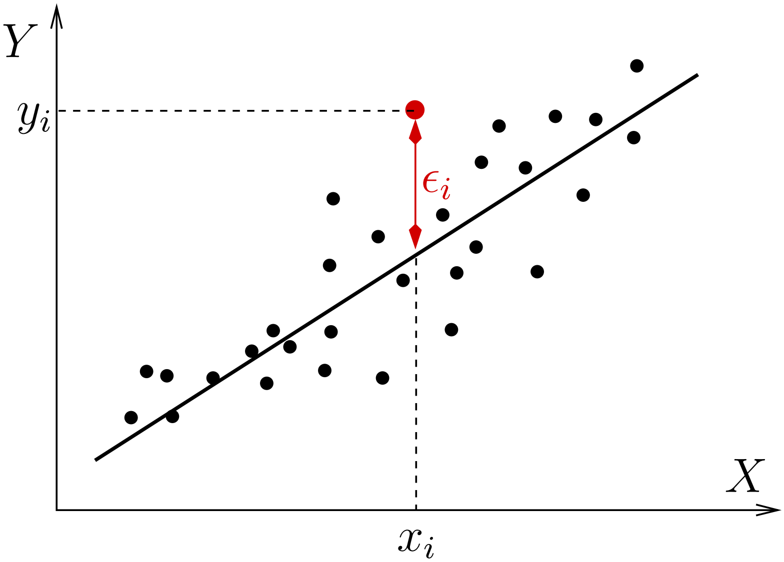
DESCENTE DE GRADIENT (ET RÉGRESSION)

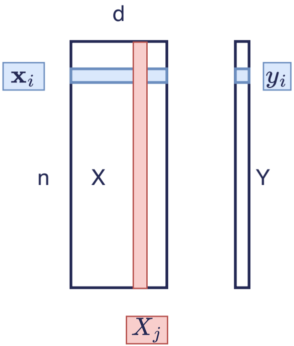
Vincent Guigue
vincent.guigue@agroparistech.fr

Régression

Régression linéaire



Régression linéaire au sens des moindres carrés



- $\mathbf{x}_i \in \mathbb{R}^d, y_i \in \mathbb{R}$
- Modèle linéaire : $\hat{y}_i = \sum_{j=1}^{d} x_{ij} w_j + b$
- Simplification : $\hat{y}_i = \sum_{j=1}^{d+1} x_{ij} w_j$ avec $\forall i,\ x_{i,d+1} = 1$
- Critère d'optimisation : $C = \sum_{i=1}^{n} (\hat{y}_i - y_i)^2$
- Problème d'apprentissage :

$$\mathbf{w}^\star = \arg\min_{\mathbf{w}} \sum_{i=1}^{n} (\sum_{j=1}^{d+1} x_{ij} w_j - y_i)^2$$

Ecriture matricielle & résolution analytique

$$C = \sum_{i=1}^{n} (\hat{y}_i - y_i)^2 = \sum_{i=1}^{n} \left(\sum_{j=1}^{d+1} x_{ij} w_j - y_i \right)^2 = \|Xw - Y\|^2$$

Résolution :

$$\nabla_{\mathbf{w}} C = \begin{pmatrix} \frac{\partial C}{\partial w_1} \\ \vdots \\ \frac{\partial C}{\partial w_d} \end{pmatrix} = 2X^T(X\mathbf{w} - Y), \qquad \frac{\partial C}{\partial w_j} = \sum_{i=1}^{n} 2x_{ij} \left(\sum_{j=1}^{d+1} x_{ij} w_j - y_i \right)$$

$$\mathbf{w}^\star \Leftrightarrow \nabla_{\mathbf{w}} C = 0 \Leftrightarrow 2X^T(X\mathbf{w} - Y) = 0 \Leftrightarrow X^T X\mathbf{w} = X^T Y$$

Cette dernière forme correspond à un système d'équations linéaires :

$$\begin{pmatrix} X_1^T X_1 & X_1^T X_2 & \dots & X_1^T X_d \\ \vdots & \vdots & \vdots & \vdots \\ X_d^T X_1 & X_d^T X_2 & \dots & X_d^T X_d \end{pmatrix} \begin{pmatrix} w_1 \\ \vdots \\ w_d \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} X_1^T Y \\ \vdots \\ X_d^T Y \end{pmatrix}$$

