

# 大數據分析 (Big Data Analytics) 資訊科學系學碩 (專) 班上課大綱

2021 年秋季班

上課期間：2021/09/16 - 2021/01/13

胡毓忠

國立政治大學資訊科學系

jong at g.nccu.edu.tw

2021 年 09 月 16 日

## 摘要

「大數據分析」(Big Data Analytics) 系列課程依序為：資料科學，大數據分析，大數據分析與金融科技，及社群媒體與大數據分析。教育部 AI 應用第二期系列課程 - 人工智慧應用領域人才 - 金融科技，其主要課程則包含有：資料科學，大數據分析，深度強化學習與應用，大數據分析與金融科技。強烈建議修課同學們能夠循序漸進，修完此系列共四門課來獲得完整資料科學，大數據分析及金融科技本體與應用知識與技術。

大數據分析課程的主要目標是協助修課同學們學習並瞭解人工智慧與大數據分析基本知識與其最新發展趨勢和挑戰。我們首先將介紹人工智慧的發展與現況，更進一步說明人工智慧，大數據分析，和機器學習三者之間的關連性。接著大數據分析的真正含意以及其所運用核心知識如機器（統計）學習將深入被介紹，並且點出為何大數據分析是一門跨統計學、電腦科學及應用的整合性科學。因此我們將介紹大數據分析所需要的完整資料處理與建模流程，包括了大數據收集，清洗，資料集轉換與載入的前置作業，及資料內涵的初步檢視；接著透過資料分析與建模所需要的各種知名機器演算法將依序被介紹；最後將完成如何進行機器學習模型的訓練，驗證以及模型最佳化技術與建模後的測試準確性與完整性的檢驗，以及資料分析最後結果的解讀。

我們希望修課同學們能夠學習與瞭解人工智慧，大數據分析與機器學習的完整核心知識，透過期中與期末考試來檢驗學習成果，並配合教育部人工智慧系列課程的相連結，本課程將協助修課同學們抓取金融大數據分析所需資料集並且要求修課同學以 2-4 人為一組來進行金融科技比特幣價格時間序列的分群，分類與迴歸預測的學期群組計畫進行建模與分析，解讀。為了發揮跨領域大數據分析團對組合優勢，我們強烈建議各組需要同時含有資訊技術和非資訊技術組合成員。金融科技應用比特幣價格波動曲線分析的學期群組計畫將要求各組在政大電算中心所提供的高速計算的 GPU 私有雲來完成。

# 1 授課教師與助教資訊

- 授課教授：胡毓忠博士
- 上課時間：每週星期四上午 09：10 - 12：00（學碩班）；下午 06：30-09：30（碩專班）
- 上課地點：資訊大樓 140401（學碩班）；電算中心二樓會議室（碩專班）
- 教授辦公室：電算中心二樓主任辦公室
- 電話：02-2939-3091 校內分機：63379
- 電子郵件：jong at g.nccu.edu.tw.
- 教授諮詢時間：每週三下午 01：00-04：00 或另約時間（可透過視訊會議來進行）
- 個人網址：<http://www.cs.nccu.edu.tw/%7Ejong> (Note: ~:=%7E)
- 課程助教：黃牧天（比特幣金融科技應用）（已畢業學長）和陳彥宏（GPU/Spark/PyTorch）(碩專班二年級)
- 電話：校內分機 62066
- 電子郵件：108971007 at g.nccu.edu.tw ; u3300035 at gmail.com
- 助教諮詢時間：TBA
- 課程網址：<https://app.slack.com/client/T02DZ1UPKL1/C02DZ1UQC01>

# 2 課程目標與學習成效

這學期的「大數據分析」本進階課將會連結資科系張家銘老師的「資料科學」的核心課以及金融系林士貴老師的「大數據分析與金融科技」應用課。我們將透過期中考與期末考試檢驗修課同學們對於本課程內容的學習精熟度。為了更進一步發揮學以致用的目的，修課同學們將以 2-4 人為一組透過自由組合方式來進行學期計畫應用情境的實作。此外，為了解決大數據分析所需高效能運算，我們將要求各群組在政大電算中心提供高速運算的 GPU 私有雲平台來進行大數據資料集的建模與分析。修課同學們各組將被要求具體展示大數據分析最佳模型建置時所將面臨的資料前置處理（包含高維期度特徵值的降維與萃取）和整合，以及分析模型的學習、驗證與準確度測試所需的完整程序。各群組將以本課程所提供爬蟲程式來收集網路上影響比特幣價格波動的財經數據以及比特幣價格的大數據資料集與金融應用設定情境來進行具時間序列的價格變化波動預測與實作，並且完成最後結果的解讀與圖形展示。

