



Деревья решений

Методы, основанные на деревьях решений

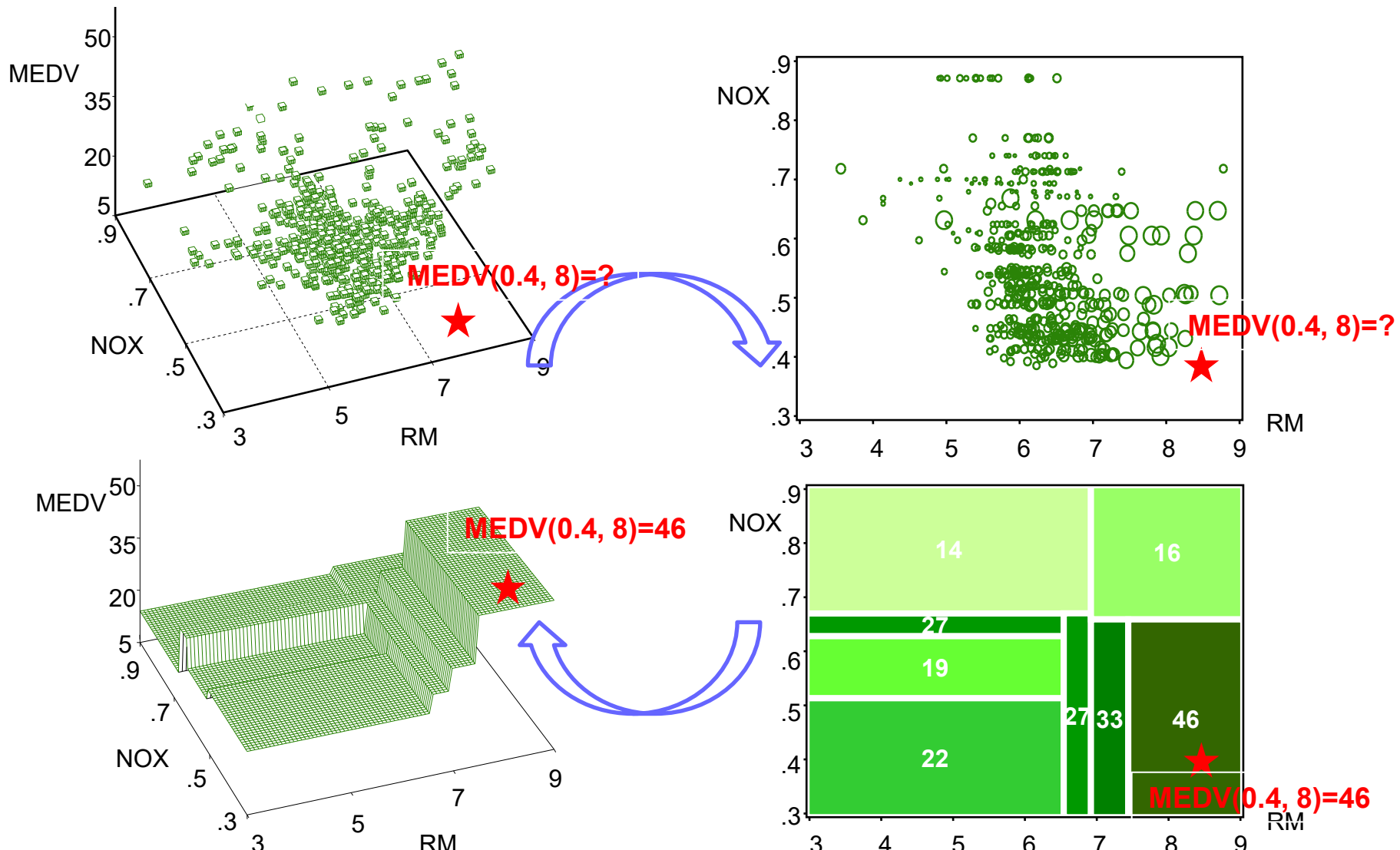
■ Ключевые особенности:

- Эти методы используют *стратификацию* или *сегментирование* пространства признаков на области.
- Для сегментации пространства признаков может использоваться *набор правил*, который можно представить в виде дерева
- Деревья решений могут применяться как к *задачам регрессии*, так и к *классификации*.
- Методы, основанные на деревьях, просты в *интерпретации*, при этом показывают достаточно хорошие результаты по точности прогнозирования.
- Нестабильные модели – это плюс для ансамблей *бэггинг*, *методы случайного леса* и *бустинг*. Эти методы строят множество деревьев, результаты прогнозирования которых потом объединяются для получения итогового прогноза.

Деревья решений в задачах классификации и регрессии

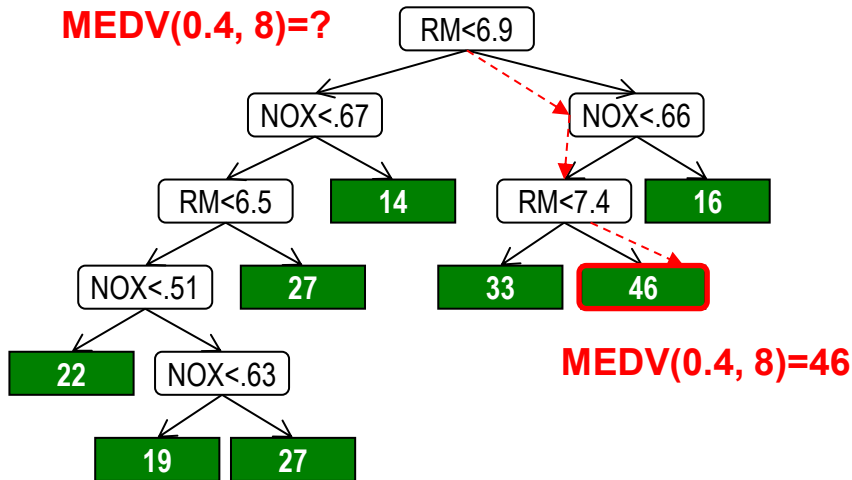
- Дерево решений - граф (древовидная структура), в котором:
 - Внутренние узлы – условия на атрибуты
 - Каждая исходящая ветка соответствует выходному значению условия, ветка целиком – альтернативное решение
 - В листьях метки классов (или распределение классов) или значения целевой переменной для регрессии
 - Каждому узлу соответствует область в пространстве признаков R
 - Области для листьев – финальные, не содержат внутри других областей
- Построение дерева обычно – 2 фазы
 - «рост» : в начале в корне все примеры, далее рекурсивное разбиение множества примеров по выбранному(ым) атрибуту(ам)
 - «отсечение» ветвей pruning - выявление и удаление ветвей (решений), приводящих к шуму или к выбросам
- Применение дерева решений для нового объекта
 - Проверка атрибутов – путь по ветви до листа. В листе отклик.

Непрерывный отклик



Непрерывный отклик

MEDV(0.4, 8)=?



If $RM \in \{values\}$ and $NOX \in \{values\}$, then $MEDV=value$.

Leaf	RM	NOX	Прогноз MEDV
1	<6.5	<.51	22
2	<6.5	[.51, .63)	19
3	<6.5	[.63, .67)	27
4	[6.5, 6.9)	<.67	27
5	<6.9	$\geq .67$	14
6	[6.9, 7.4)	<.66	33
7	≥ 7.4	<.66	46
8	≥ 6.9	$\geq .66$	16

- Модели регрессии на основе деревьев решений:

- Решающая (регрессионная) функция кусочно-постоянная:

$a(x) = \sum_{m=1}^M c_m I(x \in R_m)$, где c_m - константа, M – число регионов (листьев)

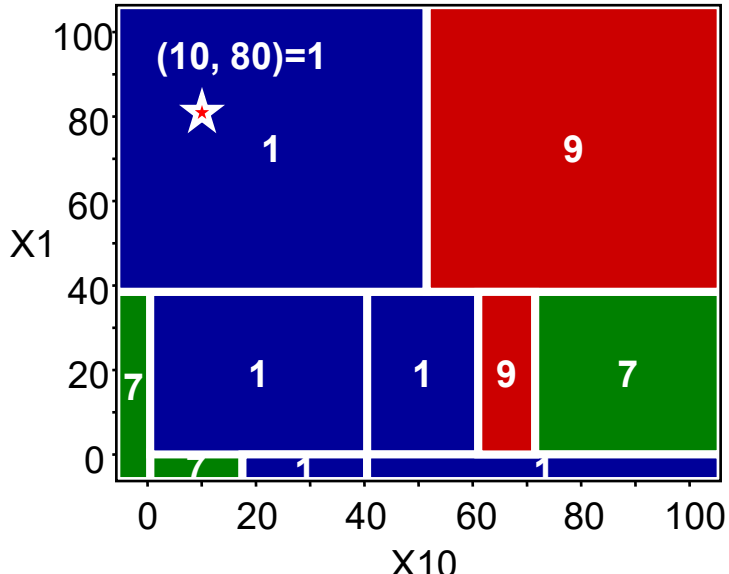
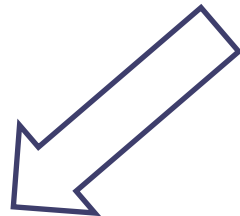
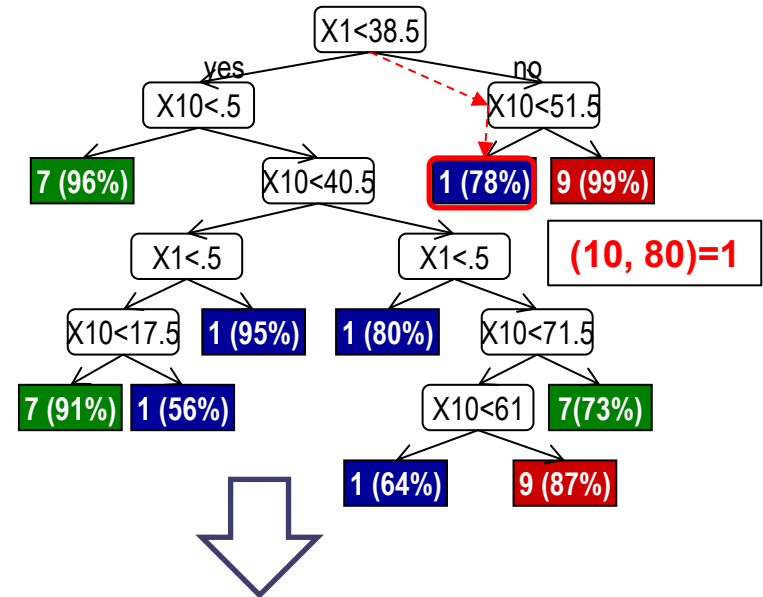
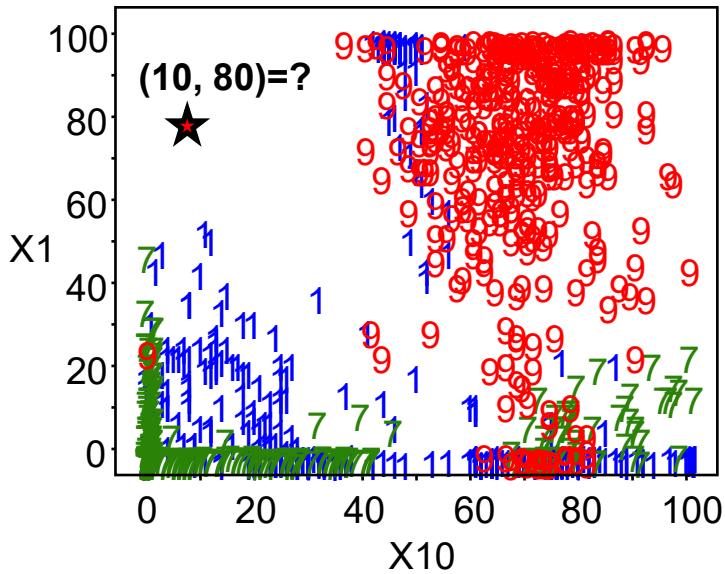
$R_m = \prod_{i=1}^d I(a_{mi} < x_i \leq b_{mi})$ или $R_m = \bigwedge_{i=1}^d [a_{mi} < x_i \leq b_{mi}]$ - «прямоугольный» регион (для числовых признаков), d – размерность X

