

Machine learning

L. Rouvière

laurent.rouviere@univ-rennes2.fr

Mai 2021

Présentation

- **Objectifs** : comprendre les aspects **théoriques** et **pratiques** des algorithmes machine learning de référence.
- **Pré-requis** : théorie des probabilités, modélisation statistique, régression (linéaire et logistique). R, niveau avancé.
- **Enseignant** : Laurent Rouvière laurent.rouviere@univ-rennes2.fr
 - **Recherche** : statistique non paramétrique, apprentissage statistique
 - **Enseignements** : statistique et probabilités (Université, école d'ingénieur et de commerce, formation continue).
 - **Consulting** : énergie, finance, marketing, sport.

- **Matériel** :
 - slides : https://lrouviere.github.io/machine_learning/
 - Tutoriel long : https://lrouviere.github.io/TUTO_ML/
 - Tutoriel court : https://lrouviere.github.io/machine_learning/tuto_court_ml_sans_correc.html
- **4 parties** :
 1. **Machine Learning** : cadre, objectif, risque...
 2. **Algorithmes linéaires** : MCO, régularisation (ridge, lasso), SVM
 3. **Algorithmes linéaires** : arbres et réseaux de neurones
 4. **Agrégation** : forêts aléatoires et boosting

Objectifs/questions

- **Buzzword** : machine learning, big data, data mining, intelligence artificielle...
- **Machine learning** versus **statistique** (traditionnelle)
- **Risque** \implies calcul ou estimation : ré-échantillonnage, validation croisée...
- Algorithmes versus estimateurs...
- **Classification** des algorithmes. Tous équivalents? Cadre propice...
- ...

Première partie I

Apprentissage : contexte et formalisation

Motivations

Quelques exemples

Cadre statistique pour l'apprentissage supervisé

Exemples de fonction de perte

Estimation du risque

Le sur-apprentissage

Le package tidymodels

Annexe : le package caret

Bibliographie

Motivations

Quelques exemples

Cadre statistique pour l'apprentissage supervisé

Exemples de fonction de perte

Estimation du risque

Le sur-apprentissage

Le package tidymodels

Annexe : le package caret

Bibliographie

Apprentissage statistique ?

Plusieurs "définitions"

1. "... explores way of **estimating functional dependency** from a given collection of data" [Vapnik, 2000].
2. "...vast set of tools for modelling and understanding **complex data**" [James et al., 2015]

Apprentissage statistique ?

Plusieurs "définitions"

1. "... explores way of **estimating functional dependency** from a given collection of data" [Vapnik, 2000].
2. "...vast set of tools for modelling and understanding **complex data**" [James et al., 2015]

Wikipedia

L'**apprentissage automatique** (en anglais : machine learning), **apprentissage artificiel** ou **apprentissage statistique** est un champ d'étude de l'**intelligence artificielle** qui se fonde sur des approches **mathématiques et statistiques** pour donner aux **ordinateurs** la capacité d'apprendre à partir de donnée...

Apprentissage statistique ?

Plusieurs "définitions"

1. "... explores way of **estimating functional dependency** from a given collection of data" [Vapnik, 2000].
2. "...vast set of tools for modelling and understanding **complex data**" [James et al., 2015]

Wikipedia

L'**apprentissage automatique** (en anglais : machine learning), **apprentissage artificiel** ou **apprentissage statistique** est un champ d'étude de l'**intelligence artificielle** qui se fonde sur des approches **mathématiques et statistiques** pour donner aux **ordinateurs** la capacité d'apprendre à partir de donnée...

⇒ **Interface** : Mathématiques-statistiques/informatique.

Constat

- Le **développement des moyens informatiques** fait que l'on est confronté à des données de plus en plus **complexes**.
- Les méthodes **traditionnelles** se révèlent souvent **peu efficaces** face à ce type de données.
- Nécessité de proposer des **algorithmes/modèles statistiques** qui apprennent directement à partir des données.

Un peu d'histoire - voir [Besse, 2018]

Période	Mémoire	Ordre de grandeur
1940-70	Octet	$n = 30, p \leq 10$
1970	kO	$n = 500, p \leq 10$
1980	MO	Machine Learning
1990	GO	Data-Mining
2000	TO	$p > n$, apprentissage statistique
2010	PO	n explose, cloud, cluster...
2013	serveurs	Big data
2017	??	Intelligence artificielle...

Un peu d'histoire - voir [Besse, 2018]

Période	Mémoire	Ordre de grandeur
1940-70	Octet	$n = 30, p \leq 10$
1970	kO	$n = 500, p \leq 10$
1980	MO	Machine Learning
1990	GO	Data-Mining
2000	TO	$p > n$, apprentissage statistique
2010	PO	n explose, cloud, cluster...
2013	serveurs	Big data
2017	??	Intelligence artificielle...

Conclusion

Capacités informatiques \implies Data Mining \implies Apprentissage statistique
 \implies Big Data \implies Intelligence artificielle...

Objectif \implies expliquer

- notion de **modèle** ;
- retrouver des lois de probabilités ;
- décisions prises à l'aide de **tests statistiques, intervalles de confiance**.

Approche statistique

Objectif \implies expliquer

- notion de **modèle** ;
- retrouver des lois de probabilités ;
- décisions prises à l'aide de **tests statistiques, intervalles de confiance**.

Exemples

- Tests indépendance/adéquation...
- Modèle linéaire : estimation, sélection de variables, analyse des résidus...
- Régression logistique...
- Séries temporelles...

Objectif \implies prédire

- notion d'**algorithmes de prévision** ;
- critères d'**erreur de prévision** ;
- **calibration** de paramètres (tuning).

Objectif \implies prédire

- notion d'**algorithmes de prévision** ;
- critères d'**erreur de prévision** ;
- **calibration** de paramètres (tuning).

Exemples

- Algorithmes linéaires (moindres carrés, régularisation, "SVM") ;
- Arbres, réseaux de neurones ;
- **Agrégation** : boosting, bagging (forêts aléatoires) ;
- Deep learning (apprentissage profond).

Statistique vs apprentissage

- Les objectifs **diffèrent** :
 - recherche de **complexité minimale** en statistique \implies le modèle doit être **interprétable** !
 - **complexité moins importante** en machine learning \implies on veut "juste bien prédire".

Statistique vs apprentissage

- Les objectifs **diffèrent** :
 - recherche de **complexité minimale** en statistique \implies le modèle doit être **interprétable** !
 - **complexité moins importante** en machine learning \implies on veut "juste bien prédire".
- Approches néanmoins **complémentaires** :
 - bien expliquer \implies bien prédire ;
 - "Récentes" évolutions d'aide à l'**interprétation des algorithmes ML** \implies **scores d'importance** des variables...
 - Un bon algorithme doit posséder des **bonnes propriétés statistiques** (convergence, biais, variance...).

Statistique vs apprentissage

- Les objectifs **diffèrent** :
 - recherche de **complexité minimale** en statistique \implies le modèle doit être **interprétable** !
 - **complexité moins importante** en machine learning \implies on veut "juste bien prédire".
- Approches néanmoins **complémentaires** :
 - bien expliquer \implies bien prédire ;
 - "Récentes" évolutions d'aide à l'**interprétation des algorithmes ML** \implies **scores d'importance** des variables...
 - Un bon algorithme doit posséder des **bonnes propriétés statistiques** (convergence, biais, variance...).

Conclusion

Ne **pas dissocier** les deux approches.

Problématiques associées à l'apprentissage

- **Apprentissage supervisé** : prédire une sortie $y \in \mathcal{Y}$ à partir d'entrées $x \in \mathcal{X}$;
- **Apprentissage non supervisé** : établir une typologie des observations ;
- **Règles d'association** : identifier des liens entre différents produits ;
- **Systemes de recommandation** : identifier les produits susceptibles d'intéresser des consommateurs.

Problématiques associées à l'apprentissage

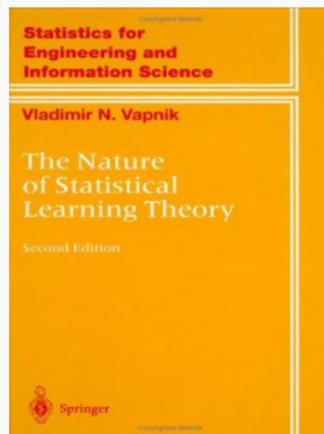
- **Apprentissage supervisé** : prédire une sortie $y \in \mathcal{Y}$ à partir d'entrées $x \in \mathcal{X}$;
- **Apprentissage non supervisé** : établir une typologie des observations ;
- **Règles d'association** : identifier des liens entre différents produits ;
- **Systemes de recommandation** : identifier les produits susceptibles d'intéresser des consommateurs.

Nombreuses applications

finance, économie, marketing, biologie, médecine...

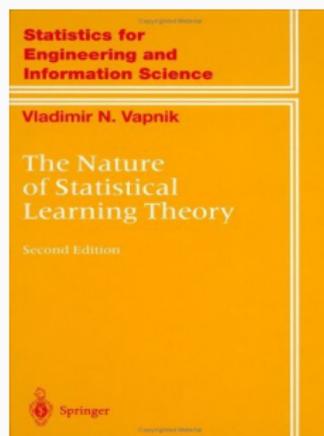
Approche mathématique

- Ouvrage fondateur : [Vapnik, 2000]

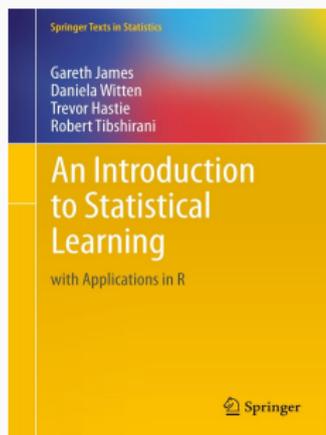
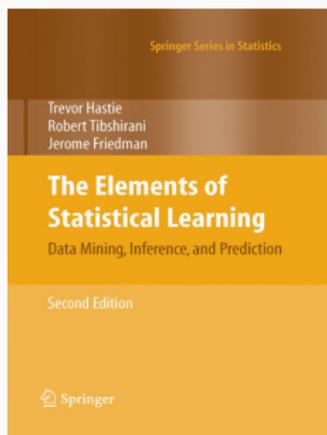


Approche mathématique

- Ouvrage fondateur : [Vapnik, 2000]
- voir aussi [Bousquet et al., 2003].



The Elements of Statistical Learning [Hastie et al., 2009, James et al., 2015]



- Disponibles (avec jeux de données, codes...) aux url :

<https://web.stanford.edu/~hastie/ElemStatLearn/>

<http://www-bcf.usc.edu/~gareth/ISL/>

- Page de cours et tutoriels très bien faits sur la **statistique classique et moderne**.
- On pourra notamment regarder les **vignettes** sur la partie **apprentissage** :
 - [Wikistat, 2020a]
 - [Wikistat, 2020b]
 - ...

- Page de cours et tutoriels très bien faits sur la **statistique classique et moderne**.
- On pourra notamment regarder les **vignettes** sur la partie **apprentissage** :
 - [Wikistat, 2020a]
 - [Wikistat, 2020b]
 - ...
- Plusieurs parties de ce cours sont **inspirées de ces vignettes**.

Motivations

Quelques exemples

Cadre statistique pour l'apprentissage supervisé

Exemples de fonction de perte

Estimation du risque

Le sur-apprentissage

Le package tidymodels

Annexe : le package caret

Bibliographie

Apprentissage statistique

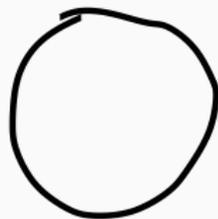
Comprendre et apprendre un comportement à partir d'exemples.

0	0	0	0	0
1	1	1	1	1
2	2	2	2	2
3	3	3	3	3
4	4	4	4	4
5	5	5	5	5
6	6	6	6	6
7	7	7	7	7
8	8	8	8	8
9	9	9	9	9

Apprentissage statistique

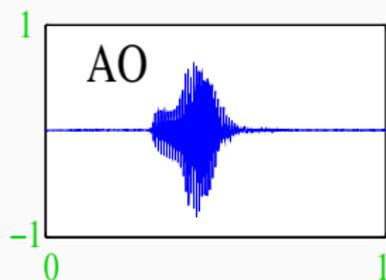
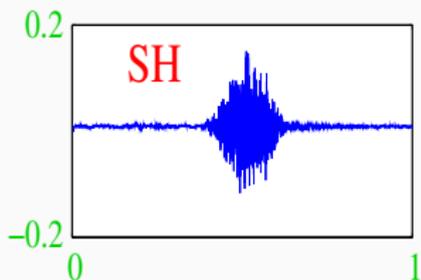
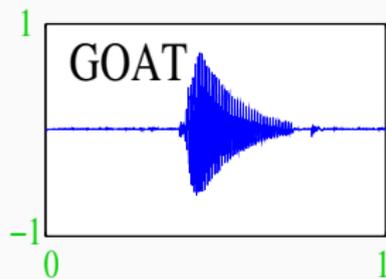
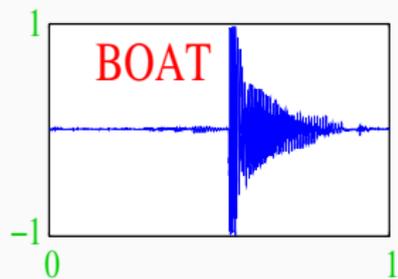
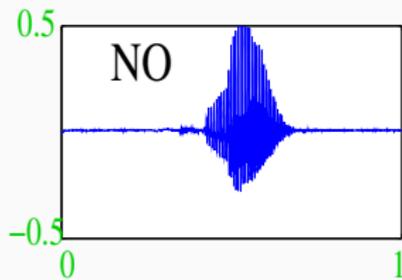
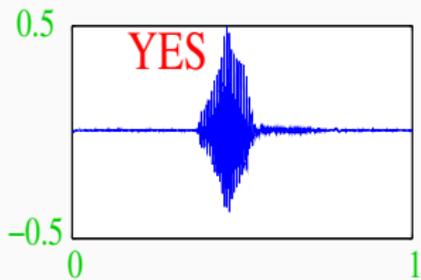
Comprendre et apprendre un comportement à partir d'exemples.

0	0	0	0	0
1	1	1	1	1
2	2	2	2	2
3	3	3	3	3
4	4	4	4	4
5	5	5	5	5
6	6	6	6	6
7	7	7	7	7
8	8	8	8	8
9	9	9	9	9

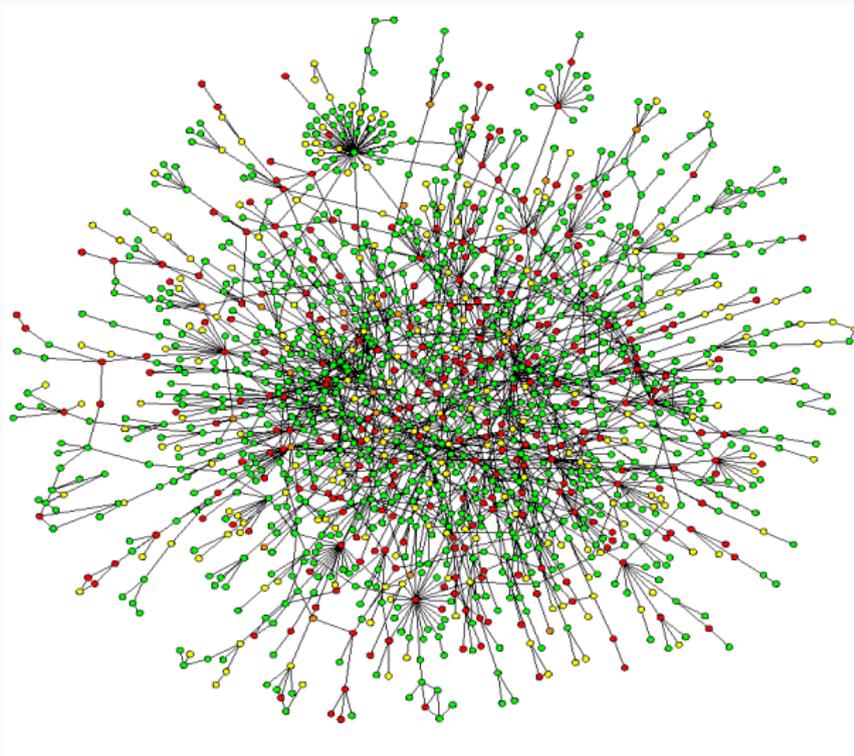


Qu'est-ce qui est écrit ? 0, 1, 2... ?

Reconnaissance de la parole



Apprentissage sur les réseaux



Prévision de pics d'ozone

- On a mesuré pendant 366 jours la **concentration maximale** en ozone (V4);
- On dispose également d'autres variables météorologiques (température, nébulosité, vent...).

```
> head(Ozone)
```

```
##      V1 V2 V3 V4   V5 V6 V7 V8    V9  V10 V11   V12 V13
## 1    1  1  4  3 5480  8 20 NA    NA 5000 -15 30.56 200
## 2    1  2  5  3 5660  6 NA 38    NA   NA -14   NA 300
## 3    1  3  6  3 5710  4 28 40    NA 2693 -25 47.66 250
## 4    1  4  7  5 5700  3 37 45    NA  590 -24 55.04 100
## 5    1  5  1  5 5760  3 51 54 45.32 1450  25 57.02  60
## 6    1  6  2  6 5720  4 69 35 49.64 1568  15 53.78  60
```

Prévision de pics d'ozone

- On a mesuré pendant 366 jours la **concentration maximale** en ozone (V4);
- On dispose également d'autres variables météorologiques (température, nébulosité, vent...).

```
> head(Ozone)
##   V1 V2 V3 V4   V5 V6 V7 V8   V9  V10 V11   V12 V13
## 1  1  1  4  3 5480  8 20 NA   NA 5000 -15 30.56 200
## 2  1  2  5  3 5660  6 NA 38   NA  NA -14   NA 300
## 3  1  3  6  3 5710  4 28 40   NA 2693 -25 47.66 250
## 4  1  4  7  5 5700  3 37 45   NA  590 -24 55.04 100
## 5  1  5  1  5 5760  3 51 54 45.32 1450  25 57.02  60
## 6  1  6  2  6 5720  4 69 35 49.64 1568  15 53.78  60
```

Question

Peut-on **prédire** la concentration maximale en ozone du **lendemain** à partir des prévisions météorologiques ?

Détection de spam

- Sur 4 601 mails, on a pu identifier **1813 spams**.
- On a également mesuré sur chacun de ces mails la présence ou absence de **57 mots**.

```
> spam %>% select(c(1:8,58)) %>% head()
##   make address  all num3d  our over remove internet type
## 1 0.00    0.64 0.64    0 0.32 0.00    0.00    0.00 spam
## 2 0.21    0.28 0.50    0 0.14 0.28    0.21    0.07 spam
## 3 0.06    0.00 0.71    0 1.23 0.19    0.19    0.12 spam
## 4 0.00    0.00 0.00    0 0.63 0.00    0.31    0.63 spam
## 5 0.00    0.00 0.00    0 0.63 0.00    0.31    0.63 spam
## 6 0.00    0.00 0.00    0 1.85 0.00    0.00    1.85 spam
```

Détection de spam

- Sur 4 601 mails, on a pu identifier **1813 spams**.
- On a également mesuré sur chacun de ces mails la présence ou absence de **57 mots**.

```
> spam %>% select(c(1:8,58)) %>% head()
##   make address  all num3d  our over remove internet type
## 1 0.00    0.64 0.64    0 0.32 0.00    0.00    0.00 spam
## 2 0.21    0.28 0.50    0 0.14 0.28    0.21    0.07 spam
## 3 0.06    0.00 0.71    0 1.23 0.19    0.19    0.12 spam
## 4 0.00    0.00 0.00    0 0.63 0.00    0.31    0.63 spam
## 5 0.00    0.00 0.00    0 0.63 0.00    0.31    0.63 spam
## 6 0.00    0.00 0.00    0 1.85 0.00    0.00    1.85 spam
```

Question

Peut-on construire à partir de ces données une méthode de **détection automatique** de spam ?

Motivations

Quelques exemples

Cadre statistique pour l'apprentissage supervisé

Exemples de fonction de perte

Estimation du risque

Le sur-apprentissage

Le package tidymodels

Annexe : le package caret

Bibliographie

Régression vs classification

- **Données** de type **entrée-sortie** : $d_n = (x_1, y_1), \dots, (x_n, y_n)$ où $x_i \in \mathcal{X}$ représente l'entrée et $y_i \in \mathcal{Y}$ la sortie.

Objectifs

1. **Expliquer** le(s) mécanisme(s) liant les entrée x_i aux sorties y_i ;
2. **Prédire** « au mieux » la sortie y associée à une nouvelle entrée $x \in \mathcal{X}$.

Régression vs classification

- **Données** de type **entrée-sortie** : $d_n = (x_1, y_1), \dots, (x_n, y_n)$ où $x_i \in \mathcal{X}$ représente l'entrée et $y_i \in \mathcal{Y}$ la sortie.

Objectifs

1. **Expliquer** le(s) mécanisme(s) liant les entrée x_i aux sorties y_i ;
2. **Prédire** « au mieux » la sortie y associée à une nouvelle entrée $x \in \mathcal{X}$.

Vocabulaire

- Lorsque la variable à expliquer est quantitative ($\mathcal{Y} \subseteq \mathbb{R}$), on parle de **régression**.
- Lorsqu'elle est qualitative ($\text{Card}(\mathcal{Y})$ fini), on parle de **classification (supervisée)**.

Exemples

- La plupart des problèmes présentés précédemment peuvent être appréhendés dans un contexte d'**apprentissage supervisé** : on cherche à expliquer une sortie y par des entrées x :

y_i	x_i	
Chiffre	image	Classification
Mot	courbe	Classification
Spam	présence/absence de mots	Classification
C. en O_3	données météo.	Régression

Exemples

- La plupart des problèmes présentés précédemment peuvent être appréhendés dans un contexte d'**apprentissage supervisé** : on cherche à expliquer une sortie y par des entrées x :

y_i	x_i	
Chiffre	image	Classification
Mot	courbe	Classification
Spam	présence/absence de mots	Classification
C. en O_3	données météo.	Régression

Remarque

La nature des variables associées aux **entrées** x_i est **variée** (quantitative, qualitative, fonctionnelle...).

Un début de formalisation mathématique

- Etant données des observations $d_n = \{(x_1, y_1), \dots, (x_n, y_n)\}$ on cherche à **expliquer/prédire** les sorties $y_i \in \mathcal{Y}$ à partir des entrées $x_i \in \mathcal{X}$.

Un début de formalisation mathématique

- Etant données des observations $d_n = \{(x_1, y_1), \dots, (x_n, y_n)\}$ on cherche à **expliquer/prédire** les sorties $y_i \in \mathcal{Y}$ à partir des entrées $x_i \in \mathcal{X}$.
- Il s'agit donc de trouver **une fonction de prévision** $f : \mathcal{X} \rightarrow \mathcal{Y}$ telle que

$$f(x_i) \approx y_i, i = 1, \dots, n.$$

Un début de formalisation mathématique

- Etant données des observations $d_n = \{(x_1, y_1), \dots, (x_n, y_n)\}$ on cherche à **expliquer/prédire** les sorties $y_i \in \mathcal{Y}$ à partir des entrées $x_i \in \mathcal{X}$.
- Il s'agit donc de trouver **une fonction de prévision** $f : \mathcal{X} \rightarrow \mathcal{Y}$ telle que

$$f(x_i) \approx y_i, i = 1, \dots, n.$$

- Nécessité de se donner un **critère** qui permette de mesurer la qualité des fonctions de prévision f .

Un début de formalisation mathématique

- Etant données des observations $d_n = \{(x_1, y_1), \dots, (x_n, y_n)\}$ on cherche à **expliquer/prédire** les sorties $y_i \in \mathcal{Y}$ à partir des entrées $x_i \in \mathcal{X}$.
- Il s'agit donc de trouver **une fonction de prévision** $f : \mathcal{X} \rightarrow \mathcal{Y}$ telle que

$$f(x_i) \approx y_i, i = 1, \dots, n.$$

- Nécessité de se donner un **critère** qui permette de mesurer la qualité des fonctions de prévision f .
- Le plus souvent, on utilise une **fonction de perte** $\ell : \mathcal{Y} \times \mathcal{Y} \rightarrow \mathbb{R}^+$ telle que

$$\begin{cases} \ell(y, y') = 0 & \text{si } y = y' \\ \ell(y, y') > 0 & \text{si } y \neq y'. \end{cases}$$

Vision statistique

- On suppose que les données $d_n = \{(x_1, y_1), \dots, (x_n, y_n)\}$ sont des réalisations d'un n -échantillon $\mathcal{D}_n = \{(X_1, Y_1), \dots, (X_n, Y_n)\}$ de loi inconnue.
- Les X_i sont des variables aléatoires à valeurs dans \mathcal{X} , les Y_i dans \mathcal{Y} .
- Le plus souvent on supposera que les couples $(X_i, Y_i), i = 1, \dots, n$ sont i.i.d de loi \mathbf{P} .

Vision statistique

- On suppose que les données $d_n = \{(x_1, y_1), \dots, (x_n, y_n)\}$ sont des réalisations d'un n -échantillon $\mathcal{D}_n = \{(X_1, Y_1), \dots, (X_n, Y_n)\}$ de loi inconnue.
- Les X_i sont des variables aléatoires à valeurs dans \mathcal{X} , les Y_i dans \mathcal{Y} .
- Le plus souvent on supposera que les couples $(X_i, Y_i), i = 1, \dots, n$ sont i.i.d de loi \mathbf{P} .

Performance d'une fonction de prévision

- Etant donné une fonction de perte $\ell : \mathcal{Y} \times \mathcal{Y} \rightarrow \mathbb{R}^+$, la performance d'une fonction de prévision $f : \mathcal{X} \rightarrow \mathcal{Y}$ est mesurée par

$$\mathcal{R}(f) = \mathbf{E}[\ell(Y, f(X))]$$

où (X, Y) est indépendant des (X_i, Y_i) et de même loi P .

Vision statistique

- On suppose que les données $d_n = \{(x_1, y_1), \dots, (x_n, y_n)\}$ sont des réalisations d'un n -échantillon $\mathcal{D}_n = \{(X_1, Y_1), \dots, (X_n, Y_n)\}$ de loi inconnue.
- Les X_i sont des variables aléatoires à valeurs dans \mathcal{X} , les Y_i dans \mathcal{Y} .
- Le plus souvent on supposera que les couples $(X_i, Y_i), i = 1, \dots, n$ sont i.i.d de loi \mathbf{P} .

Performance d'une fonction de prévision

- Etant donné une fonction de perte $\ell : \mathcal{Y} \times \mathcal{Y} \rightarrow \mathbb{R}^+$, la performance d'une fonction de prévision $f : \mathcal{X} \rightarrow \mathcal{Y}$ est mesurée par

$$\mathcal{R}(f) = \mathbf{E}[\ell(Y, f(X))]$$

où (X, Y) est indépendant des (X_i, Y_i) et de même loi P .

- $\mathcal{R}(f)$ est appelé risque ou erreur de généralisation de f .

Fonction de prévision optimale

- $\mathcal{R}(f) \implies$ "Erreur moyenne" de f par rapport à la loi ds données.
- **Idée** : trouver f qui a la plus petite erreur.

Fonction de prévision optimale

- $\mathcal{R}(f) \implies$ "Erreur moyenne" de f par rapport à la loi ds données.
- Idée : trouver f qui a la plus petite erreur.

Aspect théorique

- Pour une fonction de perte $\ell : \mathcal{Y} \times \mathcal{Y} \rightarrow \mathbb{R}^+$ donnée, le problème théorique consiste à trouver

$$f^* \in \underset{f}{\operatorname{argmin}} \mathcal{R}(f) \iff \mathcal{R}(f^*) \leq \mathcal{R}(f) \forall f$$

- Une telle fonction f^* (si elle existe) est appelée fonction de prévision optimale pour la perte ℓ .

Aspect pratique

- La fonction de prévision optimale f^* dépend le plus souvent de la loi \mathbf{P} des (X, Y) qui est en pratique **inconnue**.

Aspect pratique

- La fonction de prévision optimale f^* dépend le plus souvent de la loi \mathbf{P} des (X, Y) qui est en pratique **inconnue**.
- Le job du statisticien est de trouver un **estimateur** $f_n = f_n(\cdot, \mathcal{D}_n)$ tel que $\mathcal{R}(f_n) \approx \mathcal{R}(f^*)$.

Aspect pratique

- La fonction de prévision optimale f^* dépend le plus souvent de la loi \mathbf{P} des (X, Y) qui est en pratique **inconnue**.
- Le job du statisticien est de trouver un **estimateur** $f_n = f_n(\cdot, \mathcal{D}_n)$ tel que $\mathcal{R}(f_n) \approx \mathcal{R}(f^*)$.

Définition

Un **algorithme de prévision** est représenté par une suite $(f_n)_n$ d'applications (mesurables) telles que pour $n \geq 1$, $f_n : \mathcal{X} \times (\mathcal{X} \times \mathcal{Y})^n \rightarrow \mathcal{Y}$.

- 1 un **algorithme** : 1 **estimateur** $f_n(\cdot) = f_n(\cdot, \mathcal{D}_n)$ de f^* .

Propriétés statistiques d'un algorithme

- 1 un algorithme : 1 estimateur $f_n(\cdot) = f_n(\cdot, \mathcal{D}_n)$ de f^* .

Propriétés statistiques

- Biais : $\mathbf{E}[f_n(x)] - f^*(x) \implies$ prévisions "en moyenne" ;
- Variance : $\mathbf{V}[f_n(x)] \implies$ stabilité des prévisions ;
- Consistance : $\lim_{n \rightarrow \infty} \mathcal{R}(f_n) = \mathcal{R}(f^*) \implies$ précision quand n augmente ;
- ...

Motivations

Quelques exemples

Cadre statistique pour l'apprentissage supervisé

Exemples de fonction de perte

Estimation du risque

Le sur-apprentissage

Le package tidymodels

Annexe : le package caret

Bibliographie

Choix de la fonction de perte

- Le cadre mathématique développé précédemment sous-entend qu'une fonction est **performante** (voire **optimale**) vis-à-vis d'un **critère** (représenté par la **fonction de perte** ℓ).
- Un algorithme de prévision performant pour un critère ne sera **pas forcément performant pour un autre**.

Choix de la fonction de perte

- Le cadre mathématique développé précédemment sous-entend qu'une fonction est **performante** (voire **optimale**) vis-à-vis d'un **critère** (représenté par la **fonction de perte** ℓ).
- Un algorithme de prévision performant pour un critère ne sera **pas forcément performant pour un autre**.

Conséquence pratique

Avant de s'attacher à construire un algorithme de prévision, il est **capital** de savoir **mesurer la performance** d'un algorithme de prévision.

- Une fonction de perte $\ell : \mathcal{Y} \times \tilde{\mathcal{Y}} \rightarrow \mathbb{R}^+$ dépend de l'espace des observations \mathcal{Y} et de celui des prévisions $\tilde{\mathcal{Y}}$.

- Une fonction de perte $\ell : \mathcal{Y} \times \tilde{\mathcal{Y}} \rightarrow \mathbb{R}^+$ dépend de l'espace des observations \mathcal{Y} et de celui des prévisions $\tilde{\mathcal{Y}}$.
- On distingue 3 catégories de fonction de perte en fonction de ces espaces :
 1. Prévisions numériques : problème de régression où on cherche à prédire la valeur de $Y : \ell : \mathbb{R} \times \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}^+$;

- Une fonction de perte $\ell : \mathcal{Y} \times \tilde{\mathcal{Y}} \rightarrow \mathbb{R}^+$ dépend de l'espace des observations \mathcal{Y} et de celui des prévisions $\tilde{\mathcal{Y}}$.
- On distingue 3 catégories de fonction de perte en fonction de ces espaces :
 1. Prévisions numériques : problème de régression où on cherche à prédire la valeur de $Y : \ell : \mathbb{R} \times \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}^+$;
 2. Prédiction de groupes : problème de classification où on veut prédire un label : $\ell : \{1, \dots, K\} \times \{1, \dots, K\} \rightarrow \mathbb{R}^+$;

- Une fonction de perte $\ell : \mathcal{Y} \times \tilde{\mathcal{Y}} \rightarrow \mathbb{R}^+$ dépend de l'espace des observations \mathcal{Y} et de celui des prévisions $\tilde{\mathcal{Y}}$.
- On distingue 3 catégories de fonction de perte en fonction de ces espaces :
 1. Prévisions numériques : problème de régression où on cherche à prédire la valeur de $Y : \ell : \mathbb{R} \times \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}^+$;
 2. Prédiction de groupes : problème de classification où on veut prédire un label : $\ell : \{1, \dots, K\} \times \{1, \dots, K\} \rightarrow \mathbb{R}^+$;
 3. Prédiction de probabilités : problème de classification où on veut prédire les probabilités $\mathbf{P}(Y = k|X = x) : \ell : \{1, \dots, K\} \times \mathbb{R}^K \rightarrow \mathbb{R}^+$.

Régression

- $\mathcal{Y} = \mathbb{R}$, une prévision = un réel $\implies m : \mathcal{X} \rightarrow \mathbb{R}$;

- $\mathcal{Y} = \mathbb{R}$, une prévision = un réel $\implies m : \mathcal{X} \rightarrow \mathbb{R}$;
- Une perte = une **distance** entre deux nombres, par exemple la **perte quadratique** :

$$\ell : \mathbb{R} \times \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}^+$$

$$(y, y') \mapsto (y - y')^2$$

- Le **risque** (**risque quadratique**) est alors donné par

$$\mathcal{R}(m) = \mathbf{E}[(Y - m(X))^2]$$

- $\mathcal{Y} = \mathbb{R}$, une prévision = un réel $\implies m : \mathcal{X} \rightarrow \mathbb{R}$;
- Une perte = une **distance** entre deux nombres, par exemple la **perte quadratique** :

$$\begin{aligned} \ell : \mathbb{R} \times \mathbb{R} &\rightarrow \mathbb{R}^+ \\ (y, y') &\mapsto (y - y')^2 \end{aligned}$$

- Le **risque** (**risque quadratique**) est alors donné par

$$\mathcal{R}(m) = \mathbf{E}[(Y - m(X))^2]$$

- et la **fonction optimale** (**inconnue**), appelée **fonction de régression**, par

$$m^*(x) = \mathbf{E}[Y|X = x].$$

Classification

- $\mathcal{Y} = \{1, \dots, K\}$, une prévision = un **groupe** $\implies g : \mathcal{X} \rightarrow \{1, \dots, K\}$;
- Une perte = 1 **coût** pour une mauvaise prévision, par exemple la **perte indicatrice**

$$\begin{aligned} \ell : \{1, \dots, K\} \times \{1, \dots, K\} &\rightarrow \mathbb{R}^+ \\ (y, y') &\mapsto \mathbf{1}_{y \neq y'} \end{aligned}$$

- Le **risque** (**erreur de classification**) est alors donné par

$$\mathcal{R}(g) = \mathbf{E}[\mathbf{1}_{g(X) \neq Y}] = \mathbf{P}(g(X) \neq Y).$$

- et la **fonction optimale (inconnue)**, appelée **règle de Bayes**, par

$$g^*(x) = \operatorname{argmax}_k \mathbf{P}(Y = k | X = x).$$

Classification binaire

- $\mathcal{Y} = \{-1, 1\}$, une prévision = un groupe $\implies g : \mathcal{X} \rightarrow \{-1, 1\}$.
- Ce cadre permet une analyse plus fine des différents types d'erreur.

Classification binaire

- $\mathcal{Y} = \{-1, 1\}$, une prévision = un **groupe** $\implies g : \mathcal{X} \rightarrow \{-1, 1\}$.
- Ce cadre permet une **analyse plus fine** des différents types d'erreur.
- En effet, seules **4 situations** peuvent se produire

	$g(x) = -1$	$g(x) = 1$
$y = -1$	VN	FP
$y = 1$	FN	VP

- On peut les quantifier en terme de **probabilités**.

Pour aller plus vite

Erreurs binaires

- **Spécificité** \implies bien prédire les négatifs :

$$\text{sp}(g) = \mathbf{P}(g(X) = -1 | Y = -1),$$

- **Sensibilité** \implies bien prédire les positifs :

$$\text{se}(g) = \mathbf{P}(g(X) = 1 | Y = 1),$$

- **Taux de faux négatifs** \implies prédire négatif à tort :

$$\text{fn}(g) = \mathbf{P}(g(X) = -1 | Y = 1),$$

- **Taux de faux positifs** \implies prédire positif à tort :

$$\text{fp}(g) = \mathbf{P}(g(X) = 1 | Y = -1).$$

Erreurs binaires

- **Spécificité** \implies bien prédire les négatifs :

$$\text{sp}(g) = \mathbf{P}(g(X) = -1 | Y = -1),$$

- **Sensibilité** \implies bien prédire les positifs :

$$\text{se}(g) = \mathbf{P}(g(X) = 1 | Y = 1),$$

- **Taux de faux négatifs** \implies prédire négatif à tort :

$$\text{fn}(g) = \mathbf{P}(g(X) = -1 | Y = 1),$$

- **Taux de faux positifs** \implies prédire positif à tort :

$$\text{fp}(g) = \mathbf{P}(g(X) = 1 | Y = -1).$$

Critères binaires

De nombreux critères s'obtiennent en combinant ces probabilités :

$$\text{EC}(g) = \mathbf{P}(g(X) \neq Y) = \text{fp}(g)\mathbf{P}(Y = -1) + \text{fn}(g)\mathbf{P}(Y = 1).$$

Quelques critères binaires

- **Balanced Accuracy** :

$$\frac{1}{2}\mathbf{P}(g(X) = -1|Y = -1) + \frac{1}{2}\mathbf{P}(g(X) = 1|Y = 1) = \frac{1}{2}(\text{se}(g) + \text{sp}(g)).$$

Quelques critères binaires

- **Balanced Accuracy** :

$$\frac{1}{2}\mathbf{P}(g(X) = -1|Y = -1) + \frac{1}{2}\mathbf{P}(g(X) = 1|Y = 1) = \frac{1}{2}(\text{se}(g) + \text{sp}(g)).$$

- **F_1 -score** :

$$2 \frac{\text{Precision} \times \text{Recall}}{\text{Precision} + \text{Recall}},$$

avec

$$\text{Precision } \mathbf{P}(Y = 1|g(X) = 1) \quad \text{et} \quad \text{Recall} = \mathbf{P}(g(X) = 1|Y = 1).$$

- **Kappa de Cohen...**

Quelques critères binaires

- **Balanced Accuracy** :

$$\frac{1}{2}\mathbf{P}(g(X) = -1|Y = -1) + \frac{1}{2}\mathbf{P}(g(X) = 1|Y = 1) = \frac{1}{2}(\text{se}(g) + \text{sp}(g)).$$

- **F_1 -score** :

$$2 \frac{\text{Precision} \times \text{Recall}}{\text{Precision} + \text{Recall}},$$

avec

Precision $\mathbf{P}(Y = 1|g(X) = 1)$ et Recall $= \mathbf{P}(g(X) = 1|Y = 1)$.

- **Kappa de Cohen...**

Remarque

Mieux adapté que l'erreur de classification au cas de **données déséquilibrées**.

Classification (pour des probabilités)

- $\mathcal{Y} = \{1, \dots, K\}$, une prévision = $K - 1$ probabilités
 $p_k(x) = \mathbf{P}(Y = k|X = x), k = 1, \dots, K - 1.$

Classification (pour des probabilités)

- $\mathcal{Y} = \{1, \dots, K\}$, une prévision = $K - 1$ probabilités
 $p_k(x) = \mathbf{P}(Y = k|X = x), k = 1, \dots, K - 1.$
- Les fonctions de perte sont généralement définies comme généralisation de pertes spécifiques au problème de **classification binaire**.

Classification (pour des probabilités)

- $\mathcal{Y} = \{1, \dots, K\}$, une prévision = $K - 1$ probabilités
 $p_k(x) = \mathbf{P}(Y = k|X = x)$, $k = 1, \dots, K - 1$.
- Les fonctions de perte sont généralement définies comme généralisation de pertes spécifiques au problème de **classification binaire**.
- **Classification binaire** avec $\mathcal{Y} = \{-1, 1\}$ et $S : \mathcal{X} \rightarrow \mathbb{R}$
($S(x) = \mathbf{P}(Y = 1|X = x)$ ou une transformation bijective de cette probabilité) \implies fonction de **score**.

Fonction de score

- Objectif d'un score : ordonner



Fonction de score

- Objectif d'un score : ordonner



- avant (d'éventuellement) classer en fixant un seuil $s \in \mathbb{R}$:

$$g_s(x) = \begin{cases} 1 & \text{si } S(x) > s \\ -1 & \text{sinon.} \end{cases}$$

Fonction de score

- Objectif d'un score : ordonner



- avant (d'éventuellement) classer en fixant un seuil $s \in \mathbb{R}$:

$$g_s(x) = \begin{cases} 1 & \text{si } S(x) > s \\ -1 & \text{sinon.} \end{cases}$$

- Pour un seuil s donné, on a les erreurs (FP et FN)

$$\alpha(s) = \mathbf{P}(S(X) > s | Y = -1) = 1 - \text{sp}(s)$$

et

$$\beta(s) = \mathbf{P}(S(X) \leq s | Y = 1) = 1 - \text{se}(s).$$

Courbe ROC

- **Idée** : s'affranchir du choix de s en **visualisant les erreurs $\alpha(s)$ et $\beta(s)$** sur un graphe 2D pour toutes les valeurs de s .

Courbe ROC

- **Idée** : s'affranchir du choix de s en **visualisant les erreurs $\alpha(s)$ et $\beta(s)$** sur un graphe 2D pour toutes les valeurs de s .

Définition

La **courbe ROC** de S est la courbe paramétrée par les valeurs de seuil s dont les abscisses et ordonnées sont définies par

$$\begin{cases} x(s) = \mathbf{P}(S(X) > s | Y = -1) = \alpha(s) \\ y(s) = \mathbf{P}(S(X) > s | Y = 1) = 1 - \beta(s). \end{cases}$$

Courbe ROC

- **Idée** : s'affranchir du choix de s en **visualisant les erreurs $\alpha(s)$ et $\beta(s)$** sur un graphe 2D pour toutes les valeurs de s .

Définition

La **courbe ROC** de S est la courbe paramétrée par les valeurs de seuil s dont les abscisses et ordonnées sont définies par

$$\begin{cases} x(s) = \mathbf{P}(S(X) > s | Y = -1) = \alpha(s) \\ y(s) = \mathbf{P}(S(X) > s | Y = 1) = 1 - \beta(s). \end{cases}$$

Visualisation

- **Abscisses** : les faux positifs ou la spécificité ;
- **Ordonnées** : les faux négatifs ou la sensibilité.

Analyse de la courbe ROC

- Une proba est entre 0 et 1 \implies ROC vit dans le carré $[0, 1]^2$.

Analyse de la courbe ROC

- Une proba est entre 0 et 1 \implies ROC vit dans le carré $[0, 1]^2$.
- $x(-\infty) = y(-\infty) = 1$ et $x(+\infty) = y(+\infty) = 0 \implies$ ROC part du point $(1, 1)$ pour arriver en $(0, 0)$.

Analyse de la courbe ROC

- Une proba est entre 0 et 1 \implies ROC vit dans le carré $[0, 1]^2$.
- $x(-\infty) = y(-\infty) = 1$ et $x(+\infty) = y(+\infty) = 1 \implies$ ROC part du point $(1, 1)$ pour arriver en $(0, 0)$.
- **ROC parfaite** : il existe s^* tel que $\alpha(s^*) = \beta(s^*) = 0 \implies$ ROC est définie par l'union des segments

$$[(1, 1); (0, 1)] \quad \text{et} \quad [(0, 1); (0, 0)].$$

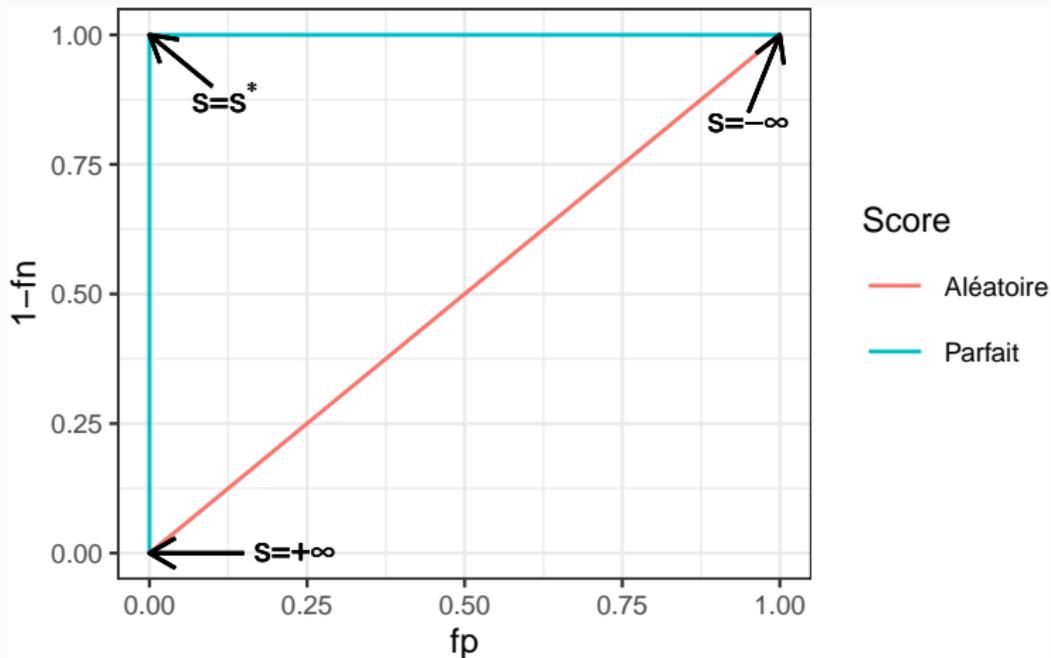
Analyse de la courbe ROC

- Une proba est entre 0 et 1 \implies ROC vit dans le carré $[0, 1]^2$.
- $x(-\infty) = y(-\infty) = 1$ et $x(+\infty) = y(+\infty) = 1 \implies$ ROC part du point $(1, 1)$ pour arriver en $(0, 0)$.
- **ROC parfaite** : il existe s^* tel que $\alpha(s^*) = \beta(s^*) = 0 \implies$ ROC est définie par l'union des segments

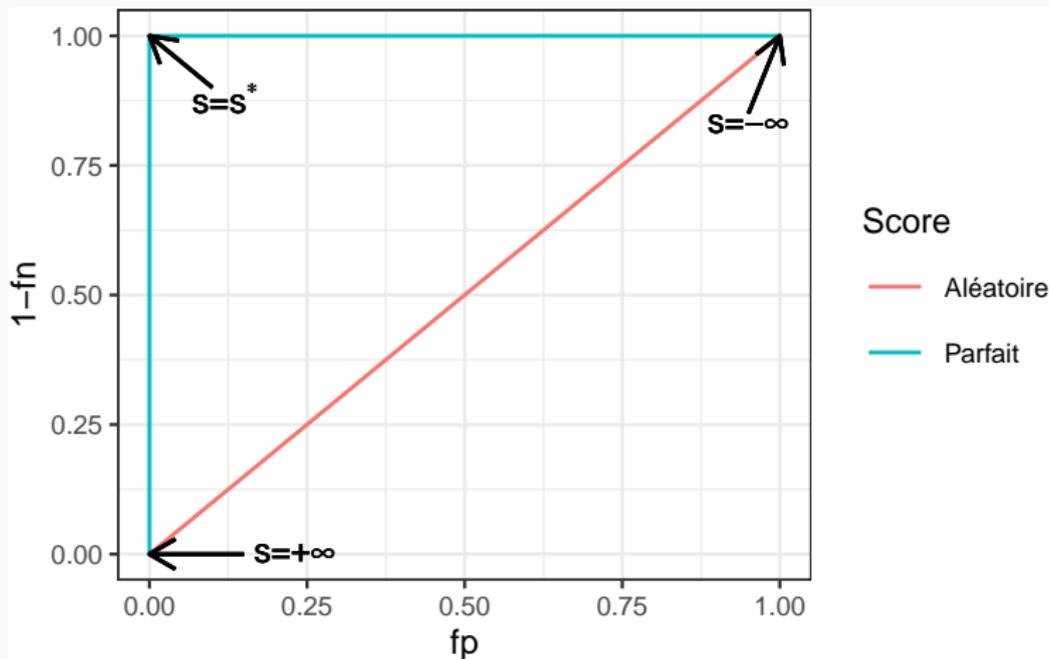
$$[(1, 1); (0, 1)] \quad \text{et} \quad [(0, 1); (0, 0)].$$

- **Mauvaise ROC** : $S(X)$ et Y sont indépendantes $\implies x(s) = y(s)$ pour tout $s \in \mathbb{R}$ et ROC correspond à la première bissectrice.

Visualisation

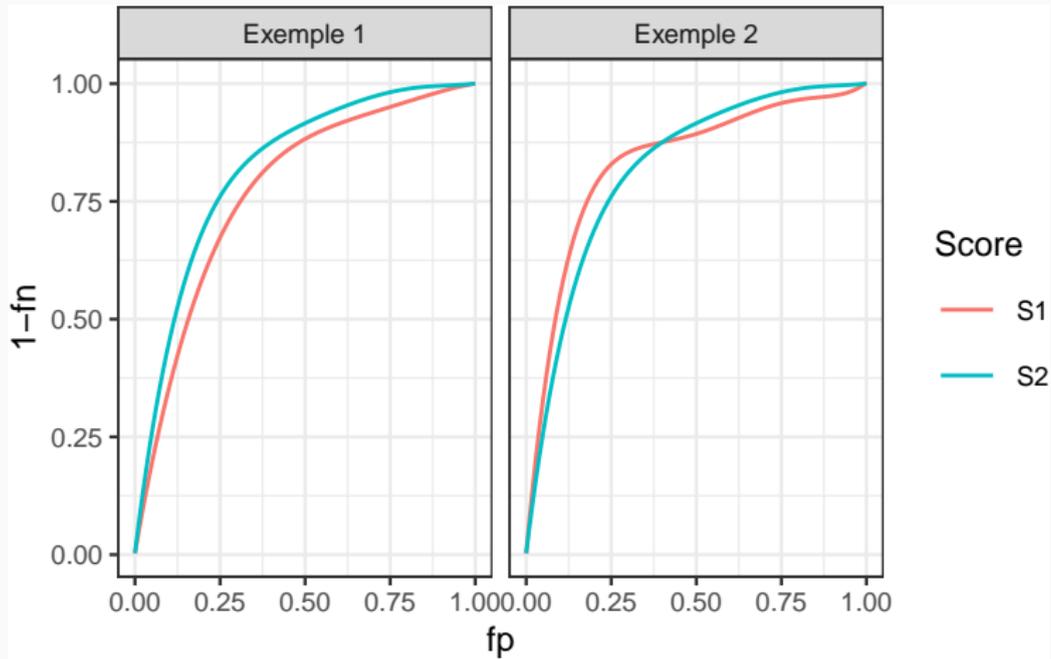


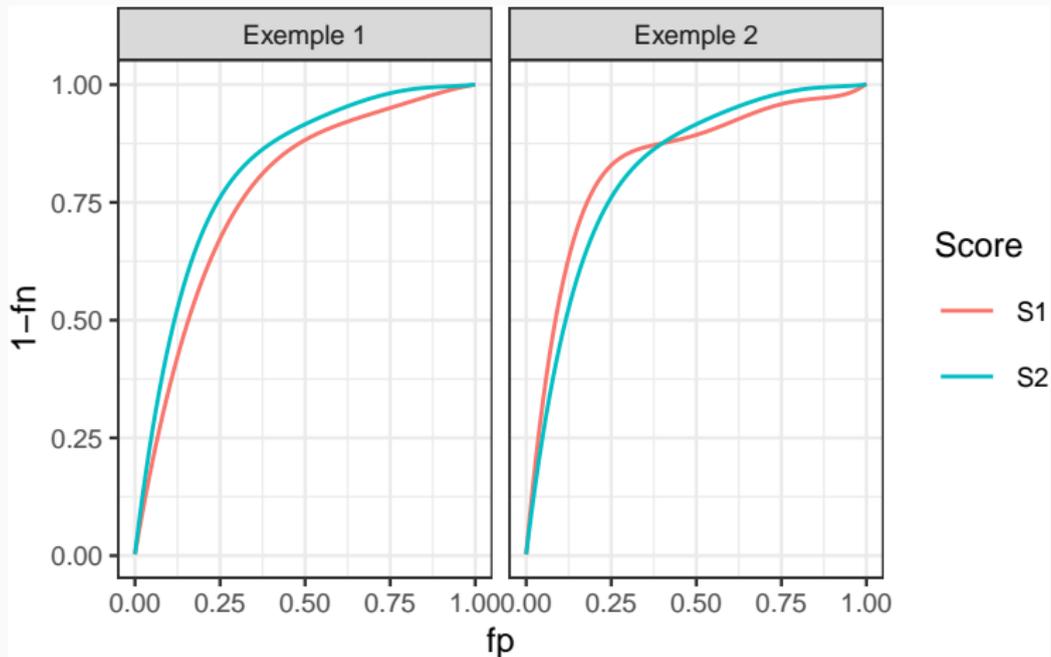
Visualisation



Interprétation

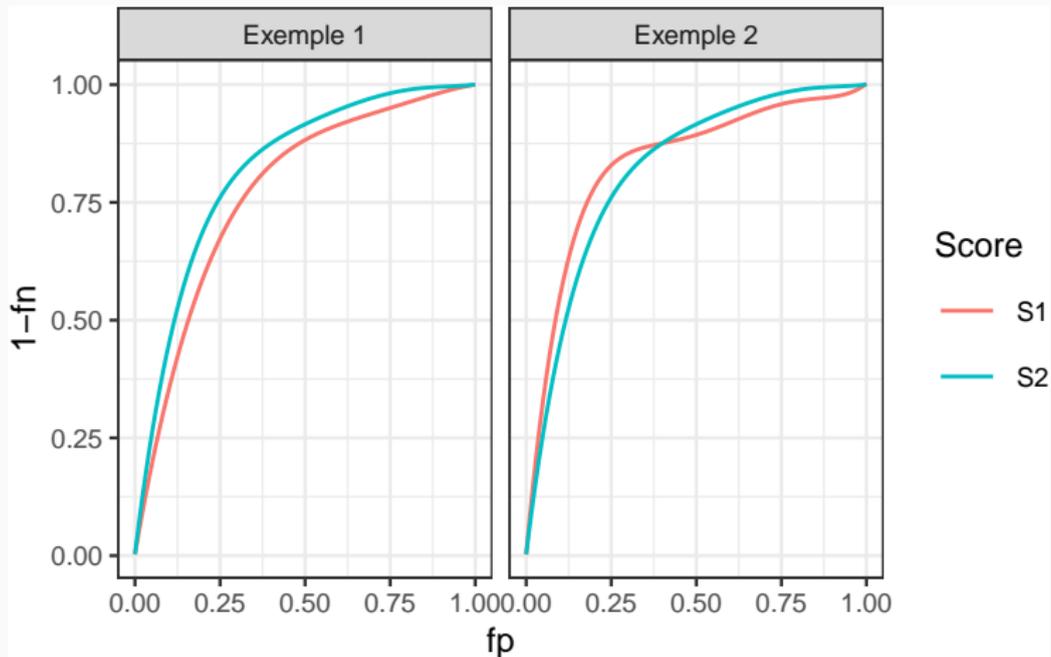
On évalue la performance d'un score par sa capacité à se rapprocher le plus vite possible de la droite $y = 1$.





Comparaison

- Exemple 1 : S2 meilleur que S1.
- Exemple 2 : il y a débat...



Comparaison

- Exemple 1 : S2 meilleur que S1.
- Exemple 2 : il y a débat...
- Idée : utiliser l'aire sous la courbe.

Définition

On appelle AUC l'aire sous la courbe ROC de S .

Propriété

- $0.5 \leq \text{AUC}(S) \leq 1$.
- Plus l'AUC est **grand**, **meilleur** est le score.

Interprétation de l'AUC

Propriété

Soit (X_1, Y_1) et (X_2, Y_2) indépendants et de même loi que (X, Y) , on a

$$\begin{aligned} \text{AUC}(S) &= \mathbf{P}(S(X_1) > S(X_2) | Y_1 = 1, Y_2 = -1) \\ &\quad + \frac{1}{2} \mathbf{P}(S(X_1) = S(X_2) | Y_1 = 1, Y_2 = -1). \end{aligned}$$

En particulier si $S(X)$ est continue alors

$$\text{AUC}(S) = \mathbf{P}(S(X_1) \geq S(X_2) | Y_1 = 1, Y_2 = -1).$$

Interprétation

- L'AUC correspond à la probabilité que le score **ordonne correctement deux observations** prélevées aléatoirement dans les groupes -1 et 1.

Interprétation de l'AUC

Propriété

Soit (X_1, Y_1) et (X_2, Y_2) indépendants et de même loi que (X, Y) , on a

$$\begin{aligned} \text{AUC}(S) &= \mathbf{P}(S(X_1) > S(X_2) | Y_1 = 1, Y_2 = -1) \\ &\quad + \frac{1}{2} \mathbf{P}(S(X_1) = S(X_2) | Y_1 = 1, Y_2 = -1). \end{aligned}$$

En particulier si $S(X)$ est continue alors

$$\text{AUC}(S) = \mathbf{P}(S(X_1) \geq S(X_2) | Y_1 = 1, Y_2 = -1).$$

Interprétation

- L'AUC correspond à la probabilité que le score **ordonne correctement deux observations** prélevées aléatoirement dans les groupes -1 et 1.
- $\text{AUC}(S) = 0.9 \implies$ dans 90% des cas, le score d'un individu positif sera plus grand que le score d'un individu négatif.

Perte AUC et score optimal

- Remarquons que

$$\text{AUC}(S) = \mathbf{E}[\mathbf{1}_{S(X_1) > S(X_2)} | Y_1 = 1, Y_2 = -1].$$

Perte AUC et score optimal

- Remarquons que

$$\text{AUC}(S) = \mathbf{E}[\mathbf{1}_{S(x_1) > S(x_2)} | Y_1 = 1, Y_2 = -1].$$

- L'AUC peut donc s'écrire comme l'espérance d'une fonction de perte particulière

$$\ell((y_1, y_2), (S(x_1), S(x_2))) = \mathbf{1}_{S(x_1) > S(x_2)} \quad \text{avec} \quad y_1 = 1 \text{ et } y_2 = -1.$$

Perte AUC et score optimal

- Remarquons que

$$\text{AUC}(S) = \mathbf{E}[\mathbf{1}_{S(X_1) > S(X_2)} | Y_1 = 1, Y_2 = -1].$$

- L'AUC peut donc s'écrire comme l'espérance d'une fonction de perte particulière

$$\ell((y_1, y_2), (S(x_1), S(x_2))) = \mathbf{1}_{S(x_1) > S(x_2)} \quad \text{avec} \quad y_1 = 1 \text{ et } y_2 = -1.$$

Proposition

Le score optimal par rapport à l'AUC est

$$S^*(x) = \mathbf{P}(Y = 1 | X = x).$$

En effet pour tout score $S : \mathcal{X} \rightarrow \mathbb{R}$ on a

$$\text{AUC}(S^*) \geq \text{AUC}(S).$$

Résumé

	Perte $\ell(y, f(x))$	Risque $\mathcal{R}(f)$	Champion f^*
Régression	$(y - m(x))^2$	$\mathbf{E}[Y - m(X)]^2$	$\mathbf{E}[Y X = x]$
Classif. binaire	$\mathbf{1}_{y \neq g(x)}$	$\mathbf{P}(Y \neq g(X))$	Bayes
Scoring	$\mathbf{1}_{S(x_1) > S(x_2)}$	AUC(S)	$\mathbf{P}(Y = 1 X = x)$

Le package yardstick

- Nous verrons dans la section suivante que ces **critères** se **calculent** (ou plutôt s'**estiment**) en confrontant les valeurs **observées** y_i aux valeurs **prédites** d'un algorithme. Par exemple

```
> head(tbl)
## # A tibble: 6 x 3
##   obs   proba class
##   <fct> <dbl> <fct>
## 1 0     0.117 0
## 2 0     0.288 0
## 3 1     0.994 1
## 4 0     0.528 1
## 5 0     0.577 1
## 6 1     0.997 1
```

Le package yardstick

- Nous verrons dans la section suivante que ces critères se calculent (ou plutôt s'estiment) en confrontant les valeurs observées y_i aux valeurs prédites d'un algorithme. Par exemple

```
> head(tbl)
## # A tibble: 6 x 3
##   obs   proba class
##   <fct> <dbl> <fct>
## 1 0     0.117 0
## 2 0     0.288 0
## 3 1     0.994 1
## 4 0     0.528 1
## 5 0     0.577 1
## 6 1     0.997 1
```

- Le package `yardstick` contient un ensemble de fonctions qui permettent de calculer les critères :

<https://yardstick.tidymodels.org/articles/metric-types.html>

Exemples

- Erreur de classification (ou plutôt accuracy) avec `accuracy` :

```
> library(yardstick)
> tbl %>% accuracy(truth=obs,estimate=class)
## # A tibble: 1 x 3
##   .metric .estimator .estimate
##   <chr>   <chr>       <dbl>
## 1 accuracy binary         0.834
```

Exemples

- Erreur de classification (ou plutôt accuracy) avec `accuracy` :

```
> library(yardstick)
> tbl %>% accuracy(truth=obs, estimate=class)
## # A tibble: 1 x 3
##   .metric .estimator .estimate
##   <chr>   <chr>       <dbl>
## 1 accuracy binary         0.834
```

- AUC avec `roc_auc`

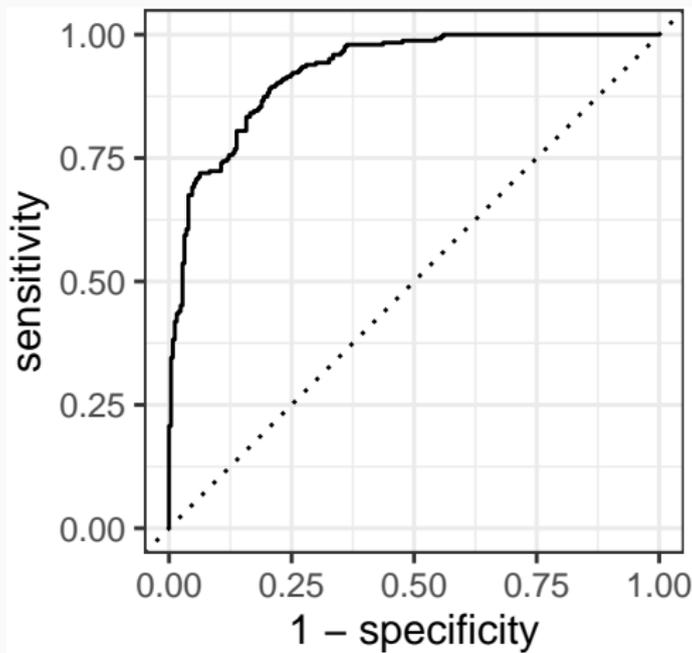
```
> tbl %>% roc_auc(truth=obs, estimate=proba, event_level="second")
## # A tibble: 1 x 3
##   .metric .estimator .estimate
##   <chr>   <chr>       <dbl>
## 1 roc_auc binary         0.926
```

- On peut aussi définir plusieurs critères :

```
> multi_metric <- metric_set(accuracy,bal_accuracy,f_meas,kap)
> tbl %>% multi_metric(truth=obs,estimate=class,event_level="second")
## # A tibble: 4 x 3
##   .metric      .estimator .estimate
##   <chr>        <chr>        <dbl>
## 1 accuracy    binary        0.834
## 2 bal_accuracy binary        0.834
## 3 f_meas      binary        0.832
## 4 kap         binary        0.668
```

- et tracer des courbes ROC avec `roc_curve` et `autoplot`

```
> tbl %>% roc_curve(truth=obs, estimate=proba, event_level="second") %>%  
+ autoplot()
```



Motivations

Quelques exemples

Cadre statistique pour l'apprentissage supervisé

Exemples de fonction de perte

Estimation du risque

Le sur-apprentissage

Le package tidymodels

Annexe : le package caret

Bibliographie

Rappels

- n observations $(X_1, Y_1), \dots, (X_n, Y_n)$ i.i.d à valeurs dans $\mathcal{X} \times \mathcal{Y}$.

Objectif

Etant donnée une fonction de perte $\ell : \mathcal{Y} \times \mathcal{Y} \rightarrow \mathbb{R}^+$, on cherche un **algorithme de prévision** $f_n(x) = f_n(x, \mathcal{D}_n)$ qui soit "proche" de l'oracle f^* défini par

$$f^* \in \underset{f}{\operatorname{argmin}} \mathcal{R}(f)$$

où $\mathcal{R}(f) = \mathbf{E}[\ell(Y, f(X))]$.

Rappels

- n observations $(X_1, Y_1), \dots, (X_n, Y_n)$ i.i.d à valeurs dans $\mathcal{X} \times \mathcal{Y}$.

Objectif

Etant donnée une fonction de perte $\ell : \mathcal{Y} \times \mathcal{Y} \rightarrow \mathbb{R}^+$, on cherche un **algorithme de prévision** $f_n(x) = f_n(x, \mathcal{D}_n)$ qui soit "proche" de l'oracle f^* défini par

$$f^* \in \underset{f}{\operatorname{argmin}} \mathcal{R}(f)$$

où $\mathcal{R}(f) = \mathbf{E}[\ell(Y, f(X))]$.

