

Machine learning

L. Rouvière

laurent.rouviere@univ-rennes2.fr

Octobre 2020

Présentation

- **Objectifs** : comprendre les aspects **théoriques** et **pratiques** des algorithmes machine learning de référence.
- **Pré-requis** : théorie des probabilités, modélisation statistique, régression (linéaire et logistique). R, niveau avancé.
- **Enseignant** : Laurent Rouvière laurent.rouviere@univ-rennes2.fr
 - **Recherche** : statistique non paramétrique, apprentissage statistique
 - **Enseignements** : statistique et probabilités (Université, école d'ingénieur et de commerce, formation continue).
 - **Consulting** : energie, finance, marketing, sport.

Programme

- Matériel :
 - slides : <https://lrouviere.github.io/INP-HB/>
 - Tutoriel (sans correction) :
https://lrouviere.github.io/TUTO_ML/
 - Tutoriel (avec corrections, plus tard...) :
https://lrouviere.github.io/TUTO_ML/correction/
- 2 parties
 1. Rappels machine learning : notions de risque, estimation de risque, complexité/surapprentissage...
 2. Support vector machine.

Première partie I

Apprentissage : contexte et formalisation

Motivations

Cadre mathématique pour l'apprentissage supervisé

Exemples de fonction de perte

Estimation du risque

Le sur-apprentissage

Le package caret

Annexe : compléments sur les scores

Bibliographie

Motivations

Cadre mathématique pour l'apprentissage supervisé

Exemples de fonction de perte

Estimation du risque

Le sur-apprentissage

Le package caret

Annexe : compléments sur les scores

Bibliographie

Apprentissage statistique ?

Plusieurs "définitions"

1. "... explores way of estimating functional dependency from a given collection of data" [Vapnik, 2000].
2. "...vast set of tools for modelling and understanding complex data" [James et al., 2015]

Apprentissage statistique ?

Plusieurs "définitions"

1. "... explores way of estimating functional dependency from a given collection of data" [Vapnik, 2000].
2. "...vast set of tools for modelling and understanding complex data" [James et al., 2015]
3. Comprendre et apprendre un comportement à partir d'exemples.

Apprentissage statistique ?

Plusieurs "définitions"

1. "... explores way of estimating functional dependency from a given collection of data" [Vapnik, 2000].
2. "...vast set of tools for modelling and understanding complex data" [James et al., 2015]
3. Comprendre et apprendre un comportement à partir d'exemples.

Constat

- Le développement des moyens informatiques fait que l'on est confronté à des données de plus en plus complexes.
- Les méthodes traditionnelles se révèlent souvent peu efficaces face à ce type de données.
- Nécessité de proposer des algorithmes/modèles statistiques qui apprennent directement à partir des données.

Un peu d'histoire - voir [Besse, 2018]

Période	Mémoire	Ordre de grandeur
1940-70	Octet	$n = 30, p \leq 10$
1970	kO	$n = 500, p \leq 10$
1980	MO	Machine Learning
1990	GO	Data-Mining
2000	TO	$p > n$, apprentissage statistique
2010	PO	n explose, cloud, cluster...
2013	??	Big data
2017	??	Intelligence artificielle...

Un peu d'histoire - voir [Besse, 2018]

Période	Mémoire	Ordre de grandeur
1940-70	Octet	$n = 30, p \leq 10$
1970	kO	$n = 500, p \leq 10$
1980	MO	Machine Learning
1990	GO	Data-Mining
2000	TO	$p > n$, apprentissage statistique
2010	PO	n explose, cloud, cluster...
2013	??	Big data
2017	??	Intelligence artificielle...

Conclusion

Capacités informatiques \Rightarrow Data Mining \Rightarrow Apprentissage statistique
 \Rightarrow Big Data \Rightarrow Intelligence artificielle...

Reconnaissance de l'écriture

Apprentissage statistique

Comprendre et apprendre un comportement à partir d'**exemples**.

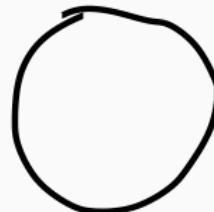
0	0	0	0	0
1	1	1	1	1
2	2	2	2	2
3	3	3	3	3
4	4	4	4	4
5	5	5	5	5
6	6	6	6	6
7	7	7	7	7
8	8	8	8	8
9	9	9	9	9

Reconnaissance de l'écriture

Apprentissage statistique

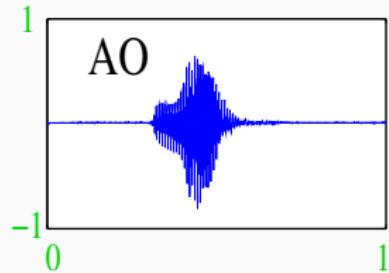
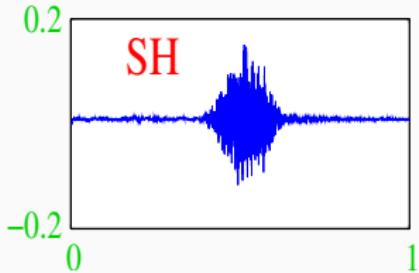
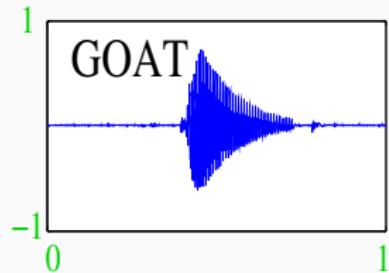
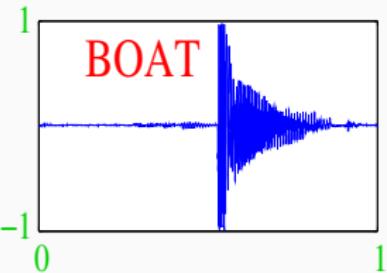
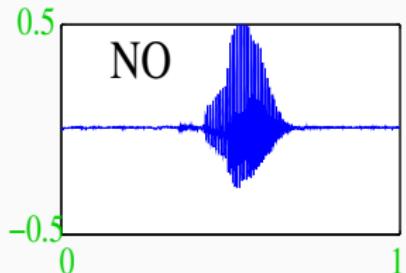
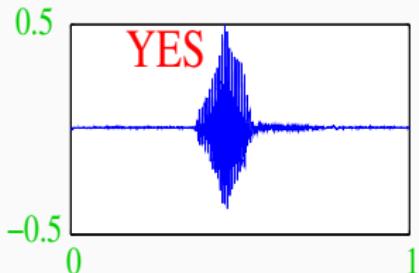
Comprendre et apprendre un comportement à partir d'**exemples**.

0	0	0	0	0
1	1	1	1	1
2	2	2	2	2
3	3	3	3	3
4	4	4	4	4
5	5	5	5	5
6	6	6	6	6
7	7	7	7	7
8	8	8	8	8
9	9	9	9	9

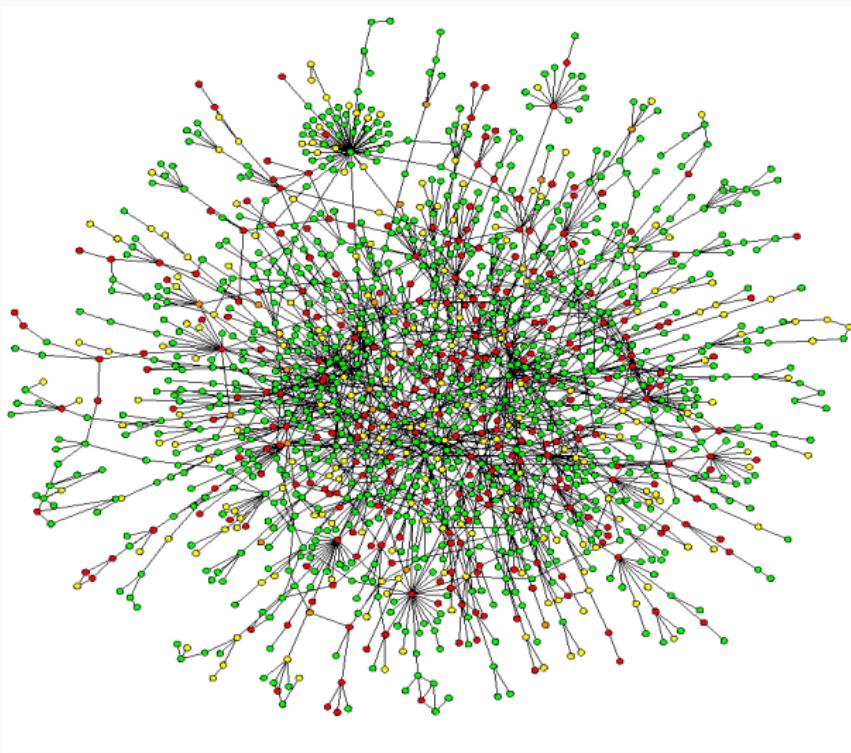


Qu'est-ce qui est écrit ? 0, 1, 2... ?

Reconnaissance de la parole



Apprentissage sur les réseaux



Prévision de pics d'ozone

- On a mesuré pendant 366 jours la **concentration maximale** en ozone (V4) ;
- On dispose également d'autres variables météorologiques (température, nébulosité, vent...).

```
> head(Ozone)
##   V1 V2 V3 V4    V5 V6 V7 V8     V9 V10 V11    V12 V13
## 1  1  1  4  3 5480  8 20 NA     NA 5000 -15 30.56 200
## 2  1  2  5  3 5660  6 NA 38     NA   NA -14     NA 300
## 3  1  3  6  3 5710  4 28 40     NA 2693 -25 47.66 250
## 4  1  4  7  5 5700  3 37 45     NA  590 -24 55.04 100
## 5  1  5  1  5 5760  3 51 54 45.32 1450  25 57.02  60
## 6  1  6  2  6 5720  4 69 35 49.64 1568  15 53.78  60
```

Prévision de pics d'ozone

- On a mesuré pendant 366 jours la **concentration maximale** en ozone (V4) ;
- On dispose également d'autres variables météorologiques (température, nébulosité, vent...).

```
> head(Ozone)
##   V1 V2 V3 V4    V5 V6 V7 V8     V9 V10 V11    V12 V13
## 1  1  1  4  3 5480  8 20 NA     NA 5000 -15 30.56 200
## 2  1  2  5  3 5660  6 NA 38     NA   NA -14     NA 300
## 3  1  3  6  3 5710  4 28 40     NA 2693 -25 47.66 250
## 4  1  4  7  5 5700  3 37 45     NA  590 -24 55.04 100
## 5  1  5  1  5 5760  3 51 54 45.32 1450  25 57.02  60
## 6  1  6  2  6 5720  4 69 35 49.64 1568  15 53.78  60
```

Question

Peut-on **prédire** la concentration maximale en ozone du **lendemain** à partir des prévisions météorologiques ?

Détection de spam

- Sur 4 601 mails, on a pu identifier **1813 spams**.
- On a également mesuré sur chacun de ces mails la présence ou absence de **57 mots**.

```
> spam %>% select(c(1:8,58)) %>% head()
##   make address all num3d our over remove internet type
## 1 0.00    0.64 0.64    0 0.32 0.00    0.00    0.00 spam
## 2 0.21    0.28 0.50    0 0.14 0.28    0.21    0.07 spam
## 3 0.06    0.00 0.71    0 1.23 0.19    0.19    0.12 spam
## 4 0.00    0.00 0.00    0 0.63 0.00    0.31    0.63 spam
## 5 0.00    0.00 0.00    0 0.63 0.00    0.31    0.63 spam
## 6 0.00    0.00 0.00    0 1.85 0.00    0.00    1.85 spam
```

Détection de spam

- Sur 4 601 mails, on a pu identifier 1813 spams.
- On a également mesuré sur chacun de ces mails la présence ou absence de 57 mots.

```
> spam %>% select(c(1:8,58)) %>% head()  
##   make address all num3d our over remove internet type  
## 1 0.00    0.64 0.64    0 0.32 0.00    0.00    0.00 spam  
## 2 0.21    0.28 0.50    0 0.14 0.28    0.21    0.07 spam  
## 3 0.06    0.00 0.71    0 1.23 0.19    0.19    0.12 spam  
## 4 0.00    0.00 0.00    0 0.63 0.00    0.31    0.63 spam  
## 5 0.00    0.00 0.00    0 0.63 0.00    0.31    0.63 spam  
## 6 0.00    0.00 0.00    0 1.85 0.00    0.00    1.85 spam
```

Question

Peut-on construire à partir de ces données une méthode de détection automatique de spam ?