- Эмпирический риск (однородность регионов):

- один из вариантов, без регуляризации и с кв. функцией потерь:

$$Q(a(x), \{(x_i, y_i)\}_{i=1}^l) = \sum_{i=1}^l \sum_{m=1}^M (y_i - a(x))^2 I(x_i \in R_m) \rightarrow \min_{R_m, c_m} \Rightarrow c_m = \frac{1}{|R_m|} \sum_{i: x_i \in R_m} y_i$$

Категориальный отклик



Leaf	Pr(1 x)	Pr(7 x)	Pr(9 x)	Прогноз
1	.03	.96	.01	7
2	.09	.91	.00	7
3	.56	.44	.00	1
4	.95	.05	.00	1
5	.80	.10	.10	1
6	.64	.09	.27	1
7	.00	.13	.87	9
8	.10	.73	.17	7
9	.78	.01	.21	1
10	.01	.00	.99	9

Категориальный отклик

- Модели классификации на основе деревьев решений:

- Классификатор $a(x) = \operatorname{argmax}_{k,m} [p_{mk} I(x \in R_m)]$, где

$p_{mk} = P(y = k | x \in R_m) = \frac{1}{|R_m|} \sum_{i: x_i \in R_m} (y_i = k)$ - оценка вероятности класса k в регионе m , если $m(x)$ – индекс региона, куда попало наблюдение x , то $p_{m(x)k}$ является дискриминантной функцией класса k

- Эмпирический риск (однородность регионов):

- Ошибка классификации (не гладкая):

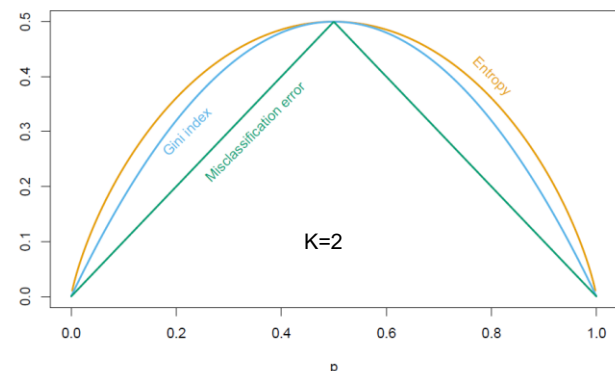
$$Q_{miss} = \sum_{m=1}^M I(x_i \in R_m) \frac{I(y_i \neq a(x_i))}{|R_m|} = (1 - p_{m(x_i) a(x_i)})$$

- Индекс Джини (гладкая, ограничивает Q_{miss} сверху):

$$Q_{Gini} = \sum_{m=1}^M \sum_{k=1}^K p_{mk} (1 - p_{mk})$$

- Энтропия (ограничивает Q_{Gini} сверху):

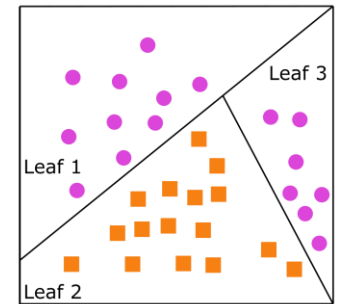
$$Q_{KL} = - \sum_{m=1}^M \sum_{k=1}^K p_{mk} \log_2(p_{mk})$$



Более сложные варианты деревьев

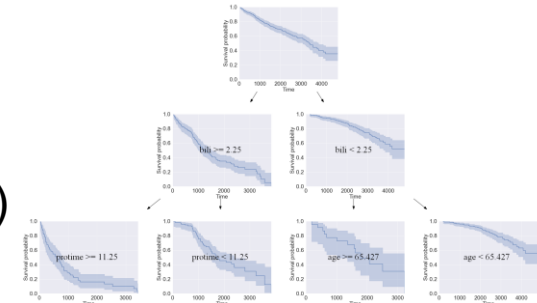
■ Типы регионов:

- Порядковые и числовые предикторы ($a_{mi} < x_i \leq b_{mi}$)
- Категориальные предикторы ($x_i \in S_{mi}$)
- «Многогранники» ($\cup \sum_i w_{mi} x_i \leq b_m$)
- «Сферы» ($\sum_i (a_{mi} - x_i)^2 \leq b_m$)



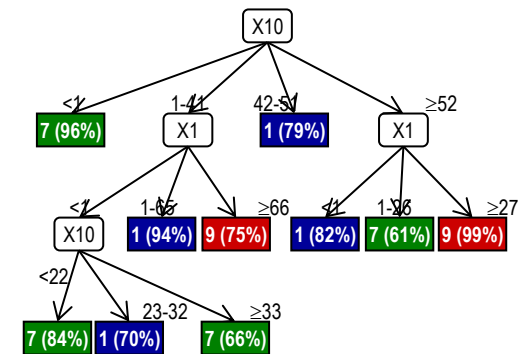
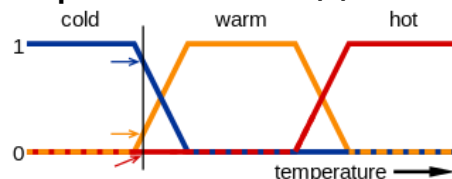
■ Стратифицированные модели :

- В регионах не константа, а функция $c_m(x)$, например, непараметрическая модель (сплайн)



■ Разбиение регионов:

- Бинарное – каждый регион делится на два
- Множественное – много ветвей в дереве
- Нечеткие правила – отдельная история



Процесс построения деревьев решений – рекурсивное разбиение

■ Цель:

- найти непересекающиеся области R_1, \dots, R_M , $\forall i \neq j: R_i \cap R_j = \emptyset$, покрывающие все пространство признаков $X = \bigcup_m R_m$ так, чтобы поведение отклика внутри каждого региона было максимально однородным, т.е. минимизировать некий целевой критерий разбиения

$$Q(R_1, \dots, R_M) \rightarrow \min$$

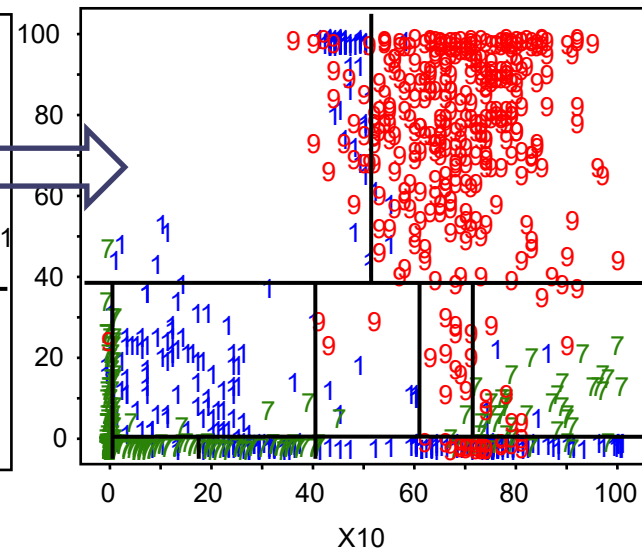
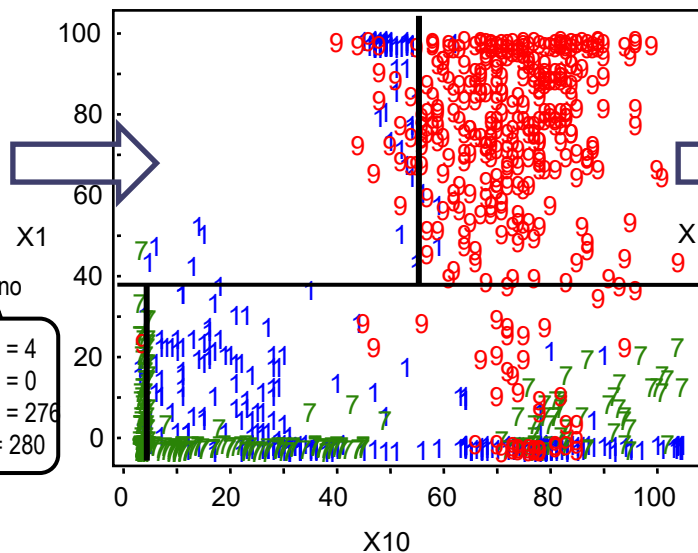
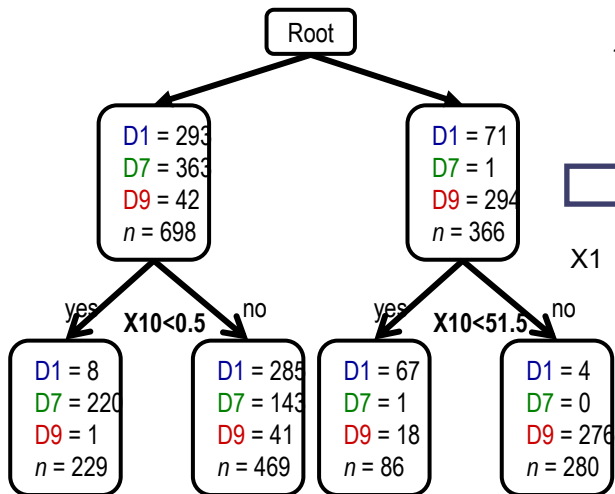
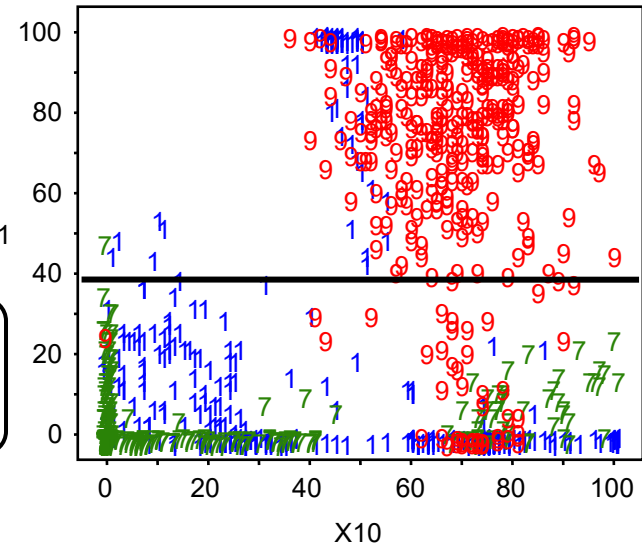
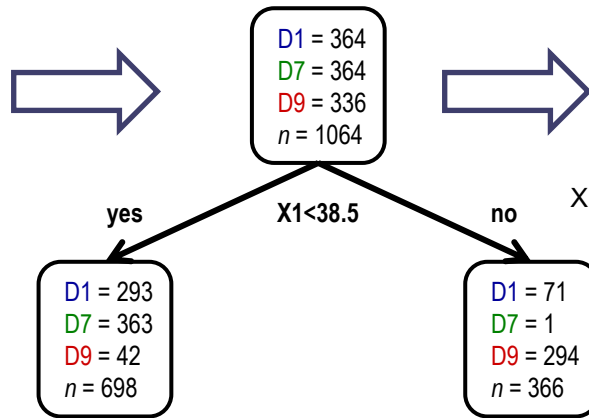
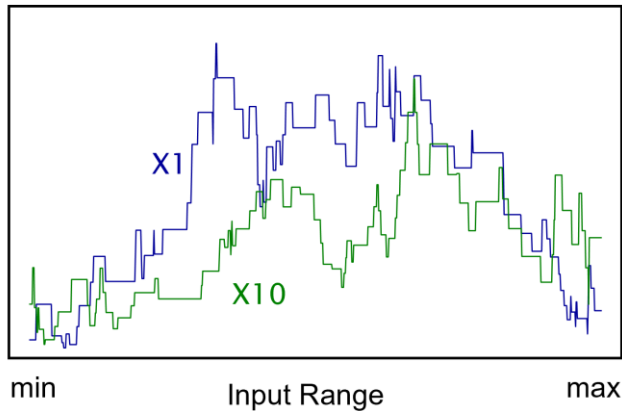
■ Подход на основе рекурсивного разбиения (*нисходящий, жадный*):