Question

Etant donné un algorithme f_n , **que vaut son risque** $\mathcal{R}(f_n)$?

Risque empirique

- La loi de (X, Y) étant **inconnue** en pratique, il est **impossible de calculer** $\mathcal{R}(f_n) = \mathbf{E}[\ell(Y, f_n(X))]$.

Risque empirique

- La loi de (X, Y) étant **inconnue** en pratique, il est **impossible de calculer** $\mathcal{R}(f_n) = \mathbf{E}[\ell(Y, f_n(X))]$.
- **Première approche** : $\mathcal{R}(f_n)$ étant une espérance, on peut l'estimer (LGN) par sa **version empirique**

$$\mathcal{R}_n(f_n) = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n \ell(Y_i, f_n(X_i)).$$

Risque empirique

- La loi de (X, Y) étant **inconnue** en pratique, il est **impossible de calculer** $\mathcal{R}(f_n) = \mathbf{E}[\ell(Y, f_n(X))]$.
- **Première approche** : $\mathcal{R}(f_n)$ étant une espérance, on peut l'estimer (LGN) par sa **version empirique**

$$\mathcal{R}_n(f_n) = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n \ell(Y_i, f_n(X_i)).$$

Problème

- L'échantillon \mathcal{D}_n a **déjà été utilisé** pour construire l'algorithme de prévision $f_n \implies$ La LGN ne peut donc s'appliquer !
- **Conséquence** : $\mathcal{R}_n(f_n)$ conduit souvent à une **sous-estimation** de $\mathcal{R}(f_n)$.

Risque empirique

- La loi de (X, Y) étant **inconnue** en pratique, il est **impossible de calculer** $\mathcal{R}(f_n) = \mathbf{E}[\ell(Y, f_n(X))]$.
- **Première approche** : $\mathcal{R}(f_n)$ étant une espérance, on peut l'estimer (LGN) par sa **version empirique**

$$\mathcal{R}_n(f_n) = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n \ell(Y_i, f_n(X_i)).$$

Problème

- L'échantillon \mathcal{D}_n a **déjà été utilisé** pour construire l'algorithme de prévision $f_n \implies$ La LGN ne peut donc s'appliquer !
- **Conséquence** : $\mathcal{R}_n(f_n)$ conduit souvent à une **sous-estimation** de $\mathcal{R}(f_n)$.

Une solution

Utiliser des méthodes de type **validation croisée** ou **bootstrap**.

Apprentissage - Validation ou Validation hold out

- Elle consiste à séparer l'échantillon \mathcal{D}_n en :
 1. un **échantillon d'apprentissage** $\mathcal{D}_{n,app}$ pour construire f_n ;
 2. un **échantillon de validation** $\mathcal{D}_{n,test}$ utilisé pour estimer le risque de f_n .

Apprentissage - Validation ou Validation hold out

- Elle consiste à séparer l'échantillon \mathcal{D}_n en :
 1. un **échantillon d'apprentissage** $\mathcal{D}_{n,app}$ pour construire f_n ;
 2. un **échantillon de validation** $\mathcal{D}_{n,test}$ utilisé pour estimer le risque de f_n .

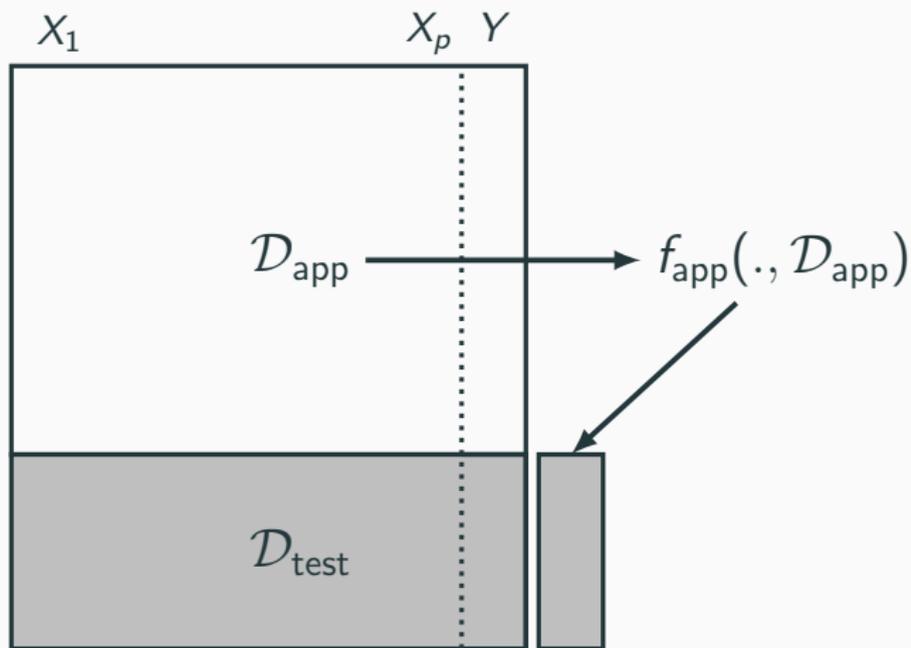
Algorithme

Entrée : $\{\mathcal{A}, \mathcal{T}\}$ une partition de $\{1, \dots, n\}$ en deux parties.

1. Ajuster l'algorithme de prévision en utilisant **uniquement les données d'apprentissage** $\mathcal{D}_{app} = \{(x_i, y_i) : i \in \mathcal{A}\}$. On désigne par $f_{app}(\cdot, \mathcal{D}_{app})$ l'algorithme obtenu.
2. Calculer les valeurs prédites $f_{app}(x_i, \mathcal{D}_{app})$ par l'algorithme pour chaque observation de l'échantillon test $\mathcal{D}_{test} = \{(x_i, y_i) : i \in \mathcal{T}\}$

Retourner :

$$\frac{1}{|\mathcal{T}|} \sum_{i \in \mathcal{T}} \ell(y_i, f_{app}(x_i, \mathcal{D}_{app})).$$



Commentaires

Nécessite d'avoir un **nombre suffisant d'observations** dans

1. \mathcal{D}_{app} pour bien ajuster l'algorithme de prévision ;
2. $\mathcal{D}_{\text{test}}$ pour bien estimer l'erreur de l'algorithme.

Validation croisée K -blocs

- **Principe** : répéter la hold out sur **différentes partitions**.

Algorithme - CV

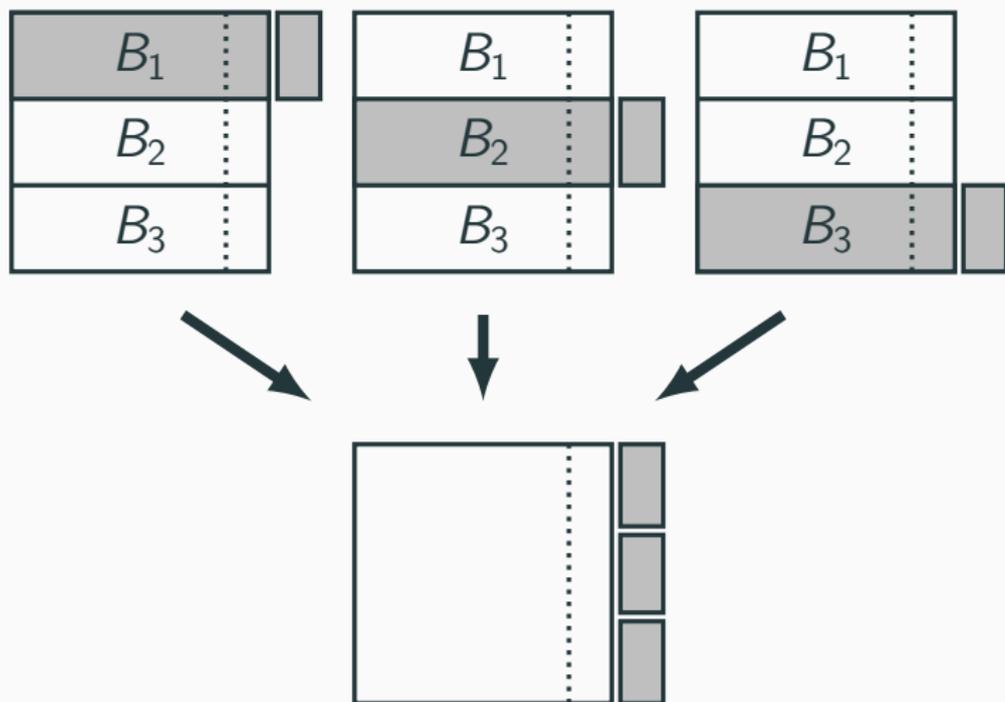
Entrée : $\{B_1, \dots, B_K\}$ une partition de $\{1, \dots, n\}$ en K blocs.

Pour $k = 1, \dots, K$:

1. Ajuster l'algorithme de prévision en utilisant **l'ensemble des données privé du k^e bloc**, c'est-à-dire $B_k = \{(x_i, y_i) : i \in \{1, \dots, n\} \setminus B_k\}$. On désigne par $f_k(\cdot) = f_k(\cdot, B_k)$ l'algorithme obtenu.
2. Calculer la valeur prédite par l'algorithme pour chaque observation du bloc k : $f_k(x_i)$, $i \in B_k$ et en déduire le **risque sur le bloc k** :

$$\widehat{\mathcal{R}}(f_k) = \frac{1}{|B_k|} \sum_{i \in B_k} \ell(y_i, f_k(x_i)).$$

Retourner : $\frac{1}{K} \sum_{k=1}^K \widehat{\mathcal{R}}(f_k)$.



Commentaires

- Le **choix de K** doit être fait par l'utilisateur (souvent $K = 10$).
- **Avantage** : plus adapté que la technique apprentissage/validation \implies **plus stable et précis**.
- **Inconvénient** : plus couteux en **temps de calcul**.

Commentaires

- Le **choix de K** doit être fait par l'utilisateur (souvent $K = 10$).
- **Avantage** : plus adapté que la technique apprentissage/validation \implies **plus stable et précis**.
- **Inconvénient** : plus couteux en **temps de calcul**.

Leave one out

- Lorsque $K = n$, on parle de validation croisée **leave one out** ;
- Le risque est alors estimé par

$$\widehat{\mathcal{R}}_n(f_n) = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n \ell(Y_i, f_n^i(X_i))$$

où f_n^i désigne l'algorithme de prévision construit sur \mathcal{D}_n **amputé de la i -ème observation**.

\implies recommandé uniquement lorsque **n est petit**.

- Estimation par pénalisation : critère ajustement/complexité, C_p de Mallows, AIC-BIC...
- Validation croisée Monte-Carlo : répéter plusieurs fois la validation hold out ;
- Bootstrap : notamment Out Of Bag ;
- voir [[Wikistat, 2020b](#)].

Motivations

Quelques exemples

Cadre statistique pour l'apprentissage supervisé

Exemples de fonction de perte

Estimation du risque

Le sur-apprentissage

Le package tidymodels

Annexe : le package caret

Bibliographie

- La plupart des modèles statistiques renvoient des estimateurs qui dépendent de paramètres λ à calibrer.

- La plupart des modèles statistiques renvoient des estimateurs qui dépendent de paramètres λ à calibrer.

Exemples

- nombres de variables dans un modèle linéaire ou logistique.
- paramètre de pénalités pour les régressions pénalisées.
- profondeur des arbres.
- nombre de plus proches voisins.
- nombre d'itérations en boosting.
- ...

- La plupart des modèles statistiques renvoient des estimateurs qui dépendent de paramètres λ à calibrer.

Exemples

- nombres de variables dans un modèle linéaire ou logistique.
- paramètre de pénalités pour les régressions pénalisées.
- profondeur des arbres.
- nombre de plus proches voisins.
- nombre d'itérations en boosting.
- ...

Remarque importante

Le choix de ces paramètres est le plus souvent crucial pour la performance de l'estimateur sélectionné.

- Le paramètre λ à sélectionner représente la **complexité du modèle** :

- Le paramètre λ à sélectionner représente la **complexité du modèle** :

Complexité \implies compromis biais/variance

- λ petit \implies modèle peu flexible \implies mauvaise adéquation sur les données \implies biais \nearrow , variance \searrow .

- Le paramètre λ à sélectionner représente la **complexité du modèle** :

Complexité \implies compromis biais/variance

- λ petit \implies modèle peu flexible \implies mauvaise adéquation sur les données \implies biais \nearrow , variance \searrow .
- λ grand \implies modèle trop flexible \implies **sur-ajustement** \implies biais \searrow , variance \nearrow .

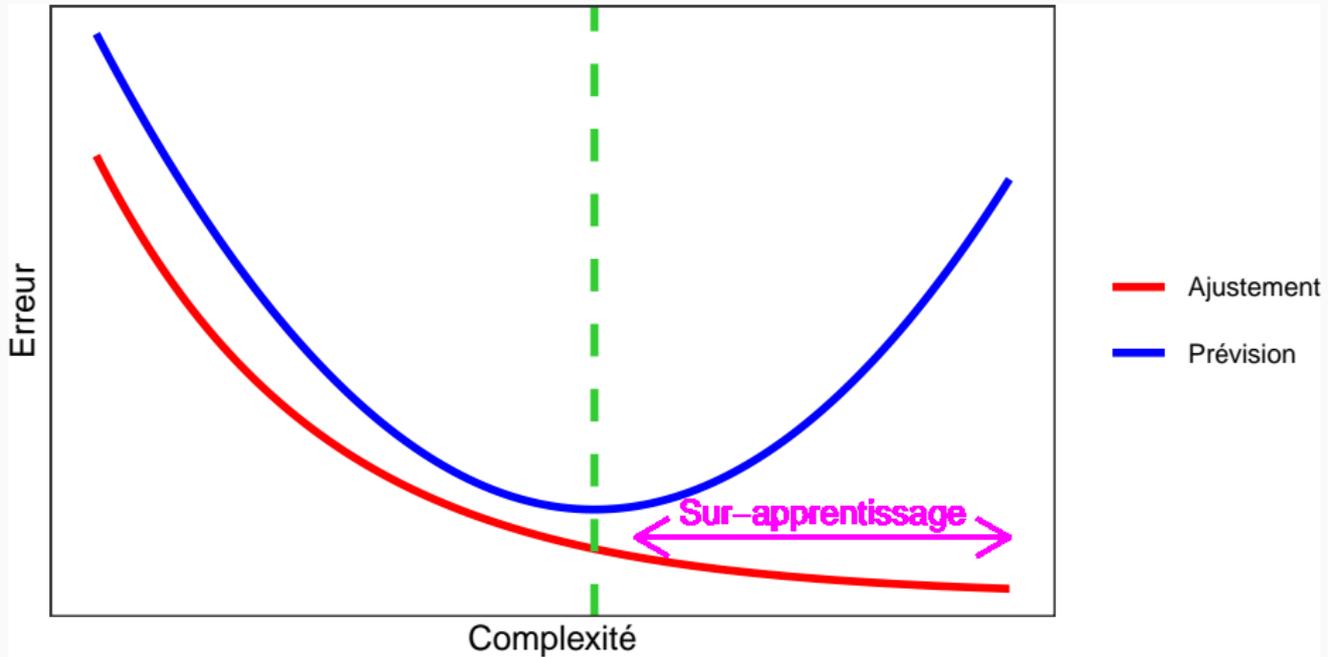
- Le paramètre λ à sélectionner représente la **complexité du modèle** :

Complexité \implies compromis biais/variance

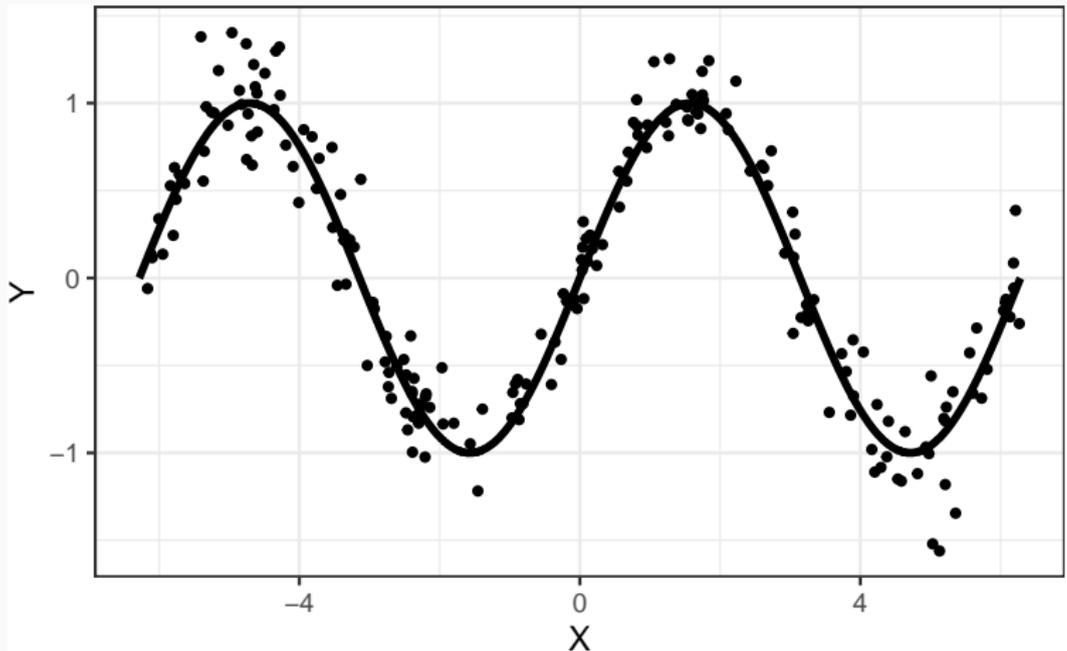
- λ petit \implies modèle peu flexible \implies mauvaise adéquation sur les données \implies biais \nearrow , variance \searrow .
- λ grand \implies modèle trop flexible \implies **sur-ajustement** \implies biais \searrow , variance \nearrow .

Overfitting

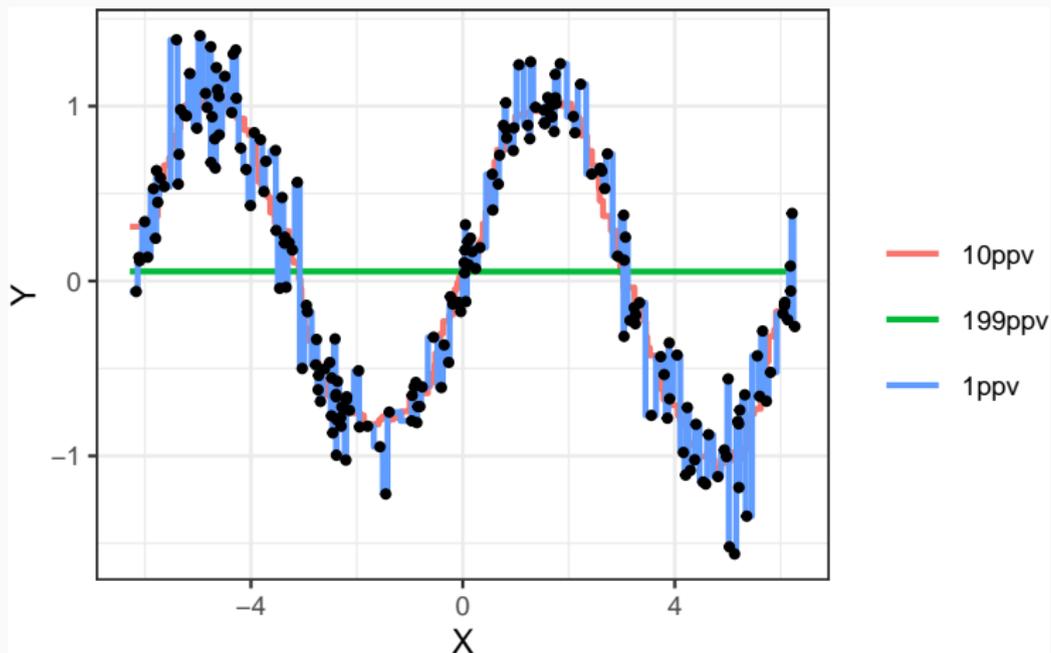
Sur-ajuster signifie que le modèle va (trop) bien ajuster les données d'apprentissage, il aura du mal à s'adapter à de nouveaux individus.



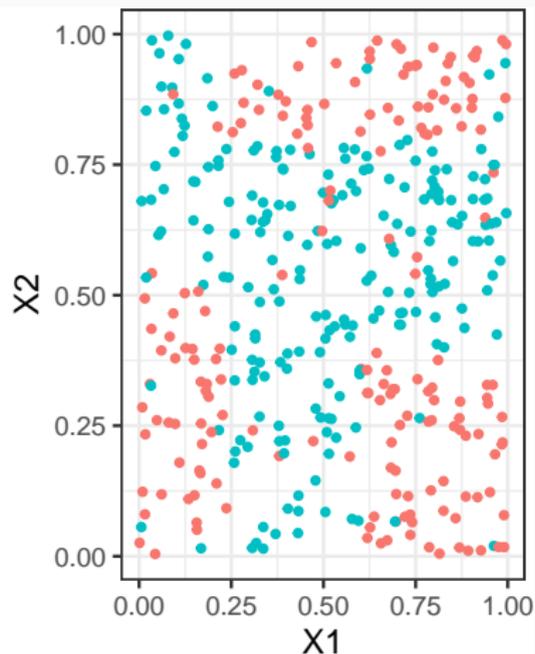
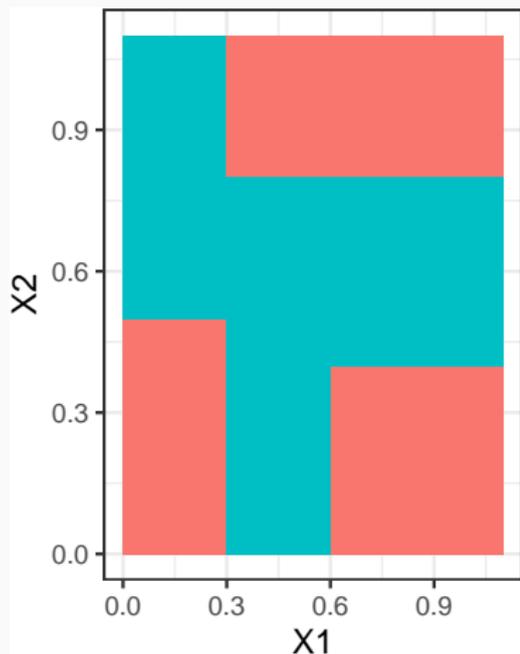
Overfitting en régression



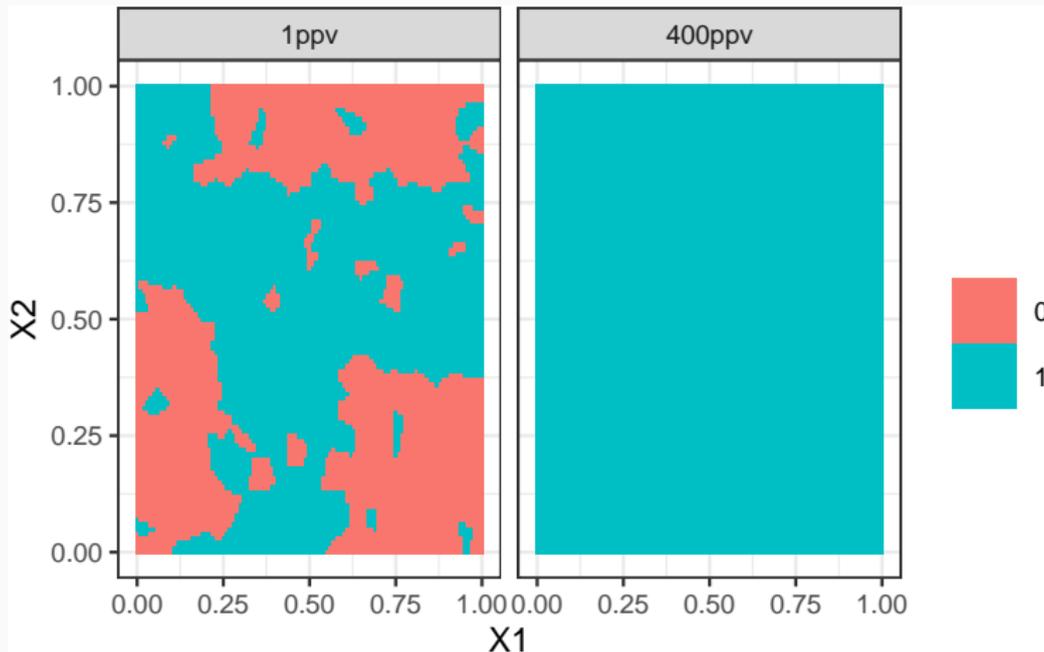
Overfitting en régression



Overfitting en classification supervisée



Overfitting en classification supervisée



Application shiny

https://lrouviere.shinyapps.io/overfitting_app/

Motivations

Quelques exemples

Cadre statistique pour l'apprentissage supervisé

Exemples de fonction de perte

Estimation du risque

Le sur-apprentissage

Le package tidymodels

Annexe : le package caret

Bibliographie

Présentation du package

- Successeur de `caret` pour conduire des projets machine learning sur R.
- Meta package qui inclut
 - `rsample` : pour ré-échantillonner
 - `yardstick` : pour les fonctions de perte
 - `recipe` : pour les recettes de préparation... des données
 - `tune` : pour calibrer les algorithmes
 - ...
- Tutoriel : <https://www.tidymodels.org>

Calibrer des paramètres

- Tous les algorithmes dépendent de **paramètres** θ que l'utilisateur doit sélectionner.
- Le procédé est **toujours le même** et peut se résumer dans l'algorithme suivant.

Choix de paramètres par minimisation du risque (grid search)

Entrées :

- Une grille `grille.theta` de valeurs pour θ ;
- Un risque de prévision \mathcal{R} ;
- un algorithme d'estimation du risque.

Pour chaque θ dans `grille.theta` :

- Estimer $\mathcal{R}(f_{n,\theta})$ par l'algorithme choisi $\implies \widehat{\mathcal{R}}(f_{n,\theta})$

Retourner : $\widehat{\theta}$ une valeur de θ qui minimise $\widehat{\mathcal{R}}(f_{n,\theta})$.

- Ce procédé est automatisé dans tidymodels.
- Il faut spécifier les différents paramètres :
 - la méthode (logistique, ppv, arbre, randomForest...)
 - Une grille pour les paramètres (nombre de ppv...)
 - Le critère de performance (erreur de classification, AUC, risque quadratique...)
 - La méthode d'estimation du critère (apprentissage validation, validation croisée, bootstrap...)

- Ce procédé est **automatisé** dans **tidymodels**.
- Il faut spécifier les différents paramètres :
 - la **méthode** (logistique, ppv, arbre, randomForest...)
 - Une grille pour les **paramètres** (nombre de ppv...)
 - Le **critère de performance** (erreur de classification, AUC, risque quadratique...)
 - La méthode d'**estimation du critère** (apprentissage validation, validation croisée, bootstrap...)
- Nous l'illustrons à travers le **choix du nombre de voisins** de l'algorithme des k -ppv.

- Une variable binaire à expliquer par 2 variables continues

```
> head(don.2D.500)
## # A tibble: 6 x 3
##       X1     X2 Y
##   <dbl> <dbl> <fct>
## 1 0.721 0.209 0
## 2 0.876 0.766 1
## 3 0.761 0.842 1
## 4 0.886 0.934 0
## 5 0.456 0.676 0
## 6 0.166 0.859 1
```

- On commence par renseigner l'**algorithme** et la manière dont on va **choisir les paramètres**.

```
> library(tidymodels)
> tune_spec <-
+   nearest_neighbor(neighbors=tune(),weight_func="rectangular") %>%
+   set_mode("classification") %>%
+   set_engine("kkn")
```

Le workflow

- On commence par renseigner l'**algorithme** et la manière dont on va **choisir les paramètres**.

```
> library(tidymodels)
> tune_spec <-
+   nearest_neighbor(neighbors=tune(),weight_func="rectangular") %>%
+   set_mode("classification") %>%
+   set_engine("kkn")
```

- On crée ensuite la **workflow** :

```
> ppv_wf <- workflow() %>%
+   add_model(tune_spec) %>%
+   add_formula(Y ~ .)
```

Ré-échantillonnage et grille de paramètres

- On spécifie ensuite la **méthode de ré-échantillonnage**, ici une **validation croisée 10 blocs**

```
> set.seed(12345)
> re_ech_cv <- vfold_cv(don.2D.500, v=10)
> re_ech_cv %>% head()
## # A tibble: 6 x 2
##   splits          id
##   <list>         <chr>
## 1 <split [450/50]> Fold01
## 2 <split [450/50]> Fold02
## 3 <split [450/50]> Fold03
## 4 <split [450/50]> Fold04
## 5 <split [450/50]> Fold05
## 6 <split [450/50]> Fold06
```

Ré-échantillonnage et grille de paramètres

- On spécifie ensuite la **méthode de ré-échantillonnage**, ici une **validation croisée 10 blocs**

```
> set.seed(12345)
> re_ech_cv <- vfold_cv(don.2D.500, v=10)
> re_ech_cv %>% head()
## # A tibble: 6 x 2
##   splits          id
##   <list>         <chr>
## 1 <split [450/50]> Fold01
## 2 <split [450/50]> Fold02
## 3 <split [450/50]> Fold03
## 4 <split [450/50]> Fold04
## 5 <split [450/50]> Fold05
## 6 <split [450/50]> Fold06
```

- Puis vient la **grille de paramètres**

```
> grille_k <- tibble(neighbors=1:100)
```

⇒ consulter <https://www.tidymodels.org/find/parsnip/> pour trouver les **identifiants** des algorithmes et de leurs paramètres.

Estimation du risque

- Fonction `tune_grid`

```
> tune_grid(..., resamples=..., grid=..., metrics=...)
```

Estimation du risque

- Fonction `tune_grid`

```
> tune_grid(..., resamples=..., grid=..., metrics=...)
```

- Calcul du **risque** pour chaque valeur de la grille :

```
> ppv.cv <- ppv_wf %>%  
+   tune_grid(  
+     resamples = re_ech_cv,  
+     grid = grille_k,  
+     metrics=metric_set(accuracy))
```

Estimation du risque

- Fonction `tune_grid`

```
> tune_grid(..., resamples=..., grid=..., metrics=...)
```

- Calcul du **risque** pour chaque valeur de la grille :

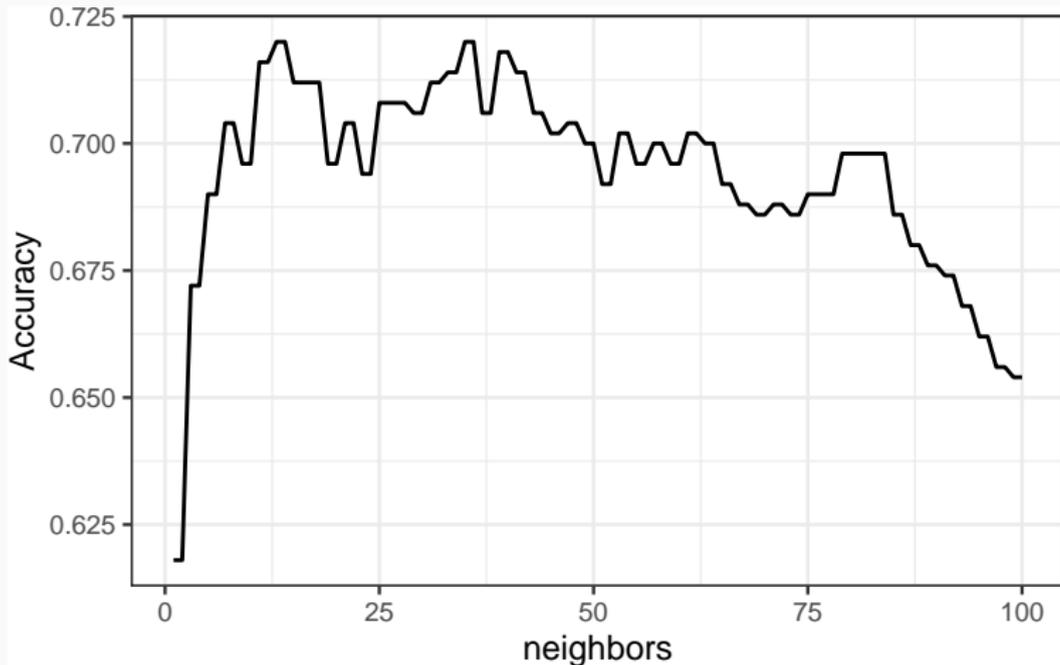
```
> ppv.cv <- ppv_wf %>%  
+   tune_grid(  
+     resamples = re_ech_cv,  
+     grid = grille_k,  
+     metrics=metric_set(accuracy))
```

- On lit les résultats avec `collect_metrics` :

```
> ppv.cv %>% collect_metrics() %>% select(1:5) %>% head()  
## # A tibble: 6 x 5  
##   neighbors .metric .estimator mean     n  
##     <int> <chr>      <chr>    <dbl> <int>  
## 1         1 accuracy binary   0.618    10  
## 2         2 accuracy binary   0.618    10  
## 3         3 accuracy binary   0.672    10  
## 4         4 accuracy binary   0.672    10  
## 5         5 accuracy binary   0.69     10  
## 6         6 accuracy binary   0.69     10
```

Visualisation des erreurs

```
> tbl <- ppv.cv %>% collect_metrics()  
> ggplot(tbl)+aes(x=neighbors,y=mean)+geom_line()+ylab("Accuracy")
```



Sélection du meilleur paramètre

- On visualise les **meilleures** valeurs de paramètres :

```
> ppv.cv %>% show_best() %>% select(1:6)
## # A tibble: 5 x 6
##   neighbors .metric .estimator  mean     n std_err
##   <int> <chr>      <chr>    <dbl> <int> <dbl>
## 1      13 accuracy binary    0.72     10 0.0255
## 2      14 accuracy binary    0.72     10 0.0255
## 3      35 accuracy binary    0.72     10 0.0207
## 4      36 accuracy binary    0.72     10 0.0207
## 5      39 accuracy binary    0.718    10 0.0199
```

Sélection du meilleur paramètre

- On visualise les **meilleures** valeurs de paramètres :

```
> ppv.cv %>% show_best() %>% select(1:6)
## # A tibble: 5 x 6
##   neighbors .metric .estimator mean     n std_err
##   <int> <chr>      <chr>    <dbl> <int> <dbl>
## 1      13 accuracy binary    0.72    10 0.0255
## 2      14 accuracy binary    0.72    10 0.0255
## 3      35 accuracy binary    0.72    10 0.0207
## 4      36 accuracy binary    0.72    10 0.0207
## 5      39 accuracy binary    0.718   10 0.0199
```

- et on choisit celle qui **maximise l'accuracy** :

```
> best_k <- ppv.cv %>% select_best()
> best_k
## # A tibble: 1 x 2
##   neighbors .config
##   <int> <chr>
## 1      13 Preprocessor1_Model013
```

Algorithme final et prévision

- L'**algorithme final** s'obtient en entraînant la méthode sur **toutes les données** pour la **valeur de paramètre sélectionné** :

```
> final_ppv <-  
+   ppv_wf %>%  
+   finalize_workflow(best_k) %>%  
+   fit(data = don.2D.500)
```

Algorithme final et prévision

- L'**algorithme final** s'obtient en entraînant la méthode sur **toutes les données** pour la **valeur de paramètre sélectionné** :

```
> final_ppv <-  
+   ppv_wf %>%  
+   finalize_workflow(best_k) %>%  
+   fit(data = don.2D.500)
```

- On peut maintenant prédire de nouveaux individus :

```
> newx <- tibble(X1=0.3,X2=0.8)  
> predict(final_ppv,new_data=newx)  
## # A tibble: 1 x 1  
##   .pred_class  
##   <fct>  
## 1 0
```

Conclusion

- Les choix de l'utilisateur sont des paramètres de la procédure.
- \implies facilement personnalisable.
- Aisé de changer le critère, la méthode de ré-échantillonnage...

Motivations

Quelques exemples

Cadre statistique pour l'apprentissage supervisé

Exemples de fonction de perte

Estimation du risque

Le sur-apprentissage

Le package tidymodels

Annexe : le package caret

Bibliographie

- Il permet d'évaluer la performance de **plus de 230 méthodes** :
<http://topepo.github.io/caret/index.html>

Le package caret

- Il permet d'évaluer la performance de **plus de 230 méthodes** :
<http://topepo.github.io/caret/index.html>
- Il suffit d'indiquer :
 - la **méthode** (logistique, ppv, arbre, randomForest...)
 - Une grille pour les **paramètres** (nombre de ppv...)
 - Le **critère de performance** (erreur de classification, AUC, risque quadratique...)
 - La méthode d'**estimation du critère** (apprentissage validation, validation croisée, bootstrap...)

Apprentissage-validation

```
> library(caret)
> K_cand <- data.frame(k=seq(1,500,by=20))
> library(caret)
> ctrl1 <- trainControl(method="LGOCV",number=1,index=list(1:1500))
> e1 <- train(Y~.,data=donnees,method="knn",trControl=ctrl1,tuneGrid=K_cand)
> e1

## k-Nearest Neighbors
##
## 2000 samples
##    2 predictor
##    2 classes: '0', '1'
##
## No pre-processing
## Resampling: Repeated Train/Test Splits Estimated (1 reps, 75%)
## Summary of sample sizes: 1500
## Resampling results across tuning parameters:
##
##    k    Accuracy  Kappa
##    1  0.620     0.2382571
##   21  0.718     0.4342076
##   41  0.722     0.4418388
```

```
## 61 0.718 0.4344073
## 81 0.720 0.4383195
## 101 0.714 0.4263847
## 121 0.716 0.4304965
## 141 0.718 0.4348063
## 161 0.718 0.4348063
## 181 0.718 0.4348063
## 201 0.720 0.4387158
## 221 0.718 0.4350056
## 241 0.718 0.4350056
## 261 0.722 0.4428232
## 281 0.714 0.4267894
## 301 0.714 0.4269915
## 321 0.710 0.4183621
## 341 0.696 0.3893130
## 361 0.696 0.3893130
## 381 0.688 0.3727988
## 401 0.684 0.3645329
## 421 0.686 0.3686666
## 441 0.686 0.3679956
## 461 0.684 0.3638574
## 481 0.680 0.3558050
```

```
## Accuracy was used to select the optimal model using the largest value.
```

```
## The final value used for the model was k = 261.
```

Validation croisée

```
> library(doMC)
> registerDoMC(cores = 3)
> ctrl12 <- trainControl(method="cv",number=10)
> e2 <- train(Y~.,data=dapp,method="knn",trControl=ctrl12,tuneGrid=K_cand)
> e2
## k-Nearest Neighbors
##
## 1500 samples
##    2 predictor
##    2 classes: '0', '1'
##
## No pre-processing
## Resampling: Cross-Validated (10 fold)
## Summary of sample sizes: 1350, 1350, 1350, 1350, 1350, 1350, ...
## Resampling results across tuning parameters:
##
##   k    Accuracy   Kappa
##   1  0.6240000  0.2446251
##   21 0.7393333  0.4745290
##   41 0.7306667  0.4570024
##   61 0.7340000  0.4636743
```

```
##      81  0.7333333  0.4632875
##     101  0.7313333  0.4593480
##     121  0.7326667  0.4624249
##     141  0.7333333  0.4640787
##     161  0.7366667  0.4708178
##     181  0.7313333  0.4602309
##     201  0.7326667  0.4626618
##     221  0.7293333  0.4559741
##     241  0.7306667  0.4585960
##     261  0.7353333  0.4676751
##     281  0.7286667  0.4537842
##     301  0.7253333  0.4463516
##     321  0.7173333  0.4294524
##     341  0.7113333  0.4168003
##     361  0.7080000  0.4099303
##     381  0.7140000  0.4213569
##     401  0.7073333  0.4073761
##     421  0.7100000  0.4126434
##     441  0.7066667  0.4054984
##     461  0.6966667  0.3844183
##     481  0.6860000  0.3612515
##
```

```
## Accuracy was used to select the optimal model using the largest value.
```

```
## The final value used for the model was k = 21.
```

Validation croisée répétée

```
> ctrl3 <- trainControl(method="repeatedcv",repeats=5,number=10)
> e3 <- train(Y~.,data=dapp,method="knn",trControl=ctrl3,tuneGrid=K_cand)
> e3
## k-Nearest Neighbors
##
## 1500 samples
##    2 predictor
##    2 classes: '0', '1'
##
## No pre-processing
## Resampling: Cross-Validated (10 fold, repeated 5 times)
## Summary of sample sizes: 1350, 1350, 1350, 1350, 1350, 1350, ...
## Resampling results across tuning parameters:
##
##    k    Accuracy    Kappa
##    1  0.6232000  0.2438066
##   21  0.7354667  0.4665640
##   41  0.7314667  0.4585144
##   61  0.7317333  0.4592608
##   81  0.7302667  0.4568784
##  101  0.7310667  0.4589567
```

```
## 121 0.7320000 0.4609326
## 141 0.7322667 0.4616077
## 161 0.7336000 0.4643374
## 181 0.7340000 0.4649895
## 201 0.7332000 0.4632905
## 221 0.7325333 0.4620114
## 241 0.7316000 0.4600484
## 261 0.7305333 0.4578098
## 281 0.7286667 0.4536040
## 301 0.7238667 0.4434101
## 321 0.7189333 0.4330787
## 341 0.7136000 0.4215865
## 361 0.7122667 0.4183400
## 381 0.7098667 0.4131761
## 401 0.7090667 0.4112403
## 421 0.7058667 0.4043164
## 441 0.7001333 0.3920207
## 461 0.6952000 0.3811374
## 481 0.6872000 0.3636126
##
## Accuracy was used to select the optimal model using the largest value.
## The final value used for the model was k = 21.
```

Critère AUC

```
> donnees1 <- donnees
> names(donnees1)[3] <- c("Class")
> levels(donnees1$Class) <- c("G0", "G1")
> ctrl11 <- trainControl(method="LGOVCV", number=1, index=list(1:1500),
+                        classProbs=TRUE, summary=twoClassSummary)
> e4 <- train(Class~., data=donnees1, method="knn", trControl=ctrl11,
+            metric="ROC", tuneGrid=K_cand)
> e4
## k-Nearest Neighbors
##
## 2000 samples
##    2 predictor
##    2 classes: 'G0', 'G1'
##
## No pre-processing
## Resampling: Repeated Train/Test Splits Estimated (1 reps, 75%)
## Summary of sample sizes: 1500
## Resampling results across tuning parameters:
##
```

##	k	ROC	Sens	Spec
##	1	0.6190866	0.5983264	0.6398467
##	21	0.7171484	0.6903766	0.7432950
##	41	0.7229757	0.6861925	0.7547893
##	61	0.7200500	0.6945607	0.7394636
##	81	0.7255567	0.6945607	0.7432950
##	101	0.7319450	0.6903766	0.7356322
##	121	0.7382452	0.6945607	0.7356322
##	141	0.7353757	0.7029289	0.7318008
##	161	0.7308549	0.7029289	0.7318008
##	181	0.7351272	0.7029289	0.7318008
##	201	0.7340050	0.7029289	0.7356322
##	221	0.7324099	0.7071130	0.7279693
##	241	0.7349028	0.7071130	0.7279693
##	261	0.7365780	0.7071130	0.7356322
##	281	0.7349749	0.6987448	0.7279693
##	301	0.7356963	0.7029289	0.7241379
##	321	0.7341493	0.6861925	0.7318008
##	341	0.7343898	0.6527197	0.7356322
##	361	0.7306385	0.6527197	0.7356322
##	381	0.7301816	0.6359833	0.7394636
##	401	0.7270957	0.6276151	0.7356322
##	421	0.7255487	0.6317992	0.7356322

```
## 441 0.7258933 0.6192469 0.7471264
## 461 0.7220619 0.6150628 0.7471264
## 481 0.7236330 0.6108787 0.7432950
##
## ROC was used to select the optimal model using the largest value.
## The final value used for the model was k = 121.
```

Motivations

Quelques exemples

Cadre statistique pour l'apprentissage supervisé

Exemples de fonction de perte

Estimation du risque

Le sur-apprentissage

Le package tidymodels

Annexe : le package caret

Bibliographie

-  Besse, P. (2018).
Science des données - Apprentissage Statistique.
INSA - Toulouse.
http://www.math.univ-toulouse.fr/~besse/pub/Appren_stat.pdf.
-  Bousquet, O., Boucheron, S., and Lugosi, G. (2003).
Introduction to Statistical Learning Theory, chapter **Advanced Lectures on Machine Learning**.
Springer.
-  Cléménçon, S., Lugosi, G., and Vayatis, N. (2008).
Ranking and empirical minimization of u-statistics.
The Annals of Statistics, 36(2) :844–874.

-  Hastie, T., Tibshirani, R., and Friedman, J. (2009).
The Elements of Statistical Learning : Data Mining, Inference, and Prediction.
Springer, second edition.
-  James, G., Witten, D., Hastie, T., and Tibshirani, R. (2015).
The Elements of Statistical Learning : Data Mining, Inference, and Prediction.
Springer.
-  Vapnik, V. (2000).
The Nature of Statistical Learning Theory.
Springer, second edition.



Wikistat (2020a).

Apprentissage machine — introduction.

<http://wikistat.fr/pdf/st-m-Intro-ApprentStat.pdf>.



Wikistat (2020b).

Qualité de prévision et risque.

<http://wikistat.fr/pdf/st-m-app-risque.pdf>.

Deuxième partie II

Algorithmes linéaires

Estimation par moindres carrés

Sélection de variables

Régularisation

Régression ridge

Régression Lasso

Variantes de ridge/lasso

Discrimination binaire

Support vector machine

SVM - cas séparable

SVM : cas non séparable

SVM non linéaire : astuce du noyau

Scores et probabilités

Compléments : SVM multi-classes et SVR

SVM multiclass

Support vector regression (SVR)

- **Rappel** : une fonction de prévision $f : \mathbb{R}^d \rightarrow \mathbb{R}$.

- **Rappel** : une fonction de prévision $f : \mathbb{R}^d \rightarrow \mathbb{R}$.

Fonction de prévision linéaire

Une fonction de prévision est dite **linéaire** si elle se met sous la forme

$$f(x) = f_{\beta}(x) = \beta_0 + \beta_1 x_1 + \dots + \beta_d x_d.$$

- **Rappel** : une fonction de prévision $f : \mathbb{R}^d \rightarrow \mathbb{R}$.

Fonction de prévision linéaire

Une fonction de prévision est dite **linéaire** si elle se met sous la forme

$$f(x) = f_{\beta}(x) = \beta_0 + \beta_1 x_1 + \dots + \beta_d x_d.$$

Remarque

- Possibilité d'inclure des **effets non linéaires** :

$$f_{\beta}(x) = \beta_0 + \beta_{11} x_1 + \beta_{12} x_1^2 + \beta_{21} x_2 + \beta_{22} x_2^2 + \beta_{12} x_1 x_2 + \beta_{31} x_3 + \beta_{32} \exp(x_3) \dots$$

- Variables **qualitatives** codées en indicatrices :

$$f_{\beta}(x) = \beta_0 + \beta_1 \mathbf{1}_{x_1=A} + \beta_2 \mathbf{1}_{x_1=B} + \beta_3 \mathbf{1}_{x_1=C} + \dots$$

muni d'une contrainte identifiante, par exemple $\beta_1 = 0$.

- Y à valeurs dans \mathbb{R} .
- On utilise souvent le terme **modèle linéaire** :

$$y_i = \beta_0 + \beta_1 x_{i1} + \dots + \beta_d x_{id} + \varepsilon_i$$

où les ε_j sont i.i.d tels que $\mathbf{E}[\varepsilon_j] = 0$ et $\mathbf{V}[\varepsilon_j] = \sigma^2$.

- Y à valeurs dans \mathbb{R} .
- On utilise souvent le terme **modèle linéaire** :

$$y_i = \beta_0 + \beta_1 x_{i1} + \dots + \beta_d x_{id} + \varepsilon_i$$

où les ε_i sont i.i.d tels que $\mathbf{E}[\varepsilon_i] = 0$ et $\mathbf{V}[\varepsilon_i] = \sigma^2$.

- **Fonction de prévision** :

$$m_\beta(x) = \mathbf{E}[Y|X = x] = \beta_0 + \beta_1 x_1 + \dots + \beta_d x_d.$$

Classification binaire

- Y à valeurs dans $\{0, 1\}$.
- La classification s'effectue à partir de la probabilité

$$p(x) = \mathbf{P}(Y = 1|X = x).$$

Classification binaire

- Y à valeurs dans $\{0, 1\}$.
- La classification s'effectue à partir de la probabilité

$$p(x) = \mathbf{P}(Y = 1|X = x).$$

- **Frontière entre les deux classes :**

$$\{x : p(x) = 1 - p(x)\} = \left\{ x : \log \frac{p(x)}{1 - p(x)} = 0 \right\}.$$

Classification binaire

- Y à valeurs dans $\{0, 1\}$.
- La classification s'effectue à partir de la probabilité

$$p(x) = \mathbf{P}(Y = 1|X = x).$$

- **Frontière entre les deux classes** :

$$\{x : p(x) = 1 - p(x)\} = \left\{ x : \log \frac{p(x)}{1 - p(x)} = 0 \right\}.$$

- La frontière est **linéaire** si

$$\log \frac{p(x)}{1 - p(x)} = \beta_0 + \beta_1 x_1 + \dots + \beta_d x_d.$$

Classification binaire

- Y à valeurs dans $\{0, 1\}$.
- La classification s'effectue à partir de la probabilité

$$p(x) = \mathbf{P}(Y = 1|X = x).$$

- **Frontière entre les deux classes** :

$$\{x : p(x) = 1 - p(x)\} = \left\{ x : \log \frac{p(x)}{1 - p(x)} = 0 \right\}.$$

- La frontière est **linéaire** si

$$\log \frac{p(x)}{1 - p(x)} = \beta_0 + \beta_1 x_1 + \dots + \beta_d x_d.$$

- \implies **Modèle logistique.**

1. Comment **calculer** (ou plutôt **estimer**) les β_j ?

1. Comment **calculer** (ou plutôt **estimer**) les β_j ?
 - MCO-vraisemblance
 - Approches régularisées \implies ridge-lasso...
 - Machines à support vecteur (SVM).

1. Comment **calculer** (ou plutôt **estimer**) les β_j ?
 - MCO-vraisemblance
 - Approches régularisées \implies ridge-lasso...
 - Machines à support vecteur (SVM).
2. Comment **choisir** la combinaison linéaire?

1. Comment **calculer** (ou plutôt **estimer**) les β_j ?

- MCO-vraisemblance
- Approches régularisées \implies ridge-lasso...
- Machines à support vecteur (SVM).

2. Comment **choisir** la combinaison linéaire ?

- Sélection de variables
- Régression sur composantes \implies PCR-PLS...
- Transformation de variables \implies résidus partiels, modèle additifs...

Estimation par moindres carrés

Sélection de variables

Régularisation

- Régression ridge

- Régression Lasso

- Variantes de ridge/lasso

- Discrimination binaire

Support vector machine

- SVM - cas séparable

- SVM : cas non séparable

- SVM non linéaire : astuce du noyau

- Scores et probabilités

- Compléments : SVM multi-classes et SVR

 - SVM multiclass

 - Support vector regression (SVR)

Minimiser les erreurs

- Les **données** : $(x_1, y_1), \dots, (x_n, y_n)$ à valeurs dans $\mathbb{R}^d \times \mathbb{R}$.
- Le **modèle**

$$y_i = \beta_0 + \beta_1 x_{i1} + \dots + \beta_d x_{id} + \varepsilon_i$$

Minimiser les erreurs

- Les **données** : $(x_1, y_1), \dots, (x_n, y_n)$ à valeurs dans $\mathbb{R}^d \times \mathbb{R}$.
- Le **modèle**

$$y_i = \beta_0 + \beta_1 x_{i1} + \dots + \beta_d x_{id} + \varepsilon_i$$

- ε_i représente **l'écart (ou l'erreur)** entre la prévision du modèle β et la valeur observée.

Minimiser les erreurs

- Les **données** : $(x_1, y_1), \dots, (x_n, y_n)$ à valeurs dans $\mathbb{R}^d \times \mathbb{R}$.
- Le **modèle**

$$y_i = \beta_0 + \beta_1 x_{i1} + \dots + \beta_d x_{id} + \varepsilon_i$$

- ε_i représente **l'écart (ou l'erreur)** entre la prévision du modèle β et la valeur observée.

Idée

Choisir β de manière à **minimiser ces erreurs**.

Estimateurs des moindres carrés

Définition

On appelle **critère des moindres carrés ordinaires** ou **somme des carrés résiduelles** la fonction de β :

$$\text{SCR}(\beta) = \sum_{i=1}^n (y_i - (\beta_0 + \beta_1 x_{i1} + \dots + \beta_d x_{id}))^2 = \|\mathbb{Y} - \mathbb{X}\beta\|^2$$

avec

$$\mathbb{Y} = \begin{pmatrix} y_1 \\ \vdots \\ y_n \end{pmatrix} \quad \text{et} \quad \mathbb{X} = \begin{pmatrix} 1 & x_{11} & \dots & x_{1d} \\ \vdots & \vdots & & \vdots \\ 1 & x_{n1} & \dots & x_{nd} \end{pmatrix}.$$

Estimateurs des moindres carrés

Définition

On appelle **critère des moindres carrés ordinaires** ou **somme des carrés résiduelles** la fonction de β :

$$\text{SCR}(\beta) = \sum_{i=1}^n (y_i - (\beta_0 + \beta_1 x_{i1} + \dots + \beta_d x_{id}))^2 = \|\mathbb{Y} - \mathbb{X}\beta\|^2$$

avec

$$\mathbb{Y} = \begin{pmatrix} y_1 \\ \vdots \\ y_n \end{pmatrix} \quad \text{et} \quad \mathbb{X} = \begin{pmatrix} 1 & x_{11} & \dots & x_{1d} \\ \vdots & \vdots & & \vdots \\ 1 & x_{n1} & \dots & x_{nd} \end{pmatrix}.$$

Propriété

Si \mathbb{X} est de plein rang alors l'**estimateur des MCO** $\hat{\beta} = (\mathbb{X}^t \mathbb{X})^{-1} \mathbb{X}^t \mathbb{Y}$ minimise $\text{SCR}(\beta)$.

Exemple

- **Données Hitters**, 263 individus, 20 variables

```
> Hitters %>% select(c(1:5,19)) %>% head()
##   AtBat Hits HmRun Runs RBI Salary
## 1   315   81     7   24  38  475.0
## 2   479  130    18   66  72  480.0
## 3   496  141    20   65  78  500.0
## 4   321   87    10   39  42   91.5
## 5   594  169     4   74  51  750.0
## 6   185   37     1   23   8   70.0
```

- **Problème** : Expliquer/prédire le salaire (**Salary**) par les autres variables.

- Calcul des estimateurs MCO avec lm :

```
> mod <- lm(Salary~.,data=Hitters)
> coef(mod)[1:5]
## (Intercept)      AtBat      Hits      HmRun      Runs
## 163.103588   -1.979873   7.500768   4.330883  -2.376210
```

- Calcul des estimateurs MCO avec `lm` :

```
> mod <- lm(Salary~.,data=Hitters)
> coef(mod)[1:5]
## (Intercept)      AtBat      Hits      HmRun      Runs
## 163.103588    -1.979873    7.500768    4.330883    -2.376210
```

- Prévision du salaire de nouveaux individus

```
> xnew %>% select(1:5)
##   AtBat Hits HmRun Runs RBI
## 1   585  139   31   93  94
```

avec `predict` :

```
> predict(mod,newdata=xnew)
##           1
## 1129.376
```

- En **supposant** de plus que les erreurs ε_j suivent une **loi Gaussienne**, on obtient la loi des estimateurs

$$\frac{\hat{\beta}_j - \beta_j}{\hat{\sigma}_{\hat{\beta}_j}} \sim \mathcal{T}_{n-(d+1)}.$$

Modèle gaussien

- En **supposant** de plus que les erreurs ε_j suivent une **loi Gaussienne**, on obtient la loi des estimateurs

$$\frac{\hat{\beta}_j - \beta_j}{\hat{\sigma}_{\hat{\beta}_j}} \sim \mathcal{T}_{n-(d+1)}.$$

- On en déduit des **procédures de test** :

```
> broom::tidy(mod) %>% head()
## # A tibble: 6 x 5
##   term          estimate std.error statistic p.value
##   <chr>         <dbl>     <dbl>     <dbl>   <dbl>
## 1 (Intercept)  163.        90.8         1.80  0.0736
## 2 AtBat        -1.98        0.634        -3.12  0.00201
## 3 Hits         7.50        2.38         3.15  0.00181
## 4 HmRun        4.33        6.20         0.698 0.486
## 5 Runs        -2.38        2.98        -0.797 0.426
## 6 RBI         -1.04        2.60        -0.402 0.688
```

- Ainsi que des intervalles de confiance pour les paramètres :

```
> confint(mod) %>% head()
##              2.5 %          97.5 %
## (Intercept) -15.709647 341.9168228
## AtBat       -3.228667  -0.7310792
## Hits        2.817562  12.1839734
## HmRun       -7.884569  16.5463352
## Runs       -8.247625   3.4952055
## RBI        -6.168102   4.0781779
```

- Ainsi que des intervalles de confiance pour les paramètres :

```
> confint(mod) %>% head()
##              2.5 %          97.5 %
## (Intercept) -15.709647 341.9168228
## AtBat       -3.228667  -0.7310792
## Hits        2.817562  12.1839734
## HmRun       -7.884569  16.5463352
## Runs       -8.247625   3.4952055
## RBI        -6.168102   4.0781779
```

- ou pour les prévisions :

```
> predict(mod, newdata=xnew, interval="confidence")
##      fit      lwr      upr
## 1 1129.376 889.2244 1369.528
```

Cas du modèle logistique

- Toutes ces notions se généralisent (assez) rapidement au **modèle logistique**

$$\log \frac{p_{\beta}(x)}{1 - p_{\beta}(x)} = \beta_0 + \beta_1 x_1 + \dots + \beta_d x_d.$$

- Le critère des MCO est remplacé par la **log-vraisemblance** (à maximiser) :

$$\mathcal{L}(y_1, \dots, y_n; \beta) = \sum_{i=1}^n [y_i x_i^t \beta - \log(1 + \exp(x_i^t \beta))].$$

Cas du modèle logistique

- Toutes ces notions se généralisent (assez) rapidement au **modèle logistique**

$$\log \frac{p_{\beta}(x)}{1 - p_{\beta}(x)} = \beta_0 + \beta_1 x_1 + \dots + \beta_d x_d.$$

- Le critère des MCO est remplacé par la **log-vraisemblance** (à maximiser) :

$$\mathcal{L}(y_1, \dots, y_n; \beta) = \sum_{i=1}^n [y_i x_i^t \beta - \log(1 + \exp(x_i^t \beta))].$$

- Pas de solution explicite mais de **(bons) algorithmes qui convergent vers le max.**

Exemple

- On considère les données **SAheart** :

```
> head(SAheart)
##   sbp tobacco  ldl adiposity famhist typea obesity alcohol age chd
## 1 160   12.00 5.73   23.11 Present   49   25.30   97.20 52  1
## 2 144    0.01 4.41   28.61  Absent   55   28.87    2.06 63  1
## 3 118    0.08 3.48   32.28 Present   52   29.14    3.81 46  0
## 4 170    7.50 6.41   38.03 Present   51   31.99   24.26 58  1
## 5 134   13.60 3.50   27.78 Present   60   25.99   57.34 49  1
## 6 132    6.20 6.47   36.21 Present   62   30.77   14.14 45  0
```

- Problème** : expliquer/prédire la variable binaire **chd** par les autres variables.

- On obtient les estimateurs avec `glm`

```
> logit <- glm(chd~.,data=SAheart,family="binomial")
> broom::tidy(logit)
## # A tibble: 10 x 5
##   term                estimate std.error statistic    p.value
##   <chr>                <dbl>    <dbl>    <dbl>    <dbl>
## 1 (Intercept)        -6.15     1.31     -4.70  0.00000258
## 2 sbp                 0.00650  0.00573    1.14  0.256
## 3 tobacco            0.0794   0.0266    2.98  0.00285
## 4 ldl                0.174    0.0597    2.92  0.00355
## 5 adiposity          0.0186   0.0293    0.635 0.526
## 6 famhistPresent     0.925    0.228     4.06  0.0000490
## 7 typea              0.0396   0.0123    3.21  0.00131
## 8 obesity            -0.0629  0.0442   -1.42  0.155
## 9 alcohol            0.000122 0.00448    0.0271 0.978
## 10 age               0.0452   0.0121    3.73  0.000193
```

- Les prévisions de la probabilité de l'évènement {**chd=1**} pour de nouveaux individus

```
> xnew
##   sbp tobacco  ldl adiposity famhist typea obesity alcohol age
## 1 146         0 6.62    25.69  Absent   60   28.07   8.23  63
```

- s'obtiennent avec `predict` :

```
> predict(logit,newdata=xnew,type="response")
##           1
## 0.4719671
```

Conclusion

Remarque

La qualité de ces modèles (et donc des prévisions) reposent sur deux postulats :

1. le **modèle est bon** : Y s'explique bien par une combinaison linéaire des X ;
2. les **estimateurs sont bons** : ils possèdent de bonnes propriétés statistiques.

Conclusion

Remarque

La qualité de ces modèles (et donc des prévisions) reposent sur deux postulats :

1. le **modèle est bon** : Y s'explique bien par une combinaison linéaire des X ;
2. les **estimateurs sont bons** : ils possèdent de bonnes propriétés statistiques.

- La qualité du modèle est toujours **difficile à vérifier** \implies ajouter d'autres effets dans la combinaison linéaire (quadratique, interactions...).
- On en sait plus sur la **performance des estimateurs** :

Conclusion

Remarque

La qualité de ces modèles (et donc des prévisions) reposent sur deux postulats :

1. le **modèle est bon** : Y s'explique bien par une combinaison linéaire des X ;
2. les **estimateurs sont bons** : ils possèdent de bonnes propriétés statistiques.

- La qualité du modèle est toujours **difficile à vérifier** \implies ajouter d'autres effets dans la combinaison linéaire (quadratique, interactions...).
- On en sait plus sur la **performance des estimateurs** :
 1. **Trop de variables** \implies \nearrow de la variance (sur-ajustement).
 2. **Colinéarités** \implies \nearrow de la variance (sur-ajustement).

Sélection de variables

Régularisation

Régression ridge

Régression Lasso

Variantes de ridge/lasso

Discrimination binaire

Support vector machine

SVM - cas séparable

SVM : cas non séparable

SVM non linéaire : astuce du noyau

Scores et probabilités

Compléments : SVM multi-classes et SVR

SVM multiclass

Support vector regression (SVR)

- Une approche naturelle pour répondre aux 2 problèmes évoqués précédemment est de sélectionner des variables explicatives parmi $\{X_1, \dots, X_d\}$.

Idée

Supprimer les variables

- qui n'expliquent pas Y .
- dont l'effet est déjà expliqué par d'autres variables

⇒ ce n'est pas parce qu'une variable n'est pas sélectionnée qu'elle n'est pas liée à Y !

Best subset selection

- d variables explicatives $\implies 2^d$ modèles concurrents.
- **Idée** : construire les 2^d modèles et les comparer.

Best subset selection

- d variables explicatives $\implies 2^d$ modèles concurrents.
- **Idée** : construire les 2^d modèles et les comparer.

Algorithme BSS

Entrée : un critère de choix de modèle (AIC, BIC...).

Pour $j = 0, \dots, d$:

1. Construire les $\binom{d}{j}$ modèles linéaires à j variables ;
2. Choisir parmi ces modèles celui qui a la plus petite SCR. On note \mathcal{M}_j le modèle sélectionné.

Retourner : le meilleur modèle parmi $\mathcal{M}_0, \mathcal{M}_1, \dots, \mathcal{M}_d$ au sens du critère de choix de modèle.

Exemples de critères (voir [Cornillon et al., 2019])

- **AIC** : Akaike Information Criterion

$$-2\mathcal{L}_n(\hat{\beta}) + 2d.$$

- **BIC** : Bayesian Information Criterion

$$-2\mathcal{L}_n(\hat{\beta}) + \log(n)d.$$

- **R^2 ajusté** :

$$R_a^2 = 1 - \frac{n-1}{n-d+1}(1-R^2) \quad \text{où} \quad R^2 = \frac{SSR}{SST} = \frac{\|\hat{Y} - \bar{Y}\mathbf{1}\|^2}{\|Y - \bar{Y}\mathbf{1}\|^2}.$$

- **C_p de Mallow** :

$$C_p = \frac{1}{n} \left(\sum_{i=1}^n (Y_i - \hat{Y}_i)^2 + 2d\hat{\sigma}^2 \right).$$

- Ces critères sont constitués de deux parties :
 1. une qui mesure la **qualité d'ajustement** du modèle ;
 2. une autre qui mesure sa **complexité**.

- Ces critères sont constitués de deux parties :
 1. une qui mesure la **qualité d'ajustement** du modèle ;
 2. une autre qui mesure sa **complexité**.

Exemple AIC

- $-2\mathcal{L}_n(\hat{\beta})$ mesure l'ajustement ;
- $2p$ mesure la complexité.

- Ces critères sont constitués de deux parties :
 1. une qui mesure la **qualité d'ajustement** du modèle ;
 2. une autre qui mesure sa **complexité**.

Exemple AIC

- $-2\mathcal{L}_n(\hat{\beta})$ mesure l'ajustement ;
- $2p$ mesure la complexité.

⇒ l'idée est de choisir un modèle de **complexité minimale** qui **ajuste bien** les données.

