

CHAPITRE V
RÉGULARISATION
CYCLE PLURIDISCIPLINAIRE D'ÉTUDES SUPÉRIEURES
UNIVERSITÉ PARIS SCIENCES ET LETTRES



Le compromis entre biais et complexité a été présenté dans le chapitre précédent. L'ajustement de ce compromis s'effectue souvent à l'aide d'un ou de plusieurs hyperparamètres. On présente dans ce chapitre un exemple fondamental, la minimisation du risque empirique *régularisé*, où un *coefficient de régularisation* est un hyperparamètre avec lequel la complexité décroît.

I. CADRE

Soit $d \geq 1$ un entier. On considère l'ensemble d'entrées $\mathcal{X} = \mathbb{R}^d$ (qui correspond à d variables explicatives quantitatives), et un ensemble de sorties \mathcal{Y} quelconque.

On va considérer une classe de *prédicteurs linéaires*. Pour $(w, b) \in \mathbb{R}^d \times \mathbb{R}$, on rappelle qu'on note $g_{w,b} : x \mapsto \langle w, x \rangle + b$. On se donne une application $\phi : \mathbb{R} \rightarrow \mathcal{Y}$ et pour tout $(w, b) \in \mathbb{R}^d \times \mathbb{R}$, on note $f_{w,b} = \phi \circ g_{w,b}$. Enfin, on note \mathcal{F} la classe de tous les prédicteurs $f_{w,b}$:

$$\mathcal{F} = \{f_{w,b}\}_{\substack{w \in \mathbb{R}^d \\ b \in \mathbb{R}}}.$$

Pour $(w, b) \in \mathbb{R}^d \times \mathbb{R}$, les coefficients w_1, \dots, w_d de w ainsi que b sont appelés *paramètres* du prédicteur $f_{w,b}$.

REMARQUE. — *Paramètres et importance accordée aux variables explicatives.* — Soit $(w, b) \in \mathbb{R}^d \times \mathbb{R}$. Pour $1 \leq j \leq d$, le paramètre w_j peut être interprété comme l'importance accordée par le prédicteur $f_{w,b}$ à la j -ème variable explicative. En effet, si w_j est grand en valeur absolue, alors il découle de la définition de $f_{w,b}$ que la prédiction $f_{w,b}(x)$ dépendra fortement de la variable x_j . À l'inverse, si $w_j = 0$, la prédiction $f_{w,b}(x)$ ne dépendra pas de la variable x_j .

REMARQUE. — *Grandeur des paramètres et complexité.* — Un algorithme ayant tendance à donner des prédicteurs $f_{\hat{w},\hat{b}}$ avec des paramètres $\hat{w}_1, \dots, \hat{w}_d, \hat{b}$ grands en valeur absolue sera considéré comme ayant une grande *complexité*.

Soit $n \geq 1$ un entier, $S = (x_i, y_i)_{i \in [n]} \in \mathcal{S}(\mathcal{X}, \mathcal{Y})$ un échantillon, et $\ell : \mathcal{Y} \times \mathcal{Y} \rightarrow \mathbb{R}$ une fonction. On rappelle que l'algorithme de *minimisation du risque empirique* (ERM) utilisant la fonction de perte ℓ donne, avec S pour échantillon d'apprentissage, le prédicteur $f_{\hat{w},\hat{b}}$ où :

$$(\hat{w}, \hat{b}) = \arg \min_{\substack{w \in \mathbb{R}^d \\ b \in \mathbb{R}}} \left\{ \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n \ell(y_i, f_{w,b}(x_i)) \right\}.$$

Les cas particuliers importants déjà rencontrés sont la régression linéaire aux moindres carrés et la régression logistique. La minimisation du risque empirique présentée ci-après est une modification de la minimisation du risque empirique.

2. MINIMISATION DU RISQUE EMPIRIQUE RÉGULARISÉ

On introduit les objets suivants. Soit $\rho : \mathbb{R}^d \times \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ une fonction appelée *régularisatrice* et $\lambda \geq 0$ un réel appelé *hyperparamètre de régularisation*.

DÉFINITION. — *Minimisation du risque empirique régularisé.* — L'algorithme de la minimisation du risque empirique régularisé avec ℓ pour fonction de perte, ρ pour fonction régularisatrice, λ pour hyperparamètre de régularisation et S pour échantillon d'apprentissage donne le prédicteur $f_{\hat{w},\hat{b}}$ où :

$$(\hat{w}, \hat{b}) = \arg \min_{\substack{w \in \mathbb{R}^d \\ b \in \mathbb{R}}} \left\{ \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n \ell(y_i, f_{w,b}(x_i)) + \lambda \rho(w, b) \right\}.$$

REMARQUE. — L'expression qui est minimisée ci-dessus comporte à présent deux termes : le risque empirique d'une part, et le terme de régularisation d'autre part. Le prédicteur obtenu $f_{\hat{w}, \hat{b}}$ résulte d'un compromis entre les deux termes. Si $\lambda = 0$, il n'y a pas de régularisation et on retrouve la minimisation du risque empirique. Si λ est grand, le biais est important.