- Вычислительно нецелесообразно (**NP-полная задача**) рассматривать все возможные разбиения пространства признаков, даже в рамках фиксированной структуры правил и критерия разбиения
- **Нисходящий** - начинается в корне дерева, где один регион (все пространство признаков), затем последовательно *рекурсивно* разбиваются доступные регионы на более мелкие и каждое разбиение приводит к образованию новых ветвей, расположенных ниже по дереву.
- **Жадный** – лучшее разбиение выбирается по критерию на каждом шаге, просмотра вглубь нет (иначе тоже NP-полная задача), не приведет к глобально лучшему дереву даже по выбранному критерию

Рекурсивное разбиение

- **Алгоритм поиска разбиения для региона R**
 - начинаем с корня, первый регион разбиения $R=X$.
 - 1. Проверить *условия остановки/роста дерева* для данного региона
 - 2. Сформировать множество *гипотез* $\{f_i\}$ для разбиения, таких что $f_i: R \rightarrow B$ разбивает «родительский» регион на B «дочерних» регионов (B – число ветвей), удовлетворяющих *условиям остановки/роста*
 - 3. Рассчитать значение *критерия разбиения* $Q(f_i)$ для каждой гипотезы и выбрать лучшую по критерию
 - 4. Дорастить дерево (лист, соответствующий разбиваемому региону превращается во внутренний узел) новыми B ветвями, заменив «родительский» регион на B «дочерних»
 - 5. Для каждого полученного региона (соответствующего новым листьям) применить **Алгоритм поиска разбиения**
- Особенности (упрощения) для поиска прямоугольных регионов:
 - Гипотезы разбиения (в виде порогов для порядковых/числовых и в виде подмножеств для категориальных) строятся по каждому предиктору отдельно, выбирается лучшая по предиктору
 - Затем лучшие гипотезы сравниваются между предикторами

Рекурсивное разбиение



Гипотезы-кандидаты для поиска разбиения числового предиктора

- Рассмотрим прямоугольные регионы для числового предиктора x :
 - Разбиваем одномерный «родительский» регион ($a < x \leq b$) с N различными значениями на B ветвей
 - Надо сформировать варианты разбиения (гипотезы), каждая задается порогами $a < \theta_1 < \theta_2 < \dots < \theta_{B-2} < \theta_{B-1} < b$, ветви задаются условиями $(a < x \leq \theta_1)$, $(\theta_1 < x \leq \theta_2)$, ..., $(\theta_{B-1} < x \leq b)$

- Варианты разбиения для числового или порядкового предиктора:

- В общем случае: $C_{B-1}^{N-1} = \frac{(N-1)!}{(B-1)! (N-B)!}$, для бинарного разбиения: $N - 1$

для всех ветвей от 2 до N : $\sum_{b=2}^N C_{b-1}^{N-1} = 2^{N-1} - 1$, 1—234 $\binom{3}{1} = 3$

- Выбор вариантов – срединные точки

X	.20	1.7	3.3	3.5	14	2515
log(X)	-1.6	.53	1.2	1.3	2.6	7.8
rank(X)	1	2	3	4	5	6

Потенциальные точки разбиения

1—234	$\binom{3}{1} = 3$
12—34	
123—4	
1—2—34	$\binom{3}{2} = 3$
1—23—4	
12—3—4	
1—2—3—4	$\binom{3}{3} = 1$

Гипотезы-кандидаты для поиска разбиения категориального предиктора

- Разбиваем множество категориальных значений предиктора из региона «родительского» узла S_m :

- Ищем B ветвей: $S_m = \bigcup_{b=1}^B S_{bm} : \forall i \neq j \Rightarrow S_{im} \cap S_{jm} = \emptyset$, если $|S_m| = N$, то всего вариантов – число Стирлинга 2 порядка:

$$S(N, B) = B \cdot S(N - 1, B) + S(N - 1, B - 1)$$

- Для бинарного дерева: $2^{N-1} - 1$

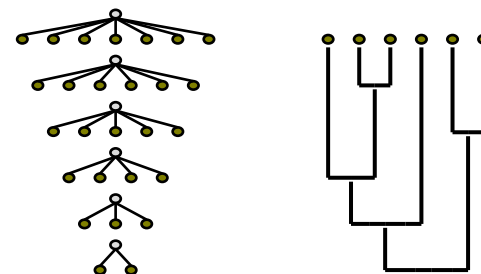
- Сокращение числа гипотез:

- Ограничение снизу на $|S_m|$ или $|S_{jm}|$
 - Эвристические, жадные алгоритмы

$B:$	2	3	4	total
2	1			1
3	3	1		4
4	7	6	1	14
N 5	15	25	10	51
6	31	90	65	202
7	63	301	350	876
8	127	966	1701	4139
9	255	3025	7770	21146

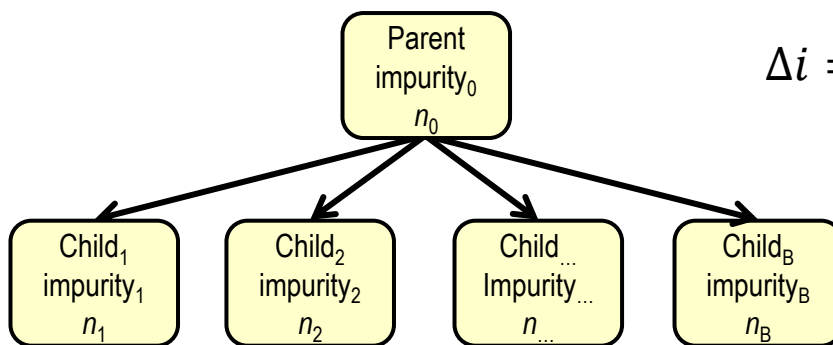
- Пример - иерархическая кластеризация гипотез (алгоритм Касса):

- Строим N ветвей (каждая ветвь – значение)
 - Рассматриваем все варианты склейки двух
 - Выбираем лучшую склейку по критерию
 - Продолжаем, пока не «склеим» все в B ветвей



Критерии разбиения на основе однородности

- Сравнить гипотезы о разбиении (внутри одного предиктора):
 - на основе прироста однородности дочерних регионов по сравнению с родительским внутри :



$$\Delta i = i_0 - \left(\frac{n_1}{n_0} i_1 + \frac{n_2}{n_0} i_2 + \dots + \frac{n_B}{n_0} i_B \right) \rightarrow \max$$

- Лучшие разбиения разных предикторов:
 - сравнивать либо по тому же критерию $\Delta i(x_k) \vee \Delta i(x_j)$, либо по нормированному $\frac{\Delta i(x_j)}{i(x_j)} \vee \frac{\Delta i(x_k)}{i(x_k)}$
- Примеры критерия однородности:
 - Вариации (числовой отклик)
 - Энтропия, Джини, ошибка классификации (категориальный отклик)

