
COMPTE-RENDU DU DEVOIR 1

Vincent Matthys

1 Learning in discrete graphical models

Etant donné que z et x sont des variables à valeurs discrètes prenant respectivement M et K valeurs, on peut procéder au *one hot encoding*, notant respectivement \mathbf{Z} et \mathbf{X} leur encodage sur, respectivement \mathbb{R}^M et \mathbb{R}^K . Ainsi, on peut écrire :

$$p(z = m) = P(Z_m = 1) = \pi_m$$

$$p(x = k|z = m) = p(X_k = 1|Z_m = 1) = \theta_{mk}$$

En supposant que l'on ait un échantillon de n observations de (x, z) , on peut exprimer la probabilité jointe d'une observation i :

$$p(x^{(i)}, z^{(i)}; \boldsymbol{\pi}, \boldsymbol{\theta}) = p(z^{(i)}; \boldsymbol{\pi})p(x^{(i)}|z^{(i)}; \boldsymbol{\theta})$$

$$p(x^{(i)}, z^{(i)}; \boldsymbol{\pi}, \boldsymbol{\theta}) = \prod_{m=1}^M \prod_{k=1}^K \theta_{mk}^{X_k^{(i)} Z_m^{(i)}} \prod_{l=1}^M \pi_l^{Z_l^{(i)}} \quad (1)$$

On peut alors écrire la log-vraisemblance de l'échantillon dans le modèle $(\boldsymbol{\pi}, \boldsymbol{\theta})$, composé d'observations i.i.d., en utilisant (1) :

$$\begin{aligned} \ell(\boldsymbol{\pi}, \boldsymbol{\theta}) &= \sum_{i=1}^n \ln(p(x^{(i)}, z^{(i)}; \boldsymbol{\pi}, \boldsymbol{\theta})) \\ &= \sum_{i=1}^n \left(\ln \left(\prod_{m=1}^M \prod_{k=1}^K \theta_{mk}^{X_k^{(i)} Z_m^{(i)}} \prod_{l=1}^M \pi_l^{Z_l^{(i)}} \right) \right) \\ &= \sum_{i=1}^n \left(\sum_{m=1}^M \sum_{k=1}^K \ln \left(\theta_{mk}^{X_k^{(i)} Z_m^{(i)}} \right) + \sum_{l=1}^M \ln \left(\pi_l^{Z_l^{(i)}} \right) \right) \\ &= \sum_{i=1}^n \left(\sum_{m=1}^M \sum_{k=1}^K X_k^{(i)} Z_m^{(i)} \ln(\theta_{mk}) + \sum_{l=1}^M Z_l^{(i)} \ln(\pi_l) \right) \\ &= \sum_{m=1}^M \sum_{k=1}^K \left(\sum_{i=1}^n X_k^{(i)} Z_m^{(i)} \right) \ln(\theta_{mk}) + \sum_{l=1}^M \left(\sum_{i=1}^n Z_l^{(i)} \right) \ln(\pi_l) \\ &= \sum_{m=1}^M \sum_{k=1}^K \alpha_{mk} \ln(\theta_{mk}) + \sum_{l=1}^M \beta_l \ln(\pi_l) \end{aligned} \quad (2)$$

avec

$$\alpha_{mk} = \sum_{i=1}^n X_k^{(i)} Z_m^{(i)}$$

$$\beta_l = \sum_{i=1}^n Z_l^{(i)}$$

D'après (2), la log-vraisemblance est donc strictement concave en chaque composantes de $\boldsymbol{\pi}$ et $\boldsymbol{\theta}$, par combinaison linéaire de logarithmes. D'autre part, on a les contraintes linéaires suivantes :

$$\sum_{m=1}^M \pi_m - 1 = 0$$

$$\sum_{k=1}^K \theta_{mk} - 1 = 0, \forall m : 1..M \quad (3)$$

On peut donc écrire le Lagrangien, en utilisant les multiplicateurs de Lagrange correspondants, associé au problème de maximisation de la log-vraisemblance (2) :

$$\mathcal{L}(\boldsymbol{\pi}, \boldsymbol{\theta}, \lambda, \boldsymbol{\gamma}) = \sum_{m=1}^M \sum_{k=1}^K \alpha_{mk} \ln(\theta_{mk}) + \sum_{l=1}^M \beta_l \ln(\pi_l) - \lambda \left(\sum_{m=1}^M \pi_m - 1 \right) - \boldsymbol{\gamma}^\top \begin{pmatrix} \vdots \\ \sum_{k=1}^K \theta_{mk} - 1 \\ \vdots \end{pmatrix} \quad (4)$$

Le problème admet une solution unique, notée $(\widehat{\boldsymbol{\pi}_{MLE}}, \widehat{\boldsymbol{\theta}_{MLE}})$ que l'on trouve par dérivation de (4)