我們希望各組在期中考週完成小數據資料集比特幣價格波動曲線的分群，分類，與迴歸預測和分析，並且能夠更進一步在期末考週檢驗各組在政大電算中心的私有雲 GPU 平台上 PyTorch 系統實作平台來完成相對應的完整的大數據分析，預測與結果解讀和展示。學期計畫期中口頭報告與期末口頭和書面報告內容請各組明確說明其所使用雲端平台的系統規格與分析建模時其使用演算法與執行所需要的最大計算時間與記憶體使用量，並具體產出優化後模型在質化與量化的金融應用比特幣價格預測問題的分析指標並加以解讀其含意。

強烈建議各群組利用 GitHub 軟體合作開發平台來完成群組實做計畫的需求分析與程式整合和測試，GitHub 平台使用的紀錄完整性將會列入各組在學期計畫完成後的加分依據。建議各組選擇 Python 電腦程式語言來完成群組計畫。本課程將運用 Slack 社群協同合作軟體來進行課程的資訊分享及老師，助教和修課同學們的互動。Slack 上同學們活動記錄以及上課的表現與出席率將當作個人學期平時成績評分的主要依據。

### 3 課程大綱

#### 1. 日期：09/16

- 課程主題：AI 與資料科學和大數據分析導論
  - 從 AI 到大數據分析
  - Slack 社群軟體
  - 學期群組計畫比特幣金融科技應用群組實作計畫的說明
- 指定閱讀與學習目標：  
Slack 平台分組與使用  
說明本課程和資料科學與金融科技應用課程的關連性  
討論 AI 和大數據分析的關連性與差異行  
閱讀參考書 (h) 與參考文獻 (a)

#### 2. 日期：09/23

- 課程主題：機器學習 4 大類別介紹
  - 介紹機器學習類別差異性含監督式，半監督式，非監督式與強化學習
  - 更進一步瞭解迴歸分析與分類學習的差異性
- 指定閱讀與學習目標：  
簡介機器學習各種類別以及其相互間的差異性  
閱讀參考書目 (b), Chap. 1  
參考書目 (h) 和參考文獻 (a)  
完成學期群組計畫的分組 (2-4 人)

3. 日期：09 / 30

- 課程主題：監督式學習演算法 (I)
  - Linear and Logistic Regression
  - K-Nearest Neighbors (KNN)
- 指定閱讀與學習目標：  
完成學期計畫的  
閱讀指定書目 (a) Chap. 3-4  
參考書目 (b) Chap. 5-6

4. 日期：10 / 07

- 課程主題：學期群組計畫應用背景知識介紹
  - 政大 GPU 私有雲環境的使用說明
  - 比特幣價格波動曲線的預測說明
  - 比特幣價格波動曲線的分群、分類與迴歸分析預測的介紹
- 指定閱讀與學習目標：  
課程助教協助使用系統實做開發環境  
學期群組計畫在政大 GPU 私有雲環境的操作  
PyTorch 的環境操作  
共同開發環境 GitHub 的初步認識  
學期群組計畫需求書釋放

5. 日期：10/14

- 課程主題：監督式學習演算法 (II)
  - Decision Trees
  - Ensemble Learners:
    - Bagging
    - Random Forests
- 指定閱讀與學習目標：  
閱讀指定書目 (a), Chap. 8  
指定書目 (b), Chap. 3  
參考書目 (b) Chap. 14  
學習 Decision Trees 和 Random Forests 演算法

6. 日期：10/21

- 課程主題：監督式學習演算法 (III)
  - Boosting (Adaboost, Gradient Boost)
  - Classification Trees vs. Regression Trees
- 指定閱讀與學習目標：
  - 閱讀指定書目 (a), Chap. 8
  - 指定書目 (b), Chap. 3
  - 參考書目 (b) Chap. 14
  - 學習 Ensemble Learners 演算法