- On peut utiliser les packages `leaps` et `bestglm`.
- On propose de présenter `bestglm` qui fait appel à `leaps` pour la régression et fonctionne également pour le modèle logistique.

- On peut utiliser les packages `leaps` et `bestglm`.
- On propose de présenter `bestglm` qui fait appel à `leaps` pour la régression et fonctionne également pour le modèle logistique.

```
> Hitters1 <- Hitters[,c(1:18,20,19)]
> sel.var <- bestglm(Hitters1)
> sel.var$Subsets %>% select(c(1:5,22)) %>% head()
##      (Intercept) AtBat Hits HmRun Runs      BIC
## 0             TRUE FALSE FALSE FALSE FALSE 3213.768
## 1             TRUE FALSE FALSE FALSE FALSE 3117.350
## 2             TRUE FALSE  TRUE FALSE FALSE 3079.270
## 3             TRUE FALSE  TRUE FALSE FALSE 3072.569
## 4             TRUE FALSE  TRUE FALSE FALSE 3066.387
## 5             TRUE  TRUE  TRUE FALSE FALSE 3064.125
```

- On obtient le **modèle sélectionné** avec :

```
> sel.var$BestModel %>% broom::tidy()
## # A tibble: 7 x 5
##   term          estimate std.error statistic  p.value
##   <chr>         <dbl>     <dbl>     <dbl>   <dbl>
## 1 (Intercept)    91.5      65.0         1.41 1.60e- 1
## 2 AtBat          -1.87     0.527        -3.54 4.70e- 4
## 3 Hits           7.60     1.66         4.57 7.46e- 6
## 4 Walks          3.70     1.21         3.06 2.49e- 3
## 5 CRBI           0.643    0.0644        9.98 5.05e-20
## 6 DivisionW     -123.     39.8         -3.09 2.24e- 3
## 7 PutOuts        0.264    0.0748        3.53 4.84e- 4
```

- On obtient le **modèle sélectionné** avec :

```
> sel.var$BestModel %>% broom::tidy()
## # A tibble: 7 x 5
##   term          estimate std.error statistic  p.value
##   <chr>         <dbl>     <dbl>    <dbl>   <dbl>
## 1 (Intercept)   91.5      65.0      1.41 1.60e- 1
## 2 AtBat        -1.87     0.527    -3.54 4.70e- 4
## 3 Hits         7.60     1.66     4.57 7.46e- 6
## 4 Walks        3.70     1.21     3.06 2.49e- 3
## 5 CRBI         0.643    0.0644    9.98 5.05e-20
## 6 DivisionW   -123.     39.8     -3.09 2.24e- 3
## 7 PutOuts      0.264    0.0748    3.53 4.84e- 4
```

Remarque

- L'approche **exhaustive** peut se révéler coûteuse en temps de calcul lorsque $d > 50$.
- On utilise généralement des méthodes **pas à pas** dans ce cas.

Pas à pas ascendant

Algorithme forward

Entrée : un critère de choix de modèle (AIC, BIC...)

1. Construire \mathcal{M}_0 le modèle linéaire qui contient uniquement la constante ;
2. Pour $j = 0, \dots, d - 1$:
 - 2.1 Construire les $d - j$ modèles linéaires en ajoutant une variable, parmi les variables non utilisées, à \mathcal{M}_j ;
 - 2.2 Choisir, parmi ces $d - j$ modèles, celui qui minimise la SCR $\rightarrow \mathcal{M}_{j+1}$.

Retourner : le meilleur modèle parmi $\mathcal{M}_0, \mathcal{M}_1, \dots, \mathcal{M}_d$ au sens du critère de choix de modèle.

Le coin R

Utiliser `method=forward` dans `bestglm`.

Pas à pas descendant

Algorithme backward

Entrée : un critère de choix de modèle (AIC, BIC...)

1. Construire \mathcal{M}_d le modèle linéaire complet (avec toutes les variables explicatives);
2. Pour $j = d, \dots, 1$:
 - 2.1 Construire les j modèles linéaires en supprimant une variable, parmi les variables non utilisées, à \mathcal{M}_j ;
 - 2.2 Choisir, parmi ces j modèles, celui qui minimise la SCR $\rightarrow \mathcal{M}_{j-1}$.

Retourner : le meilleur modèle parmi $\mathcal{M}_0, \mathcal{M}_1, \dots, \mathcal{M}_d$ au sens du critère de choix de modèle.

Le coin R

Utiliser `method=backward` dans `bestglm`.

Estimation par moindres carrés

Sélection de variables

Régularisation

Régression ridge

Régression Lasso

Variantes de ridge/lasso

Discrimination binaire

Support vector machine

SVM - cas séparable

SVM : cas non séparable

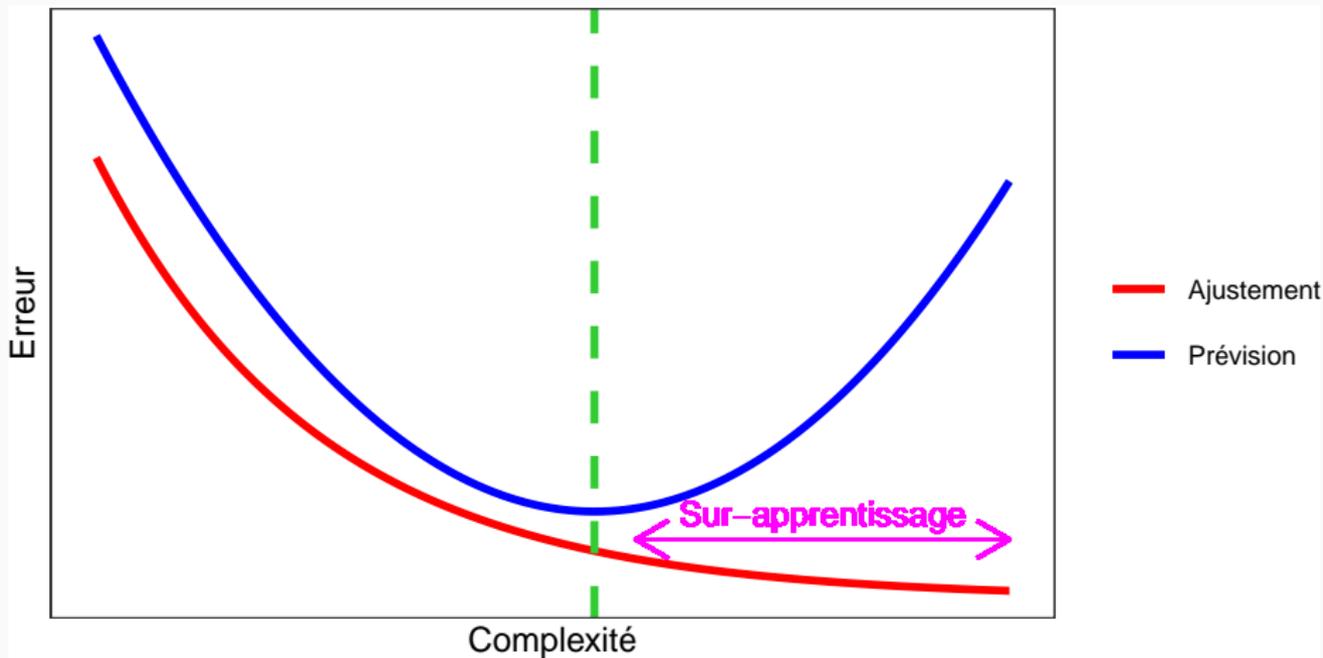
SVM non linéaire : astuce du noyau

Scores et probabilités

Compléments : SVM multi-classes et SVR

SVM multiclass

Support vector regression (SVR)



Complexité linéaire

Le **nombre de variables** est une mesure de la complexité des algorithmes linéaires.

- On génère des données $(x_i, y_i), i = 1, \dots, 500$ selon le modèle

$$y_i = 1x_{i1} + 0x_{i2} + \dots + 0x_{iq} + \varepsilon_i$$

où $x_1, \dots, x_q, \varepsilon$ sont i.i.d. de loi $\mathcal{N}(0, 1)$.

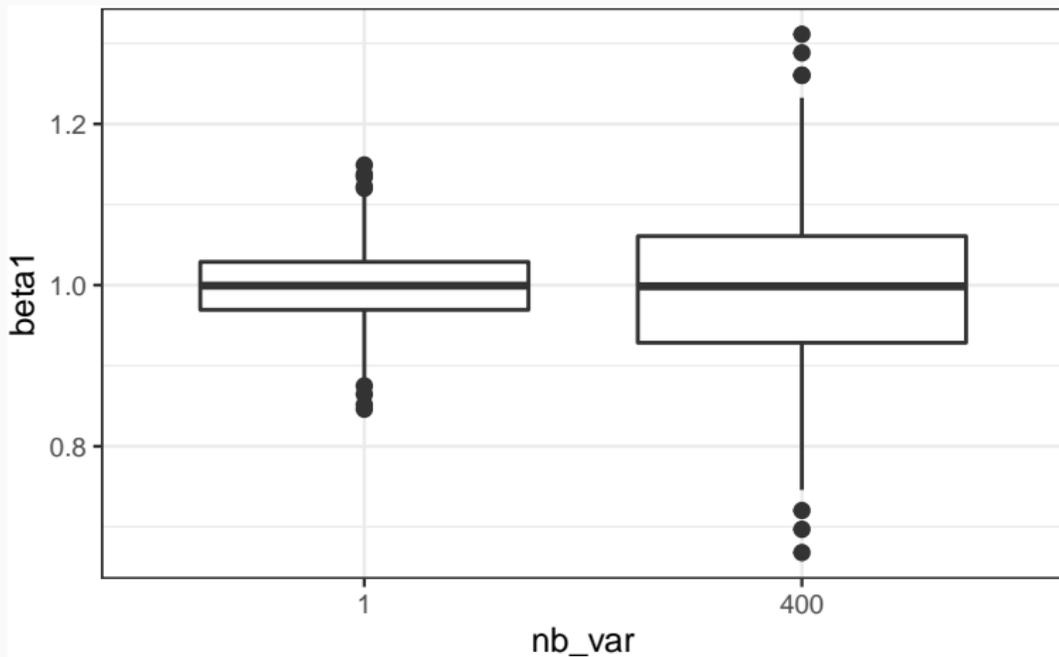
Illustration numérique

- On génère des données $(x_i, y_i), i = 1, \dots, 500$ selon le modèle

$$y_i = 1x_{i1} + 0x_{i2} + \dots + 0x_{iq} + \varepsilon_i$$

où $x_1, \dots, x_q, \varepsilon$ sont i.i.d. de loi $\mathcal{N}(0, 1)$.

- Seule X_1 est **explicative**, les $q - 1$ autres variables peuvent être vues comme du **bruit**.
- On calcule l'**estimateur de MCO de β_1** sur 1000 répétitions. On trace les boxplot de ces estimateurs pour $q = 0$ et $q = 400$.



Conclusion

Plus de **variance** (donc **moins de précision**) lorsque le nombre de variables inutiles augmente.

- Lorsque le nombre de variables d est grand, les estimateurs des moindres carrés du modèle linéaire

$$Y = \beta_1 X_1 + \dots + \beta_d X_d + \varepsilon$$

possèdent généralement une grande variance.

- Lorsque le nombre de variables d est grand, les estimateurs des moindres carrés du modèle linéaire

$$Y = \beta_1 X_1 + \dots + \beta_d X_d + \varepsilon$$

possèdent généralement une grande variance.

Idée des méthodes pénalisés

- Contraindre la valeur des estimateurs des moindres carrés de manière à réduire la variance (quitte à augmenter un peu le biais).

- Lorsque le nombre de variables d est grand, les estimateurs des moindres carrés du modèle linéaire

$$Y = \beta_1 X_1 + \dots + \beta_d X_d + \varepsilon$$

possèdent généralement une grande variance.

Idée des méthodes pénalisés

- Contraindre la valeur des estimateurs des moindres carrés de manière à réduire la variance (quitte à augmenter un peu le biais).
- Comment ? En imposant une contrainte sur la valeur des estimateurs des moindres carrés :

$$\hat{\beta}^{pen} = \underset{\beta}{\operatorname{argmin}} \sum_{i=1}^n \left(y_i - \sum_{j=1}^d x_{ij} \beta_j \right)^2$$

sous la contrainte $\|\beta\|_? \leq t$.

- Quelle **norme** utiliser pour la contrainte ?

- Quelle **norme** utiliser pour la contrainte ?
- **Existence/unicité** des estimateurs ? **Solutions explicites** du problème d'optimisation ?

- Quelle **norme** utiliser pour la contrainte ?
- **Existence/unicité** des estimateurs ? **Solutions explicites** du problème d'optimisation ?
- Comment **choisir t** ?
 - t petit \implies estimateurs **contraints** (proche de 0) ;
 - t grand \implies estimateurs des **moindres carrés** (non pénalisés).

- Cas similaire déjà vu pour LDA.
- **Modèle standard LDA** : $\mathcal{L}(X|Y = k) = \mathcal{N}(\mu_k, \Sigma)$.
- μ_k et Σ sont généralement estimés pour les **moyennes et matrice de covariance empiriques**.

- Cas similaire déjà vu pour LDA.
- **Modèle standard LDA** : $\mathcal{L}(X|Y = k) = \mathcal{N}(\mu_k, \Sigma)$.
- μ_k et Σ sont généralement estimés pour les **moyennes et matrice de covariance empiriques**.

LDA régularisée

On **régularise** la matrice de covariance en **augmentant les valeurs de la diagonale**

$$(1 - \gamma)\hat{\Sigma} + \gamma\hat{\sigma}^2 I_p.$$

Estimation par moindres carrés

Sélection de variables

Régularisation

Régression ridge

Régression Lasso

Variantes de ridge/lasso

Discrimination binaire

Support vector machine

SVM - cas séparable

SVM : cas non séparable

SVM non linéaire : astuce du noyau

Scores et probabilités

Compléments : SVM multi-classes et SVR

SVM multiclass

Support vector regression (SVR)

- La **régression ridge** consiste à minimiser le critère des moindres carrés pénalisé par la norme 2 des coefficients.

Définition

1. Les **estimateurs ridge** $\hat{\beta}^R$ s'obtiennent en minimisant

$$\sum_{i=1}^n \left(y_i - \beta_0 - \sum_{j=1}^d x_{ij} \beta_j \right)^2 \quad \text{sous la contrainte} \quad \sum_{j=1}^d \beta_j^2 \leq t \quad (1)$$

- La **régression ridge** consiste à minimiser le critère des moindres carrés pénalisé par la norme 2 des coefficients.

Définition

1. Les **estimateurs ridge** $\hat{\beta}^R$ s'obtiennent en minimisant

$$\sum_{i=1}^n \left(y_i - \beta_0 - \sum_{j=1}^d x_{ij} \beta_j \right)^2 \quad \text{sous la contrainte} \quad \sum_{j=1}^d \beta_j^2 \leq t \quad (1)$$

2. ou de façon **équivalente**

$$\hat{\beta}^R = \underset{\beta}{\operatorname{argmin}} \left\{ \sum_{i=1}^n \left(y_i - \beta_0 - \sum_{j=1}^d x_{ij} \beta_j \right)^2 + \lambda \sum_{j=1}^d \beta_j^2 \right\}. \quad (2)$$

Quelques remarques

- Les définitions (1) et (2) sont **équivalentes** dans le sens où pour tout t il existe un unique λ tels que les solutions aux deux problèmes d'optimisation **coïncident**.

Quelques remarques

- Les définitions (1) et (2) sont **équivalentes** dans le sens où pour tout t il existe un unique λ tels que les solutions aux deux problèmes d'optimisation **coïncident**.
- La **constante** β_0 n'entre généralement **pas** dans la **pénalité**.

Quelques remarques

- Les définitions (1) et (2) sont **équivalentes** dans le sens où pour tout t il existe un unique λ tels que les solutions aux deux problèmes d'optimisation **coïncident**.
- La **constante** β_0 n'entre généralement **pas** dans la **pénalité**.
- L'estimateur **dépend** bien entendu du paramètre t (ou λ) :
$$\hat{\beta}^R = \hat{\beta}^R(t) = \hat{\beta}^R(\lambda).$$

Quelques remarques

- Les définitions (1) et (2) sont **équivalentes** dans le sens où pour tout t il existe un unique λ tels que les solutions aux deux problèmes d'optimisation **coïncident**.
- La **constante** β_0 n'entre généralement **pas** dans la **pénalité**.
- L'estimateur **dépend** bien entendu du paramètre t (ou λ) :
$$\hat{\beta}^R = \hat{\beta}^R(t) = \hat{\beta}^R(\lambda).$$
- Les variables explicatives sont le plus souvent **réduites** pour **éviter les problèmes d'échelle** dans la pénalité.

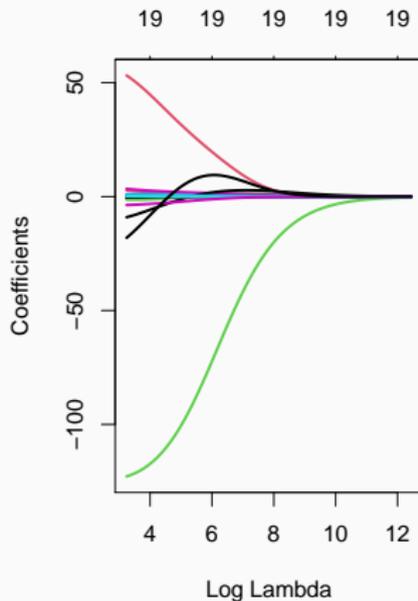
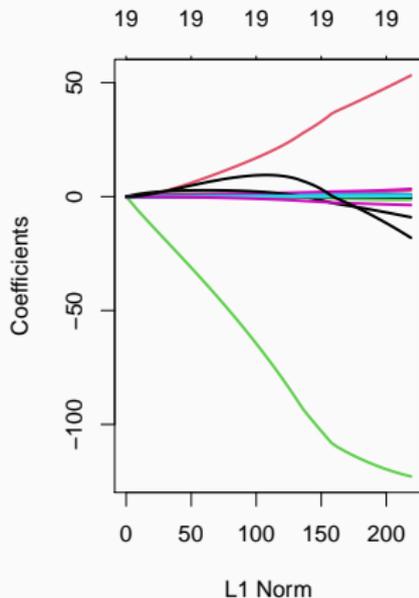
Exemple avec les données Hitters

- Il existe **plusieurs fonctions et packages** qui permettent de faire de la régression pénalisée sur **R**. Nous présentons ici **glmnet**.
- **glmnet** n'accepte pas d'objet **formule**. Il faut spécifier la **matrice** des X et le **vecteur** des Y :

```
> Hitters.X <- model.matrix(Salary~.,data=Hitters)[,-1]
```

Ridge avec glmnet

```
> library(glmnet)
> reg.ridge <- glmnet(Hitters.X,Hitters$Salary,alpha=0)
> par(mfrow=c(1,2))
> plot(reg.ridge,lwd=2)
> plot(reg.ridge,lwd=2,xvar="lambda")
```



Propriétés des estimateurs ridge

Propriétés

1. Lorsque les variables explicatives sont **centrée-réduites**, l'estimateur Ridge solution de (2) s'écrit

$$\hat{\beta}^R = \hat{\beta}^R(\lambda) = (\mathbb{X}^t\mathbb{X} + \lambda\mathbb{I})^{-1}\mathbb{X}^t\mathbb{Y}.$$

2. On déduit

$$\text{biais}(\hat{\beta}^R) = -\lambda(\mathbb{X}^t\mathbb{X} + \lambda\mathbb{I})^{-1}\beta$$

et

$$\mathbf{V}(\hat{\beta}^R) = \sigma^2(\mathbb{X}^t\mathbb{X} + \lambda\mathbb{I})^{-1}\mathbb{X}^t\mathbb{X}(\mathbb{X}^t\mathbb{X} + \lambda\mathbb{I})^{-1}.$$

Propriétés des estimateurs ridge

Propriétés

1. Lorsque les variables explicatives sont **centrée-réduites**, l'estimateur Ridge solution de (2) s'écrit

$$\hat{\beta}^R = \hat{\beta}^R(\lambda) = (\mathbb{X}^t\mathbb{X} + \lambda\mathbb{I})^{-1}\mathbb{X}^t\mathbb{Y}.$$

2. On déduit

$$\text{biais}(\hat{\beta}^R) = -\lambda(\mathbb{X}^t\mathbb{X} + \lambda\mathbb{I})^{-1}\beta$$

et

$$\mathbf{V}(\hat{\beta}^R) = \sigma^2(\mathbb{X}^t\mathbb{X} + \lambda\mathbb{I})^{-1}\mathbb{X}^t\mathbb{X}(\mathbb{X}^t\mathbb{X} + \lambda\mathbb{I})^{-1}.$$

Commentaires

- Si $\lambda = 0$, on retrouve le biais et la variance de l'estimateur des **MCO**.
- $\lambda \nearrow \implies$ biais \nearrow et variance \searrow et réciproquement lorsque $\lambda \searrow$.

- Il est **crucial** : si $\lambda \approx 0$ alors $\hat{\beta}^R \approx \hat{\beta}^{MCO}$, si λ "grand" alors $\hat{\beta}^R \approx 0$.

- Il est **crucial** : si $\lambda \approx 0$ alors $\hat{\beta}^R \approx \hat{\beta}^{MCO}$, si λ "grand" alors $\hat{\beta}^R \approx 0$.
- Le choix de λ se fait le plus souvent de façon "classique" :
 1. **Estimation d'un critère** de choix de modèle pour toutes les valeurs de λ ;

- Il est **crucial** : si $\lambda \approx 0$ alors $\hat{\beta}^R \approx \hat{\beta}^{MCO}$, si λ "grand" alors $\hat{\beta}^R \approx 0$.
- Le choix de λ se fait le plus souvent de façon "classique" :
 1. **Estimation d'un critère** de choix de modèle pour toutes les valeurs de λ ;
 2. Choix du λ qui **minimise** le critère estimé.

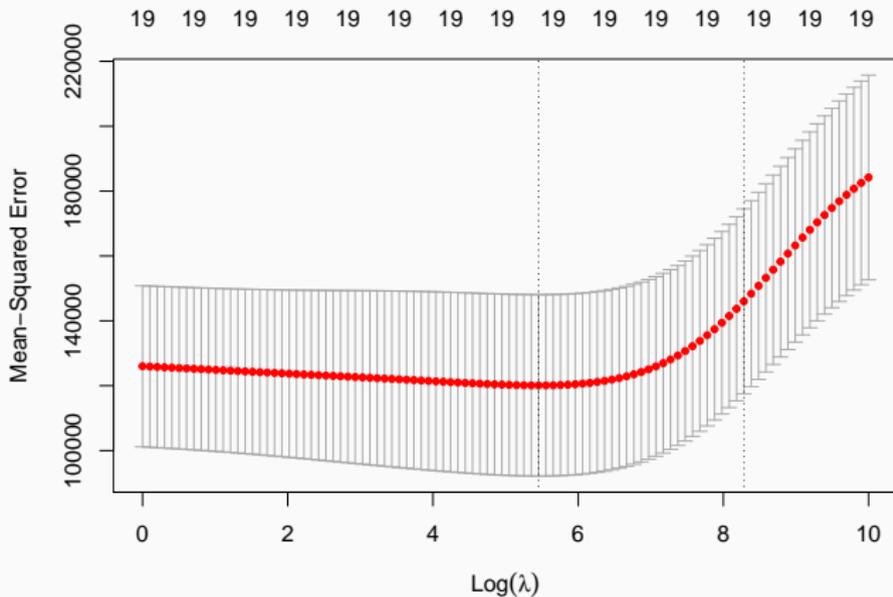
Choix de λ

- Il est **crucial** : si $\lambda \approx 0$ alors $\hat{\beta}^R \approx \hat{\beta}^{MCO}$, si λ "grand" alors $\hat{\beta}^R \approx 0$.
- Le choix de λ se fait le plus souvent de façon "classique" :
 1. **Estimation d'un critère** de choix de modèle pour toutes les valeurs de λ ;
 2. Choix du λ qui **minimise** le critère estimé.
- **Exemple** : la fonction `cv.glmnet` choisit la valeur de λ qui minimise l'**erreur quadratique moyenne**

$$E[(Y - m_{\hat{\beta}^R(\lambda)}(X))^2]$$

estimée par **validation croisée**.

```
> set.seed(321)
> reg.cvridge <- cv.glmnet(Hitters.X,Hitters$Salary,alpha=0,
+                          lambda=exp(seq(0,10,length=100)))
> bestlam <- reg.cvridge$lambda.min
> bestlam
## [1] 233.8186
> plot(reg.cvridge)
```



Estimation par moindres carrés

Sélection de variables

Régularisation

Régression ridge

Régression Lasso

Variantes de ridge/lasso

Discrimination binaire

Support vector machine

SVM - cas séparable

SVM : cas non séparable

SVM non linéaire : astuce du noyau

Scores et probabilités

Compléments : SVM multi-classes et SVR

SVM multiclass

Support vector regression (SVR)

- La **régression lasso** consiste à minimiser le critère des moindres carrés pénalisé par la norme 1 des coefficients.

Définition [**Tibshirani, 1996**]

1. Les **estimateurs lasso** $\hat{\beta}^L$ s'obtiennent en minimisant

$$\sum_{i=1}^n \left(Y_i - \beta_0 - \sum_{j=1}^d X_{ij} \beta_j \right)^2 \quad \text{sous la contrainte} \quad \sum_{j=1}^d |\beta_j| \leq t \quad (3)$$

2. ou de façon **équivalente**

$$\hat{\beta}^L = \underset{\beta}{\operatorname{argmin}} \left\{ \sum_{i=1}^n \left(Y_i - \beta_0 - \sum_{j=1}^d X_{ij} \beta_j \right)^2 + \lambda \sum_{j=1}^d |\beta_j| \right\}. \quad (4)$$

Comparaison Ridge-Lasso

- Dans le cas où la matrice \mathbb{X} est **orthonormée**, on a une **écriture explicite** pour les estimateurs ridge et lasso.

Comparaison Ridge-Lasso

- Dans le cas où la matrice \mathbb{X} est **orthonormée**, on a une **écriture explicite** pour les estimateurs ridge et lasso.

Propriété

Si la matrice de design \mathbb{X} est orthonormée, alors

$$\hat{\beta}_j^R = \frac{\hat{\beta}_j}{1 + \lambda} \quad \text{et} \quad \hat{\beta}_j^L = \text{signe}(\hat{\beta}_j)(|\hat{\beta}_j| - \lambda)_+$$

où $\hat{\beta}_j$ est l'estimateur MCO de β_j .

Comparaison Ridge-Lasso

- Dans le cas où la matrice \mathbb{X} est **orthonormée**, on a une **écriture explicite** pour les estimateurs ridge et lasso.

Propriété

Si la matrice de design \mathbb{X} est orthonormée, alors

$$\hat{\beta}_j^R = \frac{\hat{\beta}_j}{1 + \lambda} \quad \text{et} \quad \hat{\beta}_j^L = \text{signe}(\hat{\beta}_j)(|\hat{\beta}_j| - \lambda)_+$$

où $\hat{\beta}_j$ est l'estimateur MCO de β_j .

Commentaires

- **Ridge** "diminue" l'estimateur MCO de façon **proportionnelle** ;

Comparaison Ridge-Lasso

- Dans le cas où la matrice \mathbb{X} est **orthonormée**, on a une **écriture explicite** pour les estimateurs ridge et lasso.

Propriété

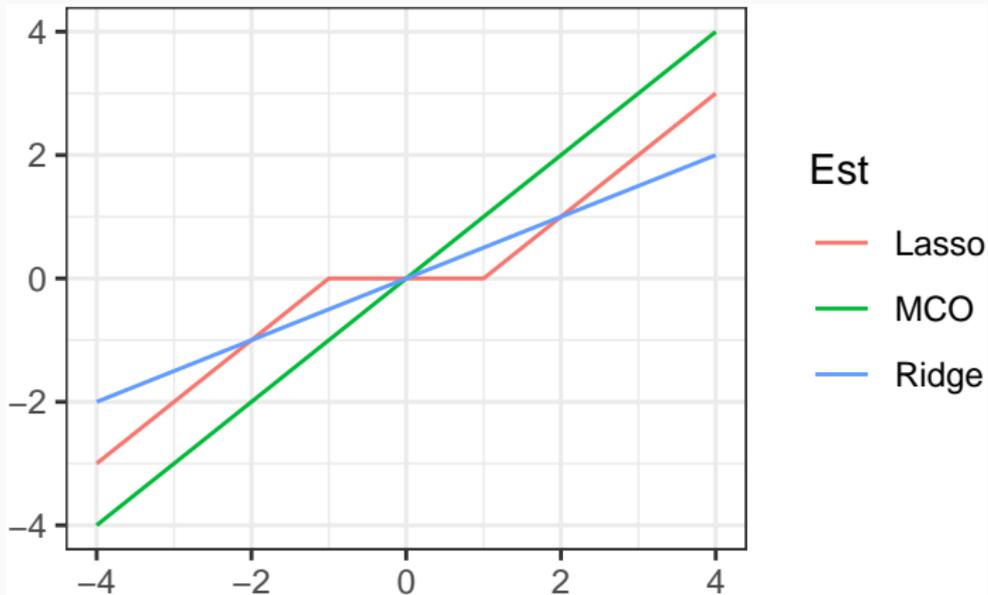
Si la matrice de design \mathbb{X} est orthonormée, alors

$$\hat{\beta}_j^R = \frac{\hat{\beta}_j}{1 + \lambda} \quad \text{et} \quad \hat{\beta}_j^L = \text{signe}(\hat{\beta}_j)(|\hat{\beta}_j| - \lambda)_+$$

où $\hat{\beta}_j$ est l'estimateur MCO de β_j .

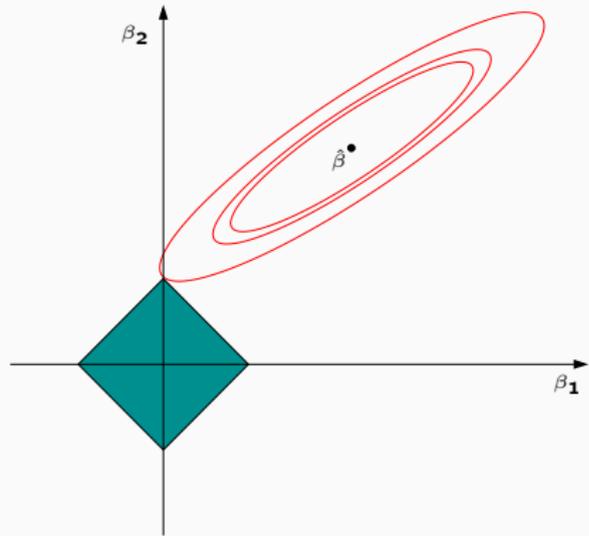
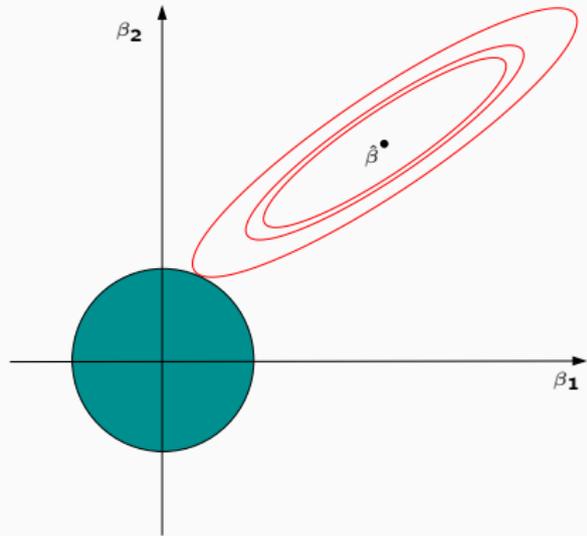
Commentaires

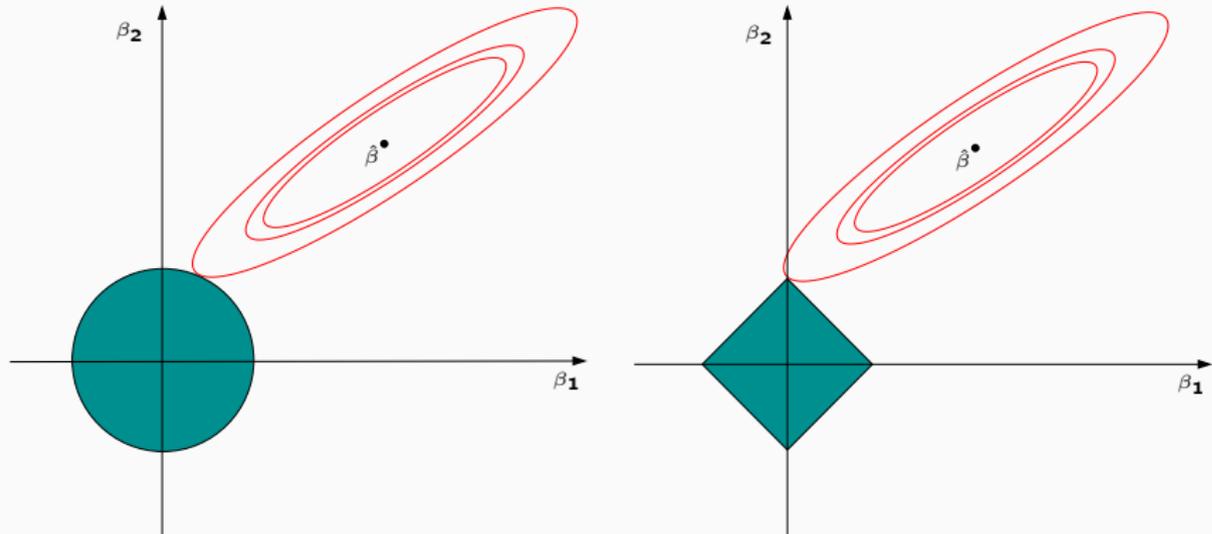
- **Ridge** "diminue" l'estimateur MCO de façon **proportionnelle** ;
- **Lasso** **translate et tronque** l'estimateur MCO (lorsque ce dernier est petit).



Conclusion

Le lasso va avoir tendance à "mettre" des coefficients à 0 et donc à faire de la sélection de variables.





Remarque

Ces approches reviennent (d'une certaine façon) à projeter l'estimateur des MCO sur les boules unités associées à

1. la norme 2 pour la régression ridge ;
2. la norme 1 pour le lasso.

Quelques remarques

- Comme pour la régression ridge :
 - on préfère souvent **réduire la matrice de design** avant d'effectuer la régression lasso ;

Quelques remarques

- Comme pour la régression ridge :
 - on préfère souvent **réduire la matrice de design** avant d'effectuer la régression lasso ;
 - Le choix de λ est **crucial** (il est le plus souvent sélectionné en minimisant un critère empirique).

Quelques remarques

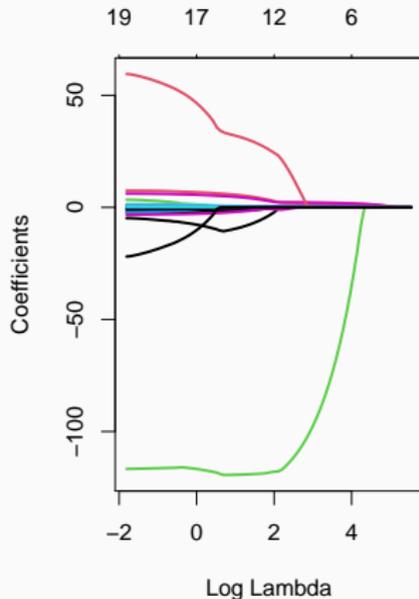
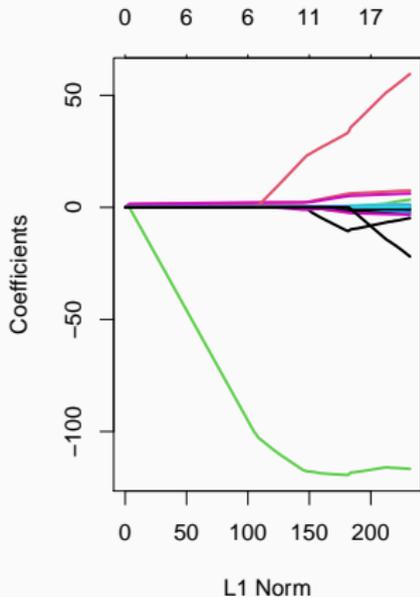
- Comme pour la régression ridge :
 - on préfère souvent **réduire la matrice de design** avant d'effectuer la régression lasso ;
 - Le choix de λ est **crucial** (il est le plus souvent sélectionné en minimisant un critère empirique).
 - $\lambda \nearrow \implies$ biais \nearrow et variance \searrow et réciproquement lorsque $\lambda \searrow$.

Quelques remarques

- Comme pour la régression ridge :
 - on préfère souvent **réduire la matrice de design** avant d'effectuer la régression lasso ;
 - Le choix de λ est **crucial** (il est le plus souvent sélectionné en minimisant un critère empirique).
 - $\lambda \nearrow \implies$ biais \nearrow et variance \searrow et réciproquement lorsque $\lambda \searrow$.
- **MAIS**, contrairement à ridge : $\lambda \nearrow \implies$ **le nombre de coefficients nuls augmente** ([Bühlmann and van de Geer, 2011]).

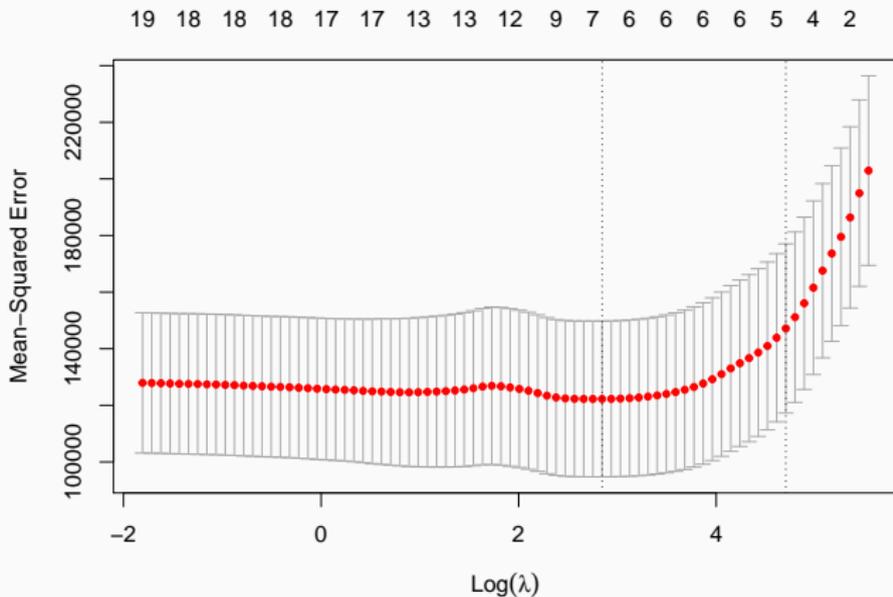
Le coin R

```
> reg.lasso <- glmnet(Hitters.X,Hitters$Salary,alpha=1)
> par(mfrow=c(1,2))
> plot(reg.lasso,lwd=2)
> plot(reg.lasso,lwd=2,xvar="lambda")
```



Sélection de λ

```
> set.seed(321)
> reg.cvlasso <- cv.glmnet(Hitters.X,Hitters$Salary,alpha=1)
> bestlam <- reg.cvlasso$lambda.min
> bestlam
## [1] 17.19108
> plot(reg.cvlasso)
```



- Il existe plusieurs façons de résoudre le problème numérique d'optimisation lasso (ou ridge).
- Un des plus utilisés est l'algorithme de descente de coordonnées [Hastie et al., 2015].

- Il existe plusieurs façons de résoudre le problème numérique d'optimisation lasso (ou ridge).
- Un des plus utilisés est l'algorithme de descente de coordonnées [Hastie et al., 2015].
- On considère le problème lasso

$$\hat{\beta}^L = \underset{\beta}{\operatorname{argmin}} \left\{ \sum_{i=1}^n \left(Y_i - \beta_0 - \sum_{j=1}^d X_{ij} \beta_j \right)^2 + \lambda \sum_{j=1}^d |\beta_j| \right\}$$

avec les variables explicatives centrées-réduites (pour simplifier).

1. **Initialisation** : $\hat{\beta}_0 = \bar{y}$, $\hat{\beta}_j = \dots, j = 1, \dots, d$.
2. Répéter jusqu'à convergence :
Pour $j = 1, \dots, d$:
 - 2.1 Calculer les **résidus partiels** $r_i^{(j)} = y_i - \sum_{k \neq j} x_{ik} \hat{\beta}_k$;
 - 2.2 Faire la **régression simple** des y_i contre $r_i^{(j)} \implies \tilde{\beta}_j$;
 - 2.3 **Mettre à jour** $\hat{\beta}_j = \text{signe}(\tilde{\beta}_j)(|\tilde{\beta}_j| - \lambda)_+$
3. **Retourner** : $\hat{\beta}_j, j = 1, \dots, d$.

Estimation par moindres carrés

Sélection de variables

Régularisation

Régression ridge

Régression Lasso

Variantes de ridge/lasso

Discrimination binaire

Support vector machine

SVM - cas séparable

SVM : cas non séparable

SVM non linéaire : astuce du noyau

Scores et probabilités

Compléments : SVM multi-classes et SVR

SVM multiclass

Support vector regression (SVR)

Différentes pénalités

- Les approches **ridge** et **lasso** diffèrent uniquement au niveau de la **pénalité** ajoutée au critère des moindres carrés.
- **Norme 2** pour **ridge** et **norme 1** pour le **lasso**.

Différentes pénalités

- Les approches **ridge** et **lasso** diffèrent uniquement au niveau de la **pénalité** ajoutée au critère des moindres carrés.
- **Norme 2** pour **ridge** et **norme 1** pour le **lasso**.
- Il existe tout un tas d'**autres stratégies** de pénalisations.
- Nous en présentons quelques unes dans cette partie.
- On pourra consulter [[Hastie et al., 2015](#)] pour plus de détails.

- [Zou and Hastie, 2005] ont proposé de combiner les approches ridge et lasso en proposant une pénalité (appelée elastic net) de la forme

$$\lambda \sum_{j=1}^d ((1 - \alpha)\beta_j^2 + \alpha|\beta_j|)$$

où $\alpha \in [0, 1]$.

- [Zou and Hastie, 2005] ont proposé de combiner les approches ridge et lasso en proposant une pénalité (appelée elastic net) de la forme

$$\lambda \sum_{j=1}^d ((1 - \alpha)\beta_j^2 + \alpha|\beta_j|)$$

où $\alpha \in [0, 1]$.

- Le paramètre α définit le compromis ridge/lasso :
 - $\alpha = 1 \implies$ Lasso ;
 - $\alpha = 0 \implies$ Ridge ;

- [Zou and Hastie, 2005] ont proposé de combiner les approches ridge et lasso en proposant une pénalité (appelée elastic net) de la forme

$$\lambda \sum_{j=1}^d ((1 - \alpha)\beta_j^2 + \alpha|\beta_j|)$$

où $\alpha \in [0, 1]$.

- Le paramètre α définit le compromis ridge/lasso :
 - $\alpha = 1 \implies$ Lasso ;
 - $\alpha = 0 \implies$ Ridge ;
 - Ce paramètre correspond (évidemment) à l'argument **alpha** de la fonction `glmnet`.

- [Zou and Hastie, 2005] ont proposé de combiner les approches ridge et lasso en proposant une pénalité (appelée elastic net) de la forme

$$\lambda \sum_{j=1}^d ((1 - \alpha)\beta_j^2 + \alpha|\beta_j|)$$

où $\alpha \in [0, 1]$.

- Le paramètre α définit le compromis ridge/lasso :
 - $\alpha = 1 \implies$ Lasso ;
 - $\alpha = 0 \implies$ Ridge ;
 - Ce paramètre correspond (évidemment) à l'argument **alpha** de la fonction `glmnet`.
- **Avantage** : on a plus de flexibilité car la pénalité elastic net propose une gamme de modèles beaucoup plus large que lasso et ridge ;

- [Zou and Hastie, 2005] ont proposé de combiner les approches ridge et lasso en proposant une pénalité (appelée elastic net) de la forme

$$\lambda \sum_{j=1}^d ((1 - \alpha)\beta_j^2 + \alpha|\beta_j|)$$

où $\alpha \in [0, 1]$.

- Le paramètre α définit le compromis ridge/lasso :
 - $\alpha = 1 \implies$ Lasso ;
 - $\alpha = 0 \implies$ Ridge ;
 - Ce paramètre correspond (évidemment) à l'argument **alpha** de la fonction `glmnet`.
- **Avantage** : on a plus de flexibilité car la pénalité elastic net propose une gamme de modèles beaucoup plus large que lasso et ridge ;
- **Inconvénient** : en plus du λ il faut aussi sélectionner le α !

- Dans certaines applications, les variables explicatives appartiennent à des groupes de variables prédéfinis.

Group Lasso

- Dans certaines applications, les variables explicatives appartiennent à des groupes de variables prédéfinis.
- Nécessité de "shrinker" ou sélectionner les variables par groupe.

Group Lasso

- Dans certaines applications, les variables explicatives appartiennent à des groupes de variables prédéfinis.
- Nécessité de "shrinker" ou sélectionner les variables par groupe.

Exemple : variables qualitatives

- 2 variables explicatives qualitatives X_1 et X_2 et une variable explicative continue X_3 .
- Le modèle s'écrit

$$Y = \beta_0 + \beta_1 \mathbf{1}_{X_1=A} + \beta_2 \mathbf{1}_{X_1=B} + \beta_3 \mathbf{1}_{X_1=C} \\ + \beta_4 \mathbf{1}_{X_2=D} + \beta_5 \mathbf{1}_{X_2=E} + \beta_6 \mathbf{1}_{X_2=F} + \beta_7 \mathbf{1}_{X_2=G} + \beta_8 X_3 + \varepsilon$$

muni des contraintes $\beta_1 = \beta_4 = 0$.

Group Lasso

- Dans certaines applications, les variables **explicatives** appartiennent à des **groupes de variables** prédéfinis.
- Nécessité de "**shrinker**" ou **sélectionner** les variables **par groupe**.

Exemple : variables qualitatives

- 2 variables explicatives qualitatives X_1 et X_2 et une variable explicative continue X_3 .
- Le **modèle** s'écrit

$$Y = \beta_0 + \beta_1 \mathbf{1}_{X_1=A} + \beta_2 \mathbf{1}_{X_1=B} + \beta_3 \mathbf{1}_{X_1=C} \\ + \beta_4 \mathbf{1}_{X_2=D} + \beta_5 \mathbf{1}_{X_2=E} + \beta_6 \mathbf{1}_{X_2=F} + \beta_7 \mathbf{1}_{X_2=G} + \beta_8 X_3 + \varepsilon$$

muni des contraintes $\beta_1 = \beta_4 = 0$.

- 3 groupes : $\mathbf{X}_1 = (\mathbf{1}_{X_1=B}, \mathbf{1}_{X_1=C})$, $\mathbf{X}_2 = (\mathbf{1}_{X_2=E}, \mathbf{1}_{X_2=F}, \mathbf{1}_{X_2=G})$ et $\mathbf{X}_3 = X_3$.

Définition

En présence de d variables réparties en L groupes $\mathbf{X}_1, \dots, \mathbf{X}_L$ de cardinal d_1, \dots, d_L . On note $\beta_\ell, \ell = 1, \dots, L$ le vecteur des coefficients associé au groupe \mathbf{X}_ℓ . Les **estimateurs group-lasso** s'obtiennent en minimisant le critère

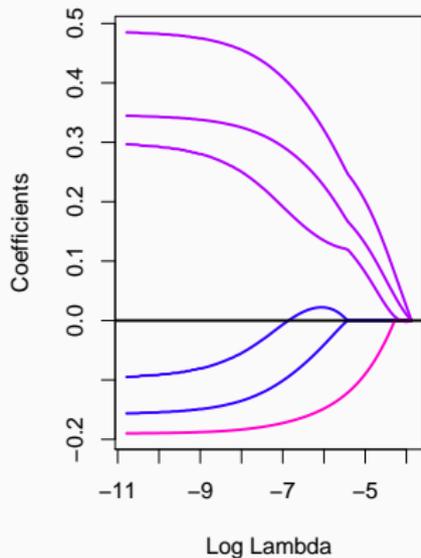
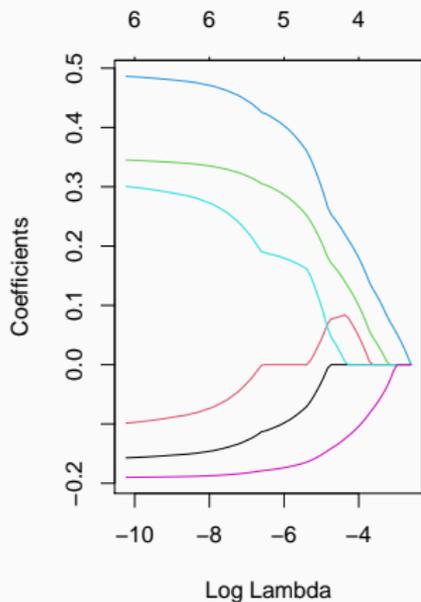
$$\sum_{i=1}^n \left(y_i - \beta_0 - \sum_{\ell=1}^L \mathbf{x}_{i\ell} \beta_\ell \right)^2 + \lambda \sum_{\ell=1}^L \sqrt{d_\ell} \|\beta_\ell\|_2$$

Remarque

Puisque $\|\beta_\ell\|_2 = 0$ ssi $\beta_{\ell 1} = \dots = \beta_{\ell d_\ell} = 0$, cette procédure encourage la **mise à zéro** des coefficients d'un **même groupe**.

- La fonction `gglasso` du package `gglasso` permet de faire du **groupe lasso** sur R.

```
> summary(donnees)
##           X1                X2                X3                Y
## Length:200      Length:200      Min.   :0.009496  Min.   : -3.23315
## Class :character  Class :character  1st Qu.:0.237935  1st Qu.: -0.50404
## Mode  :character  Mode  :character  Median :0.485563  Median :  0.16759
##                                     Mean  :0.483286  Mean   :  0.09792
##                                     3rd Qu.:0.734949  3rd Qu.:  0.66918
##                                     Max.   :0.998741  Max.   :  3.04377
> D <- model.matrix(Y~.,data=donnees)[,-1]
> model <- glmnet(D,Y,alpha=1)
> groupe <- c(1,1,2,2,2,3)
> library(gglasso)
> model1 <- gglasso(D,Y,group=groupe)
> plot(model1)
```



Remarque

Les coefficients **s'annulent par groupe** lorsque λ augmente (graphe de droite).

Sparse group lasso

- La **norme 2** de la pénalité group-lasso implique que, généralement, tous les coefficients d'un groupe sont **tous nuls** ou **tous non nuls**.
- Dans certains cas, il peut être intéressant de mettre de la **sparsité** dans les groupes aussi. Comment ?

Sparse group lasso

- La **norme 2** de la pénalité group-lasso implique que, généralement, tous les coefficients d'un groupe sont **tous nuls** ou **tous non nuls**.
- Dans certains cas, il peut être intéressant de mettre de la **sparsité** dans les groupes aussi. Comment ?
- En ajoutant **la norme 1** dans la pénalité.

Sparse group lasso

- La **norme 2** de la pénalité group-lasso implique que, généralement, tous les coefficients d'un groupe sont **tous nuls** ou **tous non nuls**.
- Dans certains cas, il peut être intéressant de mettre de la **sparsité** dans les groupes aussi. Comment ?
- En ajoutant **la norme 1** dans la pénalité.

Pénalité sparse group lasso

$$\lambda \sum_{\ell=1}^L [(1 - \alpha) \|\beta_{\ell}\|_2 + \alpha \|\beta_{\ell}\|_1].$$

- Sur **R** : package **SGL**.

Fused lasso

- Utile pour prendre en compte la **spatialité des données**.
- **Idée** : deux coefficients successifs doivent être proches.

Pénalité fused lasso

$$\lambda_1 \sum_{j=1}^d |\beta_j|$$

Fused lasso

- Utile pour prendre en compte la **spatialité des données**.
- **Idée** : deux coefficients successifs doivent être proches.

Pénalité fused lasso

$$\lambda_1 \sum_{j=1}^d |\beta_j| + \lambda_2 \sum_{j=2}^d |\beta_{j+1} - \beta_j|$$

qui peut se re-paramétrer en

$$\lambda \sum_{j=2}^d |\beta_{j+1} - \beta_j|.$$

- Sur **R** : package **genlasso**.

Estimation par moindres carrés

Sélection de variables

Régularisation

Régression ridge

Régression Lasso

Variantes de ridge/lasso

Discrimination binaire

Support vector machine

SVM - cas séparable

SVM : cas non séparable

SVM non linéaire : astuce du noyau

Scores et probabilités

Compléments : SVM multi-classes et SVR

SVM multiclass

Support vector regression (SVR)

- Les méthodes **ridge et lasso** ont été présentées dans un cadre de régression linéaire.
- Ces techniques s'adaptent directement à la **régression logistique** $\mathcal{Y} = \{-1, 1\}$.

Discrimination binaire

- Les méthodes **ridge et lasso** ont été présentées dans un cadre de régression linéaire.
- Ces techniques d'adaptent directement à la **régression logistique** $\mathcal{Y} = \{-1, 1\}$.
- Les **pénalités** sont **identiques**.
- **Seul changement** : le critère moindre carré est remplacé par la déviance \implies ce qui revient à **minimiser l'opposé de la vraisemblance plus la pénalité**.

Définition

On note $\tilde{y}_i = (y_i + 1)/2$.

- On appelle **estimateur ridge** en régression logistique l'estimateur

$$\hat{\beta}^R = \operatorname{argmin}_{\beta} \left\{ - \sum_{i=1}^n (\tilde{y}_i x_i^t \beta - \log(1 + \exp(x_i^t \beta))) + \lambda \sum_{j=1}^d \beta_j^2 \right\}.$$

- On appelle **estimateur lasso** en régression logistique l'estimateur

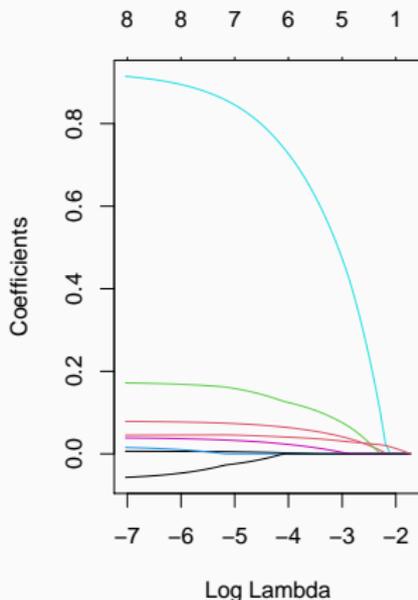
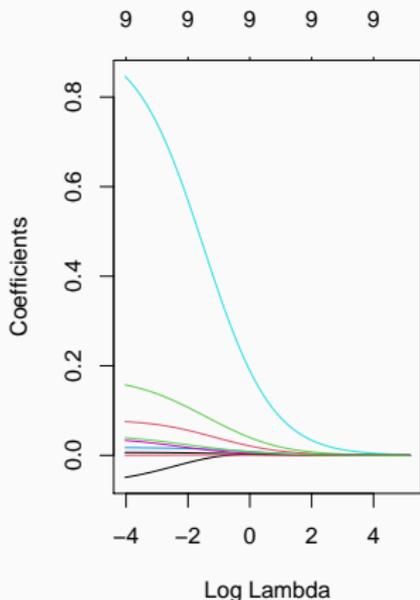
$$\hat{\beta}^L = \operatorname{argmin}_{\beta} \left\{ - \sum_{i=1}^n (\tilde{y}_i x_i^t \beta - \log(1 + \exp(x_i^t \beta))) + \lambda \sum_{j=1}^d |\beta_j| \right\}.$$

- Pour faire du ridge ou lasso en logistique, il suffit d'ajouter l'argument `family=binomial` dans `glmnet`.
- Tout reste identique pour le reste (tracé du chemin des coefficients, choix du λ ...).
- Exemple : données SAheart

```
> head(SAheart)
##   sbp tobacco   ldl adiposity famhist typea obesity alcohol age chd
## 1 160   12.00 5.73   23.11 Present   49   25.30   97.20 52  1
## 2 144    0.01 4.41   28.61  Absent   55   28.87    2.06 63  1
## 3 118    0.08 3.48   32.28 Present   52   29.14    3.81 46  0
## 4 170    7.50 6.41   38.03 Present   51   31.99   24.26 58  1
## 5 134   13.60 3.50   27.78 Present   60   25.99   57.34 49  1
## 6 132    6.20 6.47   36.21 Present   62   30.77   14.14 45  0
```

- On obtient les chemins de régularisation ridge et lasso avec les commandes suivantes :

```
> SAheart.X <- model.matrix(chd~.,data=SAheart)
> log.ridge <- glmnet(SAheart.X,SAheart$chd,family="binomial",alpha=0)
> log.lasso <- glmnet(SAheart.X,SAheart$chd,family="binomial",alpha=1)
> plot(log.ridge,xvar="lambda")
```



Estimation par moindres carrés

Sélection de variables

Régularisation

Régression ridge

Régression Lasso

Variantes de ridge/lasso

Discrimination binaire

Support vector machine

SVM - cas séparable

SVM : cas non séparable

SVM non linéaire : astuce du noyau

Scores et probabilités

Compléments : SVM multi-classes et SVR

SVM multiclass

Support vector regression (SVR)

- **Discrimination binaire** : Y à valeurs dans $\{-1, 1\}$ et $X = (X_1, \dots, X_d)$ dans \mathbb{R}^d .
- Les extensions **multi-classes** et **régression** seront présentées à la fin de cette partie.

Objectif

- Estimer la **fonction de score** $S(x) = \mathbf{P}(Y = 1|X = x)$;
- En déduire une **règle de classification** $g : \mathbb{R}^d \rightarrow \{-1, 1\}$.

- Elles consistent à **séparer** l'espace des X par un **hyperplan**.
- On classe ensuite 1 d'un côté de l'hyperplan, -1 de l'autre côté.

Règles linéaires

- Elles consistent à **séparer** l'espace des X par un **hyperplan**.
- On classe ensuite 1 d'un côté de l'hyperplan, -1 de l'autre côté.

Mathématiquement

- On cherche une combinaison linéaire des variables $w_1x_1 + \dots + w_dx_d$.
- Règle associée :

$$g(x) = \begin{cases} 1 & \text{si } w_1x_1 + \dots + w_dx_d \geq 0 \\ -1 & \text{sinon.} \end{cases}$$

Exemple 1 : régression logistique

- **Modèle :**

$$\text{logit} \frac{p(x)}{1-p(x)} = \beta_0 + \beta_1 x_1 + \dots + \beta_d x_d$$

où $p(x) = \mathbf{P}(Y = 1 | X = x)$.

- **Règle de classification :**

$$g(x) = \begin{cases} 1 & \text{si } p(x) \geq 0.5 \\ -1 & \text{sinon.} \end{cases}$$

Exemple 1 : régression logistique

- **Modèle :**

$$\text{logit} \frac{p(x)}{1-p(x)} = \beta_0 + \beta_1 x_1 + \dots + \beta_d x_d$$

où $p(x) = \mathbf{P}(Y = 1 | X = x)$.

- **Règle de classification :**

$$g(x) = \begin{cases} 1 & \text{si } p(x) \geq 0.5 \\ -1 & \text{sinon.} \end{cases}$$

- équivalent à

$$g(x) = \begin{cases} 1 & \text{si } \beta_0 + \beta_1 x_1 + \dots + \beta_d x_d \geq 0 \\ -1 & \text{sinon.} \end{cases}$$

Exemple 2 : LDA

- **Modèle** : $\mathcal{L}(X|Y = k) = \mathcal{N}(\mu_k, \Sigma), k = 0, 1.$
- **Règle de classification** :

$$g(x) = \begin{cases} 1 & \text{si } p(x) \geq 0.5 \\ -1 & \text{sinon.} \end{cases}$$

Exemple 2 : LDA

- **Modèle** : $\mathcal{L}(X|Y = k) = \mathcal{N}(\mu_k, \Sigma)$, $k = 0, 1$.
- **Règle de classification** :

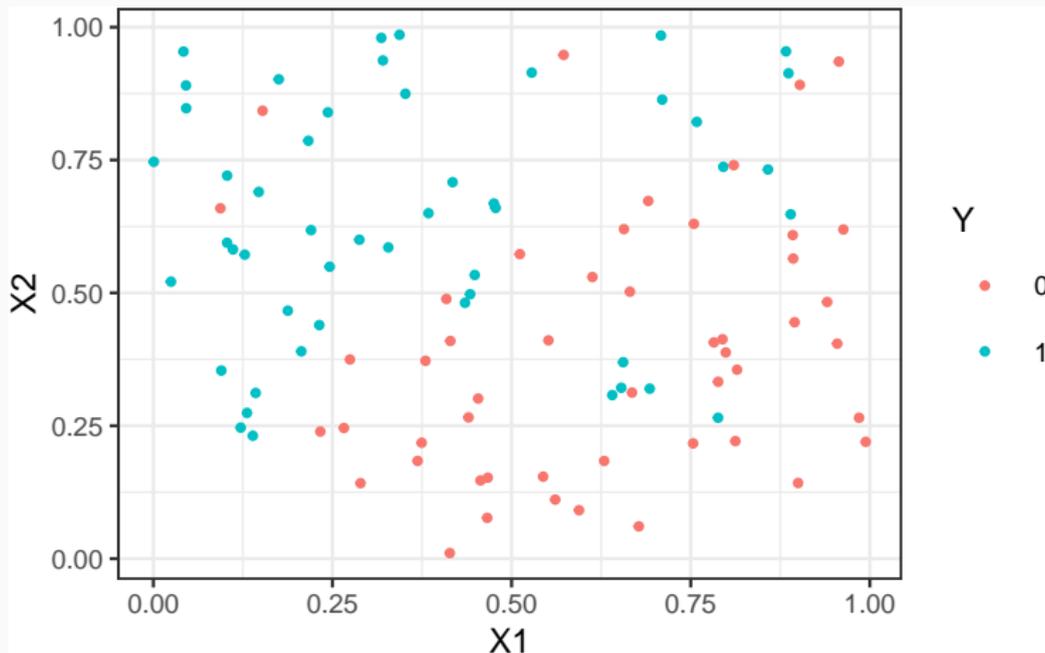
$$g(x) = \begin{cases} 1 & \text{si } p(x) \geq 0.5 \\ -1 & \text{sinon.} \end{cases}$$

- équivalent à

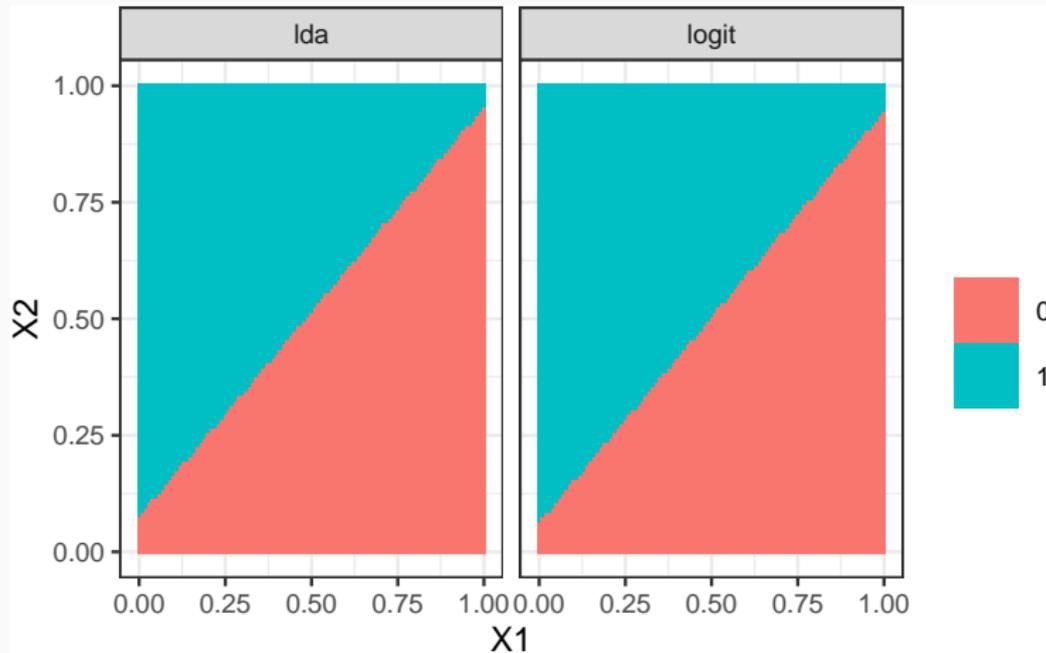
$$g(x) = \begin{cases} 1 & \text{si } c + x^t \Sigma^{-1}(\mu_1 - \mu_0) \geq 0 \\ -1 & \text{sinon.} \end{cases}$$

Illustration avec $p = 2$

- On considère les données suivantes :



- On compare les prévisions **logistique** et **lda**.



Remarque

On retrouve bien la **linéarité** (et la **proximité**) de ces deux méthodes.

- Ces approches linéaires s'obtiennent à partir d'un modèle statistique
 - sur la loi de Y sachant X pour la logistique ;
 - sur la loi de X sachant Y pour la discriminante linéaire.

