

# 法律声明

□ 本课件包括演示文稿、示例、代码、题库、视频和声音等内容，小象学院和主讲老师拥有完全知识产权的权利；只限于善意学习者在本课程使用，不得在课程范围外向任何第三方散播。任何其他人或机构不得盗版、复制、仿造其中的创意及内容，我们保留一切通过法律手段追究违反者的权利。

□ 课程详情请咨询

■ 微信公众号：小象

■ 新浪微博：ChinaHadoop



# 贝叶斯网络

---



小象学院  
ChinaHadoop.cn

邹博

# 主要内容

---

- 复习本次将用到的知识
  - 相对熵、互信息(信息增益)
- 朴素贝叶斯
- 贝叶斯网络的表达
  - 条件概率表参数个数分析
  - 马尔科夫模型
- D-separation
  - 条件独立的三种类型
  - Markov Blanket
- 网络的构建流程
  - 混合(离散+连续)网络: 线性高斯模型
- Chow-Liu算法: 最大权生成树MSWT

# 复习：相对熵

- 相对熵，又称互熵，交叉熵，鉴别信息，Kullback熵，Kullback-Leibler散度等
- 设 $p(x)$ 、 $q(x)$ 是 $X$ 中取值的两个概率分布，则 $p$ 对 $q$ 的相对熵是

$$D(p \parallel q) = \sum_x p(x) \log \frac{p(x)}{q(x)} = E_{p(x)} \log \frac{p(x)}{q(x)}$$

- 说明：
  - 相对熵可以度量两个随机变量的“距离”
  - 一般的， $D(p \parallel q) \neq D(q \parallel p)$
  - $D(p \parallel q) \geq 0$ 、 $D(q \parallel p) \geq 0$

# 复习：互信息

---

- 两个随机变量 $X$ ,  $Y$ 的互信息, 定义为 $X$ ,  $Y$ 的联合分布和独立分布乘积的相对熵。
- $I(X, Y) = D(P(X, Y) \parallel P(X)P(Y))$

$$I(X, Y) = \sum_{x, y} p(x, y) \log \frac{p(x, y)}{p(x)p(y)}$$

# 复习：信息增益

- 信息增益表示得知特征A的信息而使得类X的信息的不确定性减少的程度。
- 定义：特征A对训练数据集D的信息增益  $g(D,A)$ ，定义为集合D的经验熵  $H(D)$  与特征A给定条件下D的经验条件熵  $H(D|A)$  之差，即：
  - $g(D,A)=H(D) - H(D|A)$
  - 显然，这即为训练数据集D和特征A的互信息。

# 概率

---

□ 条件概率:

$$P(A|B) = \frac{P(AB)}{P(B)}$$

□ 全概率公式:

$$P(A) = \sum_i P(A | B_i)P(B_i)$$

□ 贝叶斯(Bayes)公式:

$$P(B_i|A) = \frac{P(A | B_i)P(B_i)}{\sum_j P(A | B_j)P(B_j)}$$

# 贝叶斯公式带来的思考 $P(A|D) = \frac{P(D|A)P(A)}{P(D)}$

- 给定某些样本D，在这些样本中计算某结论 $A_1$ 、 $A_2$ …… $A_n$ 出现的概率，即 $P(A_i|D)$

$$\begin{aligned}\max P(A_i | D) &= \max \frac{P(D | A_i)P(A_i)}{P(D)} = \max (P(D | A_i)P(A_i)) \rightarrow \max P(D | A_i) \\ &\Rightarrow \max P(A_i | D) \rightarrow \max P(D | A_i)\end{aligned}$$

- 第一个等式：贝叶斯公式；
- 第二个等式：样本给定，则对于任何 $A_i$ , $P(D)$ 是常数，仅为归一化因子；
- 第三个箭头：若这些结论 $A_1$ 、 $A_2$ …… $A_n$ 的先验概率相等（或近似），则得到最后一个等式：即第二行的公式。



# 贝叶斯公式的应用

- 8支步枪中有5支已校准过，3支未校准。一名射手用校准过的枪射击，中靶概率为0.8；用未校准的枪射击，中靶概率为0.3；现从8支枪中随机取一支射击，结果中靶。求该枪是已校准过的概率。

$$P(G=1)=\frac{5}{8} \quad P(G=0)=\frac{3}{8}$$

□ 解：

$$P(A=1|G=1)=0.8 \quad P(A=0|G=1)=0.2$$

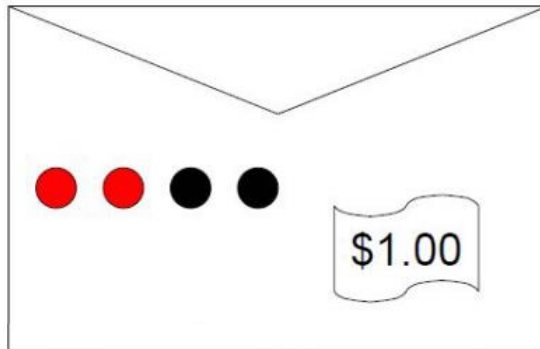
$$P(A=1|G=0)=0.3 \quad P(A=0|G=0)=0.7$$

$$P(G=1|A=1)=?$$

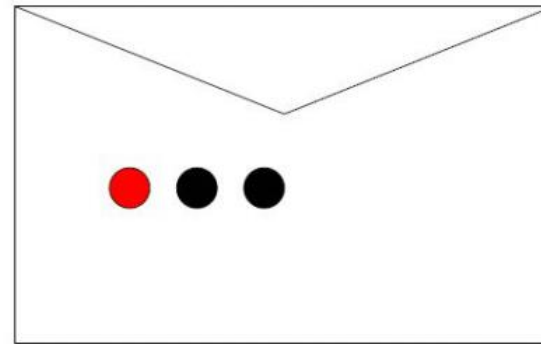
$$P(G=1|A=1)=\frac{P(A=1|G=1)P(G=1)}{\sum_{i \in G} P(A=1|G=i)P(G=i)} = \frac{0.8 \times \frac{5}{8}}{0.8 \times \frac{5}{8} + 0.3 \times \frac{3}{8}} = 0.8163$$

# 另一个实例

---



The “Win” envelope  
has a dollar and four  
beads in it



The “Lose” envelope  
has three beads and  
no money

Interesting question: before deciding, you are allowed to see one bead drawn from the envelope.

Suppose it's black: How much should you pay?

Suppose it's red: How much should you pay?

# 后验概率

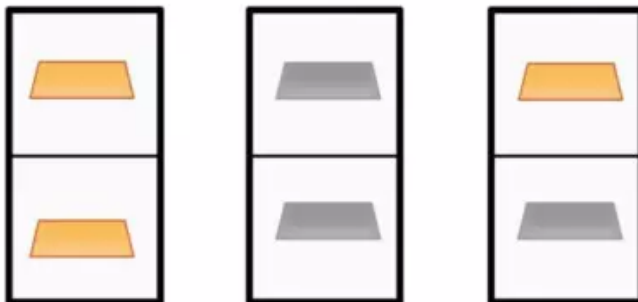
- $c_1$ 、 $c_2$ 表示左右两个信封。
- $P(R)$ ， $P(B)$ 表示摸到红球、黑球的概率。
- $P(R)=P(R|c_1)*P(c_1) + P(R|c_2)*P(c_2)$ ：全概率公式
- $P(c_1|R)=P(R|c_1)*P(c_1)/P(R)$ 
  - $P(R|c_1)=2/4$
  - $P(R|c_2)=1/3$
  - $P(c_1)=P(c_2)=1/2$
- 如果摸到红球，则该信封有1美元的概率是0.6
- 如果摸到黑球，则该信封有1美元的概率是3/7

# 金条问题

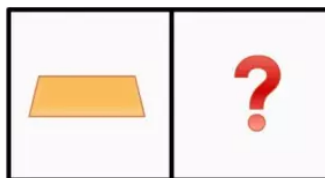


□ 现有三个箱子，每个箱子各有两块贵金属。

■ 三个箱子的金银条如下：



■ 现随机选择一个箱子的其中一块贵金属，发现是金条，请问，该箱子中另外一块仍然是金条的概率是多少？



# 贝叶斯网络

- 把某个研究系统中涉及的**随机变量**，根据是否条件独立绘制在一个**有向图**中，就形成了贝叶斯网络。
- 贝叶斯网络(Bayesian Network)，又称**有向无环图模型**(directed acyclic graphical model ,DAG)，是一种概率图模型，根据概率图的拓扑结构，考察一组随机变量 $\{X_1, X_2 \dots X_n\}$ 及其**n组条件概率分布**(Conditional Probability Distributions, CPD)的性质。

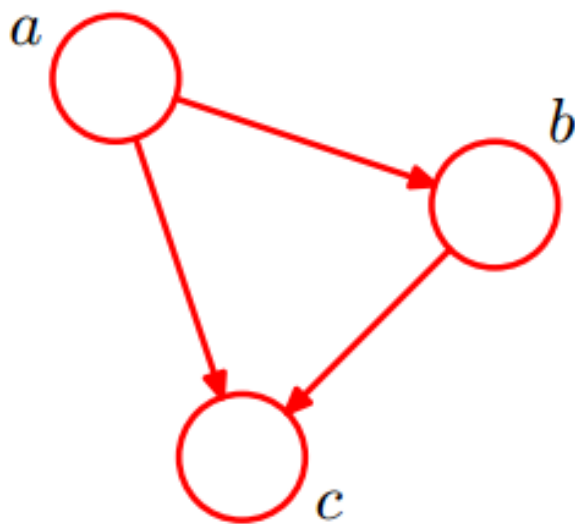
# 贝叶斯网络

- 一般而言，贝叶斯网络的有向无环图中的节点表示随机变量，它们可以是可观察到的变量，或隐变量、未知参数等。连接两个节点的箭头代表此两个随机变量是具有因果关系(或非条件独立)。若两个节点间以一个单箭头连接在一起，表示其中一个节点是“因(parents)”，另一个是“果(children)”，两节点就会产生一个条件概率值。
- 每个结点在给定其直接前驱时，条件独立于其非后继。
  - 稍后详细解释此结论

# 一个简单的贝叶斯网络

---

$$p(a, b, c) = p(c|a, b)p(b|a)p(a)$$



# 全连接贝叶斯网络

---

□ 每一对结点之间都有边连接

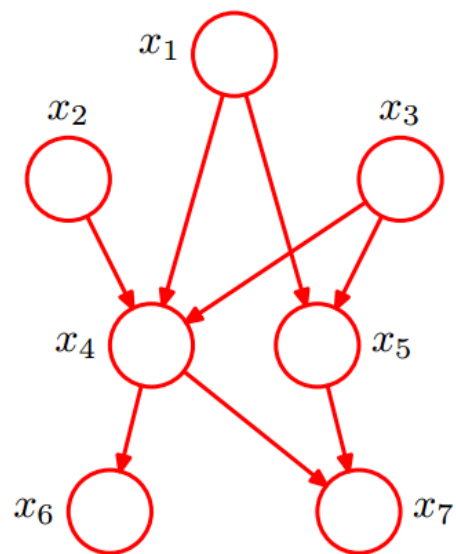
$$p(x_1, \dots, x_K) = p(x_K | x_1, \dots, x_{K-1}) \dots p(x_2 | x_1) p(x_1)$$

$$P(X_1 = x_1, \dots, X_n = x_n) = \prod_{i=1}^n P(X_i = x_i | X_{i+1} = x_{i+1}, \dots, X_n = x_n)$$



