

『異常検知と変化検知』（講談社）
初版第4刷の正誤表

井手剛（IBM T. J. ワトソン研究所）
杉山将（東京大学）

December 26, 2019

Chapter 1

異常検知・変化検知の基本的な考え方

現時点で判明している誤植はありません。

Chapter 2

ホテリングの T^2 法による異常検知

現時点で判明している誤植はありません。

Chapter 3

単純ベイズ法による異常検知

現時点で判明している誤植はありません。

Chapter 4

近傍法による異常検知

現時点で判明している誤植はありません。

Chapter 5

混合分布モデルによる逐次更新型異常検知

- p.63、アルゴリズム5.1。2つあるステップの順序を逆にした方が自然なのでそうします。保國恵様のご指摘に感謝いたします。

誤 : ● パラメータ推定. 各時刻 t において標本 \mathbf{x} を観測するたびに次の計算を行う.

- ・ 現在のパラメータ推定値を用いて \mathbf{x} の帰属度 q_k を次式で求める.

$$q_k = \frac{\pi_k \mathcal{N}(\mathbf{x}|\boldsymbol{\mu}_k, \boldsymbol{\Sigma}_k)}{\sum_{l=1}^K \pi_l \mathcal{N}(\mathbf{x}|\boldsymbol{\mu}_l, \boldsymbol{\Sigma}_l)}$$

- ・ $\{\tilde{\pi}_k, \tilde{\boldsymbol{\mu}}_k, \tilde{\boldsymbol{\Sigma}}_k\}$ を次式で更新する.

$$\begin{aligned}\tilde{\pi}_k &\leftarrow (1 - \beta)\tilde{\pi}_k + \beta q_k \\ \tilde{\boldsymbol{\mu}}_k &\leftarrow (1 - \beta)\tilde{\boldsymbol{\mu}}_k + \beta q_k \mathbf{x} \\ \tilde{\boldsymbol{\Sigma}}_k &\leftarrow (1 - \beta)\tilde{\boldsymbol{\Sigma}}_k + \beta q_k \mathbf{x} \mathbf{x}^\top\end{aligned}$$

モデルのパラメータ $\{\pi_k, \boldsymbol{\mu}_k, \boldsymbol{\Sigma}_k\}$ を次式で求める.

$$\pi_k = \frac{\tilde{\pi}_k + \gamma}{K\gamma + \sum_{l=1}^K \tilde{\pi}_l}, \quad \boldsymbol{\mu}_k = \frac{\tilde{\boldsymbol{\mu}}_k}{\tilde{\pi}_k}, \quad \boldsymbol{\Sigma}_k = \frac{\tilde{\boldsymbol{\Sigma}}_k}{\tilde{\pi}_k} - \boldsymbol{\mu}_k \boldsymbol{\mu}_k^\top$$

正 : ● パラメータ推定. 各時刻 t において標本 \mathbf{x} を観測するたびに次の計算を行う.

- ・ $\{\tilde{\pi}_k, \tilde{\boldsymbol{\mu}}_k, \tilde{\boldsymbol{\Sigma}}_k\}$ を次式で更新する.

$$\begin{aligned}\tilde{\pi}_k &\leftarrow (1 - \beta)\tilde{\pi}_k + \beta q_k \\ \tilde{\boldsymbol{\mu}}_k &\leftarrow (1 - \beta)\tilde{\boldsymbol{\mu}}_k + \beta q_k \mathbf{x} \\ \tilde{\boldsymbol{\Sigma}}_k &\leftarrow (1 - \beta)\tilde{\boldsymbol{\Sigma}}_k + \beta q_k \mathbf{x} \mathbf{x}^\top\end{aligned}$$

- ・ モデルのパラメータ $\{\pi_k, \boldsymbol{\mu}_k, \boldsymbol{\Sigma}_k\}$ を次式で求める.

$$\pi_k = \frac{\tilde{\pi}_k + \gamma}{K\gamma + \sum_{l=1}^K \tilde{\pi}_l}, \quad \boldsymbol{\mu}_k = \frac{\tilde{\boldsymbol{\mu}}_k}{\tilde{\pi}_k}, \quad \boldsymbol{\Sigma}_k = \frac{\tilde{\boldsymbol{\Sigma}}_k}{\tilde{\pi}_k} - \boldsymbol{\mu}_k \boldsymbol{\mu}_k^\top$$

- ・ 現在のパラメータ推定値を用いて \mathbf{x} の帰属度 q_k を次式で求める.

