

Fiche d'auto-évaluation 12

June 3, 2021

1. Supposez de faire de la détection d'anomalies sur un jeu de données en utilisant l'algorithme des K-moyennes (K-means clustering). Pour choisir le nombre K de clusters, vous appliquez l'algorithme sur toutes les données, sans les diviser en données d'entraînement et de test, vous regardez le silhouette-score et vous choisissez le K qui le maximise. Est-il légitime de faire cela? Ou aurait-on dû appliquer l'algorithme des K-moyennes sur les données d'entraînement seulement?
2. Écrivez la formule de la silhouette-score et de l'inertie (inertia or total within-cluster variation).
3. Supposez de faire du clustering d'un jeu de données constitué des 4 points suivants: $A=(1,1)$, $B=(2,1)$, $C=(2,2)$, $D=(3,3)$. Représentez les points sur un graphe x-y et écrivez les étapes de l'algorithme des K-moyennes, étape par étape. Pour chaque étape, écrivez et représentez dans le graphe comment les centroides changent.
4. Écrivez la formule de l'importance des caractéristiques (feature importance) pour une forêt aléatoire (random forest).
5. Supposez d'utiliser une forêt aléatoire pour faire de la régression. Supposez de faire varier les nombres d'arbres et de mesurer l'erreur sur les données de test. Comment varie l'erreur par rapport au nombre des arbres? Dessinez une courbe hypothétique, qu'on pourrait observer avec des données réelles, avec x =nombre d'arbres, y =erreur.
6. Écrivez la formule de l'entropie, de l'index Gini d'impureté (Gini impurity index) et de gain d'information (information gain).
7. Si on entraîne un réseaux de neurones en Keras, avec plusieurs "seeds", obtient-on les mêmes poids? Pourquoi, exactement?
8. Pourquoi est-il important de répéter l'algorithme des K-moyennes, avec plusieurs initialisations des centroides?
9. Quelle est la différence entre des technique de sélection de caractéristiques (feature selection - donnez un exemple de technique vue dans le cours) et de réduction de la dimensionnalité?

10. La réduction de la dimensionnalité, est-elle une technique supervisée ou non-supervisée?
11. À quoi peut-être utile la réduction de la dimensionnalité?
12. Comment peut-on utiliser la réduction de la dimensionnalité pour la détection des anomalies?
13. Quand on applique l'analyse en composantes principales, comment choisit-on le nombre de composantes à retenir?
14. Écrivez la formule de décomposition en valeurs singulières (Singular Value Decomposition) d'une matrice de donnée \mathbf{A} . Écrivez les propriétés de chaque terme de la formule.
15. Si on fait une décomposition en valeurs singulières (Singular Value Decomposition) sur une matrice de données et on met en graphique le nombre de composantes vs. la variance capturée par ces composantes, quel est la forme du graphe que vous obtenez? Dessinez-le, approximativement.
16. Prenez une matrice de données \mathbf{A} et appliquez une décomposition en valeurs singulières (Singular Value Decomposition). Supposons que $\mathbf{A}^{(k)}$ est la matrice réduite, obtenue en retenant seulement k composantes. À quoi est égale la différence entre \mathbf{A} et $\mathbf{A}^{(k)}$, mesurée par la norme de Frobenius, c'est à dire $\|\mathbf{A} - \mathbf{A}^{(k)}\|_F$?
17. Qu'est-ce l'importance de permutation (Permutation Importance) et comment la calcule-t-on?
18. L'importance de permutation, donne-t-elle des informations sur le jeu de données (informations qui ne dépendent pas du modèle supervisé utilisé) ou sur le modèle supervisé?
19. Que prédit le Kaplan-Meier estimator? Est-il utile pour classer un type d'anomalie? Ou pour avoir une idée de la probabilité de faillite d'une machine?
20. Qu'est-ce que la fonction de survie (survival function) $S(t) = \Pr(T > t)$ signifie?
21. La fonction de survie $S(t) = \Pr(T > t)$ est-elle monotone? Si oui, décroissante ou croissante? Quelle est sa valeur pour $t = 0$? Et pour $t \rightarrow +\infty$?
22. Définissez la fonction de hasard (hazard function).
23. Donnez des exemples de modèles que nous avons vus pour estimer la fonction de survie et de hasard? Sont-ils des modèles supervisés ou non-supervisés?

24. Dans l'analyse de maintenance prédictive, donnez des exemples d'exemples censurés.
25. Qu'est-ce l'index de concordance (concordance index)? Créez un petit exemple où vous avez une suite de 3 événements et un modèle qui prédit l'ordre de ce 3 événements. Calculez l'index de concordance.
26. Vous êtes ingénieur de production dans une usine qui travaille à des processus à très hautes températures. Vous y avez installé deux modèles de capteurs et vous avez collecté les données relatives à leur fonctionnement. En particulier, vous avez noté quand les capteurs se cassent. Sur la base de ces informations historiques, vous voulez comparer leur qualité, en terme de résistance (probabilité de survie). Quelles courbes pouvez vous dessiner à ce propos, parmi celles vues en cours? Dessinez deux courbes hypothétiques, en imaginant qu'un modèle de capteur est plus résistant que l'autre.
27. Quelle est la différence entre mesures de réseaux passives et actives? Quels sont les avantages et les inconvénients?
28. Considérez un jeu de données où on veut faire de la classification binaire. Seriez vous capable de générer un tel jeu de données de façon à ce que n'importe quel modèle de classification ait une précision très basse (pas plus que 50% environs)?