



Université de Montpellier

Projet M1 SSD

Un modèle pour les nids de mouettes

Rédigé par

CARVAILLO Thomas

CÔME Olivier

PRALON Nicolas

Encadrante : Elodie BRUNEL-PICCININI

23 avril 2022

Table des matières

Introduction	2
1 Modélisation du problème	3
1.1 Modélisation du problème	3
1.2 Un cas élémentaire	5
1.3 Le cas réel	6
2 L'algorithme EM	10
2.1 Quelques preuves	10
2.2 Pseudo code de l'algorithme EM	12
Bibliographie	13
A Annexe	14

Introduction

Chapitre 1

Modélisation du problème

1.1 Modélisation du problème

Nous allons pour commencer donner une première définition, qui est au coeur du présent projet.

Définition 1 (Loi de mélange). On appelle loi de mélange toute loi dont la densité s'écrit sous la forme d'une combinaison convexe de diverses densités. C'est-à-dire que si l'on se donne J variables aléatoires X_1, \dots, X_J de densité respective $f_1(x), \dots, f_J(x)$, alors est appelée loi de mélange toute variable aléatoire X dont la densité f s'exprime sous la forme

$$f(x) := \sum_{i=1}^J \alpha_i f_i(x), \alpha_i \in \mathbb{R}$$

Afin de modéliser commodément le problème, nous introduisons les variables aléatoires suivantes :

- ✂ La variable aléatoire X , modélisant la taille des nids
- ✂ Et Z , la variable aléatoire représentant l'espèce de mouette qui a construit le nid

Enfin, nous nous placerons sous les hypothèses suivantes :

Hypothèse 1. Nous supposons que, $\forall j \in \llbracket 1, J \rrbracket$, la taille des nids d'une espèce j (*i.e.* X conditionnellement à $(Z = j)$) suit une loi normale $\mathcal{N}(\mu_j, v_j)$. Nous dénoterons par $\gamma_{\mu_j, v_j}(x)$ cette densité.

Hypothèse 2. Soit $\Theta := \{\theta = (\alpha_j, \mu_j, v_j)_{1 \leq j \leq J} \text{ tels que } \alpha_j > 0 \forall j \in \llbracket 1, J \rrbracket \text{ et } \sum_{j=1}^J \alpha_j = 1\}$. Soient X_1, \dots, X_n un échantillon de même loi que X . On supposera qu'il existe un $\theta \in \Theta$ tel que les données récoltées, ici les tailles des nids, soient la réalisation du précédent échantillon.

Proposition 1. La variable Z est discrète et à valeur dans un sous-ensemble fini de \mathbb{N} , elle suit donc une loi

$$\sum_{j=1}^J \alpha_j \delta_j$$

où J représente le nombre d'espèce de mouettes considéré et les $\alpha(j)$ sont des réels, positifs stricts, représentant la proportion de nids de l'espèce j , tels que $\sum_{i=1}^J \alpha_j = 1$.

Il s'ensuit la proposition suivante, qui sera la racine du présent projet.

Proposition 2. La distribution de la taille des nids de mouettes, *i.e.* X , admet pour densité, au point x et par rapport à la mesure de Lebesgue sur \mathbb{R} , la fonction f_θ définie comme suit

$$f_\theta(x) = \sum_{j=1}^J \alpha_j \gamma_{\mu_j, v_j}(x)$$

Démonstration. On vérifie que l'on obtient bien une densité de probabilité, la forme de cette dernière étant la conséquence directe de la définition de la variable aléatoire X :

$$\int_{\mathbb{R}} f_{\theta}(x) dx = \int_{\mathbb{R}} \sum_{j=1}^J \alpha_j \gamma_{\mu_j, v_j}(x) dx = \sum_{j=1}^J \alpha_j \int_{\mathbb{R}} \gamma_{\mu_j, v_j}(x) dx = \sum_{j=1}^J \alpha_j = 1$$

2

Le but de ce projet sera d'étudier des méthodes permettant l'estimation des divers paramètres de cette densité. Nous dénoterons par $\theta := (\alpha_j, \mu_j, v_j)_{1 \leq j \leq J}$ les vecteurs des ces dits paramètres.