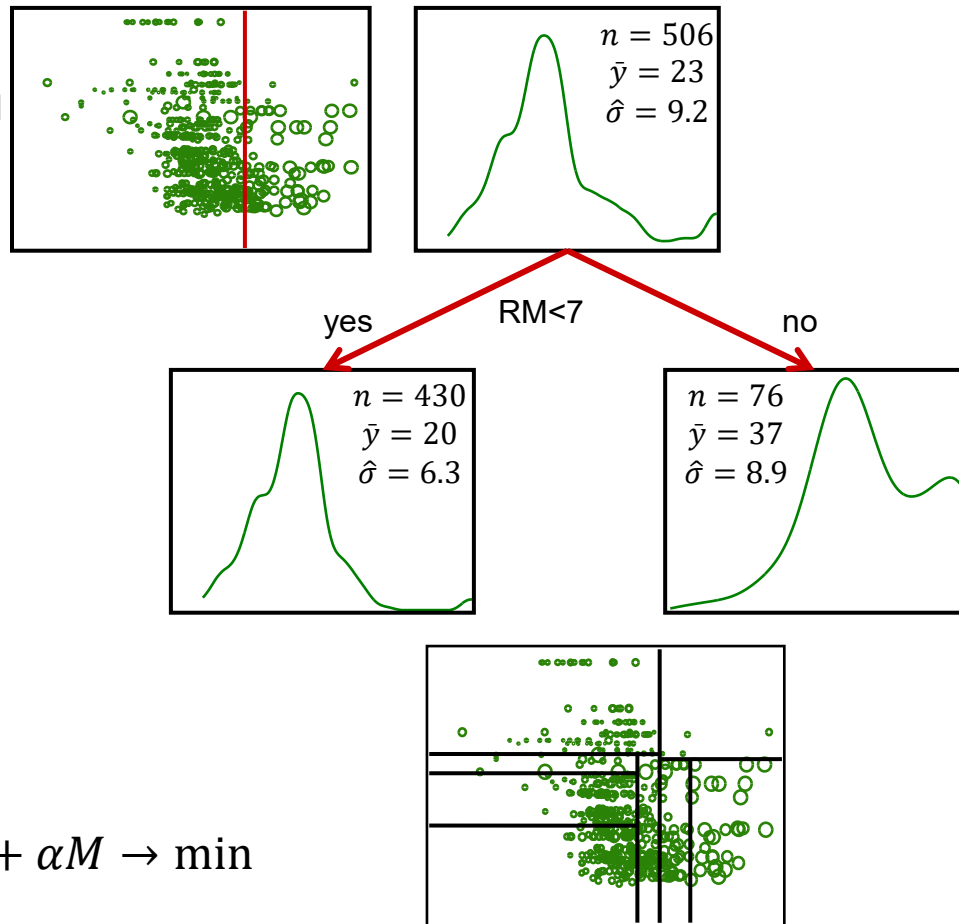
Критерии разбиения на основе уменьшения вариации

■ Для числового отклика:

- Выбираем гипотезу, для которой средняя взвешенная вариация (квадратичная ошибка) по дочерним узлам максимально уменьшается.
- В результате – «разбегаются» средние отклики по регионам и уменьшается дисперсия в них.
- Получаемый эмпирический риск квадратичной функции потерь и его можно регуляризовать (по регионам):

$$Q_{\alpha}(T) = \sum_{m=1}^M |R_m| \cdot Q_m + \alpha M \rightarrow \min$$

$$c_m = \frac{1}{|R_m|} \sum_{i: x_i \in R_m} y_i, \quad Q_m = \frac{1}{|R_m|} \sum_{i: x_i \in R_m} (y_i - c_m)^2$$



Критерии разбиения на основе уменьшения энтропии

- Мера неоднородности Q распределения классов в регионе R_m :

- $p_{mk} = P(y = k | x \in R_m) = \frac{1}{|R_m|} \sum_{i: x_i \in R_m} (y_i = k)$
- Q максимальна в чистом регионе, т.е. $\exists k': p_{mk'} = 1, \forall k \neq k': p_{mk} = 0$
- Q минимальна, если классы равновероятны, т.е. $\forall k: p_{mk} = 1/K$
- Если отклик категориальный (не порядковый), то Q не зависит от порядка классов.

- Мера неоднородности выборки в регионе R_m на основе энтропии:

$$Q_{Entropy}(R_m) = H(Y | x \in R_m) = - \sum_{k=1}^K p_{mk} \log_2(p_{mk})$$

- мера неопределенности (неоднородности) отклика Y в регионе R_m
- мат. ожидание (по классам) функции потерь: $L(p) = -\log_2(p)$
- $-\log_2(p_{mk})$ KL-дивергенция для распределения с «чистым» классом k в регионе R_m , $(0, \dots, 1_k, \dots, 0)$, насколько оно близко к p_{mk}

Information Gain (прирост информации)

- Энтропия в родительском узле - совместная:

$$H_p(y, x \in R_p) = - \sum_{k=1}^K P(Y = k, x \in R_p) \log_2 P(Y = k, x \in R_p)$$

- Энтропия в дочернем узле b – условная, неопределенность отклика, если знаем что $x \in R_b$:

$$H_b(y|x \in R_b) = - \sum_{k=1}^K P(Y = k|x \in R_b) \log_2 P(Y = k|x \in R_b)$$

- Ожидаемая условная энтропия по всем дочерним узлам $1 \leq b \leq B$, неопределенность при условии разбиения на $R_p = R_1 \cup \dots \cup R_B$:

$$H(y|R_1, \dots, R_B) = \sum_{b=1}^B P(x \in R_b) H_b(y|x \in R_b) = \sum_{b=1}^B \frac{|R_b|}{|R_p|} H_b(y|x \in R_b)$$

- Information Gain (как раз то, что мы максимизируем):

- уменьшение энтропии при заданном разбиении:

$$IG(y|R_p = R_1 \cup \dots \cup R_B) = H_p(y, x \in R_p) - H(y|R_1, \dots, R_B)$$

Критерии разбиения на основе индекса Джини

■ Интерпретации индекса Gini:

- Изначально в экономике - оценка неравенства населения по доходам
- Модельный пример – вероятность вытащить (с возвратом) из закрытой корзины с цветными шарами два шара разного цвета:

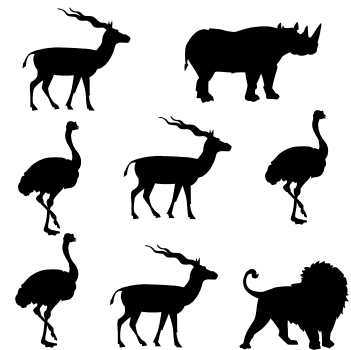
$$Gini(R_m) = 1 - \sum_{k=1}^K p_{mk}^2 = \sum_{j < k} 2p_{mk}p_{mj}$$

- Аналогично энтропии - мера неоднородности выборки в регионе и мат. ожидание (по классам) убывающей ф-ции потерь: $L(p) = (1 - p)$:

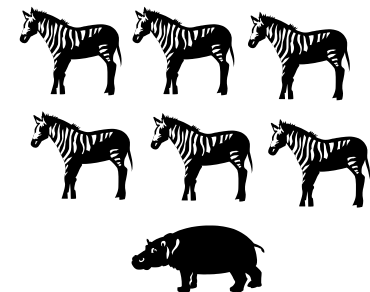
$$Q_{Gini}(R_m) = \sum_{k=1}^K p_{mk}(1 - p_{mk})$$

- Интересный факт: если мера $Y = \{0,1\}$, то индекс Джини совпадает с вариацией

$$Gini = 1 - 2\left(\frac{3}{8}\right)^2 - 2\left(\frac{1}{8}\right)^2 = 0.69$$



$$Gini = 1 - \left(\frac{6}{7}\right)^2 - \left(\frac{1}{7}\right)^2 = 0.24$$



Оценка важности переменных

- Варианты оценки важности переменных (всегда на выборке):
 - Вариант 1: по каждому предиктору x_i суммирование прироста меры однородности $Gain(x_i) = \sum_{node: x_i \in node} \Delta Q_{node}(x_i)$ (Джини или Энтропии для категориального отклика или вариации для числового) по всем вхождениям переменной в дерево, т.е. по всем внутренним узлам с условиями на переменную x_i
 - Вариант 2: считаем качество полной модели (дерева) и модели, где все $x_i = missing$, сравниваем ухудшение:

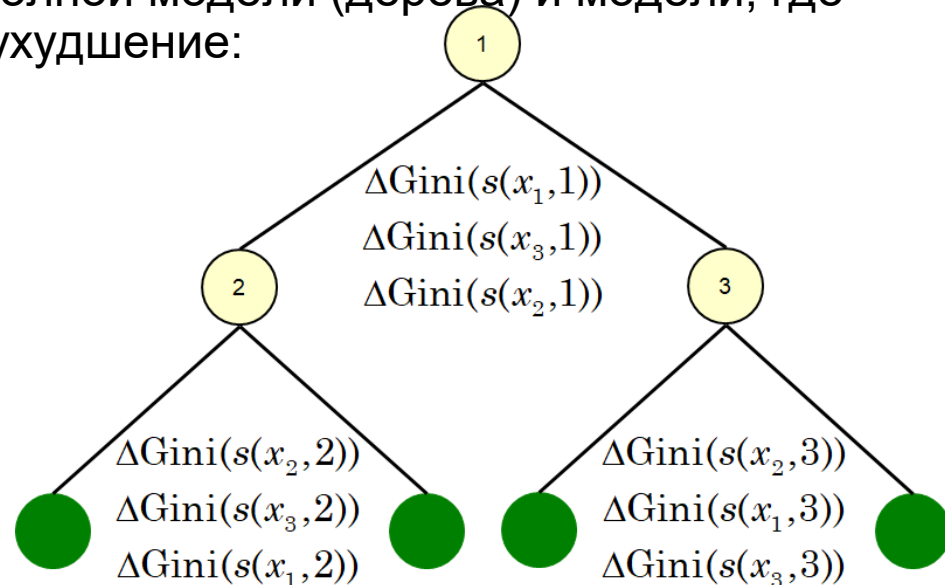
$$Gain(x_i) = \frac{Q(T) - Q(T|x_i=missing)}{Q(T)}$$

- Нормировка:

$$Importance(x_i) = \frac{Gain(x_i)}{\max_j [Gain(x_j)]}$$

или

$$Importance(x_i) = \frac{Gain(x_i)}{\sum_j Gain(x_j)}$$



Пример дерева

```
from sklearn.tree import DecisionTreeClassifier, DecisionTreeRegressor, plot_tree
from sklearn.datasets import load_iris
from sklearn.inspection import DecisionBoundaryDisplay
```

```
iris = load_iris()
X, y = iris.data, iris.target
X = X[:, :2]
X.shape, y.shape, iris.target_names
```

```
((150, 2), (150,), array(['setosa', 'versicolor', 'virginica'], dtype='<U10'))
```

```
tree = DecisionTreeClassifier(criterion="gini", max_depth=5, min_samples_split=5, min_samples_leaf=3,
                             ccp_alpha=0.0) # pruning parameter
```

```
tree.fit(X, y)
```