1.1 Par rapport à π_m

$$\frac{\partial \mathcal{L}(\boldsymbol{\pi}, \boldsymbol{\theta}, \lambda, \boldsymbol{\gamma})}{\partial \pi_m} = \frac{\beta_m}{\pi_m} - \lambda = 0 \implies \pi_m \propto \beta_m \implies \pi_m = \frac{\beta_m}{\sum_{m=1}^M \beta_m} = \frac{\sum_{i=1}^n Z_m^{(i)}}{\sum_{m=1}^M \sum_{i=1}^n Z_m^{(i)}}$$

D'où finalement :

$$(\widehat{\boldsymbol{\pi}_{MLE}})_m = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n Z_m^{(i)} \quad (5)$$

1.2 Par rapport à θ_{mk}

$$\frac{\partial \mathcal{L}(\boldsymbol{\pi}, \boldsymbol{\theta}, \lambda, \boldsymbol{\gamma})}{\partial \theta_{mk}} = \frac{\alpha_{mk}}{\theta_{mk}} - \gamma_m = 0 \implies \theta_{mk} \propto \alpha_{mk} \implies \theta_{mk} = \frac{\alpha_{mk}}{\sum_{k=1}^K \alpha_{mk}} = \frac{\sum_{i=1}^n X_k^{(i)} Z_m^{(i)}}{\sum_{i=1}^n \left(\sum_{k=1}^K X_k^{(i)} \right) Z_m^{(i)}}$$

D'où finalement :

$$(\widehat{\boldsymbol{\theta}_{MLE}})_{mk} = \frac{\sum_{i=1}^n X_k^{(i)} Z_m^{(i)}}{\sum_{i=1}^n Z_m^{(i)}} \quad (6)$$

On remarque que si $\sum_{i=1}^n Z_m^{(i)}$ est nulle, alors $\left(\widehat{\theta}_{MLE}\right)_{mk}$ n'est pas défini, et ce pour tout k . Mais, dans de telles conditions, cela signifie que la $m^{\text{ième}}$ valeur de z n'a pas été observée, et donc que l'on peut réduire $\boldsymbol{\theta}$ d'une ligne entière, puisqu'alors la probabilité d'observer une quelconque valeur de x sachant que z prend la valeur m est nulle.

En définitif, on peut s'affranchir de l'hypothèse implicite qu'aucune composante de $\boldsymbol{\pi}$ ni de $\boldsymbol{\theta}$ n'est nulle. En effet, si tel est le cas, alors la probabilité d'observer une telle observation est nulle.

1.3 Conclusion

On remarque donc que l'estimateur de $\boldsymbol{\pi}$ n'est rien d'autre que la moyenne empirique des observations de z , et que l'estimateur de $\boldsymbol{\theta}$ est également la moyenne des observations de x pour une valeur de z donnée.

2 Linear classification

2.1 Generative model : Linear Discriminant Analysis

Supposons un échantillon de N observations de x, y , notées, (x_n, y_n) , pour n variant de 1 à N , où $y_n \in \{0, 1\}$. Etant donné le modèle suivant :

$$y \sim \text{Bernoulli}(\boldsymbol{\pi})$$

$$p(x|y = i) = \frac{1}{2\pi\sqrt{\det \Sigma}} \exp\left(-\frac{1}{2}(x - \mu_i)^\top \Sigma^{-1}(x - \mu_i)\right)$$

paramétré par :

$$\Theta = (\mu_0, \mu_1, \Sigma, \boldsymbol{\pi})$$

on peut réécrire la probabilité d'observer (x_n, y_n) sous la forme comprenant déjà la contrainte sur $\boldsymbol{\pi}$:

$$p(x_n, y_n) = (\boldsymbol{\pi}p(x_n|y_n = 1))^{y_n} ((1 - \boldsymbol{\pi})p(x_n|y_n = 0))^{1-y_n} \quad (7)$$

ce qui permet de déterminer la log-vraisemblance de l'échantillon composé de N observations i.i.d dans le modèle Θ en utilisant (7) :

$$\begin{aligned} \ell(\Theta) &= \sum_{n=1}^N \ln(p(x_n, y_n; \Theta)) \\ \ell(\Theta) &= \sum_{n=1}^N \ln((\boldsymbol{\pi}p(x_n|y_n = 1))^{y_n} ((1 - \boldsymbol{\pi})p(x_n|y_n = 0))^{1-y_n}) \\ \ell(\Theta) &= \sum_{n=1}^N \left(y_n \left(\ln\left(\frac{\boldsymbol{\pi}}{2\pi\sqrt{\det \Sigma}}\right) - \frac{1}{2}(x_n - \mu_1)^\top \Sigma^{-1}(x_n - \mu_1) \right) \right. \\ &\quad \left. + \sum_{n=1}^N \left((1 - y_n) \left(\ln\left(\frac{1 - \boldsymbol{\pi}}{2\pi\sqrt{\det \Sigma}}\right) - \frac{1}{2}(x_n - \mu_0)^\top \Sigma^{-1}(x_n - \mu_0) \right) \right) \right) \\ \ell(\Theta) &= \sum_{n=1}^N \left(y_n \left(\ln \boldsymbol{\pi} - \ln(2\pi) - \frac{1}{2} \ln \det \Sigma - \frac{1}{2}(x_n - \mu_1)^\top \Sigma^{-1}(x_n - \mu_1) \right) \right) \\ &\quad + \sum_{n=1}^N \left((1 - y_n) \left(\ln(1 - \boldsymbol{\pi}) - \ln(2\pi) - \frac{1}{2} \ln \det \Sigma - \frac{1}{2}(x_n - \mu_0)^\top \Sigma^{-1}(x_n - \mu_0) \right) \right) \end{aligned} \quad (8)$$