Notation 1 (Densités). Le vecteur θ ayant été dûment introduit, nous noterons

1. $\mathbb{P}_{\theta}(Z = j) := \alpha_j$ la probabilité que la variable aléatoire Z prenne la valeur j
2. $f_{\theta}(x|Z = j) := \gamma_{\mu_j, v_j}(x)$ la densité de la loi de X sachant Z

qui sont, respectivement, contre la mesure de comptage sur \mathbb{N} , et par rapport à la mesure de Lebesgue sur \mathbb{R} ,

Introduisons deux dernières densités, qui nous seront fort utile quant à l'expression des Log-vraisemblances conditionnelles :

Proposition 3 (Loi de densité du vecteur (X, Z) et loi de densité de Z sachant X). *La densité du vecteur aléatoire (X, Z) est donnée par :*

$$\begin{aligned} h_{\theta} : (R \times \{1, \dots, J\}) &\rightarrow R_+ \\ (x, z) &\mapsto \alpha_j \times \gamma_{\mu_j, v_j}(x) \end{aligned}$$

Démonstration. En utilisant la réciproque du théorème de transfert et la densité conditionnelle de X sachant Z et Z sachant X , on obtient ainsi :

$$\begin{aligned} \mathbb{E}[h(X, Z)] &= \int_{R \times \{1, \dots, J\}} h(x, z) \times h_{\theta}(x, z) d\lambda(x) \times dN(z) \\ &= \int_{R \times \{1, \dots, J\}} h(x, z) \times f_{X|Z}(x) f_Z(z) d\lambda(x) \times dN(z) \\ &= \int_{R \times \{1, \dots, J\}} h(x, z) \times \gamma_{m(z), v(z)}(x) \alpha_z d\lambda(x) \times dN(z) \\ &= \int_{R \times \{1, \dots, J\}} h(x, z) \times f_{Z|X}(z) f_X(x) d\lambda(x) \times dN(z) \end{aligned}$$

Par identification on en déduit, la densité du couple (X, Z)

$$\begin{aligned} f_{Z|X}(z) f_X(x) &= f_{X|Z}(x) f_Z(z) \\ &= \gamma_{m(z), v(z)} \times \alpha_z \end{aligned}$$

et puis la de densité conditionnelle de Z sachant X

$$f_{Z|X}(z) = \frac{\gamma_{m(z), v(z)} \times \alpha_z}{\sum_{i=1}^J \alpha_i \times \gamma_{m(i), v(i)}(x)}$$

2

Remarque 1. Nous pouvons dès à présent noter que pour un échantillon X_1, \dots, X_n de même loi que X , nous avons

$$\forall i \in \llbracket 1, n \rrbracket, h_{\theta}(X_i, j) = f_{\theta}(X_i) \times \mathbb{P}_{\theta}(Z = j | X = X_i)$$

Ceci nous sera utile dans la suite.

Nous allons dès à présent nous intéresser à l'estimation de ces paramètres.

1.2 Un cas élémentaire

Regardons dans un premier temps un cas simplifié, un cas ne décrivant pas la réalité des observations mais qui a le mérite de constituer une agréable entrée en matière.

Nous supposons ici qu'ont été relevés simultanément et les mesures des tailles des nids et l'espèce de mouette qui l'a construit. Le modèle ici considéré est donc composé des couples (X_i, Z_i) , $i \in \llbracket 1, n \rrbracket$. On considérera dès lors la fonction de densité $h_\theta(x, z)$.

L'estimation des divers paramètres est alors élémentaire, en témoigne les propositions suivantes :

Proposition 4 (Fonction de Log-vraisemblance). *La Log-vraisemblance du modèle s'écrit*

$$\mathcal{L}_\theta(X_1, \dots, X_n, Z_1, \dots, Z_n) = \sum_{j=1}^J \#A_j \ln(\alpha_j) + \sum_{j=1}^J \sum_{i \in A_j} \ln(\gamma_{\mu_j, v_j}(X_i))$$

où les A_j sont définis par $A_j := \{i \in \llbracket 1, n \rrbracket \text{ tels que } Z_i = j\}$ i.e. $\bigcup_{j=1}^J A_j = \llbracket 1, n \rrbracket$