DecisionTreeClassifier

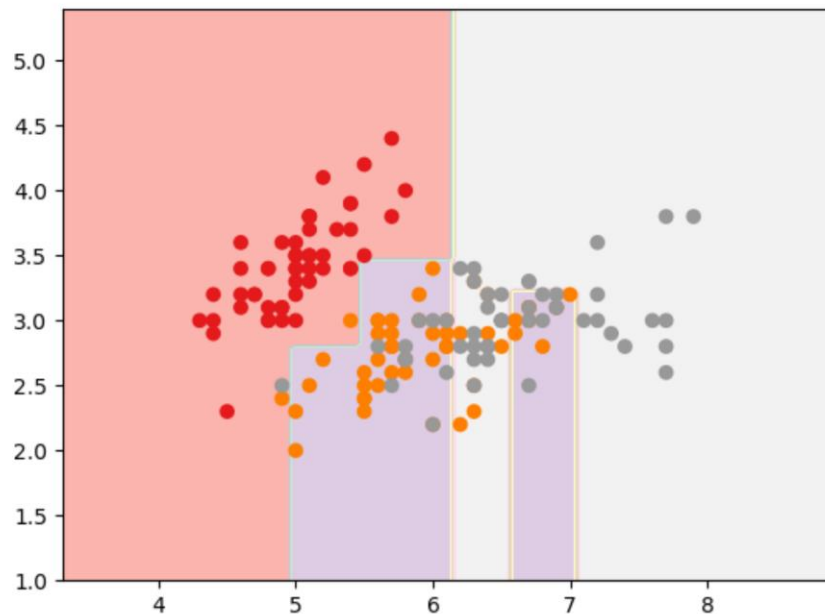
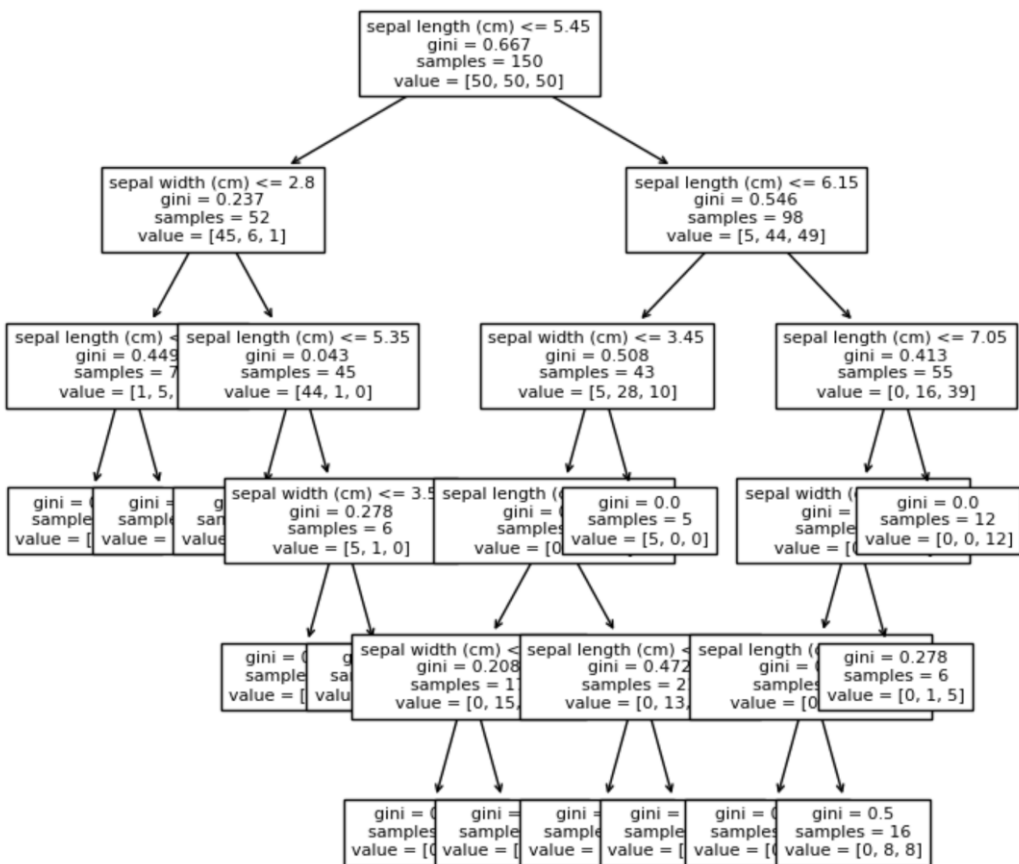
```
DecisionTreeClassifier(max_depth=5, min_samples_leaf=3, min_samples_split=5)
```

Пример дерева

```
plot_tree(tree, fontsize=8, feature_names=iris.feature_names)  
plt.gcf().set_size_inches(8, 8)
```

```
DecisionBoundaryDisplay.from_estimator(tree, X, cmap="Pastel1")  
plt.scatter(*X.T, c=y, cmap="Set1")
```

```
<matplotlib.collections.PathCollection at 0x7fa63f56b1c0>
```



```
tree.feature_importances_  
array([0.76047482, 0.23952518])
```

Статистические критерии разбиения

- Недостатки критериев на основе оценки однородности выборки:
 - При сравнении предикторов с разной мощностью (число различных значений) тяготеют к выбору более мощного варианта
 - При сравнении вариантов разбиения с разным числом ветвей (больше 2) тяготеют к выбору большего числа ветвей
 - В общем случае не позволяют разумно задать порог на остановку роста (например, на минимально допустимое улучшение)
- Идея статистических критериев:
 - Оценивать как меняются распределения отклика в дочерних узлах по сравнению с родительским, чем больше меняются, тем лучше
 - Оценивать по p-value базовую гипотезу H_0 о том, что распределение не изменилось, чем меньше p-value, тем более мы уверены, что разбиение полезно
 - Сравнить гипотезы о разбиении по $\text{logworth} = -\log_{10}(p_\alpha)$
 - Использовать порог для p-value для отбора гипотез и остановки роста
 - Использовать коррекцию Бонферрони для множественного сравнения гипотез

Критерий Фишера для числового отклика

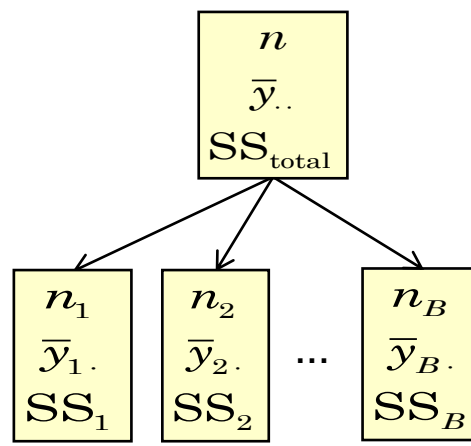
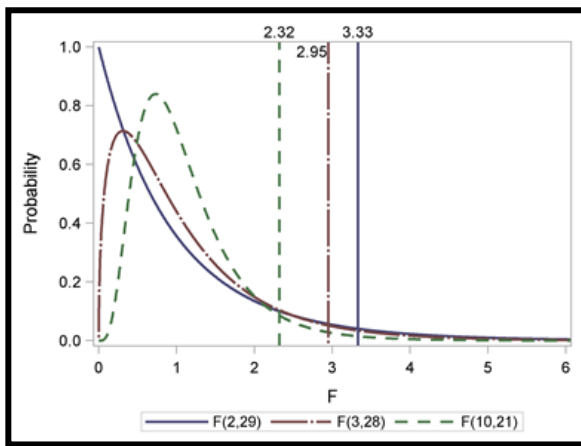
- Идея из дисперсионного анализа:

- Гипотеза H_0 - все групповые средние в B ветвях совпадают
- Считается статистика Фишера:

$$F = \left(\frac{SS_{model}}{SS_{error}} \right) \left(\frac{N-B}{B-1} \right) \sim F_{B-1, N-B}, \text{ где } SS_{total} = \sum_{i=1}^N (y_i - \bar{y})^2,$$

$$SS_{error} = \sum_{b=1}^B \sum_{i: x_i \in R_b} (y_i - \bar{y}_b)^2, SS_{model} = SS_{total} - SS_{error}$$

- По распределению Фишера со степенями свободы $B - 1$ и $N - B$ находится p-value (уровень значимости) гипотезы H_0 , чем он меньше, тем увереннее мы отклоняем H_0



Критерий χ^2 для категориального отклика

- Идея из анализа таблиц частот:

- Строим матрицу сопряженности для заданного разбиения (строки – ветви, столбцы – классы, ячейки – сколько наблюдений класса попало в соответствующую ветвь)
- Гипотеза H_0 - распределение классов в B ветвях одинаковое и совпадает с родительским, считается статистика:

$$\chi^2 = \sum_{k=1}^K \sum_{b=1}^B \frac{(O_{bk} - E_{bk})^2}{E_{bk}} \sim \chi_{(B-1)(K-1)}^2, \text{ где}$$

O_{bk} - сколько наблюдений из класса k попало в ветвь b

$E_{bk} = P_k |R_b|$ - сколько бы попало, если H_0 верна

- По распределению χ_v^2 со степенями свободы $v = (B - 1)(K - 1)$ находится p-value (уровень значимости) гипотезы H_0 , чем меньше тем лучше

Матрица O

	<38.5	≥38.5	
1	293	71	.342
7	363	1	.342
9	42	294	.316
	.656	.344	$n=1064$

Матрица E

239	125
239	125
225	116

Матрица χ^2

12	23
64	123
149	273

Корректировка Бонферрони

- Корректируется p-value с учетом множественного сравнения гипотез:
 - Для серии m сравнений нескольких гипотез, каждая с уровнем значимости α , уровень значимости всей серии $\alpha_m \leq 1 - (1 - \alpha)^m$
 - Корректировка Бонферрони – домножаем уровень значимости α на число сравнений m , что тоже самое, домножаем p-value на m
 - Скорректированный на m сравнений критерий разбиения logworth: $\logworth_m(p_\alpha) = -\log(mp_\alpha) = -\log(p_\alpha) - \log(m) = \logworth(p_\alpha) - \log(m)$
 - $\log(m)$ - штраф за мощность предиктора и/или число ветвей

X: 38.5

1	293	71
7	363	1
9	42	294


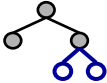
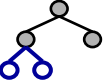
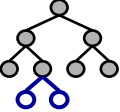
X: 17.5 36.5

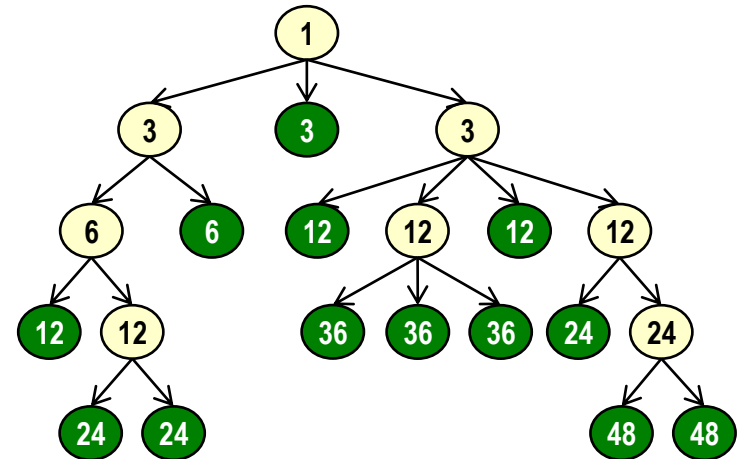
1	249	42	73
7	338	25	1
9	26	16	294

χ^2_ν	ν	$-\log_{10}(P)$	m	$-\log_{10}(mP)$
644	2	140	96	138
			?	
660	4	141	4560	137