- Ces approches linéaires s'obtiennent à partir d'un **modèle statistique**
 - sur la loi de **Y sachant X** pour la logistique ;
 - sur la loi de **X sachant Y** pour la discriminante linéaire.
- L'approche **SVM** repose sur le calcul direct du "**meilleur**" **hyperplan séparateur** qui sera déterminé à partir d'algorithmes d'optimisation.

Estimation par moindres carrés

Sélection de variables

Régularisation

Régression ridge

Régression Lasso

Variantes de ridge/lasso

Discrimination binaire

Support vector machine

SVM - cas séparable

SVM : cas non séparable

SVM non linéaire : astuce du noyau

Scores et probabilités

Compléments : SVM multi-classes et SVR

SVM multiclass

Support vector regression (SVR)

Bibliographie

En plus des documents cités précédemment, cette partie s'appuie sur les diapos de cours de

- **Magalie Fromont**, Apprentissage statistique, Université Rennes 2 ([Fromont, 2015]).
- **Jean-Philippe Vert**, *Support vector machines and applications in computational biology*, disponible à l'url <http://cbio.ensmp.fr/~jvert/svn/kernelcourse/slides/kernel2h/kernel2h.pdf>

Remarque

Les aspects techniques ne seront pas présentés ici, on pourra en trouver dans la [partie 2.4 du tutoriel](#).

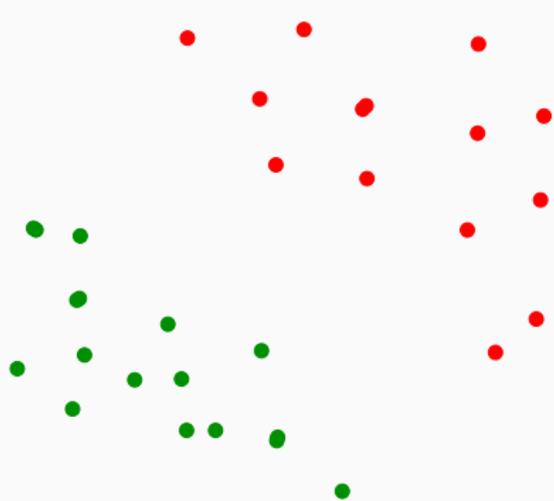
- L'approche SVM [Vapnik, 2000] peut être vue comme une généralisation de "recherche d'hyperplan optimal".

- L'approche SVM [Vapnik, 2000] peut être vue comme une généralisation de "recherche d'hyperplan optimal".

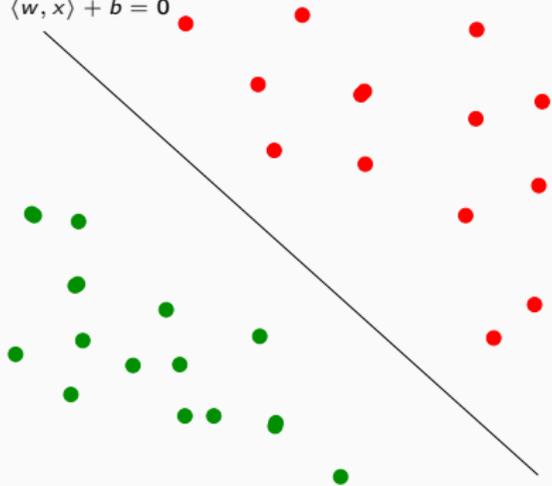
Cas simple

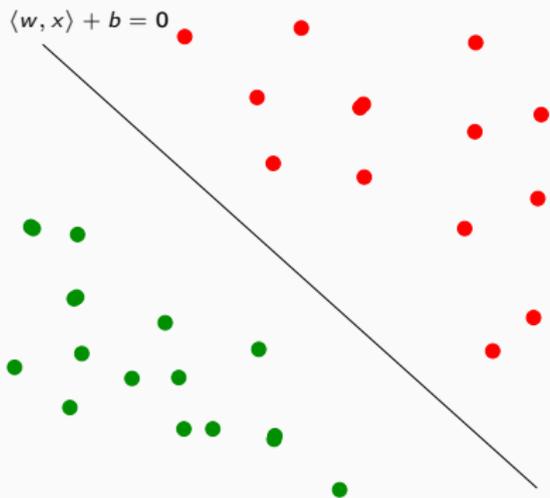
Les données $(x_1, y_1), \dots, (x_n, y_n)$ sont dites **linéairement séparables** si il existe $(w, b) \in \mathbb{R}^d \times \mathbb{R}$ tel que pour tout i :

- $y_i = 1$ si $\langle w, x_i \rangle + b = w^t x_i + b > 0$;
- $y_i = -1$ si $\langle w, x_i \rangle + b = w^t x_i + b < 0$.



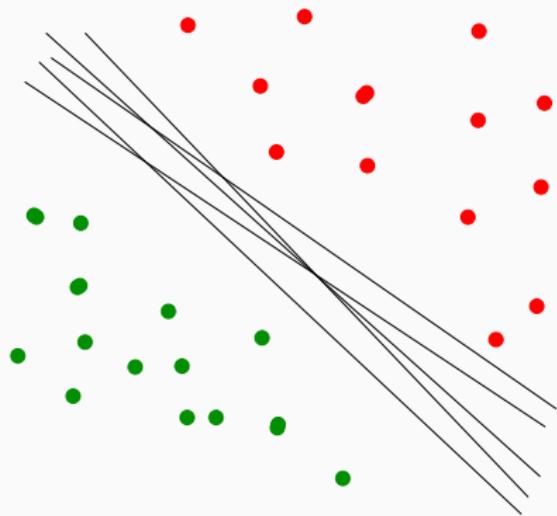
$$\langle w, x \rangle + b = 0$$





Vocabulaire

- L'équation $\langle w, x \rangle + b$ définit un **hyperplan séparateur** de vecteur normal w .
- La fonction $\text{signe}(\langle w, x \rangle + b)$ est une règle de **discrimination** potentielle.

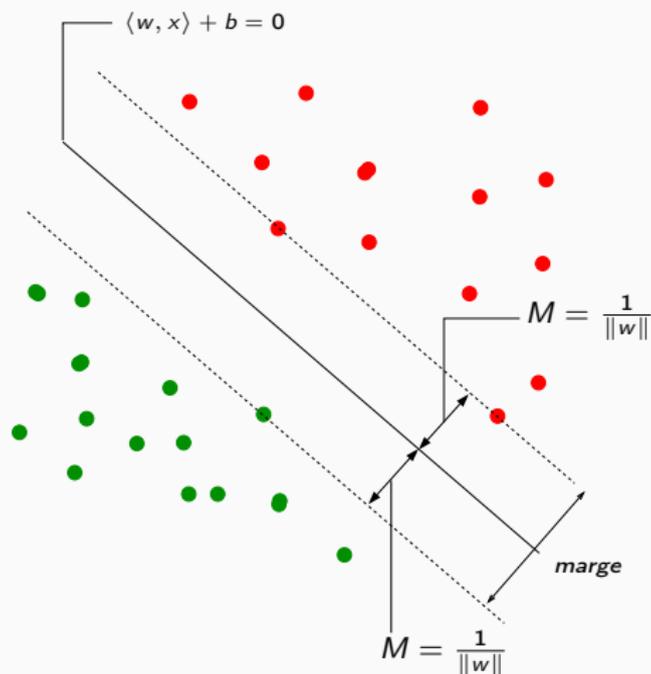


Problème

Il existe une **infinité d'hyperplans séparateurs** donc une **infinité de règles de discrimination potentielles**.

Solution

[Vapnik, 2000] propose de choisir l'hyperplan ayant la **marge maximale**.



Le problème d'optimisation

- On veut trouver l'hyperplan de **marge maximale** qui **sépare** les groupes.

Le problème d'optimisation

- On veut trouver l'hyperplan de **marge maximale** qui **sépare** les groupes.

Hyperplan séparateur optimal

Solution du problème **d'optimisation sous contrainte** :

- **Version 1** :

$$\max_{w, b, \|w\|=1} M$$

sous les contraintes $y_i(w^t x_i + b) \geq M, i = 1, \dots, n.$

Le problème d'optimisation

- On veut trouver l'hyperplan de **marge maximale** qui **sépare** les groupes.

Hyperplan séparateur optimal

Solution du problème **d'optimisation sous contrainte** :

- **Version 1** :

$$\max_{w, b, \|w\|=1} M$$

sous les contraintes $y_i(w^t x_i + b) \geq M, i = 1, \dots, n.$

- **Version 2** :

$$\min_{w, b} \frac{1}{2} \|w\|^2$$

sous les contraintes $y_i(w^t x_i + b) \geq 1, i = 1, \dots, n.$

- On obtient

$$w^* = \sum_{i=1}^n \alpha_i^* y_i x_i.$$

où les α_i^* sont des constantes positives qui s'obtiennent en résolvant le **dual** du problème précédent.

- De plus, b^* s'obtient en résolvant

$$\alpha_i^* [y_i (x_i^t w + b) - 1] = 0$$

pour un α_i^* non nul.

Solutions

- On obtient

$$w^* = \sum_{i=1}^n \alpha_i^* y_i x_i.$$

où les α_i^* sont des constantes positives qui s'obtiennent en résolvant le **dual** du problème précédent.

- De plus, b^* s'obtient en résolvant

$$\alpha_i^* [y_i (x_i^t w + b) - 1] = 0$$

pour un α_i^* non nul.

Remarque

w^* s'écrit comme une **combinaison linéaire** des x_i .

Propriété (conditions KKT)

$$\alpha_i^* [y_i(x_i^t w^* + b) - 1] = 0, i = 1, \dots, n.$$

Propriété (conditions KKT)

$$\alpha_i^* [y_i(x_i^t w^* + b) - 1] = 0, i = 1, \dots, n.$$

Conséquence (importante)

- Si $\alpha_i^* \neq 0$ alors $y_i(x_i^t w^* + b) = 1$ et x_i est **sur la marge**.
- w^* se calcule **uniquement** à partir de ces points là.

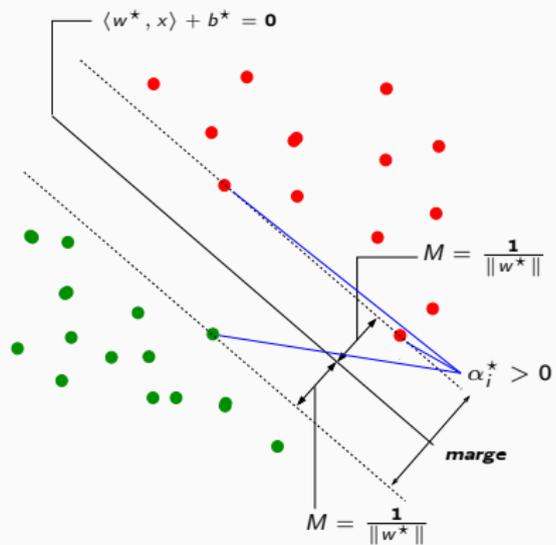
Propriété (conditions KKT)

$$\alpha_i^* [y_i(x_i^t w^* + b) - 1] = 0, i = 1, \dots, n.$$

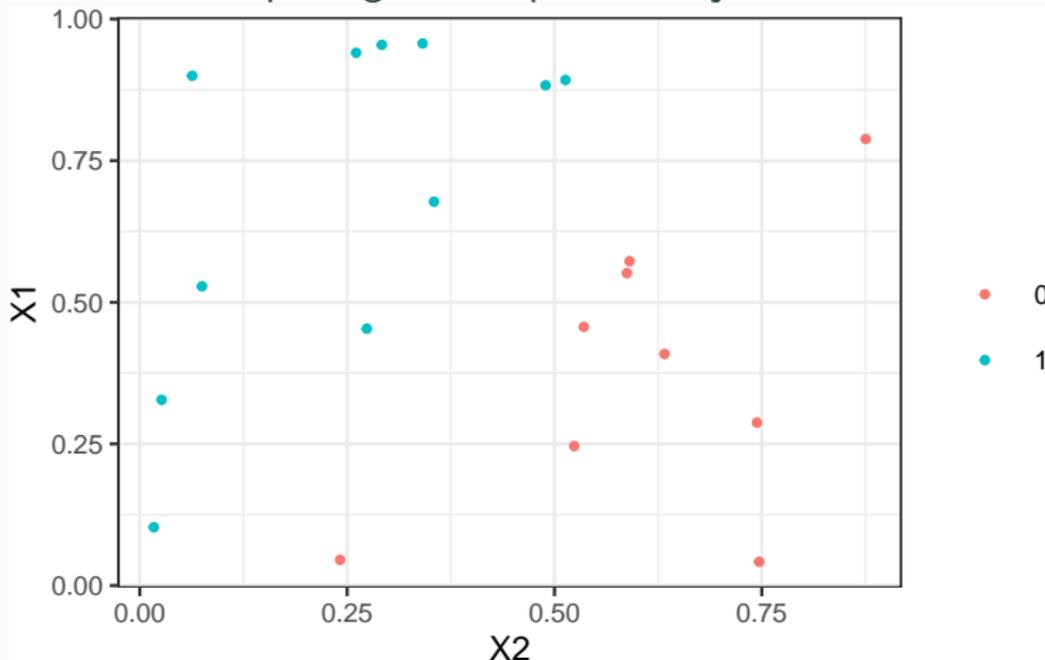
Conséquence (importante)

- Si $\alpha_i^* \neq 0$ alors $y_i(x_i^t w^* + b) = 1$ et x_i est **sur la marge**.
- w^* se calcule **uniquement** à partir de ces points là.
- Ces points sont appelés les **vecteurs supports** de la SVM.

Représentation



- La fonction `svm` du package `e1071` permet d'ajuster des SVM.



```
> library(e1071)
> mod.svm <- svm(Y~.,data=df,kernel="linear",cost=10000000000)
```

La fonction svm

- Les vecteurs supports :

```
> mod.svm$index
## [1] 6 14 12
```

- `mod.svm$coefs` = $\alpha_i^* y_i$ pour chaque vecteur support

```
> mod.svm$coefs
##           [,1]
## [1,]  1.898982
## [2,]  1.905497
## [3,] -3.804479
```

La fonction svm

- Les vecteurs supports :

```
> mod.svm$index
## [1] 6 14 12
```

- `mod.svm$coefs` = $\alpha_i^* y_i$ pour chaque vecteur support

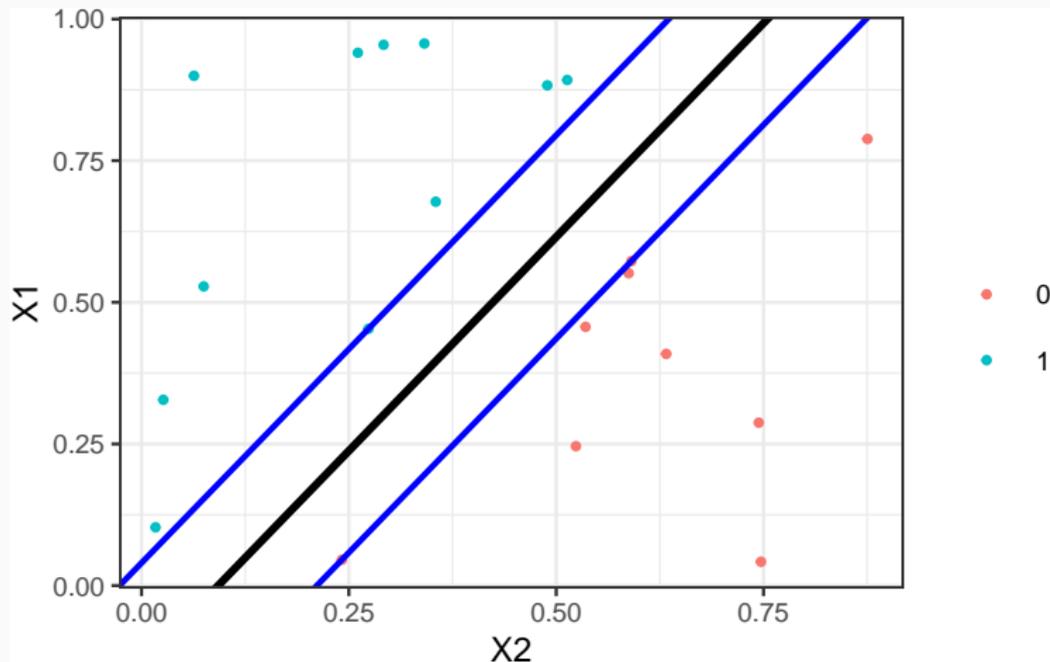
```
> mod.svm$coefs
##          [,1]
## [1,]  1.898982
## [2,]  1.905497
## [3,] -3.804479
```

- On peut en déduire l'hyperplan séparateur

```
> w <- apply(mod.svm$coefs*df[mod.svm$index,2:3],2,sum)
> b <- -mod.svm$rho
> w
##          X1          X2
## -0.5470382  0.5427583
> b
## [1] -0.4035113
```

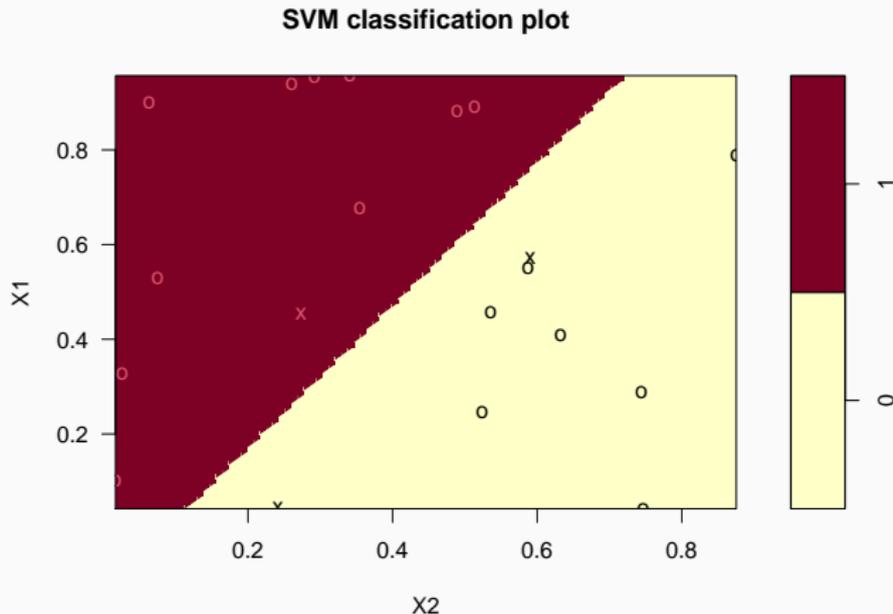
On peut ainsi visualiser

- les vecteurs supports ;
- l'hyperplan séparateur ;
- la marge.



- La fonction `plot` donne aussi une représentation de l'**hyperplan séparateur**.

```
> plot(mod.svm,data=df,fill=TRUE,grid=100)
```



Estimation par moindres carrés

Sélection de variables

Régularisation

Régression ridge

Régression Lasso

Variantes de ridge/lasso

Discrimination binaire

Support vector machine

SVM - cas séparable

SVM : cas non séparable

SVM non linéaire : astuce du noyau

Scores et probabilités

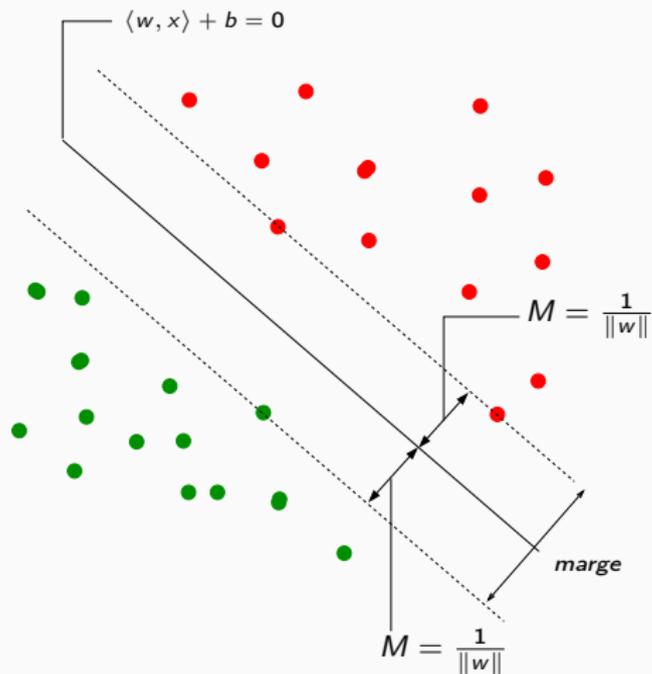
Compléments : SVM multi-classes et SVR

SVM multiclass

Support vector regression (SVR)

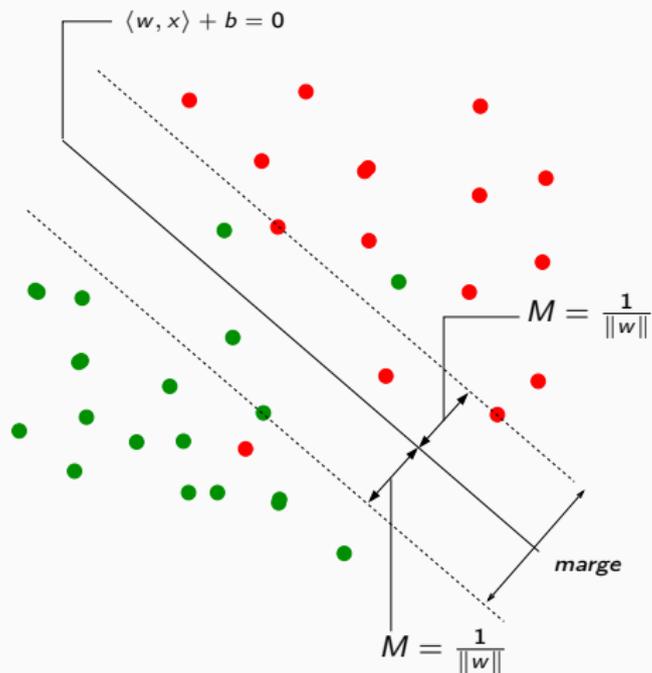
Problème

Dans la vraie vie, les données ne sont (quasiment) **jamais linéairement séparables**...



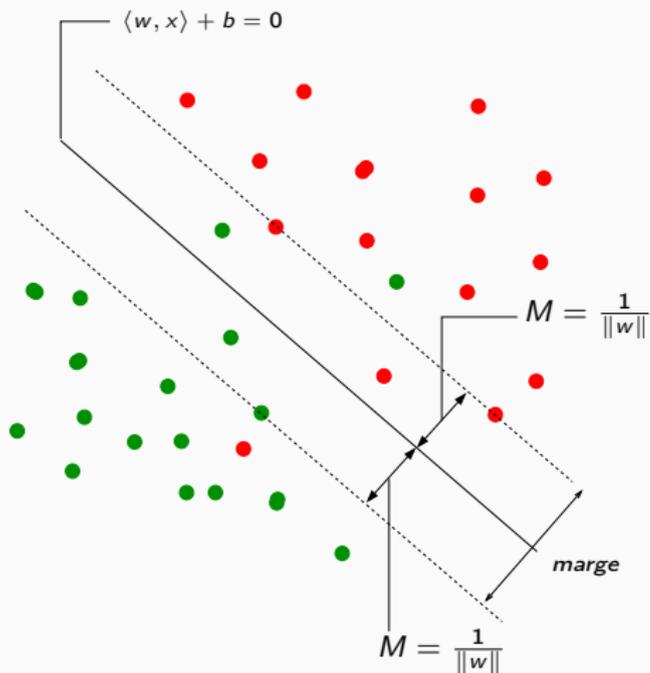
Problème

Dans la vraie vie, les données ne sont (quasiment) **jamais linéairement séparables**...



Problème

Dans la vraie vie, les données ne sont (quasiment) **jamais linéairement séparables**...



Idée

Autoriser certains points

1. à être **bien classés** mais à l'**intérieur** de la marge ;
2. et/ou à être **mal classés**.

Rappel : cas séparable

$$\min_{w,b} \frac{1}{2} \|w\|^2$$

sous les contraintes $y_i(w^t x_i + b) \geq 1, i = 1, \dots, n.$

- Les contraintes $y_i(w^t x_i + b) \geq 1$ signifient que tous les points se trouvent en dehors de la frontière définie par la **marge** ;

Rappel : cas séparable

$$\min_{w,b} \frac{1}{2} \|w\|^2$$

sous les contraintes $y_i(w^t x_i + b) \geq 1, i = 1, \dots, n.$

- Les contraintes $y_i(w^t x_i + b) \geq 1$ signifient que tous les points se trouvent en dehors de la frontière définie par la **marge** ;
- **Cas non séparable** : le problème ci-dessus n'admet pas de solution !

Slack variables

Rappel : cas séparable

$$\min_{w,b} \frac{1}{2} \|w\|^2$$

sous les contraintes $y_i(w^t x_i + b) \geq 1, i = 1, \dots, n.$

- Les contraintes $y_i(w^t x_i + b) \geq 1$ signifient que tous les points se trouvent en dehors de la frontière définie par la **marge** ;
- **Cas non séparable** : le problème ci-dessus n'admet pas de solution !

Variables ressorts

On introduit des **variables ressorts (slack variables)** positives ξ_1, \dots, ξ_n telles que $y_i(w^t x_i + b) \geq 1 - \xi_i$. 2 cas sont à distinguer :

1. $\xi_i \in [0, 1] \implies$

Slack variables

Rappel : cas séparable

$$\min_{w,b} \frac{1}{2} \|w\|^2$$

sous les contraintes $y_i(w^t x_i + b) \geq 1, i = 1, \dots, n.$

- Les contraintes $y_i(w^t x_i + b) \geq 1$ signifient que tous les points se trouvent en dehors de la frontière définie par la **marge** ;
- **Cas non séparable** : le problème ci-dessus n'admet pas de solution !

Variables ressorts

On introduit des **variables ressorts (slack variables)** positives ξ_1, \dots, ξ_n telles que $y_i(w^t x_i + b) \geq 1 - \xi_i$. 2 cas sont à distinguer :

1. $\xi_i \in [0, 1] \implies$ bien classé mais **dans** la région définie par la **marge** ;

Slack variables

Rappel : cas séparable

$$\min_{w,b} \frac{1}{2} \|w\|^2$$

sous les contraintes $y_i(w^t x_i + b) \geq 1, i = 1, \dots, n.$

- Les contraintes $y_i(w^t x_i + b) \geq 1$ signifient que tous les points se trouvent en dehors de la frontière définie par la **marge** ;
- **Cas non séparable** : le problème ci-dessus n'admet pas de solution !

Variables ressorts

On introduit des **variables ressorts (slack variables)** positives ξ_1, \dots, ξ_n telles que $y_i(w^t x_i + b) \geq 1 - \xi_i$. 2 cas sont à distinguer :

1. $\xi_i \in [0, 1] \implies$ bien classé mais **dans** la région définie par la **marge** ;
2. $\xi_i > 1 \implies$

Slack variables

Rappel : cas séparable

$$\min_{w,b} \frac{1}{2} \|w\|^2$$

sous les contraintes $y_i(w^t x_i + b) \geq 1, i = 1, \dots, n.$

- Les contraintes $y_i(w^t x_i + b) \geq 1$ signifient que tous les points se trouvent en dehors de la frontière définie par la **marge** ;
- **Cas non séparable** : le problème ci-dessus n'admet pas de solution !

Variables ressorts

On introduit des **variables ressorts (slack variables)** positives ξ_1, \dots, ξ_n telles que $y_i(w^t x_i + b) \geq 1 - \xi_i$. 2 cas sont à distinguer :

1. $\xi_i \in [0, 1] \implies$ bien classé mais **dans** la région définie par la **marge** ;
2. $\xi_i > 1 \implies$ **mal classé**.

- Bien entendu, on souhaite avoir le **maximum** de variables ressorts ξ_i nulles;
- Lorsque $\xi_i > 0$, on souhaite que ξ_i soit le **plus petit possible**.

- Bien entendu, on souhaite avoir le **maximum** de variables ressorts ξ_i nulles;
- Lorsque $\xi_i > 0$, on souhaite que ξ_i soit le **plus petit possible**.

Cas non séparable : problème d'optimisation (primal)

- Il s'agit de minimiser en (w, b, ξ)

$$\frac{1}{2} \|w\|^2$$

sous les contraintes $\left\{ \begin{array}{l} y_i(w^t x_i + b) \geq 1 \end{array} \right.$

- Bien entendu, on souhaite avoir le **maximum** de variables ressorts ξ_i nulles;
- Lorsque $\xi_i > 0$, on souhaite que ξ_i soit le **plus petit possible**.

Cas non séparable : problème d'optimisation (primal)

- Il s'agit de minimiser en (w, b, ξ)

$$\frac{1}{2} \|w\|^2 + C \sum_{i=1}^n \xi_i$$

sous les contraintes

$$\begin{cases} y_i(w^t x_i + b) \geq 1 - \xi_i \\ \xi_i \geq 0, i = 1, \dots, n. \end{cases}$$

- Bien entendu, on souhaite avoir le **maximum** de variables ressorts ξ_i nulles;
- Lorsque $\xi_i > 0$, on souhaite que ξ_i soit le **plus petit possible**.

Cas non séparable : problème d'optimisation (primal)

- Il s'agit de minimiser en (w, b, ξ)

$$\frac{1}{2} \|w\|^2 + C \sum_{i=1}^n \xi_i$$

sous les contraintes $\left\{ \begin{array}{l} y_i(w^t x_i + b) \geq 1 - \xi_i \\ \xi_i \geq 0, i = 1, \dots, n. \end{array} \right.$

- $C > 0$ est un paramètre à calibrer (**paramètre de coût**).

- Bien entendu, on souhaite avoir le **maximum** de variables ressorts ξ_i nulles;
- Lorsque $\xi_i > 0$, on souhaite que ξ_i soit le **plus petit possible**.

Cas non séparable : problème d'optimisation (primal)

- Il s'agit de minimiser en (w, b, ξ)

$$\frac{1}{2} \|w\|^2 + C \sum_{i=1}^n \xi_i$$

sous les contraintes $\left\{ \begin{array}{l} y_i(w^t x_i + b) \geq 1 - \xi_i \\ \xi_i \geq 0, i = 1, \dots, n. \end{array} \right.$

- $C > 0$ est un paramètre à calibrer (**paramètre de coût**).
- Le **cas séparable** correspond à $C \rightarrow \infty$.

- Les **solutions** de ce nouveau problème d'optimisation s'obtiennent de la **même façon** que dans le cas séparable (Lagrangien, problème dual...).
- L'**hyperplan optimal** est défini par

$$w^* = \sum_{i=1}^n \alpha_i^* y_i x_i$$

et b^* est solution de $y_i(\langle w^*, x_i \rangle + b^*) = 1$ pour tout i tel que $0 < \alpha_i^* < C$.

- Les **solutions** de ce nouveau problème d'optimisation s'obtiennent de la **même façon** que dans le cas séparable (Lagrangien, problème dual...).
- L'**hyperplan optimal** est défini par

$$w^* = \sum_{i=1}^n \alpha_i^* y_i x_i$$

et b^* est solution de $y_i(\langle w^*, x_i \rangle + b^*) = 1$ pour tout i tel que $0 < \alpha_i^* < C$.

Vecteurs supports

- Les x_i tels que $\alpha_i^* > 0$ sont les vecteurs supports ;
- On en distingue 2 types :
 1. ceux **sur la frontière** définie par la marge : $\xi_i^* = 0$;
 2. ceux **en dehors** : $\xi_i^* > 0$ et $\alpha_i^* = C$.

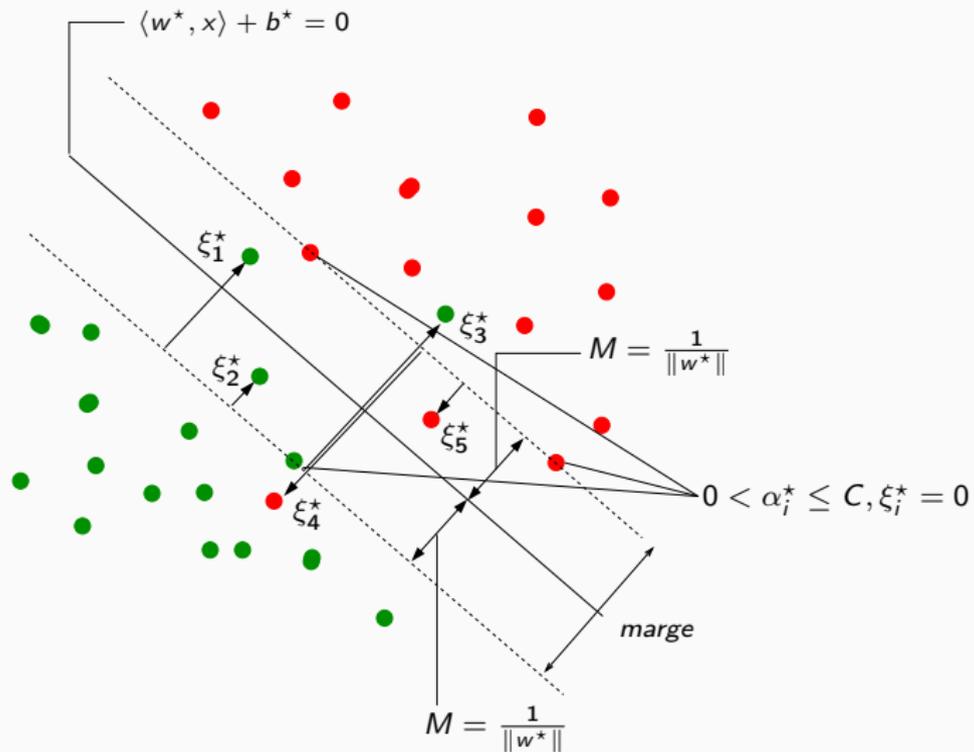
- Les **solutions** de ce nouveau problème d'optimisation s'obtiennent de la **même façon** que dans le cas séparable (Lagrangien, problème dual...).
- L'**hyperplan optimal** est défini par

$$w^* = \sum_{i=1}^n \alpha_i^* y_i x_i$$

et b^* est solution de $y_i(\langle w^*, x_i \rangle + b^*) = 1$ pour tout i tel que $0 < \alpha_i^* < C$.

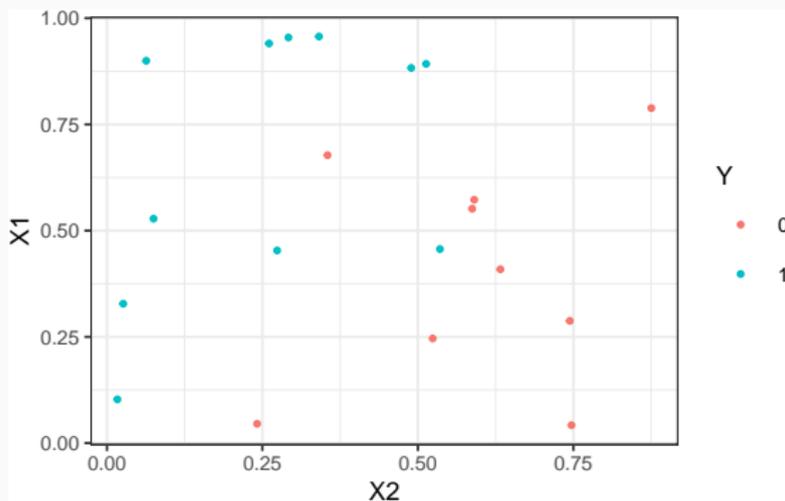
Vecteurs supports

- Les x_i tels que $\alpha_i^* > 0$ sont les vecteurs supports ;
- On en distingue 2 types :
 1. ceux **sur la frontière** définie par la marge : $\xi_i^* = 0$;
 2. ceux **en dehors** : $\xi_i^* > 0$ et $\alpha_i^* = C$.
- Les vecteurs **non supports** vérifient $\alpha_i^* = 0$ et $\xi_i^* = 0$.



Le coin R

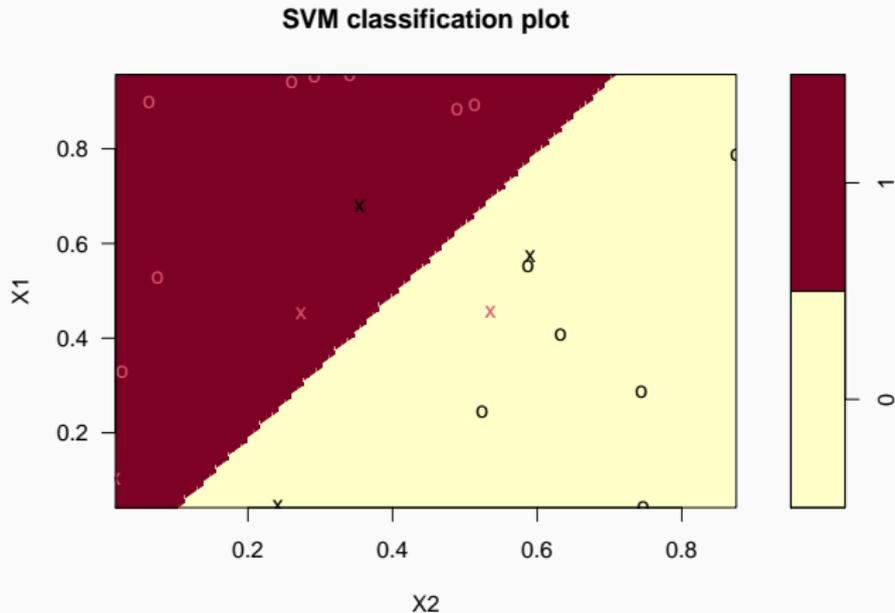
- On utilise la même fonction que dans le **cas séparable** (`svm` du package `e1071`);
- L'argument `cost` correspond à la **constante de régularisation C** .



```
> mod.svm1 <- svm(Y~.,data=df1,kernel="linear",cost=1000)
> mod.svm1$index
## [1] 6 13 14 10 12 15
```

Visualisation de l'hyperplan séparateur

```
> plot(mod.svm1, data=df1, fill=TRUE, grid=100)
```



Ce paramètre régule le **compromis biais/variance** de la svm :

- $C \searrow$: la marge est privilégiée et les $\xi_i \nearrow \implies$

Ce paramètre régule le **compromis biais/variance** de la svm :

- $C \searrow$: la marge est privilégiée et les $\xi_i \nearrow \implies$ beaucoup d'observations dans la marge ou **mal classées** (et donc beaucoup de vecteurs supports).

Ce paramètre régule le **compromis biais/variance** de la svm :

- $C \searrow$: la marge est privilégiée et les $\xi_i \nearrow \implies$ beaucoup d'observations dans la marge ou **mal classées** (et donc beaucoup de vecteurs supports).
- $C \nearrow \implies \xi_i \searrow$ donc moins d'observations mal classées \implies

Ce paramètre régule le **compromis biais/variance** de la svm :

- $C \searrow$: la marge est privilégiée et les $\xi_i \nearrow \implies$ beaucoup d'observations dans la marge ou **mal classées** (et donc beaucoup de vecteurs supports).
- $C \nearrow \implies \xi_i \searrow$ donc moins d'observations mal classées \implies **meilleur ajustement** mais petite marge \implies risque de **surajustement**.

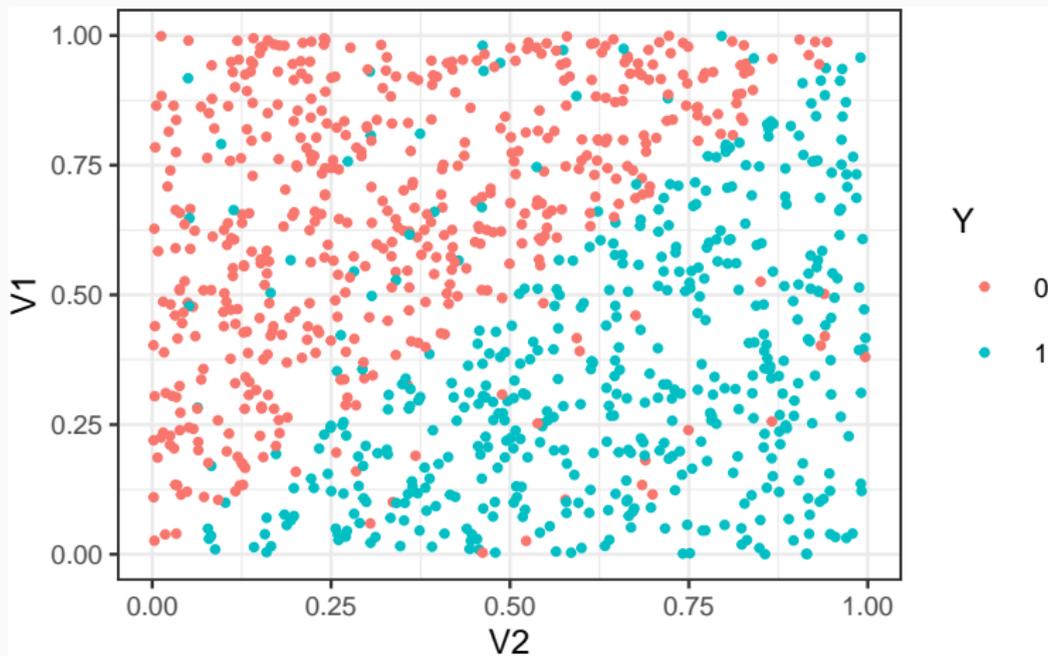
Conclusion

Il est donc très important de bien choisir ce paramètre.

- Le choix est souvent effectué de façon "classique" :
 1. On se donne un **critère de performance** (taux de mal classés par exemple);
 2. On **estime la valeur du critère** pour différentes valeurs de C ;
 3. On choisit la valeur de C pour laquelle le **critère estimé est minimum**.

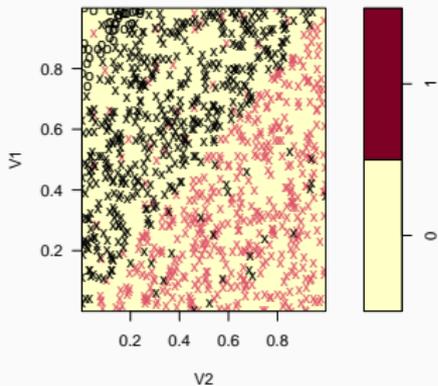
- Le choix est souvent effectué de façon "classique" :
 1. On se donne un **critère de performance** (taux de mal classés par exemple) ;
 2. On **estime la valeur du critère** pour différentes valeurs de C ;
 3. On choisit la valeur de C pour laquelle le **critère estimé est minimum**.
- La fonction **tune.svm** permet de choisir C en estimant le taux de mal classés par **validation croisée**. On peut aussi (bien entendu) utiliser la fonction **train** du package **caret**.

Un exemple

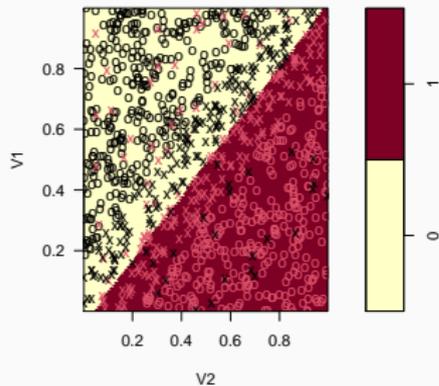


```
> mod.svm1 <- svm(Y~.,data=df3,kernel="linear",cost=0.000001)
> mod.svm2 <- svm(Y~.,data=df3,kernel="linear",cost=0.1)
> mod.svm3 <- svm(Y~.,data=df3,kernel="linear",cost=5)
```

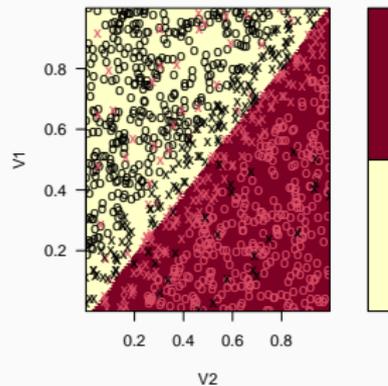
SVM classification plot



SVM classification plot



SVM classification plot



```
> mod.svm1$nSV
## [1] 480 480
> mod.svm2$nSV
## [1] 190 190
> mod.svm3$nSV
## [1] 166 165
```

Choix de C avec tune

```
> set.seed(1234)
> tune.out <- tune(svm, Y~., data=df3, kernel="linear",
+                 ranges=list(cost=c(0.001,0.01,1,10,100,1000)))
> summary(tune.out)
## Parameter tuning of 'svm':
## - sampling method: 10-fold cross validation
## - best parameters:
##   cost
##     1
##
## - best performance: 0.075
##
## - Detailed performance results:
##   cost error dispersion
## 1 1e-03 0.127 0.07087548
## 2 1e-02 0.080 0.03944053
## 3 1e+00 0.075 0.03439961
## 4 1e+01 0.075 0.03439961
## 5 1e+02 0.075 0.03439961
## 6 1e+03 0.075 0.03439961
```

```
> bestmod <- tune.out$best.model
> summary(bestmod)
##
## Call:
## best.tune(method = svm, train.x = Y ~ ., data = df3, ranges = list(cost = c(0.001,
##   0.01, 1, 10, 100, 1000)), kernel = "linear")
##
##
## Parameters:
##   SVM-Type:  C-classification
##   SVM-Kernel:  linear
##           cost:  1
##
## Number of Support Vectors:  336
##
## ( 168 168 )
##
##
## Number of Classes:  2
##
## Levels:
##  0 1
```

Approche `tune_grid` de `tidymodels`

1. Initialisation du `workflow` :

```
> library(tidymodels)
> tune_spec <-
+   svm_poly(cost=tune(),degree=1,scale_factor=1) %>%
+   set_mode("classification") %>%
+   set_engine("kernlab")
> svm_wf <- workflow() %>%
+   add_model(tune_spec) %>%
+   add_formula(Y ~ .)
```

2. Ré-échantillonnage et grille de paramètres :

```
> set.seed(12345)
> re_ech_cv <- vfold_cv(df3,v=10)
> grille_C <- tibble(cost=c(0.001,0.01,1,10,100,1000))
```

3. Calcul des erreurs :

```
> set.seed(123)
> svm.cv <- svm_wf %>%
+   tune_grid(
+     resamples = re_ech_cv,
+     grid = grille_C,
+     metrics=metric_set(accuracy))
```

4. Visualisation des résultats :

```
> svm.cv %>% collect_metrics() %>% dplyr::select(-7)
## # A tibble: 6 x 6
##       cost .metric .estimator  mean     n std_err
##   <dbl> <chr>    <chr>    <dbl> <int>  <dbl>
## 1  0.001 accuracy binary    0.864    10 0.0163
## 2  0.01  accuracy binary    0.915    10 0.00778
## 3  1     accuracy binary    0.927    10 0.00700
## 4  10    accuracy binary    0.927    10 0.00775
## 5 100    accuracy binary    0.929    10 0.00809
## 6 1000   accuracy binary    0.929    10 0.00809
```

5. Sélection du meilleur paramètre

```
> best_C <- svm.cv %>% select_best()
> best_C
## # A tibble: 1 x 2
##   cost .config
##   <dbl> <chr>
## 1    100 Preprocessor1_Model5
```

6. Ajustement de l'algorithme final :

```
> final_svm <-
+   svm_wf %>%
+   finalize_workflow(best_C) %>%
+   fit(data = df3)
```

Estimation par moindres carrés

Sélection de variables

Régularisation

Régression ridge

Régression Lasso

Variantes de ridge/lasso

Discrimination binaire

Support vector machine

SVM - cas séparable

SVM : cas non séparable

SVM non linéaire : astuce du noyau

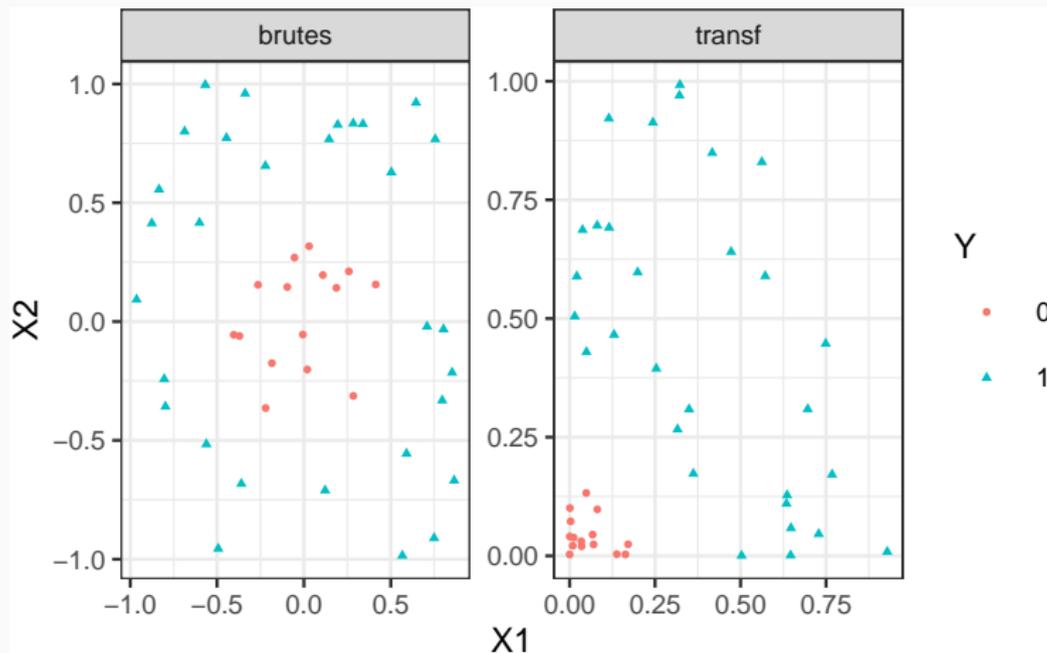
Scores et probabilités

Compléments : SVM multi-classes et SVR

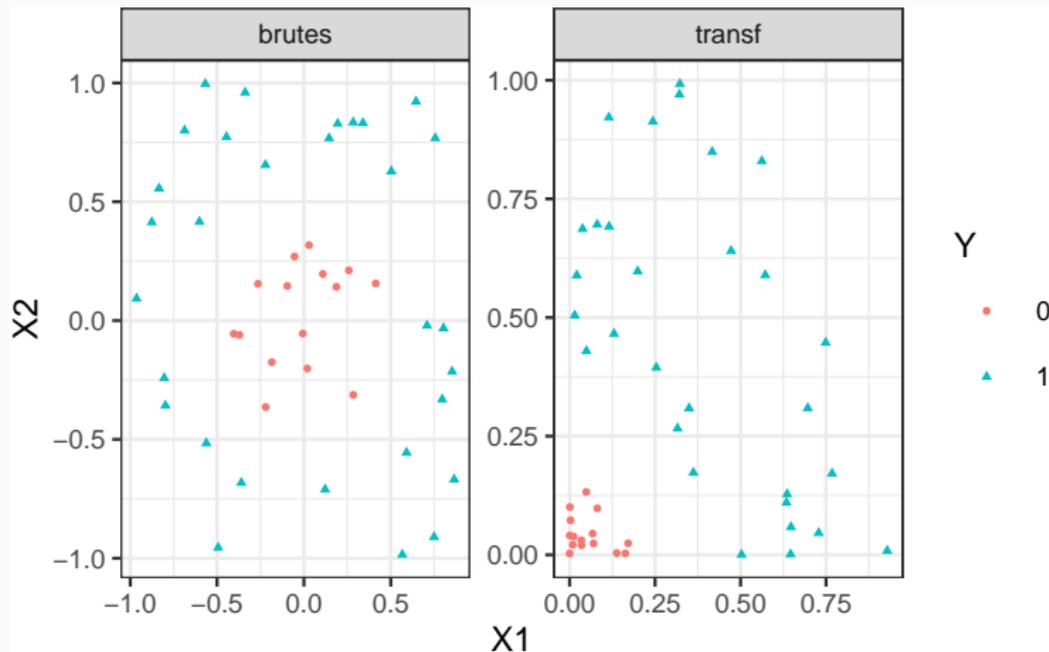
SVM multiclass

Support vector regression (SVR)

- Les solutions linéaires ne sont pas toujours intéressantes.



- Les solutions linéaires ne sont pas toujours intéressantes.



Idée

Trouver une transformation des données telle que les données transformées soient linéairement séparables.

Définition

Soit $\Phi : \mathcal{X} \rightarrow \mathcal{H}$ une application qui va de l'espace des observations \mathcal{X} dans un Hilbert \mathcal{H} . Le **noyau** K entre x et x' associé à Φ est le produit scalaire entre $\Phi(x)$ et $\Phi(x')$:

$$K : \mathcal{X} \times \mathcal{X} \rightarrow \mathbb{R}$$
$$(x, x') \mapsto \langle \Phi(x), \Phi(x') \rangle_{\mathcal{H}}.$$

Définition

Soit $\Phi : \mathcal{X} \rightarrow \mathcal{H}$ une application qui va de l'espace des observations \mathcal{X} dans un Hilbert \mathcal{H} . Le **noyau** K entre x et x' associé à Φ est le produit scalaire entre $\Phi(x)$ et $\Phi(x')$:

$$K : \mathcal{X} \times \mathcal{X} \rightarrow \mathbb{R}$$
$$(x, x') \mapsto \langle \Phi(x), \Phi(x') \rangle_{\mathcal{H}}.$$

Exemple

Si $\mathcal{X} = \mathcal{H} = \mathbb{R}^2$ et $\varphi(x_1, x_2) = (x_1^2, x_2^2)$ alors

$$K(x, x') = (x_1 x'_1)^2 + (x_2 x'_2)^2.$$

L'astuce noyau

- L'astuce consiste donc à envoyer les observations x_i dans un espace de Hilbert \mathcal{H} appelé espace de représentation ou feature space...

L'astuce noyau

- L'astuce consiste donc à envoyer les observations x_i dans un espace de Hilbert \mathcal{H} appelé espace de représentation ou feature space...
- en espérant que les données $(\Phi(x_1), y_1), \dots, (\Phi(x_n), y_n)$ soient (presque) linéairement séparables de manière à appliquer une svm sur ces données transformées.

L'astuce noyau

- L'astuce consiste donc à envoyer les observations x_i dans un espace de Hilbert \mathcal{H} appelé espace de représentation ou feature space...
- en espérant que les données $(\Phi(x_1), y_1), \dots, (\Phi(x_n), y_n)$ soient (presque) linéairement séparables de manière à appliquer une svm sur ces données transformées.

Remarque

1. Beaucoup d'algorithmes linéaires (en particulier les SVM) peuvent être appliqués sur $\Phi(x)$ sans calculer explicitement Φ ! Il suffit de pouvoir calculer le noyau $K(x, x')$;

L'astuce noyau

- L'astuce consiste donc à envoyer les observations x_i dans un espace de Hilbert \mathcal{H} appelé espace de représentation ou feature space...
- en espérant que les données $(\Phi(x_1), y_1), \dots, (\Phi(x_n), y_n)$ soient (presque) linéairement séparables de manière à appliquer une svm sur ces données transformées.

Remarque

1. Beaucoup d'algorithmes linéaires (en particulier les SVM) peuvent être appliqués sur $\Phi(x)$ sans calculer explicitement Φ ! Il suffit de pouvoir calculer le noyau $K(x, x')$;
2. On n'a pas besoin de connaître l'espace \mathcal{H} ni l'application Φ , il suffit de se donner un noyau K !

- Le **problème dual** consiste à maximiser

$$L_D(\alpha) = \sum_{i=1}^n \alpha_i - \frac{1}{2} \sum_{i=1}^n \sum_{k=1}^n \alpha_i \alpha_k y_i y_k \langle x_i, x_k \rangle$$

sous les contraintes $\begin{cases} 0 \leq \alpha_i \leq C, & i = 1, \dots, n \\ \sum_{i=1}^n \alpha_i y_i = 0. \end{cases}$

- La règle de décision s'obtient en calculant le signe de

$$f(x) = \sum_{i=1}^n \alpha_i^* y_i \langle x_i, x \rangle + b^*.$$

- Le **problème dual** consiste à maximiser

$$L_D(\alpha) = \sum_{i=1}^n \alpha_i - \frac{1}{2} \sum_{i=1}^n \sum_{k=1}^n \alpha_i \alpha_k y_i y_k \langle \Phi(x_i), \Phi(x_k) \rangle$$

sous les contraintes
$$\begin{cases} 0 \leq \alpha_i \leq C, & i = 1, \dots, n \\ \sum_{i=1}^n \alpha_i y_i = 0. \end{cases}$$

- La règle de décision s'obtient en calculant le signe de

$$f(x) = \sum_{i=1}^n \alpha_i^* y_i \langle \Phi(x_i), \Phi(x) \rangle + b^*.$$

- Le **problème dual** consiste à maximiser

$$L_D(\alpha) = \sum_{i=1}^n \alpha_i - \frac{1}{2} \sum_{i=1}^n \sum_{k=1}^n \alpha_i \alpha_k y_i y_k K(x_i, x_k)$$

sous les contraintes $\begin{cases} 0 \leq \alpha_i \leq C, & i = 1, \dots, n \\ \sum_{i=1}^n \alpha_i y_i = 0. \end{cases}$

- La règle de décision s'obtient en calculant le signe de

$$f(x) = \sum_{i=1}^n \alpha_i^* y_i K(x_i, x) + b^*.$$

Conclusion

- Pour calculer la svm, on n'a pas besoin de connaître \mathcal{H} ou Φ , il suffit de connaître K !

Conclusion

- Pour calculer la svm, on n'a pas besoin de connaître \mathcal{H} ou Φ , il suffit de connaître K !

Questions

Qu'est-ce qu'un noyau ? Comment construire un noyau ?

Conclusion

- Pour calculer la svm, on n'a pas besoin de connaître \mathcal{H} ou Φ , il suffit de connaître K !

Questions

Qu'est-ce qu'un noyau ? Comment construire un noyau ?

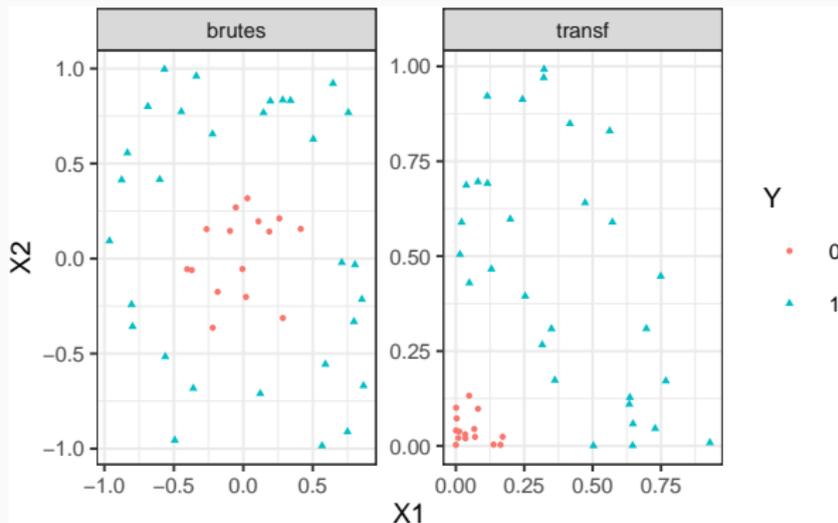
Théorème ([Aronszajn, 1950])

Une fonction $K : \mathcal{X} \times \mathcal{X} \rightarrow \mathbb{R}$ est un noyau si et seulement si elle est (symétrique) définie positive, c'est-à-dire ssi

1. $K(x, x') = K(x', x) \forall (x, x') \in \mathcal{X}^2$;
2. $\forall (x_1, \dots, x_N) \in \mathcal{X}^N$ et $\forall (a_1, \dots, a_N) \in \mathbb{R}^N$

$$\sum_{i=1}^N \sum_{j=1}^N a_i a_j K(x_i, x_j) \geq 0.$$

Exemple



Si

$$\begin{aligned}\Phi : \quad \mathbb{R}^2 &\rightarrow \mathbb{R}^3 \\ (x_1, x_2) &\mapsto (x_1^2, \sqrt{2}x_1x_2, x_2^2)\end{aligned}$$

alors $K(x, x') = (x^t x')^2$ (noyau polynomial de degré 2).

Exemples de noyau

1. **Linéaire** (**vanilladot**) : $K(x, x') = \langle x, x' \rangle$.
2. **Polynomial** (**polydot**) : $K(x, x') = (\textit{scale} \langle x, x' \rangle + \textit{offset})^{\textit{degree}}$.
3. **Gaussien** (Gaussian radial basis function ou RBF - **rbfdot**)

$$K(x, x') = \exp(-\textit{sigma} \|x - x'\|^2).$$

4. **Laplace** (sur \mathbb{R}) : $K(x, x') = \exp(-\textit{sigma} \|x - x'\|)$.
5. ...

Exemples de noyau

1. **Linéaire** (**vanilladot**) : $K(x, x') = \langle x, x' \rangle$.
2. **Polynomial** (**polydot**) : $K(x, x') = (\textit{scale} \langle x, x' \rangle + \textit{offset})^{\textit{degree}}$.
3. **Gaussien** (Gaussian radial basis function ou RBF - **rbfdot**)

$$K(x, x') = \exp(-\textit{sigma} \|x - x'\|^2).$$

4. **Laplace** (sur \mathbb{R}) : $K(x, x') = \exp(-\textit{sigma} \|x - x'\|)$.
5. ...

Remarque

Les paramètres correspondent aux noyaux proposés par la fonction `ksvm` de `kernlab` (voir [Karatzoglou et al., 2004]).

1. En l'absence d'information a priori le **noyau radial** est préconisé.
2. Procédure d'optimisation pour **sigma** proposé dans **ksvm**.

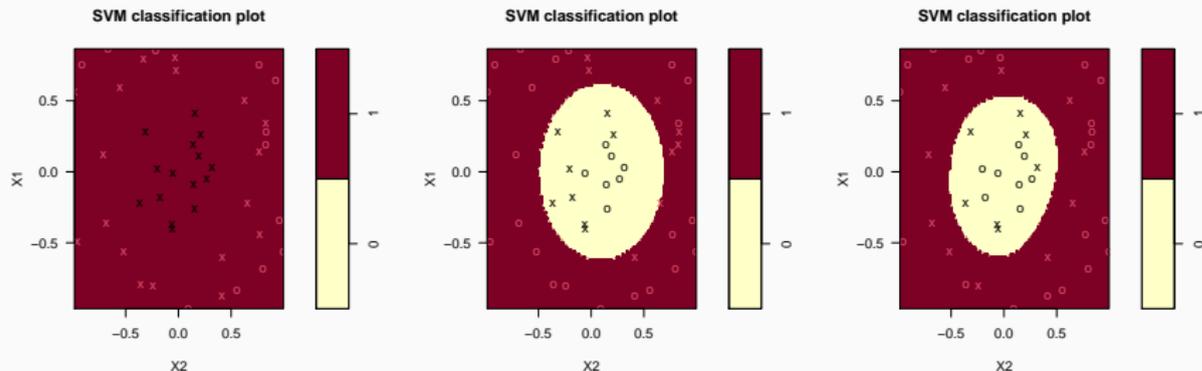
Remarque

N'importe quelle **fonction définie positive** fait l'affaire... Possibilité de construire des noyaux (et donc de faire des svm) sur des **objets plus complexes** (courbes, images, séquences de lettres...).

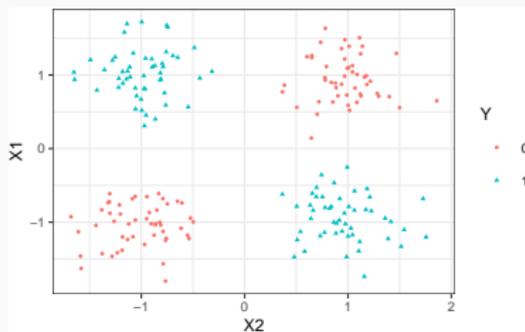
Le coin R - exemple 1

- Argument `kernel` dans la fonction `svm`.