Démonstration. La Log-vraisemblance du modèle s'écrit :

$$\begin{aligned} \mathcal{L}_\theta(X_1, \dots, X_n, Z_1, \dots, Z_n) &= \ln \left(\prod_{i=1}^n h_\theta(X_i, Z_i) \right) \\ &= \ln \left(\prod_{i=1}^n \alpha_{Z_i} \gamma_{\mu_{Z_i}, v_{Z_i}}(X_i) \right) \\ &= \sum_{i=1}^n \ln(\alpha_{Z_i}) + \ln(\gamma_{\mu_{Z_i}, v_{Z_i}}(X_i)) \end{aligned}$$

Z_i est à valeur dans $\llbracket 1, J \rrbracket$, on partitionne donc $I := \llbracket 1, n \rrbracket$ comme $I = \bigcup_{j=1}^J A_j$ pour obtenir

$$\begin{aligned} \mathcal{L}_\theta(X_1, \dots, X_n, Z_1, \dots, Z_n) &= \sum_{j=1}^J \sum_{i \in A_j} \ln(\alpha_{Z_i}) + \sum_{j=1}^J \sum_{i \in A_j} \ln(\gamma_{\mu_j, v_j}(X_i)) \\ &= \sum_{j=1}^J \sum_{i \in A_j} \ln(\alpha_j) + \sum_{j=1}^J \sum_{i \in A_j} \ln(\gamma_{\mu_j, v_j}(X_i)) \\ &= \sum_{j=1}^J \#A_j \ln(\alpha_j) + \sum_{j=1}^J \sum_{i \in A_j} \ln(\gamma_{\mu_j, v_j}(X_i)) \end{aligned}$$

2

Nous pouvons dès lors maximiser la log-vraisemblance afin d'obtenir les estimateurs souhaités :

Proposition 5 (Estimateurs). *Les estimateurs du maximum de vraisemblance $\hat{\alpha}_j$ (resp. $\hat{\mu}_j$, et \hat{v}_j) de α_j (resp. μ_j et v_j) sont donnés par*

$$\begin{aligned} \hat{\alpha}_j &= \frac{\#A_j}{n} \\ \hat{\mu}_j &= \frac{\sum_{i \in A_j} X_i}{\#A_j} \\ \hat{v}_j &= \frac{\sum_{i \in A_j} (X_i - \hat{\mu}_j)^2}{\#A_j} \end{aligned}$$

Démonstration. Soit $\theta = (\alpha_j, \mu_j, v_j)_{j \in \llbracket 1, J \rrbracket}$. Il s'agit de déterminer

$$\operatorname{argmax}_{\theta \in \mathbb{R}^{3J}, \sum_{j=1}^J \alpha_j = 1} \left(\sum_{j=1}^J \#A_j \ln(\alpha_j) + \sum_{j=1}^J \sum_{i \in A_j} \ln(\gamma_{\mu_j, v_j}(x_i)) \right)$$

Nous avons donc à résoudre un programme de minimisation d'une fonction convexe sur un convexe avec une contrainte égalité, il est ainsi naturel de faire appel au Lagrangien. Ce dernier s'écrit

$$\begin{aligned} L(\theta) &= \sum_{j=1}^J \#A_j \ln(\alpha_j) + \sum_{j=1}^J \sum_{i \in A_j} \ln(\gamma_{\mu_j, v_j}(x_i)) - \lambda \times \left(\sum_{j=1}^J \alpha_j - 1 \right) \\ &= \sum_{j=1}^J \#A_j \ln(\alpha_j) + \sum_{j=1}^J \sum_{i \in A_j} \ln \left(\frac{1}{\sqrt{2\pi v_j}} \exp \left(-\frac{(x_i - \mu_j)^2}{2v_j} \right) \right) - \lambda \times \left(\sum_{j=1}^J \alpha_j - 1 \right) \\ &= \sum_{j=1}^J \#A_j \ln(\alpha_j) + \sum_{j=1}^J \sum_{i \in A_j} \left(\frac{-1}{2} \ln(2\pi v_j) - \frac{(x_i - \mu_j)^2}{2v_j} \right) - \lambda \times \left(\sum_{j=1}^J \alpha_j - 1 \right) \end{aligned}$$

