

# Költségfüggvény

Kormányos Andor

Komplex Rendszerek Fizikája Tanszék

2020. október 19.

## Kérdés:

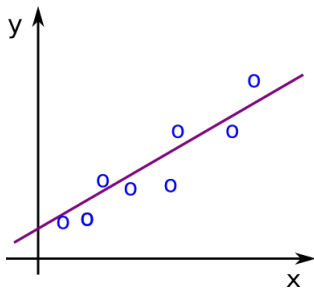
- adott egy  $\{(\mathbf{x}^{(i)}, y^{(i)})\}$  adathalmaz
- erre szeretnék illeszteni egy  $h(\mathbf{x}; \mathbf{a})$  függényt
- hogyan határozhatjuk meg a  $\mathbf{a} = (a_0, a_1 \dots a_k)$  paramétervektort?

**Példa:** egyenesillesztés  $\Rightarrow h(x; \mathbf{a}) = a_0 + a_1x$

# Költségfüggvény

Intuíció:

- az a  $h(x; \mathbf{a})$  írja le legjobban az adatokat, amelyekre a mért  $y^{(i)}$  adat és a hipotézis  $h(x^{(i)}; \mathbf{a})$  értéke **átlagosan** a legkevésbe tér el
- $h(x; \mathbf{a})$  nem kell, hogy minden  $y^{(i)}$  ponton átmenjen, csak az, hogy átlagosan kicsi legyen a különbség



## Stratégia:

- definiálunk egy  $\text{cost}(y^{(i)}, h(\mathbf{x}^{(i)}; \mathbf{a}))$  függvényt
- ez adja meg, hogy mennyire tér el az  $y^{(i)}$  adattól a  $h(\mathbf{x}^{(i)}; \mathbf{a})$  hipotézis
- definiáljuk a  $J(\mathbf{a}; \mathbf{x}^{(i)}, y^{(i)})$  költségfüggvényt:

$$J(\mathbf{a}; \mathbf{x}^{(i)}, y^{(i)}) = \frac{1}{N} \sum_{i=1}^N \text{cost}(y^{(i)}, h(\mathbf{x}^{(i)}; \mathbf{a}))$$

- adott  $h(\mathbf{x}; \mathbf{a})$  hipotézis (függvényalak) mellett az eltérés átlagosan akkor lesz a legkisebb, ha megkeressük a  $J(\mathbf{a}; \mathbf{x}^{(i)}, y^{(i)})$  minimumát a  $a_0, a_1 \dots a_k$  függvényében

$$\min_{\mathbf{a}} [J(\mathbf{a}; \mathbf{x}^{(i)}, y^{(i)})] = ?$$

- $\Rightarrow$  függvény minimalizációs probléma

# Legkisebb négyzetek módszer

**Példa:** egyenesillesztés legkisebb négyzetek módszerrel

- $h(x; \mathbf{a}) = a_0 + a_1x$
- költségfüggvény

$$J(a_0, a_1; x^{(i)}, y^{(i)}) = \frac{1}{2N} \sum_i^N \left( y^{(i)} - a_0 - a_1x^{(i)} \right)^2$$

- $\mathbf{a}$  paramétervektor meghatározása:

$$\min_{a_0, a_1} [J(a_0, a_1; x^{(i)}, y^{(i)})]$$

- milyen  $\text{cost}(y^{(i)}, h(\mathbf{x}^{(i)}; \mathbf{a}))$ -t használjunk?

- milyen  $\text{cost}(y^{(i)}, h(\mathbf{x}^{(i)}; \mathbf{a}))$ -t használjunk?
  - a legkisebb négyzetek módszer gyakran alkalmazott
  - egyenesillesztés esetén, az adatokra tett bizonyos feltételezések mellett, a legkisebb négyzetek módszernek adható egy valószínűségelméleti megalapozás (maximum likelihood becslés)
  - később még látunk példát másfajta költségfüggvényre is

- milyen  $\text{cost}(y^{(i)}, h(\mathbf{x}^{(i)}; \mathbf{a}))$ -t használjunk?
  - a legkisebb négyzetek módszer gyakran alkalmazott
  - egyenesillesztés esetén, az adatokra tett bizonyos feltételezések mellett, a legkisebb négyzetek módszernek adható egy valószínűségelméleti megalapozás (maximum likelihood becslés)
  - később még látunk példát másfajta költségfüggvényre is
- milyen algoritmussal tudjuk megtalálni egy függvény minimumát vagy maximumát?