

ГРАФИЧЕСКИЕ МОДЕЛИ

Сергей Николенко

НИУ ВШЭ — Санкт-Петербург

08 сентября 2017 г.

Random facts:

- 8 сентября --- Международный день грамотности, установленный ООН, а также День финансиста России
- 8 сентября 1636 г. был основан Гарвардский университет

ГРАФИЧЕСКИЕ МОДЕЛИ

- В предыдущих лекциях мы рассмотрели задачу байесовского вывода, ввели понятие сопряжённого априорного распределения, поняли, что наша основная задача – найти апостериорное распределение.
- Но если всё так просто – взяли интеграл, посчитали, всё получилось – о чём же здесь целая наука?
- Проблема заключается в том, что распределения, которые нас интересуют, обычно слишком сложные (слишком много переменных, сложные связи).
- Но, с другой стороны, в них есть дополнительная структура, которую можно использовать, структура в виде независимостей и условных независимостей некоторых переменных.

- Пример: рассмотрим распределение трёх переменных и запишем его по формуле полной вероятности:

$$p(x, y, z) = p(x | y, z)p(y | z)p(z).$$

- Теперь нарисуем граф, в котором стрелки указывают, какие условные вероятности заданы.
- Пока граф полностью связанный, это нам ничего не даёт – любое распределение $p(x_1, \dots, x_n)$ так можно переписать.
- Но если некоторых связей *нет*, это даёт нам важную информацию и упрощает жизнь.

- Рассмотрим направленный ациклический граф на вершинах x_1, \dots, x_k и зададим в каждой вершине распределения $p(x_i \mid \text{pa}(x_i))$. Тогда будем говорить, что граф с этими локальными распределениями является графической моделью (байесовской сетью доверия) для совместного распределения вероятностей

$$p(x_1, \dots, x_k) = \prod_{i=1}^k p(x_i \mid \text{pa}(x_i)).$$

- Другими словами, если мы можем разложить большое совместное распределение в произведение локальных распределений, каждое из которых связывает мало переменных, это хорошо. :)

- Пример: обучение параметров распределения по нескольким экспериментам (плашки, можно нарисовать параметры явно):

$$p(x_1, \dots, x_n, \theta) = p(\theta) \prod_{i=1}^n p(x_i | \theta).$$

- Что можно сказать о (не)зависимости случайных величин x_i и x_j ?
- Задача вывода на графической модели: в некоторой части вершин значения наблюдаются, надо пересчитать распределения в других вершинах (подсчитать условные распределения). Например, из этой модели получатся и задача обучения параметров, и задача последующего предсказания.

- d -разделимость – условная независимость, выраженная в структуре графа:

- последовательная связь, $p(x, y, z) = p(x)p(y | x)p(z | y)$:

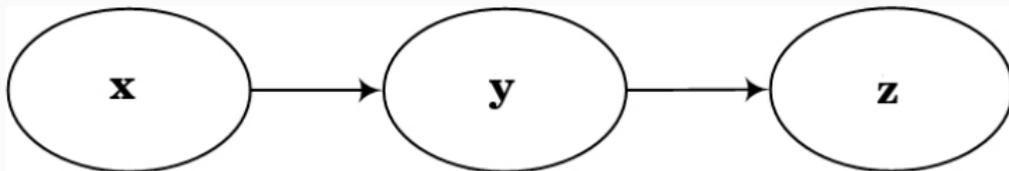
- если y не наблюдается, то

$$p(x, z) = p(x) \int p(y | x)p(z | y)dy = p(x)p(z | x);$$

- если y наблюдается, то

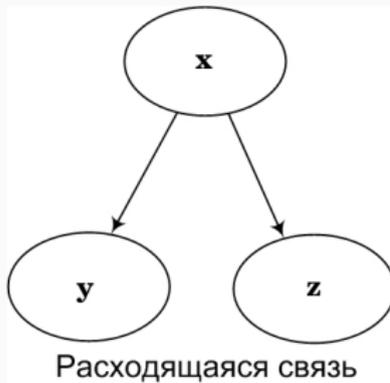
$$p(x, z | y) = \frac{p(x, y, z)}{p(y)} = \frac{p(x)p(y|x)p(z|y)}{p(y)} = p(x | y)p(z | y),$$

получили условную независимость.

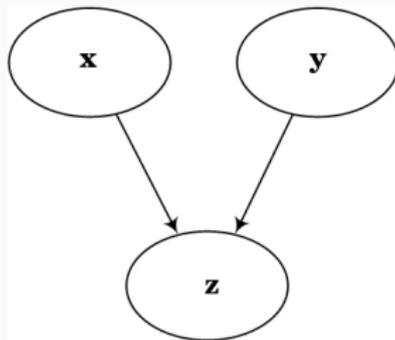


Последовательная связь

- расходящаяся связь, $p(x, y, z) = p(x)p(y | x)p(z | x)$, – так же:
 - если y не наблюдается, то
$$p(x, z) = p(x)p(z | x) \int p(y | x) dy = p(x)p(z | x);$$
 - если y наблюдается, то
$$p(x, z | y) = \frac{p(x, y, z)}{p(y)} = \frac{p(x)p(y|x)p(z|x)}{p(y)} = p(x | y)p(z | y),$$
 получили условную независимость.



