

Transport optimal entropique

D'abord j'introduirai le problème de Monge-Kantorovitch en version discrète, problème qui est le problème central du transport optimal. J'aborderai ensuite la notion d'entropie et d'entropie relative et je discuterai brièvement de ses propriétés et de son interprétation. Cela nous permettra d'introduire le problème de transport optimal avec pénalisation entropique qui correspond à une version "régularisée" du problème de transport initial. Après quoi, je présenterai l'algorithme de Sinkhorn et je ferai le lien entre cet algorithme et le problème de transport entropique. Finalement, j'aborderai la question de sa vitesse de convergence.