

Cours: MAPSI

Charles Vin

2022

Nouveau cours du 13/09

1 Introduction

- Exam final : 50%
- Partiel : 35%
- Participation : 15%
 - travail dans la séance
 - TME soumis en fin de séance omg

Deux grand type de modèle :

- Modèle paramétrique : connaissance sur la distribution stat des données. Puis on estime les paramètres de la loi.
- Modèle non paramétrique : l'inverse, on ne connaît pas la loi. exemple : regression logistique

Echantillons :

- population
- ect

Définition 1.1. Vocabulaire :

- Voir diapo 9/51

Définition 1.2 (Mesure de proba). Une fonction qui associe chaque événement à une valeur entre 0 et 1. Voir diapo 15, définition importante.

Définition 1.3.

$$P(A \cup B) = P(A) + P(B) - P(A \cap B).$$

Densité de proba

Retrouver la définition.

Fonction de répartition

$$F(x) = P(X < x) = \int_{-\infty}^x f(x)dx.$$

Espérance :

$$E(X) = \sum x_k * p_k$$

$$E(X) = \int Xp(x)dx$$

$$E(aX + b) = aE(X) + b$$

$$E(X + Y) = E(X) + E(Y)$$

Le Mode

$$p(Mo) = \max_k p(x_k) p(Mo) = \max_x p(x)$$

Variance :

$$\sigma^2 = \sum (x_k - E(X))^2$$
$$\sigma^2 = \int (x - E(X))^2 p(x) dx$$
$$V(aX + b) = a^2 V(X)$$
$$V(X) = E(X^2) - E(X)^2$$

Médiane et quantile

idk diapo

Définition 1.4 (Loi marginale). La marginalisation consiste à projeter une loi jointe sur l'une des variables aléatoires. Par exemple extraire $P(A)$ à partir de $P(A, B)$.

$$P(A) = \sum_i P(A, B = pb_i).$$

C'est la somme de la ligne ou de la colonne du tableau.

Définition 1.5. Probabilités conditionnelles

$$P(A|B) = \frac{P(A \cap B)}{P(B)}$$
$$\Leftrightarrow P(A \cap B) = P(A|B)P(B)$$

Proposition 1.1. — Réversibilité : $P(A, B) = P(A|B)P(B)$

— Théorème de Bayes :

$$P(A|B) = \frac{P(B|A)P(A)}{P(B)}.$$

— Intégration des probabilités totale

— DIAPO 39

Définition 1.6 (Indépendance probabiliste). Deux événements A et B sont indépendants si

$$P(A, B) = P(A) * P(B).$$

Corollaire : $P(A|B) = P(A)$

Définition 1.7. La covariance

$$\text{cov}(X, Y) = E[(X - E(X))(Y - E(Y))].$$

Définition 1.8 (Coefficient de corrélation linéaire). Soit X,Y deux variables. Le coefficient de corrélation linéaire entre X et Y est :

$$r = \frac{\text{cov}(X, Y)}{\sigma_X \sigma_Y}.$$

CCL : VOIR DIAPO

— Probabilité

— Marginalisation

— Conditionnement

— Indépendance : Si X_1 et X_2 sont indépendantes : $P(X_1, X_2) = P(X_1)P(X_2)$

Nouveau cours du 20/09

Définition 1.9 (Indépendance de deux variables discrète). Discrète : Continue :

Définition 1.10 (Indépendance mutuelle de n variable). Soient n variables aléatoires (X_1, \dots, X_n) . Elle sont **mutuellement indépendantes** si tout événement lié à une partie d'entre elles est indépendant de tout événement lié à toute autre partie disjointe de la précédente. Propriété :

- Indépendance mutuelle \rightarrow Indépendance deux à deux. **Attention** : réciproque fausse
- \rightarrow Permet de réduire la taille du tableau des probabilités de chaque événement !

Définition 1.11 (Indépendance conditionnelles). On reprend les formules de l'indépendance mais en sachant une variable, au final c'est dans un cas particulier.

$$X \perp Y | Z$$

$$\forall x, \forall y, \forall z P(X = x \cap Y = y | Z = z) = P(X = x | Z = z) * P(Y = y | Z = z)$$

$$\rightarrow$$

$$\Rightarrow P(X, Y | Z) = P(X | Z) * P(Y | Z).$$

Définition 1.12. Loi normale

Proposition 1.2. - Moyenne linéaire et variance comme bilinéaire

$$X \sim \mathcal{N}(\mu, \sigma^2) \text{ alors } Y = aX + b \sim \mathcal{N}(a\mu + b, a^2\sigma^2).$$

- Centrer et réduire

$$Z = \frac{X - \mu}{\sigma} \sim \mathcal{N}(0, 1).$$

Définition 1.13 (Convergence en loi).