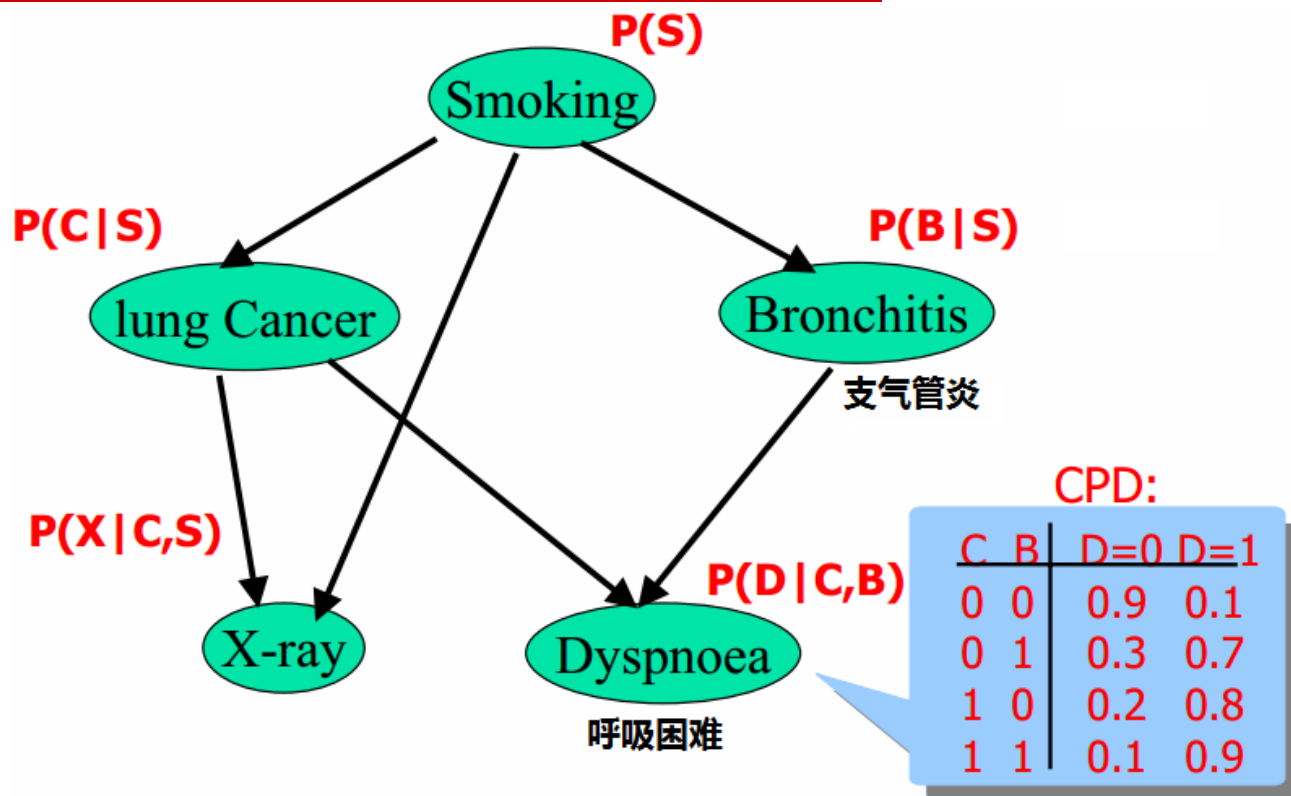
# 一个“正常”的贝叶斯网络

- 有些边缺失
- 直观上：
  - $x_1$ 和 $x_2$ 独立
  - $x_6$ 和 $x_7$ 在 $x_4$ 给定的条件下独立
- $x_1, x_2, \dots, x_7$ 的联合分布：



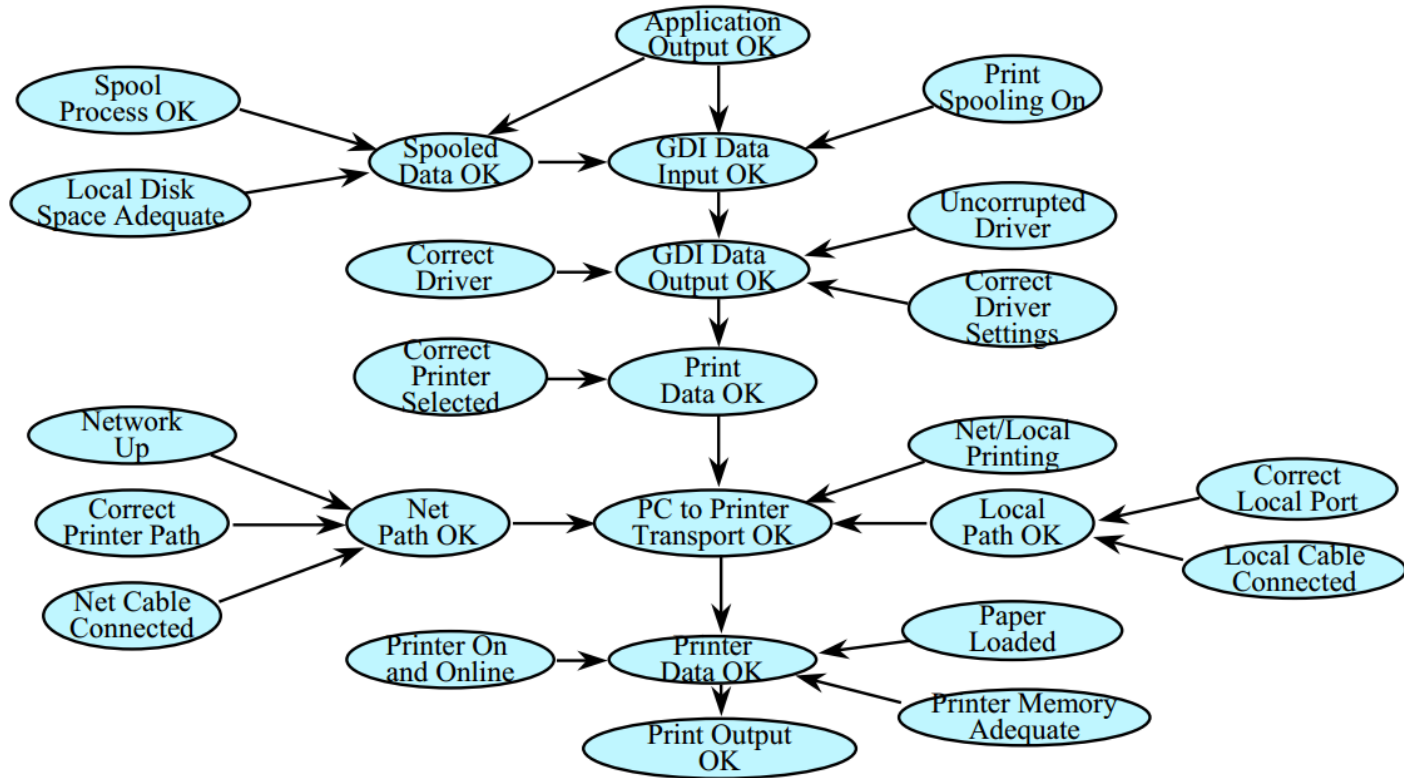
$$p(x_1)p(x_2)p(x_3)p(x_4|x_1, x_2, x_3)p(x_5|x_1, x_3)p(x_6|x_4)p(x_7|x_4, x_5)$$