Estimation vs apprentissage

- Estimation : objectifs explicatifs
 - notion de modèle ;
 - décisions prises à l'aide de tests statistiques.
- Apprentissage

Estimation vs apprentissage

- Estimation : objectifs explicatifs
 - notion de modèle ;
 - décisions prises à l'aide de tests statistiques.
- Apprentissage : objectifs prédictifs
 - complexité des modèles "peu" importantes ;
 - décisions prises à l'aide de critères de prévisions.

Problématiques associées à l'apprentissage

- Apprentissage supervisé : expliquer/prédire une sortie $y \in \mathcal{Y}$ à partir d'entrées $x \in \mathcal{X}$;
- Apprentissage non supervisé : établir une typologie des observations ;
- Règles d'association : mesurer le lien entre différents produits ;
- Systèmes de recommandation : identifier les produits susceptibles d'intéresser des consommateurs.

Problématiques associées à l'apprentissage

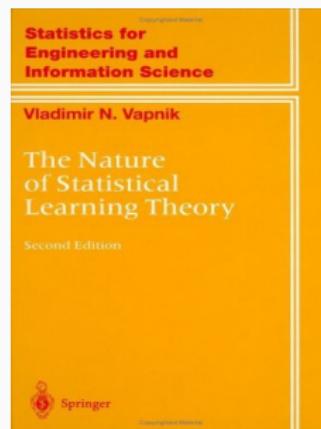
- Apprentissage supervisé : expliquer/prédire une sortie $y \in \mathcal{Y}$ à partir d'entrées $x \in \mathcal{X}$;
- Apprentissage non supervisé : établir une typologie des observations ;
- Règles d'association : mesurer le lien entre différents produits ;
- Systèmes de recommandation : identifier les produits susceptibles d'intéresser des consommateurs.

NOMBREUSES APPLICATIONS

finance, économie, marketing, biologie, médecine...

Approche mathématique

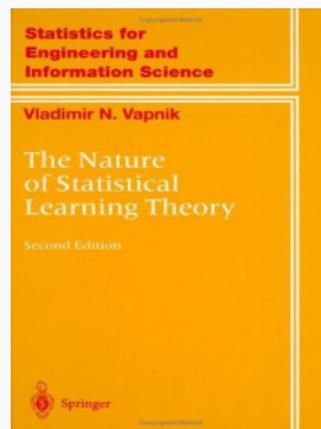
- Ouvrage fondateur : [Vapnik, 2000]



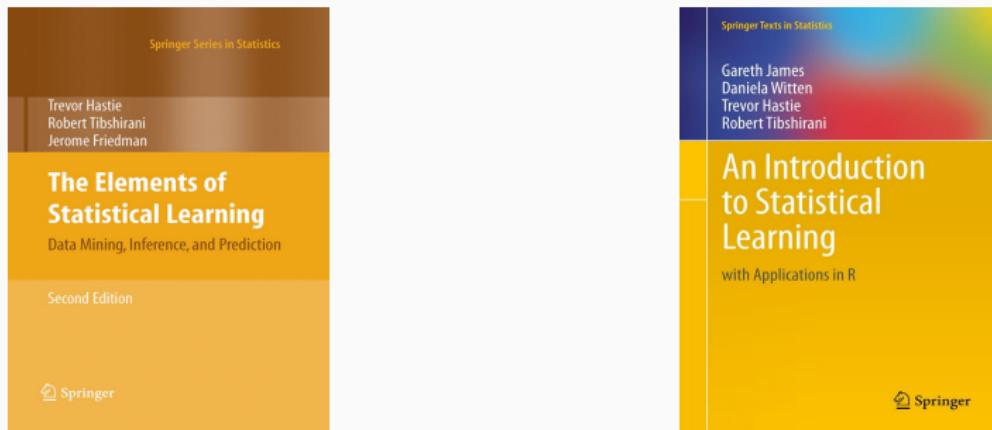
Théorie de l'apprentissage statistique

Approche mathématique

- Ouvrage fondateur : [Vapnik, 2000]
- voir aussi [Bousquet et al., 2003].



The Elements of Statistical Learning [Hastie et al., 2009, James et al., 2015]



- Disponibles (avec jeux de données, codes...) aux url :

<https://web.stanford.edu/~hastie/ElemStatLearn/>

<http://www-bcf.usc.edu/~gareth/ISL/>

- Page de cours et tutoriels très bien faits sur la statistique classique et moderne.
- On pourra notamment regarder les vignettes sur la partie apprentissage :
 - [Wikistat, 2020a]
 - [Wikistat, 2020b]
 - ...

- Page de cours et tutoriels très bien faits sur la statistique classique et moderne.
- On pourra notamment regarder les vignettes sur la partie apprentissage :
 - [Wikistat, 2020a]
 - [Wikistat, 2020b]
 - ...
- Plusieurs parties de ce cours sont inspirées de ces vignettes.

Motivations

Cadre mathématique pour l'apprentissage supervisé

Exemples de fonction de perte

Estimation du risque

Le sur-apprentissage

Le package caret

Annexe : compléments sur les scores

Bibliographie

Régression vs Discrimination

- Données de type **entrée-sortie** : $d_n = (x_1, y_1), \dots, (x_n, y_n)$ où $x_i \in \mathcal{X}$ représente l'entrée et $y_i \in \mathcal{Y}$ la sortie.

Objectifs

1. Expliquer le(s) mécanisme(s) liant les entrée x_i aux sorties y_i ;
2. Prédire « au mieux » la sortie y associée à une nouvelle entrée $x \in \mathcal{X}$.

Régression vs Discrimination

- Données de type **entrée-sortie** : $d_n = (x_1, y_1), \dots, (x_n, y_n)$ où $x_i \in \mathcal{X}$ représente l'entrée et $y_i \in \mathcal{Y}$ la sortie.

Objectifs

1. **Expliquer** le(s) mécanisme(s) liant les entrée x_i aux sorties y_i ;
2. **Prédire** « au mieux » la sortie y associée à une nouvelle entrée $x \in \mathcal{X}$.

Vocabulaire

- Lorsque la variable à expliquer est quantitative ($\mathcal{Y} \subseteq \mathbb{R}$), on parle de **régression**.
- Lorsqu'elle est qualitative ($\text{Card}(\mathcal{Y})$ fini), on parle de **discrimination** ou de **classification supervisée**.

Exemples

- La plupart des problèmes présentés précédemment peuvent être appréhendés dans un contexte d'**apprentissage supervisé** : on cherche à expliquer une sortie y par des entrées x :

y_i	x_i	
Chiffre	image	Discri.
Mot	courbe	Discri.
Spam	présence/absence de mots	Discri.
C. en O_3	données météo.	Régression

Exemples

- La plupart des problèmes présentés précédemment peuvent être appréhendés dans un contexte d'**apprentissage supervisé** : on cherche à expliquer une sortie y par des entrées x :

y_i	x_i	
Chiffre	image	Discri.
Mot	courbe	Discri.
Spam	présence/absence de mots	Discri.
C. en O_3	données météo.	Régression

Remarque

La nature des variables associées aux **entrées** x_i est **variée** (quanti, quali, fonctionnelle...).

Un début de formalisation mathématique

- Etant données des observations $d_n = \{(x_1, y_1), \dots, (x_n, y_n)\}$ on cherche à expliquer/prédire les sorties $y_i \in \mathcal{Y}$ à partir des entrées $x_i \in \mathcal{X}$.

Un début de formalisation mathématique

- Etant données des observations $d_n = \{(x_1, y_1), \dots, (x_n, y_n)\}$ on cherche à expliquer/prédire les sorties $y_i \in \mathcal{Y}$ à partir des entrées $x_i \in \mathcal{X}$.
- Il s'agit donc de trouver une fonction de prévision $f : \mathcal{X} \rightarrow \mathcal{Y}$ telle que

$$f(x_i) \approx y_i, i = 1, \dots, n.$$

Un début de formalisation mathématique

- Etant données des observations $d_n = \{(x_1, y_1), \dots, (x_n, y_n)\}$ on cherche à expliquer/prédire les sorties $y_i \in \mathcal{Y}$ à partir des entrées $x_i \in \mathcal{X}$.
- Il s'agit donc de trouver une fonction de prévision $f : \mathcal{X} \rightarrow \mathcal{Y}$ telle que

$$f(x_i) \approx y_i, i = 1, \dots, n.$$

- Nécessité de se donner un critère qui permette de mesurer la qualité des fonctions de prévision f .

Un début de formalisation mathématique

- Etant données des observations $d_n = \{(x_1, y_1), \dots, (x_n, y_n)\}$ on cherche à expliquer/prédire les sorties $y_i \in \mathcal{Y}$ à partir des entrées $x_i \in \mathcal{X}$.
- Il s'agit donc de trouver une fonction de prévision $f : \mathcal{X} \rightarrow \mathcal{Y}$ telle que

$$f(x_i) \approx y_i, i = 1, \dots, n.$$

- Nécessité de se donner un critère qui permette de mesurer la qualité des fonctions de prévision f .
- Le plus souvent, on utilise une fonction de perte $\ell : \mathcal{Y} \times \mathcal{Y} \rightarrow \mathbb{R}^+$ telle que

$$\begin{cases} \ell(y, y') = 0 & \text{si } y = y' \\ \ell(y, y') > 0 & \text{si } y \neq y'. \end{cases}$$

Approche statistique

- On suppose que les données $d_n = \{(x_1, y_1), \dots, (x_n, y_n)\}$ sont des réalisations d'un *n*-échantillon $\mathcal{D}_n = \{(X_1, Y_1), \dots, (X_n, Y_n)\}$ de loi inconnue.
- Les X_i sont des variables aléatoires à valeurs dans \mathcal{X} , les Y_i dans \mathcal{Y} .
- Le plus souvent on supposera que les couples (X_i, Y_i) , $i = 1, \dots, n$ sont i.i.d de loi \mathbf{P} .

Approche statistique

- On suppose que les données $d_n = \{(x_1, y_1), \dots, (x_n, y_n)\}$ sont des réalisations d'un *n*-échantillon $\mathcal{D}_n = \{(X_1, Y_1), \dots, (X_n, Y_n)\}$ de loi inconnue.
- Les X_i sont des variables aléatoires à valeurs dans \mathcal{X} , les Y_i dans \mathcal{Y} .
- Le plus souvent on supposera que les couples (X_i, Y_i) , $i = 1, \dots, n$ sont i.i.d de loi \mathbf{P} .

Performance d'une fonction de prévision

- Etant donné une fonction de perte $\ell : \mathcal{Y} \times \mathcal{Y} \rightarrow \mathbb{R}^+$, la performance d'une fonction (mesurable) de prévision $f : \mathcal{X} \rightarrow \mathcal{Y}$ est mesurée par

$$\mathcal{R}(f) = \mathbf{E}[\ell(Y, f(X))]$$

où (X, Y) est indépendant des (X_i, Y_i) et de même loi P .

Approche statistique

- On suppose que les données $d_n = \{(x_1, y_1), \dots, (x_n, y_n)\}$ sont des réalisations d'un *n*-échantillon $\mathcal{D}_n = \{(X_1, Y_1), \dots, (X_n, Y_n)\}$ de loi inconnue.
- Les X_i sont des variables aléatoires à valeurs dans \mathcal{X} , les Y_i dans \mathcal{Y} .
- Le plus souvent on supposera que les couples (X_i, Y_i) , $i = 1, \dots, n$ sont i.i.d de loi P .