$$\forall x, \lim_{n \rightarrow \infty} F_n(x) = F(x).$$

On ne sais pas comment ça converge

Définition 1.14 (Convergence en probabilité). (X_n) **converge en probabilité** vers X si, pour tout $\epsilon > 0$ la probabilité que l'écart absolu entre X_n et X dépasse ϵ tend vers 0 quand $n \rightarrow \infty$

$$\lim_{n \rightarrow \infty} P(|X_n - X| \geq \epsilon) = 0.$$

Définition 1.15 (convergence presque sur). (X_n) **converge presque surement** vers X s'il y a une proba 1 que la suite des réalisations des X_n tende vers X

Définition 1.16 (Loi faible des grands nombre). Soit $(X_n)_{n \in \mathbb{N}}$ est une suite de variables aléatoires :

- De même loi
- D'espérance m
- Possédant une variance σ^2
- **Deux à deux** indépendante

Alors

$$\bar{X}_n = \frac{\sum_{k=1}^n X_k}{n} \rightarrow_{\mathbb{P}} m.$$

Rappel :

$$E(\bar{X}_n) = m$$

$$V(\bar{X}_n) = \frac{\sigma^2}{n}$$

Définition 1.17 (Loi forte des grands nombres). Soit $(X_n)_{n \in \mathbb{N}}$ est une suite de variables aléatoires :

- De même loi
- D'espérance m
- Possédant une variance σ^2
- **mutuellement** indépendante

Alors

$$\bar{X}_n = \frac{\sum_{k=1}^n X_k}{n} \rightarrow_{p.s} m.$$

Définition 1.18 (Théorème centrale limite). Soit $(X_n)_{n \in \mathbb{N}}$ est une suite de variables aléatoires :

- De même loi
- D'espérance μ
- Possédant une variance σ^2
- **mutuellement** indépendantes

Alors

$$\frac{\bar{X}_n - \mu}{\sigma/\sqrt{n}} \rightarrow_{loi} \mathcal{N}(0, 1).$$

Nouveau cours du 27/09

2 Maximum Vraisemblance

Définition 2.1 (Vraisemblance d'un échantillon). Soit $x = (x_1, \dots, x_n)$ réalisation de (X_1, \dots, X_n) **iid = Mutuellement indépendant** Alors on définit la vraisemblance dans le cas discret comme étant la proba d'obtenir **cet** échantillon sachant la loi P

$$L(x) = P(X_1 = x_1, \dots, X_n = x_n) = \prod_{i=1}^n P(X_i = x_i).$$

Dans le cas continu :

Exemple 2.1 (avec des pièces de monnaies). DIAPO 5

Exemple 2.2 (inondation). 3 type de parcelles : Inondables (PI), partiellement inondables (PPI), non inondable (NI) On a deux loi caractérisant le niveau de gris par rapport à la catégorie d'inondation.

$$P(n|PI) = \mathcal{N}(\mu_1, \sigma_1^2), P(n|PPI) = \mathcal{N}(\mu_2, \sigma_2^2).$$

Avec n le niveau de gris.

Soit une image Z avec un niveau de gris $n = 80$; Deux hypothèses

- θ_1 Z PI
- θ_2 Z PPI

On va calculer le max de vraisemblance d'obtenir la zone Z sous θ_1 ou θ_2

2.1 Maximum de vraisemblance

Exemple 2.3 (Pièce de monnaie). On va faire la même chose mais cette fois ci, on prend des paramètres θ_1 et θ_2

Définition 2.2 (Vraisemblance d'un échantillon). On cherche à estimer un paramètre Θ Soit $x = (x_1, \dots, x_n)$ réalisation de (X_1, \dots, X_n) **iid = Mutuellement indépendant** Alors on définit la vraisemblance dans le cas discret comme étant la proba d'obtenir **cet** échantillon sachant la loi P

$$L(x) = P(X_1 = x_1, \dots, X_n = x_n | \Theta = \theta) = \prod_{i=1}^n P(X_i = x_i | \Theta = \theta).$$

On peut utiliser la fonction de densité.

Définition 2.3 (Maximum vraisemblance). On cherche le maximum de la fonction $L(x, \theta), \forall \theta$. Donc on va la dériver! et utiliser le log

Exemple 2.4. Plein d'exemple dans le diapo

Exemple 2.5 (problème d'ajustement). On a des points un peu random, réparti comme un sinusode qu'on va approximer par un polynome. Problème : on a une erreur Normale.

il va vite. Mais ça ressemble à une regression.