# 对一个实际贝叶斯网络的分析



$$1+2+2+4+4=13 \text{ vs } 2^5$$

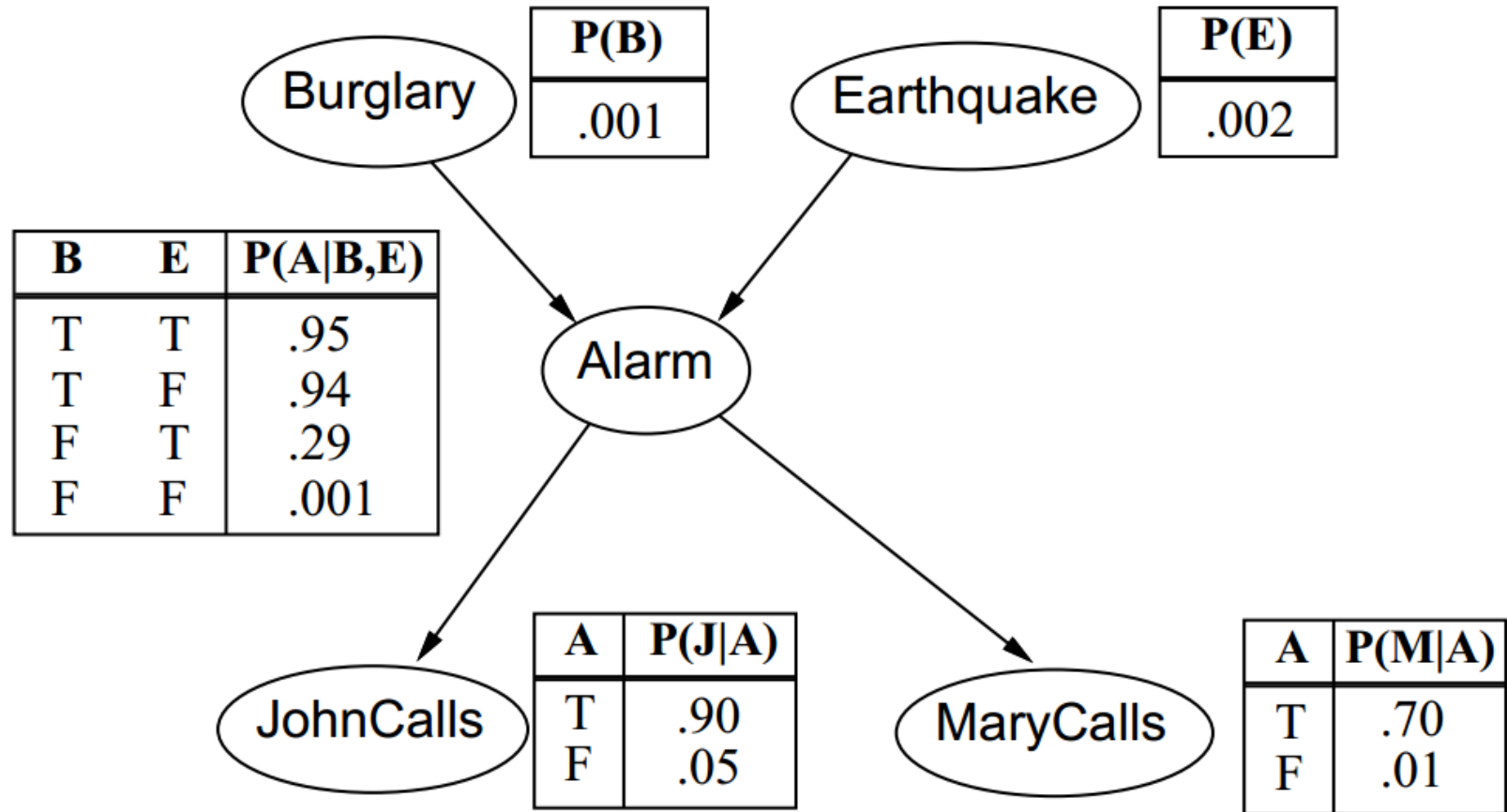
# 贝叶斯网络：打印机故障诊断



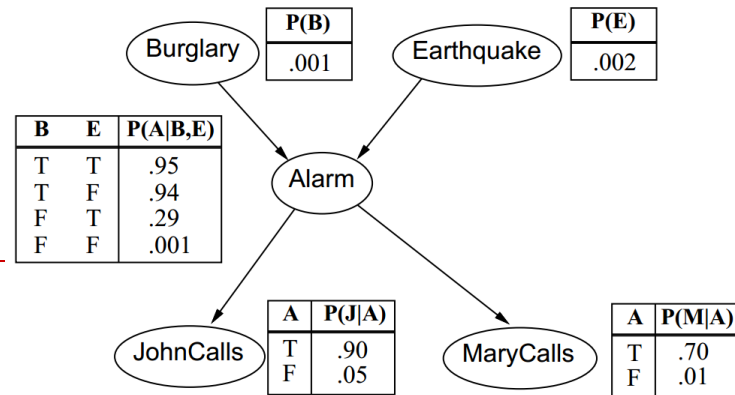
□  $17*1 + 1*2 + 2*2^2 + 3*2^3 + 3*2^4 = 99$

□  $2^{26} = 67108864$

# 贝叶斯网络：警报



# 贝叶斯网络：警报



## □ 全部随机变量的联合分布

$$P(x_1, x_2, \dots, x_n) = \prod_{i=1}^n P(x_i \mid \text{parents}(x_i))$$

$$\begin{aligned} & P(j, m, a, \bar{b}, \bar{e}) \\ &= P(j \mid a)P(m \mid a)P(a \mid \bar{b}, \bar{e})P(\bar{b})P(\bar{e}) \\ &= 0.9 \times 0.7 \times 0.001 \times 0.999 \times 0.998 \\ &\approx 0.00063 \end{aligned}$$

# 贝叶斯网络的形式化定义

## □ BN( $G, \Theta$ )

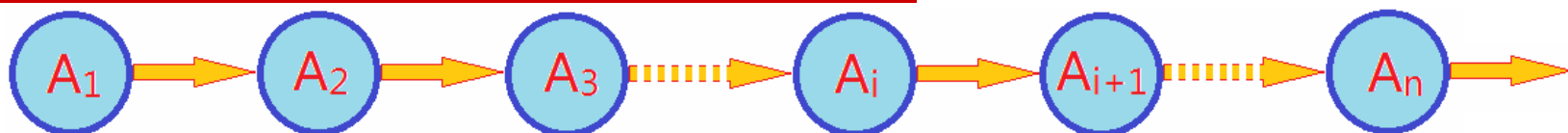
- $G$ : 有向无环图
- $G$ 的结点: 随机变量
- $G$ 的边: 结点间的有向依赖
- $\Theta$ : 所有条件概率分布的参数集合
- 结点 $X$ 的条件概率:  $P(X|\text{parent}(X))$

$$P(S, C, B, X, D) = P(S) P(C|S) P(B|S) P(X|C,S) P(D|C,B)$$

## □ 思考: 需要多少参数才能确定上述网络呢?

- 每个结点所需参数的个数: 结点的parent数目是 $M$ , 结点和parent的可取值数目都是 $K$ :  $K^{M*(K-1)}$ 
  - 考察结点的parent对该结点形成了多少种情况(条件分布)

# 特殊的贝叶斯网络



□ 结点形成一条链式网络，称作**马尔科夫模型**

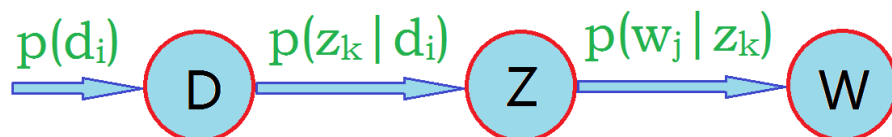
■  $A_{i+1}$  **只与 $A_i$ 有关**，与 $A_1, \dots, A_{i-1}$ 无关

□ 思考：

■ **伪随机数发生器**

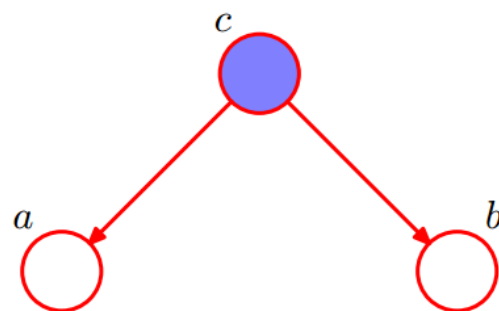
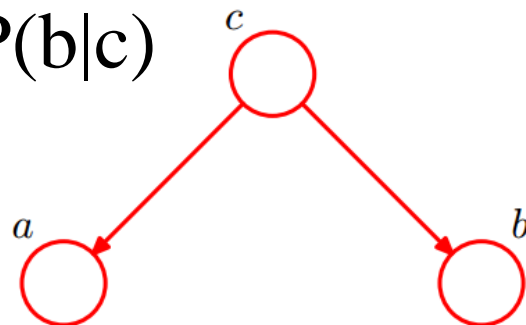
```
return(((holdrand = holdrand * 214013L + 2531011L) >> 16) & 0x7fff);
```

■ **pLSA主题模型**



# 通过贝叶斯网络判定条件独立—1

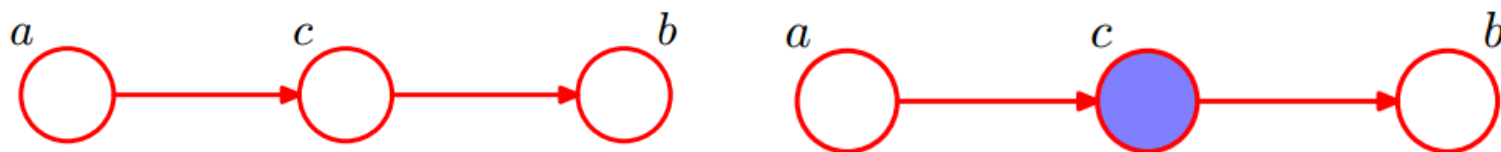
- 根据图模型，得： $P(a,b,c)=P(c)*P(a|c)*P(b|c)$
- 从而： $P(a,b,c)/P(c)=P(a|c)*P(b|c)$
- 因为  $P(a,b|c)=P(a,b,c)/P(c)$
- 得： $P(a,b|c)=P(a|c)*P(b|c)$
- 即：在c给定的条件下，  
a, b被阻断(blocked)是独立的
  - 条件独立：tail-to-tail





# 通过贝叶斯网络判定条件独立—2

□  $P(a,b,c)=P(a)*P(c|a)*P(b|c)$



$$\begin{aligned} & P(a, b | c) \\ &= P(a, b, c) / P(c) \\ &= P(a) * P(c | a) * P(b | c) / P(c) \\ &= P(a, c) * P(b | c) / P(c) \\ &= P(a | c) * P(b | c) \end{aligned}$$

□ 即：在c给定的条件下，a，b被阻断(blocked)，是独立的。

■ 条件独立：head-to-tail

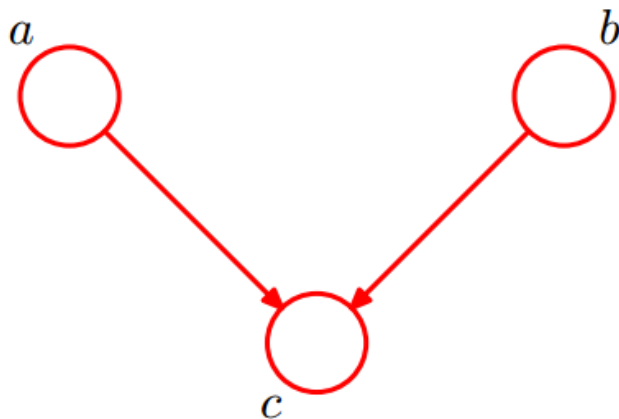
# 通过贝叶斯网络判定条件独立—3

□  $P(a, b, c) = P(a) * P(b) * P(c | a, b)$

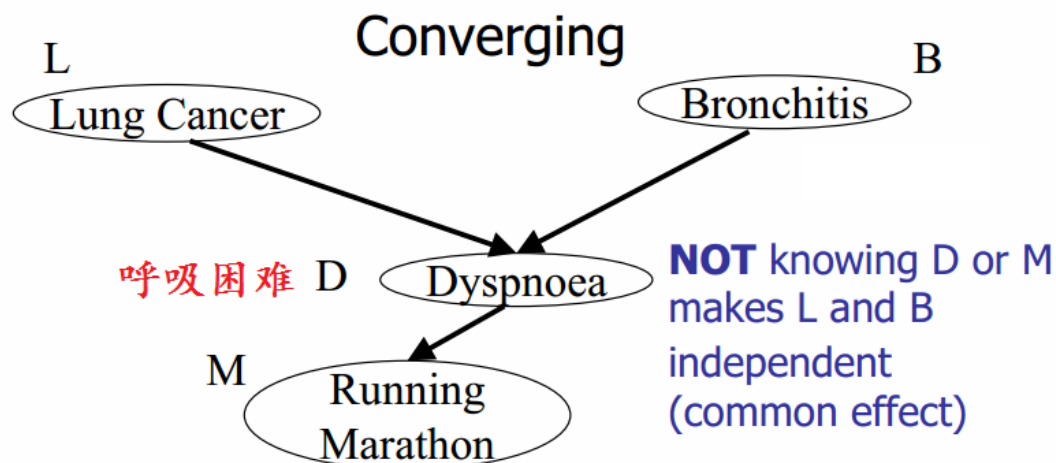
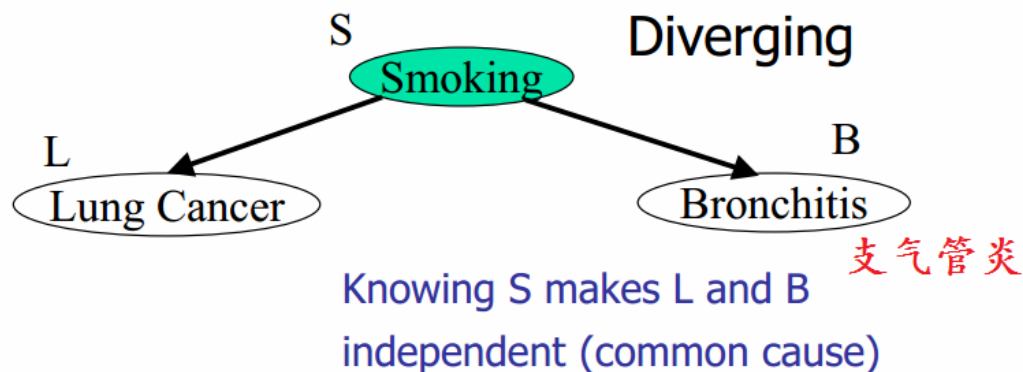
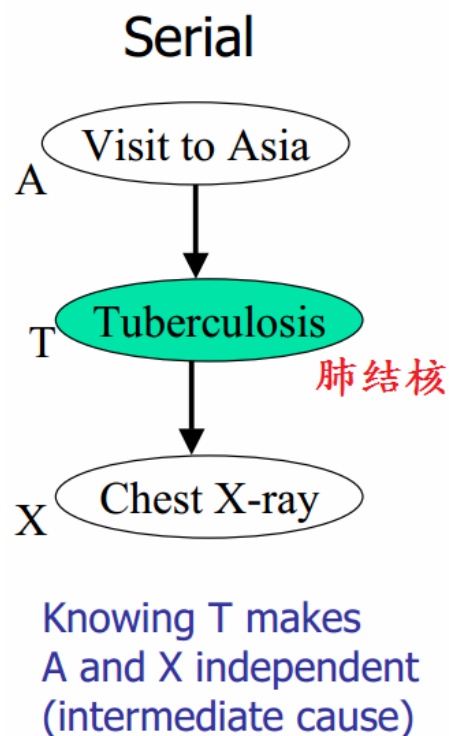
$$\sum_c P(a, b, c) = \sum_c P(a) * P(b) * P(c | a, b)$$