Il reste maintenant à résoudre le système suivant, afin d'obtenir le vecteur $\hat{\theta} := (\hat{\alpha}_j, \hat{\mu}_j, \hat{v}_j)_{j \in \llbracket 1, J \rrbracket}$ solution du programme.

$$\begin{cases} \frac{\#A_j}{\hat{\alpha}_j} - \lambda &= 0 \quad \forall j \in \llbracket 1, J \rrbracket \\ \sum_{i \in A_j} (x_i - \hat{\mu}_j) / \hat{v}_j &= 0 \quad \forall j \in \llbracket 1, J \rrbracket \\ \sum_{i \in A_j} \frac{-0.5 \times 2 \times \pi}{2\pi \hat{v}_j} + \frac{(x_i - \hat{\mu}_j)^2}{2\hat{v}_j^2} &= 0 \quad \forall j \in \llbracket 1, J \rrbracket \\ \sum_{j=1}^J \hat{\alpha}_j &= 1 \end{cases}$$

Ceci équivaut à

$$\begin{cases} \frac{\#A_j}{\hat{\alpha}_j} &= \lambda \quad \forall j \in \llbracket 1, J \rrbracket \\ \sum_{i \in A_j} x_i &= \sum_{i \in A_j} \hat{\mu}_j \quad \forall j \in \llbracket 1, J \rrbracket \\ \sum_{i \in A_j} (x_i - \hat{\mu}_j)^2 &= \sum_{i \in A_j} \hat{v}_j \quad \forall j \in \llbracket 1, J \rrbracket \\ \sum_{j=1}^J \hat{\alpha}_j &= 1 \end{cases} \Leftrightarrow \begin{cases} \frac{\#A_j}{\hat{\alpha}_j} &= \lambda \quad \forall j \in \llbracket 1, J \rrbracket \\ \sum_{i \in A_j} \frac{x_i}{\#A_j} &= \hat{\mu}_j \quad \forall j \in \llbracket 1, J \rrbracket \\ \sum_{i \in A_j} \frac{(x_i - \hat{\mu}_j)^2}{\#A_j} &= \hat{v}_j \quad \forall j \in \llbracket 1, J \rrbracket \\ \sum_{j=1}^J \hat{\alpha}_j &= 1 \end{cases}$$

En sommant les J premières lignes du système, on obtient $\sum_{j=1}^J \#A_j = \sum_{j=1}^J \hat{\alpha}_j \lambda$, i.e. $\lambda = n$. En injectant ceci dans le précédent système, on obtient finalement ce qui était annoncé :

$$\begin{cases} \hat{\alpha}_j &= \frac{\#A_j}{n} \quad \forall j \in \llbracket 1, J \rrbracket \\ \hat{\mu}_j &= \sum_{i \in A_j} \frac{x_i}{\#A_j} \quad \forall j \in \llbracket 1, J \rrbracket \\ \hat{v}_j &= \sum_{i \in A_j} \frac{(x_i - \hat{\mu}_j)^2}{\#A_j} \quad \forall j \in \llbracket 1, J \rrbracket \end{cases}$$

1.3 Le cas réel

Nous nous placerons désormais dans un contexte tout autre que celui du paragraphe précédent, un contexte correspondant davantage à la réalité. Dans ce qui suit, nous supposons que ne sont observées que les tailles des

nids, les diverses espèces de mouettes les ayant construit étant en quelques sortes des données "cachées". Nous avons donc un échantillon X_1, \dots, X_n de même loi que la variable X comme définie ci-dessus. On définit \mathcal{L}_{obs} la log-vraisemblance des observations, nous obtenons ainsi

Définition 2. La log-vraisemblance des observations s'écrit

$$\mathcal{L}_{obs}(\theta, X_1, \dots, X_n) := \ln \left(\prod_{i=1}^n f_{\theta}(X_i) \right) = \sum_{i=1}^n \ln \left(\sum_{j=1}^J \alpha_j \gamma_{\mu_j, v_j}(X_i) \right)$$

Nous voyons dès lors que l'existence d'une expression analytique du maximum de la log-vraisemblance n'est pas assurée. Il est donc nécessaire de trouver un moyen d'approcher les valeurs des différents estimateurs. Pour ce faire, on définit une log-vraisemblance des couples (X_i, Z_i) sachant le vecteurs des observations X_1, \dots, X_n .

