パターン認識
2014 年 12 月 10 日
更新 2014 年 12 月 12 日

レポート課題 2: 混合ガウスモデルの最尤推定

提出締切 1 月 7 日（水）10:30．提出先：A-333

目的： ある未知の確率分布 $p(x)$ にしたがい生成されたデータ $x_1, x_2, \cdots, x_n$ が観測されている．$p(x)$ を知りたい．$p(x)$ を m 個のガウス関数の重み付きの和で表現した場合，この近似はどのくらい有効だろうか．`for` 文を使わない `octave` のプログラミングも経験しよう．

基礎知識（教科書第 8 章，pp.105-118）

$x_i \sim p(x)$ とする．x は画像など多次元ベクトルでもよいが，ここでは簡単のため 1 次元の場合を考える．$p(x)$ を複数のガウス関数 $\phi(x; \mu, \sigma^2)$ の重み付きの和

$$q(x; \boldsymbol{\theta}) \quad = \quad \sum_{l=1}^{m} w_l \phi(x; \mu_l, \sigma_l^2) \tag{1}$$

で近似して表現することを試みる．これを混合ガウスモデルという．もちろん

$$\phi(x; \mu_l, \sigma_l^2) = \frac{1}{\sqrt{2\pi}\sigma_l} \mathrm{e}^{-\frac{(x-\mu_l)^2}{2\sigma_l^2}}$$

である．それにはパラメータ

$$\boldsymbol{\theta} = (\mu_1, \cdots, \mu_m, \sigma_1, \cdots, \sigma_m, w_1, \cdots, w_m), \ \sum_{l=1}^{m} w_l = 1$$

について，尤度を最大にする最尤推定値

$$\boldsymbol{\theta}^* \quad = \quad \operatorname*{argmax}_{\boldsymbol{\theta}} \prod_{i=1}^{n} q(x_i; \boldsymbol{\theta}) = \operatorname*{argmax}_{\boldsymbol{\theta}} \sum_{i=1}^{n} \log q(x_i; \boldsymbol{\theta}) \tag{2}$$

を求めればよい．この $\boldsymbol{\theta}^*$ を求める次の手順が知られている（詳細は教科書を参照）．

EM アルゴリズム

1. w_l, μ_l, σ_l の値として，適当な初期値を設定（$l = 1, \cdots, m, \ \sum_{l=1}^{m} w_l = 1, w_l \geqq 0$）．
2. $\eta_{i,l} := \dfrac{w_l \phi(x_i; \mu_l, \sigma_l^2)}{\sum_{l'=1}^{m} w_{l'} \phi(x_i; \mu_{l'}, \sigma_{l'}^2)}$ を計算（$i = 1, \cdots, n, \ l = 1, \cdots, m$）．
3. $w_l := \dfrac{1}{n} \sum_{i=1}^{n} \eta_{i,l}$, $\mu_l := \dfrac{\sum_{i=1}^{n} \eta_{i,l} x_i}{\sum_{i'=1}^{n} \eta_{i',l}}$, $\sigma_l := \sqrt{\dfrac{\sum_{i=1}^{n} \eta_{i,l} (x_i - \mu_l)^2}{\sum_{i'=1}^{n} \eta_{i',l}}}$ を計算．
4. 2〜3 を尤度が収束するまで繰り返す．

octave では，for 文はもちろん使えるが計算スピードは遅くなる．できる限り for 文を使わないほうがよい（教科書 p.34）．では，どう書けばよいか．

$$\eta_{i,l} := \frac{w_l \phi(x_i; \mu_l, \sigma_l^2)}{\sum_{l'=1}^{m} w_{l'} \phi(x_i; \mu_{l'}, \sigma_{l'}^2)}$$

を計算する例を示そう．ここで，$i = 1, \cdots, n$，$l = 1, \cdots, m$ であるので，C 言語なら 2 次元配列 η[i][l] を用意し，2 重 for ループで値を順に代入するだろう．一方，octave では，変数のコピーをたくさん用意することで for 文を使わず同じことが実現できる（教科書 p.118）．

```
tmp1 = ( repmat(x, [m 1]) - repmat(mu, [1 n])).^2;
tmp2 = 2*repmat( sigma2, [1 n] );
tmp3 = repmat(w, [1 n]).*exp(-tmp1./tmp2)./sqrt(pi*tmp2);
eta = tmp3./repmat(sum(tmp3, 1), [m 1]);
```