$$\Rightarrow P(a, b) = P(a) * P(b)$$

□ 在c未知的条件下，a，b被阻断(blocked)，是独立的： head-to-head



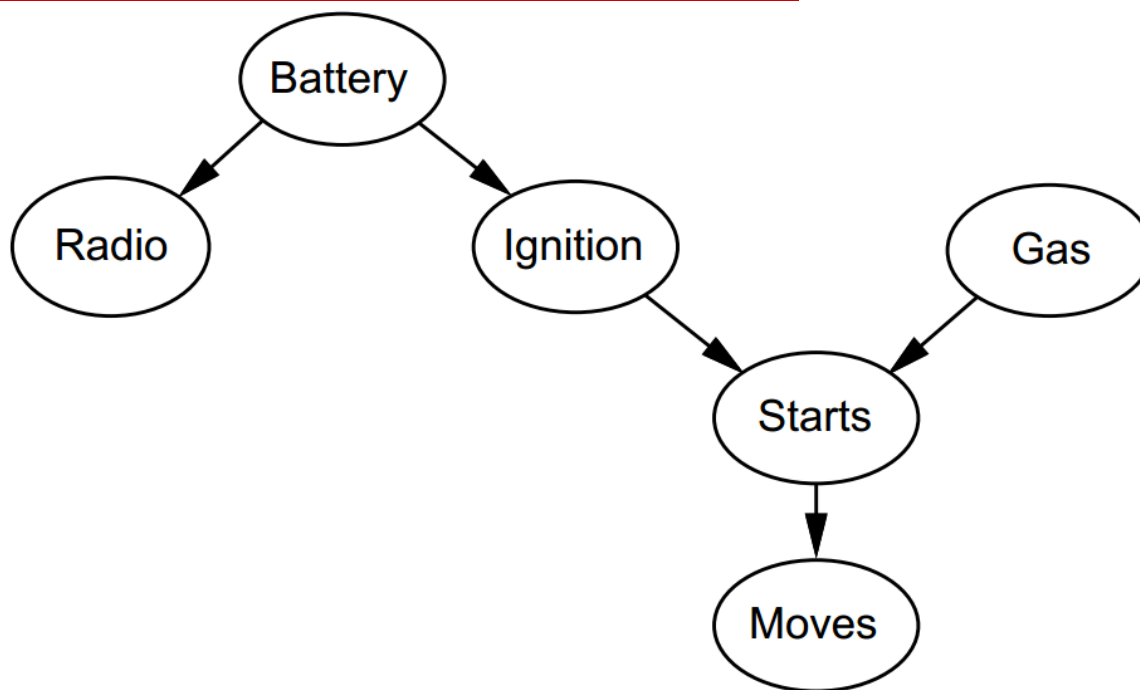
# 举例说明这三种情况



# 将上述结点推广到结点集

- D-separation: 有向分离
- 对于任意的结点集A, B, C, 考察所有通过A中任意结点到B中任意结点的路径, 若要求A, B条件独立, 则需要所有的路径都被阻断(blocked), 即满足下列两个前提之一:
  - A和B的“head-to-tail型”和“tail-to-tail型”路径都通过C;
  - A和B的“head-to-head型”路径不通过C以及C的子孙;
- 如果A,B不满足D-separation, A,B有时被称为D-connected.

# 有向分离的举例



□ Gas和Radio是独立的吗？给定Battery呢？  
Ignition呢？Starts呢？Moves呢？（答：IIID）

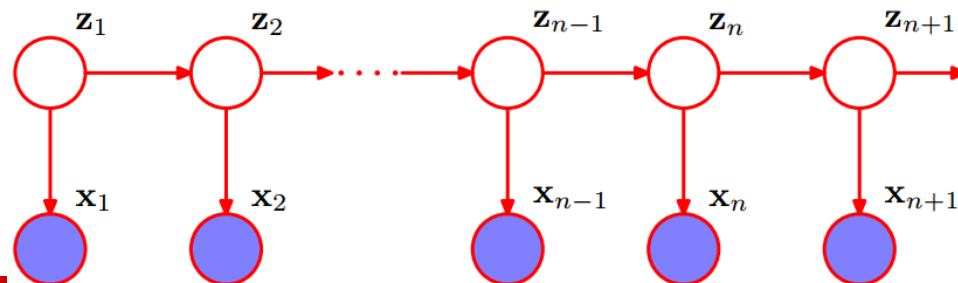
# 再次分析链式网络



- 有D-separation可知，在 $x_i$ 给定的条件下， $x_{i+1}$ 的分布和 $x_1, x_2, \dots, x_{i-1}$ 条件独立。即： $x_{i+1}$ 的分布状态只和 $x_i$ 有关，和其他变量条件独立，这种顺次演变的随机过程模型，叫做**马尔科夫模型**。

$$P(X_{n+1} = x | X_0, X_1, X_2, \dots, X_n) = P(X_{n+1} = x | X_n)$$

# HMM



- 隐马尔科夫模型(HMM, Hidden Markov Model)可用标注问题, 在语音识别、NLP、生物信息、模式识别等领域被实践证明是有效的算法。
- HMM是关于时序的概率模型, 描述由一个隐藏的马尔科夫链随机生成不可观测的状态随机序列, 再由各个状态生成一个观测而产生观测随机序列的过程。
- 隐马尔科夫模型随机生成的状态的序列, 称为状态序列; 每个状态生成一个观测, 由此产生的观测随机序列, 称为观测序列
  - 序列的每个位置可看做是一个时刻
  - 空间序列也可以使用该模型: 如分析DNA。

# Markov Blanket

---

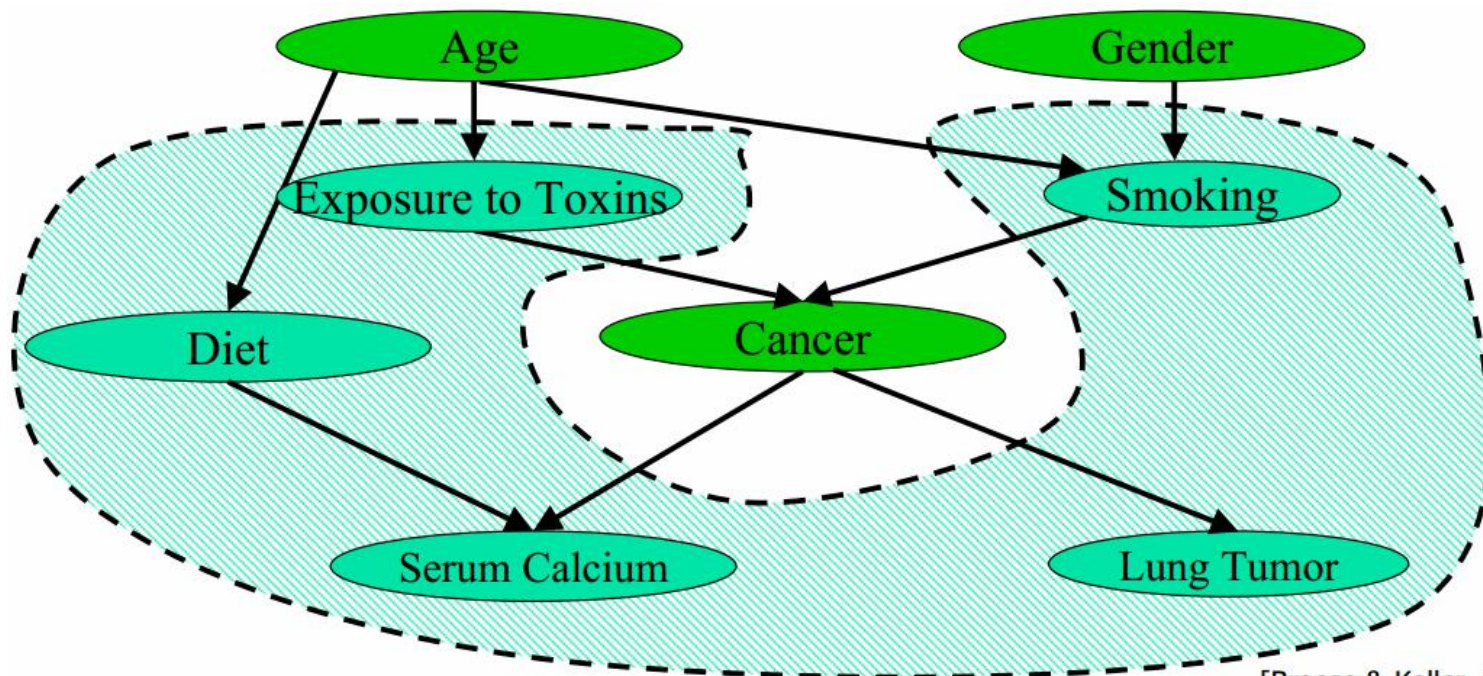
- 一个结点的Markov Blanket是一个集合，在这个集合中的结点都给定的条件下，该结点条件独立于其他所有结点。
- 即：一个结点的Markov Blanket是它的parents, children以及spouses(孩子的其他parent)



# 贝叶斯网络

背景知识: Serum Calcium(血清钙浓度)高于2.75mmol/L即为高钙血症。许多恶性肿瘤可并发高钙血症。恶性肿瘤病人离子钙增高的百分比大于总钙,也许可用于肿瘤的过筛试验。当高钙血症的原因难于确定时,必须考虑到恶性肿瘤的存在。

[http://www.wiki8.com/xueqinggai\\_131584/](http://www.wiki8.com/xueqinggai_131584/)