Performance d'une fonction de prévision

- Etant donné une fonction de perte $\ell : \mathcal{Y} \times \mathcal{Y} \rightarrow \mathbb{R}^+$, la performance d'une fonction (mesurable) de prévision $f : \mathcal{X} \rightarrow \mathcal{Y}$ est mesurée par

$$\mathcal{R}(f) = \mathbf{E}[\ell(Y, f(X))]$$

où (X, Y) est indépendant des (X_i, Y_i) et de même loi P .

- $\mathcal{R}(f)$ est appelé risque ou erreur de généralisation de f .

Aspect théorique

- Pour une fonction de perte $\ell : \mathcal{Y} \times \mathcal{Y} \rightarrow \mathbb{R}^+$ donnée, le problème **théorique** consiste à trouver

$$f^* \in \operatorname{argmin}_f \mathcal{R}(f).$$

- Une telle fonction f^* (si elle existe) est appelée **fonction de prévision optimale** pour la perte ℓ .

Aspect pratique

- La fonction de prévision optimale f^* dépend le plus souvent de la loi P des (X, Y) qui est en pratique **inconnue**.

Aspect pratique

- La fonction de prévision optimale f^* dépend le plus souvent de la loi P des (X, Y) qui est en pratique **inconnue**.
- Le job du statisticien est de trouver un **estimateur** $f_n = f_n(., \mathcal{D}_n)$ tel que $\mathcal{R}(f_n) \approx \mathcal{R}(f^*)$.

Aspect pratique

- La fonction de prévision optimale f^* dépend le plus souvent de la loi P des (X, Y) qui est en pratique **inconnue**.
- Le job du statisticien est de trouver un **estimateur** $f_n = f_n(., \mathcal{D}_n)$ tel que $\mathcal{R}(f_n) \approx \mathcal{R}(f^*)$.

Définition

- Un **algorithme de prévision** est représenté par une suite $(f_n)_n$ d'applications (mesurables) telles que pour $n \geq 1$,
 $f_n : (\mathcal{X} \times (\mathcal{X} \times \mathcal{Y})^n) \rightarrow \mathcal{Y}$.
- On dit que la suite $(f_n)_n$ est **universellement consistante** si $\forall P$

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \mathcal{R}(f_n) = \mathcal{R}(f^*).$$

Choix de la fonction de perte

- Le cadre mathématique développé précédemment sous-entend qu'une fonction est **performante** (voire **optimale**) vis-à-vis d'un **critère** (représenté par la **fonction de perte** ℓ)).
- Un algorithme de prévision performant pour un critère ne sera **pas forcément performant pour un autre**.

Choix de la fonction de perte

- Le cadre mathématique développé précédemment sous-entend qu'une fonction est **performante** (voire **optimale**) vis-à-vis d'un **critère** (représenté par la **fonction de perte** ℓ)).
- Un algorithme de prévision performant pour un critère ne sera **pas forcément performant pour un autre**.

Conséquence pratique

Avant de s'attacher à construire un algorithme de prévision, il est **capital** de savoir **mesurer la performance** d'un algorithme de prévision.

Motivations

Cadre mathématique pour l'apprentissage supervisé

Exemples de fonction de perte

Estimation du risque

Le sur-apprentissage

Le package caret

Annexe : compléments sur les scores

Bibliographie

Régression

- Dans un contexte de régression ($\mathcal{Y} = \mathbb{R}$), la **perte quadratique** est la plus souvent utilisée. Elle est définie par :

$$\ell : \mathbb{R} \times \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}^+$$

$$(y, y') \mapsto (y - y')^2$$

- Le **risque** pour une **fonction de prévision** ou **régresseur** $m : \mathcal{X} \rightarrow \mathbb{R}$ est alors donné par

$$\mathcal{R}(m) = \mathbf{E}((Y - m(X))^2).$$

Classification binaire

- Dans un contexte de discrimination binaire ($\mathcal{Y} = \{-1, 1\}$), la **perte indicatrice** est la plus souvent utilisée. Elle est définie par :

$$\begin{aligned}\ell : \{-1, 1\} \times \{-1, 1\} &\rightarrow \mathbb{R}^+ \\ (y, y') &\mapsto \mathbf{1}_{y \neq y'}\end{aligned}$$

- Le **risque** pour une **fonction de prévision** ou **règle de prévision** $g : \mathcal{X} \rightarrow \{-1, 1\}$ est alors donné par

$$\mathcal{R}(g) = \mathbf{E}(\mathbf{1}_{g(X) \neq Y}) = \mathbf{P}(g(X) \neq Y).$$

Fonction de score

- On reste dans un cadre de **classification binaire** ($\mathcal{Y} = \{-1, 1\}$).
- Mais... plutôt que de chercher une règle de prévision $g : \mathcal{X} \rightarrow \{-1, 1\}$, on **cherche une fonction $S : \mathcal{X} \rightarrow \mathbb{R}$** telle que

$\mathbf{P}(Y = 1|X = x)$ faible

$\mathbf{P}(Y = 1|X = x)$ élevée

$S(x)$

Fonction de score

- On reste dans un cadre de **classification binaire** ($\mathcal{Y} = \{-1, 1\}$).
- Mais... plutôt que de chercher une règle de prévision $g : \mathcal{X} \rightarrow \{-1, 1\}$, on **cherche une fonction $S : \mathcal{X} \rightarrow \mathbb{R}$** telle que
 - $\mathbf{P}(Y = 1|X = x)$ faible
 - $\mathbf{P}(Y = 1|X = x)$ élevée
- Une telle fonction est appelée **fonction de score** : plutôt que de prédire directement le groupe d'un nouvel individu $x \in \mathcal{X}$, on lui donne une **note $S(x)$**
 - **élevée** si il a des "chances" d'être dans le groupe 1 ;
 - **faible** si il a des "chances" d'être dans le groupe -1 ;

Courbe ROC et AUC

- On utilise souvent la **courbe ROC** pour **visualiser** la performance d'un score :

$$\begin{cases} x(s) = \alpha(s) = 1 - sp(s) = \mathbf{P}(S(X) > s | Y = -1) \\ y(s) = 1 - \beta(s) = se(s) = \mathbf{P}(S(X) \geq s | Y = 1) \end{cases}$$

Courbe ROC et AUC

- On utilise souvent la **courbe ROC** pour **visualiser** la performance d'un score :

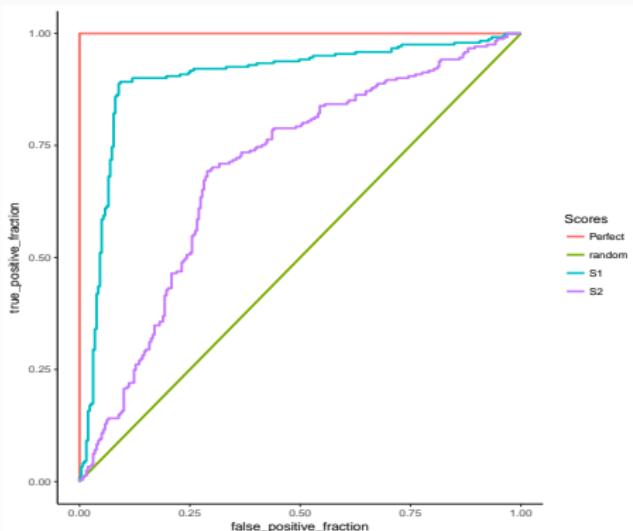
$$\begin{cases} x(s) = \alpha(s) = 1 - sp(s) = \mathbf{P}(S(X) > s | Y = -1) \\ y(s) = 1 - \beta(s) = se(s) = \mathbf{P}(S(X) \geq s | Y = 1) \end{cases}$$

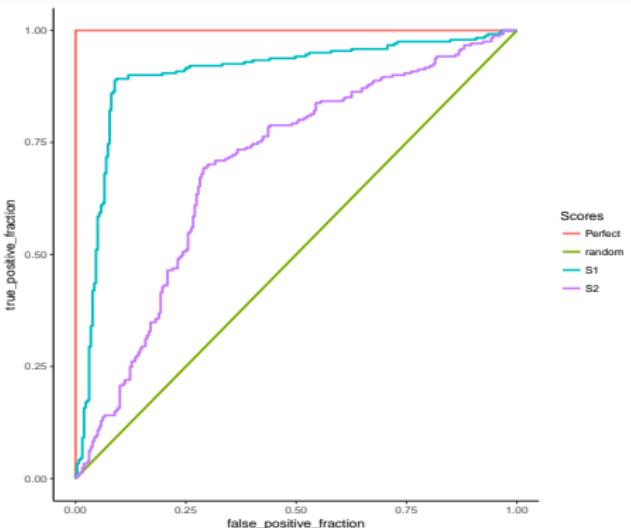
- On déduit de ce critère un **risque** pour les scores en considérant l'**aire sous la courbe ROC (AUC)** :

$$\mathcal{R}(S) = \text{AUC}(S).$$

Propriété

- $0.5 \leq \text{AUC}(S) \leq 1.$
- Plus l'AUC est **grand, meilleur** est le score.





```
> library(pROC)
> df1 %>% group_by(Scores) %>% summarize(auc(D,M))
## # A tibble: 4 x 2
##   Scores   `auc(D, M)`
##   <chr>     <dbl>
## 1 Perfect     1
## 2 random      0.5
## 3 S1          0.896
## 4 S2          0.699
```

Résumé

	Perte $\ell(y, f(x))$	Risque $\mathbf{E}[\ell(Y, f(X))]$	Champion f^*
Régression	$(y - f(x))^2$	$\mathbf{E}[Y - f(X)]^2$	$\mathbf{E}[Y X = x]$
Classif. binaire	$\mathbf{1}_{y \neq f(x)}$	$\mathbf{P}(Y \neq f(X))$	Bayes
Scoring		$AUC(S)$	$\mathbf{P}(Y = 1 X = x)$

Motivations

Cadre mathématique pour l'apprentissage supervisé

Exemples de fonction de perte

Estimation du risque

Le sur-apprentissage

Le package caret

Annexe : compléments sur les scores

Bibliographie

Rappels

- n observations $(X_1, Y_1), \dots, (X_n, Y_n)$ i.i.d à valeurs dans $\mathcal{X} \times \mathcal{Y}$.

Objectif

Etant donnée une fonction de perte $\ell : \mathcal{Y} \times \mathcal{Y} \rightarrow \mathbb{R}^+$, on cherche un **algorithme de prévision** $f_n(x) = f_n(x, \mathcal{D}_n)$ qui soit "proche" de l'oracle f^* défini par

$$f^* \in \operatorname{argmin}_f \mathcal{R}(f)$$

où $\mathcal{R}(f) = \mathbf{E}[\ell(Y, f(X))]$.

Rappels

- n observations $(X_1, Y_1), \dots, (X_n, Y_n)$ i.i.d à valeurs dans $\mathcal{X} \times \mathcal{Y}$.

Objectif

Etant donnée une fonction de perte $\ell : \mathcal{Y} \times \mathcal{Y} \rightarrow \mathbb{R}^+$, on cherche un **algorithme de prévision** $f_n(x) = f_n(x, \mathcal{D}_n)$ qui soit "proche" de l'oracle f^* défini par

$$f^* \in \operatorname{argmin}_f \mathcal{R}(f)$$

où $\mathcal{R}(f) = \mathbf{E}[\ell(Y, f(X))]$.

Question

Etant donné un algorithme f_n , que vaut son risque $\mathcal{R}(f_n)$?

Risque empirique

- La loi de (X, Y) étant **inconnue** en pratique, il est **impossible de calculer** $\mathcal{R}(f_n) = \mathbf{E}[\ell(Y, f_n(X))]$.