はじめてこれを見た場合，なんのことだか分からない．そういう場合は，小さい例で具体的に考えよう．$i = 1, \cdots, n$，$l = 1, \cdots, m$ の 2 重ループを実現するため，n 個のデータをまとめた $\boldsymbol{x}$（n 次元横ベクトル）を縦方向に m 個，各ガウスモデルの平均値をまとめた $\boldsymbol{\mu}$（m 次元縦ベクトル）を横方向に n 回複製する．このようにしておくと

$$\phi(x_i; \mu_l, \sigma_l^2) = \frac{1}{\sqrt{2\pi}\sigma_l} \mathrm{e}^{-\frac{(x_i - \mu_l)^2}{2\sigma_l^2}}$$

の指数関数の肩にある分数の分子 $(x_i - \mu_l)^2$ が，$m \times n$ の各要素ごとに計算できる（$i = 1, \cdots, n$，$l = 1, \cdots, m$）．これが tmp1 で，計算結果は $m \times n$ 行列である．次に，tmp2 は指数関数の肩にある分数の分母 $2\sigma_l^2$ の計算である（$m \times n$ 行列）．あとで tmp1./tmp2 をしたいので，tmp1 と tmp2 の型は同一でなければいけない．ここで .* とか ./ は，行列の要素ごとの掛け算，割り算を意味している．あらかじめ指定しておく必要がある sigma2 は σ^2 の値，つまり標準偏差ではなく分散の値であることを確認しておこう．

tmp3 中に，sqrt(pi*tmp2) がある．この型は tmp2 と同じで $m \times n$ である．したがって exp(-tmp1./tmp2)./sqrt(pi*tmp2) は $\mathrm{e}^{-\frac{(x_i - \mu_l)^2}{2\sigma_l^2}}$ である（$m \times n$ 行列）．tmp3 の最初の項 repmat(w, [1 n]) は，w という m 次元縦ベクトルを横に n 個複製して作った $m \times n$ 行列である．これで tmp3 が $w_l \phi(x_i; \mu_l, \sigma_l^2)$ を意味していることが分かった．

eta = tmp3./repmat(sum(tmp3, 1), [m 1]) を考えよう．sum(tmp3, 1) は tmp3 の l について全部足している．1 というのは縦方向に要素を足すという意味である．足し算した結果は 1 つであるが，計算した後，結果を縦に m 個複製している．

次に，

$$w_l := \frac{1}{n}\sum_{i=1}^{n}\eta_{i,l},\ \mu_l := \frac{\sum_{i=1}^{n}\eta_{i,l}x_i}{\sum_{i'=1}^{n}\eta_{i',l}},\ \sigma_l^2 := \frac{\sum_{i=1}^{n}\eta_{i,l}(x_i-\mu_l)^2}{\sum_{i'=1}^{n}\eta_{i',l}}$$

をどのように計算しているか確認しておこう．

```
tmp4 = sum(eta, 2);
w = tmp4/n;
mu = (eta*x')./tmp4;
sigma2 = sum(tmp1.*eta, 2)./tmp4;
```

`sum(eta, 2)` の 2 は．`eta` の型が $m \times n$ であるので，横方向に（n 個を）足し込むという意味があり，$\sum_{i=1}^{n}$ に対応する．結果，`w` の型は $m \times 1$ である．`tmp1`，`tmp4` は効率的に再利用でき，`mu`，`sigma2` が計算できる．計算結果の型はすべて $m \times 1$（m 次元縦ベクトル） である．

ここまでを表にまとめておこう．くどいが $i = 1, \cdots, n$，$l = 1, \cdots, m$ である．

`tmp1`	$(x_i - \mu_i)^2$	$m \times n$
`tmp2`	$2\sigma_l^2$	$m \times n$
`tmp3`	$w_l\phi(x_i;\mu_l,\sigma_l^2)$	$m \times n$
`eta`	$\dfrac{w_l\phi(x_i;\mu_l,\sigma_l^2)}{\sum_{l'=1}^{m} w_{l'}\phi(x_i;\mu_{l'},\sigma_{l'}^2)}$	$m \times n$
`tmp4`	$\sum_{i=1}^{n}\dfrac{w_l\phi(x_i;\mu_l,\sigma_l^2)}{\sum_{l'=1}^{m} w_{l'}\phi(x_i;\mu_{l'},\sigma_{l'}^2)}$	$m \times 1$