Proposition 6 (log-vraisemblance conditionnelle). *On définit la log-vraisemblance $\mathcal{L}_c(\theta, \tilde{\theta}, X_1, \dots, X_n)$ conditionnelle par*

$$\mathcal{L}_c(\theta, \tilde{\theta}, X_1, \dots, X_n) = \mathbb{E}_{\tilde{\theta}}[\mathcal{L}_{\theta}(X_1, \dots, X_n, Z_1, \dots, Z_n) | X_1, \dots, X_n]$$

Proposition 7. *On a*

$$\mathcal{L}_c(\theta, \tilde{\theta}, X_1, \dots, X_n) = \sum_{i=1}^n \sum_{j=1}^J \ln(h_{\theta}(X_i, j)) \mathbb{P}_{\tilde{\theta}}(Z = j | X = X_i)$$

Démonstration. En effet

$$\begin{aligned} \mathcal{L}_c(\theta, \tilde{\theta}, X_1, \dots, X_n) &= \mathbb{E}_{\tilde{\theta}}[\mathcal{L}_{\theta}(X_1, \dots, X_n, Z_1, \dots, Z_n) | X_1, \dots, X_n] \\ &= \mathbb{E}_{\tilde{\theta}} \left[\ln \left(\prod_{i=1}^n h_{\theta}(X_i, Z_i) \right) | X_1, \dots, X_n \right] \\ &= \sum_{i=1}^n \mathbb{E}_{\tilde{\theta}}[\ln(h_{\theta}(X_i, Z_i)) | X_1, \dots, X_n] \end{aligned}$$

Or, les couples (X_i, Z_i) sont indépendants, donc

$$\begin{aligned} \mathcal{L}_c(\theta, \tilde{\theta}, X_1, \dots, X_n) &= \sum_{i=1}^n \mathbb{E}_{\tilde{\theta}}[\ln(h_{\theta}(X_i, Z_i)) | X_i] \\ &= \sum_{i=1}^n \sum_{j=1}^J \ln(h_{\theta}(X_i, j)) \mathbb{P}_{\tilde{\theta}}(Z = j | X = X_i) \end{aligned}$$

2

Proposition 8 (Expression log-vraisemblance conditionnelle). *La fonction \mathcal{L}_c se réécrit sous la forme suivante :*

$$\begin{aligned} \mathcal{L}_c(\theta, \tilde{\theta}, \bar{X}) &= -\frac{n}{2} \log(2\pi) + \sum_{j=1}^J \left(\sum_{i=1}^n \mathbb{P}_{\tilde{\theta}}(Z = j | X = X_i) \right) \log(\alpha(j)) \\ &\quad - \frac{1}{2} \sum_{j=1}^J \left(\sum_{i=1}^n \mathbb{P}_{\tilde{\theta}}(Z = j | X = X_i) \right) \left(\log(v(j)) + \frac{(X_i - m(j))^2}{v(j)} \right) \end{aligned}$$

Démonstration. Il suffit de partir de la forme précédente de la log-vraisemblance conditionnelle, on a ainsi :

$$\begin{aligned}
\mathcal{L}_c(\theta, \tilde{\theta}, \bar{X}) &= \sum_{i=1}^n \sum_{j=1}^J \ln(h_{\theta}(X_i, j)) \mathbb{P}_{\tilde{\theta}}(Z = j | X = X_i) \\
&= \sum_{i=1}^n \sum_{j=1}^J \ln(\alpha(j) \gamma_{m(j), v(j)}(X_i)) \times \mathbb{P}_{\tilde{\theta}}(Z = j | X = X_i) \\
&= \sum_{i=1}^n \sum_{j=1}^J (\ln(\alpha(j)) + \ln(\gamma_{m(j), v(j)}(X_i))) \times \mathbb{P}_{\tilde{\theta}}(Z = j | X = X_i) \\
&= \sum_{i=1}^n \sum_{j=1}^J \ln(\alpha(j)) \mathbb{P}_{\tilde{\theta}}(Z = j | X = X_i) + \sum_{i=1}^n \sum_{j=1}^J \ln(\gamma_{m(j), v(j)}(X_i)) \mathbb{P}_{\tilde{\theta}}(Z = j | X = X_i)
\end{aligned}$$