Risque empirique

- La loi de (X, Y) étant **inconnue** en pratique, il est **impossible de calculer** $\mathcal{R}(f_n) = \mathbf{E}[\ell(Y, f_n(X))]$.
- **Première approche** : $\mathcal{R}(f_n)$ étant une espérance, on peut l'estimer (LGN) par sa **version empirique**

$$\mathcal{R}_n(f_n) = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n \ell(Y_i, f_n(X_i)).$$

Risque empirique

- La loi de (X, Y) étant **inconnue** en pratique, il est **impossible de calculer** $\mathcal{R}(f_n) = \mathbf{E}[\ell(Y, f_n(X))]$.
- **Première approche** : $\mathcal{R}(f_n)$ étant une espérance, on peut l'estimer (LGN) par sa **version empirique**

$$\mathcal{R}_n(f_n) = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n \ell(Y_i, f_n(X_i)).$$

Problème

- L'échantillon \mathcal{D}_n a **déjà été utilisé** pour construire l'algorithme de prévision $f_n \implies$ La LGN ne peut donc s'appliquer !
- **Conséquence** : $\mathcal{R}_n(f_n)$ conduit souvent à une **sous-estimation** de $\mathcal{R}(f_n)$.

Risque empirique

- La loi de (X, Y) étant **inconnue** en pratique, il est **impossible** de **calculer** $\mathcal{R}(f_n) = \mathbf{E}[\ell(Y, f_n(X))]$.
- **Première approche** : $\mathcal{R}(f_n)$ étant une espérance, on peut l'estimer (LGN) par sa **version empirique**

$$\mathcal{R}_n(f_n) = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n \ell(Y_i, f_n(X_i)).$$

Problème

- L'échantillon \mathcal{D}_n a **déjà été utilisé** pour construire l'algorithme de prévision $f_n \implies$ La LGN ne peut donc s'appliquer !
- **Conséquence** : $\mathcal{R}_n(f_n)$ conduit souvent à une **sous-estimation** de $\mathcal{R}(f_n)$.

Une solution

Utiliser des méthodes de type **validation croisée** ou **bootstrap**.

Apprentissage - Validation ou Validation hold out

- Elle consiste à séparer l'échantillon \mathcal{D}_n en :
 1. un échantillon d'apprentissage $\mathcal{D}_{n,app}$ pour construire f_n ;
 2. un échantillon de validation $\mathcal{D}_{n,test}$ utilisé pour estimer le risque de f_n .

Apprentissage - Validation ou Validation hold out

- Elle consiste à séparer l'échantillon \mathcal{D}_n en :
 1. un échantillon d'apprentissage $\mathcal{D}_{n,app}$ pour construire f_n ;
 2. un échantillon de validation $\mathcal{D}_{n,test}$ utilisé pour estimer le risque de f_n .

Algorithme

Entrées. \mathcal{D}_n : données, $\{\mathcal{A}, \mathcal{V}\}$: partition de $\{1, \dots, n\}$.

1. Construire l'algorithme de prédiction sur $\mathcal{D}_{n,app} = \{(X_i, Y_i) : i \in \mathcal{A}\}$, on le note $f_{n,app}$;
2. Calculer $\widehat{\mathcal{R}}_n(f_n) = \frac{1}{|\mathcal{V}|} \sum_{i \in \mathcal{V}} \ell(Y_i, f_{n,app}(X_i))$.

Apprentissage - Validation ou Validation hold out

- Elle consiste à séparer l'échantillon \mathcal{D}_n en :
 1. un échantillon d'apprentissage $\mathcal{D}_{n,app}$ pour construire f_n ;
 2. un échantillon de validation $\mathcal{D}_{n,test}$ utilisé pour estimer le risque de f_n .

Algorithme

Entrées. \mathcal{D}_n : données, $\{\mathcal{A}, \mathcal{V}\}$: partition de $\{1, \dots, n\}$.

1. Construire l'algorithme de prédiction sur $\mathcal{D}_{n,app} = \{(X_i, Y_i) : i \in \mathcal{A}\}$, on le note $f_{n,app}$;
2. Calculer $\hat{\mathcal{R}}_n(f_n) = \frac{1}{|\mathcal{V}|} \sum_{i \in \mathcal{V}} \ell(Y_i, f_{n,app}(X_i))$.

Commentaires

Nécessite d'avoir un **nombre suffisant d'observations** dans

1. $\mathcal{D}_{n,app}$ pour bien ajuster l'algorithme de prévision ;
2. $\mathcal{D}_{n,test}$ pour bien estimer l'erreur de l'algorithme.

Validation croisée K -blocs

- **Principe** : répéter l'algorithme apprentissage/validation sur **differentes partitions**.

Algorithme - CV

Entrées. \mathcal{D}_n : données, K un entier qui divise n ;

1. Construire une partition $\{\mathcal{I}_1, \dots, \mathcal{I}_K\}$ de $\{1, \dots, n\}$;
2. Pour $k = 1, \dots, K$
 - 2.1 $\mathcal{I}_{app} = \{1, \dots, n\} \setminus \mathcal{I}_k$ et $\mathcal{I}_{test} = \mathcal{I}_k$;
 - 2.2 Construire l'algorithme de prédiction sur $\mathcal{D}_{n,app} = \{(X_i, Y_i) : i \in \mathcal{I}_{app}\}$, on le note $f_{n,k}$;
 - 2.3 En déduire $f_n(X_i) = f_{n,k}(X_i)$ pour $i \in \mathcal{I}_{test}$;
3. Retourner

$$\widehat{\mathcal{R}}_n(f_n) = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n \ell(Y_i, f_n(X_i)).$$

Commentaires

- Plus adapté que la technique apprentissage/validation lorsqu'on a peu d'observations.
- Le choix de K doit être fait par l'utilisateur (souvent $K = 10$).

Leave one out

- Lorsque $K = n$, on parle de validation croisée leave one out ;
- Le risque est alors estimé par

$$\widehat{\mathcal{R}}_n(f_n) = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n \ell(Y_i, f_n^i(X_i))$$

où f_n^i désigne l'algorithme de prévision construit sur \mathcal{D}_n amputé de la i -ème observation.

Autres approches

- Estimation par pénalisation : critère ajustement/complexité, C_p de Mallows, AIC-BIC...
- Validation croisée Monte-Carlo : répéter plusieurs fois la validation hold out ;
- Bootstrap : notamment Out Of Bag ;
- voir [Wikistat, 2020b].

Motivations

Cadre mathématique pour l'apprentissage supervisé

Exemples de fonction de perte

Estimation du risque

Le sur-apprentissage

Le package caret

Annexe : compléments sur les scores

Bibliographie

- La plupart des modèles statistiques renvoient des estimateurs qui dépendent de paramètres λ à calibrer.

- La plupart des modèles statistiques renvoient des estimateurs qui dépendent de paramètres λ à calibrer.

Exemples

- nombres de variables dans un modèle linéaire ou logistique.
- paramètre de pénalités pour les régressions pénalisées.
- profondeur des arbres.
- nombre de plus proches voisins.
- nombre d'itérations en boosting.
- ...

- La plupart des modèles statistiques renvoient des estimateurs qui dépendent de paramètres λ à calibrer.

Exemples

- nombres de variables dans un modèle linéaire ou logistique.
- paramètre de pénalités pour les régressions pénalisées.
- profondeur des arbres.
- nombre de plus proches voisins.
- nombre d'itérations en boosting.
- ...

Remarque importante

Le choix de ces paramètres est le plus souvent crucial pour la performance de l'estimateur sélectionné.

- Le paramètre λ à sélectionner représente le plus souvent la **complexité du modèle** :

- Le paramètre λ à sélectionner représente le plus souvent la **complexité du modèle** :

Complexité \implies compromis biais/variance

- λ petit \implies modèle peu flexible \implies mauvaise adéquation sur les données \implies biais \nearrow , variance \searrow .

- Le paramètre λ à sélectionner représente le plus souvent la **complexité du modèle** :

Complexité \Rightarrow compromis biais/variance

- λ petit \Rightarrow modèle peu flexible \Rightarrow mauvaise adéquation sur les données \Rightarrow biais \nearrow , variance \searrow .
- λ grand \Rightarrow modèle trop flexible \Rightarrow **sur-ajustement** \Rightarrow biais \searrow , variance \nearrow .

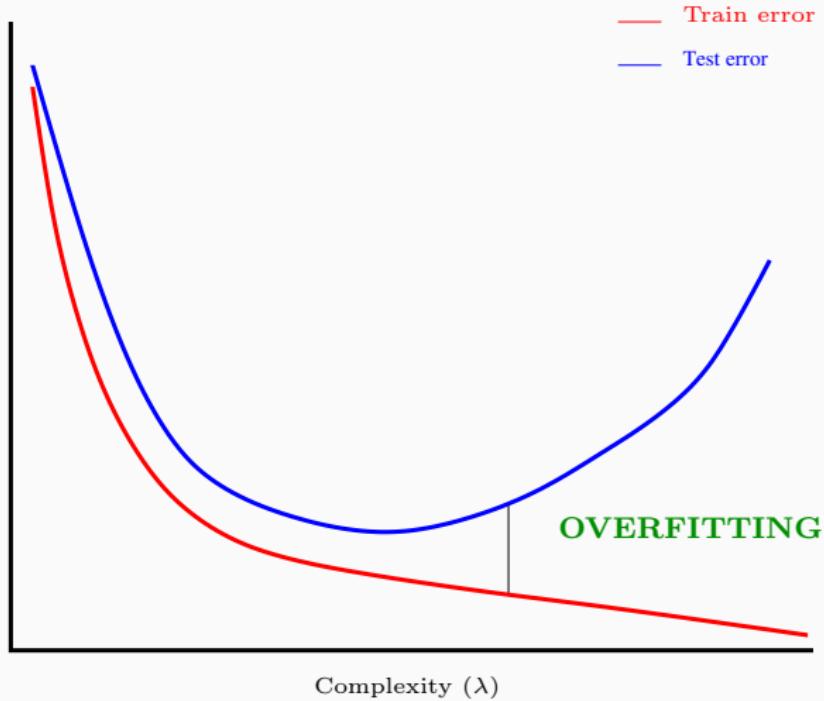
- Le paramètre λ à sélectionner représente le plus souvent la **complexité du modèle** :

Complexité \Rightarrow compromis biais/variance

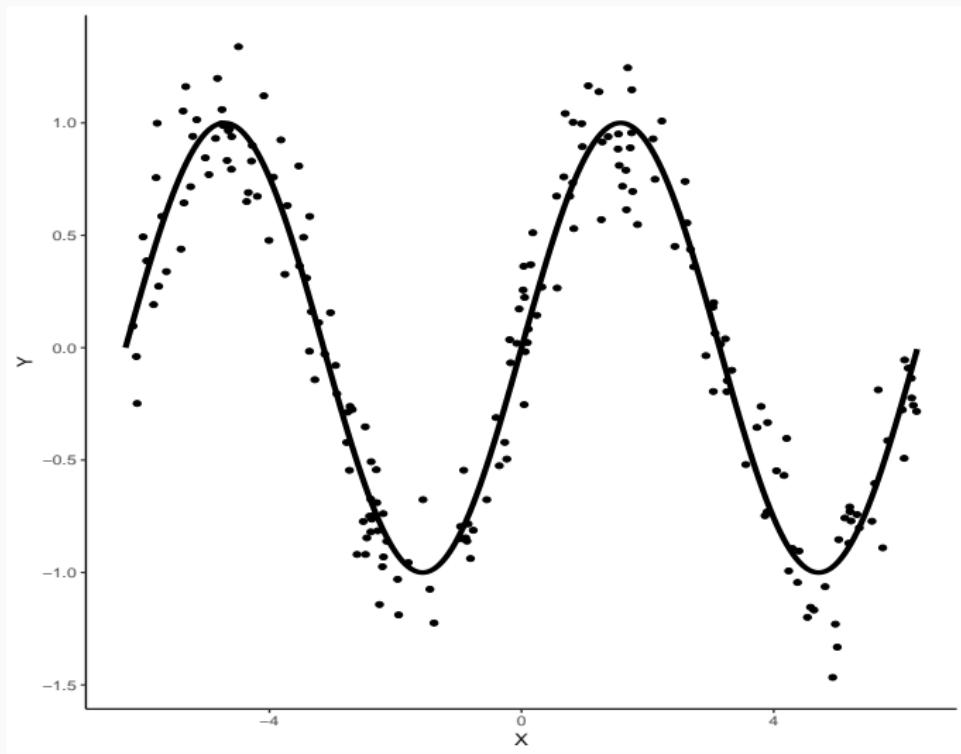
- λ petit \Rightarrow modèle peu flexible \Rightarrow mauvaise adéquation sur les données \Rightarrow biais \nearrow , variance \searrow .
- λ grand \Rightarrow modèle trop flexible \Rightarrow **sur-ajustement** \Rightarrow biais \searrow , variance \nearrow .