Résolution rapide & efficace

Problème de la forme :

$$A\mathbf{w} = B, \qquad A = X^T X \in \mathbb{R}^{d\times d}, \qquad B = X^T Y \in \mathbb{R}^d$$

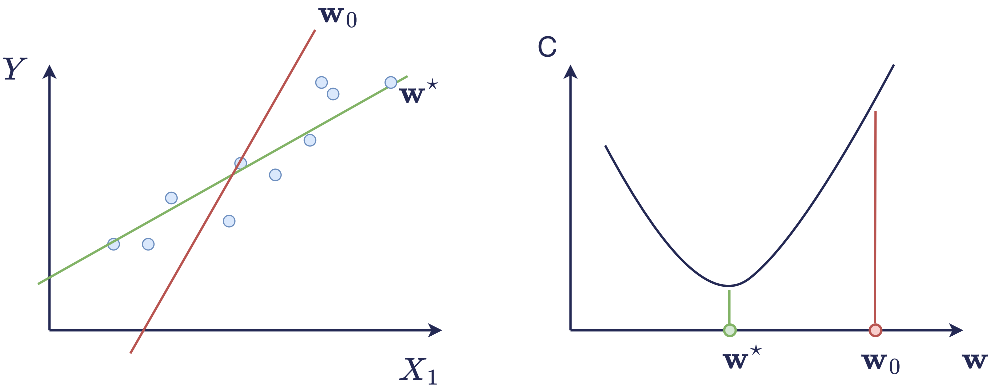
Résolution `w=np.linalg.solve(A,B)`

Un cadre idéal pour étudier la descente de gradient :

1. descente de gradient = solution approchée
2. descente de gradient = le 4x4 de l'optimisation :
   - on fait tout... Et parfois n'importe quoi

Gradient

Espace de description *vs* espace des paramètres



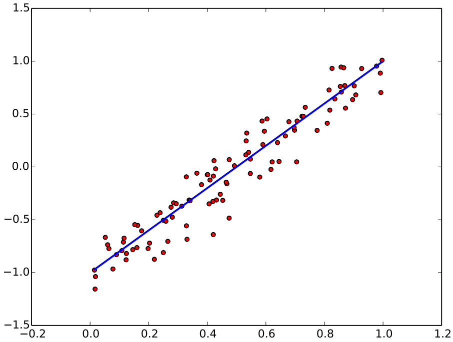
Algorithme itératif de la descente de grandient :

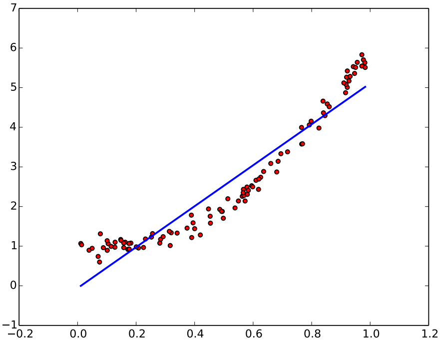
1. Initialiser $\mathbf{w}_0$
2. En boucle (avec mise à jour du gradient) :

$$\mathbf{w}^{t+1} = \mathbf{w}^t - \varepsilon \nabla_{\mathbf{w}} C$$

Extension

Passer à la regression non linéaire





Bonne nouvelle : le cadre précédent va nous permettre de passer facilement au cas non linéaire.

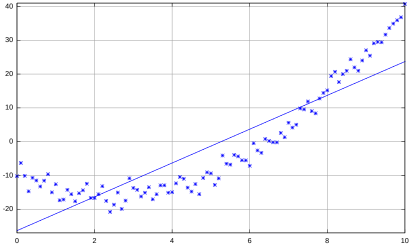
Transition facile

1. Transformer les données

$$Xinit = \begin{pmatrix} x_0 \\ x_1 \\ \vdots \\ x_n \end{pmatrix} \Rightarrow X = \begin{pmatrix} x_0^2 & x_0 & 1 \\ \vdots & \vdots & \\ x_n^2 & x_n & 1 \end{pmatrix}$$

2. Tout est fait !

$$\hat{Y} = X \cdot w, \qquad X \in \mathbb{R}^{n\times 3}, \qquad w = \begin{pmatrix} a \\ b \\ c \end{pmatrix} \in \mathbb{R}^2, \qquad \forall i,\ \hat{y}_i = ax_i^2 + bx_i + c$$



$\Rightarrow$