REMARQUE. — *Choix de la fonction régularisatrice ρ .* — Typiquement, on choisit ρ une fonction croissante en les valeurs absolues des paramètres w_1, \dots, w_d, b . Des exemples sont présentés dans les paragraphes suivants. On a alors les conséquences suivantes. D'une part, la régularisation a tendance à diminuer les valeurs absolues des paramètres obtenus $\hat{w}_1, \dots, \hat{w}_d, \hat{b}$, ce qu'on interprète comme une diminution de la complexité. D'autre part, augmenter la valeur de λ réduit le sur-apprentissage¹.

REMARQUE. — *Choix de l'hyperparamètre de régularisation λ .* — Pour choisir une valeur de λ , on considère en pratique plusieurs valeurs pour ensuite choisir celle qui semble la meilleure par validation (éventuellement *croisée*).

3. LASSO : RÉGULARISATION ℓ_1

Un exemple important de fonction régularisatrice est celle de la norme ℓ_1 (ici ℓ_1 n'a aucun rapport à la fonction de perte, mais désigne la norme $\|\cdot\|_1$), définie par :

$$\forall (w, b) \in \mathbb{R}^d \times \mathbb{R}, \quad \rho_{\text{lasso}}(w, b) = \|w\|_1 + |b| = \sum_{j=1}^d |w_j| + |b|.$$

L'algorithme correspondant est appelé LASSO (*Least Absolute Shrinkage and Selection Operator*) et donne donc le prédicteur $f_{\hat{w}, \hat{b}}$ où :

$$(\hat{w}, \hat{b}) = \arg \min_{(w, b) \in \mathbb{R}^d \times \mathbb{R}} \left\{ \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n \ell(y_i, f_{w, b}(x_i)) + \lambda (\|w\|_1 + |b|) \right\}.$$

REMARQUE. — La fonction régularisatrice ρ_{lasso} est bien croissante en les valeurs absolues des paramètres w_1, \dots, w_d, b . Par conséquent, augmenter la valeur de l'hyperparamètre λ réduit la complexité de l'algorithme et donc le sur-apprentissage.

1. Si toutefois $n \gg d$, le grand nombre d'exemples d'apprentissage empêche alors déjà le sur-apprentissage.

REMARQUE. — *Tendance à donner peu de paramètres non nuls.* — Augmenter la valeur de λ permet non seulement d'obtenir des paramètres $\hat{w}_1, \dots, \hat{w}_d, \hat{b}$ plus petits en valeur absolue, mais permet également de rendre *nuls* un grand nombre de ces paramètres (cela est dû à la spécificité de la régularisatrice ℓ_1 , et ne sera pas le cas pour la régularisatrice ℓ_2 présentée au paragraphe suivant). Alors, les prédictions du prédicteur obtenu ne dépendront que d'un petit nombre de variables explicatives (celles correspondant aux paramètres \hat{w}_j non nuls). Cette tendance est une des raisons principales pour lesquelles on a recours à l'algorithme LASSO : en effet, lorsqu'on soupçonne, ou qu'on sait, qu'un grand nombre de variables explicatives n'a pas de corrélation significative avec la variable à prédire, on peut souhaiter obtenir des prédicteurs qui ignorent un grand nombre de variables explicatives.

4. RIDGE : RÉGULARISATION ℓ_2

L'autre exemple fondamental de fonction régularisatrice est celle donnée par le carré de la norme ℓ_2 , et parfois appelée régularisation de *Tikhonov* :

$$\forall (w, b) \in \mathbb{R}^d \times \mathbb{R}, \quad \rho_{\text{ridge}}(w, b) = \frac{1}{2} (\|w\|_2^2 + b^2) = \frac{1}{2} \left(\sum_{j=1}^d w_j^2 + b^2 \right).$$

L'algorithme correspondant est appelé *Ridge* et s'écrit donc :

$$(\hat{w}, \hat{b}) = \arg \min_{(w, b) \in \mathbb{R}^d \times \mathbb{R}} \left\{ \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n \ell(y_i, f_{w, b}(x_i)) + \frac{\lambda}{2} (\|w\|_2^2 + b^2) \right\}.$$

REMARQUE. — La fonction régularisatrice ρ_{ridge} est également croissante en les valeurs absolues des paramètres w_1, \dots, w_d, b . Par conséquent, augmenter la valeur de l'hyperparamètre λ réduit la complexité de l'algorithme et donc le surapprentissage.

REMARQUE. — Plus la valeur de λ est grande, et plus les paramètres obtenus $\hat{w}_1, \dots, \hat{w}_d, \hat{b}$ sont petits en valeurs absolue, mais contrairement à l'algorithme LASSO, ils ne sont en pratique jamais nuls.