2.2 Estimation par maximum a posteriori

Exemple 2.6 (Pièce de monnaie). Imaginons qu'on a un tirage de 3 piles. Le maximum de vraisemblance vaut 1. Mais ça va à l'encontre du bon sens. → Solution : Maximum a posteriori. (A voir pourquoi ça fait 1)

Définition 2.4 (Maximum a posteriori). On se base dans un modèle bayésien avec

- \mathcal{X} = l'espace des observations x de taille n
- Θ

Formule de la vraisemblance diapo 32.

Estimateur du maximum a posteriori toujours égal à l'argmax de la vraisemblance

$$x \mapsto t = \operatorname{Argmax}_{\theta \in \Theta} \pi(\theta|x).$$

Exemple 2.7 (pièce de monnaie). En fait la grosse différence c'est la dernière ligne du diapo 34. On pose, on invente l'information a priori de la proba de chaque paramètre qu'on vas tester. Cette information vas permettre d'être utiliser dans le modèle bayésien. On l'a choisi en fonction d'une loi normale. Fin du cours sans qu'il ait fini.

Nouveau cours du 04/10

3 Principes d'apprentissage avec donnée manquantes

- Solution ez : Supprimer les lignes avec des données manquantes. Problème, ça peut changer les probabilités qu'on peut apprendre.
- Remplacer les valeurs manquante par les plus probable : C'est équivalent à l'algo des K-Means. Mais pareil ça change les probas. Mais la valeur la plus probable peut quand même valoir 15% si notre variables aléatoire peut prendre beaucoup de valeur.
- Replacer les valeurs manquante par toutes les valeurs possible : marche pas non plus.
- Tenir compte de la distribution des valeur : mais ça change encore X
- **Solution algo EM** : Replacer les valeurs manquante par toutes les valeurs possible ponderers par leur probabilité d'apparition. Cette fois-ci les proba sont équivalente entre les deux tableaux.

Idée de K-MEans et EM :

- Se donner un modèle initial (pas trop mauvais)
- Ce modèle → Donne des données complétés
- Apprendre un nouveau modèle avec ces données
- Boucle

Y'a-t-il convergence ?

3.1 L'algorithme EM

Notation :

- x^o données observées, x^h données manquantes, $x = x^o \cup x^h$
- $M_{ij} = P(r_i^j \in x^h)$ proba de position des données manquantes

Plusieurs cas sur les proba de missing data :

- Missing Completely at Random (MCAR) : $P(M|x) = P(M)$ Aucune relation entre le fait qu'une donnée soit manquante ou observée
- Missing at Random (MAR) : $P(M|x) = P(M|x^o)$ données manquantes en relation avec les données observées mais pas avec les autres données manquantes
- Not Missing At Random (NMAR) : $P(M|x)$ données manquantes en relation avec toutes les données

On vas regarder que **MCAR**.

On calcule une log vraisemblance sur les données observées

$$\log L(x^o, \Theta) = \sum_{i=1}^n \log P(x_i^o | \Theta) = \sum_{i=1}^n \log \left(\sum_{x_i^h \in x^h} P(x_i^o, x_i^h | \Theta) \right)$$

On fait apparaitre les x^h avec la formule de somme loi marginale. Rappel : on leur a donnée des probas manuellement.

Soit $Q_i(x_i^h)$ une loi de proba **quelconque** alors on peut l'insérer dans l'équation pour ensuite utiliser l'équation de Jensen des fonction convexe/concave. Comme ça on vas pouvoir sortir la somme du log.

Bref, pour plus de détail sur les math voir le diapo, finalement on arrive diapo 16.

Algo EM :

1. Choisir valeur initiale
2. **Pour chaque ligne**, je fais le calcul diapo 17
3. Maximisation
4. Boucle tant que pas de convergence

En fait on converge vers un optimum **local** qui dépend du point initial. Donc du coup on en test plein

Exemple 3.1. DIAPO 18

1. On est pas obligé de faire cette méthode d'initialisation. C'est juste une sorte d'indication mais au final on définit encore en random après
- 2.

Pourquoi ça converge? Grâce à l'inégalité de Jensen et la concavité du log. Voir diapo 26 et 27.

4 Mixure de gaussiennes

Les données suivent plusieurs gaussiennes différentes?

Exemple 4.1 (application : apprentissage de prix fonciers). On a un échantillon de prix de logement avec leur caractéristique et le quartier. Le prix est sur une gaussienne de paramètre variant en fonction du quartier. (Je suis pas sûr de si on a l'info sur le quartier, je crois on cherche à la prédire avec de l'apprentissage non-supervisé)

On peut tenter de calculer directement ça je crois mais bref ça marche pas, pas de solution analytique. Solution → EM

On crée une colonne vide, pleine de valeurs manquantes pour le quartier et on va faire EM dessus. C'est assez drôle on crée des données à partir de rien.

Exemple 4.2 (Classification d'image). Deux dernières diapos

Nouveau cours du 11/10

5 Tests d'hypothèses

tout comme l'année dernière