Traitons la double somme $\sum_{i=1}^n \sum_{j=1}^J \ln(\gamma_{m(j), v(j)}(X_i)) \mathbb{P}_{\tilde{\theta}}(Z = j | X = X_i)$ on a :

$$\gamma_{m(j), v(j)}(X_i) = \frac{1}{\sqrt{2\pi v(j)}} e^{-\frac{1}{2} \frac{(X_i - m(j))^2}{v(j)}}$$

$$\mathbb{P}_{\tilde{\theta}}(Z = j | X = X_i) = \frac{\alpha(j) \gamma_{m(j), v(j)}(X_i)}{\sum_{i=1}^J \alpha(j) \gamma_{m(i), v(i)}(X_i)}$$

La double somme devient alors

$$\begin{aligned}
&\sum_{i=1}^n \sum_{j=1}^J \ln \left(\frac{1}{\sqrt{2\pi v(j)}} e^{-\frac{1}{2} \frac{(X_i - m(j))^2}{v(j)}} \right) \mathbb{P}_{\tilde{\theta}}(Z = j | X = X_i) \\
&= \sum_{i=1}^n \sum_{j=1}^J \ln \left(\frac{1}{\sqrt{2\pi v(j)}} \right) \mathbb{P}_{\tilde{\theta}}(Z = j | X = X_i) - \frac{1}{2} \left(\frac{(X_i - m(j))^2}{v(j)} \right) \mathbb{P}_{\tilde{\theta}}(Z = j | X = X_i) \\
&= \sum_{i=1}^n \sum_{j=1}^J -\frac{1}{2} \ln(2\pi) \mathbb{P}_{\tilde{\theta}}(Z = j | X = X_i) - \frac{1}{2} \ln(v(j)) \mathbb{P}_{\tilde{\theta}}(Z = j | X = X_i) - \frac{1}{2} \left(\frac{(X_i - m(j))^2}{v(j)} \right) \mathbb{P}_{\tilde{\theta}}(Z = j | X = X_i) \\
&= -\frac{n}{2} \ln(2\pi) - \frac{1}{2} \sum_{i=1}^n \sum_{j=1}^J \left(\ln(v(j)) + \frac{(X_i - m(j))^2}{v(j)} \right) \mathbb{P}_{\tilde{\theta}}(Z = j | X = X_i) \\
&= -\frac{n}{2} \ln(2\pi) - \frac{1}{2} \sum_{j=1}^J \left(\sum_{i=1}^n \mathbb{P}_{\tilde{\theta}}(Z = j | X = X_i) \right) \left(\ln(v(j)) + \frac{(X_i - m(j))^2}{v(j)} \right)
\end{aligned}$$

On obtient bien le résultat espéré :

$$\begin{aligned}
\mathcal{L}_c(\theta, \tilde{\theta}, \bar{X}) &= -\frac{n}{2} \log(2\pi) + \sum_{j=1}^J \left(\sum_{i=1}^n \mathbb{P}_{\tilde{\theta}}(Z = j | X = X_i) \right) \log(\alpha(j)) \\
&\quad - \frac{1}{2} \sum_{j=1}^J \left(\sum_{i=1}^n \mathbb{P}_{\tilde{\theta}}(Z = j | X = X_i) \right) \left(\log(v(j)) + \frac{(X_i - m(j))^2}{v(j)} \right)
\end{aligned}$$