Множитель глубины

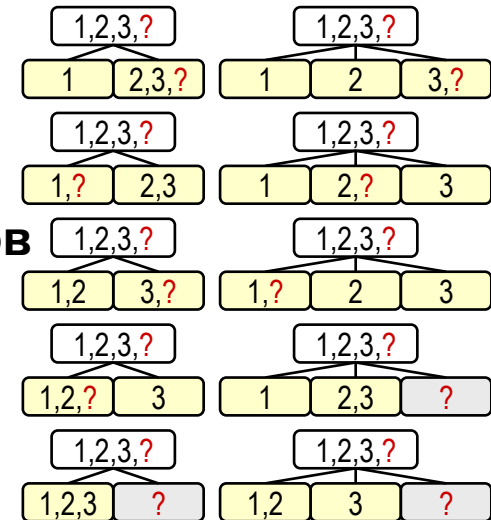
- В теории разбиение на глубине d также зависит от предыдущих разбиений, поэтому p -value можно корректировать по Бонферрони с учетом глубины и числа ветвей на уровнях выше

	$-\log_{10}(P)$	m	$-\log_{10}(mP)$	d	$-\log_{10}(2^d mP)$
	26.7	53	24.9	0	24.9
	3.12	14	1.97	1	1.67
	1.63	39	.039	1	-.26
	2.40	11	1.36	2	.76

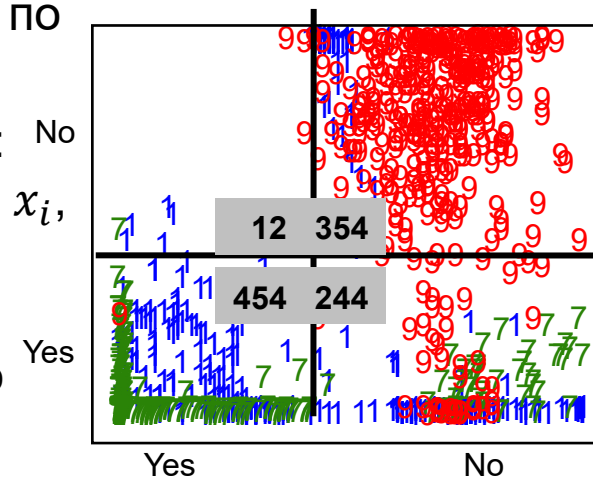


Пропущенные значения

- Важное преимущество деревьев решений:
 - Могут работать с пропусками без подстановки
- Основные подходы:
 - Строим гипотезы о разбиении **без учета пропусков**
 - **Направляем пропуски** по *отдельной* ветке (если дерево не бинарное), по *самой большой* ветке, по *самой точной* ветке, по *всем веткам* одновременно пропорционально их размеру
 - **Расширяем множество гипотез** разбиения проверкой: что будет, если запустить пропуски по каждой ветке b (пример справа вверху)
 - **Суррогатные правила** (пример справа внизу): No для каждого лучшего разбиения по предиктору x_i , находим разбиение по $x_{j \neq i}$, максимально согласованное (максимальное пересечения регионов дочерних узлов) с исходным. Обычно строят несколько дублирующих правил

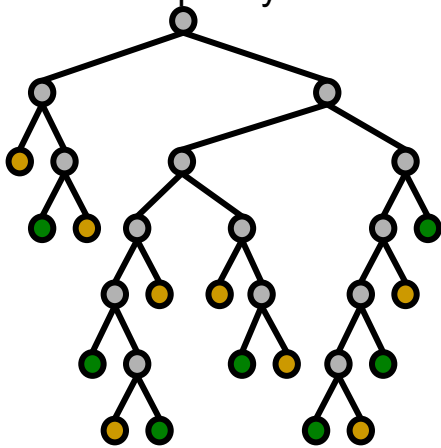


Уровень согласия=76%

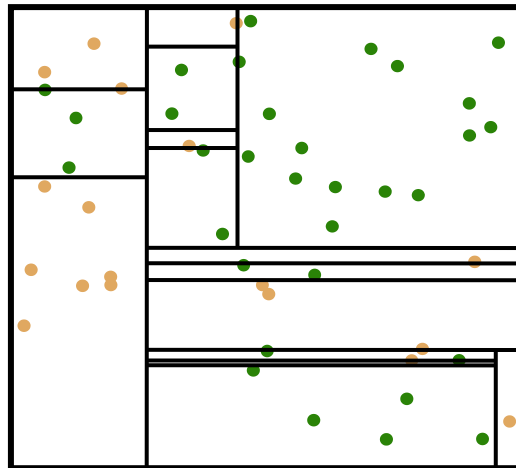


Переобучение и сложность деревьев решений

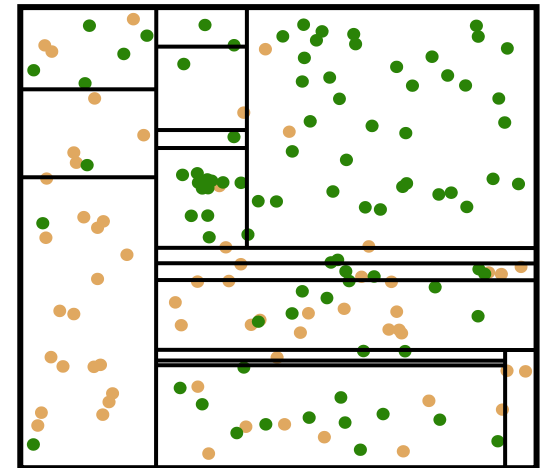
Максимальное дерево
часто переобучено



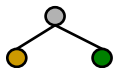
Тренировочный набор



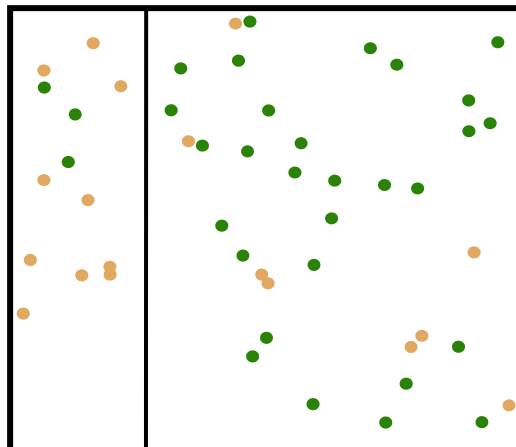
Новые данные



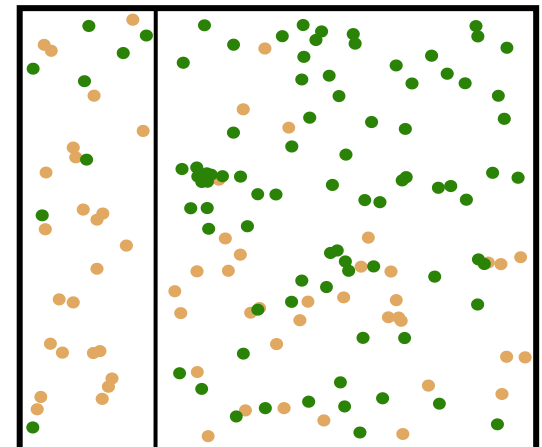
Небольшое дерево
часто недообучено



Тренировочный набор



Новые данные

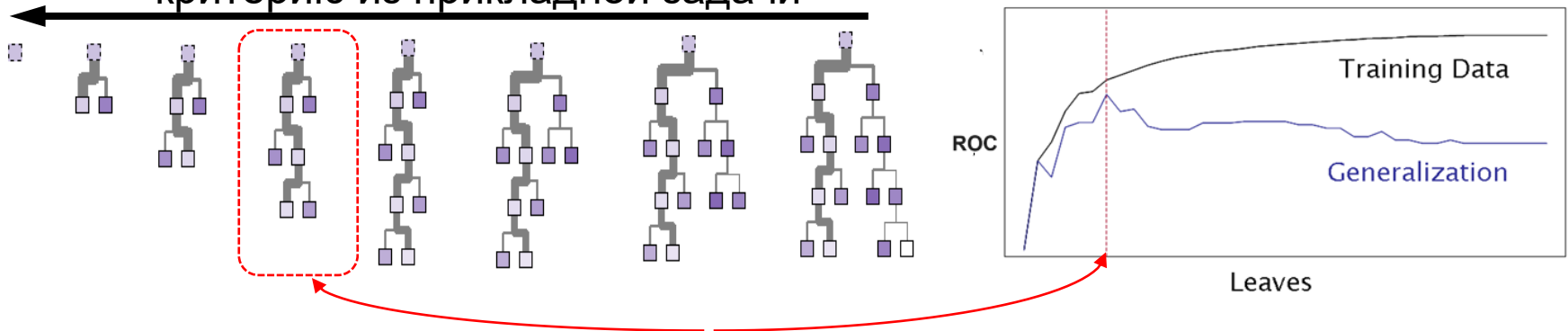


Контроль сложности деревьев решений

- Сложность дерева:
 - Обычно оценивают по числу листьев
 - Как и у других моделей – рост сложности влечет рост дисперсии и уменьшение смещения, и наоборот.
 - Сложность можно контролировать: ограничением роста (pre-pruning) или упрощением максимального дерева – обрубанием ветвей (pruning)
- Параметры ограничение роста:
 - Максимально допустимая глубина дерева
 - Минимально допустимое число наблюдений в листе
 - Максимально допустимое число ветвей
 - Минимально допустимое число различных значений в предикторе для формирования по нему гипотез о разбиении
 - Порог останова на p-value или другой нормированный критерий
 - Корректировка порогов отсечения с учетом глубины или числа ветвей
- Обрубание ветвей - дальше

Обрубание дерева

- Процедура обрубания ветвей (или удаление слабых связей):
 - построение большого дерева T_0 , а затем выполнение *отсечения* для получения *поддерева* для *сокращения сложности*
- Простой подход – с использованием валидационного набора
 - Строим максимальное дерево и последовательно проверяем варианты обрубания листьев (из одного общего родителя) с оценкой качества поддерева на валидационной выборке
 - Получаем семейство поддеревьев, выбираем лучшее
 - Важно: **критерий обрубания может не совпадать с критерием роста**, например, строим дерево по IG, а упрощаем по ROC или критерию из прикладной задачи