$\ell(\Theta)$ est donc une fonction strictement concave en π par stricte concavité du logarithme, en μ_0 et μ_1 par stricte concavité de l'opposé d'une forme quadratique (avec les valeurs propres de Σ strictement positives), et en Σ par convexité du logdet. Le problème de maximisation $\ell(\Theta)$ admet une solution unique, notée $(\widehat{\mu_{0,MLE}}, \widehat{\mu_{1,MLE}}, \widehat{\Sigma_{MLE}}, \widehat{\pi_{MLE}})$ que l'on trouve par dérivation de (8).

2.1.1 Par rapport à π

$$\frac{\partial \ell(\mu_0, \mu_1, \Sigma, \pi)}{\partial \pi} = \sum_{n=1}^N \left(\frac{y_n}{\pi} - \frac{1-y_n}{1-\pi} \right) = 0 \implies \frac{1-\pi}{\pi} = \frac{\sum_{n=1}^N (1-y_n)}{\sum_{n=1}^N y_n} \implies \pi = \frac{\sum_{n=1}^N y_n}{\sum_{n=1}^N 1}$$

D'où finalement :

$$(\widehat{\pi_{MLE}}) = \frac{1}{N} \sum_{n=1}^N y_n \quad (9)$$

qui est la moyenne empirique des classes observées.

2.1.2 Par rapport à μ_0 et μ_1

$$\frac{\partial \ell(\mu_0, \mu_1, \Sigma, \pi)}{\partial \mu_0} = \sum_{n=1}^N ((1-y_n)(-\Sigma^{-1}(x_n - \mu_0))) = 0 \implies \mu_0 = \frac{\sum_{n=1}^N (1-y_n)x_n}{\sum_{n=1}^N (1-y_n)}$$

En introduisant $A = \sum_{n=1}^N y_n$, on a donc :

$$(\widehat{\mu_{0,MLE}}) = \frac{1}{N-A} \sum_{y_n=0} x_n \quad (10)$$

Et de la même façon :

$$(\widehat{\mu_{1,MLE}}) = \frac{1}{A} \sum_{y_n=1} x_n \quad (11)$$

2.1.3 Par rapport à Σ

En introduisant temporairement $\Lambda = \Sigma^{-1}$, la log-vraisemblance se réécrit :

$$\begin{aligned} \ell(\Theta) = & \sum_{n=1}^N \left(y_n \left(\ln \pi - \ln(2\pi) + \frac{1}{2} \ln \det \Lambda - \frac{1}{2} (x_n - \mu_1)^\top \Lambda (x_n - \mu_1) \right) \right) \\ & + \sum_{n=1}^N \left((1-y_n) \left(\ln(1-\pi) - \ln(2\pi) + \frac{1}{2} \ln \det \Lambda - \frac{1}{2} (x_n - \mu_0)^\top \Lambda (x_n - \mu_0) \right) \right) \end{aligned} \quad (12)$$

En introduisant aussi :

$$\begin{aligned} \tilde{\Sigma}_0 &= \frac{1}{N-A} \sum_{y_n=0} (x_n - \mu_0)^\top (x_n - \mu_0) \\ \tilde{\Sigma}_1 &= \frac{1}{A} \sum_{y_n=1} (x_n - \mu_1)^\top (x_n - \mu_1) \end{aligned} \quad (13)$$

On peut réécrire (12) sous la forme suivante :

$$\begin{aligned} \ell(\Theta) = & \sum_{n=1}^N \left(y_n \left(\ln \boldsymbol{\pi} - \ln(2\pi) + \frac{1}{2} \ln \det \Lambda - \frac{1}{2} \text{tr}(\tilde{\Sigma}_1 \Lambda) \right) \right) \\ & + \sum_{n=1}^N \left((1 - y_n) \left(\ln(1 - \boldsymbol{\pi}) - \ln(2\pi) + \frac{1}{2} \ln \det \Lambda - \frac{1}{2} \text{tr}(\tilde{\Sigma}_0 \Lambda) \right) \right) \end{aligned} \quad (14)$$

Dérivant (14) par rapport à Λ :

$$\frac{\partial \ell(\mu_0, \mu_1, \Sigma, \boldsymbol{\pi})}{\partial \mu_0} = \sum_{n=1}^N ((1 - y_n)(-\Sigma^{-1}(x_n - \mu_0))) = 0 \implies \mu_0 = \frac{\sum_{n=1}^N (1 - y_n)x_n}{\sum_{n=1}^N (1 - y_n)}$$