最後に

$$L(\boldsymbol{\theta}) \quad = \quad \sum_{i=1}^{n}\log\sum_{l=1}^{m} w_l\phi(x_i;\mu_l,\sigma_l^2) \tag{3}$$

の計算を考えよう．この計算には `tmp3` が再利用できる．まず，$\sum_{l=1}^{m} w_l\phi(x_i;\mu_l,\sigma_l^2)$ は `sum(tmp3,1)` で計算できる（$1 \times n$ の横ベクトル）．この各要素を log をとり，n 項を足し算すればよいのだから．`sum(log(sum(tmp3,1)),2)` で計算できる．横方向に足しこむ意味の 2 は省略できる．

```
Lnew=sum(log(sum(tmp3,1)),2)
```

コンピュータ演習：$m = 3$ の混合ガウスモデルから．データを n 個生成する関数を作成せよ．モデルのパラメータの値を適当に指定し，具体的にデータを 1000 個生成し，ヒストグラムを描け．また，4 つの関数，$q(x;\boldsymbol{\theta}), \phi(x;\mu_l,\sigma_l^2)$ を同一グラフに描いてみよ （$l = 1,\cdots,3$）．

$w_1 = w_2 = w_3 = 1/3, \mu_1 = 1, \mu_2 = 2, \mu_3 = 3, \sigma_1 = 0.1, \sigma_2 = 0.3, \sigma_3 = 0.5$ とする．

$$q(x;\boldsymbol{\theta}) \quad = \quad \sum_{l=1}^{m} w_l \phi(x;\mu_l,\sigma_l^2)$$

からデータを 1000 個生成する例を以下に示す．

ガウス混合モデルからのデータ生成： myrand_gmm.m

```
function x = myrand_gmm(n)
x=zeros(1,n);
g=randn(1,n);
u=rand(1,n);
mu = [1.0 2.0 3.0];      % 各ガウス分布の平均値．値を変えていろいろ試す．
sigma = [0.1 0.3 0.5]; % 各分布の標準偏差．値を変えていろいろ試す．
flag=(0<=u & u<1/3); % この例は，各分布から 1/3 の確率でデータが出現する場合．
x(flag)= mu(1) + sigma(1)*g(flag);
flag=(1/3<=u & u<2/3);
x(flag)= mu(2) + sigma(2)*g(flag);
flag=(2/3<=u & u<=1);
x(flag)= mu(3) + sigma(3)*g(flag);
```

ガウス混合モデルからのデータ生成： test_gmm.m

```
clear all
n = 1000; % 標本数（サンプル数）
x = myrand_gmm(n); % データの生成（n 次元横ベクトル）
m = 3;

mu = [1.0 2.0 3.0]';
sigma = [0.1 0.3 0.5]';
sigma2 = sigma.^2;
w = ones(m, 1)/m;

xx = 0:0.01:5;
% octave v2 → v3 正規分布関連の関数の第 3 引数は，分散ではなく，標準偏差を指定
y1 = normpdf(xx, mu(1), sigma(1));
y2 = normpdf(xx, mu(2), sigma(2));
y3 = normpdf(xx, mu(3), sigma(3));
y =  y1/3 + y2/3 + y3/3;

figure(1);clf;
hist(x, 0:0.1:5, 10);
hold on
plot(xx, y, 'r-');
print -depsc2 hist800.eps   % png ファイルを出力したければ -dpng gmm800.png

figure(2);clf;
plot(xx, y1, 'r-', xx, y2, 'r-', xx, y3, 'r-', xx, y, 'b-');
print -depsc2 gmm800.eps
```

```
% octave test_gmm
```