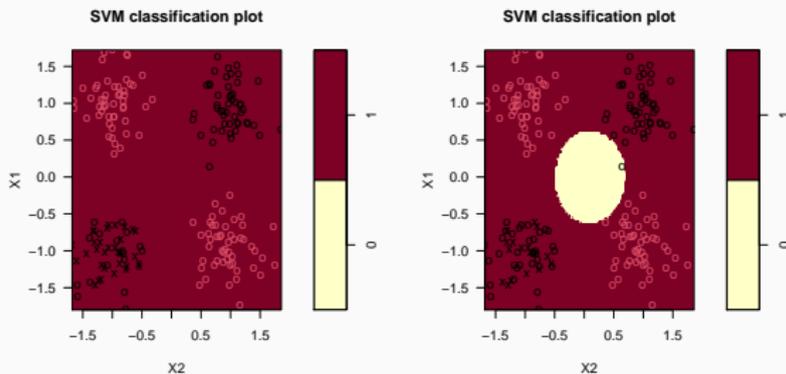
```
> svm(Y~.,data=donnees,cost=1,kernel="linear")  
> svm(Y~.,data=donnees,cost=1,kernel="polynomial",degree=2)  
> svm(Y~.,data=donnees,cost=1,kernel="radial",gamma=1)
```



Le coin R - exemple 2



```
> svm(Y~., data=donnees, kernel="linear", cost=1)  
> svm(Y~., data=donnees, kernel="polynomial", degree=2, cost=1)
```

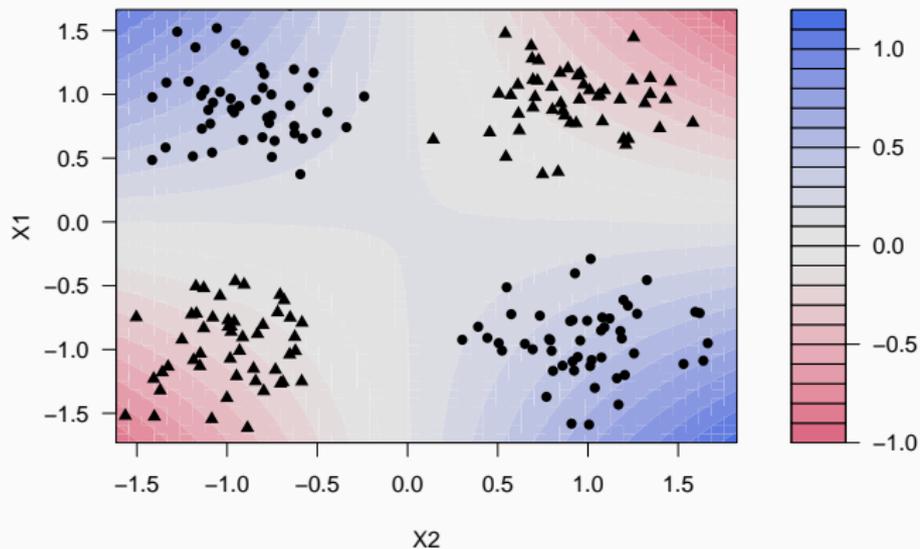


Le package **kernlab**

- Il propose un **choix plus large** de noyau.

```
> library(kernlab)
> mod.ksvm <- ksvm(Y~., data=donnees, kernel="polydot",
+                 kpar=list(degree=2), C=0.001)
> plot(mod.ksvm)
```

SVM classification plot



Estimation par moindres carrés

Sélection de variables

Régularisation

Régression ridge

Régression Lasso

Variantes de ridge/lasso

Discrimination binaire

Support vector machine

SVM - cas séparable

SVM : cas non séparable

SVM non linéaire : astuce du noyau

Scores et probabilités

Compléments : SVM multi-classes et SVR

SVM multiclass

Support vector regression (SVR)

- Jusqu'à présent nous avons utiliser la SVM uniquement pour classer :
 - 1 si on est d'un coté de l'hyperplan $\implies \sum_{i=1}^n \alpha_i^* y_i K(x_i, x) + b^* \geq 0$;
 - -1 si on est de l'autre coté $\implies \sum_{i=1}^n \alpha_i^* y_i K(x_i, x) + b^* < 0$.

- Jusqu'à présent nous avons utiliser la SVM uniquement pour classer :
 - 1 si on est d'un coté de l'hyperplan $\implies \sum_{i=1}^n \alpha_i^* y_i K(x_i, x) + b^* \geq 0$;
 - -1 si on est de l'autre coté $\implies \sum_{i=1}^n \alpha_i^* y_i K(x_i, x) + b^* < 0$.
- Rappel : dans le cas linéaire la fonction

$$f(x) = \sum_{i=1}^n \alpha_i^* y_i K(x_i, x) + b^*$$

mesure la distance entre x et l'hyperplan séparateur.

- Jusqu'à présent nous avons utilisé la SVM uniquement pour classer :
 - 1 si on est d'un côté de l'hyperplan $\implies \sum_{i=1}^n \alpha_i^* y_i K(x_i, x) + b^* \geq 0$;
 - -1 si on est de l'autre côté $\implies \sum_{i=1}^n \alpha_i^* y_i K(x_i, x) + b^* < 0$.
- Rappel : dans le cas linéaire la fonction

$$f(x) = \sum_{i=1}^n \alpha_i^* y_i K(x_i, x) + b^*$$

mesure la distance entre x et l'hyperplan séparateur.

- Conclusion : cette fonction peut être utilisée comme un score, puisque sa valeur (absolue) traduit une confiance que l'on a dans la prévision.

- La valeur de $f(x)$ est **difficilement interprétable** en tant que telle.
- Il peut être intéressant de la "**ramener**" entre 0 et 1 pour l'interpréter comme une **estimation de $P(Y = 1|X = x)$** .

- La valeur de $f(x)$ est **difficilement interprétable** en tant que telle.
- Il peut être intéressant de la "**ramener**" entre 0 et 1 pour l'interpréter comme une **estimation de $P(Y = 1|X = x)$** .

Une solution

- Considérer un **modèle logistique** :

$$P(Y = 1|X = x) = \frac{1}{1 + \exp(af(x) + b)}$$

- La valeur de $f(x)$ est **difficilement interprétable** en tant que telle.
- Il peut être intéressant de la "**ramener**" entre 0 et 1 pour l'interpréter comme une **estimation de $P(Y = 1|X = x)$** .

Une solution

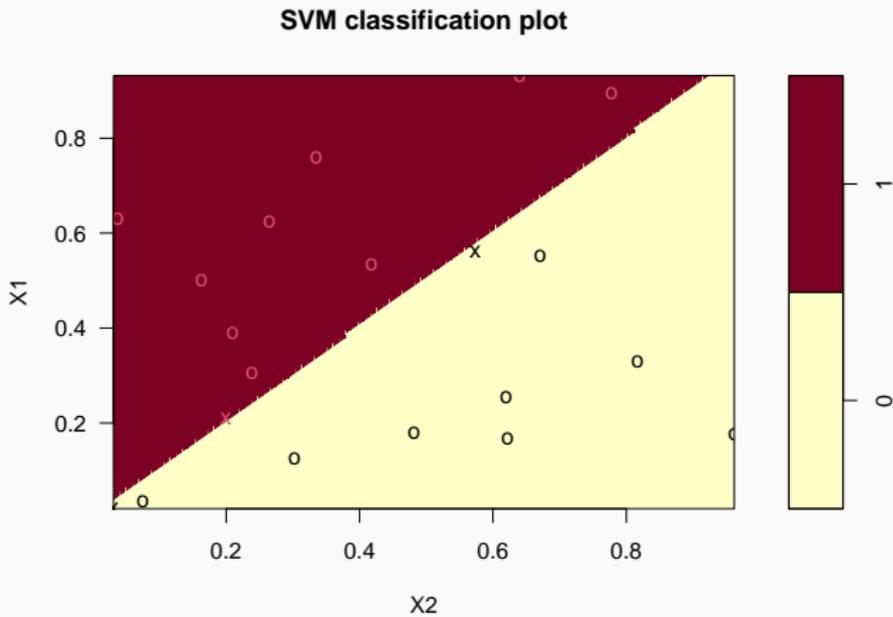
- Considérer un **modèle logistique** :

$$P(Y = 1|X = x) = \frac{1}{1 + \exp(af(x) + b)}$$

- et d'estimer a et b par **maximum de vraisemblance** sur les données $(f(x_i), y_i), i = 1, \dots, n$.

Le coin R

```
> mod.svm <- svm(Y~.,data=df,kernel="linear",cost=10000000000,probability=TRUE)  
> plot(mod.svm,data=df,fill=TRUE,grid=100)
```



- Nouvelle observation :

```
> newX <- data.frame(X1=0.2,X2=0.6)
```

- Nouvelle observation :

```
> newX <- data.frame(X1=0.2,X2=0.6)
```

- Calcul du **score** et de la **proba** :

```
> predict(mod.svm,newdata=newX,decision.values = TRUE,probability=TRUE)
## 1
## 0
## attr("decision.values")
##      0/1
## 1 36.44796
## attr("probabilities")
##      0      1
## 1 0.9770206 0.02297939
## Levels: 0 1
```

- Nouvelle observation :

```
> newX <- data.frame(X1=0.2,X2=0.6)
```

- Calcul du **score** et de la **proba** :

```
> predict(mod.svm,newdata=newX,decision.values = TRUE,probability=TRUE)
## 1
## 0
## attr("decision.values")
##      0/1
## 1 36.44796
## attr("probabilities")
##      0      1
## 1 0.9770206 0.02297939
## Levels: 0 1
```

- On peut retrouver cette proba avec :

```
> a <- mod.svm$probA
> b <- mod.svm$probB
> 1/(1+exp(a*36.44796+b))
## [1] 0.9770206
```

Estimation par moindres carrés

Sélection de variables

Régularisation

Régression ridge

Régression Lasso

Variantes de ridge/lasso

Discrimination binaire

Support vector machine

SVM - cas séparable

SVM : cas non séparable

SVM non linéaire : astuce du noyau

Scores et probabilités

Compléments : SVM multi-classes et SVR

SVM multiclass

Support vector regression (SVR)

- On a abordé ici uniquement le problème de la **classification binaire** : $y_i \in \{-1, 1\}$.
- Les SVM se généralisent aux cas **multi-classes** : $y_i \in \{1, \dots, M\}$
- et à la **régression** : $y_i \in \mathbb{R}$.

Estimation par moindres carrés

Sélection de variables

Régularisation

Régression ridge

Régression Lasso

Variantes de ridge/lasso

Discrimination binaire

Support vector machine

SVM - cas séparable

SVM : cas non séparable

SVM non linéaire : astuce du noyau

Scores et probabilités

Compléments : SVM multi-classes et SVR

SVM multiclass

Support vector regression (SVR)

- On suppose ici que $y_i \in \{1, \dots, M\}$
- Il existe plusieurs approches pour généraliser les SVM à ce contexte, notamment :

- On suppose ici que $y_i \in \{1, \dots, M\}$
- Il existe plusieurs approches pour généraliser les SVM à ce contexte, notamment :
- **One against one**

Idée

Faire une SVM binaire sur **toutes les paires** $(j, k) \in \{1, \dots, M\}^2$ avec $j \neq k$ et choisir le **groupe qui gagne le plus souvent**.

- On suppose ici que $y_i \in \{1, \dots, M\}$
- Il existe plusieurs approches pour généraliser les SVM à ce contexte, notamment :
- One against one

Idée

Faire une SVM binaire sur toutes les paires $(j, k) \in \{1, \dots, M\}^2$ avec $j \neq k$ et choisir le groupe qui gagne le plus souvent.

- One against all

Idée

Faire une SVM binaire de chaque groupe contre les autres et choisir le groupe qui a la "plus belle victoire".

One against one

Algorithme

1. Pour chaque paire (j, k) , faire la SVM **binaire** avec uniquement les individus des groupes k et j ;
2. On obtient ainsi $M(M - 1)/2$ règles "**linéaires**" $f_{j,k}(x)$.

One against one

Algorithme

1. Pour chaque paire (j, k) , faire la SVM **binaire** avec uniquement les individus des groupes k et j ;
2. On obtient ainsi $M(M - 1)/2$ règles "**linéaires**" $f_{j,k}(x)$.
3. On calcule pour $j = 1, \dots, M$

$$V(j) = \sum_{k \neq j} \text{signe}(f_{j,k}(x))$$

qui représente le **nombre de fois où on a voté j contre les autres groupes**.

One against one

Algorithme

1. Pour chaque paire (j, k) , faire la SVM **binaire** avec uniquement les individus des groupes k et j ;
2. On obtient ainsi $M(M - 1)/2$ **règles "linéaires"** $f_{j,k}(x)$.
3. On calcule pour $j = 1, \dots, M$

$$V(j) = \sum_{k \neq j} \text{signe}(f_{j,k}(x))$$

qui représente le **nombre de fois où on a voté j contre les autres groupes**.

4. On classe un nouvel individu x dans le groupe qui a **remporté le plus de suffrage** :

$$f(x) = \underset{j}{\operatorname{argmax}} V(j).$$

Algorithme

1. Faire une SVM binaire avec tous les individus de chaque groupe contre les autres.
2. On obtient ainsi M règles "linéaires" $f_j(x)$ (groupe j contre les autres).

Algorithme

1. Faire une SVM binaire avec **tous les individus** de chaque groupe contre les autres.
2. On obtient ainsi M **règles "linéaires"** $f_j(x)$ (groupe j contre les autres).
3. On classe un nouvel individu dans la classe qui a le score le plus élevé :

$$f(x) = \operatorname{argmax}_j f_j(x).$$

Comparaison

- M SVM binaire avec l'approche **one against all** contre $M(M - 1)/2$ avec le **one against one** mais...

Comparaison

- M SVM binaire avec l'approche **one against all** contre $M(M - 1)/2$ avec le **one against one** mais...
- **moins** d'individus dans les **one against one**.

Comparaison

- M SVM binaire avec l'approche **one against all** contre $M(M - 1)/2$ avec le **one against one** mais...
- **moins** d'individus dans les **one against one**.
- Risque de déséquilibre plus fort avec le **one against all** (mais généralement plus rapide).

Comparaison

- M SVM binaire avec l'approche **one against all** contre $M(M - 1)/2$ avec le **one against one** mais...
- **moins** d'individus dans les **one against one**.
- Risque de déséquilibre plus fort avec le **one against all** (mais généralement plus rapide).
- Comme dans le cas binaire, il faut **sélectionner** le **paramètre de complexité**, le **noyau**, les **paramètres du noyau**...

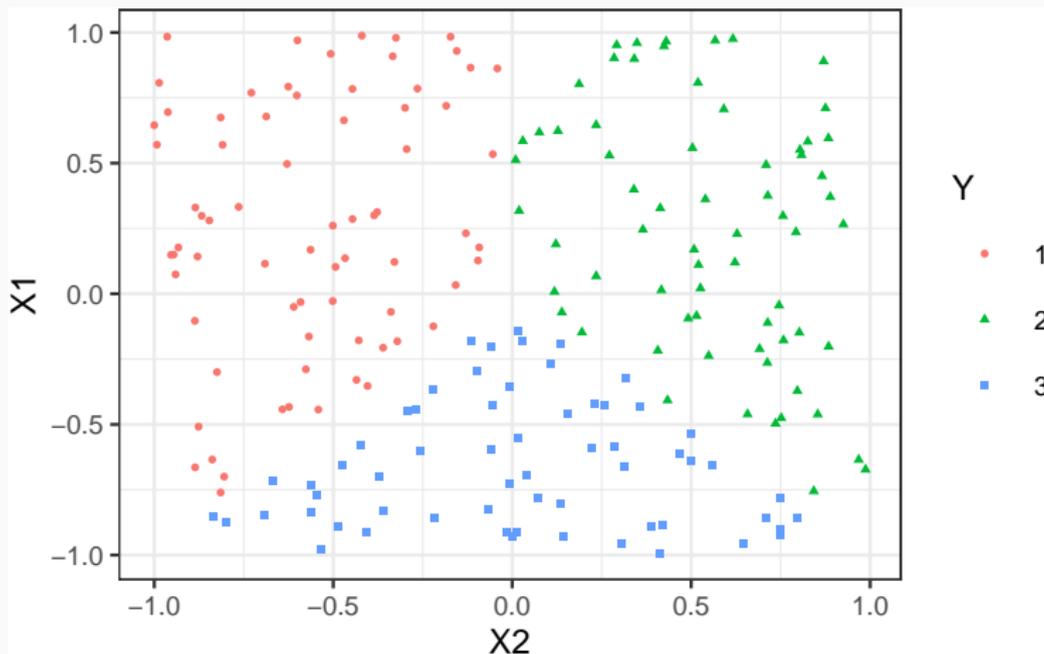
Comparaison

- M SVM binaire avec l'approche **one against all** contre $M(M - 1)/2$ avec le **one against one** mais...
- **moins** d'individus dans les **one against one**.
- Risque de déséquilibre plus fort avec le **one against all** (mais généralement plus rapide).
- Comme dans le cas binaire, il faut **sélectionner** le **paramètre de complexité**, le **noyau**, les **paramètres du noyau**...

Le coin R

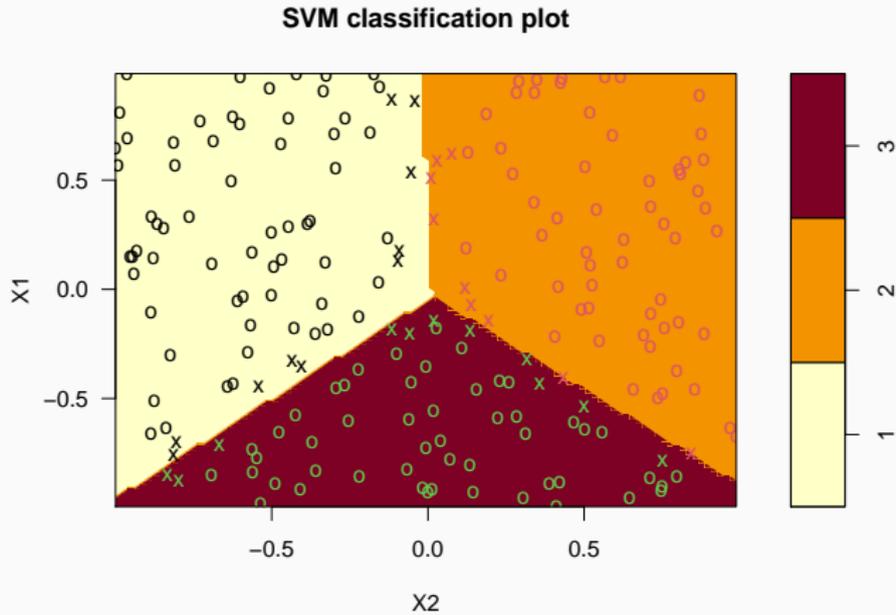
- L'approche **one against one** est plus souvent utilisée.
- C'est le cas par défaut avec **svm** de **e1071** et **ksvm** de **kernlab**.

Exemple



SVM linéaire multi classes

```
> multi1 <- svm(Y~.,data=df,cost=10,kernel="linear")  
> plot(multi1,data=df,grid=100)
```



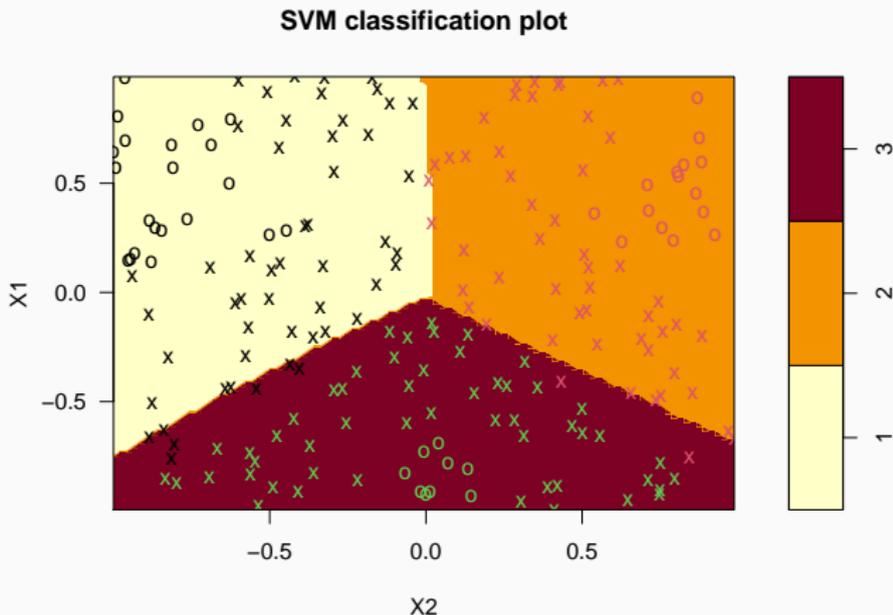
SVM non linéaire multi classes

- Il "suffit" d'utiliser un **noyau**.

SVM non linéaire multi classes

- Il "suffit" d'utiliser un **noyau**.

```
> multi2 <- svm(Y~.,data=df,cost=0.1,kernel="sigmoid")  
> plot(multi2,data=df,grid=100)
```



Estimation par moindres carrés

Sélection de variables

Régularisation

Régression ridge

Régression Lasso

Variantes de ridge/lasso

Discrimination binaire

Support vector machine

SVM - cas séparable

SVM : cas non séparable

SVM non linéaire : astuce du noyau

Scores et probabilités

Compléments : SVM multi-classes et SVR

SVM multiclass

Support vector regression (SVR)

- On suppose ici que les y_i sont dans \mathbb{R} .
- On ne va plus chercher l'hyperplan qui **sépare au mieux les groupes** mais

- On suppose ici que les y_i sont dans \mathbb{R} .
- On ne va plus chercher l'hyperplan qui **sépare au mieux les groupes** mais
- l'hyperplan (w, b) qui **"approche au mieux"** les valeurs y_i

$$|\langle w, x_i \rangle + b - y_i| \quad \text{petits.}$$

Comparaison avec les MCO

- **Approche MCO** (rappel) : on cherche (w, b) qui minimise

$$\sum_{i=1}^n (y_i - \langle w, x_i \rangle - b)^2$$

Comparaison avec les MCO

- **Approche MCO** (rappel) : on cherche (w, b) qui minimise

$$\sum_{i=1}^n (y_i - \langle w, x_i \rangle - b)^2$$

- **Approche SVR** : on veut
 1. tous les points à distance de moins de ε de (w, b) ;
 2. (w, b) de marge maximale ($\|w\|$ minimale).

Comparaison avec les MCO

- **Approche MCO** (rappel) : on cherche (w, b) qui minimise

$$\sum_{i=1}^n (y_i - \langle w, x_i \rangle - b)^2$$

- **Approche SVR** : on veut
 1. tous les points à distance de moins de ε de (w, b) ;
 2. (w, b) de marge maximale ($\|w\|$ minimale).

Optimisation SVR

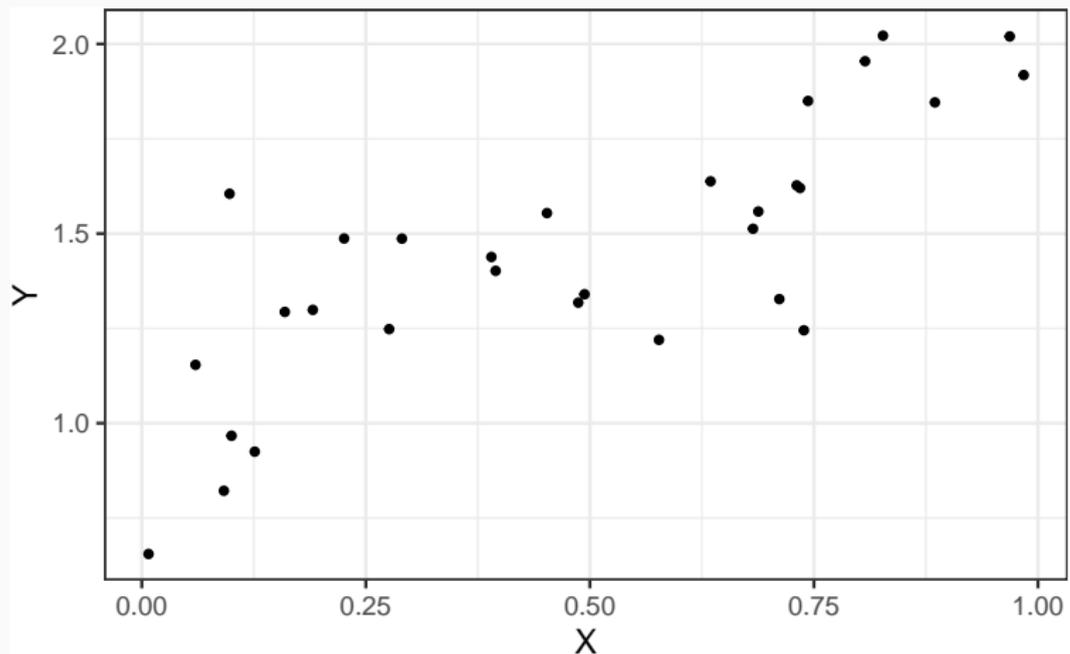
On va chercher à **minimiser la norme de w** en se fixant comme contrainte que les y_i ne soient pas "trop loin" de l'hyperplan :

$$\min_{w, b} \frac{1}{2} \|w\|^2$$

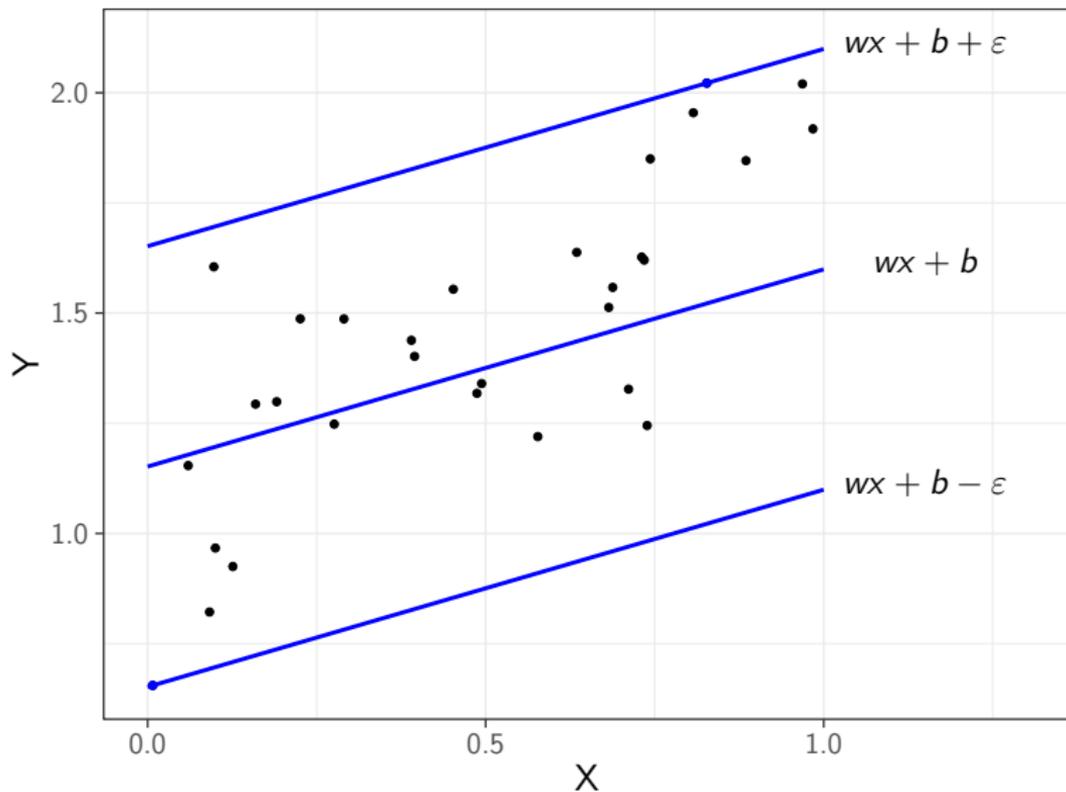
sous les contraintes $|y_i - \langle w, x_i \rangle - b| \leq \varepsilon, \quad i = 1, \dots, n,$

où $\varepsilon > 0$ est un **paramètre à calibrer par l'utilisateur**.

Un exemple en dimension 1

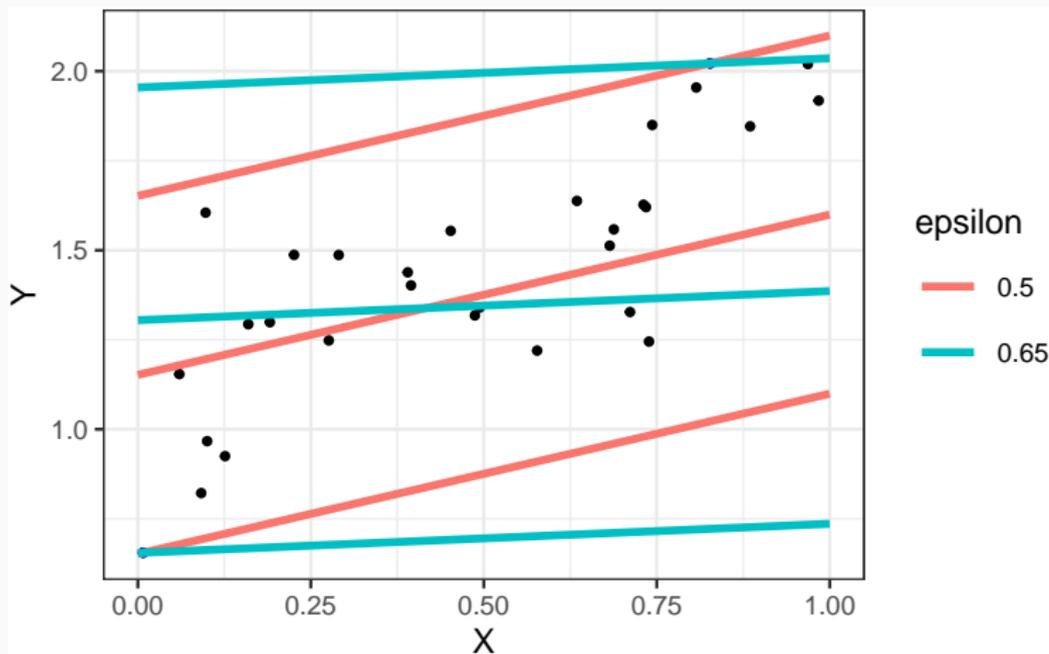


Un exemple en dimension 1



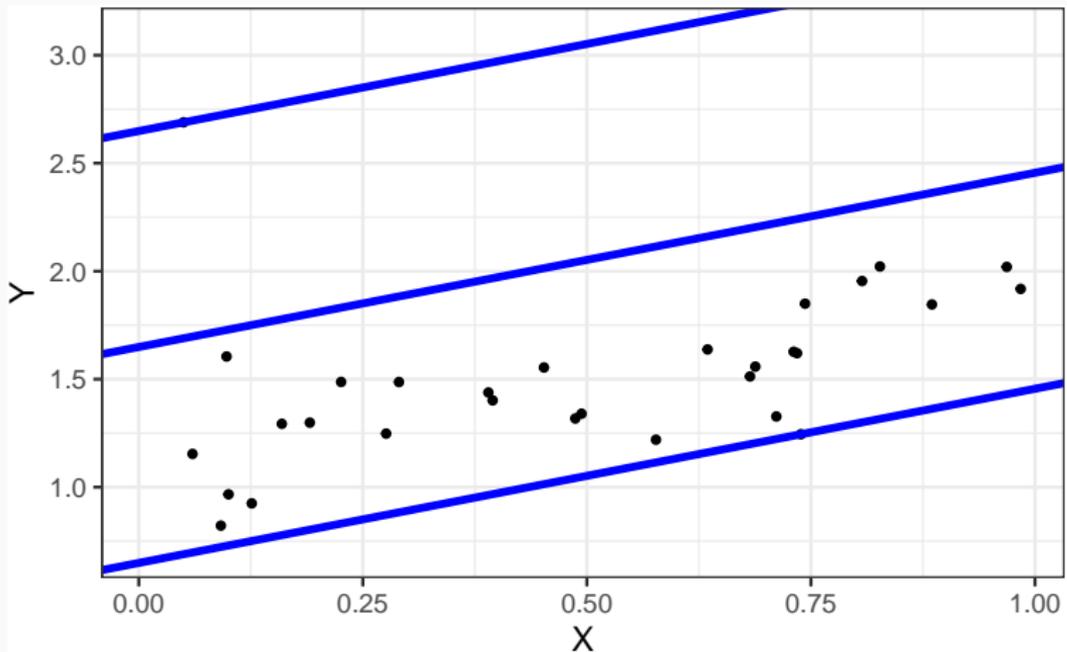
Influence de ε

- Il contrôle le **niveau de tolérance** que l'on se donne.



Alléger la contrainte...

- La contrainte nécessite souvent de **prendre des grandes valeurs** de ε ...



- Clairement pas satisfaisant de prendre ε trop grand.

- Clairement pas satisfaisant de prendre ϵ trop grand.

Idée

- Comme pour la SVM binaire, autoriser des observations à se situer en dehors de la marge !
- Comment ?

- Clairement pas satisfaisant de prendre ε trop grand.

Idée

- Comme pour la SVM binaire, autoriser des observations à se situer en dehors de la marge !
- Comment ? En introduisant des slack variables !

Le problème d'optimisation

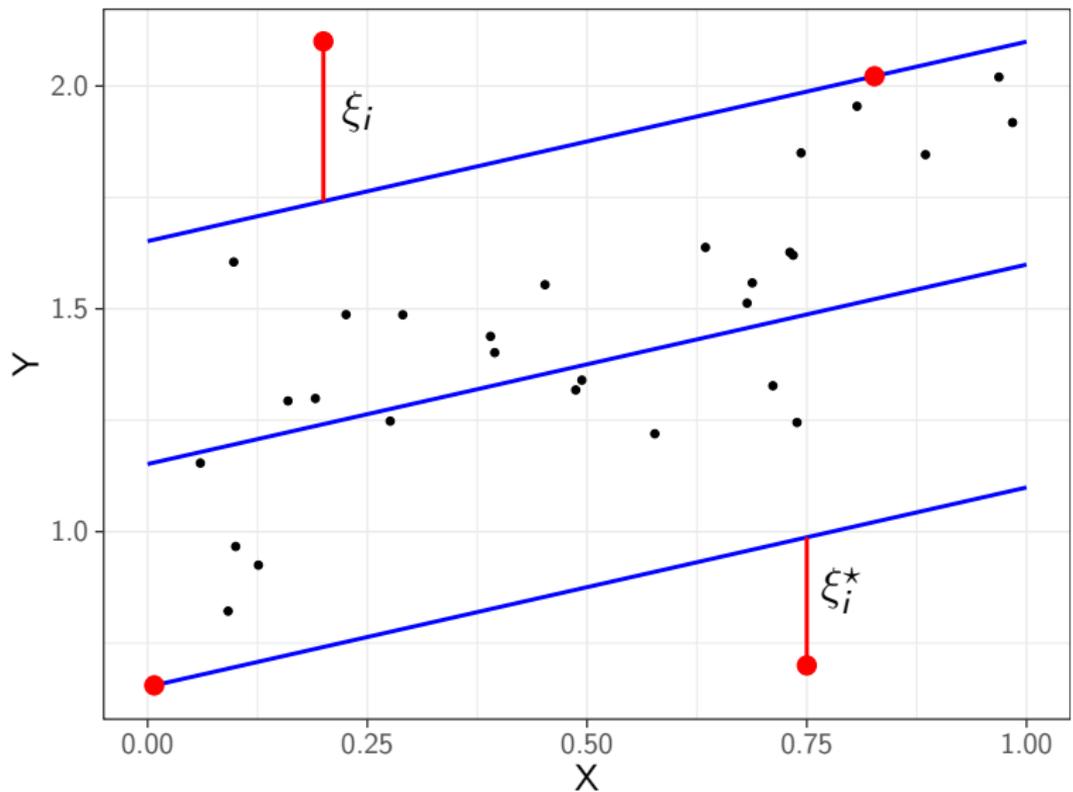
On cherche (w, b, ξ, ξ^*) qui minimise

$$\frac{1}{2} \|w\|^2 + C \sum_{i=1}^n (\xi_i + \xi_i^*)$$

sous les contraintes

$$\begin{cases} y_i - \langle w, x_i \rangle - b \leq \varepsilon + \xi_i, & i = 1, \dots, n, \\ \langle w, x_i \rangle + b - y_i \leq \varepsilon + \xi_i^*, & i = 1, \dots, n \\ \xi_i \geq 0, \xi_i^* \geq 0, & i = 1, \dots, n \end{cases}$$

Slack variables en régression



Rien ne change après...

- Les solutions s'obtiennent en résolvant le **problème dual** $\implies \alpha_j, \alpha_j^*$.

Rien ne change après...

- Les solutions s'obtiennent en résolvant le **problème dual** $\implies \alpha_j, \alpha_j^*$.
- Les données (les X) sont généralement **centrées-réduites** pour éviter les problèmes d'échelle.

Rien ne change après...

- Les solutions s'obtiennent en résolvant le **problème dual** $\implies \alpha_j, \alpha_j^*$.
- Les données (les X) sont généralement **centrées-réduites** pour éviter les problèmes d'échelle.
- Les observations vérifiant $\alpha_j^* - \alpha_j \neq 0$ sont les **vecteurs supports**.

Rien ne change après...

- Les solutions s'obtiennent en résolvant le **problème dual** $\implies \alpha_i, \alpha_i^*$.
- Les données (les X) sont généralement **centrées-réduites** pour éviter les problèmes d'échelle.
- Les observations vérifiant $\alpha_i^* - \alpha_i \neq 0$ sont les **vecteurs supports**.
- L'hyperplan optimal se déduit des **vecteurs supports** :

$$w^* = \sum_{i=1}^n (\alpha_i^* - \alpha_i) x_i.$$

- L'**astuce du noyau** reste d'actualité pour prendre en compte de la **non linéarité**.

Rien ne change après...

- Les solutions s'obtiennent en résolvant le **problème dual** $\implies \alpha_i, \alpha_i^*$.
- Les données (les X) sont généralement **centrées-réduites** pour éviter les problèmes d'échelle.
- Les observations vérifiant $\alpha_i^* - \alpha_i \neq 0$ sont les **vecteurs supports**.
- L'hyperplan optimal se déduit des **vecteurs supports** :

$$w^* = \sum_{i=1}^n (\alpha_i^* - \alpha_i) x_i.$$

- L'**astuce du noyau** reste d'actualité pour prendre en compte de la **non linéarité**.
- Il faut **sélectionner** C , le noyau (et ses paramètres) ainsi que ε ...

- Là aussi, pas grand chose ne change.

```
> svm(Y~.,data=df,kernel="linear",epsilon=0.5,cost=100)
##
## Call:
## svm(formula = Y ~ ., data = df, kernel = "linear", epsilon = 0.5,
##      cost = 100)
##
##
## Parameters:
##   SVM-Type:  eps-regression
##   SVM-Kernel: linear
##         cost: 100
##         gamma: 1
##         epsilon: 0.5
##
##
## Number of Support Vectors: 11
```

Conclusion

- Algorithme machine learning pouvant être utilisé en régression et en classification supervisée.

Conclusion

- Algorithme machine learning pouvant être utilisé en régression et en classification supervisée.
- Méthode linéaire mais prise en compte possible de la non linéarité grâce à l'astuce du noyau.

Conclusion

- Algorithme machine learning pouvant être utilisé en **régression** et en **classification supervisée**.
- Méthode **linéaire** mais prise en compte possible de la **non linéarité** grâce à l'**astuce du noyau**.
- **Calibration difficile** : beaucoup de paramètres
 1. paramètre de cout C
 2. noyau
 3. paramètres du noyau
 4. seuil de tolérance ε pour la régression

Conclusion

- Algorithme machine learning pouvant être utilisé en régression et en classification supervisée.
- Méthode linéaire mais prise en compte possible de la non linéarité grâce à l'astuce du noyau.
- Calibration difficile : beaucoup de paramètres
 1. paramètre de cout C
 2. noyau
 3. paramètres du noyau
 4. seuil de tolérance ε pour la régression
- et souvent peu d'information a priori sur la valeur de ces paramètres...

Estimation par moindres carrés

Sélection de variables

Régularisation

Régression ridge

Régression Lasso

Variantes de ridge/lasso

Discrimination binaire

Support vector machine

SVM - cas séparable

SVM : cas non séparable

SVM non linéaire : astuce du noyau

Scores et probabilités

Compléments : SVM multi-classes et SVR

SVM multiclass

Support vector regression (SVR)

-  Aronszajn, N. (1950).
Theory of reproducing kernels.
Transactions of the American Mathematical Society, 68 :337–404.
-  Bühlmann, P. and van de Geer, S. (2011).
Statistics for high-dimensional data.
Springer.
-  Cornillon, P., Hengartner, N., Matzner-Løber, E., and Rouvière, L. (2019).
Régression avec R.
EDP Sciences.

-  Fromont, M. (2015).
Apprentissage statistique.
Université Rennes 2, diapos de cours.
-  Hastie, T., Tibshirani, R., and Friedman, J. (2009).
The Elements of Statistical Learning : Data Mining, Inference, and Prediction.
Springer, second edition.
-  Hastie, T., Tibshirani, R., and Wainwright, M. (2015).
Statistical Learning with Sparsity : The Lasso and Generalizations.
CRC Press.
https://web.stanford.edu/~hastie/StatLearnSparsity_files/SLS.pdf.

-  Karatzoglou, A., Smola, A., Hornik, K., and Zeileis, A. (2004).
kernlab – an s4 package for kernel methods in r.
Journal of Statistical Software, 11(9).
-  Tibshirani, R. (1996).
Regression shrinkage and selection via the lasso.
Journal of the Royal Statistical Society, Series B, 58 :267–288.
-  Zou, H. and Hastie, T. (2005).
Regularization and variable selection via the elastic net.
Journal of the Royal Statistical Society, Series B, 67 :301–320.

Troisième partie III

Algorithmes non linéaires

Arbres

Arbres binaires

Choix des coupures

Cas de la régression

Cas de la classification supervisée

Elagage

Importance des variables

Réseaux de neurones

Introduction

Le perceptron simple

Perceptron multicouches

Estimation

Choix des paramètres et surapprentissage

Bibliographie

- Algorithmes **linéaires** :

$$f(x) = f_{\beta}(x) = \beta_0 + \beta_1 x_1 + \dots + \beta_d x_d.$$

- **Problème** : tous les problèmes ne sont pas linéaires.

- Algorithmes **linéaires** :

$$f(x) = f_{\beta}(x) = \beta_0 + \beta_1 x_1 + \dots + \beta_d x_d.$$

- **Problème** : tous les problèmes ne sont pas linéaires.
- Possible d'**ajouter de la non linéarité** dans les algorithmes linéaires : effets quadratiques, interaction...

- Algorithmes **linéaires** :

$$f(x) = f_{\beta}(x) = \beta_0 + \beta_1 x_1 + \dots + \beta_d x_d.$$

- **Problème** : tous les problèmes ne sont pas linéaires.
- Possible d'**ajouter de la non linéarité** dans les algorithmes linéaires : effets quadratiques, interaction...
- **Difficile pour l'utilisateur** de trouver quels effets ajouter ! Surtout lorsque d est grand.

- Algorithmes **linéaires** :

$$f(x) = f_{\beta}(x) = \beta_0 + \beta_1 x_1 + \dots + \beta_d x_d.$$

- **Problème** : tous les problèmes ne sont pas linéaires.
- Possible d'**ajouter de la non linéarité** dans les algorithmes linéaires : effets quadratiques, interaction...
- **Difficile pour l'utilisateur** de trouver quels effets ajouter ! Surtout lorsque d est grand.

Dans cette partie

Présentation de quelques algorithmes **non linéaires** :

- Méthodes par **arbres**.
- **Réseaux de neurones**.

Arbres binaires

Choix des coupures

Cas de la régression

Cas de la classification supervisée

Elagage

Importance des variables

Réseaux de neurones

Introduction

Le perceptron simple

Perceptron multicouches

Estimation

Choix des paramètres et surapprentissage

Bibliographie

- Les arbres sont des algorithmes de prédiction qui fonctionnent en régression et en discrimination.
- Il existe différentes variantes permettant de construire des prédicteurs par arbres.
- Nous nous focalisons dans cette partie sur la méthode CART [Breiman et al., 1984] qui est la plus utilisée.

Arbres binaires

Choix des coupures

- Cas de la régression

- Cas de la classification supervisée

Elagage

Importance des variables

Réseaux de neurones

Introduction

Le perceptron simple

Perceptron multicouches

Estimation

Choix des paramètres et surapprentissage

Bibliographie

- On cherche à expliquer une variable Y par d variables explicatives X_1, \dots, X_d .

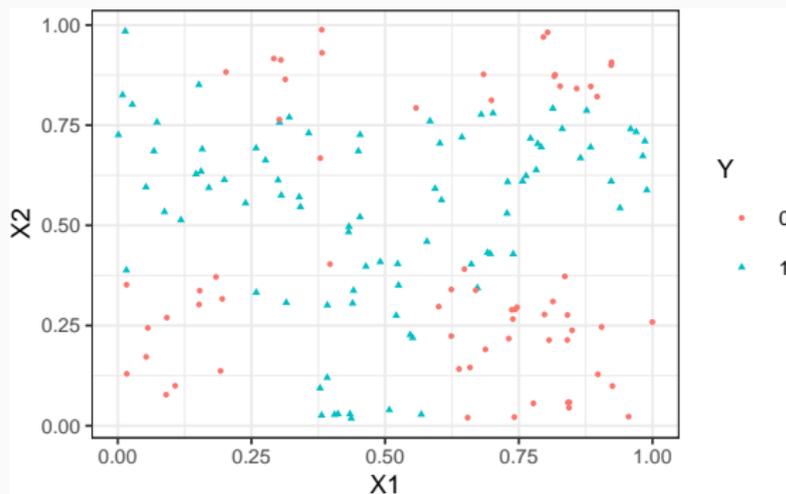
- On cherche à expliquer une variable Y par d variables explicatives X_1, \dots, X_d .
- Y peut admettre un nombre quelconque de modalités et les variables X_1, \dots, X_d peuvent être qualitatives et/ou quantitatives.

Notations

- On cherche à expliquer une variable Y par d variables explicatives X_1, \dots, X_d .
- Y peut admettre un nombre quelconque de modalités et les variables X_1, \dots, X_d peuvent être qualitatives et/ou quantitatives.
- Néanmoins, pour simplifier on se place dans un premier temps en discrimination binaire : Y admet 2 modalités (-1 ou 1). On suppose de plus que l'on a simplement 2 variables explicatives quantitatives.

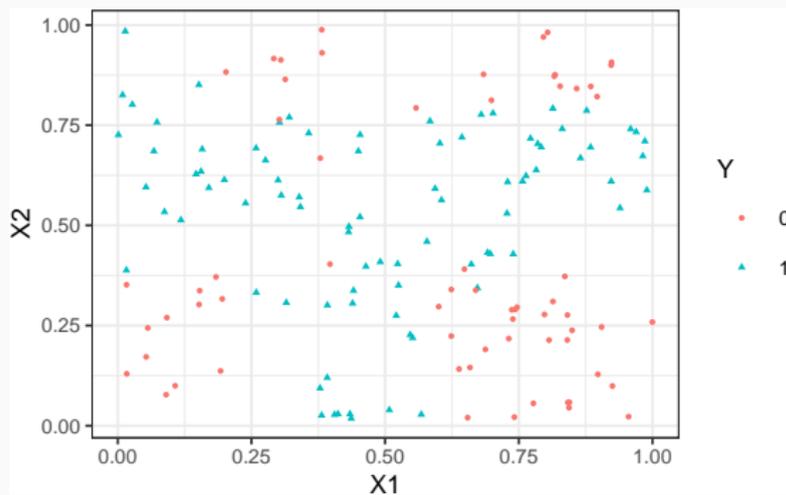
Représentation des données

- On dispose de n observations $(x_1, y_1), \dots, (x_n, y_n)$ où $x_i \in \mathbb{R}^2$ et $y_i \in \{0, 1\}$.



Représentation des données

- On dispose de n observations $(x_1, y_1), \dots, (x_n, y_n)$ où $x_i \in \mathbb{R}^2$ et $y_i \in \{0, 1\}$.

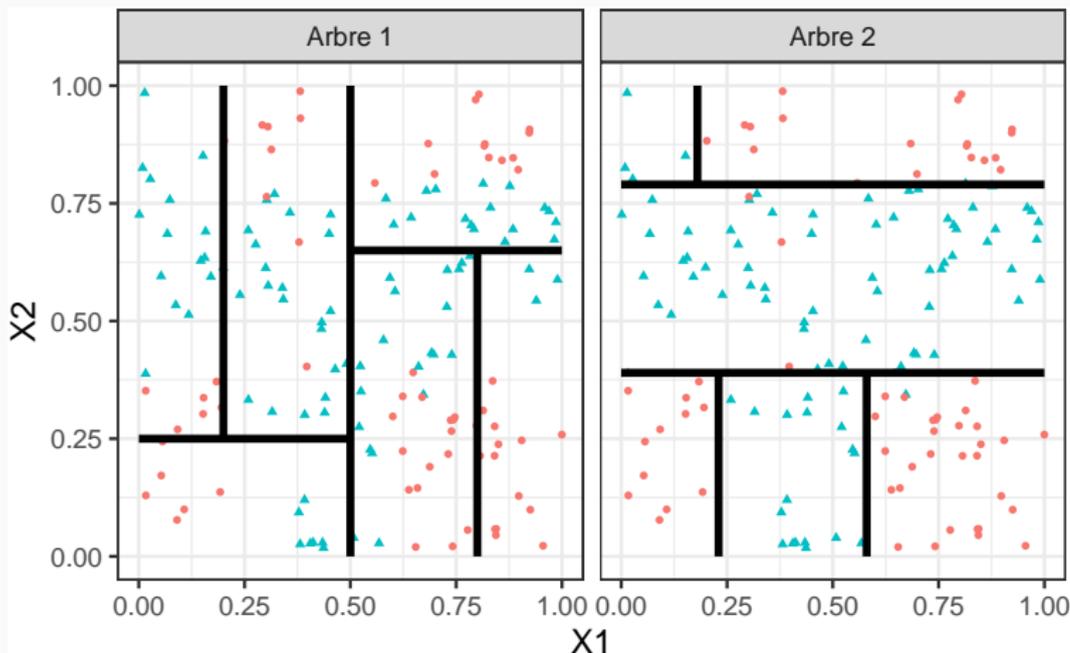


Approche par arbres

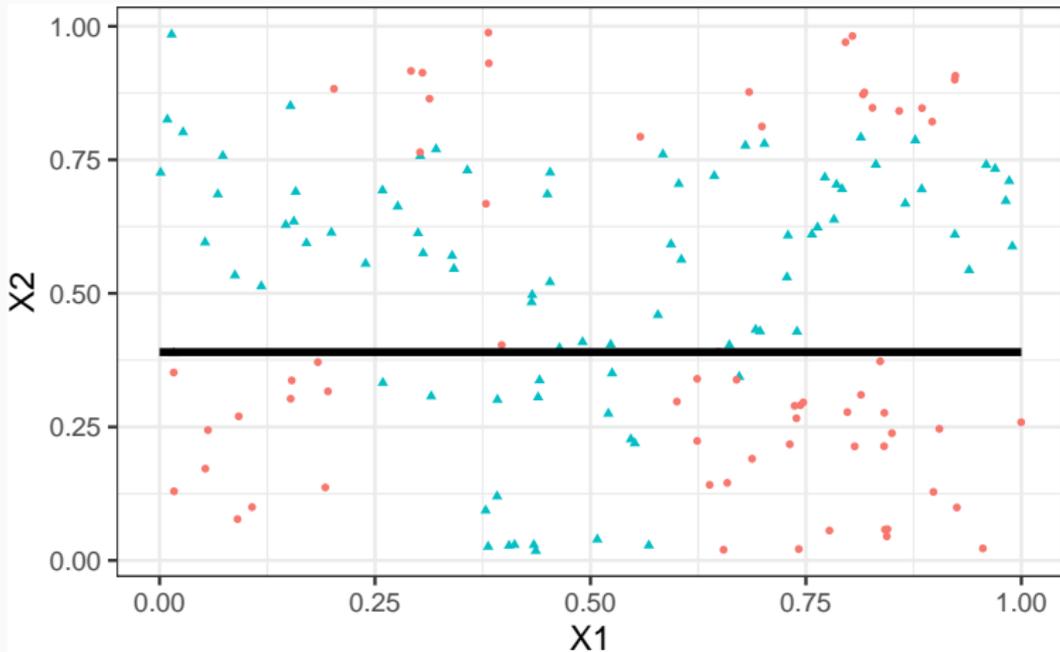
Trouver une **partition** des observations qui **sépare** "au mieux" les points rouges des points bleus.

Arbres binaires

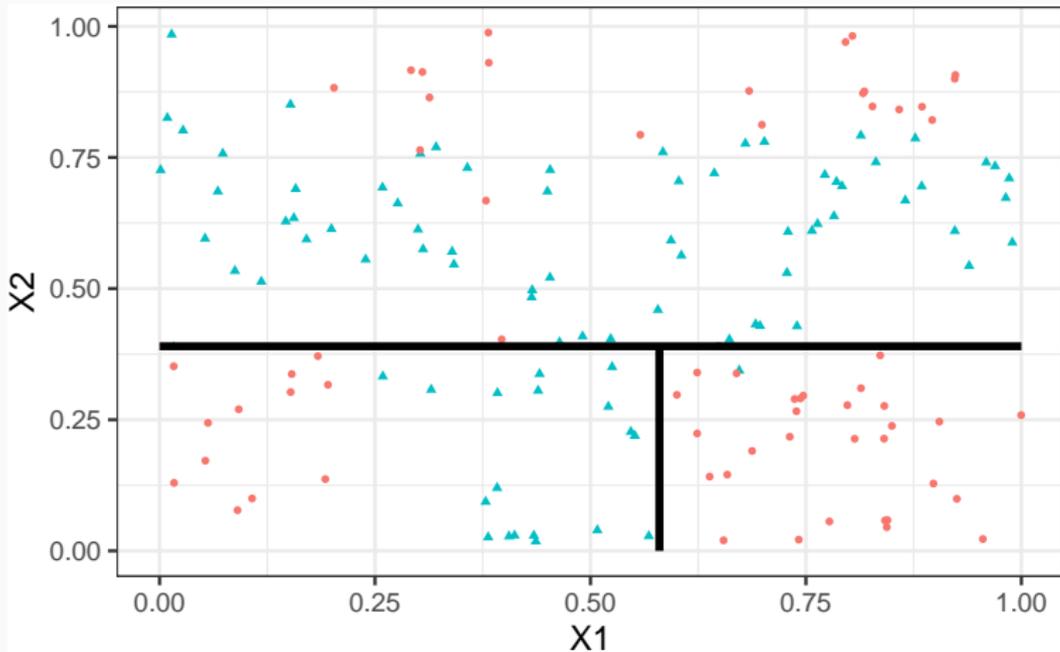
- La **méthode CART** propose de construire une partition basée sur des divisions **successives parallèles aux axes**.
- 2 exemples de partition :



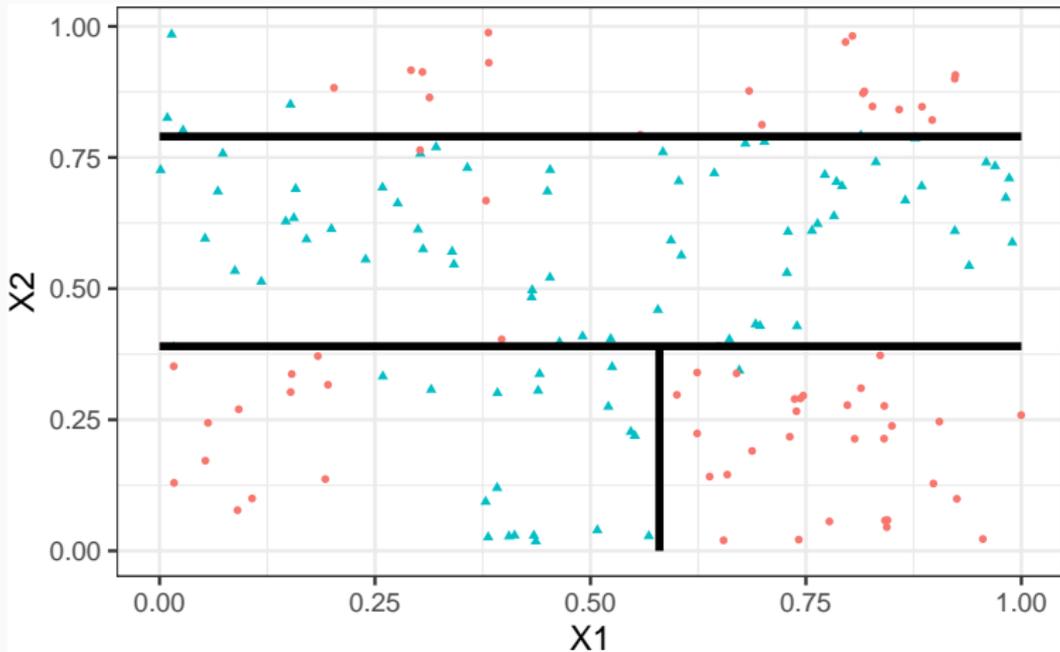
- A chaque étape, la méthode cherche une **nouvelle division** : une **variable** et un **seuil** de coupure.



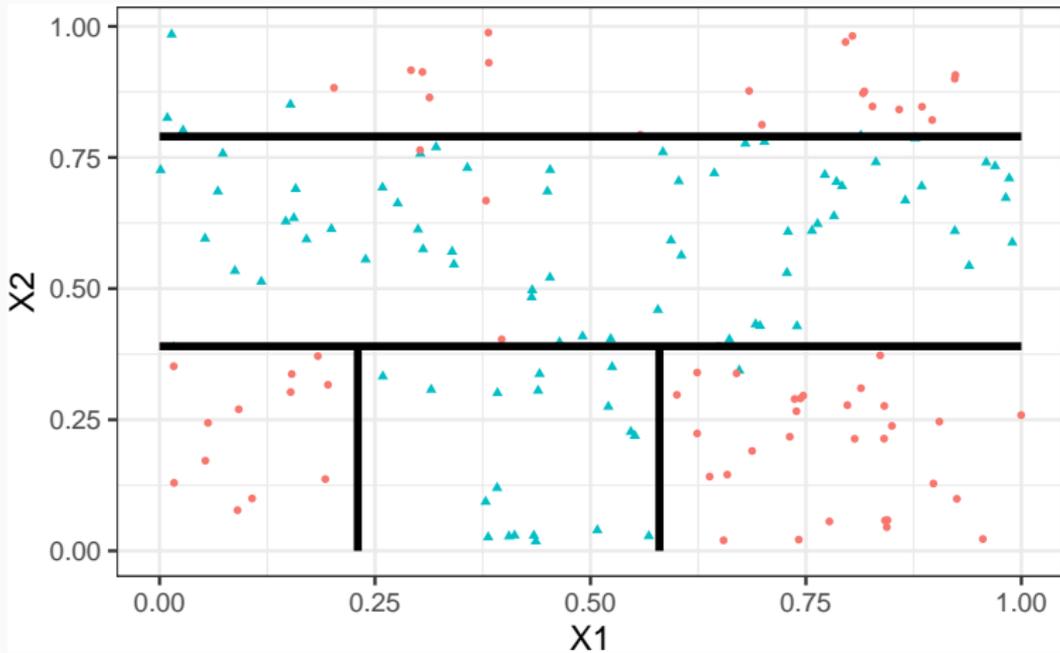
- A chaque étape, la méthode cherche une **nouvelle division** : une **variable** et un **seuil** de coupure.



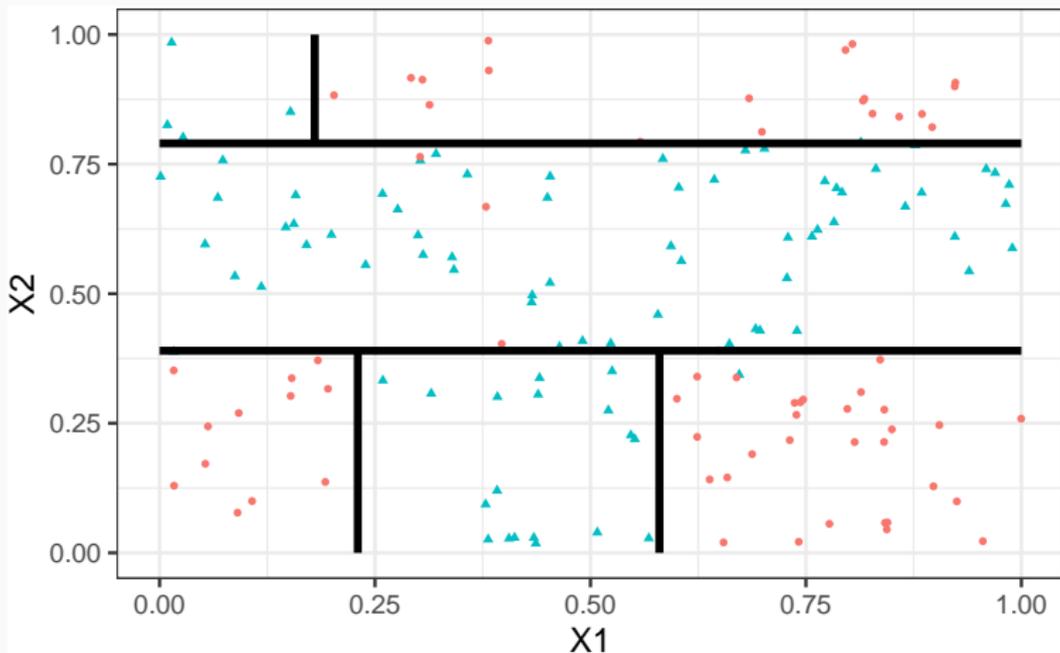
- A chaque étape, la méthode cherche une **nouvelle division** : une **variable** et un **seuil** de coupure.



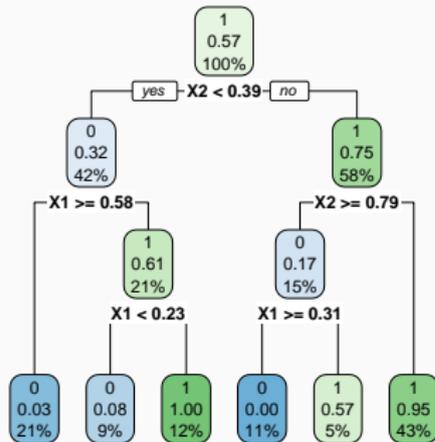
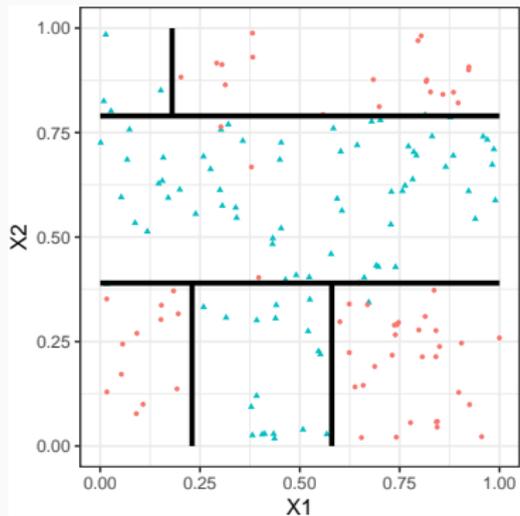
- A chaque étape, la méthode cherche une **nouvelle division** : une **variable** et un **seuil** de coupure.



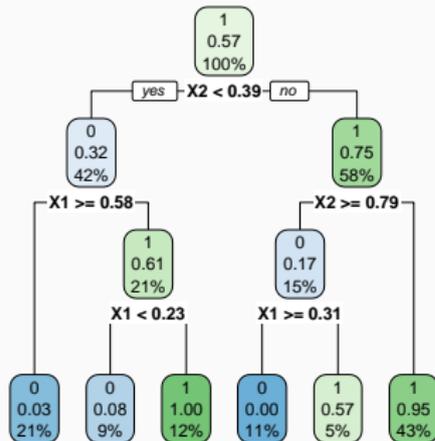
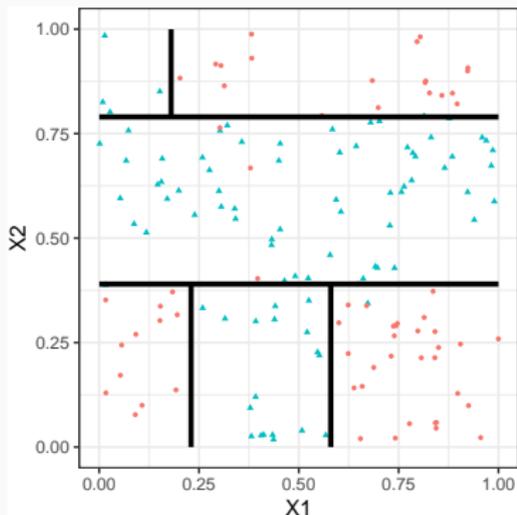
- A chaque étape, la méthode cherche une **nouvelle division** : une **variable** et un **seuil** de coupure.



Représentation de l'arbre



Représentation de l'arbre



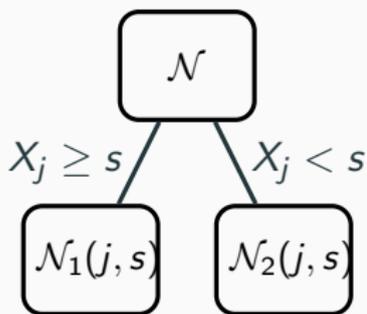
Remarque

Visuel de **droite** plus pertinent :

- Plus d'information.
- Généralisation à plus de deux dimensions.

Vocabulaire

- Chaque coupure divise une partie de \mathbb{R}^d en deux parties appelées **nœuds**.
- Le premier nœud, qui contient toutes les observations, est le **nœud racine**.
- Une coupure divise un nœud en deux **nœuds fils** :



- Les nœuds qui ne sont pas découpés (en bas de l'arbre) sont les **nœuds terminaux** ou **feuilles** de l'arbre.

Arbre et algorithme de prévision

- L'arbre construit, les **prévisions** se déduisent à partir de **moyennes faites dans les feuilles**.
- On note $\mathcal{N}(x)$ la feuille de l'arbre qui contient $x \in \mathbb{R}^d$, les prévisions s'obtiennent selon :
 1. **Régression** \implies moyenne des y_i de la feuille

$$m_n(x) = \frac{1}{|\mathcal{N}(x)|} \sum_{i: x_i \in \mathcal{N}(x)} y_i$$

Arbre et algorithme de prévision

- L'arbre construit, les **prévisions** se déduisent à partir de **moyennes faites dans les feuilles**.
- On note $\mathcal{N}(x)$ la feuille de l'arbre qui contient $x \in \mathbb{R}^d$, les prévisions s'obtiennent selon :

1. **Régression** \implies moyenne des y_i de la feuille

$$m_n(x) = \frac{1}{|\mathcal{N}(x)|} \sum_{i: x_i \in \mathcal{N}(x)} y_i$$

2. **Classification (classe)** \implies vote à la majorité :

$$g_n(x) = \operatorname{argmax}_k \sum_{i: x_i \in \mathcal{N}(x)} \mathbf{1}_{y_i=k}$$

3. **Classification (proba)** \implies proportion d'obs. du groupe k :

$$S_{k,n}(x) = \frac{1}{|\mathcal{N}(x)|} \sum_{i: x_i \in \mathcal{N}(x)} \mathbf{1}_{y_i=k}$$

1. Comment **découper** un nœud ?

⇒ si on dispose d'un algorithme pour découper un nœud, il suffira de le répéter.