Overfitting

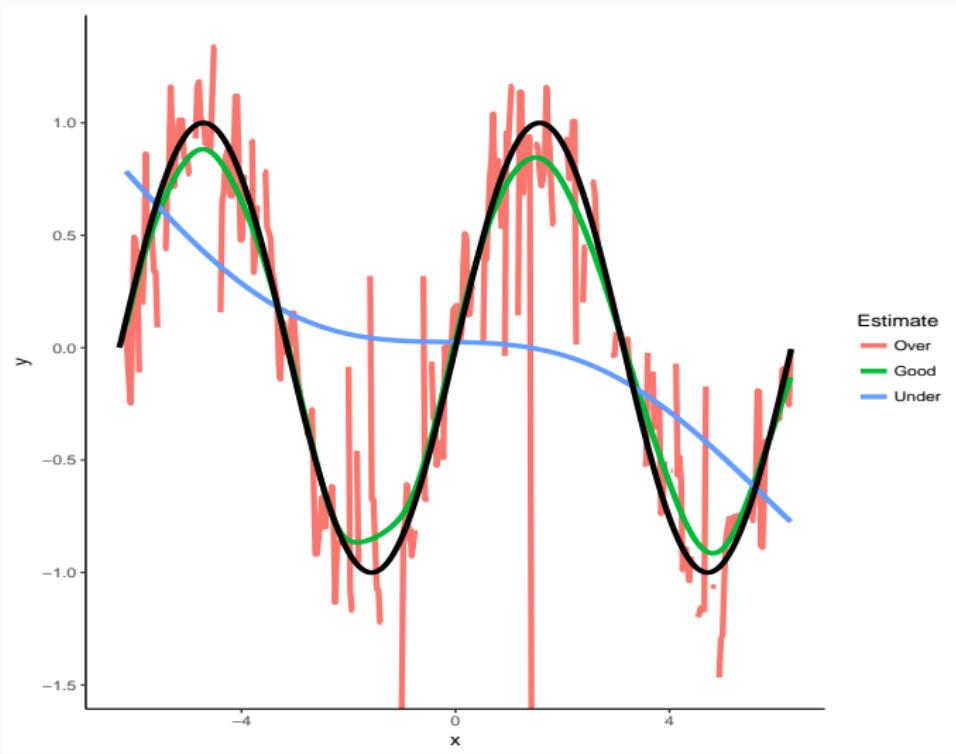
Sur-ajuster signifie que le modèle va (trop) bien ajuster sur les données d'apprentissage, il aura du mal à s'adapter à de nouveaux individus.



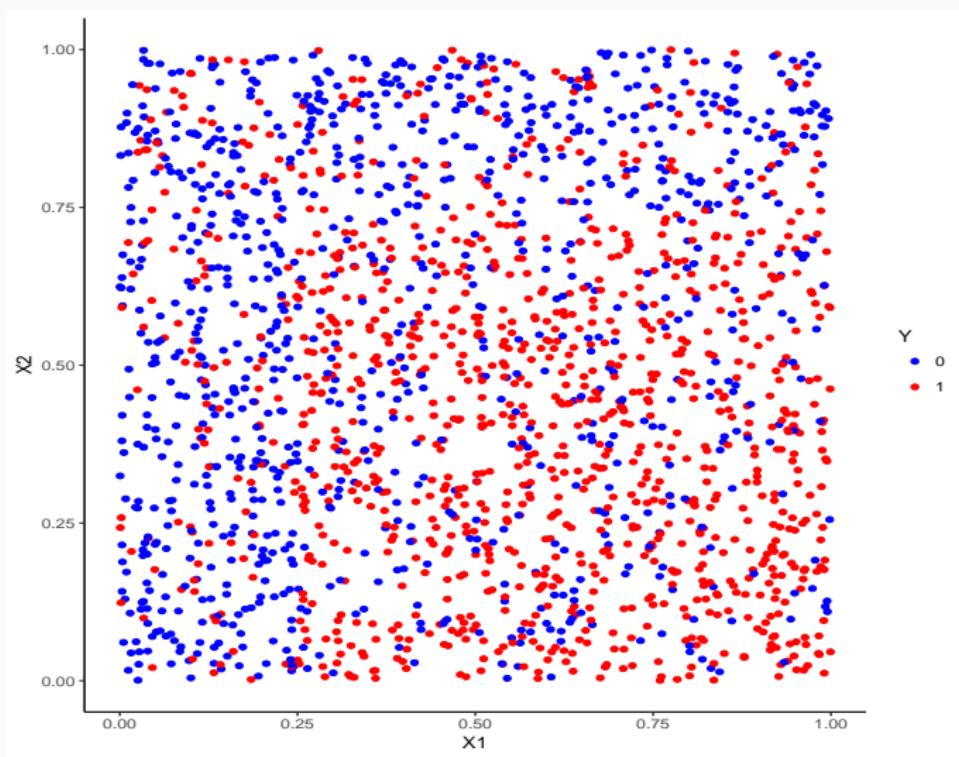
Overfitting en regression



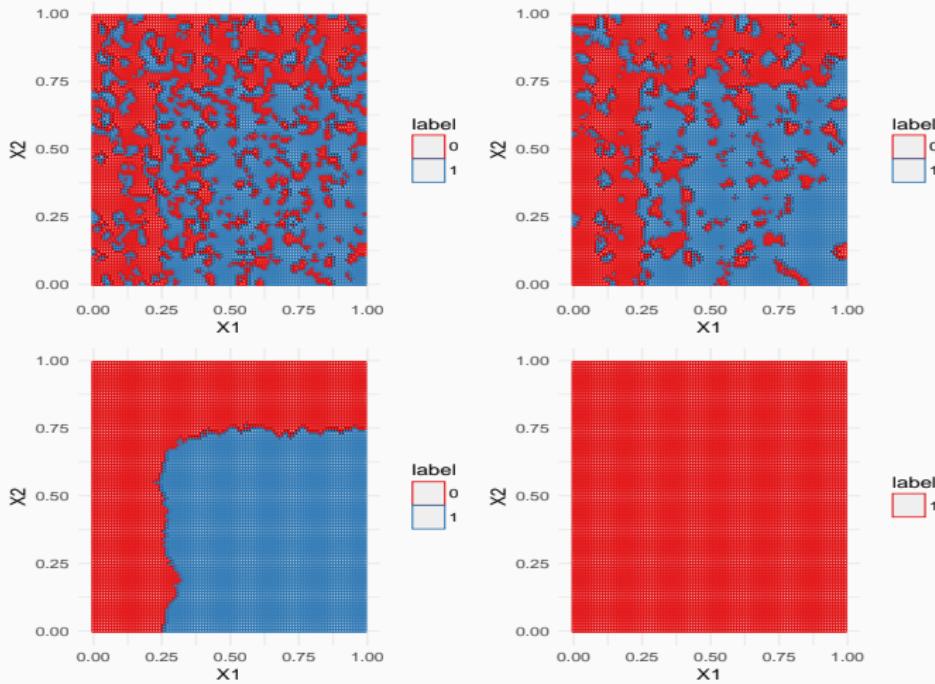
Overfitting en regression



Overfitting en classification supervisée



Overfitting en classification supervisée



Application shiny

https://lrouviere.shinyapps.io/overfitting_app/

Motivations

Cadre mathématique pour l'apprentissage supervisé

Exemples de fonction de perte

Estimation du risque

Le sur-apprentissage

Le package caret

Annexe : compléments sur les scores

Bibliographie

Le package caret

- Il permet d'évaluer la performance de plus de 230 méthodes :
<http://topepo.github.io/caret/index.html>

Le package caret

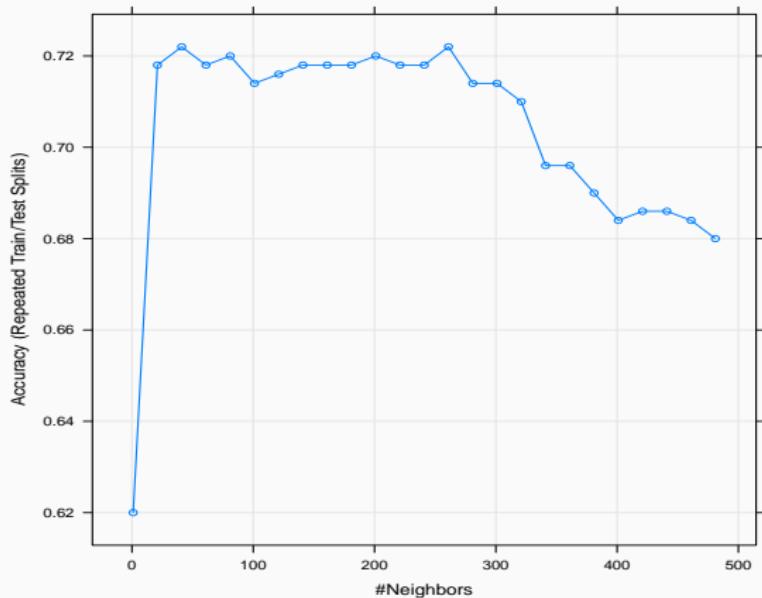
- Il permet d'évaluer la performance de plus de 230 méthodes :
<http://topepo.github.io/caret/index.html>
- Il suffit d'indiquer :
 - la méthode (logistique, ppv, arbre, randomForest...)
 - Une grille pour les paramètres (nombre de ppv...)
 - Le critère de performance (erreur de classification, AUC, risque quadratique...)
 - La méthode d'estimation du critère (apprentissage validation, validation croisée, bootstrap...)

Apprentissage-validation

```
> library(caret)
> K_cand <- data.frame(k=seq(1,500,by=20))
> library(caret)
> ctrl1 <- trainControl(method="LGOCV",number=1,index=list(1:1500))
> e1 <- train(Y~.,data=donnees,method="knn",trControl=ctrl1,tuneGrid=K_cand)
> e1
## k-Nearest Neighbors
##
## 2000 samples
##    2 predictor
##    2 classes: '0', '1'
##
## No pre-processing
## Resampling: Repeated Train/Test Splits Estimated (1 reps, 75%)
## Summary of sample sizes: 1500
## Resampling results across tuning parameters:
##
##     k      Accuracy   Kappa
##     1      0.620      0.2382571
##    21      0.718      0.4342076
##    41      0.722      0.4418388
```

```
##      61  0.718      0.4344073
##      81  0.720      0.4383195
##     101  0.714      0.4263847
##     121  0.716      0.4304965
##     141  0.718      0.4348063
##     161  0.718      0.4348063
##     181  0.718      0.4348063
##     201  0.720      0.4387158
##     221  0.718      0.4350056
##     241  0.718      0.4350056
##     261  0.722      0.4428232
##     281  0.714      0.4267894
##     301  0.714      0.4269915
##     321  0.710      0.4183621
##     341  0.696      0.3893130
##     361  0.696      0.3893130
##     381  0.688      0.3727988
##     401  0.684      0.3645329
##     421  0.686      0.3686666
##     441  0.686      0.3679956
##     461  0.684      0.3638574
##     481  0.680      0.3558050
## Accuracy was used to select the optimal model using the largest value.
## The final value used for the model was k = 261.
```

```
> plot(e1)
```