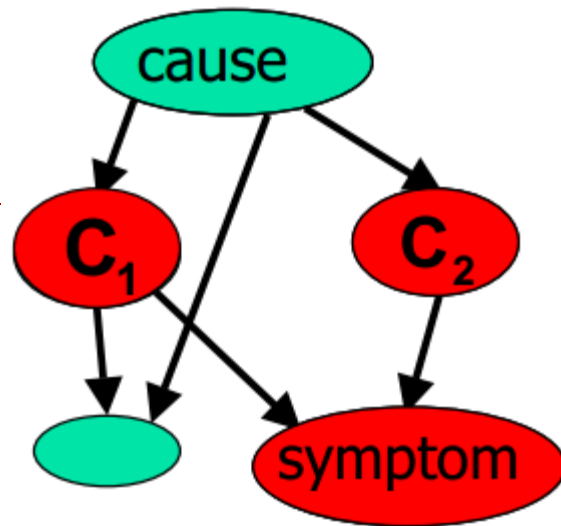


[Breese & Koller, 97]

阴影部分的结点集合, 是Cancer的“马尔科夫毯”(Markov Blanket)

条件独立:  $P(S,L|C) = P(S|C) * P(L|C)$

# 贝叶斯网络的用途



- 诊断:  $P(\text{病因}|\text{症状})$
- 预测:  $P(\text{症状}|\text{病因})$
- 分类:  $\max_{\text{class}} P(\text{类别}|\text{数据})$

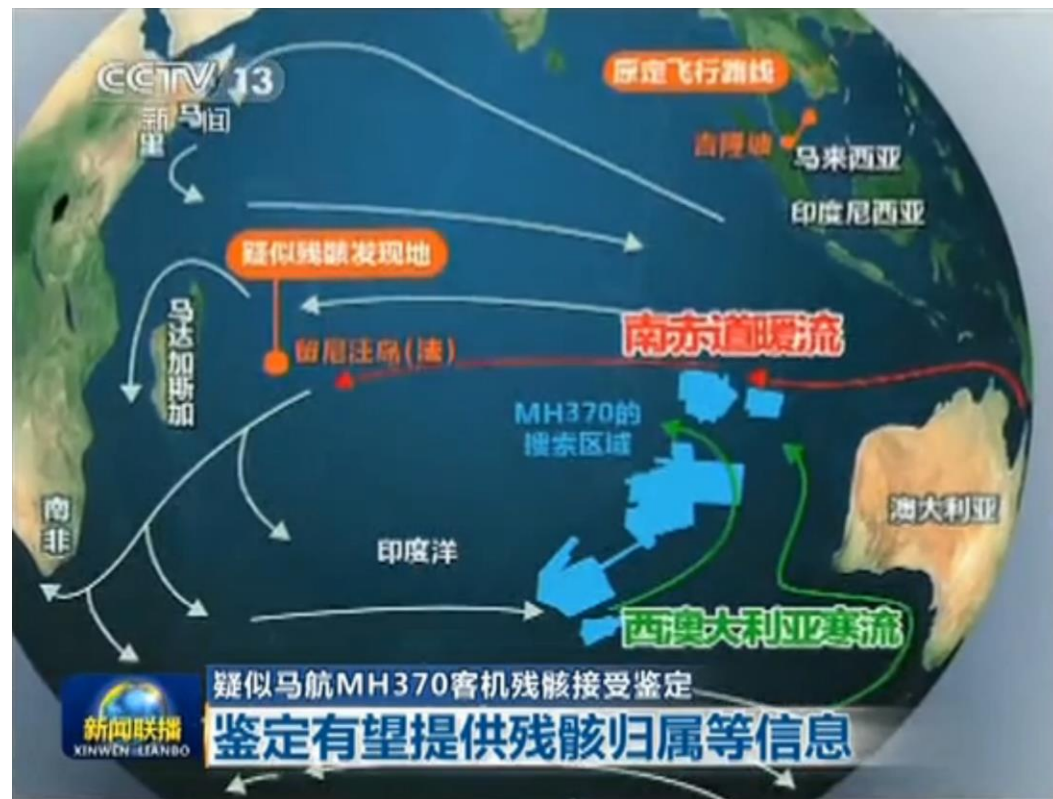
- 通过给定的样本数据，建立贝叶斯网络的拓扑结构和结点的条件概率分布参数。这往往需要借助先验知识和极大似然估计来完成。
- 在贝叶斯网络确定的结点拓扑结构和条件概率分布的前提下，可以使用该网络，对未知数据计算条件的概率或后验概率，从而达到诊断、预测或者分类的目的。

# 寻找马航MH370

- 2014年3月8日，马来西亚航空公司**MH370**航班(波音777-200ER)客机凌晨0:41分从**吉隆坡**飞往**北京**；**凌晨1:19**分，马航MH370与空管失去联系。凌晨2:14分飞机最后一次出现在军事雷达上之后**人间消失**。
- 2015年7月29日在法属**留尼汪岛**(l'île de la Reunion)发现**襟副翼残骸**；2015年8月6日，马来西亚宣布，该残骸**确属**马航MH370。随后法国谨慎宣布，“**有很强的理由推测**认为，...残骸属于马航MH370航班的波音777客机...但最终的比对结果还需要**进一步的技术验证**加以确认。”

# MH370最后消失区域

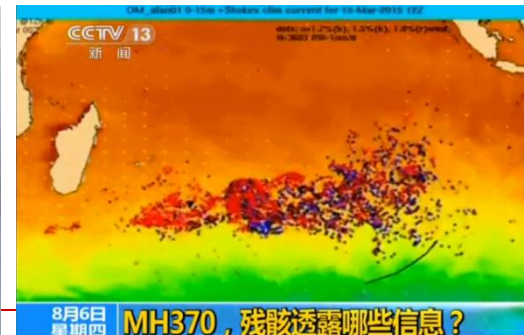
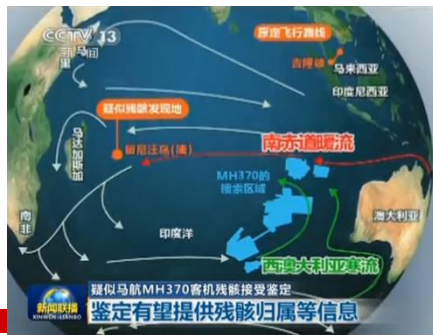
- 可否根据雷达**最后消失区域**和**洋流、大气**等因素：
- 判断**留尼汪岛**是否位于可能区域？
- 残骸漂流到该岛屿的**概率有多大**？



# 建模分析

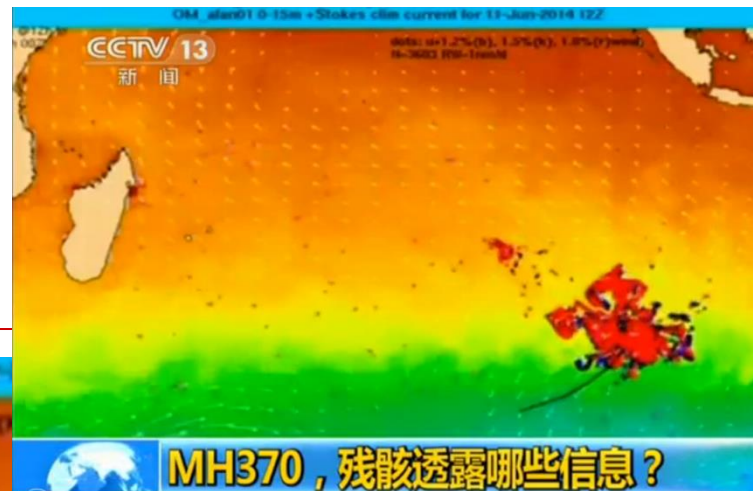
- 记MH370最后消失区域坐标为 $(x_0, y_0)$ ，经过短暂时间后，如何推断它的可能区域？
- 以 $(x_0, y_0)$ 为圆心、以X轴正向为 $0^\circ$ ，逆时针为旋转角正向建立坐标系，将旋转角按照 $0.1^\circ$ 为步长，分成3600份。经过时间 $\Delta t$ 后，残骸落在哪个区域？
- 根据洋流大气等综合因素，判断在 $(x_0, y_0)$ 移动方向 $d$ 的概率为 $p_d$ 。 $d \in [0, 360]$ ，步长为0.1；
- 得到3600维的初始行向量 $\pi$ 。
  - 移动速度 $V_0$ \*微小时间段 $\Delta t$ ，得到位于新位置 $(x_1, y_1)$ 的概率。这些新位置的外包围盒构成区域 $R_1$ 。

# 转移概率矩阵



- 建模任务：在某个时刻 $t_i$ ，物体位于区域 $R_i$ ，计算下一时刻位于 $R_{i+1}$ 的概率。
- 遍历 $R_i$ 上所有**概率非零**的坐标点，用 $V_i * \Delta t$ 确定 $R_{i+1}$ 的**先验范围**。将 $R_i$ 增广到 $R_{i+1}$ 上。
  - 将二维区域 $R_i$ 和 $R_{i+1}$ **拉直成行向量**，假定**维度为N**
- 根据领域知识建立 $R_i$ 上所有概率非零点的概率 $P_i$ 。
  - $P_i$ 表示区域 $R_i$ 到 $R_{i+1}$ 的**转移概率**，因此，是 $N \times N$ 的二维矩阵(方阵)，
- 区域 $R_{i+1}$ 的后验概率为： $R_{i+1} = R_i \times P_i$ 
  - 以上述方法，计算每个时刻的可能区域 $R_0, R_1, \dots, R_n$