2

Proposition 9 (Estimateurs du maximum de la log-vraisemblance conditionnelle). *La fonction $\theta \mapsto \mathcal{L}_c(\theta, \tilde{\theta}, \bar{X})$ admet un unique maximum θ_M donné par :*

$$\begin{aligned}
\alpha_M(j) &= \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n \mathbb{P}_{\tilde{\theta}}(Z = j | X = X_i) \\
m_M(j) &= \frac{\sum_{i=1}^n X_i \mathbb{P}_{\tilde{\theta}}(Z = j | X = X_i)}{\sum_{i=1}^n \mathbb{P}_{\tilde{\theta}}(Z = j | X = X_i)} \\
v_M(j) &= \frac{\sum_{i=1}^n (X_i - m(j))^2 \mathbb{P}_{\tilde{\theta}}(Z = j | X = X_i)}{\sum_{i=1}^n \mathbb{P}_{\tilde{\theta}}(Z = j | X = X_i)}
\end{aligned}$$

Démonstration.

28

Chapitre 2

L'algorithme EM

2.1 Quelques preuves

Théorème 1. Soit $(\theta_k)_{k \in \mathbb{N}}$ la suite de paramètres construite à l'aide de l'algorithme EM. La log-vraisemblance \mathcal{L}_{obs} des observations vérifie

$$\mathcal{L}_{obs}(\theta_{k+1}, X_1, \dots, X_n) \geq \mathcal{L}_{obs}(\theta_k, X_1, \dots, X_n)$$

Démonstration. Nous allons commencer cette preuve en donnant une autre forme de la log-vraisemblance, dépendant de $\mathcal{L}_{obs}(\theta, X_1, \dots, X_n)$ et d'un terme $\kappa_{\theta, \theta_k}$. Nous avons :

$$\begin{aligned} \mathcal{L}_c(\theta, \theta_k, X_1, \dots, X_n) &= \sum_{i=1}^n \sum_{j=1}^J \ln(h_\theta(X_i, j)) \mathbb{P}_{\theta_k}(Z = j | X = X_i) \\ &= \sum_{i=1}^n \sum_{j=1}^J \ln[f_\theta(X_i) \times \mathbb{P}_\theta(Z = j | X = X_i)] \mathbb{P}_{\theta_k}(Z = j | X = X_i) \\ &= \sum_{i=1}^n \sum_{j=1}^J \ln(f_\theta(X_i)) \mathbb{P}_{\theta_k}(Z = j | X = X_i) + \sum_{i=1}^n \sum_{j=1}^J \ln(\mathbb{P}_\theta(Z = j | X = X_i)) \mathbb{P}_{\theta_k}(Z = j | X = X_i) \\ &= \sum_{i=1}^n \ln(f_\theta(X_i)) \times \underbrace{\sum_{j=1}^J \mathbb{P}_{\theta_k}(Z = j | X = X_i)}_{=1} + \sum_{i=1}^n \sum_{j=1}^J \ln(\mathbb{P}_\theta(Z = j | X = X_i)) \mathbb{P}_{\theta_k}(Z = j | X = X_i) \\ &= \sum_{i=1}^n \ln(f_\theta(X_i)) + \sum_{i=1}^n \sum_{j=1}^J \ln(\mathbb{P}_\theta(Z = j | X = X_i)) \mathbb{P}_{\theta_k}(Z = j | X = X_i) \\ &= \mathcal{L}_{obs}(\theta, X_1, \dots, X_n) + \kappa_{\theta, \theta_k} \end{aligned}$$

Dès lors, on obtient

$$\mathcal{L}_{obs}(\theta_{k+1}, X_1, \dots, X_n) - \mathcal{L}_{obs}(\theta_k, X_1, \dots, X_n) = \mathcal{L}_c(\theta_{k+1}, \theta_k, X_1, \dots, X_n) - \kappa_{\theta_{k+1}, \theta_k} - \mathcal{L}_c(\theta_k, \theta_k, X_1, \dots, X_n) + \kappa_{\theta_k, \theta_k}$$

Or, la quantité \mathcal{L}_c est maximisée en θ_{k+1} lors de l'étape M de l'algorithme, donc

$$\mathcal{L}_c(\theta_{k+1}, \theta_k, X_1, \dots, X_n) - \mathcal{L}_c(\theta_k, \theta_k, X_1, \dots, X_n) \geq 0$$