Сложность дерева - пример

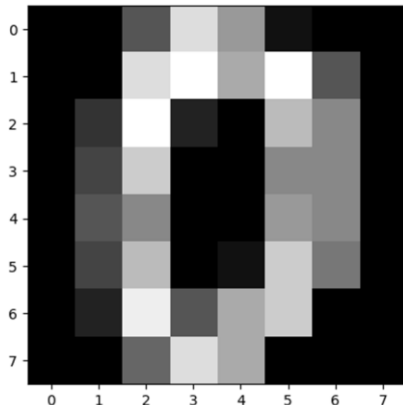
```
N = 1000 # Labels are scattered evenly enough
train_X, train_y = X[:N], y[:N]
test_X, test_y = X[N:], y[N:]
```

```
from sklearn.metrics import accuracy_score
from sklearn.datasets import load_digits
```

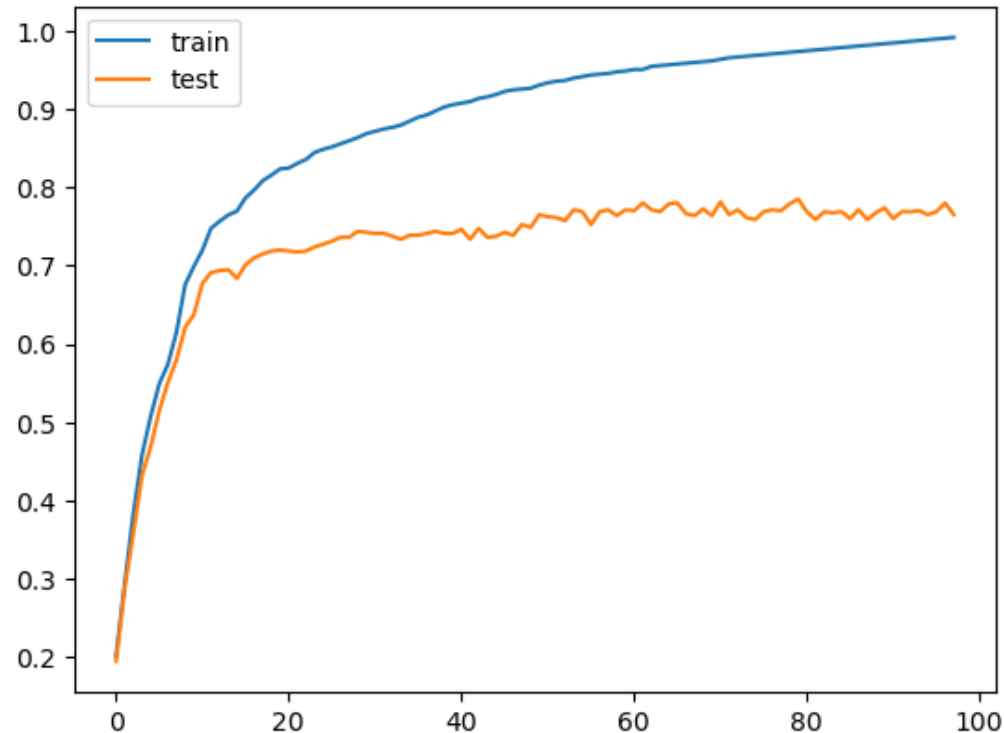
```
digits = load_digits()
X, y = digits.data, digits.target
X.shape, np.unique(y)
```

```
((1797, 64), array([0, 1, 2, 3, 4, 5, 6, 7, 8, 9]))
```

```
plt.imshow(X[0].reshape(8, 8), cmap="gray");
```



```
result = []
for max_leaf_nodes in range(2, 100):
    tree = DecisionTreeClassifier(max_leaf_nodes=max_leaf_nodes)
    tree.fit(train_X, train_y)
    score = {"train":accuracy_score(train_y, tree.predict(train_X)),
            "test":accuracy_score(test_y, tree.predict(test_X))}
    result.append(score)
pd.DataFrame(data=result).plot();
```



Обрубание дерева с регуляризацией (cost-complexity/MDL)

- Регуляризованный эмпирический риск:

$$Q_\alpha(T) = \sum_{m \in T} |T_m| \cdot Q_m(T) + \alpha |T|,$$

Q_m - оценка неоднородности в листе m , $|T|$ - сложность дерева T (обычно, число листьев), мощность листа $|T_m|$ - число наблюдений

- Что обрубить? Если $Q_\alpha(t) - Q_\alpha(T_t) \rightarrow 0$, то $\alpha_{eff}(t) = \frac{Q(t) - Q(T_t)}{|T_t| - 1}$, t - узел, T_t - его поддереву, $\alpha_{eff}(t)$ - его параметр регуляризации

- Процедура обрубания

- Инициализация $T^{(1)} = T, \alpha_1 = 0, i = 1$

- Повторять: выбрать $\min_{t \in T^{(i)}} \alpha_{eff}(t)$

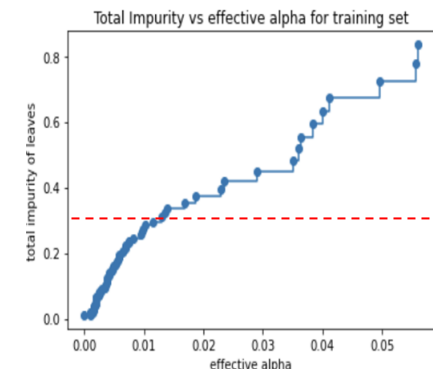
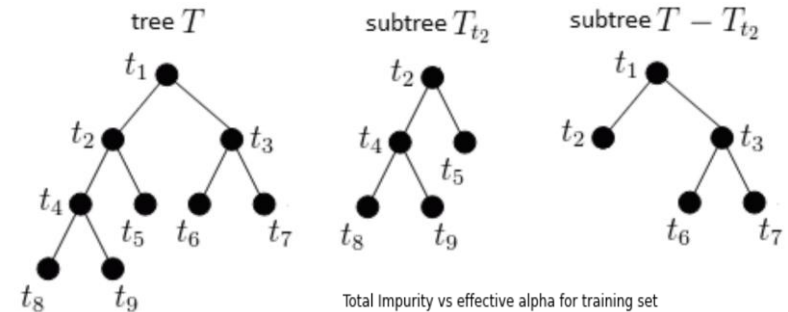
$$\alpha_{i+1} = \alpha_{eff}(t), T^{(i+1)} = T^{(i)} - T_t^{(i)}$$

- Результат:

- $0 = \alpha_1 \leq \alpha_2 \leq \dots \leq \alpha_k \Leftrightarrow$

$$T = T^{(1)} \subset T^{(2)} \subset \dots \subset T^{(k)} = \{root\}$$

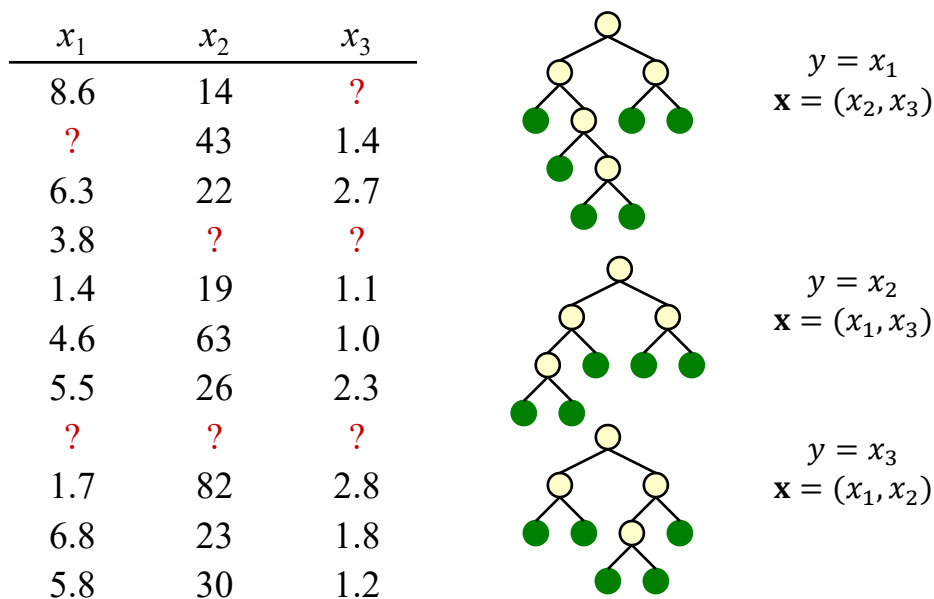
- Можно построить «трассу» зависимости однородности Q_α от α_{eff} и подобрать порог кросс-валидацией или на тестовой выборке



Деревья решений как инструмент предобработки данных

■ Подстановка пропусков

- на основе оценок $x_i = F_{tree}(x_1, \dots, x_{i-1}, x_{i+1}, \dots)$
- много достоинств: любой отклик, работа с числовыми, категориальными и пропущенными значениями других признаков, произвольные зависимости, сохранение распределений
- недостатки: нестабильность и невысокая точность (но они тут не важны)



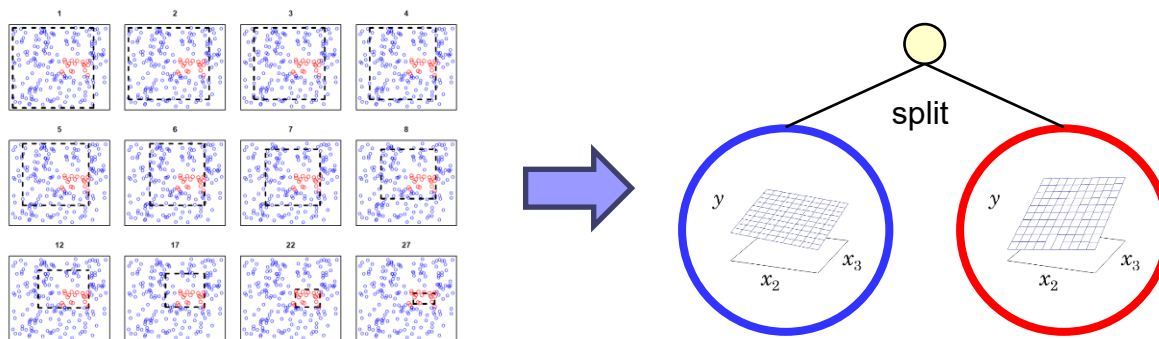
Деревья решений как инструмент предобработки данных

■ Выделение «чистых» регионов:

□ для задач классификации с большим дисбалансом классов (PNrule), пример алгоритма:

1. P-фаза: строим дерево решений, находим самый большой и «чистый» лист (пропорция целевого класса и размер выше заданных порогов), удаляем наблюдения найденного листа из выборки, повторяем P-фазу
2. N-фаза: «очищенный» набор не такой дисбалансный, имеет смешанные области со сложными границами, в них строим гибкие точные модели (например, ансамбли или нейросети)

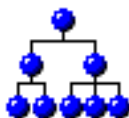
□ для «негладких» регрессий (PRIM, bump hunting)