1. Comment **découper** un nœud ?

⇒ si on dispose d'un algorithme pour découper un nœud, il suffira de le répéter.

2. Comment choisir la **profondeur de l'arbre** ?

- Profondeur **maximale** ? (on découpe jusqu'à ne plus pouvoir)

1. Comment **découper** un nœud ?

⇒ si on dispose d'un algorithme pour découper un nœud, il suffira de le répéter.

2. Comment choisir la **profondeur de l'arbre** ?

- Profondeur **maximale** ? (on découpe jusqu'à ne plus pouvoir)
sur-ajustement ?
- Critère d'arrêt ?

1. Comment **découper** un nœud ?

⇒ si on dispose d'un algorithme pour découper un nœud, il suffira de le répéter.

2. Comment choisir la **profondeur de l'arbre** ?

- Profondeur **maximale** ? (on découpe jusqu'à ne plus pouvoir **sur-ajustement** ?
- Critère d'arrêt ?
- Élagage ? (on construit un arbre profond et on enlève des branches "inutiles" ...).

Arbres binaires

Choix des coupures

Cas de la régression

Cas de la classification supervisée

Elagage

Importance des variables

Réseaux de neurones

Introduction

Le perceptron simple

Perceptron multicouches

Estimation

Choix des paramètres et surapprentissage

Bibliographie

- Une coupure = un couple $(j, s) \in \{1, \dots, d\} \times \mathbb{R}$.
- Idée : définir un critère mesure la performance d'une coupure et choisir celle qui optimise le critère.

- Une coupure = un couple $(j, s) \in \{1, \dots, d\} \times \mathbb{R}$.
- Idée : définir un critère mesure la performance d'une coupure et choisir celle qui optimise le critère.
- Coupure performante \implies les deux nœuds fils sont homogènes vis-à-vis de Y .

- Une coupure = un couple $(j, s) \in \{1, \dots, d\} \times \mathbb{R}$.
- Idée : définir un critère mesure la performance d'une coupure et choisir celle qui optimise le critère.
- Coupure performante \implies les deux nœuds fils sont homogènes vis-à-vis de Y .

Fonction d'impureté

- Objectif : mesurer l'homogénéité d'un nœud.

- Une coupure = un couple $(j, s) \in \{1, \dots, d\} \times \mathbb{R}$.
- Idée : définir un critère mesure la performance d'une coupure et choisir celle qui optimise le critère.
- Coupure performante \implies les deux nœuds fils sont homogènes vis-à-vis de Y .

Fonction d'impureté

- Objectif : mesurer l'homogénéité d'un nœud.
- Intérêt : choisir la coupure qui maximise la pureté des nœuds fils.

- L'impureté \mathcal{I} d'un nœud doit être :
 1. faible lorsque un nœud est homogène : les valeurs de Y dans le nœud sont proches.
 2. élevée lorsque un nœud est hétérogène : les valeurs de Y dans le nœud sont dispersées.

Critère de découpe

- L'**impureté** \mathcal{I} d'un nœud doit être :
 1. **faible** lorsque un nœud est homogène : les valeurs de Y dans le nœud sont **proches**.
 2. **élevée** lorsque un nœud est hétérogène : les valeurs de Y dans le nœud sont **dispersées**.

L'idée

Une fois \mathcal{I} définie, on choisira le couple (j, s) qui **maximise le gain d'impureté** :

$$\Delta(j, s) = p(\mathcal{N})\mathcal{I}(\mathcal{N}) - (p(\mathcal{N}_1(j, s))\mathcal{I}(\mathcal{N}_1(j, s)) + p(\mathcal{N}_2(j, s))\mathcal{I}(\mathcal{N}_2(j, s)))$$

où $p(\mathcal{N})$ représente la proportion d'observations dans le nœud \mathcal{N} .

Arbres binaires

Choix des coupures

Cas de la régression

Cas de la classification supervisée

Elagage

Importance des variables

Réseaux de neurones

Introduction

Le perceptron simple

Perceptron multicouches

Estimation

Choix des paramètres et surapprentissage

Bibliographie

- Une mesure naturelle de l'**impureté** d'un nœud \mathcal{N} en **régression** est la **variance** du nœud :

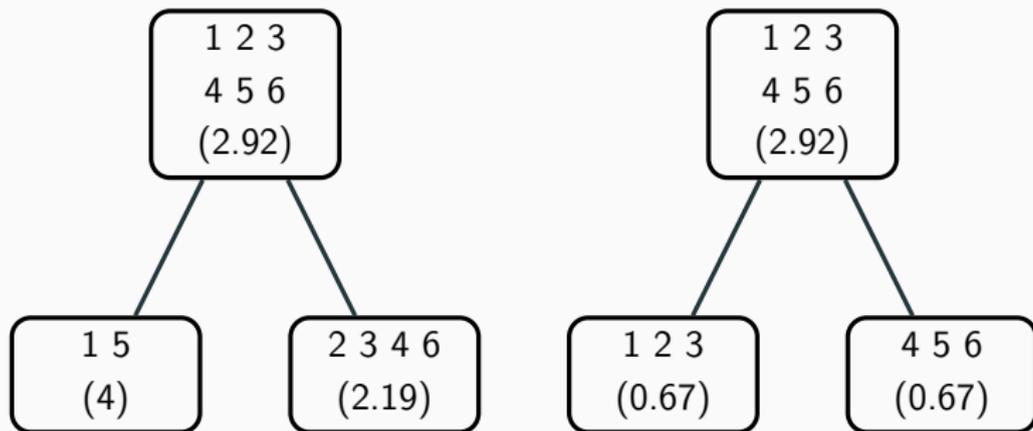
$$\mathcal{I}(\mathcal{N}) = \frac{1}{|\mathcal{N}|} \sum_{i: x_i \in \mathcal{N}} (y_i - \bar{y}_{\mathcal{N}})^2,$$

où $\bar{y}_{\mathcal{N}}$ désigne la moyenne des Y_i dans \mathcal{N} .

- Une mesure naturelle de l'**impureté** d'un nœud \mathcal{N} en **régression** est la **variance** du nœud :

$$\mathcal{I}(\mathcal{N}) = \frac{1}{|\mathcal{N}|} \sum_{i: x_i \in \mathcal{N}} (y_i - \bar{y}_{\mathcal{N}})^2,$$

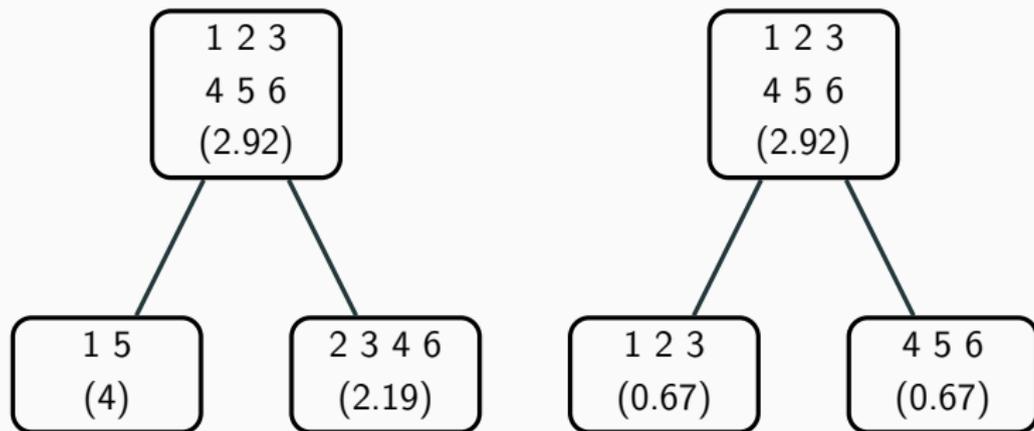
où $\bar{y}_{\mathcal{N}}$ désigne la moyenne des Y_i dans \mathcal{N} .



- Une mesure naturelle de l'**impureté** d'un nœud \mathcal{N} en **régression** est la **variance** du nœud :

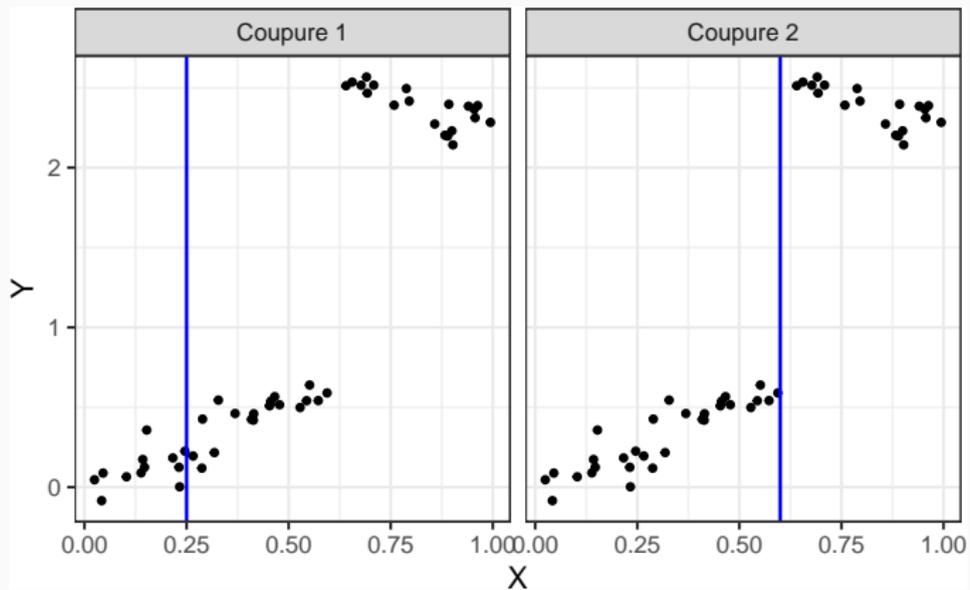
$$\mathcal{I}(\mathcal{N}) = \frac{1}{|\mathcal{N}|} \sum_{i: x_i \in \mathcal{N}} (y_i - \bar{y}_{\mathcal{N}})^2,$$

où $\bar{y}_{\mathcal{N}}$ désigne la moyenne des Y_i dans \mathcal{N} .

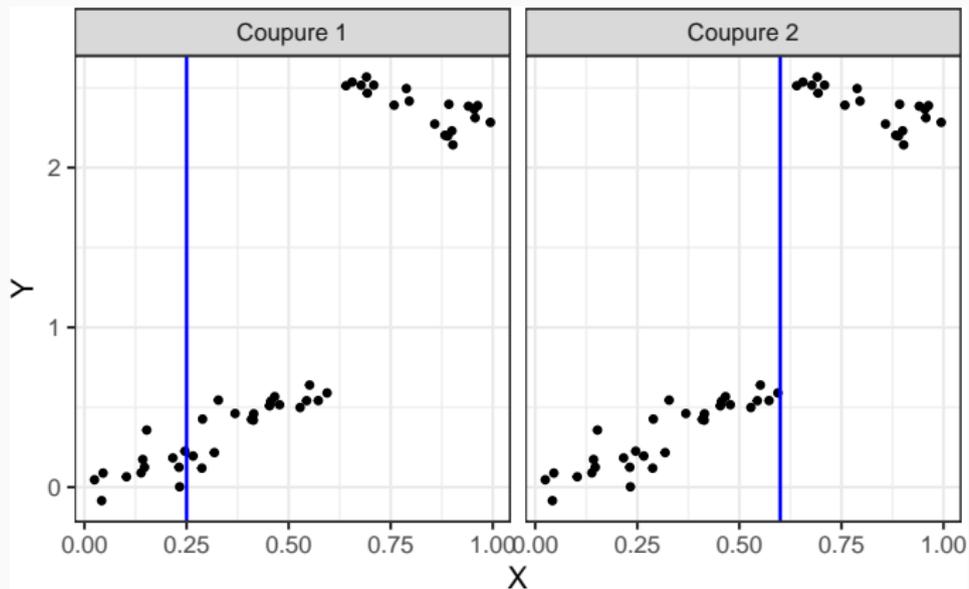


⇒ coupure de **droite** plus performante.

Exemple



Exemple



	$\mathcal{I}(\mathcal{N})$	$\mathcal{I}(\mathcal{N}_1)$	$\mathcal{I}(\mathcal{N}_2)$	Δ
Gauche	1.05	0.01	0.94	0.34
Droite	1.05	0.04	0.01	1.02

Arbres binaires

Choix des coupures

Cas de la régression

Cas de la classification supervisée

Elagage

Importance des variables

Réseaux de neurones

Introduction

Le perceptron simple

Perceptron multicouches

Estimation

Choix des paramètres et surapprentissage

Bibliographie

- Les $Y_i, i = 1, \dots, n$ sont à valeurs dans $\{1, \dots, K\}$.

- Les $Y_i, i = 1, \dots, n$ sont à valeurs dans $\{1, \dots, K\}$.
- On cherche une fonction \mathcal{I} telle que $\mathcal{I}(\mathcal{N})$ soit
 - **petite** si un **label majoritaire** se distingue clairement dans \mathcal{N} ;
 - **grande** sinon.

- Les $Y_i, i = 1, \dots, n$ sont à valeurs dans $\{1, \dots, K\}$.
- On cherche une fonction \mathcal{I} telle que $\mathcal{I}(\mathcal{N})$ soit
 - **petite** si un **label majoritaire** se distingue clairement dans \mathcal{N} ;
 - **grande** sinon.

Impureté

L'**impureté** d'un nœud \mathcal{N} en classification se mesure selon

$$\mathcal{I}(\mathcal{N}) = \sum_{j=1}^K f(p_j(\mathcal{N}))$$

où

- $p_j(\mathcal{N})$ représente la proportion d'observations de la classe j dans le nœud \mathcal{N} .
- f est une fonction (concave) $[0, 1] \rightarrow \mathbb{R}^+$ telle que $f(0) = f(1) = 0$.

Exemples de fonctions f

- Si \mathcal{N} est pur, on veut $\mathcal{I}(\mathcal{N}) = 0$

Exemples de fonctions f

- Si \mathcal{N} est pur, on veut $\mathcal{I}(\mathcal{N}) = 0 \implies$ c'est pourquoi f doit vérifier $f(0) = f(1) = 0$.

Exemples de fonctions f

- Si \mathcal{N} est pur, on veut $\mathcal{I}(\mathcal{N}) = 0 \implies$ c'est pourquoi f doit vérifier $f(0) = f(1) = 0$.
- Les 2 mesures d'impureté les plus classiques sont :
 1. **Gini** : $f(p) = p(1 - p)$;
 2. **Information** : $f(p) = -p \log(p)$.

Exemples de fonctions f

- Si \mathcal{N} est pur, on veut $\mathcal{I}(\mathcal{N}) = 0 \implies$ c'est pourquoi f doit vérifier $f(0) = f(1) = 0$.
- Les 2 mesures d'impureté les plus classiques sont :
 1. **Gini** : $f(p) = p(1 - p)$;
 2. **Information** : $f(p) = -p \log(p)$.

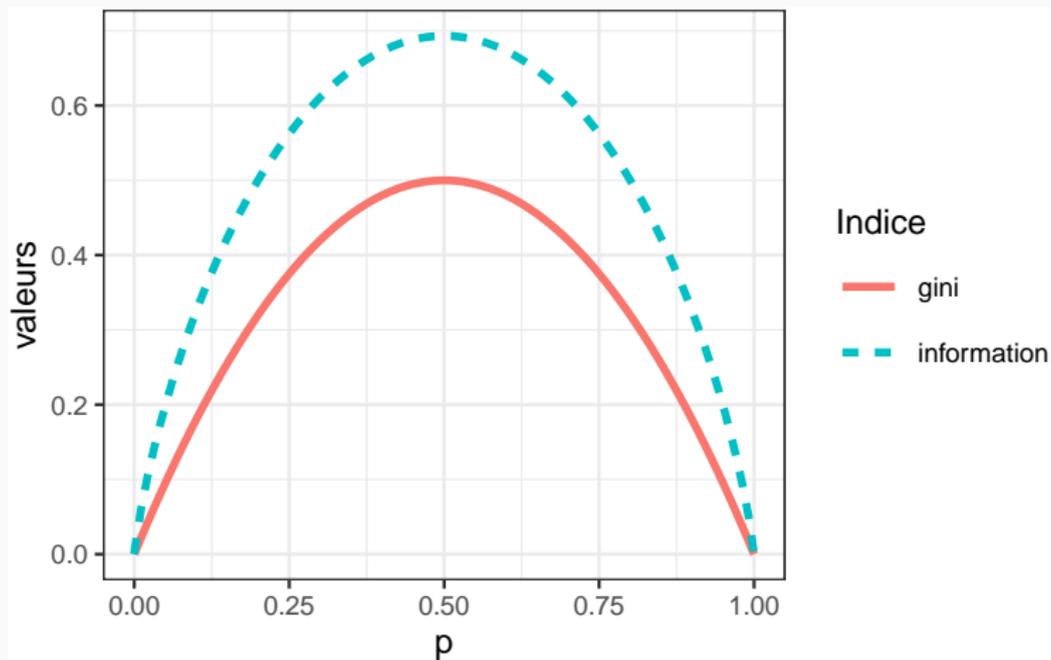
Cas binaire

Dans ce cas on a

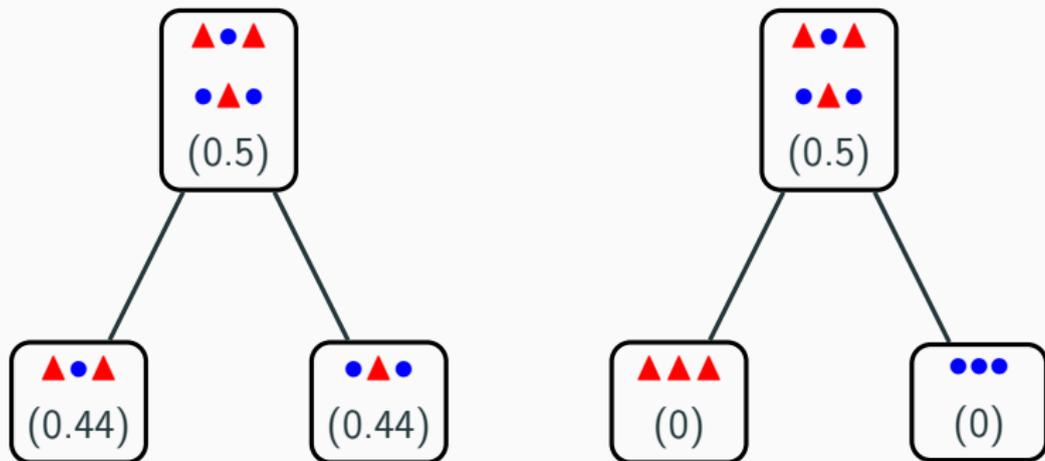
1. $\mathcal{I}(\mathcal{N}) = 2p(1 - p)$ pour **Gini**
2. $\mathcal{I}(\mathcal{N}) = -p \log p - (1 - p) \log(1 - p)$ pour **Information**

où p désigne la proportion de 1 (ou 0) dans \mathcal{N} .

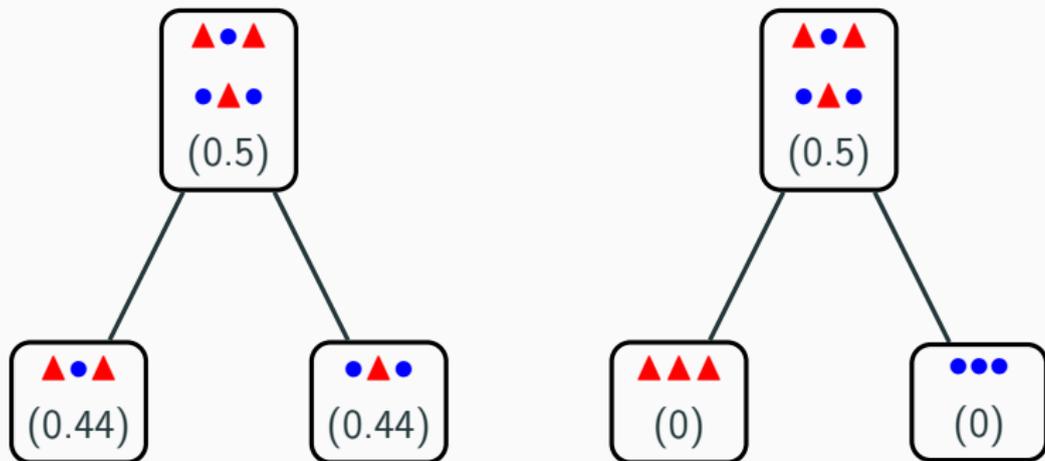
Impureté dans le cas binaire



Example 1

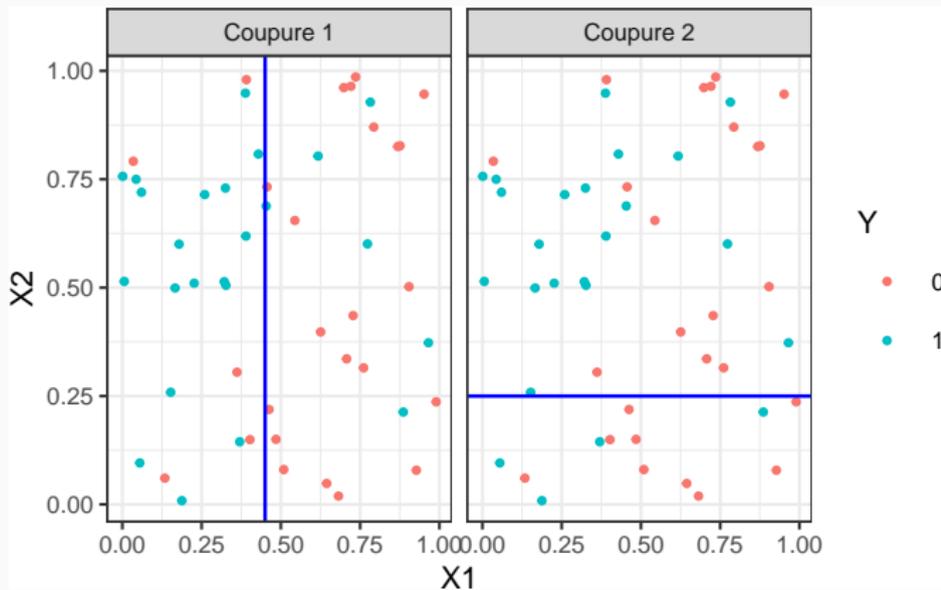


Exemple 1

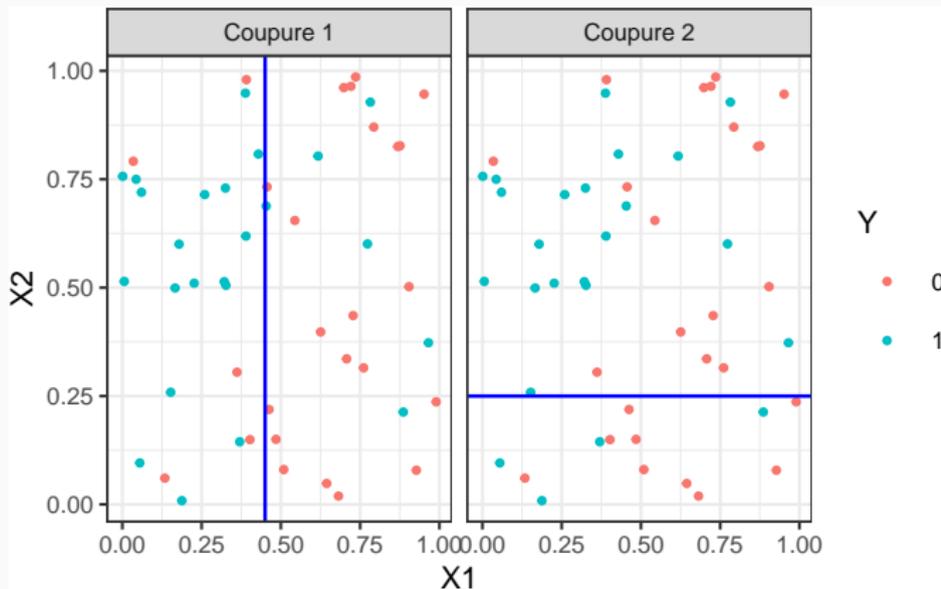


⇒ coupure de **droite** plus performante.

Exemple 2



Exemple 2



	$\mathcal{I}(\mathcal{N})$	$\mathcal{I}(\mathcal{N}_1)$	$\mathcal{I}(\mathcal{N}_2)$	Δ
Gauche	0.50	0.34	0.35	0.16
Droite	0.50	0.43	0.50	0.02

Arbres binaires

Choix des coupures

Cas de la régression

Cas de la classification supervisée

Elagage

Importance des variables

Réseaux de neurones

Introduction

Le perceptron simple

Perceptron multicouches

Estimation

Choix des paramètres et surapprentissage

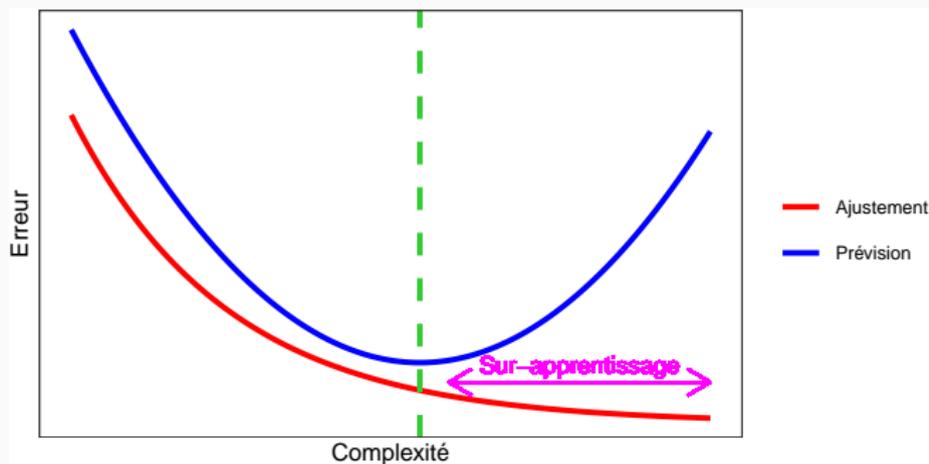
Bibliographie

Pourquoi élaguer ?

- Les coupures permettent de **séparer les données selon Y**
⇒ plus on coupe mieux on ajuste !

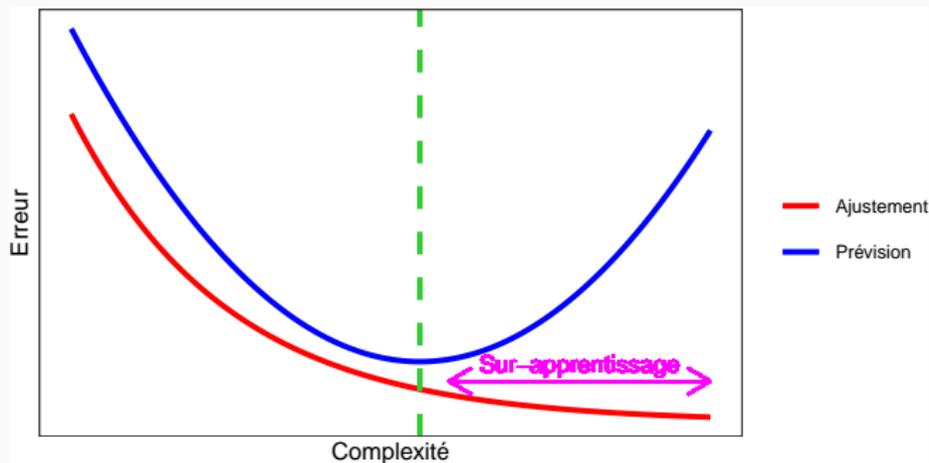
Pourquoi élaguer ?

- Les coupures permettent de **séparer les données selon Y**
⇒ plus on coupe mieux on ajuste !
- Risque de **sur-ajustement** si on coupe trop !



Pourquoi élaguer ?

- Les coupures permettent de **séparer les données selon Y**
⇒ plus on coupe mieux on ajuste !
- Risque de **sur-ajustement** si on coupe trop !



Complexité d'un arbre

Représentée par son **nombre de coupures** ou sa **profondeur**.

Comment faire ?

- Tester tous les arbres ?

Comment faire ?

- Tester tous les arbres ?
⇒ possible uniquement sur de petits échantillons !
- Critère d'arrêt : ne plus découper si une certaine condition est vérifiée.

Comment faire ?

- **Tester tous les arbres ?**
⇒ possible uniquement sur de petits échantillons !
- **Critère d'arrêt** : ne plus découper si une certaine condition est vérifiée.
⇒ possible mais... une coupure peut ne pas être pertinente alors que des **coupures plus basses** le seront !

Comment faire ?

- **Tester tous les arbres ?**
⇒ possible uniquement sur de petits échantillons !
- **Critère d'arrêt** : ne plus découper si une certaine condition est vérifiée.
⇒ possible mais... une coupure peut ne pas être pertinente alors que des **coupures plus basses** le seront !

Élaguer

1. Considérer un **arbre (trop) profond** ⇒ qui sur-ajuste ;
2. Supprimer les **branches peu utiles**.

Élagage CART

- Tester **tous les sous-arbres** d'un arbre très profond se révèlent souvent **trop coûteux** en temps de calcul.

Élagage CART

- Tester **tous les sous-arbres** d'un arbre très profond se révèlent souvent **trop coûteux** en temps de calcul.
- [Breiman et al., 1984] propose une stratégie d'élagage qui permet de se ramener à **une suite d'arbres emboîtés**

$$\mathcal{T}_{max} = \mathcal{T}_0 \supset \mathcal{T}_1 \supset \dots \supset \mathcal{T}_K.$$

de **taille raisonnable** (plus petite que n).

Élagage CART

- Tester **tous les sous-arbres** d'un arbre très profond se révèlent souvent **trop coûteux** en temps de calcul.
- [Breiman et al., 1984] propose une stratégie d'élagage qui permet de se ramener à **une suite d'arbres emboîtés**

$$\mathcal{T}_{max} = \mathcal{T}_0 \supset \mathcal{T}_1 \supset \dots \supset \mathcal{T}_K.$$

de **taille raisonnable** (plus petite que n).

- Il est ensuite possible de **choisir un arbre dans cette suite** par des méthodes traditionnelles :
 1. choix d'un risque ;
 2. optimisation de ce risque (par validation croisée par exemple).

Construction de la suite de sous arbres

- Soit T un arbre à $|T|$ nœuds terminaux $\mathcal{N}_1, \dots, \mathcal{N}_{|T|}$.
- Soit $R(\mathcal{N})$ un risque (d'ajustement) dans le nœud \mathcal{N} :

- **Régression** :

$$R_m(T) = \frac{1}{N_m} \sum_{i: x_i \in \mathcal{N}_m} (y_i - \bar{y}_{\mathcal{N}_m})^2$$

- **Classification** :

$$R_m(T) = \frac{1}{N_m} \sum_{i: x_i \in \mathcal{N}_m} \mathbf{1}_{y_i \neq y_{\mathcal{N}_m}}$$

Construction de la suite de sous arbres

- Soit T un arbre à $|T|$ nœuds terminaux $\mathcal{N}_1, \dots, \mathcal{N}_{|T|}$.
- Soit $R(\mathcal{N})$ un risque (d'ajustement) dans le nœud \mathcal{N} :
 - **Régression** :

$$R_m(T) = \frac{1}{N_m} \sum_{i: x_i \in \mathcal{N}_m} (y_i - \bar{y}_{\mathcal{N}_m})^2$$

- **Classification** :

$$R_m(T) = \frac{1}{N_m} \sum_{i: x_i \in \mathcal{N}_m} \mathbf{1}_{y_i \neq y_{\mathcal{N}_m}}$$

Définition

Soit $\alpha \geq 0$, le critère **coût/complexité** est défini par :

$$C_\alpha(T) = \sum_{m=1}^{|T|} N_m R_m(T) + \alpha |T|.$$

Idée

- $C_\alpha(T)$ est un critère qui prend en compte l'adéquation d'un arbre et sa complexité.
- L'idée est de chercher un arbre T_α qui minimise $C_\alpha(T)$ pour une valeur de α bien choisie.

Idée

- $C_\alpha(T)$ est un critère qui prend en compte l'adéquation d'un arbre et sa complexité.
- L'idée est de chercher un arbre T_α qui minimise $C_\alpha(T)$ pour une valeur de α bien choisie.

Remarque

- $\alpha = 0 \implies T_\alpha = T_0 = T_{\max}$.
- $\alpha = +\infty \implies T_\alpha = T_{+\infty} = T_{\text{root}}$ arbre sans coupure.

Idée

- $C_\alpha(T)$ est un critère qui prend en compte l'adéquation d'un arbre et sa complexité.
- L'idée est de chercher un arbre T_α qui minimise $C_\alpha(T)$ pour une valeur de α bien choisie.

Remarque

- $\alpha = 0 \implies T_\alpha = T_0 = T_{\max}$.
- $\alpha = +\infty \implies T_\alpha = T_{+\infty} = T_{\text{root}}$ arbre sans coupure.

Question (a priori difficile)

Comment calculer T_α qui minimise $C_\alpha(T)$?

Lemme 1

Si T_1 et T_2 sont deux sous-arbres de T_{\max} avec $R_\alpha(T_1) = R_\alpha(T_2)$. Alors $T_1 \subset T_2$ ou $T_2 \subset T_1$

\implies garantit une unique solution de **taille minimale**.

Deux lemmes

Lemme 1

Si T_1 et T_2 sont deux sous-arbres de T_{\max} avec $R_\alpha(T_1) = R_\alpha(T_2)$. Alors $T_1 \subset T_2$ ou $T_2 \subset T_1$

\implies garantit une unique solution de **taille minimale**.

Lemme 2

Si $\alpha > \alpha'$ alors $T_\alpha = T_{\alpha'}$ ou $T_\alpha \subset T_{\alpha'}$.

\implies garantit une **stabilité des solutions** lorsque α parcourt \mathbb{R}^+ \implies elles vont être **emboîtées** les unes dans les autres.

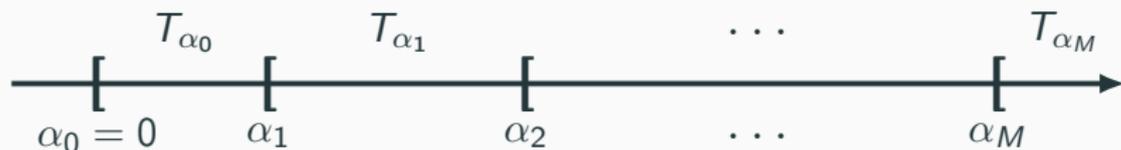
Théorème [Breiman et al., 1984]

Il existe une suite finie $\alpha_0 = 0 < \alpha_1 < \dots < \alpha_M$ avec $M \leq |T_{\max}|$ et une suite associée d'arbres emboîtés $(T_{\alpha_m})_m$

$$T_{\max} = T_{\alpha_0} \supset T_{\alpha_1} \supset \dots \supset T_{\alpha_M} = T_{\text{root}}$$

telle que $\forall \alpha \in [\alpha_m, \alpha_{m+1}[$

$$T_m \in \underset{T \subseteq T_{\max}}{\operatorname{argmin}} C_\alpha(T).$$



Théorème [Breiman et al., 1984]

Il existe une suite finie $\alpha_0 = 0 < \alpha_1 < \dots < \alpha_M$ avec $M \leq |T_{\max}|$ et une suite associée d'arbres emboîtés $(T_{\alpha_m})_m$

$$T_{\max} = T_{\alpha_0} \supset T_{\alpha_1} \supset \dots \supset T_{\alpha_M} = T_{\text{root}}$$

telle que $\forall \alpha \in [\alpha_m, \alpha_{m+1}[$

$$T_m \in \underset{T \subseteq T_{\max}}{\operatorname{argmin}} C_\alpha(T).$$



Commentaires

- Nombre de minimiseurs de $C_\alpha(T)$ est "petit".
- Ils s'obtiennent en **élaguant** : en supprimant des branches.

Exemple

- On visualise la suite de sous-arbres avec la fonction `printcp` ou dans l'objet `rpart` :

```
> library(rpart)
> set.seed(123)
> arbre <- rpart(Y~.,data=don.2D.arbre,cp=0.0001,minsplitlevel=2)
> arbre$cptable
```

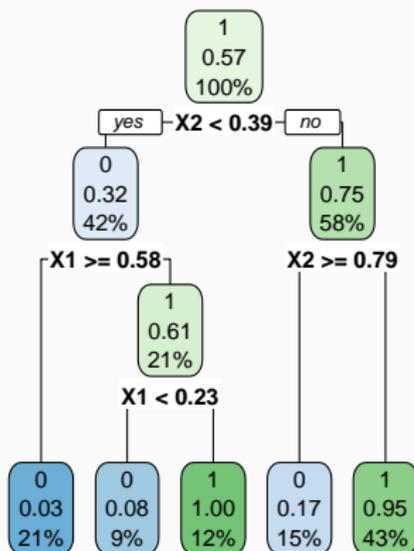
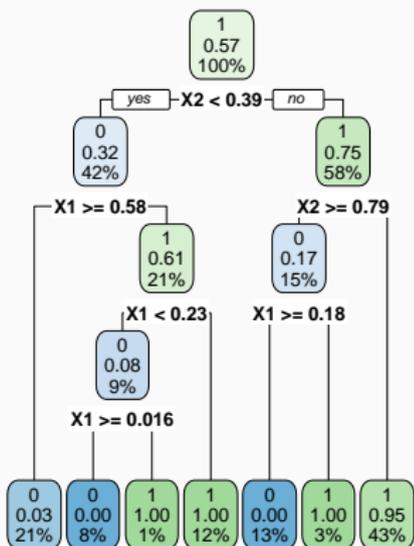
##	CP	nsplit	rel error	xerror	xstd
## 1	0.353846154	0	1.00000000	1.00000000	0.09336996
## 2	0.230769231	1	0.64615385	0.7076923	0.08688336
## 3	0.138461538	2	0.41538462	0.5076923	0.07805324
## 4	0.061538462	4	0.13846154	0.2153846	0.05481185
## 5	0.015384615	5	0.07692308	0.1846154	0.05111769
## 6	0.007692308	6	0.06153846	0.2461538	0.05816388
## 7	0.000100000	14	0.00000000	0.2153846	0.05481185

- Suite de 7 arbres emboîtés.
- CP : complexity parameter, il mesure la complexité de l'arbre : CP $\searrow \implies$ complexité \nearrow .
- nsplit : nombre de coupures de l'arbre.
- rel.error : erreur (normalisée) calculée sur les données d'apprentissage \implies erreur d'ajustement.
- xerror : erreur (normalisée) calculée par validation croisée 10 blocs \implies erreur de prévision (voir diapos suivantes).
- xstd : écart-type associé à l'erreur de validation croisée.

Visualisation

- On peut les visualiser en combinant `prune` (extraction) et `rpart.plot` (tracé) :

```
> arbre1 <- prune(arbre, cp=0.01)
> arbre2 <- prune(arbre, cp=0.1)
> library(rpart.plot)
> rpart.plot(arbre1); rpart.plot(arbre2)
```



Choix de l'arbre final

- Choisir un arbre dans la suite revient à choisir une valeur de α .

Choix de l'arbre final

- Choisir un arbre dans la suite revient à **choisir une valeur de α** .
- Ce choix s'effectue généralement de façon classique :
 1. Choix d'un **risque**.
 2. **Estimation** du risque par **ré-échantillonnage** (CV par exemple) pour tous les α_m .
 3. **Sélection** du α_m qui **minimise** le risque estimé.

Choix de l'arbre final

- Choisir un arbre dans la suite revient à **choisir une valeur de α** .
- Ce choix s'effectue généralement de façon classique :
 1. Choix d'un **risque**.
 2. **Estimation** du risque par **ré-échantillonnage** (CV par exemple) pour tous les α_m .
 3. **Sélection** du α_m qui **minimise** le risque estimé.

Remarque

La fonction `rpart` effectue par défaut une validation croisée 10 blocs en prenant :

- le **risque quadratique** en régression.
- l'**erreur de classification** en classification.

1. Calculer

$$\beta_0 = 0, \quad \beta_1 = \sqrt{\alpha_1 \alpha_2}, \quad \dots \quad \beta_{M-1} = \sqrt{\alpha_{M-1} \alpha_M}, \quad \beta_M = +\infty.$$

2. Pour $k = 1, \dots, K$

2.1 Construire l'arbre maximal sur l'ensemble des données privé du k^e bloc, c'est-à-dire $\mathcal{B}^{-k} = \{(x_i, y_i) : i \in \{1, \dots, n\} \setminus B_k\}$.

2.2 Appliquer l'algorithme d'élagage à cet arbre maximal, puis extraire les arbres qui correspondent aux valeurs $\beta_m, m = 0, \dots, M \implies T_{\beta_m}(\cdot, \mathcal{B}^{-k})$.

2.3 Calculer les valeurs prédites par chaque arbre sur le bloc k : $T_{\beta_m}(x_i, \mathcal{B}^{-k}), i \in B_k$.

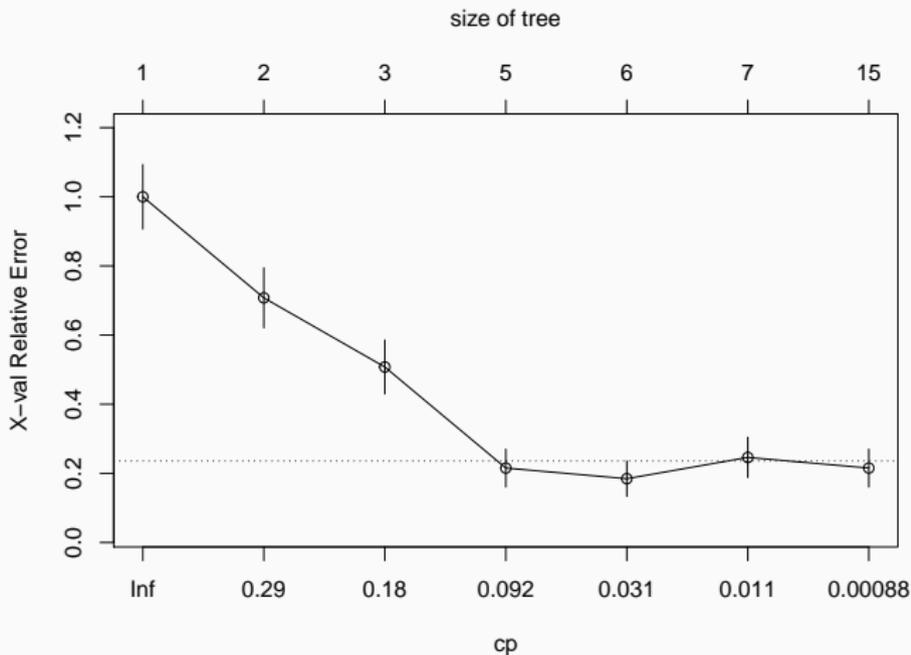
3. En déduire les erreurs pour chaque β_m :

$$\widehat{\mathcal{R}}(\beta_m) = \frac{1}{n} \sum_{k=1}^K \sum_{i \in B_k} \ell(y_i, T_{\beta_m}(x_i, \mathcal{B}^{-k})).$$

Retourner : une valeur α_m telle que $\widehat{\mathcal{R}}(\beta_m)$ est minimum.

- Les erreurs de validation croisée se trouvent dans la colonne `xerror` de l'élément `cptable`.
- On peut les visualiser avec `plotcp` :

```
> plotcp(arbre)
```



- Il reste à choisir l'arbre qui minimise l'erreur de prévision :

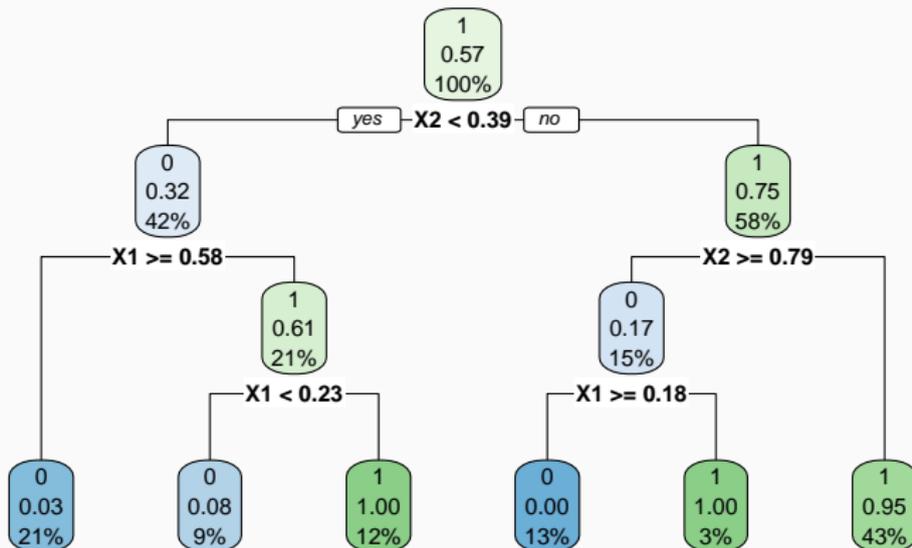
```
> cp_opt <- as_tibble(arbre$cptable) %>% arrange(xerror) %>%  
+ slice(1) %>% select(CP) %>% as.numeric()  
> cp_opt  
## [1] 0.01538462
```

- Il reste à choisir l'arbre qui **minimise l'erreur de prévision** :

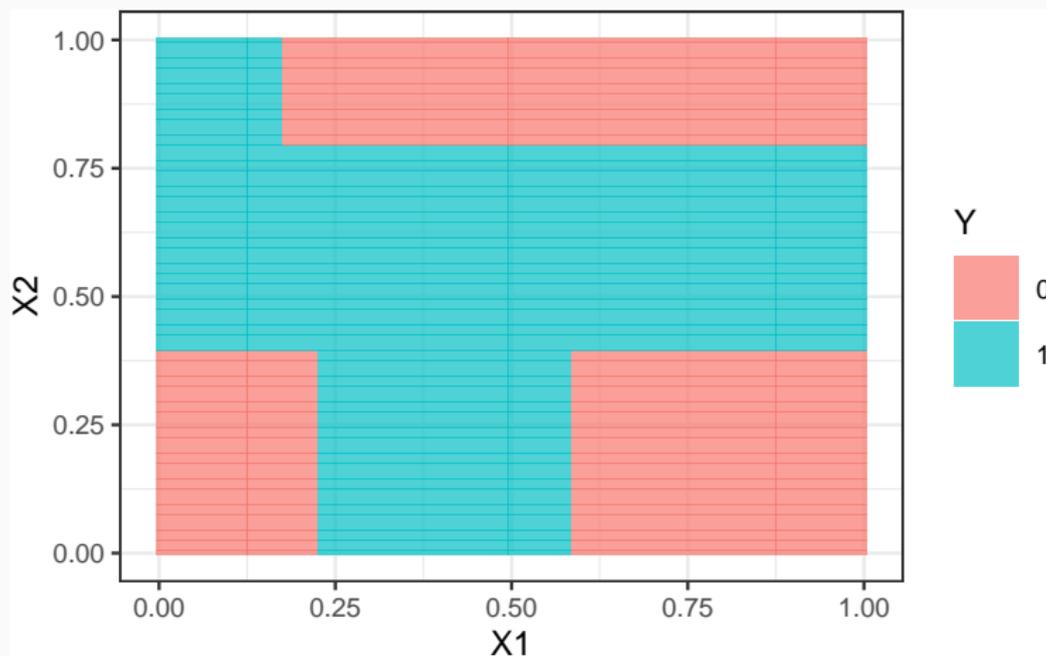
```
> cp_opt <- as_tibble(arbre$cptable) %>% arrange(xerror) %>%  
+ slice(1) %>% select(CP) %>% as.numeric()  
> cp_opt  
## [1] 0.01538462
```

- et à le visualiser :

```
> arbre_final <- prune(arbre, cp=cp_opt)  
> rpart.plot(arbre_final)
```



- 2 variables explicatives \implies on peut visualiser l'arbre final
- en coloriant le carré $[0, 1]^2$ en fonction des valeurs prédites.



- Nouvel individu :

```
> xnew <- tibble(X1=0.4,X2=0.5)
```

- Nouvel individu :

```
> xnew <- tibble(X1=0.4,X2=0.5)
```

- Prévision de la classe :

```
> predict(arbre_final,newdata=xnew,type="class")  
## 1  
## 1  
## Levels: 0 1
```

- Nouvel individu :

```
> xnew <- tibble(X1=0.4,X2=0.5)
```

- Prévision de la classe :

```
> predict(arbre_final,newdata=xnew,type="class")  
## 1  
## 1  
## Levels: 0 1
```

- Prévision des probabilités :

```
> predict(arbre_final,newdata=xnew,type="prob")  
##           0           1  
## 1 0.046875 0.953125
```

Arbres binaires

Choix des coupures

Cas de la régression

Cas de la classification supervisée

Elagage

Importance des variables

Réseaux de neurones

Introduction

Le perceptron simple

Perceptron multicouches

Estimation

Choix des paramètres et surapprentissage

Bibliographie

- La **visualisation de l'arbre** peut donner une idée sur l'**importance des variables** dans l'algorithme.
- **Pas suffisant !** Il se peut en effet que des variables possèdent une grande importance sans pour autant apparaître explicitement dans l'arbre !

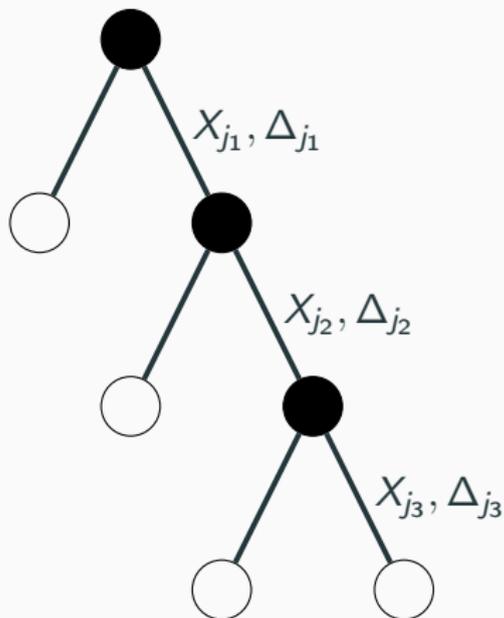
- La **visualisation de l'arbre** peut donner une idée sur l'**importance des variables** dans l'algorithme.
- **Pas suffisant !** Il se peut en effet que des variables possèdent une grande importance sans pour autant apparaître explicitement dans l'arbre !
 - Difficile de **quantifier l'importance** juste en regardant l'arbre !
 - Il se peut en effet que des variables possèdent une grande importance **sans pour autant apparaître en haut** de l'arbre !

- La **visualisation de l'arbre** peut donner une idée sur l'**importance des variables** dans l'algorithme.
- **Pas suffisant !** Il se peut en effet que des variables possèdent une grande importance sans pour autant apparaître explicitement dans l'arbre !
 - Difficile de **quantifier l'importance** juste en regardant l'arbre !
 - Il se peut en effet que des variables possèdent une grande importance **sans pour autant apparaître en haut** de l'arbre !

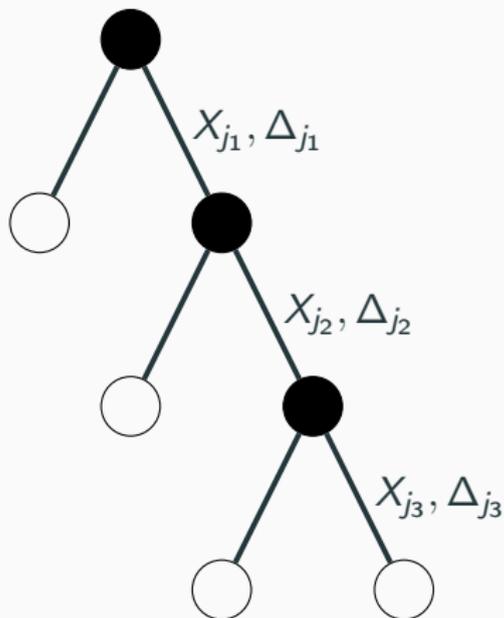
Mesure d'importance d'un arbre

Basée sur le **gain d'impureté** des nœuds internes.

- Nœuds internes $\implies N_t, t = 1, \dots, J - 1;$
- Variables de coupure $\implies X_{j_t};$
- Gain d'impureté $\implies i_{j_t}^2.$

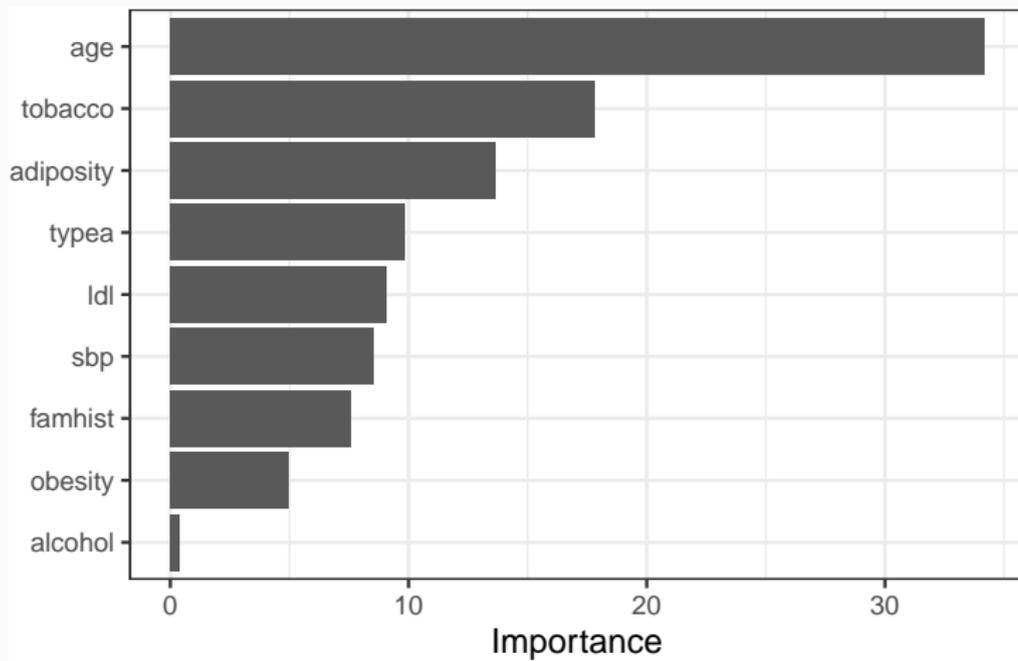


- Nœuds internes $\implies N_t, t = 1, \dots, J - 1;$
- Variables de coupure $\implies X_{j_t};$
- Gain d'impureté $\implies i_{j_t}^2.$



Mesure d'impureté de la variable ℓ

$$\mathcal{I}_\ell(T) = \sum_{t=1}^{|T|-1} \Delta_t \mathbf{1}_{j_t=\ell}.$$



1. Avantages :

- Méthode « simple » relativement facile à mettre en œuvre.
- Fonctionne en régression et en classification.
- Résultats interprétables (à condition que l'arbre ne soit pas trop profond).

1. Avantages :

- Méthode « simple » relativement facile à mettre en œuvre.
- Fonctionne en régression et en classification.
- Résultats interprétables (à condition que l'arbre ne soit pas trop profond).

2. Inconvénients :

- Performances prédictives limitées.
- méthode connue pour être instable, sensible à de légères perturbations de l'échantillon.
 - ⇒ Cet inconvénient sera un avantage pour des agrégations bootstrap
 - ⇒ forêts aléatoires.

Arbres binaires

Choix des coupures

Cas de la régression

Cas de la classification supervisée

Elagage

Importance des variables

Réseaux de neurones

Introduction

Le perceptron simple

Perceptron multicouches

Estimation

Choix des paramètres et surapprentissage

Bibliographie

Arbres binaires

Choix des coupures

Cas de la régression

Cas de la classification supervisée

Elagage

Importance des variables

Réseaux de neurones

Introduction

Le perceptron simple

Perceptron multicouches

Estimation

Choix des paramètres et surapprentissage

Bibliographie

- Wikistat : Neural networks and introduction to deep learning
- Eric Rakotomalala : Deep learning : Tensorflow et Keras sous R
- Rstudio : R interface to Keras

- Modélisation du **neurone formel** [McCulloch and Pitts, 1943].
- Concept mis en **réseau** avec **une couche d'entrée et une sortie** [Rosenblatt, 1958].
 - Origine du **perceptron**
 - Approche **connexioniste** (atteint ses limites technologiques et théoriques au début des années 70)
- Relance de l'approche connexioniste au début des années 80 avec l'essor technologique et quelques avancées théoriques
- Estimation du **gradient** par **rétro-propagation de l'erreur** [Rumelhart et al., 1986].

- Développement considérable (au début des années 90)
- Remis en veilleuse au milieu des années 90 au profit d'**autres algorithmes d'apprentissage** : boosting, support vector machine...
- Regain d'intérêt dans les années 2010, énorme battage médiatique sous l'appellation d'**apprentissage profond/deep learning**.
- Résultats **spectaculaires** obtenus par ces réseaux en **reconnaissance d'images**, traitement du **langage naturel**...

Différentes architectures

Il existe différents types de réseaux neuronaux :

- **perceptron multicouches** : les plus anciens et les plus simples ;
- **réseaux de convolution** : particulièrement efficaces pour le traitement d'images ;
- **réseaux récurrents** : adaptés à des données séquentielles (données textuelles, séries temporelles).

Différentes architectures

Il existe **différents types** de réseaux neuronaux :

- **perceptron multicouches** : les plus anciens et les plus simples ;
- **réseaux de convolution** : particulièrement efficaces pour le traitement d'images ;
- **réseaux récurrents** : adaptés à des données séquentielles (données textuelles, séries temporelles).

Dans cette partie

nous nous intéresserons uniquement au **perceptron multicouches**.

Neurone : vision biologique



Définition : neurone biologique

Un neurone biologique est une cellule qui se caractérise par

- des **synapses** : les points de **connexion** avec les autres neurones ;
- **dentrites** : **entrées** du neurones ;
- les **axones** ou **sorties** du neurone vers d'autres neurones ;
- le **noyau** qui **active** les sorties.

Définition : neurone biologique

Un neurone biologique est une cellule qui se caractérise par

- des **synapses** : les points de **connexion** avec les autres neurones ;
- des **dendrites** : **entrées** du neurones ;
- les **axones** ou **sorties** du neurone vers d'autres neurones ;
- le **noyau** qui **active** les sorties.

Définition : neurone formel

Un **neurone formel** est un modèle qui se caractérise par

- des **entrées** x_1, \dots, x_p ;
- des **poids** w_0, w_1, \dots, w_p ;
- une **fonction d'activation** $\sigma : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$;
- une **sortie** :

$$\hat{y} = \sigma(w_0 + w_1x_1 + \dots + x_px_p).$$

Arbres binaires

Choix des coupures

Cas de la régression

Cas de la classification supervisée

Elagage

Importance des variables

Réseaux de neurones

Introduction

Le perceptron simple

Perceptron multicouches

Estimation

Choix des paramètres et surapprentissage

Bibliographie

- **Le problème** : expliquer une **sortie** $y \in \mathbb{R}$ par des entrées $x = (x_1, \dots, x_p)$.

- Le problème : expliquer une sortie $y \in \mathbb{R}$ par des entrées $x = (x_1, \dots, x_p)$.

Définition

Le perceptron simple est une fonction f des entrées x

- pondérées par un vecteur $w = (w_1, \dots, w_p)$,
- complétées par un neurone de biais w_0 ,
- et une fonction d'activation $\sigma : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$

$$\hat{y} = f(x) = \sigma(w_0 + w_1x_1 + \dots + x_px_p).$$

Plusieurs fonctions d'activation peuvent être utilisées :

- **Identité** : $\sigma(x) = x$;
- **sigmoïde** ou **logistique** : $\sigma(x) = 1/(1 + \exp(-x))$;
- **seuil** : $\sigma(x) = \mathbf{1}_{x \geq 0}$;
- **ReLU** (Rectified Linear Unit) : $\sigma(x) = \max(x, 0)$;
- **Radiale** : $\sigma(x) = \sqrt{1/2\pi} \exp(-x^2/2)$.

Fonction d'activation

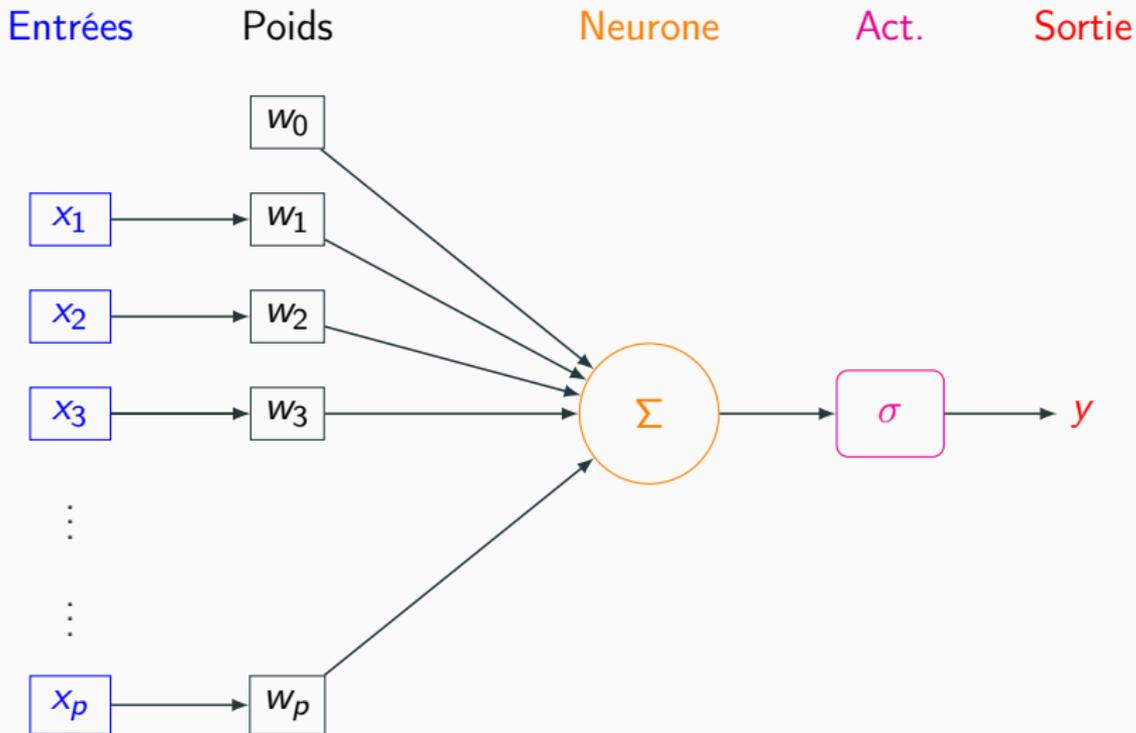
Plusieurs fonctions d'activation peuvent être utilisées :

- **Identité** : $\sigma(x) = x$;
- **sigmoïde** ou **logistique** : $\sigma(x) = 1/(1 + \exp(-x))$;
- **seuil** : $\sigma(x) = \mathbf{1}_{x \geq 0}$;
- **ReLU** (Rectified Linear Unit) : $\sigma(x) = \max(x, 0)$;
- **Radiale** : $\sigma(x) = \sqrt{1/2\pi} \exp(-x^2/2)$.

Remarque

Les **poids** w_j sont estimés à partir des **données** (voir plus loin).

Représentation graphique



- Plusieurs **packages R** permettent d'ajuster des réseaux de neurones : **nnet**, **deepnet**...
- Nous présentons ici le package **keras**, initialement programmé en **Python** et qui a été "traduit" récemment en **R**.

```
> library(keras)
> install_keras()
```

Exemple

- On veut expliquer **une variable Y** binaire par **4 variables d'entrées** X_1, \dots, X_4 .
- On dispose d'un **échantillon d'apprentissage** de taille 300 :

```
> head(dapp)
##           X1           X2           X3           X4 Y
## 1  0.5855288 -1.4203239  1.67751179 -0.1746226 1
## 2  0.7094660 -2.4669386  0.07947405 -0.6706167 1
## 3 -0.1093033  0.4847158 -0.85642750  0.5074258 0
## 4 -0.4534972 -0.9379723 -0.77877729  1.2474343 0
## 5  0.6058875  3.3307333 -0.38093608 -1.2482755 1
## 6 -1.8179560 -0.1629455 -1.89735834 -1.9347187 1
```

Définition du modèle

- Elle s'effectue à l'aide des fonctions `keras_model_sequential` et `layer_dense`.

```
> model <- keras_model_sequential()
> model %>% layer_dense(units=1,input_shape=c(4),
+                       activation="sigmoid")
```

Définition du modèle

- Elle s'effectue à l'aide des fonctions `keras_model_sequential` et `layer_dense`.

```
> model <- keras_model_sequential()  
> model %>% layer_dense(units=1,input_shape=c(4),  
+                       activation="sigmoid")
```

- **units** : nombre de neurones souhaités ;
- **activation** : choix de la fonction d'activation.