Validation croisée

```
> library(doMC)
> registerDoMC(cores = 3)
> ctrl2 <- trainControl(method="cv",number=10)
> e2 <- train(Y~.,data=dapp,method="knn",trControl=ctrl2,tuneGrid=K_cand)
> e2
## k-Nearest Neighbors
##
## 1500 samples
##    2 predictor
##    2 classes: '0', '1'
##
## No pre-processing
## Resampling: Cross-Validated (10 fold)
## Summary of sample sizes: 1350, 1350, 1350, 1350, 1350, 1350, ...
## Resampling results across tuning parameters:
##
##     k      Accuracy   Kappa
##     1    0.6240000  0.2446251
##    21   0.7393333  0.4745290
##    41   0.7306667  0.4570024
##    61   0.7340000  0.4636743
```

```
##     81  0.7333333  0.4632875
##    101  0.7313333  0.4593480
##    121  0.7326667  0.4624249
##    141  0.7333333  0.4640787
##    161  0.7366667  0.4708178
##    181  0.7313333  0.4602309
##    201  0.7326667  0.4626618
##    221  0.7293333  0.4559741
##    241  0.7306667  0.4585960
##    261  0.7353333  0.4676751
##    281  0.7286667  0.4537842
##    301  0.7253333  0.4463516
##    321  0.7173333  0.4294524
##    341  0.7113333  0.4168003
##    361  0.7080000  0.4099303
##    381  0.7140000  0.4213569
##    401  0.7073333  0.4073761
##    421  0.7100000  0.4126434
##    441  0.7066667  0.4054984
##    461  0.6966667  0.3844183
##    481  0.6860000  0.3612515
##
## Accuracy was used to select the optimal model using the largest value.
## The final value used for the model was k = 21.
```

Validation croisée répétée

```
> ctrl3 <- trainControl(method="repeatedcv",repeats=5,number=10)
> e3 <- train(Y~.,data=dapp,method="knn",trControl=ctrl3,tuneGrid=K_cand)
> e3
## k-Nearest Neighbors
##
## 1500 samples
##      2 predictor
##      2 classes: '0', '1'
##
## No pre-processing
## Resampling: Cross-Validated (10 fold, repeated 5 times)
## Summary of sample sizes: 1350, 1350, 1350, 1350, 1350, 1350, ...
## Resampling results across tuning parameters:
##
##     k      Accuracy   Kappa
##     1    0.6232000  0.2438066
##    21   0.7354667  0.4665640
##    41   0.7314667  0.4585144
##    61   0.7317333  0.4592608
##    81   0.7302667  0.4568784
##   101   0.7310667  0.4589567
```

```
## 121 0.7320000 0.4609326
## 141 0.7322667 0.4616077
## 161 0.7336000 0.4643374
## 181 0.7340000 0.4649895
## 201 0.7332000 0.4632905
## 221 0.7325333 0.4620114
## 241 0.7316000 0.4600484
## 261 0.7305333 0.4578098
## 281 0.7286667 0.4536040
## 301 0.7238667 0.4434101
## 321 0.7189333 0.4330787
## 341 0.7136000 0.4215865
## 361 0.7122667 0.4183400
## 381 0.7098667 0.4131761
## 401 0.7090667 0.4112403
## 421 0.7058667 0.4043164
## 441 0.7001333 0.3920207
## 461 0.6952000 0.3811374
## 481 0.6872000 0.3636126
##
## Accuracy was used to select the optimal model using the largest value.
## The final value used for the model was k = 21.
```

Critère AUC

```
> donnees1 <- donnees
> names(donnees1)[3] <- c("Class")
> levels(donnees1$Class) <- c("G0","G1")
> ctrl11 <- trainControl(method="LGOCV",number=1,index=list(1:1500),
+                         classProbs=TRUE,summary=twoClassSummary)
> e4 <- train(Class~.,data=donnees1,method="knn",trControl=ctrl11,
+               metric="ROC",tuneGrid=K_cand)
> e4
## k-Nearest Neighbors
##
## 2000 samples
##    2 predictor
##    2 classes: 'G0', 'G1'
##
## No pre-processing
## Resampling: Repeated Train/Test Splits Estimated (1 reps, 75%)
## Summary of sample sizes: 1500
## Resampling results across tuning parameters:
##
```

##	k	ROC	Sens	Spec
##	1	0.6190866	0.5983264	0.6398467
##	21	0.7171484	0.6903766	0.7432950
##	41	0.7229757	0.6861925	0.7547893
##	61	0.7200500	0.6945607	0.7394636
##	81	0.7255567	0.6945607	0.7432950
##	101	0.7319450	0.6903766	0.7356322
##	121	0.7382452	0.6945607	0.7356322
##	141	0.7353757	0.7029289	0.7318008
##	161	0.7308549	0.7029289	0.7318008
##	181	0.7351272	0.7029289	0.7318008
##	201	0.7340050	0.7029289	0.7356322
##	221	0.7324099	0.7071130	0.7279693
##	241	0.7349028	0.7071130	0.7279693
##	261	0.7365780	0.7071130	0.7356322
##	281	0.7349749	0.6987448	0.7279693
##	301	0.7356963	0.7029289	0.7241379
##	321	0.7341493	0.6861925	0.7318008
##	341	0.7343898	0.6527197	0.7356322
##	361	0.7306385	0.6527197	0.7356322
##	381	0.7301816	0.6359833	0.7394636
##	401	0.7270957	0.6276151	0.7356322
##	421	0.7255487	0.6317992	0.7356322

```
##   441  0.7258933  0.6192469  0.7471264
##   461  0.7220619  0.6150628  0.7471264
##   481  0.7236330  0.6108787  0.7432950
##
## ROC was used to select the optimal model using the largest value.
## The final value used for the model was k = 121.
```

```
##   441  0.7258933  0.6192469  0.7471264
##   461  0.7220619  0.6150628  0.7471264
##   481  0.7236330  0.6108787  0.7432950
##
## ROC was used to select the optimal model using the largest value.
## The final value used for the model was k = 121.
```

⇒ Partie 1 du tuto

Motivations

Cadre mathématique pour l'apprentissage supervisé

Exemples de fonction de perte

Estimation du risque

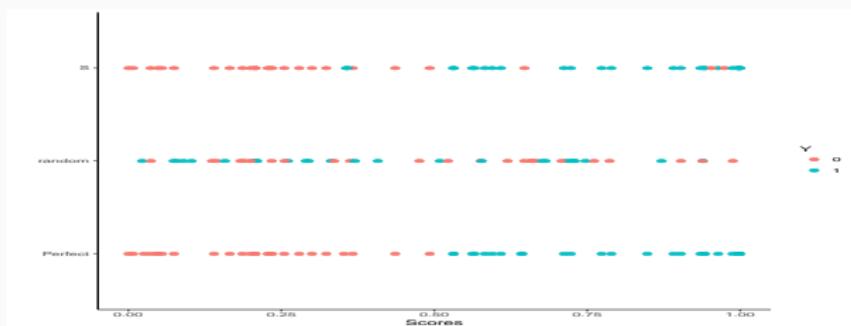
Le sur-apprentissage

Le package caret

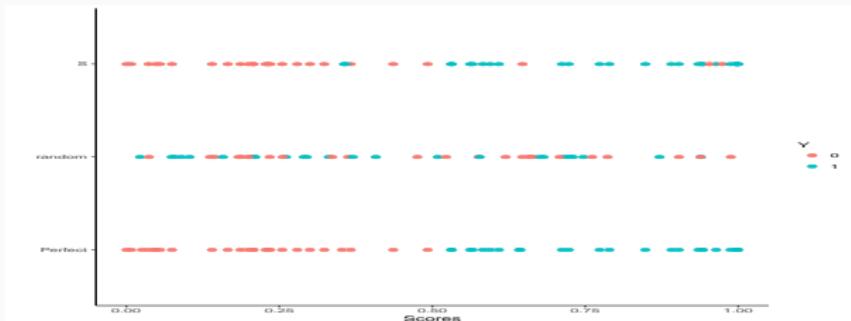
Annexe : compléments sur les scores

Bibliographie

Scores parfait et aléatoire



Scores parfait et aléatoire

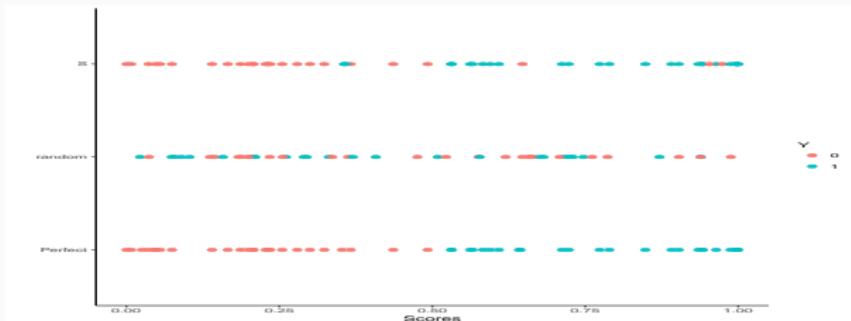


Définition

- *Score parfait* : il est tel qu'il existe un seuil s^* tel que

$$\mathbf{P}(Y = 1 | S(X) \geq s^*) = 1 \quad \text{et} \quad \mathbf{P}(Y = -1 | S(X) < s^*) = 1.$$

Scores parfait et aléatoire



Définition

- *Score parfait* : il est tel qu'il existe un seuil s^* tel que

$$\mathbb{P}(Y = 1 | S(X) \geq s^*) = 1 \quad \text{et} \quad \mathbb{P}(Y = -1 | S(X) < s^*) = 1.$$

- *Score aléatoire* : il est tel que $S(X)$ et Y sont indépendantes.

Lien score/règle de prévision

- Etant donné un score S , on peut déduire une **règle de prévision** en **fixant un seuil s** (la réciproque n'est pas vraie) :

$$g_s(x) = \begin{cases} 1 & \text{si } S(x) \geq s \\ -1 & \text{sinon.} \end{cases}$$

- Cette règle définit la **table de confusion**

	$g_s(X) = -1$	$g_s(X) = 1$
$Y = -1$	OK	E_1
$Y = 1$	E_2	OK

Lien score/règle de prévision

- Etant donné un score S , on peut déduire une **règle de prévision** en **fixant un seuil s** (la réciproque n'est pas vraie) :

$$g_s(x) = \begin{cases} 1 & \text{si } S(x) \geq s \\ -1 & \text{sinon.} \end{cases}$$

- Cette règle définit la **table de confusion**

	$g_s(X) = -1$	$g_s(X) = 1$
$Y = -1$	OK	E_1
$Y = 1$	E_2	OK

- Pour chaque seuil s , on distingue deux types d'**erreur**

$$\alpha(s) = \mathbf{P}(g_s(X) = 1 | Y = -1) = \mathbf{P}(S(X) \geq s | Y = -1)$$

et

$$\beta(s) = \mathbf{P}(g_s(X) = -1 | Y = 1) = \mathbf{P}(S(X) < s | Y = 1).$$

On définit également

- Spécificité : $sp(s) = \mathbf{P}(S(X) < s | Y = -1) = 1 - \alpha(s)$
- Sensibilité : $se(s) = \mathbf{P}(S(X) \geq s | Y = 1) = 1 - \beta(s)$

On définit également

- Spécificité : $sp(s) = \mathbf{P}(S(X) < s | Y = -1) = 1 - \alpha(s)$
- Sensibilité : $se(s) = \mathbf{P}(S(X) \geq s | Y = 1) = 1 - \beta(s)$

Performance d'un score

Elle se mesure généralement en visualisant les erreurs $\alpha(s)$ et $\beta(s)$ et/ou la spécificité et la sensibilité pour tous les seuils s .

Courbe ROC

- Idée : représenter sur un graphe 2d les deux types d'erreur pour **tous les seuils** s .

Définition

*C'est une **courbe paramétrée** par le seuil :*

$$\begin{cases} x(s) = \alpha(s) = 1 - sp(s) = \mathbf{P}(S(X) > s | Y = -1) \\ y(s) = 1 - \beta(s) = se(s) = \mathbf{P}(S(X) \geq s | Y = 1) \end{cases}$$

Courbe ROC

- Idée : représenter sur un graphe 2d les deux types d'erreur pour tous les seuils s .