Деревья решений как инструмент предобработки данных

- Отбор значимых признаков:
 - Не нужно дополнительно предобрабатывать – деревья работают с пропусками, числовыми и категориальными признаками
 - Не важно насколько сложная нелинейная зависимость

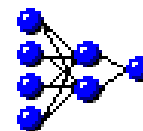
Дерево решений



предикторы

Variable	Nodes	Training	Validation	Importance
Saving Balance	2	1.000	1.000	
Money Market	1	0.654	0.621	
Checking Balance	2	0.506	0.505	
Checking Account	1	0.498	0.442	
CD Balance	1	0.223	0.218	
Age of Oldest Account	1	0.205	0.098	
Number of Checks	1	0.133	0.127	
Credit Card Balance	1	0.114	0.082	
Credit Card	1	0.109	0.000	
Mortgage Balance	1	0.095	0.000	
Number Telephone Banking	0	0.000	0.000	
Age	0	0.000	0.000	
Credit Card Purchases	0	0.000	0.000	
Amount NSF	0	0.000	0.000	
Amount Deposited	0	0.000	0.000	
Loan Balance	0	0.000	0.000	
Income	0	0.000	0.000	
Number Cash Back	0	0.000	0.000	
Checking Deposits	0	0.000	0.000	
Line of Credit Balance	0	0.000	0.000	
Home Value	0	0.000	0.000	
Money Market Balance	0	0.000	0.000	
Money Market Credits	0	0.000	0.000	
Investment Balance	0	0.000	0.000	

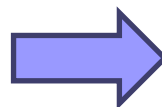
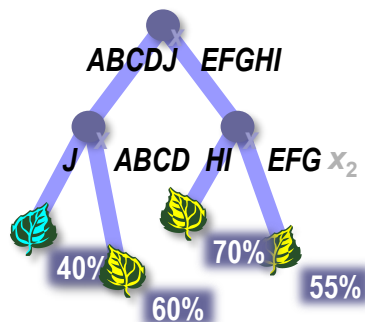
Значимые предикторы



Нейросеть

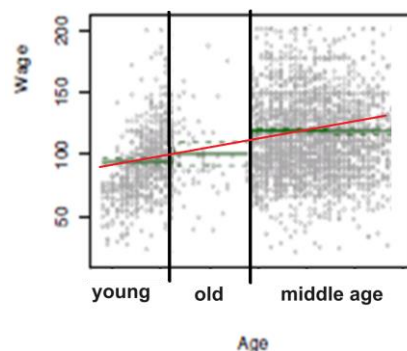
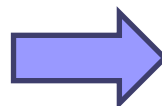
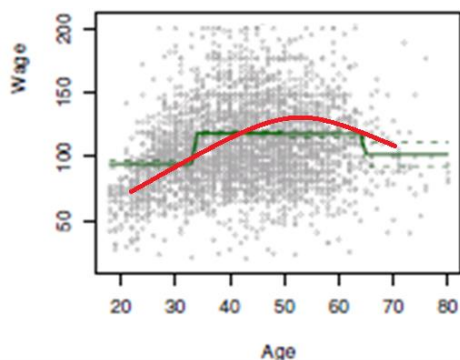
Деревья решений как инструмент предобработки данных

- Преобразование предикторов с учетом отклика:
 - строится одномерное дерево (с одним входом)
 - значения, попавшие в листья формируют подмножества группировки (для категориальных)



$\{A, B, C, D, E, F, G, H, I, J\} \Rightarrow$
 $\Rightarrow \{\{J\}, \{ABCD\}, \{HI\}, \{EFG\}\}$

- отрезки дискретизации (для числовых предикторов)



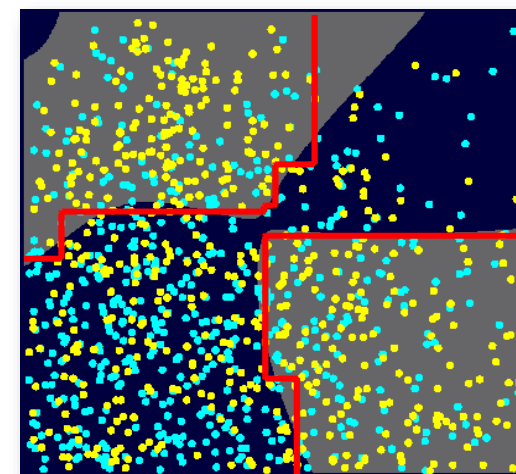
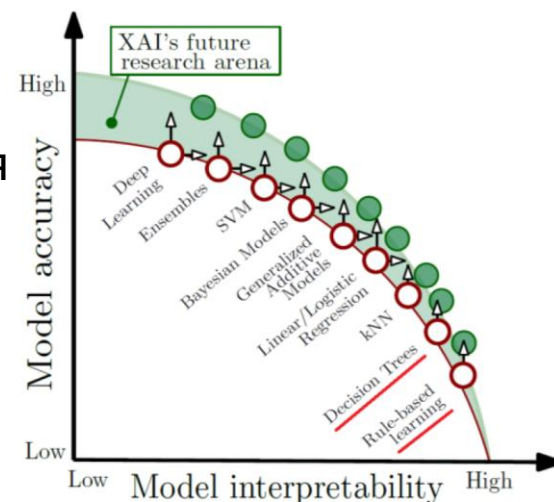
Деревья решений как инструмент интерпретации сложных моделей

■ Explainable AI:

- Чем модель более сложная, тем более точная и менее понятная человеку (менее интерпретируемая)
- Как получить описание не интерпретируемой модели?

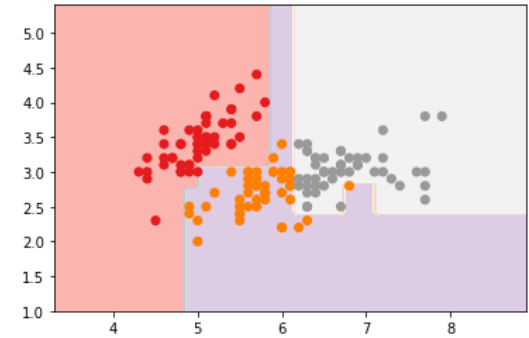
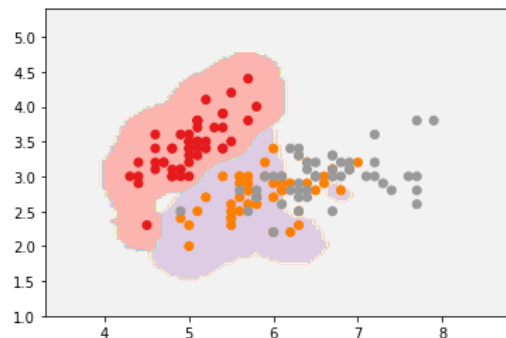
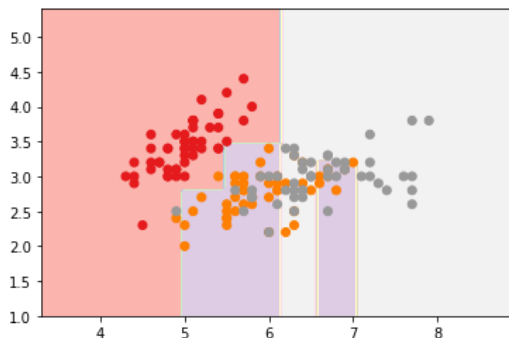
■ Суррогатные модели:

- Строится сложная не интерпретируемая модель (например, нейросеть, сплайны или ансамбль)
- **На ее прогнозах** (а не на реальных откликах) строится суррогатное «объясняющее» дерево (можно оценить уровень его согласованности или аппроксимации исходной модели)
- На реальных откликах такое дерево не построить

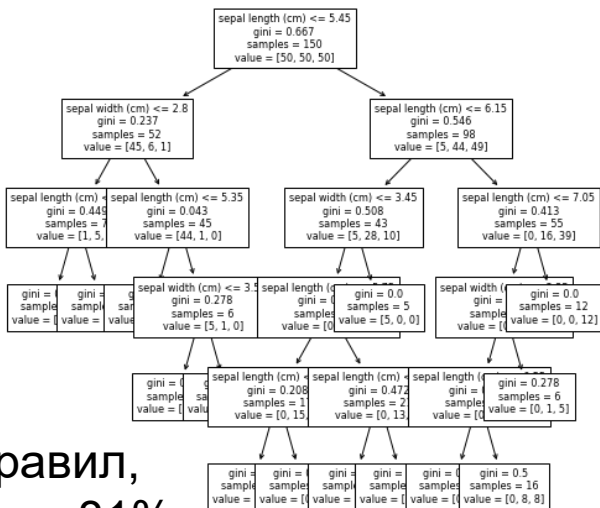


Пример суррогатной модели

- Дерево на исходных данных, SVM с RBF, Суррогатное дерево



ТОЧНОСТЬ 84%



13 правил,
точность 81%

8 правил,
точность 84%

Особенности классических алгоритмов построения деревьев решений

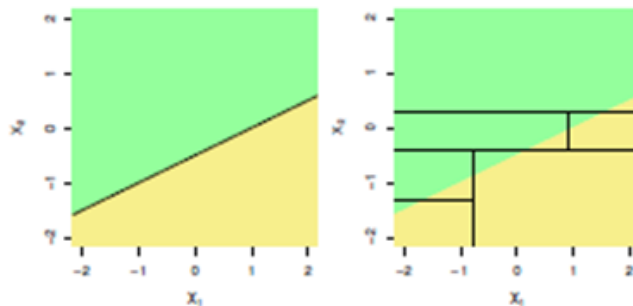
Свойства	CHAID (Kass)	CART (Breiman)	C4.5 (Quinlan)
Критерий для числ. отклика	Фишер	Вариация	нет
Критерий для кат. отклика	Хи-квадрат	Джини	Энтропия
Число ветвей	Больше или равно двум	Всегда две	Больше или равно двум
Работа с пропусками	Отдельная ветвь или перебор гипотез	Подстановка или суррогатные правила	Пропорция по веткам или подстановка
Особенности	Корректировка Бонферрони и глубина	Линейные комбинации при разбиении	Алгоритм логического «сокращения»
Обрубание вервей	Нет или по валидации	Cost-complexity	На основе ошибок

Преимущества деревьев решений

- Деревья решений имеют самую высокую интерпретируемость, считается, что они отражают процесс принятия решений людьми
- Деревья могут обрабатывать разные типы входных переменных и откликов, пропуски, относительно не чувствительны к выбросам в признаках (но чувствительны в отклике)
- Деревья не делают предположений о виде и сложности зависимости
- Есть эффективные инструменты борьбы с переобучением
- Легко адаптируются к разным задачам машинного обучения
- Быстро обучаются и применяются
- Инструмент подготовки данных

Недостатки деревьев решений

- Невысокое качество модели (особенно на гладких зависимостях, где растет сложность):



- Нестабильность модели (жадный алгоритм):