7. 日期：10/28

- 課程主題：機器學習模型建置與評量 (I)
  - Offline Training and Cross-Validation (CV)
  - Online Testing and Bias-Variance Trade-Off
  - Resampling and Bootstrapping
  - Linear Model Selection and Regularization
  - Feature Engineering and Seltion
- 指定閱讀與學習目標：
  - 閱讀指定書目 (a), Chap. 5-6
  - 瞭解大數據分析完整流程及學習模型的優化技巧
  - 課程助教協助使用政大電算中心私有雲端環境平台的操作
  - Scikit-Learn 和 PyTorch 的比較與其函式庫呼叫練習
  - 參考書目 (b), Chap. 9-11

8. 日期：11/04

- 課程主題：機器學習模型建置與評量 (II)
  - ROC/AUC 二元/多元分類曲線圖
  - 迴歸分析的 Mean-Square Error (MSE) 指標
  - 模型參數與超級參數的調整
  - 自動化機器學習 (AutoML)
- 指定閱讀與學習目標：
  - 閱讀參考書目 (b), Chap. 7; 參考文獻 (b-c)
  - 瞭解大數據分析完整流程及學習模型優化技巧
  - Scikit-Learn 和 PyTorch 函式庫呼叫的案例實習

9. 日期：11/11

- 課程主題：期中考週及學期群組計畫小數據資料集檢驗
  - 進行課堂 90 分鐘開放式期中考試
  - 進行小數據比特幣價格曲線預測應用資料集分析的評量
  - 各組分別上台報告學期群組計畫的實作現況與老師評量與回饋

10. 日期：11/18

- 課程主題：MAP/MLE 和 Naïve Bayes
  - 機率與條件機率的複習
  - Bayes 和 Naïve Bayes
  - $\text{MAP} = \text{MLE} \times \text{Prior}$
  - Generative vs. Discriminate 分類器比較
- 指定閱讀與學習目標：  
閱讀指定書目 (b) 投影片  
瞭解以 Bayes 定理為導向的 Naïve Bayes 簡式分類器  
和 Logistic Regression 分類器的差異；

11. 日期：11/25

- 課程主題：Bayesian Networks
  - 如何訓練 Bayes Nets 與推論
  - 以 Bayes Nets 來表示 Naïve Bayes 和 Hidden Markov 模型
  - D-Separation and Markov Blanket
- 指定閱讀與學習目標：  
閱讀指定書目 (b) 投影片  
瞭解以 Bayes Nets 分類器模型的建置技巧與推論

12. 日期：12/02

- 課程主題：半監督式與非監督式分群學習
  - Expectation Maximization (EM) 演算法
  - K-Means and Hierarchical Clustering
  - Principal Components Analysis (PCM)
  - Dimension Reduction

- 指定閱讀與學習目標：  
閱讀指定書目 (b) 投影片  
參考書目 (b) Chap. 8  
瞭解如何運用半監督式 EM 演算法來進行分類  
如何透過特徵值降維；分群和分類的差異性

13. 日期：12/09

- 課程主題：Support Vector Machine (SVM) and Kernel Methods
  - SVM Primal and Dual Forms
  - Kernel Functions
  - Kernel SVM
- 指定閱讀與學習目標：  
閱讀指定書目 (a) Chap. 9 指定書目 (b) 投影片  
瞭解如何建置 (Kernel) SVM 分類器  
參考書目 (b) Chap. 6,12  
比特幣價格曲線預測大數據資料集的使用

14. 日期：12/16

- 課程主題：Artificial Neural Nets (ANNs) 傳統類神經網路
  - ANNs
  - Multilayer Neural Nets
  - Backpropagation
  - Gradient Descent Optimization
  - MAP/MLE Training for ANN
- 指定閱讀與學習目標：  
閱讀指定書目 (b) Chap. 4 與其投影片  
瞭解如何建置與優化 ANNs 分類器  
參考書目 (b), Chap. 13

15. 日期：12/23

- 課程主題：深度學習 (Deep Learning) 介紹 (I)
  - ANNs vs. Deep Neural Nets
  - Deep Convolutional Neural Nets (CNNs)

- 指定閱讀與學習目標：  
閱讀深度學習參考文獻 (e) 與相關影片  
參考書目 (b), Chap.