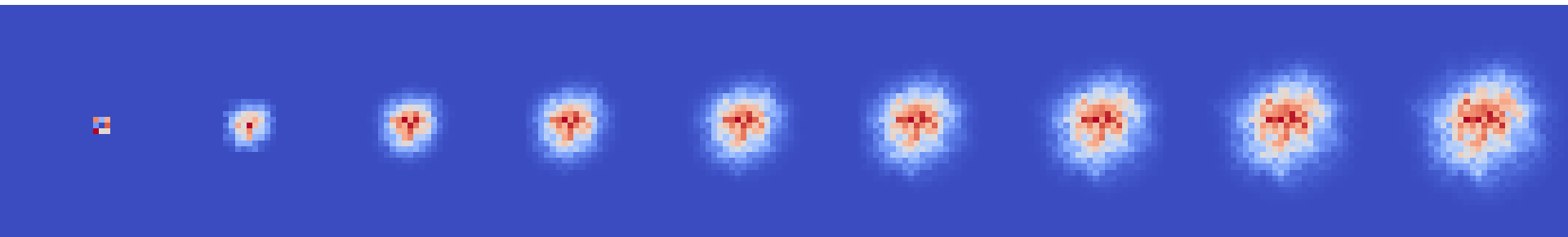
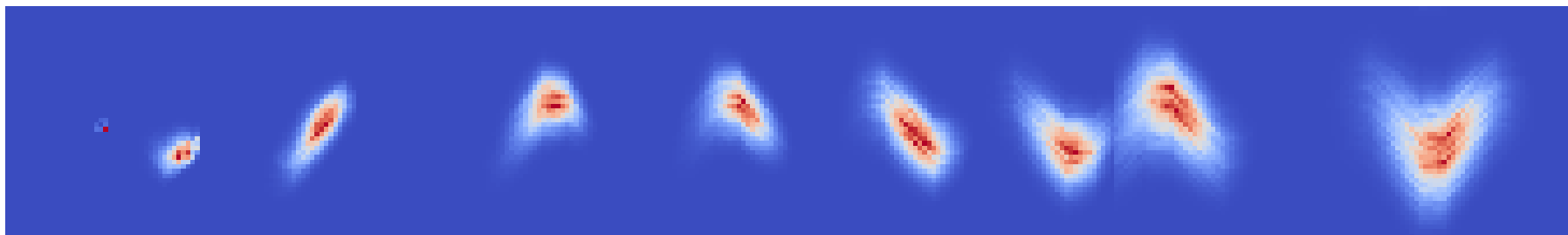
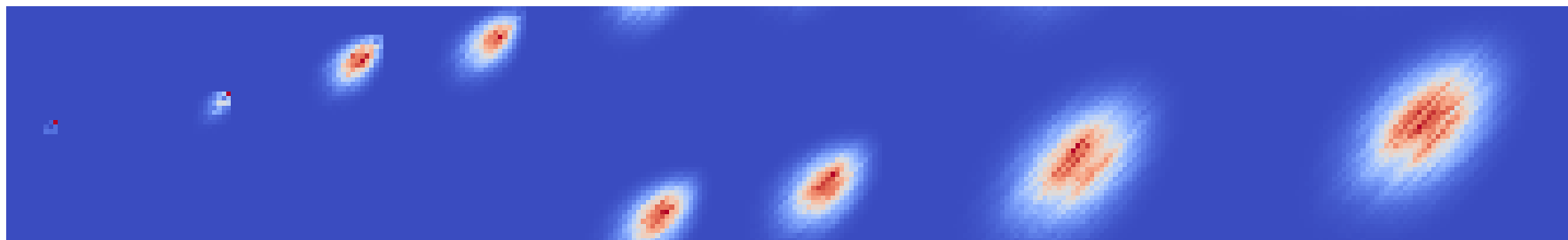
# MH370可能区域



# 马尔科夫模型模拟实验

---

□ 概率优势方向：Direct/Sin/Random





# Code

```
save_image = True
style = 'Direct' # Sin/Direct/Random
m, n = 50, 100
directions = np.random.rand(m, n, 8)

if style == 'Direct':
    directions[:, :, 1] = 10
elif style == 'Sin':
    x = np.arange(n)
    y_d = np.cos(6*np.pi*x/n)
    theta = np.empty_like(x, dtype=np.int)
    theta[y_d > 0.5] = 1
    theta[~(y_d > 0.5) & (y_d > -0.5)] = 0
    theta[~(y_d > -0.5)] = 7
    directions[:, x.astype(np.int), theta] = 10
for i in np.arange(m):
    for j in np.arange(n):
        directions[i, j] /= np.sum(directions[i, j])
print directions

loc = np.zeros((m, n), dtype=np.float)
loc[m/2, n/2] = 1
loc_prime = np.empty_like(loc)
loc_prime = loc
fig = plt.figure(figsize=(8, 6), facecolor='w')
im = plt.imshow(loc/np.max(loc), cmap='coolwarm')
anim = animation.FuncAnimation(fig, update, frames=1000, interval=50, blit=True)
plt.tight_layout(1.5)
plt.show()
```

# 总结

- 在每个时刻，物体的当前可能区域是上一时刻所有可能区域和相应转移概率的乘积和，这恰好是矩阵乘法(矩阵和向量乘法)的定义。
- 当前可能区域只和上一个时刻的区域有关，而与更上一个时刻无关，因此，是马尔科夫模型。
- 思考：可以使用“漂流位置”建立马尔科夫模型，该可能位置是不可观察的，而将“转移位置”认为是“漂流位置”的转换结果，“转移位置”是残骸的最终真实位置，使用增强的隐马尔科夫模型。
  - 不要过得累加模型的复杂度，适时使用奥卡姆剃刀 (Occam's Razor)。
  - 该模型仅个人观点。

# 贝叶斯网络的构建

□ 依次计算每个变量的D-separation的局部测试结果，综合每个结点得到贝叶斯网络。

□ 算法过程：

■ 选择变量的一个合理顺序： $X_1, X_2, \dots, X_n$

■ 对于 $i=1$ 到 $n$

□ 在网络中添加 $X_i$ 结点

□ 在 $X_1, X_2, \dots, X_{i-1}$ 中选择 $X_i$ 的父母，使得：

$$P(X_i | \text{Parent}(X_i)) = P(X_i | X_1, X_2 \dots X_{i-1})$$

□ 这种构造方法，显然保证了全局的语义要求：

$$P(X_1, X_2 \dots X_n) = \prod_{i=1}^n P(X_i | X_1, X_2 \dots X_{i-1}) = \prod_{i=1}^n P(X_i | \text{Parent}(X_i))$$

# 贝叶斯网络的构建举例

---

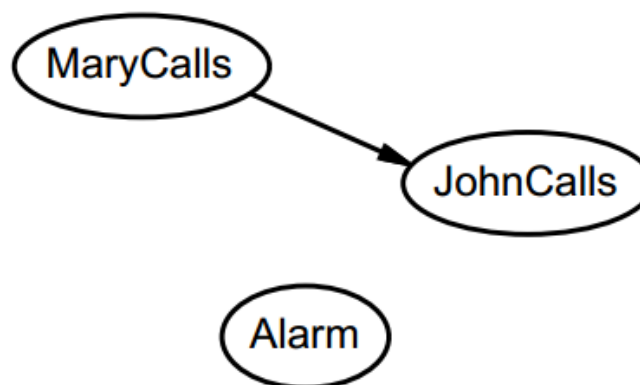
Suppose we choose the ordering  $M, J, A, B, E$



$$P(J|M) = P(J)?$$

# 构建举例

Suppose we choose the ordering  $M, J, A, B, E$

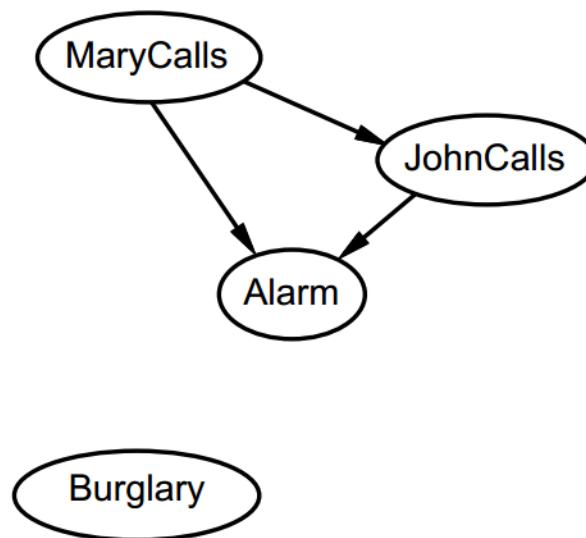


$P(J|M) = P(J)$ ? No

$P(A|J, M) = P(A|J)$ ?  $P(A|J, M) = P(A)$ ?

# 构建举例

Suppose we choose the ordering  $M, J, A, B, E$



$P(J|M) = P(J)$ ? No

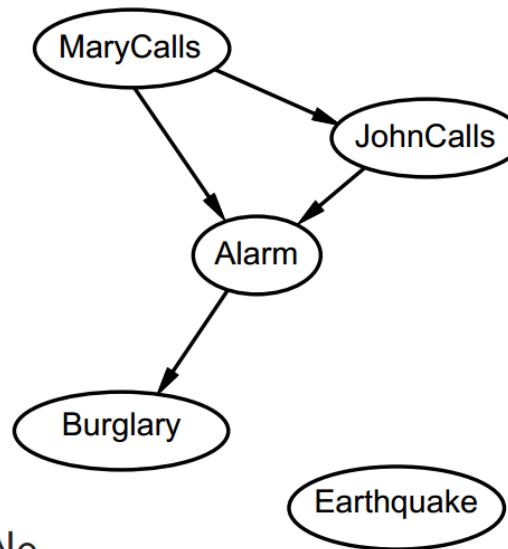
$P(A|J, M) = P(A|J)$ ?  $P(A|J, M) = P(A)$ ? No

$P(B|A, J, M) = P(B|A)$ ?

$P(B|A, J, M) = P(B)$ ?

# 构建举例

Suppose we choose the ordering  $M, J, A, B, E$



$P(J|M) = P(J)$ ? No

$P(A|J, M) = P(A|J)$ ?  $P(A|J, M) = P(A)$ ? No

$P(B|A, J, M) = P(B|A)$ ? Yes

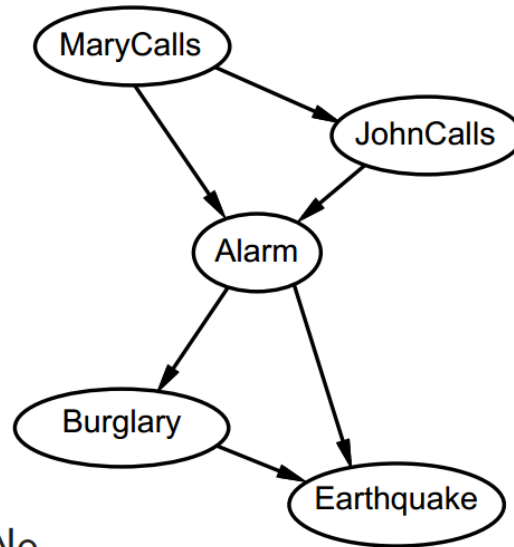
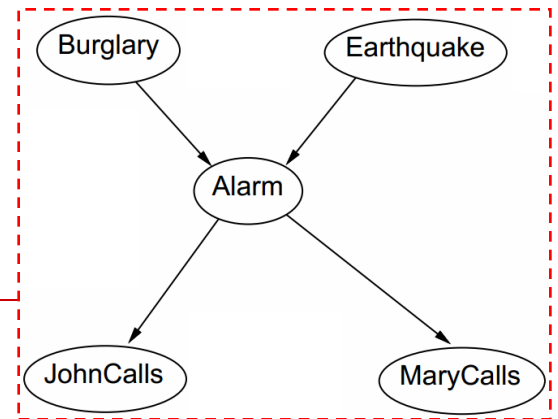
$P(B|A, J, M) = P(B)$ ? No

$P(E|B, A, J, M) = P(E|A)$ ?

$P(E|B, A, J, M) = P(E|A, B)$ ?