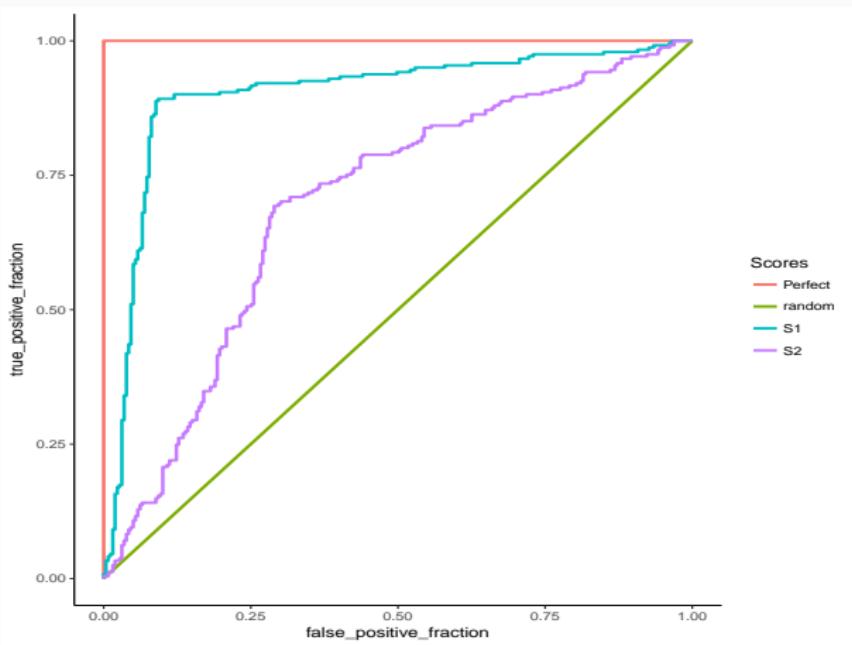
Définition

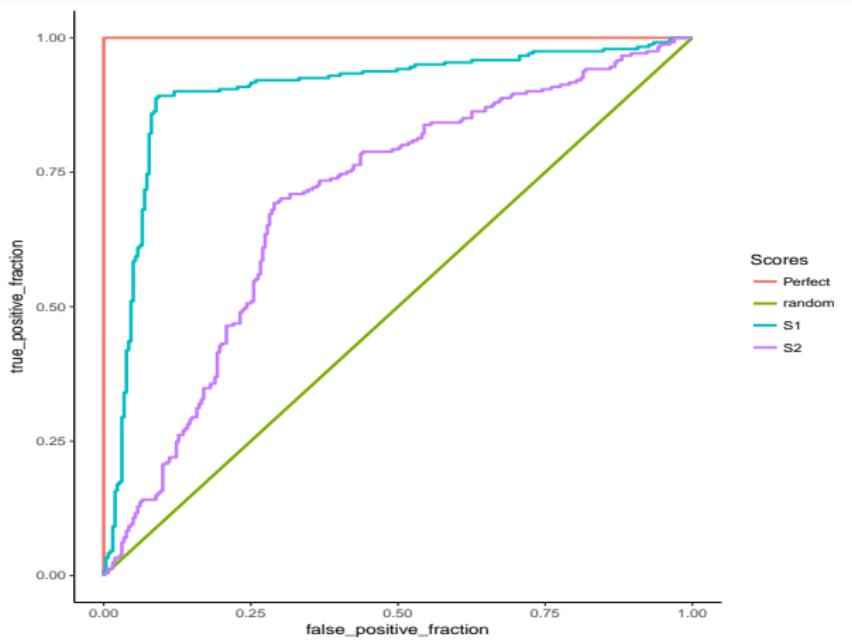
C'est une *courbe paramétrée par le seuil* :

$$\begin{cases} x(s) = \alpha(s) = 1 - sp(s) = \mathbb{P}(S(X) > s | Y = -1) \\ y(s) = 1 - \beta(s) = se(s) = \mathbb{P}(S(X) \geq s | Y = 1) \end{cases}$$

Remarque

- La courbe ROC d'un score **parfait** passe par le point $(0,1)$.
- La courbe ROC d'un score **aléatoire** correspond à la **première bissectrice**.





Interprétation

On mesurera la performance d'un score par sa **capacité à se rapprocher de la droite d'équation $y = 1$** le plus vite possible.

Définition

- L'aire sous la courbe ROC d'un score S , notée $AUC(S)$ est souvent utilisée pour mesurer sa performance.
- Pour un score parfait on a $AUC(S) = 1$, pour un score aléatoire $AUC(S) = 1/2$.

AUC

Définition

- L'aire sous la courbe ROC d'un score S , notée $AUC(S)$ est souvent utilisée pour mesurer sa performance.
- Pour un score parfait on a $AUC(S) = 1$, pour un score aléatoire $AUC(S) = 1/2$.

Proposition

- Etant données deux observations (X_1, Y_1) et (X_2, Y_2) indépendantes et de même loi que (X, Y) , on a

$$AUC(S) = \mathbf{P}(S(X_1) \geq S(X_2) | (Y_1, Y_2) = (1, -1)).$$

AUC

```
> library(pROC)
> df1 %>% group_by(Scores) %>% summarize(auc(D,M))
## # A tibble: 4 x 2
##   Scores   `auc(D, M)`
##   <chr>     <dbl>
## 1 Perfect      1
## 2 random      0.5
## 3 S1          0.896
## 4 S2          0.699
```

Score optimal

- Le critère $AUC(S)$ peut être interprété comme une **fonction de perte** pour un score S ;
- Se pose donc la question d'existence d'un **score optimal** S^* vis-à-vis de ce critère.

Score optimal

- Le critère $AUC(S)$ peut être interprété comme une **fonction de perte** pour un score S ;
- Se pose donc la question d'existence d'un **score optimal** S^* vis-à-vis de ce critère.

Théorème ([Cléménçon et al., 2008])

Soit $S^*(x) = \mathbf{P}(Y = 1|X = x)$, on a alors pour toutes fonctions de score S

$$AUC(S^*) \geq AUC(S).$$

Score optimal

- Le critère $AUC(S)$ peut être interprété comme une **fonction de perte** pour un score S ;
- Se pose donc la question d'existence d'un **score optimal** S^* vis-à-vis de ce critère.

Théorème ([Cléménçon et al., 2008])

Soit $S^*(x) = \mathbf{P}(Y = 1|X = x)$, on a alors pour toutes fonctions de score S

$$AUC(S^*) \geq AUC(S).$$

Conséquence

Le problème pratique consistera à trouver un "**bon**" estimateur $S_n(x) = S_n(x, \mathcal{D}_n)$ de

$$S^*(x) = \mathbf{P}(Y = 1|X = x).$$

Motivations

Cadre mathématique pour l'apprentissage supervisé

Exemples de fonction de perte

Estimation du risque

Le sur-apprentissage

Le package caret

Annexe : compléments sur les scores

Bibliographie

Références i

-  Besse, P. (2018).
Science des données - Apprentissage Statistique.
INSA - Toulouse.
http://www.math.univ-toulouse.fr/~besse/pub/Appren_stat.pdf.
-  Bousquet, O., Boucheron, S., and Lugosi, G. (2003).
Introduction to Statistical Learning Theory, chapter Advanced Lectures on Machine Learning.
Springer.
-  Cléménçon, S., Lugosi, G., and Vayatis, N. (2008).
Ranking and empirical minimization of u-statistics.
The Annals of Statistics, 36(2) :844–874.

Références ii

-  Hastie, T., Tibshirani, R., and Friedman, J. (2009).
The Elements of Statistical Learning : Data Mining, Inference, and Prediction.
Springer, second edition.
-  James, G., Witten, D., Hastie, T., and Tibshirani, R. (2015).
The Elements of Statistical Learning : Data Mining, Inference, and Prediction.
Springer.
-  Vapnik, V. (2000).
The Nature of Statistical Learning Theory.
Springer, second edition.

-  Wikistat (2020a).
Apprentissage machine — introduction.
<http://wikistat.fr/pdf/st-m-Intro-ApprentStat.pdf>.
-  Wikistat (2020b).
Qualité de prévision et risque.
<http://wikistat.fr/pdf/st-m-app-risque.pdf>.

Deuxième partie II

Support vector machine

SVM - cas séparable

SVM : cas non séparable

SVM non linéaire : astuce du noyau

Scores et probabilités

Compléments : SVM multi-classes et SVR

SVM multiclasses

Support vector regression (SVR)

Bibliographie

- **Discrimination binaire** : Y à valeurs dans $\{-1, 1\}$ et $X = (X_1, \dots, X_p)$ dans \mathbb{R}^p .

Objectif

- Estimer la **fonction de score** $S(x) = \mathbf{P}(Y = 1|X = x)$;
- En déduire une **règle de classification** $g : \mathbb{R}^p \rightarrow \{-1, 1\}$.

Règles linéaires

- Elles consistent à séparer l'espace des X par un hyperplan.
- On classe ensuite 1 d'un côté de l'hyperplan, -1 de l'autre côté.

Règles linéaires

- Elles consistent à séparer l'espace des X par un hyperplan.
- On classe ensuite 1 d'un côté de l'hyperplan, -1 de l'autre côté.

Mathématiquement

- On cherche une combinaison linéaire des variables $w_1X_1 + \dots + w_pX_p$.
- Règle associée :

$$g(x) = \begin{cases} 1 & \text{si } w_1X_1 + \dots + w_pX_p \geq 0 \\ -1 & \text{sinon.} \end{cases}$$

Exemple 1 : régression logistique

- Modèle :

$$\text{logit } \frac{p(x)}{1 - p(x)} = \beta_0 + \beta_1 x_1 + \dots + \beta_p x_p$$

où $p(x) = \mathbf{P}(Y = 1 | X = x)$.

- Règle de classification :

$$g(x) = \begin{cases} 1 & \text{si } p(x) \geq 0.5 \\ -1 & \text{sinon.} \end{cases}$$

Exemple 1 : régression logistique

- Modèle :

$$\text{logit } \frac{p(x)}{1 - p(x)} = \beta_0 + \beta_1 x_1 + \dots + \beta_p x_p$$

où $p(x) = \mathbf{P}(Y = 1 | X = x)$.

- Règle de classification :

$$g(x) = \begin{cases} 1 & \text{si } p(x) \geq 0.5 \\ -1 & \text{sinon.} \end{cases}$$

- équivalent à

$$g(x) = \begin{cases} 1 & \text{si } \beta_0 + \beta_1 x_1 + \dots + \beta_p x_p \geq 0 \\ -1 & \text{sinon.} \end{cases}$$

Exemple 2 : LDA

- Modèle : $\mathcal{L}(X|Y = k) = \mathcal{N}(\mu_k, \Sigma), k = 0, 1.$
- Règle de classification :

$$g(x) = \begin{cases} 1 & \text{si } p(x) \geq 0.5 \\ -1 & \text{sinon.} \end{cases}$$

Exemple 2 : LDA

- Modèle : $\mathcal{L}(X|Y = k) = \mathcal{N}(\mu_k, \Sigma), k = 0, 1.$
- Règle de classification :

$$g(x) = \begin{cases} 1 & \text{si } p(x) \geq 0.5 \\ -1 & \text{sinon.} \end{cases}$$

- équivalent à

$$g(x) = \begin{cases} 1 & \text{si } c + x'\Sigma^{-1}(\mu_1 - \mu_0) \geq 0 \\ -1 & \text{sinon.} \end{cases}$$

Illustration avec $p = 2$

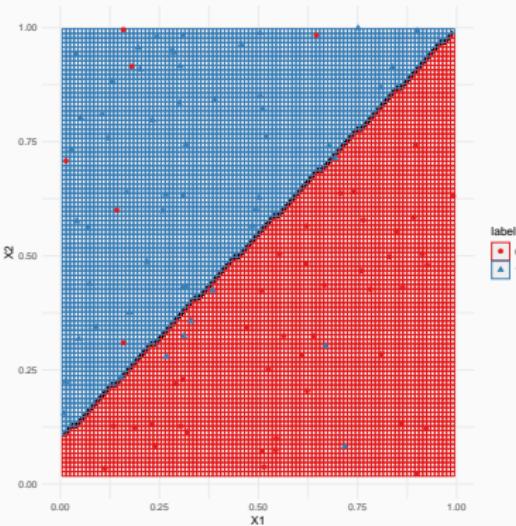
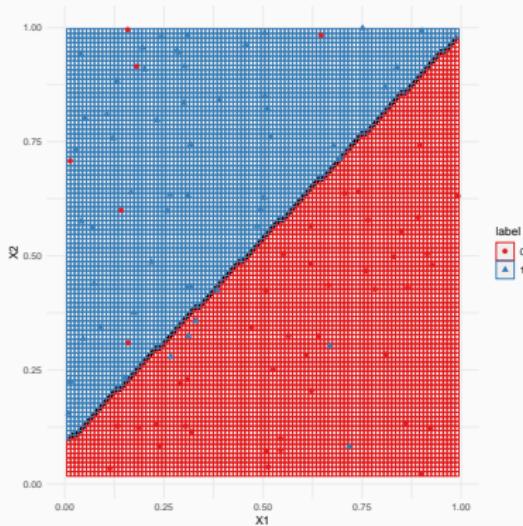


Figure 1 – Règles logistique (gauche) et lda (droite).