16. 日期：12/30

- 課程主題：深度學習 (Deep Learning) 介紹 (II)
  - Deep Recurrent Neural Nets
  - Backpropagation with Time
  - LSTM, GRU, LSTNet, etc
- 指定閱讀與學習目標：  
閱讀深度學習參考文獻 (e) 與相關影片  
PyTorch 系統使用操作與比特幣價格曲線預測的案例

17. 日期：01/06

- 課程主題：探討各種時間序列演算法應用到比特幣價格波動曲線的分析
  - 價格波動曲線的分群
  - 價格波動曲線的分類
  - 價格波動曲線的迴歸預測
- 指定閱讀與學習目標：  
閱讀強化學習參考書目  
文獻與收播影片

18. 日期：01/13

- 課程主題：
  - Take-Home 48 hours 期末考
  - 群組學期計畫分組口頭成果報告
- 指定閱讀與學習目標：  
完成 48 小時 Take-Home 期末考  
在預定期限內繳交 8-12 頁學期群組計畫的成果報告書  
完成學期總成績計算



## 4 指定書目與參考書目 (文獻)

### 1. 指定書目 (含作者提供投影片語與視訊) :

- (a) An Introduction to Statistical Learning with Application in R, G. James, D. Witten, T. Hastie, R. Tibshirani, Springer, 2014.  
<http://www-bcf.usc.edu/%7Egareth/ISL/>
- (b) Machine Learning, Tom M. Mitchell, McGraw-Hill, 1997  
<http://www.cs.cmu.edu/%7Etom/mlbook.html>

### 2. 參考書目 :

- (a) Practical Time Series Analysis - Prediction with Statistics & Machine Learning, Aileen Nielsen, O'Reilly, 2019.
- (b) Machine Learning Refined - Foundations, Algorithms, and Applications by Watt, J., Borhani, R., Katsaggelos, A. K., 1st Ed., Cambridge Univ. Press, 2020.
- (c) Mathematics for Machine Learning by Deisenroth, M. P., Faisal, A. A., Cheng, S. O., Cambridge Univ. Press, 2020.
- (d) Data Science for Business by Provost, F. and Fawcett, T., O'Reilly Media, July, 2013.
- (e) Data Science from Scratch by Grus, J., O'Reilly Media, July, 2015.
- (f) Mastering Feature Engineering: Principles and Techniques for Data Scientists by Zheng, A., O'Reilly Media, 2017.
- (g) The Book of Why: The New Science of Cause and Effect by Pearl, J. and Mackenzie, D., Basic Books, New York, 2018.
- (h) Architects of Intelligence: The truth about AI from the people building it by Ford, M., Packt>, 2018.

### 3. 參考文獻

- (a) Big Data Taxonomy, Cloud Security Alliance (CSA), Technical Report, 2014.
- (b) Fawcett, T., An introduction to ROC analysis, Pattern Recognition Letters 27, 2006.
- (c) Zheng, A., Evaluating machine learning models: a beginner's guide to key concepts and pitfalls, O'Reilly Media, Sep., 2015.
- (d) Shmueli, G., To Explain or to Predict? Statistical Science, 25(3), 2010.
- (e) LeCun, Y., Y. Bengio, and G. Hinton, Deep Learning, Nature, 521(28), 2015.

## 5 注意事項

本學期上課的期間為 2020/09/16- 2021/01/13，共計有 18 次的上課，在這期間我們將進行 2 次的考試，分別為 11/11 的期中考和 01/13 的期末考以評量各位基礎知識學習狀況，兩次考試將分別各佔這學期總成績的 25%，合計總成績 50%。期中考試將採隨堂 90 分鐘開放式考試，期末考試則採取 48 小時回家考試 (Take-Home) 型態。兩次考試同學們可以參考任何書籍，筆記和資料以及透過電腦上網查詢。但是兩次考試都必須自己獨自完成，不能夠和其他人討論與諮詢。當老師閱卷發現有任何可能欺騙行為時，經過驗證如果屬實將逕行送往校方處理。

## 6 評分標準

- 10% 上課表現 (含出缺與上課時與在 Slack 平台上的討論)
- 40% 學期群組計畫 (含期中與期末口頭和書面報告)
- 25% 期中考試
- 25% 期末考試