# 构建举例

Suppose we choose the ordering  $M, J, A, B, E$



$P(J|M) = P(J)$ ? No

$P(A|J, M) = P(A|J)$ ?  $P(A|J, M) = P(A)$ ? No

$P(B|A, J, M) = P(B|A)$ ? Yes

$P(B|A, J, M) = P(B)$ ? No

$P(E|B, A, J, M) = P(E|A)$ ? No

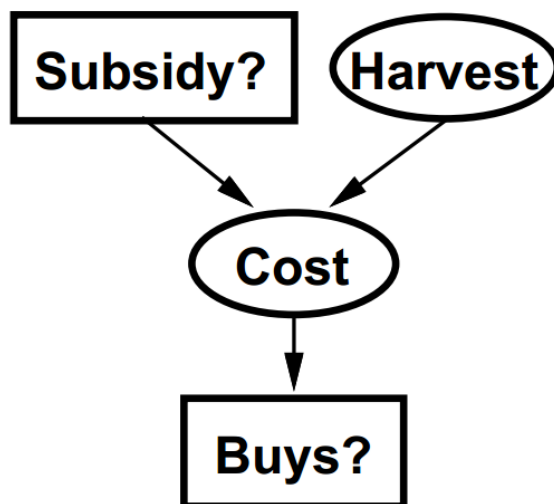
$P(E|B, A, J, M) = P(E|A, B)$ ? Yes

$$1+2+4+2+4=13$$



# 混合(离散+连续)网络

Discrete (*Subsidy?* and *Buys?*); continuous (*Harvest* and *Cost*)



Option 1: discretization—possibly large errors, large CPTs

Option 2: finitely parameterized canonical families

1) Continuous variable, discrete+continuous parents (e.g., *Cost*)

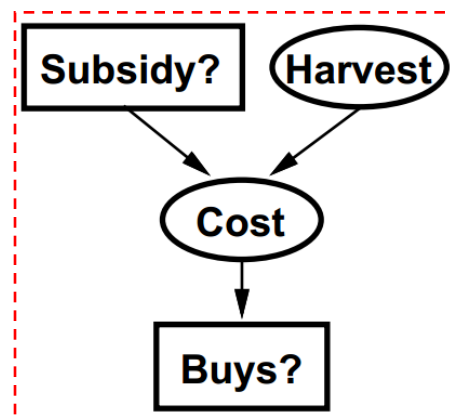
2) Discrete variable, continuous parents (e.g., *Buys?*)

# 孩子节点是连续的

Need one **conditional density** function for child variable given continuous parents, for each possible assignment to discrete parents

Most common is the **linear Gaussian** model, e.g.,:

$$\begin{aligned} P(\text{Cost} = c | \text{Harvest} = h, \text{Subsidy?} = \text{true}) \\ &= N(a_t h + b_t, \sigma_t)(c) \\ &= \frac{1}{\sigma_t \sqrt{2\pi}} \exp\left(-\frac{1}{2} \left(\frac{c - (a_t h + b_t)}{\sigma_t}\right)^2\right) \end{aligned}$$



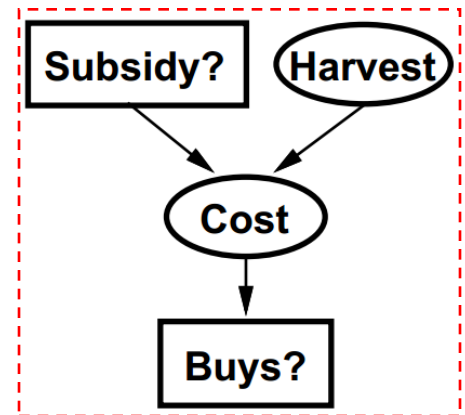
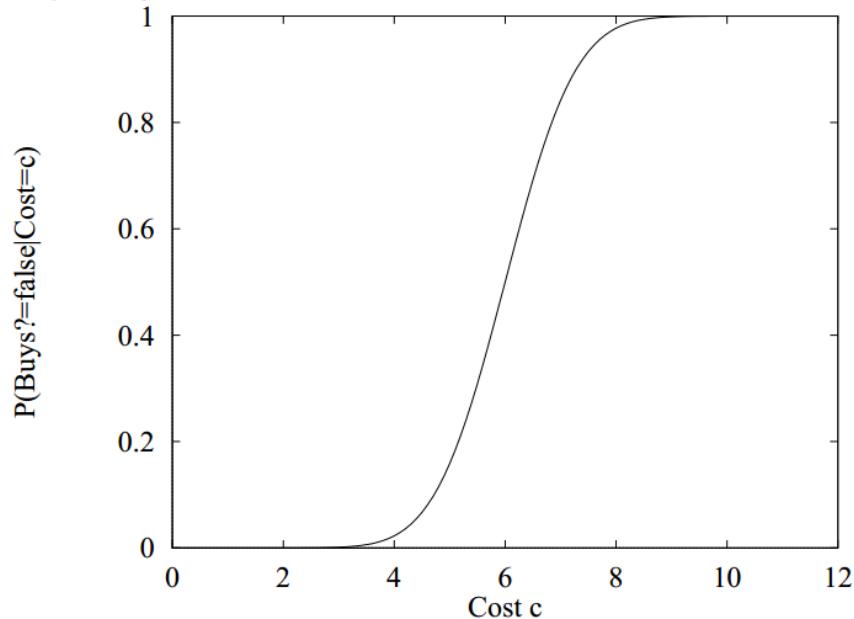
Mean *Cost* varies linearly with *Harvest*, variance is fixed

Linear variation is unreasonable over the full range

but works OK if the **likely** range of *Harvest* is narrow

# 孩子节点是离散的，父节点是连续的

Probability of *Buys?* given *Cost* should be a “soft” threshold:



Probit distribution uses integral of Gaussian:

$$\Phi(x) = \int_{-\infty}^x N(0, 1)(x)dx$$

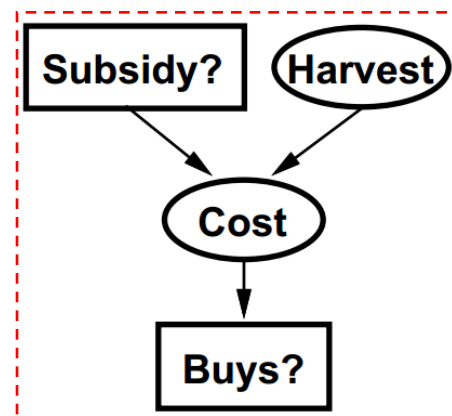
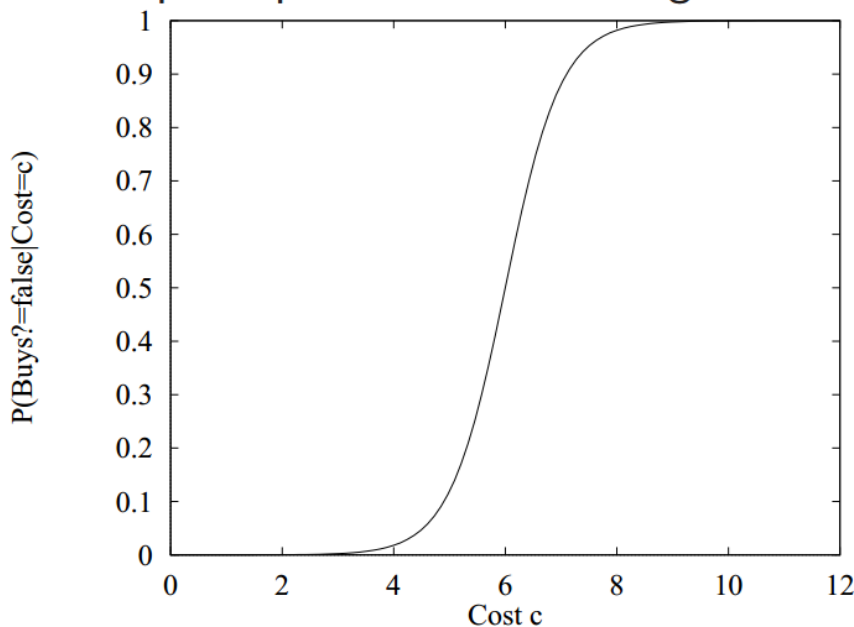
$$P(\text{Buys?} = \text{true} \mid \text{Cost} = c) = \Phi((-c + \mu)/\sigma)$$

# 孩子节点是离散的，父节点是连续的

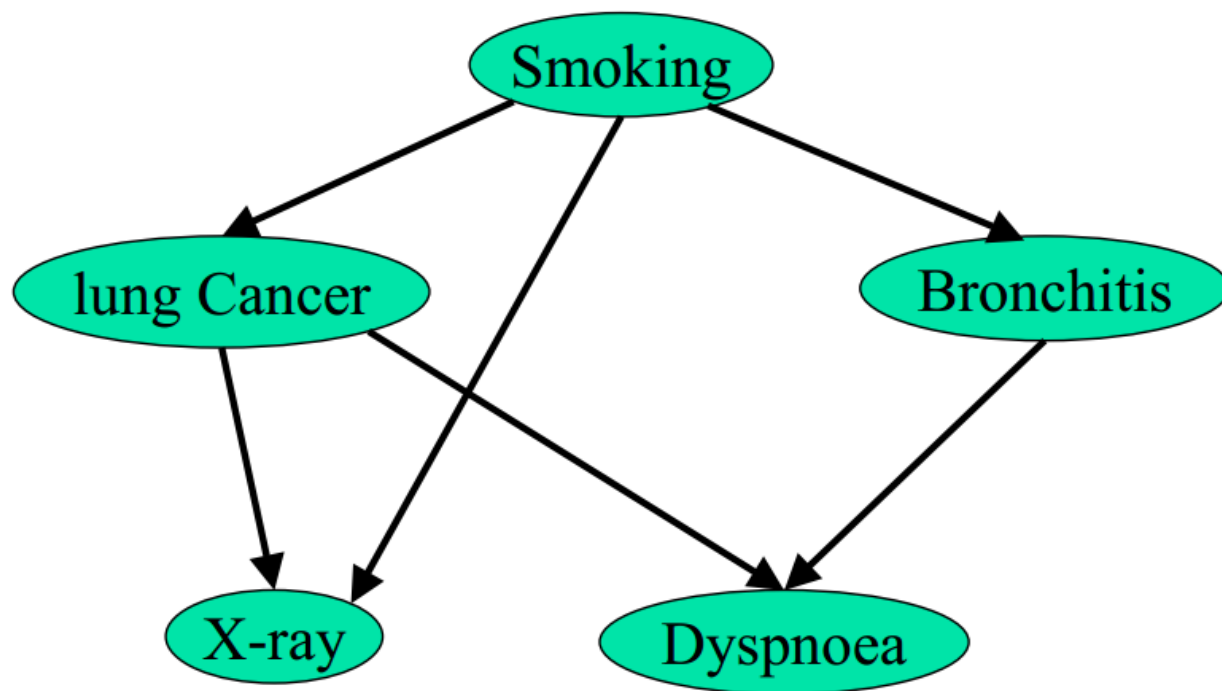
Sigmoid (or logit) distribution also used in neural networks:

$$P(\text{Buys?} = \text{true} \mid \text{Cost} = c) = \frac{1}{1 + \exp(-2\frac{-c+\mu}{\sigma})}$$

Sigmoid has similar shape to probit but much longer tails:

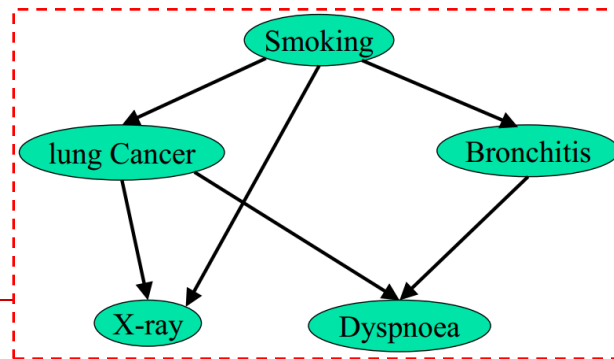


# 贝叶斯网络的推导



$$P(\text{smoking} \mid \text{dyspnoea}=\text{yes}) = ?$$

# 贝叶斯网络的推导



$$P(s|d=1) = \frac{P(s, d=1)}{P(d=1)} \propto P(s, d=1) =$$

$$\sum_{d=1, b, x, c} P(s) \underbrace{P(c|s)} P(b|s) \underbrace{P(x|c, s) P(d|c, b)} =$$

$$P(s) \sum_{d=1} \sum_b P(b|s) \sum_x \underbrace{\sum_c P(c|s) P(x|c, s) P(d|c, b)}_{f(s, d, b, x)}$$

Variable Elimination

$f(s, d, b, x)$

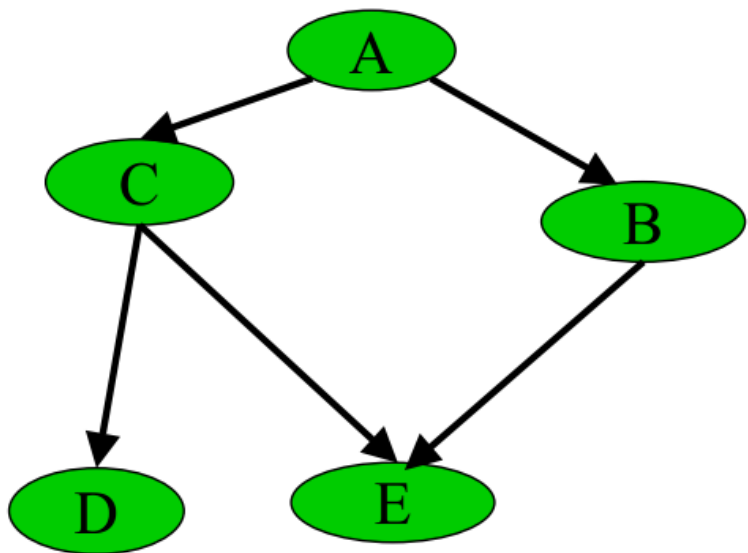
# 无向环

---

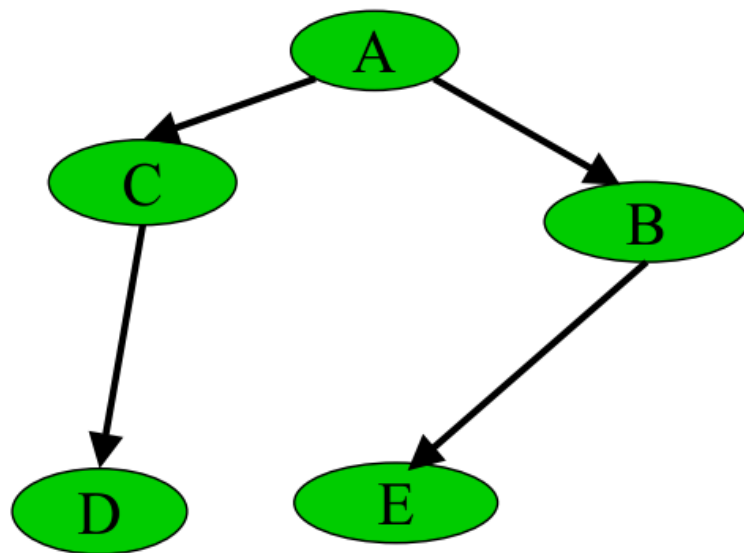
- 可以发现，若贝叶斯网络中存在“环”（无向），则因此构造的因子图会得到环。而使用消息传递的思想，这个消息将无限传输下去，不利于概率计算。
- 解决方法：
  - 删除贝叶斯网络中的若干条边，使得它不含有无向环
  - 重新构造没有环的贝叶斯网络

# 原贝叶斯网络的近似树结构

True distribution  $P(X)$



Tree-approximation  $P'(X)$



$$D(p \parallel q) = \sum_x p(x) \log \frac{p(x)}{q(x)} = E_{p(x)} \log \frac{p(x)}{q(x)}$$



# 将两图的相对熵转换成变量的互信息

**Theorem** [Chow and Liu, 1968]

Given a joint PDF  $P(x)$ , the KL-divergence  $D(P, P')$  is minimized by projecting  $P(x)$  on a *maximum-weight spanning tree (MSWT)* over nodes in  $X$ , where the weight on the edge  $(X_i, X_j)$  is defined by the mutual information measure

$$I(X_i; X_j) = \sum_{x_i, x_j} P(x_i, x_j) \log \frac{P(x_i, x_j)}{P(x_i)P(x_j)}$$

# 最大权生成树MSWT的建立过程

- 对于分布 $P(x)$ , 对于所有的 $i \neq j$ , 计算联合分布 $P(X_i|Y_j)$ ;
- 使用第1步得到的概率分布, 计算任意两个结点的互信息 $I(X_i, Y_j)$ , 并把 $I(X_i, Y_j)$ 作为这两个结点连接边的权值;
- 计算最大权生成树(Maximum-weight spanning tree)
  - a. 初始状态:  $n$ 个变量(结点),  $0$ 条边
  - b. 插入最大权重的边
  - c. 找到下一个最大的边, 并且加入到树中; 要求加入后, 没有环生成。否则, 查找次大的边;
  - d. 重复上述过程c过程直到插入了 $n-1$ 条边(树建立完成)
- 选择任意结点作为根, 从根到叶子标识边的方向;
- 该生成树的近似联合概率 $P'(x)$ 和原贝叶斯网络的联合概率 $P(x)$ 的相对熵最小。

# 附：Chow-Liu算法

1. From the given distribution  $P(x)$  (or from data generated by  $P(x)$ ), compute the joint distribution  $P(x_i | x_j)$  for all  $i \neq j$
2. Using the pairwise distributions from step 1, compute the mutual information  $I(X_i; X_j)$  for each pair of nodes and assign it as the weight to the corresponding edge  $(X_i, X_j)$ .
3. Compute the maximum-weight spanning tree (MSWT):
  - a. Start from the empty tree over  $n$  variables
  - b. Insert the two largest-weight edges
  - c. Find the next largest-weight edge and add it to the tree if no cycle is formed; otherwise, discard the edge and repeat this step.
  - d. Repeat step (c) until  $n-1$  edges have been selected (a tree is constructed).
4. Select an arbitrary root node, and direct the edges outwards from the root.
5. Tree approximation  $P'(x)$  can be computed as a projection of  $P(x)$  on the resulting directed tree (using the product-form of  $P'(x)$ ).

# 参考文献

---

- M. Jordan, J. Kleinberg, ect. *Pattern Recognition and Machine Learning, Chapter 8*. 2006
- Irina Rish. *A Tutorial on Inference and Learning in Bayesian Networks*
- David Heckerman. *A Tutorial on Learning With Bayesian Networks* 1996
- Hans-Andrea Loeliger. *An Introduction to Factor Graphs*, MLSB 2008
- Frank R. Kschischang, Brendan J.Frey, ect. *Factor graph and sum-product algorithm*. 1998
- [http://www.eng.yale.edu/pjk/eesrproj\\_02/luckenbill\\_html/node4.html](http://www.eng.yale.edu/pjk/eesrproj_02/luckenbill_html/node4.html)(sum-product)



graphviz has no attribute 'write'

邹博 回复了问题 · 2 人关注 · 1 个回复 · 3 次浏览 · 2017-04-09 15:48

贡献



sklearn中如何理解Pipeline机制

数据分析与数据挖掘 邹博 回复了问题 · 2 人关注 · 1 个回复 · 28 次浏览 · 2017-04-09 15:39

贡献



关于9.Logistic回归的ppt中第9页的对数线性函数

机器学习 邹博 回复了问题 · 3 人关注 · 3 个回复 · 39 次浏览 · 2017-04-09 15:35

贡献



关于“贝叶斯估计中，最大后验概率估计就是结构化风险最小化的例子：当模型是条件概率分布，损失函数为对数损失函数，模型的复杂度由模型的先验概率表示，结构风险最小化就等价于最大后验概率估计”

机器学习 邹博 回复了问题 · 2 人关注 · 1 个回复 · 26 次浏览 · 2017-04-09 15:27

贡献



关于连续值的预测

咨询 邹博 回复了问题 · 2 人关注 · 1 个回复 · 31 次浏览 · 2017-04-09 15:24

贡献



拉格朗日对偶函数为什么一定是凸函数

数据科学 邹博 回复了问题 · 2 人关注 · 2 个回复 · 26 次浏览 · 2017-04-09 15:20

贡献



梯度下降公式中的斯堪J是

机器学习 邹博 回复了问题 · 2 人关注 · 1 个回复 · 29 次浏览 · 2017-04-09 15:17

贡献



深度学习适合做预测吗？

深度学习 邹博 回复了问题 · 2 人关注 · 1 个回复 · 27 次浏览 · 2017-04-09 15:15

贡献



关于6.4PCA\_FeatureSelection.py中plt.legend的参数疑问

机器学习 邹博 回复了问题 · 2 人关注 · 1 个回复 · 28 次浏览 · 2017-04-09 15:04

贡献



@邹博 有哪些可以下载数据源的网站？

数据分析与数据挖掘 邹博 回复了问题 · 4 人关注 · 1 个回复 · 31 次浏览 · 2017-04-09 14:53

贡献



LDA主题模型

机器学习 邹博 回复了问题 · 2 人关注 · 1 个回复 · 29 次浏览 · 2017-04-09 14:45

贡献



代码10.6bagging\_ridged老师提到了采样率设为0.2能够使峰值部分的数据被体现出来。这是为什么呢？

机器学习 邹博 回复了问题 · 2 人关注 · 1 个回复 · 22 次浏览 · 2017-04-09 14:26

贡献



GraphViz's executables not found

机器学习 邹博 回复了问题 · 3 人关注 · 2 个回复 · 23 次浏览 · 2017-04-09 13:47

贡献



决策树中关于feature\_importances代码的问题

机器学习 邹博 回复了问题 · 2 人关注 · 1 个回复 · 6 次浏览 · 2017-04-09 13:11

贡献



招聘求职

大数据行业应用

数据科学

系统与编程

云计算技术

热门话题

更多 &gt;



机器学习

907 个问题, 230 人关注



spark

387 个问题, 172 人关注



hadoop

1059 个问题, 155 人关注



python数据分析

171 个问题, 28 人关注



数据分析与数据挖掘

54 个问题, 111 人关注

热门用户

更多 &gt;



小心巴

14 个问题, 0 次赞同



又又V

45 个问题, 22 次赞同



铁甲无声

10 个问题, 0 次赞同



带刀锦衣卫

13 个问题, 0 次赞同

# 我们在这里

□ <http://wenda.ChinaHadoop.cn>

■ 视频/课程/社区

□ 微博

■ @ChinaHadoop

■ @邹博\_机器学习

□ 微信公众号

■ 小象学院

■ 大数据分析挖掘

---

感谢大家！

恳请大家批评指正！