で実行できる．もし理解できないところがあれば，octave を立ち上げた後，1 行 1 行実行し，

```
octave: > whos
```

で各変数の形を確認しながら進むとよい．

p118a.m

```
clear all
n = 5000; % 標本数（サンプル数）.
x = myrand_gmm(n); % 乱数の生成．実験に使うデータを生成する関数名に書き換える.
m = 3; % 混合数．この値を変えて実験する.

% 初期値の設定．w, mu, sigma2 は m 次元縦ベクトル.
L = -inf;
w = ones(m, 1)/m; % m 個の正規分布の重みの初期値
mu = linspace( min(x), max(x), m)'; % 平均値の初期値
sigma2 = ones(m, 1)/10; % 分散の初期値

while 1
  tmp1 = ( repmat(x, [m 1]) - repmat(mu, [1 n])).^2;
  tmp2 = 2*repmat( sigma2, [1 n] );
  tmp3 = repmat(w, [1 n]).*exp(-tmp1./tmp2)./sqrt(pi*tmp2);
  eta = tmp3./repmat(sum(tmp3, 1), [m 1]); % ここまでがηの計算
  tmp4 = sum(eta, 2);
  w = tmp4/n;
  mu = (eta*x')./tmp4;
  sigma2 = sum(tmp1.*eta, 2)./tmp4;
  Lnew = sum(log(sum(tmp3,1))); % 更新後の対数尤度 *** 教科書誤植あり
  if Lnew -L < 0.0001
    break
  end
  L = Lnew;
end

xx = 0:0.01:5;
% octave v2 → v3 正規分布関連の関数の第 3 引数は，分散ではなく，標準偏差を指定
y1 = normpdf(xx, mu(1), sqrt(sigma2(1)) );
y2 = normpdf(xx, mu(2), sqrt(sigma2(2)) );
y3 = normpdf(xx, mu(3), sqrt(sigma2(3)) );
y = y1/3 + y2/3 + y3/3;

figure(1); clf;
hist(x, 0:0.1:5,10);
print -depsc2 hist801.png % png ファイルを出力したければ -dpng hist801.png

% もとの分布が混合ガウス分布の場合，もとのパラメータを指定し比較するのがよい.
figure(2); clf;
plot(xx, y1, 'r-', xx, y2, 'r-', xx, y3, 'r-', xx, y, 'b-');
print -depsc2 gmm801.png
```

レポート課題 ：

1. $m = 2$, $w_1 = w_2 = 1/2, \mu_1 = 1, \mu_2 = 2, \sigma_1 = 0.1, \sigma_2 = 0.3$ とする．

$$q(x;\boldsymbol{\theta}) \quad = \quad \sum_{l=1}^{m} w_l \phi(x;\mu_l,\sigma_l^2)$$

からデータを1000個生成し，ヒストグラムを描け．4つの確率密度関数，$q(x;\boldsymbol{\theta}), \phi(x;\mu_l,\sigma_l^2)$ を同一グラフに描きなさい （$l = 1, 2$）．1000個のデータも同一グラフにプロットせよ．

2. $m = 3$ で μ, σ を適当な値に設定し，確率密度関数 $p(x)$ からデータを生成する関数を作れ．$m = 3$ のモデル $q(x)$ を使い，最尤推定せよ（p118.m 参照）．EM アルゴリズムの繰り返し回数が増えるにしたがい，各パラメータの値が，もとの確率分布のパラメータに近づいていく様子を示せ．

   以下の問を 2. と同様に実験し，分析・考察せよ．

3. 真の分布 $p(x)$ を $m = 5$ で作成し，$m = 3$ のモデル $q(x)$ を使い最尤推定せよ．

4. 真の分布 $p(x)$ を $m = 3$ で作成し，$m = 5$ のモデル $q(x)$ を使い最尤推定せよ．

5. 真の分布が，教科書 p.172 の `myrand(n)` で定義される分布とする．$m = 2, 3, 5$ のモデル $q(x)$ を使い最尤推定せよ．

6. （オプション） 適当な問題を作り，結果を分析せよ．

レポートの最後には，感想を記述してほしい．理解できた点，理解できない点・疑問点などを，具体的に 箇条書きしてほしい．このプリント中に理解しにくい点があった場合は，何ページ何行目の，どこの部分が分かりにくかったか，具体的に，指摘してほしい．

注意事項：

1. この文章中には記述ミスがあるかもしれない．その場合は以下のページで更新情報を伝えます．気づいた点があれば，気軽にメールで連絡して欲しい．

   `http://www.cs.miyazaki-u.ac.jp/ date/lectures/pattern/octave4pattern_Ch8.html`

2. レポートの LaTeX を使った簡単な書き方は

   `http://www.cs.miyazaki-u.ac.jp/~date/lectures/latex/latexreport.html` を参照．

3. レポートは，1年前の自分が読んでも，何を調べようとしているのか（目的），得られた結果（図）が分かるように書けていればよい（コレは簡単ではない）．

4. 独力で課題が遂行できそうにない場合は，早めに相談すること．