- Интересный случай – сходящаяся связь, $p(x, y, z) = p(x)p(y)p(z | x, y)$:
 - если z не наблюдается, то $p(x, y) = p(x)p(y)$, независимость есть;
 - если z наблюдается, то $p(x, y | z) = \frac{p(x, y, z)}{p(z)} = \frac{p(x)p(y)p(z|x, y)}{p(z)}$, и условной независимости нету.



Сходящаяся связь

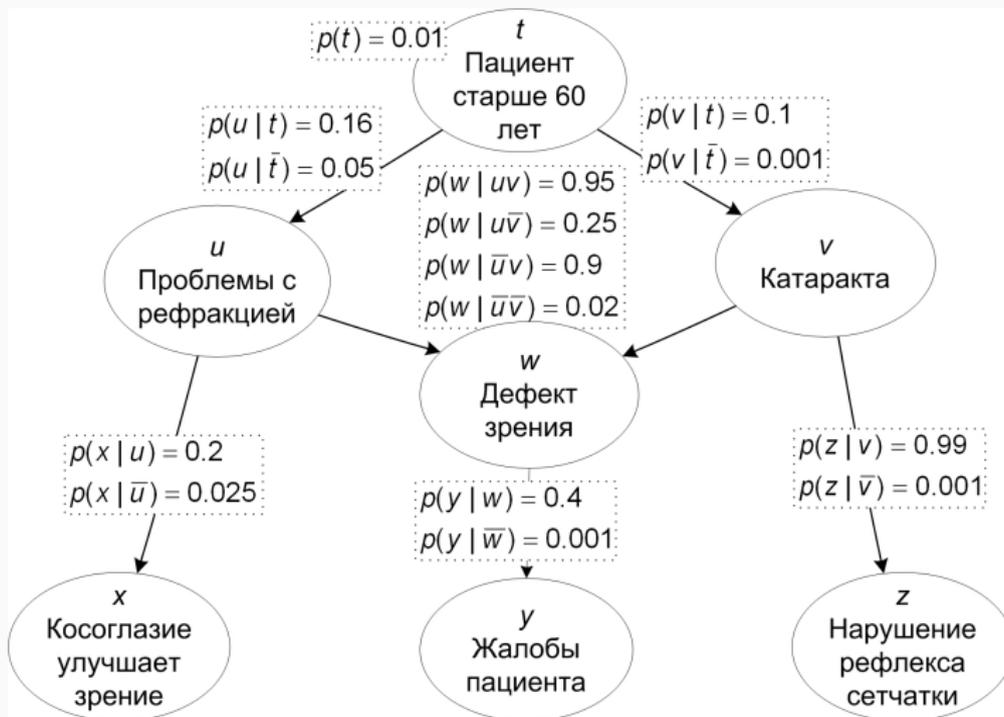
Обобщение: если наблюдается хотя бы один из потомков z , уже может не быть независимости между x и y .

- Можно сформулировать, как структура графа соотносится с условной независимостью: в графе, где вершины из множества Z получили означивания (evidence), две ещё не означенные вершины x и y условно независимы при условии множества означенных вершин Z , если любой (ненаправленный) путь между x и y :
 - либо проходит через означенную вершину $z \in Z$ с последовательной или расходящейся связью;
 - либо проходит через вершину со сходящейся связью, в которой ни она, ни её потомки не получили означиваний.

- Можно сказать, что граф задаёт некоторое семейство распределений – не все распределения на вершинах графа будут соответствовать тем ограничениям по условной независимости, которые накладывает структура графа.
- Теорема (без доказательства): это семейство распределений в точности совпадает с семейством тех распределений, которые можно разложить в произведение

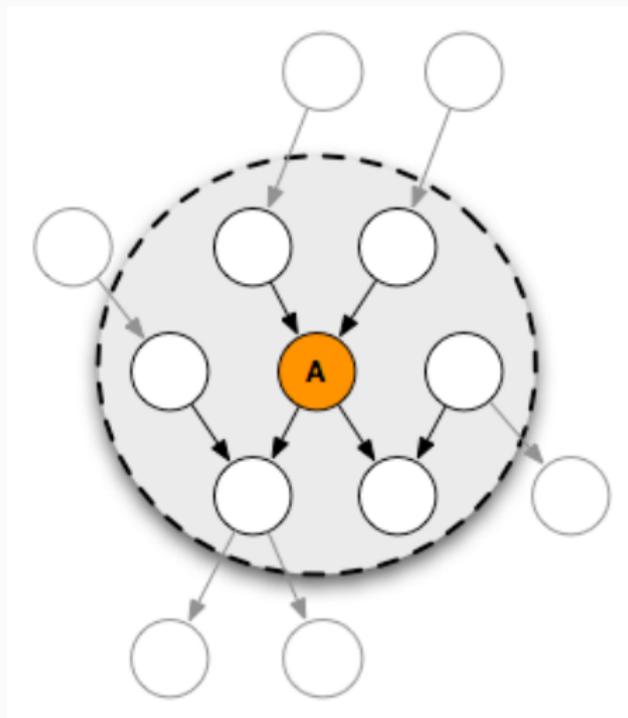
$$p(x_1, \dots, x_k) = \prod_{i=1}^k p(x_i \mid \text{pa}(x_i)).$$

ПРИМЕР БАЙЕСОВСКОЙ СЕТИ



- Интересный вопрос: какие вершины нужно означить, чтобы наверняка «отрезать» одну вершину (Markov blanket)?
- Иначе говоря, для какого минимального множества вершин X $p(x_i | x_{j \neq i}) = p(x_i | X)$?

MARKOV BLANKET



THANK YOU!

Thank you for your attention!