Il reste donc à prouver que

$$\kappa_{\theta_k, \theta_k} - \kappa_{\theta_{k+1}, \theta_k} \geq 0$$

En effet, nous avons

$$\begin{aligned}
\kappa_{\theta_k, \theta_k} - \kappa_{\theta_{k+1}, \theta_k} &= \sum_{i=1}^n \sum_{j=1}^J \ln(\mathbb{P}_{\theta_k}(Z = j|X = X_i)) \mathbb{P}_{\theta_k}(Z = j|X = X_i) \\
&\quad - \sum_{i=1}^n \sum_{j=1}^J \ln(\mathbb{P}_{\theta_{k+1}}(Z = j|X = X_i)) \mathbb{P}_{\theta_k}(Z = j|X = X_i) \\
&= \sum_{i=1}^n \sum_{j=1}^J \ln\left(\frac{\mathbb{P}_{\theta_k}(Z = j|X = X_i)}{\mathbb{P}_{\theta_{k+1}}(Z = j|X = X_i)}\right) \mathbb{P}_{\theta_k}(Z = j|X = X_i) \\
&= - \sum_{i=1}^n \sum_{j=1}^J \ln\left(\frac{\mathbb{P}_{\theta_{k+1}}(Z = j|X = X_i)}{\mathbb{P}_{\theta_k}(Z = j|X = X_i)}\right) \mathbb{P}_{\theta_k}(Z = j|X = X_i) \\
&\geq - \sum_{i=1}^n \ln\left(\sum_{j=1}^J \frac{\mathbb{P}_{\theta_{k+1}}(Z = j|X = X_i)}{\mathbb{P}_{\theta_k}(Z = j|X = X_i)} \mathbb{P}_{\theta_k}(Z = j|X = X_i)\right)
\end{aligned}$$

[Cette dernière inégalité est due à la convexité du \log et au fait que $\sum_{j=1}^J \mathbb{P}_{\theta_k}(Z = j|X) = 1$]

$$\begin{aligned}
&= - \sum_{i=1}^n \ln\left(\sum_{j=1}^J \mathbb{P}_{\theta_{k+1}}(Z = j|X = X_i)\right) \\
&= - \sum_{i=1}^n \ln(1) \\
&= 0
\end{aligned}$$

On obtient ainsi

$$\kappa_{\theta_k, \theta_k} - \kappa_{\theta_{k+1}, \theta_k} \geq 0$$

Et finalement

$$\mathcal{L}_{obs}(\theta_{k+1}, X_1, \dots, X_n) \geq \mathcal{L}_{obs}(\theta_k, X_1, \dots, X_n)$$

2

Théorème 2 (Non monotonie de la vraisemblance).

2.2 Pseudo code de l'algorithme EM

Pour l'implémentation de cet algorithme, nous nous sommes appuyés sur le pseudo-code suivant.

Algorithm 1 L'algorithme EM (Dempster et al., 1977).

Entrée(s) : $N \in \mathbb{N}$, $\hat{\theta}_0 \in \Theta$, un jeu de données $x_1 \dots x_n$;

Initialisation ;

1: $k := 1$;

2: **Tant que** $K < N + 1$ **faire**

3: **ETAPE E :** *Calculer la fonction* $Q(\theta; \hat{\theta}_{k-1}) = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n \mathbb{E}_{\hat{\theta}_{k-1}} [\log f(X_i, Z_i, \theta) | X_i = x_i]$;

4: **ETAPE M :** $\hat{\theta}_k = \operatorname{argmax} Q(\theta; \hat{\theta}_{k-1})$;

5: $k \leftarrow k + 1$;

6: **fin du Tant que ;**

7: **retourner** $\hat{\theta}_N$;

Bibliographie

Liens utiles

<https://www.lpsm.paris/pageperso/rebafka/BookGraphes/algorithmem.html>
<https://members.loria.fr/moberger/Enseignement/AVR/Exposes/algo-em.pdf>
http://faculty.washington.edu/fxia/courses/LING572/EM_collins97.pdf
<https://core.ac.uk/download/pdf/155777956.pdf>
<http://www.cmap.polytechnique.fr/~bansaye/CoursTD6.pdf>

Annexe A

Annexe