

TRAVAUX DIRIGÉS DE
MACHINE LEARNING
CYCLE PLURIDISCIPLINAIRE D'ÉTUDES SUPÉRIEURES
UNIVERSITÉ PARIS SCIENCES ET LETTRES

Joon Kwon

vendredi 27 mars 2020



Soit $d \geq 1$ un entier. Pour $(w, b) \in \mathbb{R}^d \times \mathbb{R}$, on note $g_{w,b}$ la fonction définie par :

$$\forall x \in \mathbb{R}^d, \quad g_{w,b}(x) = \langle w, x \rangle + b.$$

On se place dans un cadre de classification binaire. Soient $\mathcal{X} = \mathbb{R}^d$ et $\mathcal{Y} = \{-1, 1\}$ les ensembles d'entrée et de sortie, et $S = (x_i, y_i)_{i \in [n]}$ l'échantillon d'apprentissage. Soit $(\hat{w}, \hat{b}) \in \mathbb{R}^d \times \mathbb{R}$ tel que $\hat{f} = \text{sign} \circ g_{\hat{w}, \hat{b}}$ soit le classifieur donné par la régression logistique.

1) Rappeler la définition de \hat{w} et \hat{b} .

Le but de l'exercice est de montrer que la régression logistique peut être vue comme une minimisation de risque empirique dans un problème auxiliaire de *régression*.

Soit $\phi_{\text{sig}} : \mathbb{R} \rightarrow]0, 1[$ la fonction définie par

$$\forall z \in \mathbb{R}, \quad \phi_{\text{sig}}(z) = \frac{1}{1 + e^{-z}}.$$

2) Tracer l'allure de ϕ_{sig} .

- 3) Montrer que ϕ_{sig} admet une fonction réciproque et en donner une expression.

On considère un problème auxiliaire avec pour ensembles d'entrée et de sortie $\mathcal{X}_0 = \mathbb{R}^d$ et $\mathcal{Y}_0 = [0, 1]$, et pour classe de prédicteurs :

$$\mathcal{F}_0 = \left\{ \phi_{\text{sig}} \circ g_{w,b} \right\}_{\substack{w \in \mathbb{R}^d \\ b \in \mathbb{R}}}.$$

Soit $S_0 = \left(x_i, \frac{y_i+1}{2} \right)_{i \in [n]}.$

- 4) Soit $\hat{f}_0 = \phi_{\text{sig}} \circ g_{\hat{w}, \hat{b}}$. Montrer que \hat{f}_0 est le prédicteur donné par la minimisation du risque empirique dans ce problème auxiliaire avec l'échantillon d'apprentissage S_0 et pour une certaine fonction de perte ℓ_0 à déterminer.
- 5) Montrer que $\hat{f} = \text{sign} \circ \hat{f}_0$.