Summary

- Un **summary** du modèle permet de visualiser le **nombre de paramètres** à estimer.

```
> summary(model)
## -----
## Layer (type)                Output Shape                Param #
## =====
## dense (Dense)                (None, 1)                   5
## =====
## Total params: 5
## Trainable params: 5
## Non-trainable params: 0
## -----
```

- On indique dans la fonction `compile` la **fonction de perte** pour l'estimation des paramètres du modèle et le **critère de performance**

```
> model %>% compile(  
+   loss="binary_crossentropy",  
+   optimizer="adam",  
+   metrics="accuracy"  
+ )
```

Estimation

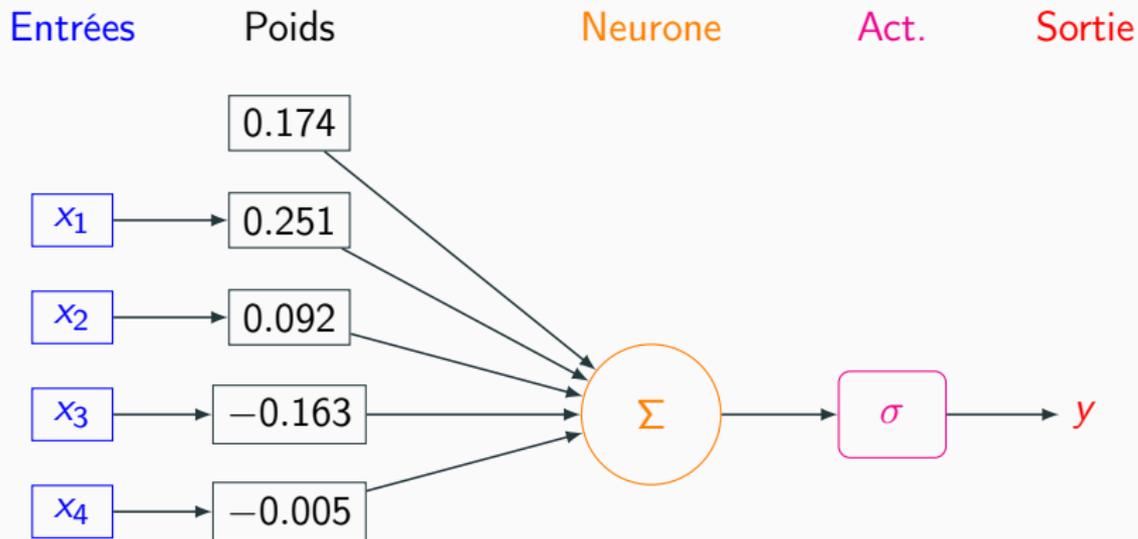
- On utilise la fonction `fit` pour entrainer le modèle

```
> Xtrain <- as.matrix(dapp[,1:4])
> Ytrain <- dapp$Y
> model %>% fit(x=Xtrain,y=Ytrain,epochs=300,batch_size=5)
```

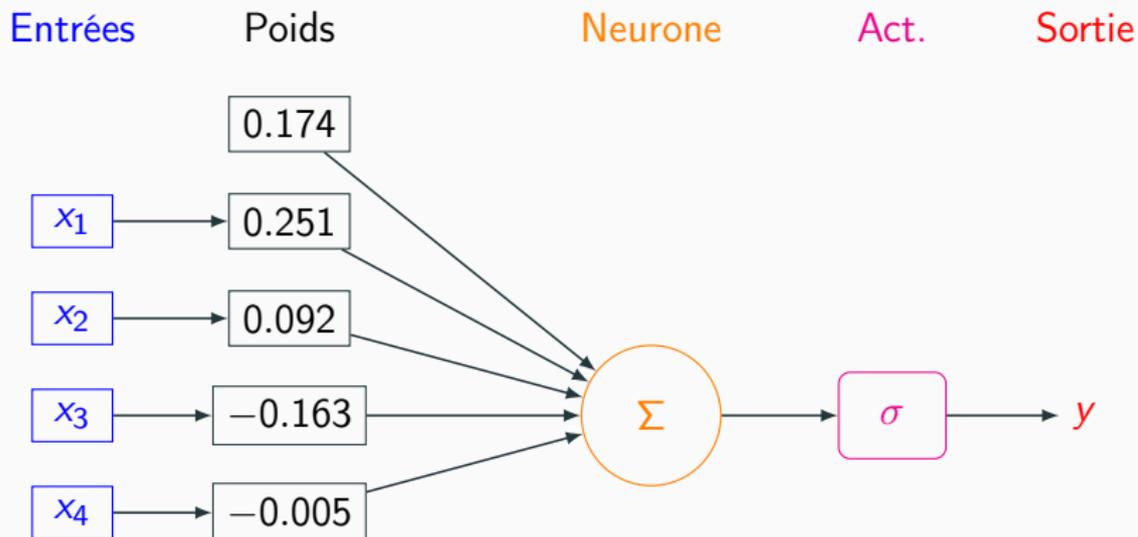
- Et on obtient les poids avec `get_weights` :

```
> W <- get_weights(model)
> W
## [[1]]
##           [,1]
## [1,]  0.250867128
## [2,]  0.092339918
## [3,] -0.162947521
## [4,] -0.005261241
##
## [[2]]
## [1] 0.1739036
```

Visualisation du réseau



Visualisation du réseau



Estimation

$$\hat{P}(Y = 1|X = x) = \frac{1}{1 + \exp(-(0.174 + 0.251x_1 + \dots - 0.005x_4))}$$

- On calcule la **prévision de la probabilité** $P(Y = 1|X = x)$ pour le premier individu de l'échantillon test :

```
> w <- W[[1]]
> w0 <- W[[2]]
> Xtest <- as.matrix(dtest[,1:4])
> sc1 <- w0+sum(w*Xtest[1,])
> 1/(1+exp(-sc1))
## [1] 0.6209704
```

- On calcule la **prévision de la probabilité** $P(Y = 1|X = x)$ pour le premier individu de l'échantillon test :

```
> w <- W[[1]]
> w0 <- W[[2]]
> Xtest <- as.matrix(dtest[,1:4])
> sc1 <- w0+sum(w*Xtest[1,])
> 1/(1+exp(-sc1))
## [1] 0.6209704
```

- que l'on retrouve avec **predict_proba** :

```
> prev <- model %>% predict_proba(Xtest)
> prev[1]
## [1] 0.6209704
```

Arbres binaires

Choix des coupures

Cas de la régression

Cas de la classification supervisée

Elagage

Importance des variables

Réseaux de neurones

Introduction

Le perceptron simple

Perceptron multicouches

Estimation

Choix des paramètres et surapprentissage

Bibliographie

Constat

- Règle de classification : le **preceptron simple** affecte un individu dans le groupe 1 si

$$P(Y = 1|X = x) \geq 0.5 \iff w_0 + w_1x_1 + \dots + w_px_p \geq 0.$$

- Il s'agit donc d'une **règle linéaire**.

Constat

- Règle de classification : le **preceptron simple** affecte un individu dans le groupe 1 si

$$P(Y = 1|X = x) \geq 0.5 \iff w_0 + w_1x_1 + \dots + w_px_p \geq 0.$$

- Il s'agit donc d'une **règle linéaire**.

\implies **peu efficace** pour représenter des **phénomènes "complexes"**.

Constat

- Règle de classification : le **preceptron simple** affecte un individu dans le groupe 1 si

$$P(Y = 1|X = x) \geq 0.5 \iff w_0 + w_1x_1 + \dots + w_px_p \geq 0.$$

- Il s'agit donc d'une **règle linéaire**.

\implies **peu efficace** pour représenter des **phénomènes "complexes"**.

Idée

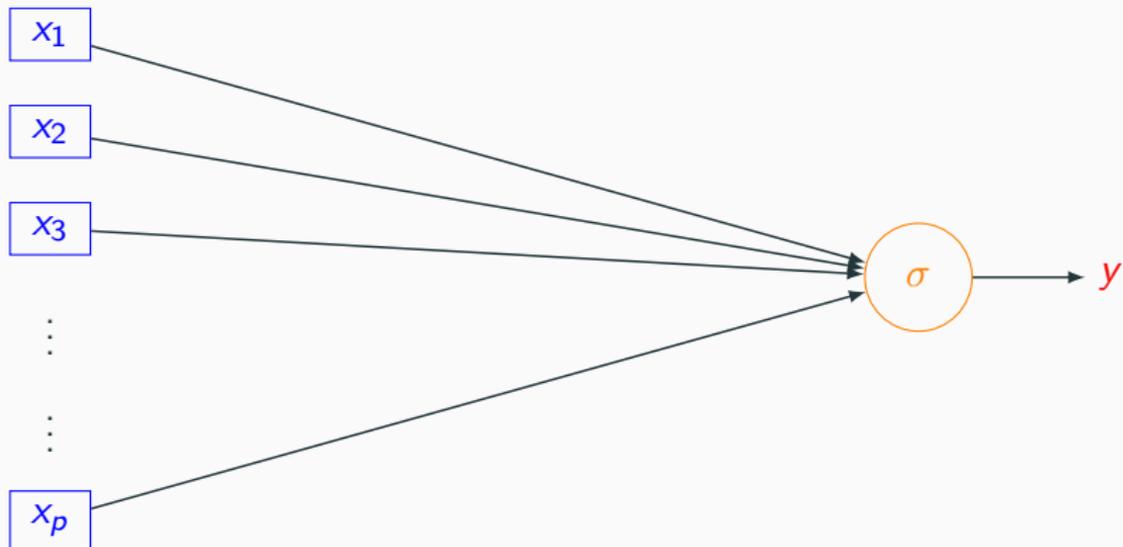
Conserver cette structure de réseau en considérant **plusieurs couches** de **plusieurs neurones**.

Perceptron simple

Entrées

C. Sortie

Sortie



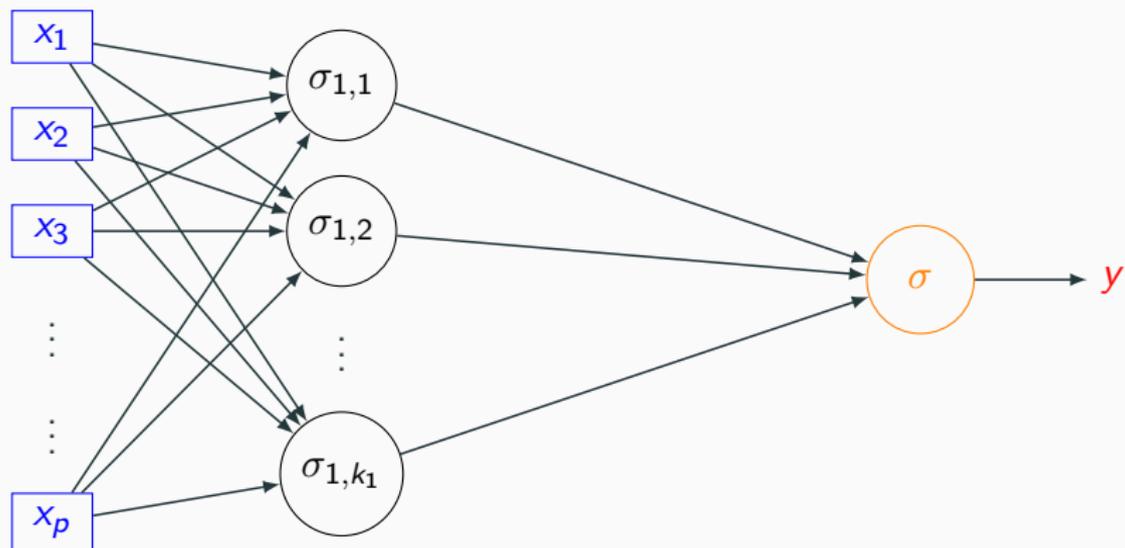
Une couche cachée

Entrées

C. cachée

C. Sortie

Sortie



Deux couches cachées

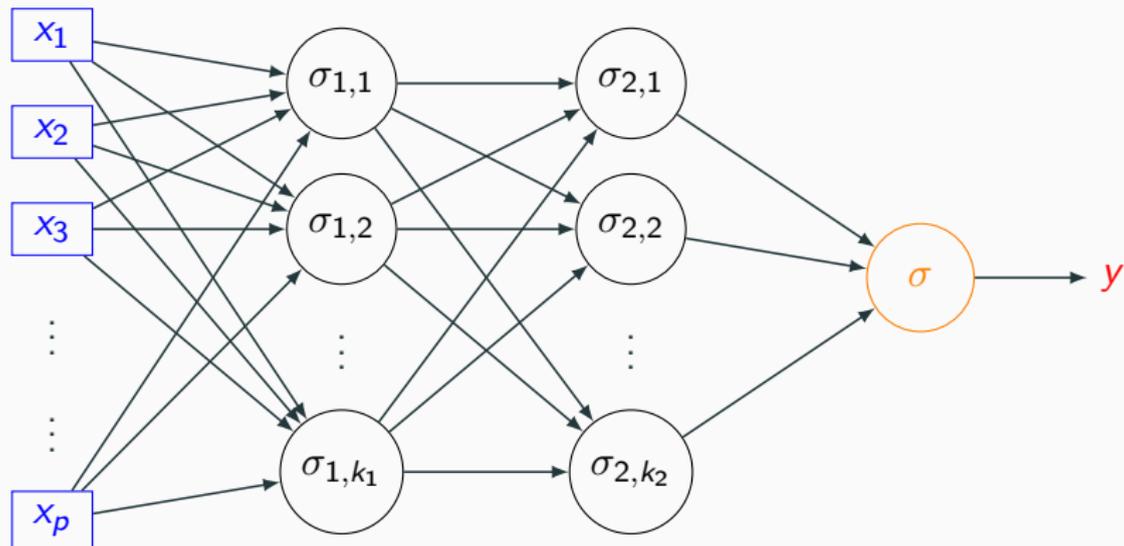
Entrées

C. cachée 1

C. cachée 2

C. Sortie

Sortie



Commentaires

- Les neurones de la première couche (cachée) calculent des combinaisons linéaires des entrées.
- Ces combinaisons linéaires sont ensuite activées par une fonction d'activation, produisant une sortie par neurone.

Commentaires

- Les neurones de la **première couche (cachée)** calculent des **combinaisons linéaires des entrées**.
- Ces combinaisons linéaires sont ensuite **activées par une fonction d'activation**, produisant **une sortie par neurone**.
- Chaque neurone de la **deuxième couche (cachée)** est une combinaison linéaire des **sorties de la couche précédente...**
- **activées par une fonction d'activation**, produisant **une sortie par neurone...**

Commentaires

- Les neurones de la **première couche (cachée)** calculent des **combinaisons linéaires des entrées**.
- Ces combinaisons linéaires sont ensuite **activées par une fonction d'activation**, produisant **une sortie par neurone**.
- Chaque neurone de la **deuxième couche (cachée)** est une combinaison linéaire des **sorties de la couche précédente...**
- **activées par une fonction d'activation**, produisant **une sortie par neurone...**

Remarque

Le nombre de neurones dans la **couche finale** est définie par la **dimension de la sortie y** :

- Régression ou classification binaire \implies 1 neurone.
- Classification multiclasse (K) \implies K (ou $K - 1$) neurones.

- L'ajout de couches cachées dans `keras` est relativement simple.
- Il suffit de définir ces couches au moment de la spécification du modèle.

- L'ajout de couches cachées dans `keras` est relativement simple.
- Il suffit de définir ces couches au moment de la spécification du modèle.
- Par exemple, pour `deux couches cachées` avec 10 et 5 neurones, on utilisera :

```
> model <- keras_model_sequential()
> model %>% layer_dense(units=10,input_shape=c(4),activation="sigmoid") %>%
+   layer_dense(units=5,activation="sigmoid") %>%
+   layer_dense(units=1,activation="sigmoid")
```

```
> summary(model)
## -----
## Layer (type)                Output Shape                Param #
## =====
## dense_1 (Dense)              (None, 10)                  50
## -----
## dense_2 (Dense)              (None, 5)                   55
## -----
## dense_3 (Dense)              (None, 1)                   6
## =====
## Total params: 111
## Trainable params: 111
## Non-trainable params: 0
## -----
```

Arbres binaires

Choix des coupures

Cas de la régression

Cas de la classification supervisée

Elagage

Importance des variables

Réseaux de neurones

Introduction

Le perceptron simple

Perceptron multicouches

Estimation

Choix des paramètres et surapprentissage

Bibliographie

- L'utilisateur doit choisir le nombre de couches, le nombre de neurones par couche, les fonctions d'activation de chaque neurone.

- L'utilisateur doit choisir le nombre de couches, le nombre de neurones par couche, les fonctions d'activation de chaque neurone.
- Une fois ces paramètres choisis, il faut calculer (estimer) tous les vecteurs de poids dans tous les neurones.

- L'utilisateur doit choisir le nombre de couches, le nombre de neurones par couche, les fonctions d'activation de chaque neurone.
- Une fois ces paramètres choisis, il faut calculer (estimer) tous les vecteurs de poids dans tous les neurones.

L'approche

- On désigne par θ l'ensemble des paramètres à estimer $\implies f(x, \theta)$ la règle associée au réseau.
- Minimisation de risque empirique : minimiser

$$\mathcal{R}_n(\theta) = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n \ell(y_i, f(x_i, \theta))$$

où ℓ est une fonction de perte (classique).

Fonctions de perte

- Erreur quadratique (régression) :

$$\ell(y, f(x)) = (y - f(x))^2.$$

- Cross-entropy ou log-vraisemblance négative (classification binaire 0/1) :

$$\ell(y, p(x)) = -(y \log(p(x)) + (1 - y) \log(1 - p(x)))$$

où $p(x) = \mathbf{P}(Y = 1|X = x)$.

- Cross-entropy ou log-vraisemblance négative (classification multi-classes) :

$$\ell(y, p(x)) = - \sum_{k=1}^K \mathbf{1}_{y=k} \log(p_k(x))$$

où $p_k(x) = \mathbf{P}(Y = k|X = x)$.

Descente de gradient

- La solution s'obtient à l'aide de méthodes de type **descente de gradient** :

$$\theta^{\text{new}} = \theta^{\text{old}} - \varepsilon \nabla_{\theta} \mathcal{R}_n(\theta^{\text{old}}).$$

- Le réseau étant **structuré en couches**, la mise à jour des paramètres **n'est pas directe**.

Descente de gradient

- La solution s'obtient à l'aide de méthodes de type **descente de gradient** :

$$\theta^{\text{new}} = \theta^{\text{old}} - \varepsilon \nabla_{\theta} \mathcal{R}_n(\theta^{\text{old}}).$$

- Le réseau étant **structuré en couches**, la mise à jour des paramètres n'est pas directe.

Algorithme de rétropropagation (voir ici)

1. **Etape forward** : calculer tous les poids associés à θ^{old} et stocker toutes les valeurs intermédiaires.
2. **Etape backward** :
 - 2.1 Calculer le gradient dans la couche de sortie.
 - 2.2 En déduire les gradients des couches cachées.

Batch et epoch

- L'algorithme de rétropropagation n'est généralement **pas appliqué sur l'ensemble des données**, mais sur des sous-ensemble de cardinaux m appelés **batch**.
- Cette approche est classique sur les **gros volumes de données** et permet de prendre en compte des **données séquentielles**.

Batch et epoch

- L'algorithme de rétropropagation n'est généralement **pas appliqué sur l'ensemble des données**, mais sur des sous-ensemble de cardinaux m appelés **batch**.
- Cette approche est classique sur les **gros volumes de données** et permet de prendre en compte des **données séquentielles**.
- Pour prendre en compte **toutes les données** sur une étape de la descente de gradient, on va donc appliquer **n/m fois l'algorithme de rétropropagation**.
- Une itération sur l'ensemble des données est appelée **epoch**.

Algorithme de rétropropagation stochastique

Algorithme

Entrées : ε (learning rate), m (taille des batches), nb (nombre d'epochs).

1. Pour $\ell = 1$ à nb
2. Partitionner aléatoire les données en n/m batch de taille $m \implies B_1, \dots, B_{n/m}$
 - 2.1 Pour $j = 1$ à n/m
 - 2.1.1 Calculer les gradients sur le batch j avec l'algorithme de **rétropropagation** : ∇_{θ} .
 - 2.1.2 Mettre à jour les paramètres

$$\theta^{\text{new}} = \theta^{\text{old}} - \varepsilon \nabla_{\theta^{\text{old}}}.$$

Sorties : θ^{new} et $f(x, \theta^{\text{new}})$.

Choix des paramètres

- ϵ (pas de la descente de gradient), généralement petit. Existence de **versions améliorées** de l'algorithme précédent moins sensible à ce paramètre (**RMSProp**, **Adam...**).
- m (taille des batch) : généralement petit (pas trop en fonction du temps de calcul). L'utilisateur peut (doit) faire **plusieurs essais**.
- nb (nombre d'epoch), proche du nombre d'itérations en boosting \implies risque de **surapprentissage** si trop grand.

Choix des paramètres

- ε (pas de la descente de gradient), généralement petit. Existence de **versions améliorées** de l'algorithme précédent moins sensible à ce paramètre (**RMSProp**, **Adam...**).
- m (taille des batch) : généralement petit (pas trop en fonction du temps de calcul). L'utilisateur peut (doit) faire **plusieurs essais**.
- nb (nombre d'epoch), proche du nombre d'itérations en boosting \implies risque de **surapprentissage** si trop grand.

En pratique

Il est courant de visualiser l'évolution de la **fonction de perte** et/ou d'un **critère de performance** en fonction du **nombre d'epoch**.

Un exemple

- On considère un réseau à 2 couches cachées comportant 50 nœuds (2851 paramètres).

```
> model1 <- keras_model_sequential()
> model1 %>% layer_dense(units=50,input_shape=c(4),
+                       activation="sigmoid") %>%
+   layer_dense(units = 50,activation = "sigmoid") %>%
+   layer_dense(units = 1,activation = "sigmoid")
```

- On utilise
 - `crossentropy` comme perte.
 - `Adam` comme algorithme d'optimisation.
 - `accuracy` (taux de bien classés) comme mesure de performance.

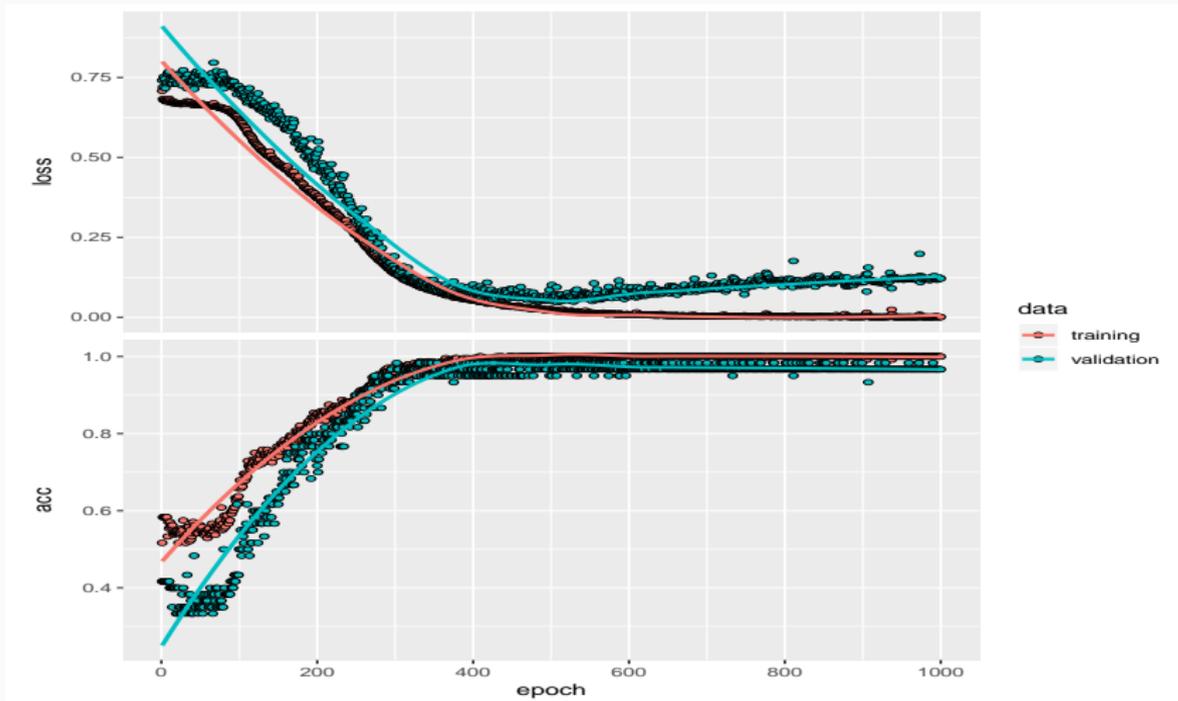
```
> model1 %>% compile(  
+   loss="binary_crossentropy",  
+   optimizer="adam",  
+   metrics="accuracy"  
+ )
```

- On **estime les paramètres** avec $m = 5$ et $nb = 1000$ et utilise 20% des données dans l'échantillon de validation.

```
> history <- model1 %>% fit(  
+   x=Xtrain,  
+   y=Ytrain,  
+   epochs=1000,  
+   batch_size=5,  
+   validation_split=0.2  
+ )
```

Erreur et perte

```
> plot(history)
```



- On compare ce **nouveau réseau** avec le **perceptron simple** construit précédemment.

```
> Xtest <- as.matrix(dtest[,1:4])
> Ytest <- dtest$Y
> model %>% evaluate(Xtest,Ytest)
## $loss
## [1] 0.7259337
##
## $acc
## [1] 0.39
> model1 %>% evaluate(Xtest,Ytest)
## $loss
## [1] 0.3290039
##
## $acc
## [1] 0.935
```

Nombre de couches et de neurones

- A choisir par l'utilisateur.
- Il est généralement mieux d'en avoir trop que pas assez \implies plus "facile" de capter des non linéarités complexes avec beaucoup de couches et de neurones.
- On fait généralement plusieurs essais que l'on compare (avec caret par exemple).
- Voir par exemple l'appli suivante :

<http://playground.tensorflow.org/>

Arbres binaires

Choix des coupures

Cas de la régression

Cas de la classification supervisée

Elagage

Importance des variables

Réseaux de neurones

Introduction

Le perceptron simple

Perceptron multicouches

Estimation

Choix des paramètres et surapprentissage

Bibliographie

Surapprentissage

- Plusieurs paramètres peuvent causer du surapprentissage, notamment les nombres de couches cachées, de neurones et d'epoch.

Surapprentissage

- Plusieurs paramètres peuvent causer du **surapprentissage**, notamment les nombres de **couches cachées**, de **neurones** et **d'epoch**.

Plusieurs solutions

1. **Régularisation** de type ridge/lasso :

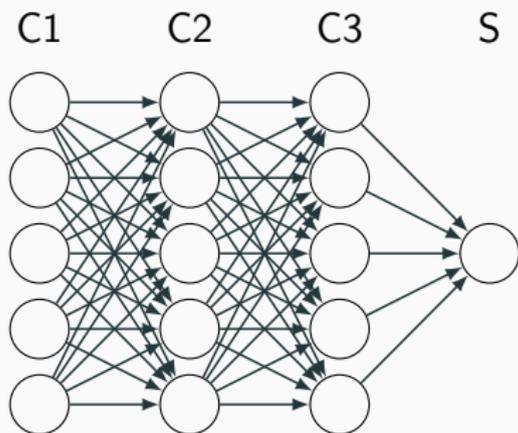
$$\mathcal{R}_n(\theta) = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n \ell(y_i, f(x_i, \theta)) + \lambda \Omega(\theta).$$

⇒ ajouter `kernel_regularizer = regularizer_l2(l = 0.001)` dans la fonction `layer_dense` par exemple.

2. **Early stopping** : on stoppe l'algorithme lorsque l'ajout d'epoch n'améliore pas suffisamment un critère donné.
3. **Dropout** : suppression (aléatoire) de certains neurones dans les couches
⇒ souvent la **solution privilégiée**.

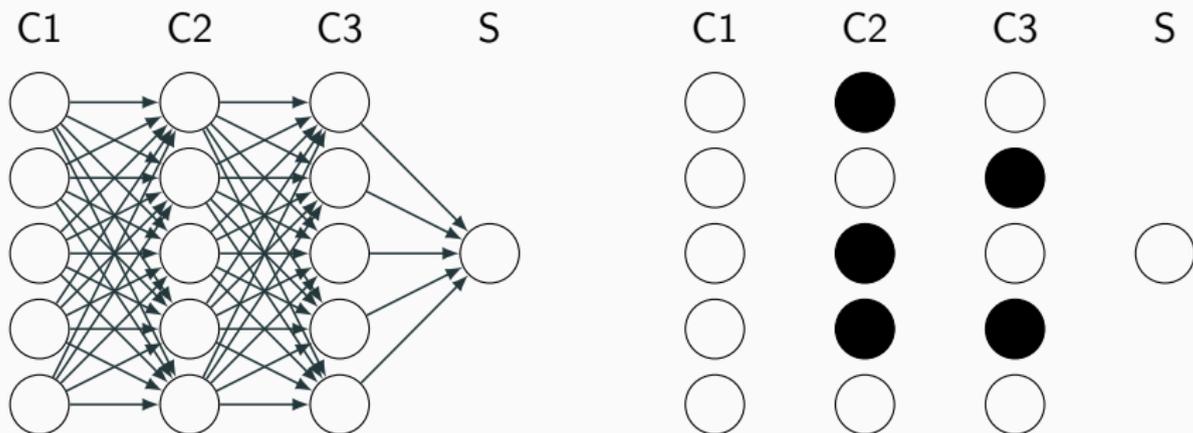
Dropout

- A chaque étape de la phase d'entraînement, on **supprime un nombre de neurones** (selon une Bernoulli de paramètre p).



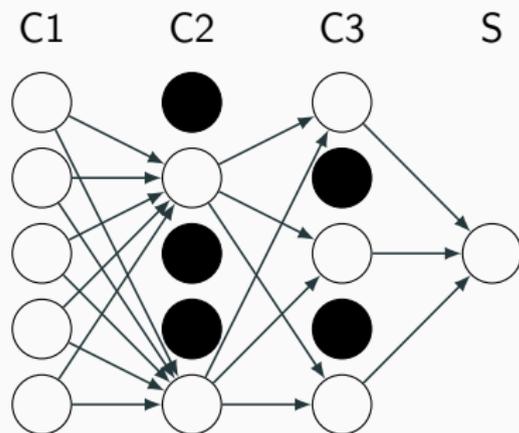
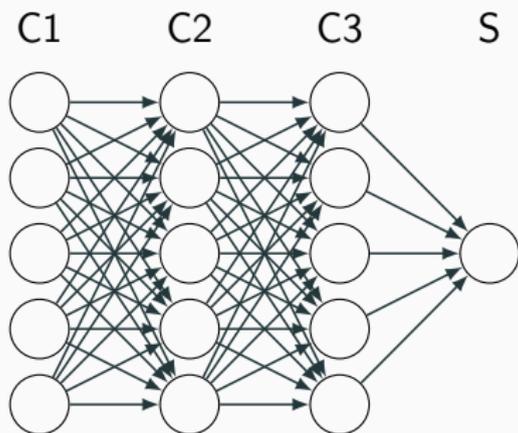
Dropout

- A chaque étape de la phase d'entraînement, on **supprime un nombre de neurones** (selon une Bernoulli de paramètre p).



Dropout

- A chaque étape de la phase d'entraînement, on **supprime un nombre de neurones** (selon une Bernoulli de paramètre p).



- Il suffit d'ajouter `layer_dropout` après les couches cachées.

```
> model3 <- keras_model_sequential()
> model3 %>% layer_dense(units=50,input_shape=c(4),activation="sigmoid") %>%
+   layer_dropout(0.5) %>%
+   layer_dense(units = 50,activation = "sigmoid") %>%
+   layer_dropout(0.5) %>%
+   layer_dense(units = 1,activation = "sigmoid")
```

Sélection avec caret

- On peut sélectionner la plupart des paramètres avec **caret**.
- On propose par exemple, pour un réseau avec une couche cachée, de choisir
 1. le nombre de **neurones dans la couche cachée** parmi 10, 50, 100
 2. la **fonction d'activation** : sigmoïde ou relu.

Sélection avec caret

- On peut sélectionner la plupart des paramètres avec **caret**.
- On propose par exemple, pour un réseau avec une couche cachée, de choisir
 1. le nombre de **neurones dans la couche cachée** parmi 10, 50, 100
 2. la **fonction d'activation** : sigmoïde ou relu.
- On définit d'abord les **paramètres du modèle**

```
> library(caret)
> dapp1 <- dapp
> dapp1$Y <- as.factor(dapp1$Y)
> param_grid <- expand.grid(size=c(10,50,100),
+                           lambda=0, batch_size=5, lr=0.001,
+                           rho=0.9, decay=0,
+                           activation=c("relu", "sigmoid"))
```

- On calcule ensuite les taux de bien classés par validation croisée 5 blocs pour chaque combinaison de paramètres.

```
> caret_mlp <- train(Y~., data=dapp1, method="mlpKerasDecay",  
+                   tuneGrid=param_grid, epoch=500, verbose=0,  
+                   trControl=trainControl(method="cv", number=5))
```

```
> caret_mlp
## Multilayer Perceptron Network with Weight Decay
## 300 samples
## 4 predictor
## 2 classes: '0', '1'
## No pre-processing
## Resampling: Cross-Validated (5 fold)
## Summary of sample sizes: 240, 240, 240, 240, 240
## Resampling results across tuning parameters:
##   size activation Accuracy Kappa
##   10   relu       0.9200000 0.8394122
##   10   sigmoid    0.8966667 0.7913512
##   50   relu       0.9266667 0.8515286
##   50   sigmoid    0.9066667 0.8127427
##   100  relu       0.9366667 0.8722974
##   100  sigmoid    0.9300000 0.8595025
## Tuning parameter 'lambda' was held constant at a value of 0
## Tuning parameter 'rho' was held constant at a value of 0.9
## Tuning parameter 'decay' was held constant at a value of 0
## Accuracy was used to select the optimal model using the largest value.
## The final values used for the model were size = 100, lambda =
## 0, batch_size = 5, lr = 0.001, rho = 0.9, decay = 0 and activation = relu.
```

- **Avantages :**
 - Méthode connue pour être efficace pour (quasiment) tous les problèmes.
 - Plus particulièrement sur des **architectures particulières** : **images**, **données textuelles**.

Conclusion

- **Avantages :**
 - Méthode connue pour être efficace pour (quasiment) tous les problèmes.
 - Plus particulièrement sur des **architectures particulières** : **images**, **données textuelles**.
- **Inconvénients :**
 - Gain **plus discutable** sur des problèmes standards.
 - (Beaucoup) plus **difficile à calibrer** que les autres algorithmes ML.
 - Niveau d'expertise important.

Arbres binaires

Choix des coupures

Cas de la régression

Cas de la classification supervisée

Elagage

Importance des variables

Réseaux de neurones

Introduction

Le perceptron simple

Perceptron multicouches

Estimation

Choix des paramètres et surapprentissage

Bibliographie

-  Breiman, L., Friedman, J., Olshen, R., and Stone, C. (1984).
Classification and regression trees.
Wadsworth & Brooks.
-  McCulloch, W. and Pitts, W. (1943).
A logical calculus of ideas immanent in nervous activity.
Bulletin of Mathematical Biophysics, 5 :115–133.
-  Rosenblatt, F. (1958).
The perceptron : a probabilistic model for information storage and organization in the brain.
Psychological Review, 65 :386–408.

-  Rumelhart, D. E., Hinton, G. E., and R. J. Williams, R. J. (1986).
Learning representations by back-propagating errors.
Nature, pages 533–536.

Quatrième partie IV

Agrégation

Bagging et forêts aléatoires

Bagging

Forêts aléatoires

Algorithme

Choix des paramètres

Erreur OOB et importance des variables

Boosting

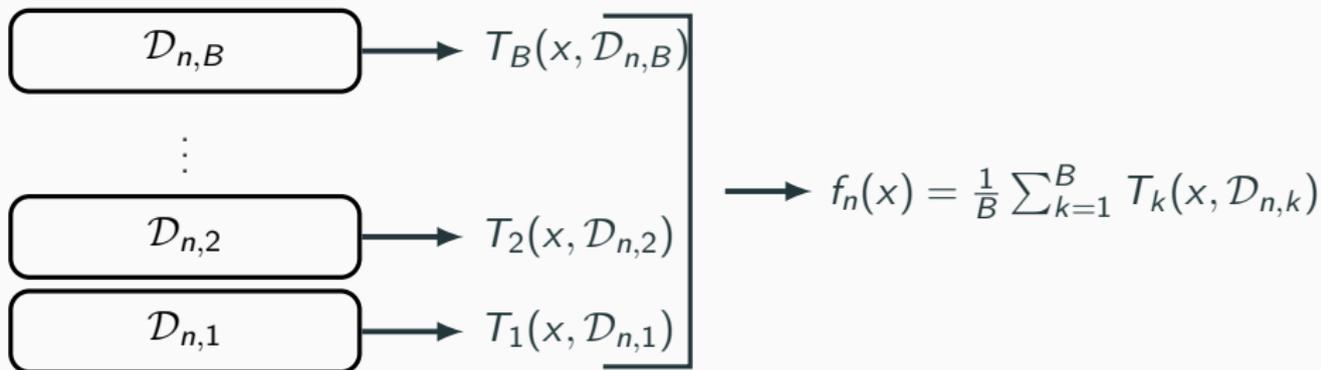
Algorithme de gradient boosting

Choix des paramètres

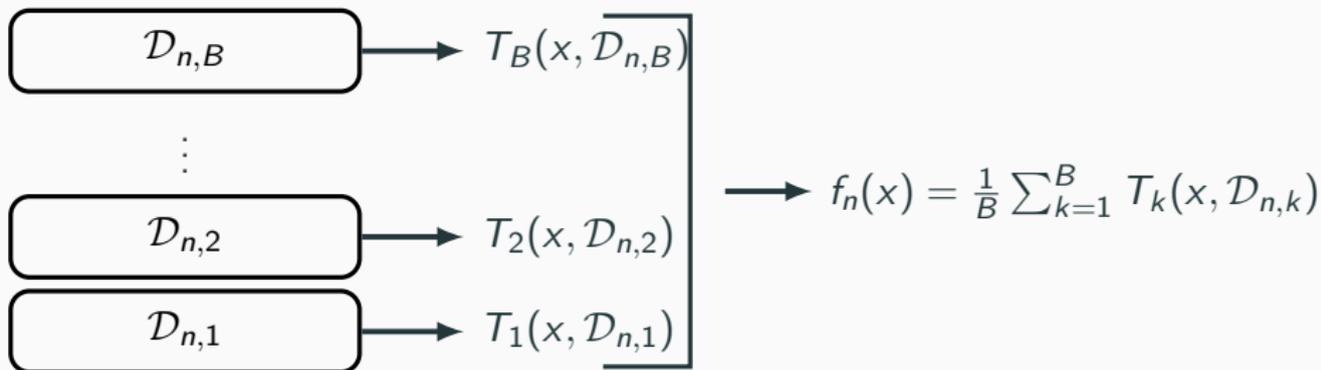
Compléments/conclusion

Bibliographie

- **Idée** : construire un grand nombre d'algorithmes "simples" et les agréger pour obtenir une seule prévision. Par exemple



- **Idée** : construire un grand nombre d'**algorithmes "simples"** et les agréger pour obtenir une seule prévision. Par exemple



Questions

1. Comment choisir les **échantillons** $\mathcal{D}_{n,b}$?
2. Comment choisir les **algorithmes** ?
3. ...

Bagging et forêts aléatoires

Bagging

Forêts aléatoires

- Algorithme

- Choix des paramètres

- Erreur OOB et importance des variables

Boosting

- Algorithme de gradient boosting

- Choix des paramètres

- Compléments/conclusion

Bibliographie

- Idem que précédemment, on cherche à **expliquer** une variable Y par d variables explicatives X_1, \dots, X_d .

- Idem que précédemment, on cherche à **expliquer** une variable Y par d variables explicatives X_1, \dots, X_d .
- Pour simplifier on se place en **régression** : Y est à valeurs dans \mathbb{R} mais tout ce qui va être fait s'étant directement à la **classification binaire ou multiclassés**.

- Idem que précédemment, on cherche à **expliquer** une variable Y par d variables explicatives X_1, \dots, X_d .
- Pour simplifier on se place en **régression** : Y est à valeurs dans \mathbb{R} mais tout ce qui va être fait s'étant directement à la **classification binaire ou multiclassés**.
- **Notations** :
 - (X, Y) un couple aléatoire à valeurs dans $\mathbb{R}^d \times \mathbb{R}$.
 - $\mathcal{D}_n = (X_1, Y_1), \dots, (X_n, Y_n)$ un n -échantillon i.i.d. de même loi que (X, Y) .

- Un algorithme de la forme :

$$f_n(x) = \frac{1}{B} \sum_{b=1}^B T_b(x)$$

- **Hypothèse** : les T_1, \dots, T_b sont **identiquement distribuées**.

- Un algorithme de la forme :

$$f_n(x) = \frac{1}{B} \sum_{b=1}^B T_b(x)$$

- **Hypothèse** : les T_1, \dots, T_b sont **identiquement distribuées**.

Propriété

$$\mathbf{E}[f_n(x)] = \mathbf{E}[T_1(x)] \quad \text{et} \quad \mathbf{V}[f_n(x)] = \rho(x)\mathbf{V}[T_1(x)] + \frac{1 - \rho(x)}{B}\mathbf{V}[T_1(x)]$$

où $\rho(x) = \text{corr}(T_1(x), T_2(x))$.

- Un algorithme de la forme :

$$f_n(x) = \frac{1}{B} \sum_{b=1}^B T_b(x)$$

- **Hypothèse** : les T_1, \dots, T_b sont **identiquement distribuées**.

Propriété

$$\mathbf{E}[f_n(x)] = \mathbf{E}[T_1(x)] \quad \text{et} \quad \mathbf{V}[f_n(x)] = \rho(x)\mathbf{V}[T_1(x)] + \frac{1 - \rho(x)}{B}\mathbf{V}[T_1(x)]$$

où $\rho(x) = \text{corr}(T_1(x), T_2(x))$.

Conséquence

- **Biais** non modifié.
- **Variance** \searrow si $B \nearrow$ et $\rho(x) \searrow$.

- Ajuster le même algorithme sur les mêmes données n'est d'aucun intérêt.

- Ajuster le même algorithme sur les mêmes données n'est d'aucun intérêt.
- Ajuster le même algorithme sur des sous-échantillons disjoints est d'un intérêt limité.

- Ajuster le même algorithme sur les mêmes données n'est d'aucun intérêt.
- Ajuster le même algorithme sur des sous-échantillons disjoints est d'un intérêt limité.
- Utiliser un grand nombre d'algorithmes différents différent est compliqué...

- Ajuster le même algorithme sur les mêmes données n'est d'aucun intérêt.
- Ajuster le même algorithme sur des sous-échantillons disjoints est d'un intérêt limité.
- Utiliser un grand nombre d'algorithmes différents différent est compliqué...

Idée

Ajuster le même algorithme sur des échantillons bootstraps.

Bagging et forêts aléatoires

Bagging

Forêts aléatoires

- Algorithme

- Choix des paramètres

- Erreur OOB et importance des variables

Boosting

- Algorithme de gradient boosting

- Choix des paramètres

- Compléments/conclusion

Bibliographie

- Le **bagging** désigne un ensemble de méthodes introduit par Léo Breiman [[Breiman, 1996](#)].
- **Bagging** : vient de la contraction de **Bootstrap Aggregating**.
- **Idée** : plutôt que de construire un seul estimateur, en construire un grand nombre (sur des échantillons **bootstrap**) et les **agréger**.

Idée : échantillons bootstrap

- Echantillon **initial** :

1	2	3	4	5	6	7	8	9	10
---	---	---	---	---	---	---	---	---	----

Idée : échantillons bootstrap

- Echantillon **initial** :

1	2	3	4	5	6	7	8	9	10
---	---	---	---	---	---	---	---	---	----

- Echantillons **bootstrap** : tirage de taille n avec remise

3	4	6	10	3	9	10	7	7	1	T_1
2	8	6	2	10	10	2	9	5	6	T_2
2	9	4	4	7	7	2	3	6	7	T_3
6	1	3	3	9	3	8	10	10	1	T_4
3	7	10	3	2	8	6	9	10	2	T_5
	\vdots								\vdots	
7	10	3	4	9	10	10	8	6	1	T_B

Idée : échantillons bootstrap

- Echantillon **initial** :

1	2	3	4	5	6	7	8	9	10
---	---	---	---	---	---	---	---	---	----

- Echantillons **bootstrap** : tirage de taille n avec remise

3	4	6	10	3	9	10	7	7	1	T_1
2	8	6	2	10	10	2	9	5	6	T_2
2	9	4	4	7	7	2	3	6	7	T_3
6	1	3	3	9	3	8	10	10	1	T_4
3	7	10	3	2	8	6	9	10	2	T_5
	⋮								⋮	
7	10	3	4	9	10	10	8	6	1	T_B

- A la fin, on **agrège** :

$$f_n(x) = \frac{1}{B} \sum_{b=1}^B T_b(x)$$

Algorithme bagging

Entrées :

- B un entier positif ;
- T un algorithme de prévision.

Pour b entre 1 et B :

1. Faire un tirage aléatoire avec remise de taille n dans $\{1, \dots, n\}$. On note θ_b l'ensemble des indices sélectionnés et $\mathcal{D}_{n,b}^* = \{(x_i, y_i), i \in \theta_b\}$ l'échantillon bootstrap associé.
2. Entraîner l'algorithme T sur $\mathcal{D}_{n,b}^* \implies T(\cdot, \theta_b, \mathcal{D}_n)$.

Retourner : $f_n(x) = \frac{1}{B} \sum_{b=1}^B T(x, \theta_b, \mathcal{D}_n)$.

Un algorithme pas forcément aléatoire

- L'**aléa bootstrap** implique que l'algorithme "change" lorsqu'on l'exécute plusieurs fois mais...

Un algorithme pas forcément aléatoire

- L'**aléa bootstrap** implique que l'algorithme "change" lorsqu'on l'exécute plusieurs fois mais...

$$\lim_{B \rightarrow +\infty} \frac{1}{B} \sum_{b=1}^B T(x, \theta_b, \mathcal{D}_n) = \mathbf{E}_{\theta} [T(x, \theta, \mathcal{D}_n)] = \bar{f}_n(x, \mathcal{D}_n)$$

Un algorithme pas forcément aléatoire

- L'**aléa bootstrap** implique que l'algorithme "change" lorsqu'on l'exécute plusieurs fois mais...

$$\lim_{B \rightarrow +\infty} \frac{1}{B} \sum_{b=1}^B T(x, \theta_b, \mathcal{D}_n) = \mathbf{E}_{\theta} [T(x, \theta, \mathcal{D}_n)] = \bar{f}_n(x, \mathcal{D}_n)$$

Conséquence

- L'algorithme se **stabilise** (converge) lorsque $B \nearrow$.

Un algorithme pas forcément aléatoire

- L'**aléa bootstrap** implique que l'algorithme "change" lorsqu'on l'exécute plusieurs fois mais...

$$\lim_{B \rightarrow +\infty} \frac{1}{B} \sum_{b=1}^B T(x, \theta_b, \mathcal{D}_n) = \mathbf{E}_{\theta} [T(x, \theta, \mathcal{D}_n)] = \bar{f}_n(x, \mathcal{D}_n)$$

Conséquence

- L'algorithme se **stabilise** (converge) lorsque $B \nearrow$.
- Recommandation : choisir B le **plus grand possible**.

$$\mathbf{E}[f_n(x)] = \mathbf{E}[T_1(x)] \quad \text{et} \quad \mathbf{V}[f_n(x)] = \rho(x)\mathbf{V}[T_1(x)] + \frac{1 - \rho(x)}{B}\mathbf{V}[T_1(x)].$$

$$\mathbf{E}[f_n(x)] = \mathbf{E}[T_1(x)] \quad \text{et} \quad \mathbf{V}[f_n(x)] = \rho(x)\mathbf{V}[T_1(x)] + \frac{1 - \rho(x)}{B}\mathbf{V}[T_1(x)].$$

Conclusion

- Bagging ne modifie pas le biais.

$$\mathbf{E}[f_n(x)] = \mathbf{E}[T_1(x)] \quad \text{et} \quad \mathbf{V}[f_n(x)] = \rho(x)\mathbf{V}[T_1(x)] + \frac{1 - \rho(x)}{B}\mathbf{V}[T_1(x)].$$

Conclusion

- Bagging ne modifie pas le biais.
- B grand $\implies \mathbf{V}[f_n(x)] \approx \rho(x)\mathbf{V}[T_1(x)]$

$$\mathbf{E}[f_n(x)] = \mathbf{E}[T_1(x)] \quad \text{et} \quad \mathbf{V}[f_n(x)] = \rho(x)\mathbf{V}[T_1(x)] + \frac{1 - \rho(x)}{B}\mathbf{V}[T_1(x)].$$

Conclusion

- Bagging ne modifie pas le biais.
- B grand $\implies \mathbf{V}[f_n(x)] \approx \rho(x)\mathbf{V}[T_1(x)] \implies$ la variance diminue d'autant plus que la corrélation entre les prédicteurs diminue.

$$\mathbf{E}[f_n(x)] = \mathbf{E}[T_1(x)] \quad \text{et} \quad \mathbf{V}[f_n(x)] = \rho(x)\mathbf{V}[T_1(x)] + \frac{1 - \rho(x)}{B}\mathbf{V}[T_1(x)].$$

Conclusion

- Bagging ne modifie pas le biais.
- B grand $\implies \mathbf{V}[f_n(x)] \approx \rho(x)\mathbf{V}[T_1(x)] \implies$ la variance diminue d'autant plus que la corrélation entre les prédicteurs diminue.
- Il est donc nécessaire d'agréger des estimateurs sensibles à de légères perturbations de l'échantillon.

$$\mathbf{E}[f_n(x)] = \mathbf{E}[T_1(x)] \quad \text{et} \quad \mathbf{V}[f_n(x)] = \rho(x)\mathbf{V}[T_1(x)] + \frac{1 - \rho(x)}{B}\mathbf{V}[T_1(x)].$$

Conclusion

- Bagging ne modifie pas le biais.
- B grand $\implies \mathbf{V}[f_n(x)] \approx \rho(x)\mathbf{V}[T_1(x)] \implies$ la variance diminue d'autant plus que la corrélation entre les prédicteurs diminue.
- Il est donc nécessaire d'agréger des estimateurs sensibles à de légères perturbations de l'échantillon.
- Les arbres sont connus pour posséder de telles propriétés.

Bagging et forêts aléatoires

Bagging

Forêts aléatoires

Algorithme

Choix des paramètres

Erreur OOB et importance des variables

Boosting

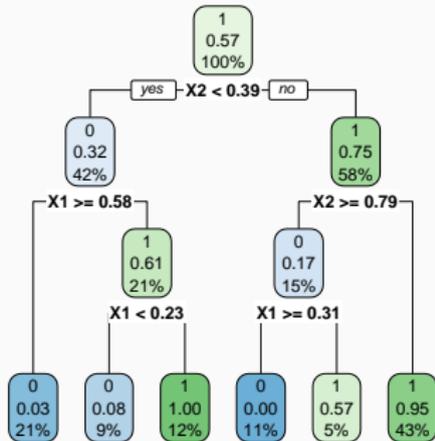
Algorithme de gradient boosting

Choix des paramètres

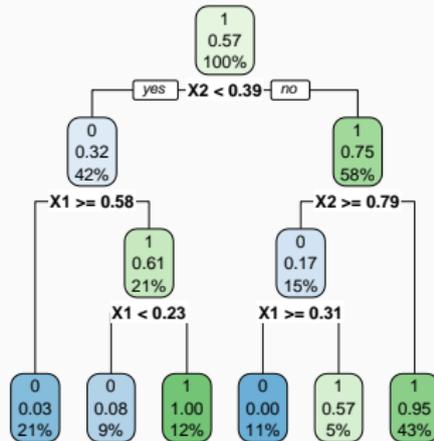
Compléments/conclusion

Bibliographie

Rappels sur les arbres



Rappels sur les arbres



Complexité

Profondeur

- **petite** : biais \nearrow , variance \searrow
- **grande** : biais \searrow , variance \nearrow (sur-apprentissage).

- Comme son nom l'indique, une forêt aléatoire est définie à partir d'un ensemble d'arbres.

- Comme son nom l'indique, une **forêt aléatoire** est définie à partir d'un ensemble d'arbres.

Définition

Soit $T_k(x)$, $k = 1, \dots, B$ des prédicteurs par arbre ($T_k : \mathbb{R}^d \rightarrow \mathbb{R}$). Le prédicteur des **forêts aléatoires** est obtenu par agrégation de cette collection d'arbres :

$$f_n(x) = \frac{1}{B} \sum_{k=1}^B T_k(x).$$

- Forêts aléatoires = collection d'arbres.

Forêts aléatoires

- Forêts aléatoires = collection d'arbres.
- Les forêts aléatoires les plus utilisées sont (de loin) celles proposées par Léo Breiman (au début des années 2000).

Forêts aléatoires

- Forêts aléatoires = collection d'arbres.
- Les forêts aléatoires les plus utilisées sont (de loin) celles proposées par Léo Breiman (au début des années 2000).
- Elles consistent à agréger des arbres construits sur des échantillons bootstrap.

Forêts aléatoires

- Forêts aléatoires = collection d'arbres.
- Les forêts aléatoires les plus utilisées sont (de loin) celles proposées par Léo Breiman (au début des années 2000).
- Elles consistent à agréger des arbres construits sur des échantillons bootstrap.
- On pourra trouver de la doc à l'url <http://www.stat.berkeley.edu/~breiman/RandomForests/> et consulter la thèse de Robin Genuer [Genuer, 2010].

Bagging et forêts aléatoires

Bagging

Forêts aléatoires

Algorithme

Choix des paramètres

Erreur OOB et importance des variables

Boosting

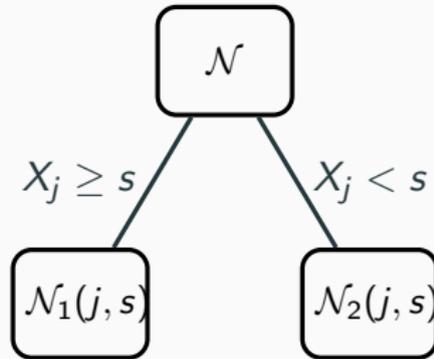
Algorithme de gradient boosting

Choix des paramètres

Compléments/conclusion

Bibliographie

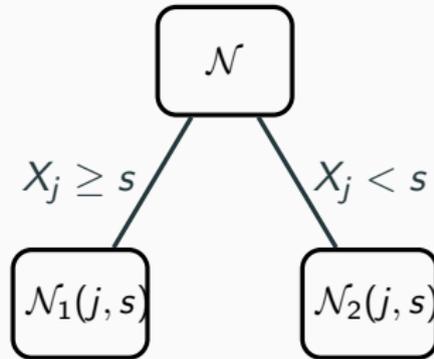
Coupures "aléatoires"



Arbres pour forêt

- Breiman propose de sélectionner la "meilleure" variable dans un ensemble composé **uniquement de m try variables choisies aléatoirement parmi les d variables initiales.**

Coupures "aléatoires"



Arbres pour forêt

- Breiman propose de sélectionner la "meilleure" variable dans un ensemble composé **uniquement de m try variables choisies aléatoirement parmi les d variables initiales.**
- **Objectif** : **diminuer la corrélation** entre les arbres que l'on agrège.

Algorithme forêts aléatoires

Entrées :

- B un entier positif ;
- **mtry** un entier entre 1 et d ;
- **min.node.size** un entier plus petit que n .

Pour b entre 1 et B :

1. Faire un tirage aléatoire avec remise de taille n dans $\{1, \dots, n\}$. On note \mathcal{I}_b l'ensemble des indices sélectionnés et $\mathcal{D}_{n,b}^* = \{(x_i, y_i), i \in \mathcal{I}_b\}$ l'échantillon bootstrap associé.
2. Construire un arbre CART à partir de $\mathcal{D}_{n,b}^*$ en découpant chaque nœud de la façon suivante :
 - 2.1 Choisir **mtry** variables au hasard parmi les d variables explicatives ;
 - 2.2 Sélectionner la meilleure coupure $X_j \leq s$ en ne considérant que les **mtry** variables sélectionnées ;
 - 2.3 Ne pas découper un nœud s'il contient moins de **min.node.size** observations.
3. On note $T(\cdot, \theta_b, \mathcal{D}_n)$ l'arbre obtenu.

Retourner : $f_n(x) = \frac{1}{B} \sum_{b=1}^B T(x, \theta_b, \mathcal{D}_n)$.

Type de prévision

La prévision dépend de la **nature de Y** et de ce que l'on souhaite **estimer**

- **Régression** : $T(x, \theta_b, \mathcal{D}_n) \in \mathbb{R}$ et

$$m_n(x) = \frac{1}{B} \sum_{b=1}^B T(x, \theta_b, \mathcal{D}_n).$$

Type de prévision

La prévision dépend de la **nature de Y** et de ce que l'on souhaite **estimer**

- **Régression** : $T(x, \theta_b, \mathcal{D}_n) \in \mathbb{R}$ et

$$m_n(x) = \frac{1}{B} \sum_{b=1}^B T(x, \theta_b, \mathcal{D}_n).$$

- **Classification** (classe) : $T(x, \theta_b, \mathcal{D}_n) \in \{1, \dots, K\}$ et

$$g_n(x) \in \operatorname{argmax}_{k \in \{1, \dots, K\}} \sum_{b=1}^B \mathbf{1}_{T(x, \theta_b, \mathcal{D}_n)=k}, \quad k = 1, \dots, K.$$

Type de prévision

La prévision dépend de la **nature de Y** et de ce que l'on souhaite **estimer**

- **Régression** : $T(x, \theta_b, \mathcal{D}_n) \in \mathbb{R}$ et

$$m_n(x) = \frac{1}{B} \sum_{b=1}^B T(x, \theta_b, \mathcal{D}_n).$$

- **Classification** (classe) : $T(x, \theta_b, \mathcal{D}_n) \in \{1, \dots, K\}$ et

$$g_n(x) \in \operatorname{argmax}_{k \in \{1, \dots, K\}} \sum_{b=1}^B \mathbf{1}_{T(x, \theta_b, \mathcal{D}_n)=k}, \quad k = 1, \dots, K.$$

- **Classification** (proba) : $T_k(x, \theta_b, \mathcal{D}_n) \in [0, 1]$ et

$$S_{n,k}(x) = \frac{1}{B} \sum_{b=1}^B T_k(x, \theta_b, \mathcal{D}_n), \quad k = 1, \dots, K.$$

- Notamment 2 packages avec à peu près la même syntaxe.
- **randomforest** : le plus ancien et probablement encore le plus utilisé.
- **ranger** [Wright and Ziegler, 2017] : plus efficace au niveau **temps de calcul** (codé en C++).

```
> library(ranger)
> set.seed(12345)
> foret <- ranger(type~.,data=spam)
> foret
## ranger(type ~ ., data = spam)
## Type: Classification
## Number of trees: 500
## Sample size: 4601
## Number of independent variables: 57
## Mtry: 7
## Target node size: 1
## Variable importance mode: none
## Splitrule: gini
## OOB prediction error: 4.59 %
```

Bagging et forêts aléatoires

Bagging

Forêts aléatoires

- Algorithme

- Choix des paramètres

- Erreur OOB et importance des variables

Boosting

- Algorithme de gradient boosting

- Choix des paramètres

- Compléments/conclusion

Bibliographie

- B réglé \implies le plus grand possible.

En pratique on pourra s'assurer que le **courbe d'erreur** en fonction du nombre d'arbres est **stabilisée**.

- B réglé \implies le plus grand possible.

En pratique on pourra s'assurer que la **courbe d'erreur** en fonction du nombre d'arbres est **stabilisée**.

- Pour les autres paramètres on étudie à nouveau :

$$\mathbf{E}[f_n(x)] = \mathbf{E}[T_1(x)] \quad \text{et} \quad \mathbf{V}[f_n(x)] = \rho(x)\mathbf{V}[T_1(x)] + \frac{1 - \rho(x)}{B}\mathbf{V}[T_1(x)].$$

Conséquence

- Le biais n'étant pas amélioré par "l'agrégation bagging", il est recommandé d'agréger des estimateurs qui possèdent un **biais faible** (**contrairement au boosting**).

- B réglé \implies le plus grand possible.

En pratique on pourra s'assurer que le **courbe d'erreur** en fonction du nombre d'arbres est **stabilisée**.

- Pour les autres paramètres on étudie à nouveau :

$$\mathbf{E}[f_n(x)] = \mathbf{E}[T_1(x)] \quad \text{et} \quad \mathbf{V}[f_n(x)] = \rho(x)\mathbf{V}[T_1(x)] + \frac{1 - \rho(x)}{B}\mathbf{V}[T_1(x)].$$

Conséquence

- Le biais n'étant pas amélioré par "l'agrégation bagging", il est recommandé d'agréger des estimateurs qui possèdent un **biais faible** (**contrairement au boosting**).
- Arbres "**profonds**", **peu d'observations dans les nœuds terminaux**.

- B réglé \implies le plus grand possible.

En pratique on pourra s'assurer que la **courbe d'erreur** en fonction du nombre d'arbres est **stabilisée**.

- Pour les autres paramètres on étudie à nouveau :

$$\mathbf{E}[f_n(x)] = \mathbf{E}[T_1(x)] \quad \text{et} \quad \mathbf{V}[f_n(x)] = \rho(x)\mathbf{V}[T_1(x)] + \frac{1 - \rho(x)}{B}\mathbf{V}[T_1(x)].$$

Conséquence

- Le biais n'étant pas amélioré par "l'agrégation bagging", il est recommandé d'agréger des estimateurs qui possèdent un **biais faible** (**contrairement au boosting**).
- Arbres "**profonds**", **peu d'observations dans les nœuds terminaux**.
- Par défaut dans **randomForest**, ***min.node.size*** = 5 en régression et 1 en classification.

- Il est en relation avec la corrélation entre les arbres $\rho(x)$.

Choix de m try

- Il est en relation avec la corrélation entre les arbres $\rho(x)$.
- Ce paramètre a une influence sur le compromis biais/variance de la forêt.

Choix de *mtry*

- Il est en relation avec la corrélation entre les arbres $\rho(x)$.
- Ce paramètre a une influence sur le compromis biais/variance de la forêt.
- *mtry* ↘

Choix de *mtry*

- Il est en relation avec la corrélation entre les arbres $\rho(x)$.
- Ce paramètre a une influence sur le compromis biais/variance de la forêt.
- *mtry* ↘
 1. tendance à se rapprocher d'un choix "aléatoire" des variables de découpe des arbres

Choix de *mtry*

- Il est en relation avec la corrélation entre les arbres $\rho(x)$.
- Ce paramètre a une influence sur le compromis biais/variance de la forêt.
- *mtry* ↘
 1. tendance à se rapprocher d'un choix "aléatoire" des variables de découpe des arbres \implies les arbres sont de plus en plus différents

Choix de $mtry$

- Il est en relation avec la corrélation entre les arbres $\rho(x)$.
- Ce paramètre a une influence sur le compromis biais/variance de la forêt.
- $mtry \searrow$
 1. tendance à se rapprocher d'un choix "aléatoire" des variables de découpe des arbres \implies les arbres sont de plus en plus différents $\implies \rho(x) \searrow \implies$ la variance de la forêt diminue.

Choix de $mtry$

- Il est en relation avec la corrélation entre les arbres $\rho(x)$.
- Ce paramètre a une influence sur le compromis biais/variance de la forêt.
- $mtry \searrow$
 1. tendance à se rapprocher d'un choix "aléatoire" des variables de découpe des arbres \implies les arbres sont de plus en plus différents $\implies \rho(x) \searrow \implies$ la variance de la forêt diminue.
 2. mais... le biais des arbres \nearrow

Choix de $mtry$

- Il est en relation avec la corrélation entre les arbres $\rho(x)$.
- Ce paramètre a une influence sur le compromis biais/variance de la forêt.
- $mtry \searrow$
 1. tendance à se rapprocher d'un choix "aléatoire" des variables de découpe des arbres \implies les arbres sont de plus en plus différents $\implies \rho(x) \searrow \implies$ la variance de la forêt diminue.
 2. mais... le biais des arbres $\nearrow \implies$ le biais de la forêt \nearrow .

Choix de $mtry$

- Il est en relation avec la corrélation entre les arbres $\rho(x)$.
- Ce paramètre a une influence sur le compromis biais/variance de la forêt.
- $mtry \searrow$
 1. tendance à se rapprocher d'un choix "aléatoire" des variables de découpe des arbres \implies les arbres sont de plus en plus différents $\implies \rho(x) \searrow \implies$ la variance de la forêt diminue.
 2. mais... le biais des arbres $\nearrow \implies$ le biais de la forêt \nearrow .
- Inversement lorsque $mtry \nearrow$ (risque de sur-ajustement).