$$q_k = \frac{\pi_k \mathcal{N}(\mathbf{x} | \boldsymbol{\mu}_k, \boldsymbol{\Sigma}_k)}{\sum_{l=1}^K \pi_l \mathcal{N}(\mathbf{x} | \boldsymbol{\mu}_l, \boldsymbol{\Sigma}_l)}$$

- p.63、アルゴリズム5.1。前項の変更に伴い、チルダ（ \sim ）付きの量を初期化します。保國恵様のご指摘に感謝いたします。

- 誤： ● 初期化。混合正規分布モデルのパラメータ

$$\Theta = \{\pi_1, \dots, \pi_K, \boldsymbol{\mu}_1, \dots, \boldsymbol{\mu}_K, \boldsymbol{\Sigma}_1, \dots, \boldsymbol{\Sigma}_K\}$$

に適当な初期値を設定する。

- 正： ● 初期化。パラメータ $\{\tilde{\pi}_1, \dots, \tilde{\pi}_K, \tilde{\boldsymbol{\mu}}_1, \dots, \tilde{\boldsymbol{\mu}}_K, \tilde{\boldsymbol{\Sigma}}_1, \dots, \tilde{\boldsymbol{\Sigma}}_K\}$ に適当な初期値を設定する。また $q_1 = \dots = q_K = \frac{1}{K}$ と初期化しておく。

- p.64、最後の式。保國恵様のご指摘に感謝いたします。

- 誤： $\tilde{\boldsymbol{\Sigma}}_k^{(t)} = (1 - \beta)\tilde{\boldsymbol{\Sigma}}_k^{(t)} + \beta q_k^{(t)} \mathbf{x}^{(t)} \mathbf{x}^{(t)\top}$

- 正： $\tilde{\boldsymbol{\Sigma}}_k^{(t)} = (1 - \beta)\tilde{\boldsymbol{\Sigma}}_k^{(t-1)} + \beta q_k^{(t)} \mathbf{x}^{(t)} \mathbf{x}^{(t)\top}$

Chapter 6

サポートベクトルデータ記述 法による異常検知

現時点で判明している誤植はありません。

Chapter 7

方向データの異常検知

現時点で判明している誤植はありません。

Chapter 8

ガウス過程回帰による異常検知

- p.100、式(8.37)の上。右辺の $f(\mathbf{x})$ の f はボールドではなくて、左辺と同じ普通の f （元原稿では正しいが手元の本ではボールドに見えるので一応）。
 - 誤： $p(f(\mathbf{x}) | \mathbf{f}_N) = \mathcal{N}(f(\mathbf{x}) | \mathbf{k}^\top \mathbf{K}^{-1} \mathbf{f}_N, K_0 - \mathbf{k}^\top \mathbf{K}^{-1} \mathbf{k})$
 - 正： $p(f(\mathbf{x}) | \mathbf{f}_N) = \mathcal{N}(f(\mathbf{x}) | \mathbf{k}^\top \mathbf{K}^{-1} \mathbf{f}_N, K_0 - \mathbf{k}^\top \mathbf{K}^{-1} \mathbf{k})$
- p.103、式(8.37)の上。
 - 誤：尤度(8.7)および事前分布(8.4)を使うことにより
 - 正：尤度(8.7)および事前分布(8.5)を使うことにより

Chapter 9

部分空間法による変化検知

- p.111、式(9.4)、第2項の符号。上振れでも下振れでも、対数尤度比が正なら「変化後のモデルの方がより確からしい」ということなので、異常度は加算されねばなりません。山路貴司様のご教示に感謝いたします。

– 誤： $a_-^{(t)} \equiv [a_-^{(t-1)} - a(\xi^{(t)})]_+$

– 正： $a_-^{(t)} \equiv [a_-^{(t-1)} + a(\xi^{(t)})]_+$

Chapter 10

疎構造学習による異常検知

- p.133、式(10.7)。マイナスが抜けていました。

– 誤 :

$$r^{i,j} \equiv \frac{\Lambda_{i,j}}{\sqrt{\Lambda_{i,i}\Lambda_{j,j}}}$$

– 正 :

$$r^{i,j} \equiv -\frac{\Lambda_{i,j}}{\sqrt{\Lambda_{i,i}\Lambda_{j,j}}}$$

Chapter 11

密度比推定による異常検知

現時点で判明している誤植はありません。

Chapter 12

密度比推定による変化検知

現時点で判明している誤植はありません。