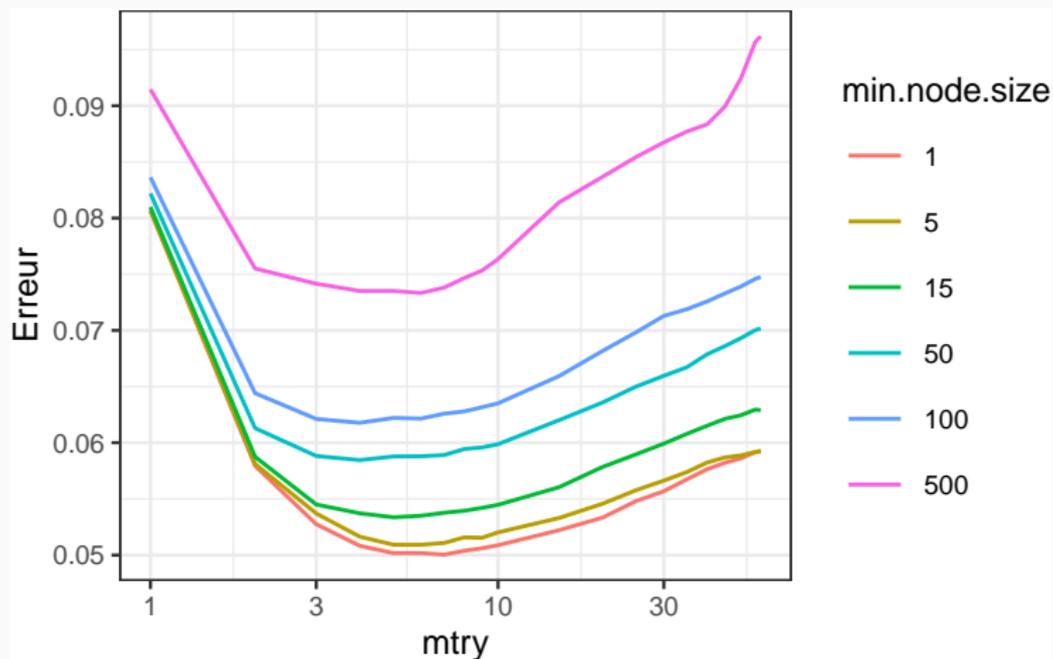
Choix de $mtry$

- Il est en relation avec la corrélation entre les arbres $\rho(x)$.
- Ce paramètre a une influence sur le compromis biais/variance de la forêt.
- $mtry \searrow$
 1. tendance à se rapprocher d'un choix "aléatoire" des variables de découpe des arbres \implies les arbres sont de plus en plus différents $\implies \rho(x) \searrow \implies$ la variance de la forêt diminue.
 2. mais... le biais des arbres $\nearrow \implies$ le biais de la forêt \nearrow .
- Inversement lorsque $mtry \nearrow$ (risque de sur-ajustement).

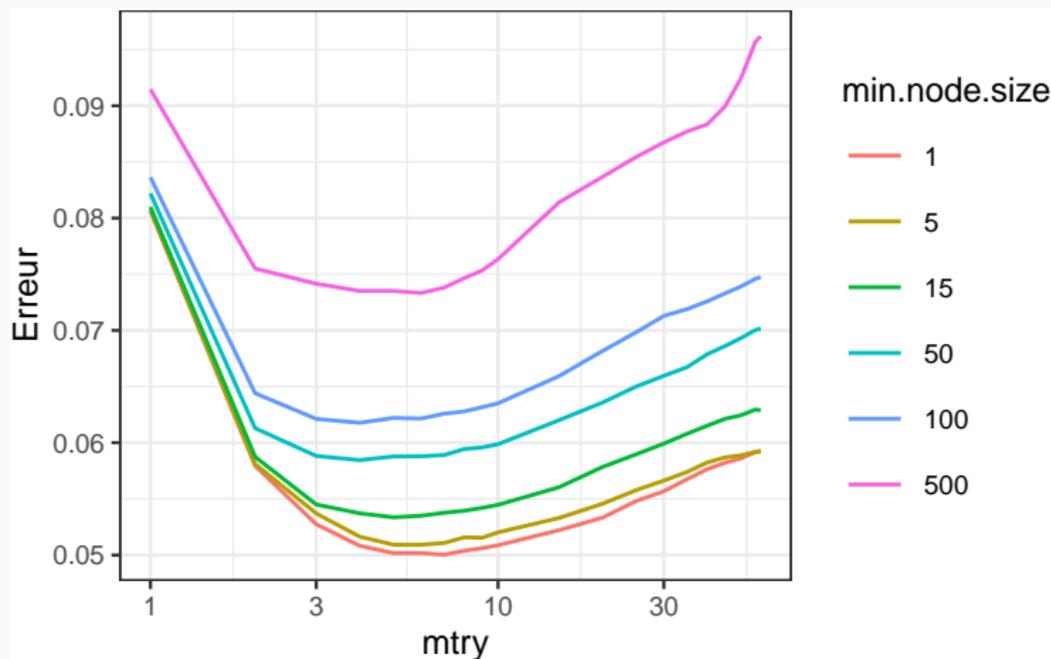
Conclusion

- Il est recommandé de comparer les performances de la forêt pour plusieurs valeurs de $mtry$.
- Par défaut $mtry = d/3$ en régression et \sqrt{d} en classification.

- Visualisation d'erreur en fonction de **min.node.size** et **mtry**



- Visualisation d'erreur en fonction de **min.node.size** et **mtry**



Commentaires

min.node.size petit et **mtry** à calibrer.

- On peut bien entendu **calibrer ces paramètres** avec les approches traditionnelles mais...

- On peut bien entendu **calibrer ces paramètres** avec les approches traditionnelles mais...
- les valeurs par défaut sont souvent performantes !

- On peut bien entendu **calibrer ces paramètres** avec les approches traditionnelles mais...
- les valeurs par défaut sont souvent performantes !
- On pourra quand même faire quelques essais, notamment pour **mtry**.

Un exemple avec tidymodels

1. Initialisation du workflow :

```
> tune_spec <- rand_forest(mtry = tune(),min_n= tune()) %>%  
+   set_engine("ranger") %>%  
+   set_mode("classification")  
> rf_wf <- workflow() %>% add_model(tune_spec) %>% add_formula(type ~ .)
```

2. Ré-échantillonnage et grille de paramètres :

```
> blocs <- vfold_cv(spam, v = 10,repeats = 5)  
> rf_grid <- expand_grid(mtry=c(seq(1,55,by=5),57),  
+                       min_n=c(1,5,15,50,100,500))
```

3. Calcul des erreurs :

```
> rf_res <- rf_wf %>% tune_grid(resamples = blocs, grid = rf_grid)
```

4. Visualisation des résultats (AUC et accuracy) :

```
> rf_res %>% show_best("roc_auc") %>% select(-8)
```

```
## # A tibble: 5 x 7
```

##	mtry	min_n	.metric	.estimator	mean	n	std_err
##	<dbl>	<dbl>	<chr>	<chr>	<dbl>	<int>	<dbl>
## 1	4	1	roc_auc	binary	0.988	50	0.000614
## 2	5	1	roc_auc	binary	0.988	50	0.000623
## 3	6	1	roc_auc	binary	0.988	50	0.000617
## 4	5	5	roc_auc	binary	0.988	50	0.000621
## 5	7	1	roc_auc	binary	0.988	50	0.000645

```
> rf_res %>% show_best("accuracy") %>% select(-8)
```

```
## # A tibble: 5 x 7
```

##	mtry	min_n	.metric	.estimator	mean	n	std_err
##	<dbl>	<dbl>	<chr>	<chr>	<dbl>	<int>	<dbl>
## 1	4	1	accuracy	binary	0.954	50	0.00159
## 2	6	1	accuracy	binary	0.954	50	0.00141
## 3	7	1	accuracy	binary	0.954	50	0.00149
## 4	5	1	accuracy	binary	0.954	50	0.00153
## 5	8	1	accuracy	binary	0.953	50	0.00146

Remarque

On retrouve bien `min.node.size` petit et `mtry` proche de la valeur par défaut (7).

Remarque

On retrouve bien `min.node.size` petit et `mtry` proche de la valeur par défaut (7).

5. Ajustement de l'algorithme final :

```
> foret_finale <- rf_wf %>%  
+   finalize_workflow(list(mtry=7,min_n=1)) %>%  
+   fit(data=spam)
```

Bagging et forêts aléatoires

Bagging

Forêts aléatoires

- Algorithme

- Choix des paramètres

- Erreur OOB et importance des variables

Boosting

- Algorithme de gradient boosting

- Choix des paramètres

- Compléments/conclusion

Bibliographie

- Comme pour tous les algorithmes de prévision on peut évaluer la performance des forêts aléatoires en estimant un risque par ré-échantillonnage.

- Comme pour tous les algorithmes de prévision on peut évaluer la performance des forêts aléatoires en estimant un risque par ré-échantillonnage.
- Les tirages bootstraps permettent de définir une alternative, souvent moins couteuse en temps de calcul, au ré-échantillonnage.

- Comme pour tous les algorithmes de prévision on peut évaluer la performance des forêts aléatoires en estimant un risque par ré-échantillonnage.
- Les tirages bootstraps permettent de définir une alternative, souvent moins couteuse en temps de calcul, au ré-échantillonnage.
- Idée/astuce : utiliser les observations non sélectionnées dans les échantillons bootstraps pour estimer le risque.

OOB illustration

3	4	6	10	3	9	10	7	7	1	T_1
2	8	6	2	10	10	2	9	5	6	T_2
2	9	4	4	7	7	2	3	6	7	T_3
6	1	3	3	9	3	8	10	10	1	T_4
3	7	10	3	2	8	6	9	10	2	T_5
7	10	3	4	9	10	10	8	6	1	T_6

OOB illustration

3	4	6	10	3	9	10	7	7	1	T_1
2	8	6	2	10	10	2	9	5	6	T_2
2	9	4	4	7	7	2	3	6	7	T_3
6	1	3	3	9	3	8	10	10	1	T_4
3	7	10	3	2	8	6	9	10	2	T_5
7	10	3	4	9	10	10	8	6	1	T_6

- Les échantillons 2, 3 et 5 ne contiennent pas la première observation, donc

$$\hat{y}_1 = \frac{1}{3}(T_2(x_1) + T_3(x_1) + T_5(x_1)).$$

- On fait de même pour toutes les observations $\implies \hat{y}_2, \dots, \hat{y}_n$.

OOB illustration

3	4	6	10	3	9	10	7	7	1	T_1
2	8	6	2	10	10	2	9	5	6	T_2
2	9	4	4	7	7	2	3	6	7	T_3
6	1	3	3	9	3	8	10	10	1	T_4
3	7	10	3	2	8	6	9	10	2	T_5
7	10	3	4	9	10	10	8	6	1	T_6

- Les échantillons 2, 3 et 5 **ne contiennent pas** la première observation, donc

$$\hat{y}_1 = \frac{1}{3}(T_2(x_1) + T_3(x_1) + T_5(x_1)).$$

- On fait de même pour **toutes les observations** $\implies \hat{y}_2, \dots, \hat{y}_n$.
- On **calcule l'erreur** selon

$$\frac{1}{n} \sum_{i=1}^n (\hat{y}_i - y_i)^2 \quad \text{ou} \quad \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n \mathbf{1}_{\hat{y}_i \neq y_i}.$$

OOB définition

- Pour $i = 1, \dots, n$ on note

$$\text{OOB}(i) = \{b \leq B : i \notin \mathcal{I}_b\}$$

l'ensemble des tirages bootstrap qui **ne contiennent pas** i et

$$f_{n,\text{OOB}(i)}(x_i) = \frac{1}{|\text{OOB}(i)|} \sum_{b \in \text{OOB}(i)} T(x_i, \theta_b, \mathcal{D}_n)$$

la prévision de la forêt en ne considérant **que les arbres pour lesquels** i **n'est pas dans le tirage bootstrap.**

OOB définition

- Pour $i = 1, \dots, n$ on note

$$\text{OOB}(i) = \{b \leq B : i \notin \mathcal{I}_b\}$$

l'ensemble des tirages bootstrap qui **ne contiennent pas** i et

$$f_{n,\text{OOB}(i)}(x_i) = \frac{1}{|\text{OOB}(i)|} \sum_{b \in \text{OOB}(i)} T(x_i, \theta_b, \mathcal{D}_n)$$

la prévision de la forêt en ne considérant **que les arbres pour lesquels i n'est pas dans le tirage bootstrap**.

- L'**erreur OOB** s'obtient en confrontant ces prévisions aux valeurs observées, par exemple

$$\frac{1}{n} \sum_{i=1}^n (y_i - f_{n,\text{OOB}(i)}(x_i))^2 \quad \text{ou} \quad \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n \mathbf{1}_{f_{n,\text{OOB}(i)}(x_i) \neq y_i}$$

OOB définition

- Pour $i = 1, \dots, n$ on note

$$\text{OOB}(i) = \{b \leq B : i \notin \mathcal{I}_b\}$$

l'ensemble des tirages bootstrap qui **ne contiennent pas** i et

$$f_{n,\text{OOB}(i)}(x_i) = \frac{1}{|\text{OOB}(i)|} \sum_{b \in \text{OOB}(i)} T(x_i, \theta_b, \mathcal{D}_n)$$

la prévision de la forêt en ne considérant **que les arbres pour lesquels i n'est pas dans le tirage bootstrap**.

- L'**erreur OOB** s'obtient en confrontant ces prévisions aux valeurs observées, par exemple

$$\frac{1}{n} \sum_{i=1}^n (y_i - f_{n,\text{OOB}(i)}(x_i))^2 \quad \text{ou} \quad \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n \mathbf{1}_{f_{n,\text{OOB}(i)}(x_i) \neq y_i}$$

⇒ erreur renvoyée par défaut dans **ranger** et **randomforest**.

Importance des variables

Deux mesures sont généralement utilisées.

- **Score d'impureté** : simplement la moyenne des importances de X_j dans chaque arbre de la forêt :

$$\mathcal{I}_j^{\text{imp}} = \frac{1}{B} \sum_{b=1}^B \mathcal{I}_j(T_b),$$

voir chapitre sur les arbres pour la définition de $\mathcal{I}_j(T_b)$.

Importance des variables

Deux mesures sont généralement utilisées.

- **Score d'impureté** : simplement la moyenne des importances de X_j dans chaque arbre de la forêt :

$$\mathcal{I}_j^{\text{imp}} = \frac{1}{B} \sum_{b=1}^B \mathcal{I}_j(T_b),$$

voir chapitre sur les arbres pour la définition de $\mathcal{I}_j(T_b)$.

- **Importance par permutation** : comparer les erreurs de chaque arbre sur l'échantillon
 1. OOB de l'arbre ;
 2. OOB en permutant les valeurs de la variables j .

⇒ **Idée** : Si X_j est importante ces erreurs doivent être très différentes.

Importance par permutation

- On présente ce score en régression mais rien ne change pour la classification.
- On note

$$\text{Err}(\text{OOB}_b) = \frac{1}{|\text{OOB}_b|} \sum_{i \in \text{OOB}_b} (y_i - T(x_i, \theta_b, \mathcal{D}_n))^2,$$

avec

$$\text{OOB}_b = \{i \leq n : i \notin \mathcal{I}_b\}.$$

⇒ Erreur de l'arbre b calculée sur les données OOB.

Importance par permutation

- On présente ce score en régression mais rien ne change pour la classification.
- On note

$$\text{Err}(\text{OOB}_b) = \frac{1}{|\text{OOB}_b|} \sum_{i \in \text{OOB}_b} (y_i - T(x_i, \theta_b, \mathcal{D}_n))^2,$$

avec

$$\text{OOB}_b = \{i \leq n : i \notin \mathcal{I}_b\}.$$

\implies Erreur de l'arbre b calculée sur les données OOB.

- On recalcule cette erreur mais sur OOB_b où on permute les valeurs de la j^{e} colonne.

$$\begin{bmatrix} x_{11} & \dots & x_{1j} & \dots & x_{1d} \\ x_{21} & \dots & x_{2j} & \dots & x_{2d} \\ x_{51} & \dots & x_{3j} & \dots & x_{3d} \\ x_{41} & \dots & x_{4j} & \dots & x_{4d} \\ x_{51} & \dots & x_{5j} & \dots & x_{5d} \end{bmatrix} \implies \begin{bmatrix} x_{11} & \dots & x_{3j} & \dots & x_{1d} \\ x_{21} & \dots & x_{5j} & \dots & x_{2d} \\ x_{51} & \dots & x_{1j} & \dots & x_{3d} \\ x_{41} & \dots & x_{2j} & \dots & x_{4d} \\ x_{51} & \dots & x_{4j} & \dots & x_{5d} \end{bmatrix}$$

- On note \tilde{x}_i^j les individus de l'échantillon OOB_b permuté et on calcule

$$\text{Err}(\text{OOB}_b^j) = \frac{1}{|\text{OOB}_b|} \sum_{i \in \text{OOB}_b} (y_i - T(\tilde{x}_i^j, \theta_b, \mathcal{D}_n))^2.$$

$$\begin{bmatrix} x_{11} & \dots & x_{1j} & \dots & x_{1d} \\ x_{21} & \dots & x_{2j} & \dots & x_{2d} \\ x_{51} & \dots & x_{3j} & \dots & x_{3d} \\ x_{41} & \dots & x_{4j} & \dots & x_{4d} \\ x_{51} & \dots & x_{5j} & \dots & x_{5d} \end{bmatrix} \Rightarrow \begin{bmatrix} x_{11} & \dots & x_{3j} & \dots & x_{1d} \\ x_{21} & \dots & x_{5j} & \dots & x_{2d} \\ x_{51} & \dots & x_{1j} & \dots & x_{3d} \\ x_{41} & \dots & x_{2j} & \dots & x_{4d} \\ x_{51} & \dots & x_{4j} & \dots & x_{5d} \end{bmatrix}$$

- On note \tilde{x}_i^j les individus de l'échantillon OOB_b permuté et on calcule

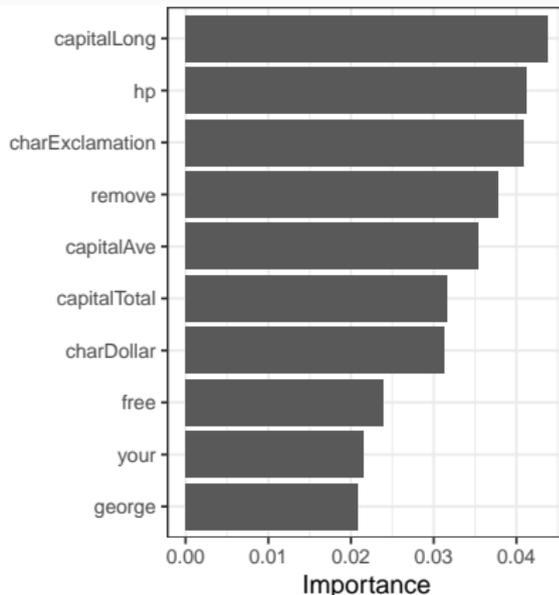
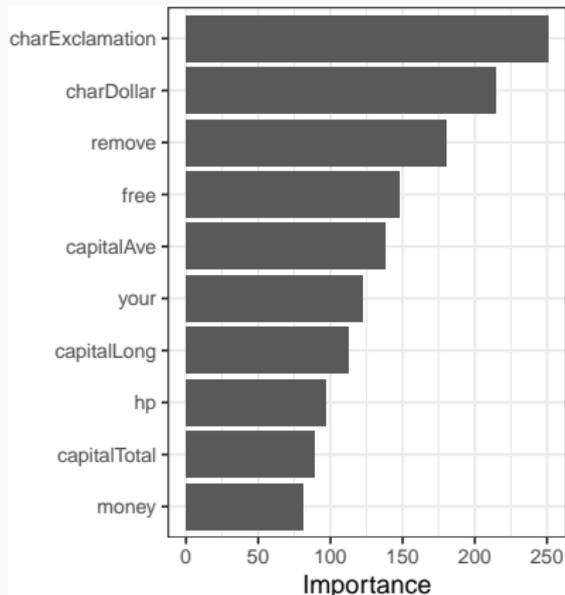
$$\text{Err}(\text{OOB}_b^j) = \frac{1}{|\text{OOB}_b|} \sum_{i \in \text{OOB}_b} (y_i - T(\tilde{x}_i^j, \theta_b, \mathcal{D}_n))^2.$$

Importance par permutation

$$\mathcal{I}_j^{\text{perm}} = \frac{1}{B} \sum_{b=1}^B (\text{Err}(\text{OOB}_b^j) - \text{Err}(\text{OOB}_b)).$$

- On peut **calculer et visualiser** facilement ces importances avec **ranger** :

```
> set.seed(1234)
> foret.imp <- ranger(type~.,data=spam,importance="impurity")
> foret.perm <- ranger(type~.,data=spam,importance="permutation")
> vip(foret.imp);vip(foret.perm)
```



Beaucoup d'avantages

- Bonnes performances prédictives \implies souvent parmi les algorithmes de tête dans les compétitions [[Fernández-Delgado et al., 2014](#)].
- Facile à calibrer.

Conclusion

Beaucoup d'avantages

- Bonnes performances prédictives \implies souvent parmi les algorithmes de tête dans les compétitions [[Fernández-Delgado et al., 2014](#)].
- Facile à calibrer.

Assez peu d'inconvénients

Coté boîte noire (mais guère plus que les autres méthodes...)

Bagging et forêts aléatoires

Bagging

Forêts aléatoires

Algorithme

Choix des paramètres

Erreur OOB et importance des variables

Boosting

Algorithme de gradient boosting

Choix des paramètres

Compléments/conclusion

Bibliographie

- Le terme **Boosting** s'applique à des méthodes générales permettant de produire des décisions précises à partir de **règles faibles** (weaklearner).

- Le terme **Boosting** s'applique à des méthodes générales permettant de produire des décisions précises à partir de **règles faibles** (weaklearner).
- Historiquement, le **premier** algorithme boosting est **adaboost** [Freund and Schapire, 1996].
- Beaucoup de travaux ont par la suite été développés pour **comprendre et généraliser** ces algorithmes (voir [Hastie et al., 2009]) :
 - modèle additif
 - **descente de gradient** \implies gradient boosting machine, extreme gradient boosting (Xgboost).
 - ...

- Le terme **Boosting** s'applique à des méthodes générales permettant de produire des décisions précises à partir de **règles faibles** (weaklearner).
- Historiquement, le **premier** algorithme boosting est **adaboost** [Freund and Schapire, 1996].
- Beaucoup de travaux ont par la suite été développés pour **comprendre et généraliser** ces algorithmes (voir [Hastie et al., 2009]) :
 - modèle additif
 - **descente de gradient** \implies gradient boosting machine, extreme gradient boosting (Xgboost).
 - ...
- Dans cette partie \implies descente de gradient.

- Machine learning \implies objectifs prédictifs \implies minimisation de risque.

- **Machine learning** \implies objectifs **prédictifs** \implies minimisation de risque.
- **Risque** d'une fonction de prévision $f : \mathbb{R}^d \rightarrow \mathbb{R}$:

$$\mathcal{R}(f) = \mathbf{E}[\ell(Y, f(X))].$$

- **Machine learning** \implies objectifs **prédictifs** \implies minimisation de risque.
- **Risque** d'une fonction de prévision $f : \mathbb{R}^d \rightarrow \mathbb{R}$:

$$\mathcal{R}(f) = \mathbf{E}[\ell(Y, f(X))].$$

- $\mathcal{R}(f)$ inconnu \implies version empirique

$$\mathcal{R}_n(f) = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n \ell(y_i, f(x_i)).$$

- **Machine learning** \implies objectifs **prédictifs** \implies minimisation de risque.
- **Risque** d'une fonction de prévision $f : \mathbb{R}^d \rightarrow \mathbb{R}$:

$$\mathcal{R}(f) = \mathbf{E}[\ell(Y, f(X))].$$

- $\mathcal{R}(f)$ inconnu \implies version empirique

$$\mathcal{R}_n(f) = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n \ell(y_i, f(x_i)).$$

Idée

Minimiser $\mathcal{R}_n(f)$ sur une classe d'algorithmes \mathcal{F} .

Choix de \mathcal{F}

- Il est bien entendu **crucial**.
- \mathcal{F} riche/complexité élevée \implies

Choix de \mathcal{F}

- Il est bien entendu **crucial**.
- \mathcal{F} riche/complexité élevée $\implies \mathcal{R}_n(f) \searrow \implies f(x_i) \approx y_i, i = 1, \dots, n$
 \implies **sur-ajustement**.

Choix de \mathcal{F}

- Il est bien entendu **crucial**.
- \mathcal{F} riche/complexité élevée $\implies \mathcal{R}_n(f) \searrow \implies f(x_i) \approx y_i, i = 1, \dots, n$
 \implies **sur-ajustement**.
- et réciproquement pour des classes \mathcal{F} simple/complexité faible.

Choix de \mathcal{F}

- Il est bien entendu **crucial**.
- \mathcal{F} riche/complexité élevée $\implies \mathcal{R}_n(f) \searrow \implies f(x_i) \approx y_i, i = 1, \dots, n$
 \implies **sur-ajustement**.
- et réciproquement pour des classes \mathcal{F} simple/complexité faible.

Combinaisons d'arbres

- [Friedman, 2001, Friedman, 2002] propose de se restreindre à des combinaisons d'arbres :

$$\mathcal{F} = \left\{ \sum_{b=1}^B \lambda_b T(x, \theta_b), \lambda_b \in \mathbb{R}, \theta_b \in \Theta \right\}$$

où θ_b désigne les paramètres de l'arbre (impureté, profondeur)...

- **Rappel** : un arbre peut s'écrire

$$T(x, \theta_b) = \sum_{\ell=1}^L \gamma_{b\ell} \mathbf{1}_{x \in \mathcal{N}_{b\ell}}$$

où $\mathcal{N}_{b\ell}$ désigne les feuilles et $\gamma_{b\ell}$ les prévisions dans les feuilles.

- **Rappel** : un arbre peut s'écrire

$$T(x, \theta_b) = \sum_{\ell=1}^L \gamma_{b\ell} \mathbf{1}_{x \in \mathcal{N}_{b\ell}}$$

où $\mathcal{N}_{b\ell}$ désigne les feuilles et $\gamma_{b\ell}$ les prévisions dans les feuilles.

- Les paramètres B, θ_b définissent la **complexité** de \mathcal{F} .
- Il faudra les **calibrer** à un moment mais nous les considérons **fixés** pour l'instant.

- **Rappel** : un arbre peut s'écrire

$$T(x, \theta_b) = \sum_{\ell=1}^L \gamma_{b\ell} \mathbf{1}_{x \in \mathcal{N}_{b\ell}}$$

où $\mathcal{N}_{b\ell}$ désigne les feuilles et $\gamma_{b\ell}$ les prévisions dans les feuilles.

- Les paramètres B, θ_b définissent la **complexité** de \mathcal{F} .
- Il faudra les **calibrer** à un moment mais nous les considérons **fixés** pour l'instant.

Un premier problème

Chercher $f \in \mathcal{F}$ qui minimise $\mathcal{R}_n(f)$.

- **Rappel** : un arbre peut s'écrire

$$T(x, \theta_b) = \sum_{\ell=1}^L \gamma_{b\ell} \mathbf{1}_{x \in \mathcal{N}_{b\ell}}$$

où $\mathcal{N}_{b\ell}$ désigne les feuilles et $\gamma_{b\ell}$ les prévisions dans les feuilles.

- Les paramètres B, θ_b définissent la **complexité** de \mathcal{F} .
- Il faudra les **calibrer** à un moment mais nous les considérons **fixés** pour l'instant.

Un premier problème

Chercher $f \in \mathcal{F}$ qui minimise $\mathcal{R}_n(f)$.

- Résolution numérique **trop difficile**.
- Nécessité de trouver un **algorithme** qui approche la solution.

Bagging et forêts aléatoires

- Bagging

- Forêts aléatoires

 - Algorithme

 - Choix des paramètres

 - Erreur OOB et importance des variables

Boosting

- Algorithme de gradient boosting

- Choix des paramètres

- Compléments/conclusion

Bibliographie

Descentes de gradient

- Définissent des **suites** qui convergent vers des **extrema locaux** de fonctions $\mathbb{R}^p \rightarrow \mathbb{R}$.

Descentes de gradient

- Définissent des **suites** qui convergent vers des **extrema locaux** de fonctions $\mathbb{R}^p \rightarrow \mathbb{R}$.
- Le risque $\mathcal{R}_n(f)$ ne dépend que des valeurs de **f aux points x_i** .

Descentes de gradient

- Définissent des **suites** qui convergent vers des **extrema locaux** de fonctions $\mathbb{R}^p \rightarrow \mathbb{R}$.
- Le risque $\mathcal{R}_n(f)$ ne dépend que des valeurs de **f aux points x_i** .
- En notant $\mathbf{f} = (\mathbf{f}(x_1), \dots, \mathbf{f}(x_n)) \in \mathbb{R}^n$, on a

$$\mathcal{R}_n(f) = \tilde{\mathcal{R}}_n(\mathbf{f}) = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n \ell(y_i, \mathbf{f}(x_i))$$

avec $\tilde{\mathcal{R}}_n : \mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R}$.

Descentes de gradient

- Définissent des **suites** qui convergent vers des **extrema locaux** de fonctions $\mathbb{R}^p \rightarrow \mathbb{R}$.
- Le risque $\mathcal{R}_n(f)$ ne dépend que des valeurs de **f aux points x_i** .
- En notant $\mathbf{f} = (\mathbf{f}(x_1), \dots, \mathbf{f}(x_n)) \in \mathbb{R}^n$, on a

$$\mathcal{R}_n(f) = \tilde{\mathcal{R}}_n(\mathbf{f}) = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n \ell(y_i, \mathbf{f}(x_i))$$

avec $\tilde{\mathcal{R}}_n : \mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R}$.

Nouveau problème

Minimiser $\tilde{\mathcal{R}}_n$.

\implies en gardant en tête que **minimiser de $\mathcal{R}_n(f)$ n'est pas équivalent à minimiser $\tilde{\mathcal{R}}_n(\mathbf{f})$** .

- **Descente de gradient** \implies suite $(\mathbf{f}_b)_b$ de vecteurs de \mathbb{R}^n qui convergent vers des extrema (locaux) de $\tilde{\mathcal{R}}_n$.

- **Descente de gradient** \implies suite $(\mathbf{f}_b)_b$ de vecteurs de \mathbb{R}^n qui convergent vers des extrema (locaux) de $\widetilde{\mathcal{R}}_n$.
- Suite **récursive** :

$$\mathbf{f}_b = \mathbf{f}_{b-1} - \rho_b \nabla \widetilde{\mathcal{R}}_n(\mathbf{f}_{b-1}),$$

où $\nabla \widetilde{\mathcal{R}}_n(\mathbf{f}_{b-1})$ désigne le vecteur gradient de $\widetilde{\mathcal{R}}_n$ évalué en \mathbf{f}_{b-1} .

\implies **vecteur de \mathbb{R}^n** donc la i^e coordonnée vaut

$$\frac{\partial \widetilde{\mathcal{R}}_n(\mathbf{f})}{\partial \mathbf{f}(x_i)}(\mathbf{f}_{b-1}) = \frac{\partial \ell(y_i, \mathbf{f}(x_i))}{\partial \mathbf{f}(x_i)}(\mathbf{f}_{b-1}(x_i)).$$

- **Descente de gradient** \implies suite $(\mathbf{f}_b)_b$ de vecteurs de \mathbb{R}^n qui convergent vers des extrema (locaux) de $\widetilde{\mathcal{R}}_n$.
- Suite **récursive** :

$$\mathbf{f}_b = \mathbf{f}_{b-1} - \rho_b \nabla \widetilde{\mathcal{R}}_n(\mathbf{f}_{b-1}),$$

où $\nabla \widetilde{\mathcal{R}}_n(\mathbf{f}_{b-1})$ désigne le vecteur gradient de $\widetilde{\mathcal{R}}_n$ évalué en \mathbf{f}_{b-1} .

\implies **vecteur de \mathbb{R}^n** donc la i^e coordonnée vaut

$$\frac{\partial \widetilde{\mathcal{R}}_n(\mathbf{f})}{\partial \mathbf{f}(x_i)}(\mathbf{f}_{b-1}) = \frac{\partial \ell(y_i, \mathbf{f}(x_i))}{\partial \mathbf{f}(x_i)}(\mathbf{f}_{b-1}(x_i)).$$

Exemple

Si $\ell(y, f(x)) = 1/2(y - f(x))^2$ alors

$$-\frac{\partial \ell(y_i, \mathbf{f}(x_i))}{\partial \mathbf{f}(x_i)}(\mathbf{f}_{b-1}(x_i)) = y_i - \mathbf{f}_{b-1}(x_i),$$

\implies **résidu** de $\mathbf{f}_{b-1}(x_i)$.

- Si tout se passe bien... la suite $(f_b)_b$ doit **converger** vers un minimum de $\widetilde{\mathcal{R}}_n$.

Deux problèmes

- Si tout se passe bien... la suite $(f_b)_b$ doit **converger** vers un minimum de $\widetilde{\mathcal{R}}_n$.

Deux problèmes

1. Cette suite définit des prévisions uniquement aux points $x_i \implies$
impossible de prédire en tout x .

- Si tout se passe bien... la suite $(f_b)_b$ doit **converger** vers un minimum de $\widetilde{\mathcal{R}}_n$.

Deux problèmes

1. Cette suite définit des prévisions uniquement aux points $x_i \implies$ impossible de prédire en tout x .
2. Les éléments de la suite ne s'écrivent pas comme des combinaisons d'arbres.

- Si tout se passe bien... la suite $(\mathbf{f}_b)_b$ doit **converger** vers un minimum de $\widetilde{\mathcal{R}}_n$.

Deux problèmes

1. Cette suite définit des prévisions uniquement aux points $x_i \implies$ impossible de prédire en tout x .
2. Les éléments de la suite ne s'écrivent pas comme des combinaisons d'arbres.

Une solution

[Friedman, 2001] propose d'ajuster un arbre sur les valeurs du gradient à chaque étape de la descente.

Algorithme de gradient boosting

1. Initialisation : $f_0(\cdot) = \operatorname{argmin}_c \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n \ell(y_i, c)$

Algorithme de gradient boosting

1. Initialisation : $f_0(\cdot) = \operatorname{argmin}_c \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n \ell(y_i, c)$
2. Pour $b = 1$ à B :
 - 2.1 Calculer l'opposé du gradient $-\frac{\partial}{\partial f(x_i)} \ell(y_i, f(x_i))$ et l'évaluer aux points $f_{b-1}(x_i)$:

$$u_i = -\frac{\partial}{\partial f(x_i)} \ell(y_i, f(x_i)) \Big|_{f(x_i)=f_{b-1}(x_i)}, \quad i = 1, \dots, n.$$

Algorithme de gradient boosting

1. Initialisation : $f_0(\cdot) = \operatorname{argmin}_c \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n \ell(y_i, c)$

2. Pour $b = 1$ à B :

2.1 Calculer l'opposé du gradient $-\frac{\partial}{\partial f(x_i)} \ell(y_i, f(x_i))$ et l'évaluer aux points $f_{b-1}(x_i)$:

$$u_i = -\frac{\partial}{\partial f(x_i)} \ell(y_i, f(x_i)) \Big|_{f(x_i)=f_{b-1}(x_i)}, \quad i = 1, \dots, n.$$

2.2 Ajuster un arbre de régression à J feuilles sur $(x_i, u_i), \dots, (x_n, u_n)$.

Algorithme de gradient boosting

1. Initialisation : $f_0(\cdot) = \operatorname{argmin}_c \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n \ell(y_i, c)$

2. Pour $b = 1$ à B :

2.1 Calculer l'opposé du gradient $-\frac{\partial}{\partial f(x_i)} \ell(y_i, f(x_i))$ et l'évaluer aux points $f_{b-1}(x_i)$:

$$u_i = -\frac{\partial}{\partial f(x_i)} \ell(y_i, f(x_i)) \Big|_{f(x_i)=f_{b-1}(x_i)}, \quad i = 1, \dots, n.$$

2.2 Ajuster un arbre de régression à J feuilles sur $(x_i, u_i), \dots, (x_n, u_n)$.

2.3 Calculer les valeurs prédites dans chaque feuille

$$\gamma_{jb} = \operatorname{argmin}_{\gamma} \sum_{i: x_i \in \mathcal{N}_{jb}} \ell(y_i, f_{b-1}(x_i) + \gamma).$$

Algorithme de gradient boosting

1. Initialisation : $f_0(\cdot) = \operatorname{argmin}_c \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n \ell(y_i, c)$

2. Pour $b = 1$ à B :

2.1 Calculer l'opposé du gradient $-\frac{\partial}{\partial f(x_i)} \ell(y_i, f(x_i))$ et l'évaluer aux points $f_{b-1}(x_i)$:

$$u_i = -\frac{\partial}{\partial f(x_i)} \ell(y_i, f(x_i)) \Big|_{f(x_i)=f_{b-1}(x_i)}, \quad i = 1, \dots, n.$$

2.2 Ajuster un arbre de régression à J feuilles sur $(x_i, u_i), \dots, (x_n, u_n)$.

2.3 Calculer les valeurs prédites dans chaque feuille

$$\gamma_{jb} = \operatorname{argmin}_{\gamma} \sum_{i: x_i \in \mathcal{N}_{jb}} \ell(y_i, f_{b-1}(x_i) + \gamma).$$

2.4 Mise à jour : $f_b(x) = f_{b-1}(x) + \sum_{j=1}^J \gamma_{jb} \mathbf{1}_{x \in \mathcal{N}_{jb}}$.

Algorithme de gradient boosting

1. Initialisation : $f_0(\cdot) = \operatorname{argmin}_c \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n \ell(y_i, c)$

2. Pour $b = 1$ à B :

2.1 Calculer l'opposé du gradient $-\frac{\partial}{\partial f(x_i)} \ell(y_i, f(x_i))$ et l'évaluer aux points $f_{b-1}(x_i)$:

$$u_i = -\frac{\partial}{\partial f(x_i)} \ell(y_i, f(x_i)) \Big|_{f(x_i)=f_{b-1}(x_i)}, \quad i = 1, \dots, n.$$

2.2 Ajuster un arbre de régression à J feuilles sur $(x_i, u_i), \dots, (x_n, u_n)$.

2.3 Calculer les valeurs prédites dans chaque feuille

$$\gamma_{jb} = \operatorname{argmin}_{\gamma} \sum_{i: x_i \in \mathcal{N}_{jb}} \ell(y_i, f_{b-1}(x_i) + \gamma).$$

2.4 Mise à jour : $f_b(x) = f_{b-1}(x) + \sum_{j=1}^J \gamma_{jb} \mathbf{1}_{x \in \mathcal{N}_{jb}}$.

Retourner : l'algorithme $f_n(x) = f_B(x)$.

Paramètres

Nous donnons les correspondances entre les paramètres et les options de la fonction `gbm` :

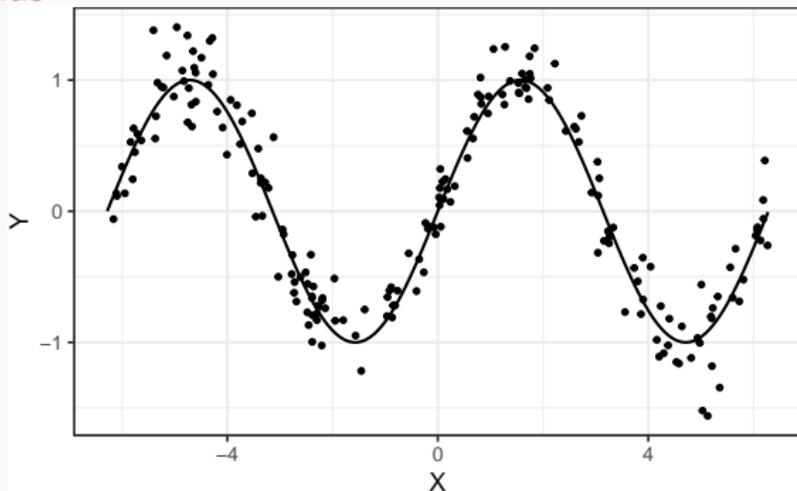
- ℓ la fonction de perte \implies `distribution`
- B nombre d'itérations \implies `n.tree`
- J le nombre de feuilles des arbres \implies `interaction.dept` ($=J - 1$)
- λ le paramètre de rétrécissement \implies `shrinkage`.

Stochastic gradient boosting

[Friedman, 2002] montre qu'`ajuster les arbres sur des sous-échantillons` (tirage sans remise) améliore souvent les performances de l'algorithme.
 \implies `bag.fraction` : taille des sous-échantillons.

Exemple

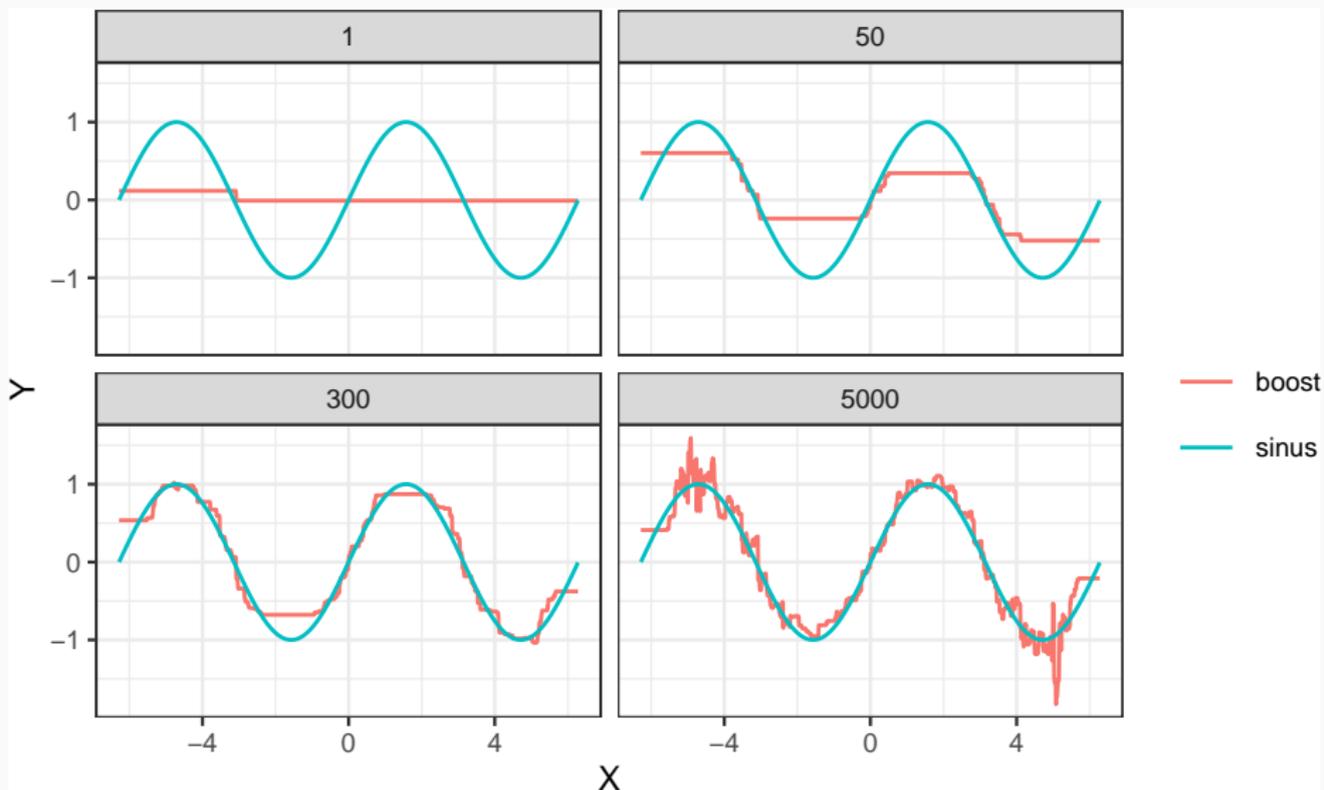
- Données **sinus**



- On entraîne l'algorithme :

```
> set.seed(1234)
> library(gbm)
> boost.5000 <- gbm(Y~.,data=data_sinus,
+                   distribution="gaussian",shrinkage=0.1,n.trees = 5000)
```

- On visualise les prévisions en fonction du nombre d'itérations :



Bagging et forêts aléatoires

- Bagging

- Forêts aléatoires

 - Algorithme

 - Choix des paramètres

 - Erreur OOB et importance des variables

Boosting

- Algorithme de gradient boosting

- Choix des paramètres

- Compléments/conclusion

Bibliographie

Fonction de perte

- Pas vraiment un paramètre...
- Elle doit
 1. mesurer un **coût** (comme d'habitude).
 \implies elle caractérise la fonction de prévision à estimer $\implies f_n$ est en effet un **estimateur** de

$$f^* \in \operatorname{argmin}_{f: \mathbb{R}^d \rightarrow \mathbb{R}} \mathbf{E}[\ell(Y, f(X))].$$

- Pas vraiment un paramètre...
- Elle doit
 1. mesurer un **coût** (comme d'habitude).
 \implies elle caractérise la fonction de prévision à estimer $\implies f_n$ est en effet un **estimateur** de

$$f^* \in \operatorname{argmin}_{f: \mathbb{R}^d \rightarrow \mathbb{R}} \mathbf{E}[\ell(Y, f(X))].$$

2. être **convexe** et **dérivable** par rapport à son second argument (spécificité gradient).

L_2 -boosting en régression

- Correspond à la **perte quadratique**

$$\ell(y, f(x)) = \frac{1}{2}(y - f(x))^2.$$

L_2 -boosting en régression

- Correspond à la **perte quadratique**

$$\ell(y, f(x)) = \frac{1}{2}(y - f(x))^2.$$

- **fonction de prévision optimale** : $f^*(x) = \mathbf{E}[Y|X = x]$.

L_2 -boosting en régression

- Correspond à la **perte quadratique**

$$\ell(y, f(x)) = \frac{1}{2}(y - f(x))^2.$$

- **fonction de prévision optimale** : $f^*(x) = \mathbf{E}[Y|X = x]$.

Remarque

- Avec cette perte, les u_i sont donnés par

$$u_i = -\frac{\partial \ell(y_i, f(x_i))}{\partial f(x_i)}(f_{b-1}(x_i)) = y_i - f_{b-1}(x_i),$$

L_2 -boosting en régression

- Correspond à la **perte quadratique**

$$\ell(y, f(x)) = \frac{1}{2}(y - f(x))^2.$$

- **fonction de prévision optimale** : $f^*(x) = \mathbf{E}[Y|X = x]$.

Remarque

- Avec cette perte, les u_i sont donnés par

$$u_i = -\frac{\partial \ell(y_i, f(x_i))}{\partial f(x_i)}(f_{b-1}(x_i)) = y_i - f_{b-1}(x_i),$$

- f_b s'obtient donc en **corrigeant** f_{b-1} avec une **régression sur ses résidus**.

Version simplifiée du L_2 -boosting

La boucle de l'algorithme de gradient boosting peut se réécrire :

1. Calculer les résidus $u_i = y_i - f_{b-1}(x_i), i = 1, \dots, n$;
2. Ajuster un arbre de régression pour expliquer les résidus u_i par les x_i ;
3. Corriger f_{b-1} en lui ajoutant l'arbre construit.

Version simplifiée du L_2 -boosting

La boucle de l'algorithme de gradient boosting peut se réécrire :

1. Calculer les résidus $u_i = y_i - f_{b-1}(x_i)$, $i = 1, \dots, n$;
2. Ajuster un arbre de régression pour expliquer les résidus u_i par les x_i ;
3. Corriger f_{b-1} en lui ajoutant l'arbre construit.

Interprétation

- On "corrige" f_{b-1} en cherchant à expliquer "l'information restante" qui est contenue dans les résidus.
- Meilleur ajustement lorsque $b \nearrow \implies$ biais \searrow (mais variance \nearrow).

- **Classification binaire** avec Y dans $\{-1, 1\}$ et $\tilde{Y} = (Y + 1)/2$ dans $\{0, 1\}$.

- **Classification binaire** avec Y dans $\{-1, 1\}$ et $\tilde{Y} = (Y + 1)/2$ dans $\{0, 1\}$.
- **Log-vraisemblance binomiale** de la prévision $p(x) \in [0, 1]$ par rapport à l'observation \tilde{y} :

$$\mathcal{L}(\tilde{y}, p(x)) = \tilde{y} \log p(x) + (1 - \tilde{y}) \log(1 - p(x)).$$

- **Classification binaire** avec Y dans $\{-1, 1\}$ et $\tilde{Y} = (Y + 1)/2$ dans $\{0, 1\}$.
- **Log-vraisemblance binomiale** de la prévision $p(x) \in [0, 1]$ par rapport à l'observation \tilde{y} :

$$\mathcal{L}(\tilde{y}, p(x)) = \tilde{y} \log p(x) + (1 - \tilde{y}) \log(1 - p(x)).$$

- Soit $f : \mathbb{R}^d \rightarrow \mathbb{R}$ telle que

$$f(x) = \frac{1}{2} \log \frac{p(x)}{1 - p(x)} \iff p(x) = \frac{1}{1 + \exp(-2f(x))}.$$

\implies re-paramétrisation.

- Chercher $p(x)$ qui maximise $\mathcal{L}(\tilde{y}, p(x))$ revient à chercher $f(x)$ qui minimise son opposé :

$$\begin{aligned} -\mathcal{L}(y, f(x)) &= -\frac{y+1}{2} \log p(x) - \left(1 - \frac{y+1}{2}\right) \log(1 - p(x)) \\ &= \frac{y+1}{2} \log(1 + \exp(-2f(x))) + \\ &\quad \left(1 - \frac{y+1}{2}\right) \log(1 + \exp(2f(x))) \\ &= \log(1 + \exp(-2yf(x))). \end{aligned}$$

- Chercher $p(x)$ qui maximise $\mathcal{L}(\tilde{y}, p(x))$ revient à chercher $f(x)$ qui minimise son opposé :

$$\begin{aligned} -\mathcal{L}(y, f(x)) &= -\frac{y+1}{2} \log p(x) - \left(1 - \frac{y+1}{2}\right) \log(1 - p(x)) \\ &= \frac{y+1}{2} \log(1 + \exp(-2f(x))) + \\ &\quad \left(1 - \frac{y+1}{2}\right) \log(1 + \exp(2f(x))) \\ &= \log(1 + \exp(-2yf(x))). \end{aligned}$$

Remarque

$f(x) \mapsto \log(1 + \exp(-2yf(x)))$ est **convexe** et **dérivable**.

Logitboost

Algorithme de gradient boosting avec la fonction de perte

$$\ell(y, f(x)) = \log(1 + \exp(-2yf(x))).$$

Logitboost

Algorithme de gradient boosting avec la fonction de perte

$$\ell(y, f(x)) = \log(1 + \exp(-2yf(x))).$$

- Fonction optimale

$$f^*(x) = \frac{1}{2} \log \frac{\mathbf{P}(Y = 1|X = x)}{1 - \mathbf{P}(Y = 1|X = x)}.$$

Logitboost

Algorithme de gradient boosting avec la fonction de perte

$$\ell(y, f(x)) = \log(1 + \exp(-2yf(x))).$$

- Fonction optimale

$$f^*(x) = \frac{1}{2} \log \frac{\mathbf{P}(Y = 1|X = x)}{1 - \mathbf{P}(Y = 1|X = x)}.$$

- f_n estimant f^* , on estime $\mathbf{P}(Y = 1|X = x)$ avec

$$\frac{1}{1 + \exp(-2f_n(x))}.$$

- Remarque : $f(x) \mapsto \exp(-yf(x))$ est aussi convexe et dérivable.

Adaboost

Algorithme de gradient boosting avec la fonction de perte

$$\ell(y, f(x)) = \exp(-yf(x)).$$

Adaboost

- **Remarque** : $f(x) \mapsto \exp(-yf(x))$ est aussi **convexe** et **dérivable**.

Adaboost

Algorithme de gradient boosting avec la fonction de perte

$$\ell(y, f(x)) = \exp(-yf(x)).$$

Remarque

- Même nom que l'algorithme initial de [\[Freund and Schapire, 1996\]](#) car

Adaboost

- **Remarque** : $f(x) \mapsto \exp(-yf(x))$ est aussi **convexe** et **dérivable**.

Adaboost

Algorithme de gradient boosting avec la fonction de perte

$$\ell(y, f(x)) = \exp(-yf(x)).$$

Remarque

- Même nom que l'algorithme initial de [Freund and Schapire, 1996] car quasi-similaire [Hastie et al., 2009].
- Même f^* que **logitboost**.

Algorithme [Freund and Schapire, 1996]

Entrées : une règle faible, M nombre d'itérations.

1. Initialiser les poids $w_i = 1/n$, $i = 1, \dots, n$
2. Pour $m = 1$ à M :
 - a) Ajuster la règle faible sur l'échantillon d_n pondéré par les poids w_1, \dots, w_n , on note $g_m(x)$ l'estimateur issu de cet ajustement
 - b) Calculer le taux d'erreur :
$$e_m = \frac{\sum_{i=1}^n w_i \mathbf{1}_{y_i \neq g_m(x_i)}}{\sum_{i=1}^n w_i}.$$
 - c) Calculer : $\alpha_m = \log((1 - e_m)/e_m)$
 - d) Réajuster les poids : $w_i = w_i \exp(\alpha_m \mathbf{1}_{y_i \neq g_m(x_i)})$, $i = 1, \dots, n$

Sorties : l'algorithme de prévision $\sum_{m=1}^M \alpha_m g_m(x)$.

Récapitulatif

- Les principales fonctions de perte pour la régression et classification sont résumées dans le tableau :

	Y	Perte	Prév. optimale
L_2 -boosting	\mathbb{R}	$(y - f(x))^2$	$\mathbf{E}[Y X = x]$
Logitboost	$\{-1, 1\}$	$\log(1 + \exp(-2yf(x)))$	$\frac{1}{2} \log \frac{\mathbf{P}(Y=1 X=x)}{1 - \mathbf{P}(Y=1 X=x)}$
Adaboost	$\{-1, 1\}$	$\exp(-yf(x))$	$\frac{1}{2} \log \frac{\mathbf{P}(Y=1 X=x)}{1 - \mathbf{P}(Y=1 X=x)}$

- Dans gbm on utilise **distribution=**
 - gaussian** pour le L_2 -boosting.
 - bernoulli** pour logitboost.
 - adaboost** pour adaboost.

- **interaction.depth** qui correspond au **nombre de coupures** \implies nombre de feuilles $J - 1$.
- On parle d'**interaction** car ce paramètre est associé au **degrés d'interactions** que l'algorithme peut identifier :

$$f^*(x) = \sum_{1 \leq j \leq d} f_j(x_j) + \sum_{1 \leq j, k \leq d} f_{j,k}(x_j, x_k) + \sum_{1 \leq j, k, \ell \leq d} f_{j,k,\ell}(x_j, x_k, x_\ell) + \dots$$

\implies **interaction.depth** =

- 1 \implies premier terme
- 2 \implies second terme (interactions d'ordre 2)
- ...

- Boosting : réduction de biais.

- Boosting : réduction de biais.
- Nécessité d'utiliser des arbres biaisés \implies peu de coupures.

- Boosting : réduction de biais.
- Nécessité d'utiliser des arbres biaisés \implies peu de coupures.

Recommandation

Choisir `interaction.depth` entre 2 et 5.

Nombre d'itérations

- Le **nombre d'arbres n.trees** mesure la **complexité** de l'algorithme.
- Plus on itère, mieux on ajuste
⇒ si on itère trop, on **sur-ajuste**.

Nombre d'itérations

- Le **nombre d'arbres n.trees** mesure la **complexité** de l'algorithme.
- Plus on itère, mieux on ajuste
⇒ si on itère trop, on **sur-ajuste**.
- Nécessité de **calibrer correctement** ce paramètre.

Comment ?

Nombre d'itérations

- Le **nombre d'arbres n.trees** mesure la **complexité** de l'algorithme.
- Plus on itère, mieux on ajuste
⇒ si on itère trop, on **sur-ajuste**.
- Nécessité de **calibrer correctement** ce paramètre.

Comment ?

Avec des méthodes classiques d'**estimation du risque**.

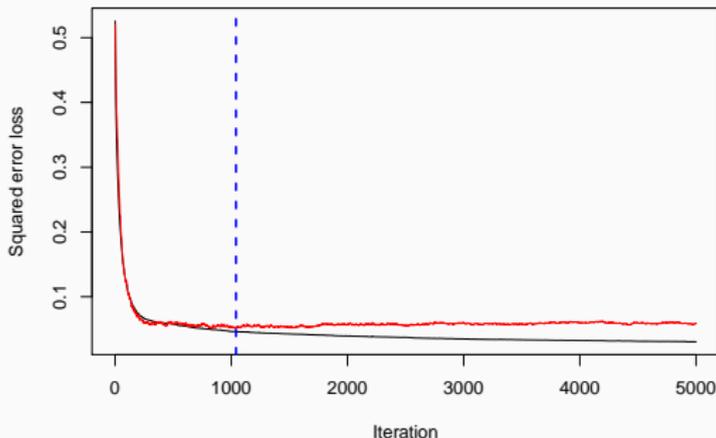
- `gbm` propose d'estimer le risque associé au paramètre `distribution` par ré-échantillonnage :
 - `bag.fraction` pour du `Out Of Bag`.
 - `train.fraction` pour de la `validation hold out`.
 - `cv.folds` pour de la `validation croisée`.

Sélection de `n.trees` dans `gbm`

- `gbm` propose d'estimer le risque associé au paramètre `distribution` par ré-échantillonnage :
 - `bag.fraction` pour du `Out Of Bag`.
 - `train.fraction` pour de la `validation hold out`.
 - `cv.folds` pour de la `validation croisée`.
- La valeur sélectionnée s'obtient avec `gbm.perf`.

Exemple

```
> set.seed(321)
> boost.5000 <- gbm(Y~., data=data_sinus, train.fraction = 0.75,
+                 distribution="gaussian", shrinkage=0.1, n.trees = 5000)
> gbm.perf(boost.5000)
## [1] 1040
```



⇒ **Risque quadratique** estimé par **hold out** avec 75% d'observations dans l'échantillon d'apprentissage.

- shrinkage dans gbm.
- Correspond au pas de la descente de gradient : shrinkage ↗ ⇒ minimisation plus rapide.

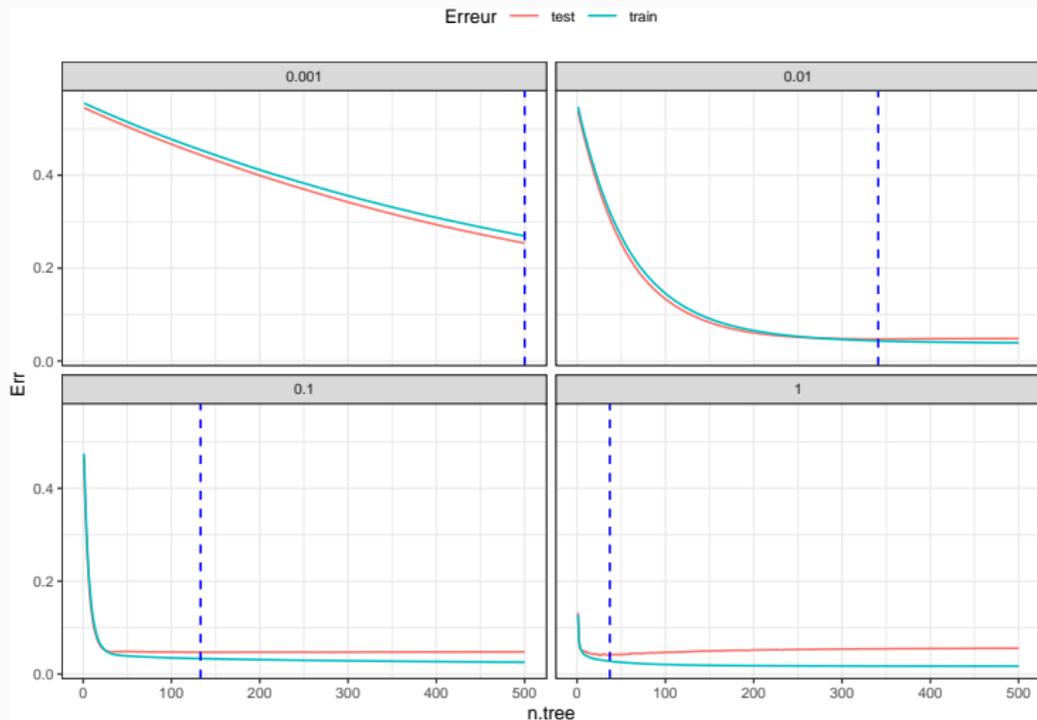
- shrinkage dans gbm.
- Correspond au pas de la descente de gradient : shrinkage $\nearrow \implies$ minimisation plus rapide.

Conséquence

shrinkage est lié à n.trees :

- shrinkage $\nearrow \implies$ n.trees \searrow .
- shrinkage $\searrow \implies$ n.trees \nearrow .

Illustration



Remarque

Le nombre d'itération optimal diminue lorsque **shrinkage** augmente.

- Pas nécessaire de trop optimiser **shrinkage**.
- Tester 3 ou 4 valeurs (0.01, 0.1, 0.5...) et regarder les **courbes de risque**.

- Pas nécessaire de trop optimiser **shrinkage**.
- Tester 3 ou 4 valeurs (0.01, 0.1, 0.5...) et regarder les **courbes de risque**.
- S'assurer que le **nombre d'itérations optimal** se trouve sur un **"plateau"** pour des raisons de **stabilité**.

Bagging et forêts aléatoires

- Bagging

- Forêts aléatoires

 - Algorithme

 - Choix des paramètres

 - Erreur OOB et importance des variables

Boosting

- Algorithme de gradient boosting

- Choix des paramètres

- Compléments/conclusion**

Bibliographie

- Similaire aux **forêts aléatoires**.
- **Score d'impureté** :

$$\mathcal{I}_j^{\text{imp}} = \frac{1}{B} \sum_{b=1}^B \mathcal{I}_j(T_b).$$

- Visualisation avec **vip**.

Comparaison Boosting/Forêts aléatoires

- Deux algorithmes qui agrègent des arbres :

$$f_n(x) = \sum_{b=1}^B \alpha_b T_b(x).$$

- **Indépendance** pour les forêts $\implies T_b$ se construit indépendamment de T_{b-1} .

Comparaison Boosting/Forêts aléatoires

- Deux algorithmes qui agrègent des arbres :

$$f_n(x) = \sum_{b=1}^B \alpha_b T_b(x).$$

- **Indépendance** pour les forêts $\implies T_b$ se construit indépendamment de T_{b-1} .
- **Récurtivité** pour le boosting $\implies T_b$ se construit à partir de T_{b-1} .

Comparaison Boosting/Forêts aléatoires

- Deux algorithmes qui agrègent des arbres :

$$f_n(x) = \sum_{b=1}^B \alpha_b T_b(x).$$

- **Indépendance** pour les forêts $\implies T_b$ se construit indépendamment de T_{b-1} .
- **Récursivité** pour le boosting $\implies T_b$ se construit à partir de T_{b-1} .

Interprétation statistique

- **Boosting** : réduction de biais \implies arbres peu profonds.
- **Random Forest** : réduction de variance \implies arbres très profonds.

Comparaison Boosting/Forêts aléatoires

- Deux algorithmes qui agrègent des arbres :

$$f_n(x) = \sum_{b=1}^B \alpha_b T_b(x).$$

- **Indépendance** pour les forêts $\implies T_b$ se construit indépendamment de T_{b-1} .
- **Récurtivité** pour le boosting $\implies T_b$ se construit à partir de T_{b-1} .

Interprétation statistique

- **Boosting** : réduction de biais \implies arbres peu profonds.
- **Random Forest** : réduction de variance \implies arbres très profonds.

\implies les arbres sont ajustés de **façon différente** pour ces deux algorithmes.

\implies dans les deux cas, il faut des **arbres "mauvais"**.

Bagging et forêts aléatoires

- Bagging

- Forêts aléatoires

 - Algorithme

 - Choix des paramètres

 - Erreur OOB et importance des variables

- Boosting

 - Algorithme de gradient boosting

 - Choix des paramètres

 - Compléments/conclusion

Bibliographie

-  Breiman, L. (1996).
Bagging predictors.
Machine Learning, 26(2) :123–140.
-  Fernández-Delgado, M., Cernadas, E., Barro, S., and Amorim, D. (2014).
Do we need hundreds of classifiers to solve real world classification problems ?
Journal of Machine Learning Research, 15 :3133–3181.
-  Freund, Y. and Schapire, R. (1996).
Experiments with a new boosting algorithm.
In *Proceedings of the Thirteenth International Conference on Machine Learning*.

-  Friedman, J. H. (2001).
Greedy function approximation : A gradient boosting machine.
Annals of Statistics, 29 :1189–1232.
-  Friedman, J. H. (2002).
Stochastic gradient boosting.
Computational Statistics & Data Analysis, 28 :367–378.
-  Genuer, R. (2010).
Forêts aléatoires : aspects théoriques, sélection de variables et applications.
PhD thesis, Université Paris XI.



Hastie, T., Tibshirani, R., and Friedman, J. (2009).

The Elements of Statistical Learning : Data Mining, Inference, and Prediction.

Springer, second edition.



Wright, M. and Ziegler, A. (2017).

ranger : A fast implementation of random forests for high dimensional data in c++ and r.

Journal of Statistical Software, 17(1).

Discussion/comparaison des algorithmes

	Linéaire	SVM	Réseau	Arbre	Forêt	Boosting
Performance	■	■	■	▼	▲	▲
Calibration	▼	▼	▼	▲	▲	▲
Coût calc.	■	▼	▼	▲	▲	▲
Interprétation	▲	▼	▼	■	▼	▼

Commentaires

- Résultats pour **données tabulaires**.
- Différent pour **données structurées** (image, texte..)
 ⇒ performance ↗ réseaux pré-entraînés ⇒ **apprentissage profond/deep learning**.