- Ces approches linéaires s'obtiennent à partir d'un modèle statistique
 - sur la loi de Y sachant X pour la logistique;
 - sur la loi de X sachant Y pour la discriminante linéaire.

- Ces approches linéaires s'obtiennent à partir d'un **modèle statistique**
 - sur la loi de **Y sachant X** pour la logistique ;
 - sur la loi de **X sachant Y** pour la discriminante linéaire.
- L'approche **SVM** repose sur le calcul direct du "**meilleur**" **hyperplan séparateur** qui sera déterminé à partir d'algorithmes d'optimisation.

SVM - cas séparable

SVM : cas non séparable

SVM non linéaire : astuce du noyau

Scores et probabilités

Compléments : SVM multi-classes et SVR

SVM multiclasses

Support vector regression (SVR)

Bibliographie

Bibliographie

En plus des documents cités précédemment, cette partie s'appuie sur les diapos de cours de

- Magalie Fromont, Apprentissage statistique, Université Rennes 2 ([Fromont, 2015]).
- Jean-Philippe Vert, *Support vector machines and applications in computational biology*, disponible à l'url
<http://cbio.ensmp.fr/~jvert/svn/kernelcourse/slides/kernel2h/kernel2h.pdf>

Remarque

Les aspects techniques ne seront pas présentés ici, on pourra en trouver dans la partie 2.4 du tutoriel.

Présentation

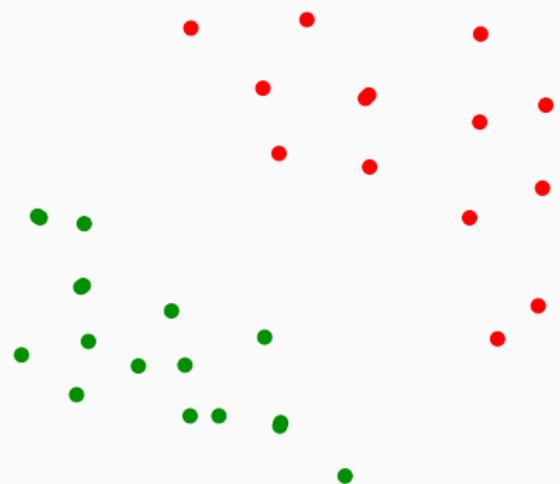
- L'approche SVM [Vapnik, 2000] peut être vue comme une généralisation de "recherche d'hyperplan optimal".

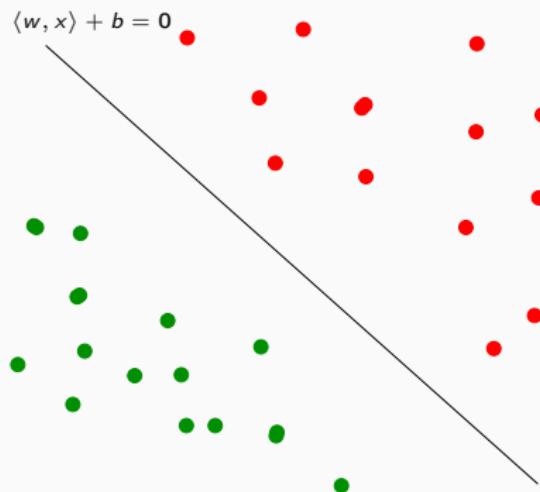
- L'approche SVM [Vapnik, 2000] peut être vue comme une généralisation de "recherche d'hyperplan optimal".

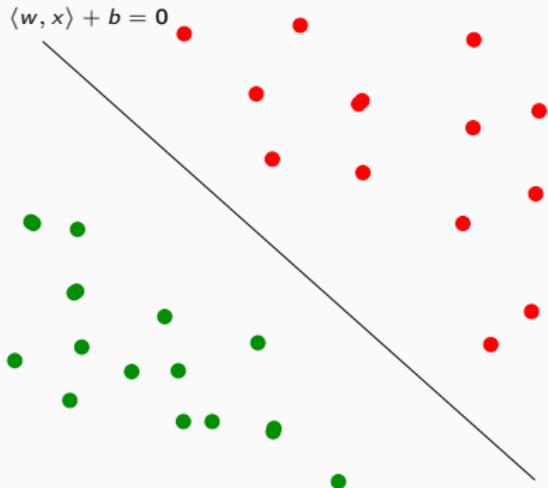
Cas simple

Les données $(x_1, y_1), \dots, (x_n, y_n)$ sont dites linéairement séparables si il existe $(w, b) \in \mathbb{R}^p \times \mathbb{R}$ tel que pour tout i :

- $y_i = 1$ si $\langle w, x_i \rangle + b = w^t x_i + b > 0$;
- $y_i = -1$ si $\langle w, x_i \rangle + b = w^t x_i + b < 0$.

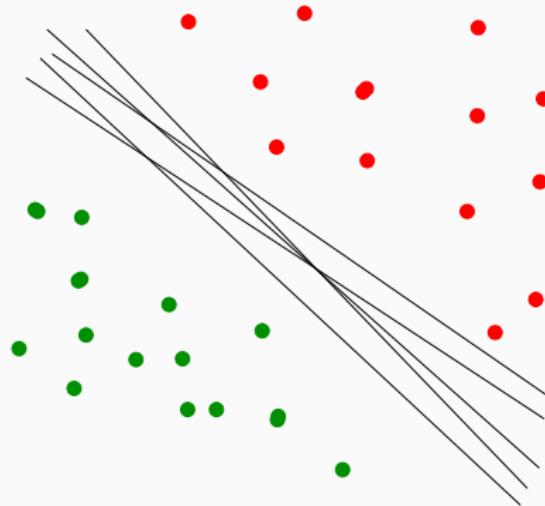






Vocabulaire

- L'équation $\langle w, x \rangle + b$ définit un **hyperplan séparateur** de vecteur normal w .
- La fonction signe($\langle w, x \rangle + b$) est une règle de **discrimination** potentielle.

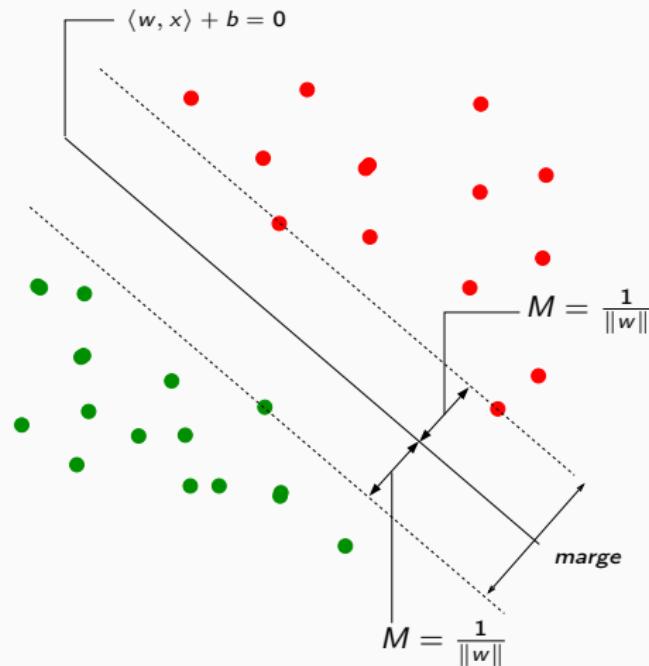


Problème

Il existe une infinité d'hyperplans séparateurs donc une infinité de règles de discrimination potentielles.

Solution

[Vapnik, 2000] propose de choisir l'hyperplan ayant la **marge maximale**.



Le problème d'optimisation

- On veut trouver l'hyperplan de **marge maximale** qui **sépare** les groupes.

Le problème d'optimisation

- On veut trouver l'hyperplan de **marge maximale** qui **sépare** les groupes.

Hyperplan séparateur optimal

Solution du problème **d'optimisation sous contrainte** :

- **Version 1** :

$$\max_{w,b,\|w\|=1} M$$

sous les contraintes $y_i(w^t x_i + b) \geq M, i = 1, \dots, n.$

Le problème d'optimisation

- On veut trouver l'hyperplan de **marge maximale** qui **sépare** les groupes.

Hyperplan séparateur optimal

Solution du problème **d'optimisation sous contrainte** :

- **Version 1** :

$$\max_{w,b, \|w\|=1} M$$

sous les contraintes $y_i(w^t x_i + b) \geq M, i = 1, \dots, n.$

- **Version 2** :

$$\min_{w,b} \frac{1}{2} \|w\|^2$$

sous les contraintes $y_i(w^t x_i + b) \geq 1, i = 1, \dots, n.$

Solutions

- On obtient

$$w^* = \sum_{i=1}^n \alpha_i^* y_i x_i.$$

où les α_i^* sont des constantes positives qui s'obtiennent en résolvant le **dual** du problème précédent.

- De plus, b^* s'obtient en résolvant

$$\alpha_i^* [y_i (x_i^t w + b) - 1] = 0$$

pour un α_i^* non nul.

Solutions

- On obtient

$$w^* = \sum_{i=1}^n \alpha_i^* y_i x_i.$$

où les α_i^* sont des constantes positives qui s'obtiennent en résolvant le **dual** du problème précédent.

- De plus, b^* s'obtient en résolvant

$$\alpha_i^* [y_i (x_i^t w + b) - 1] = 0$$

pour un α_i^* non nul.

Remarque

w^* s'écrit comme une **combinaison linéaire** des x_i .

Propriété (conditions KKT)

$$\alpha_i^*[y_i(x_i^t w^* + b) - 1] = 0, i = 1, \dots, n.$$

Vecteurs supports

Propriété (conditions KKT)

$$\alpha_i^*[y_i(x_i^t w^* + b) - 1] = 0, i = 1, \dots, n.$$

Conséquence (importante)

- Si $\alpha_i^* \neq 0$ alors $y_i(x_i^t w^* + b) = 1$ et x_i est sur la marge.
- w^* se calcule uniquement à partir de ces points là.

Vecteurs supports

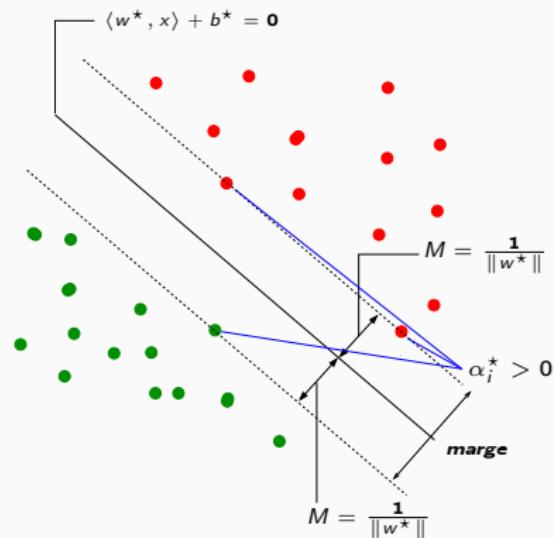
Propriété (conditions KKT)

$$\alpha_i^*[y_i(x_i^t w^* + b) - 1] = 0, i = 1, \dots, n.$$

Conséquence (importante)

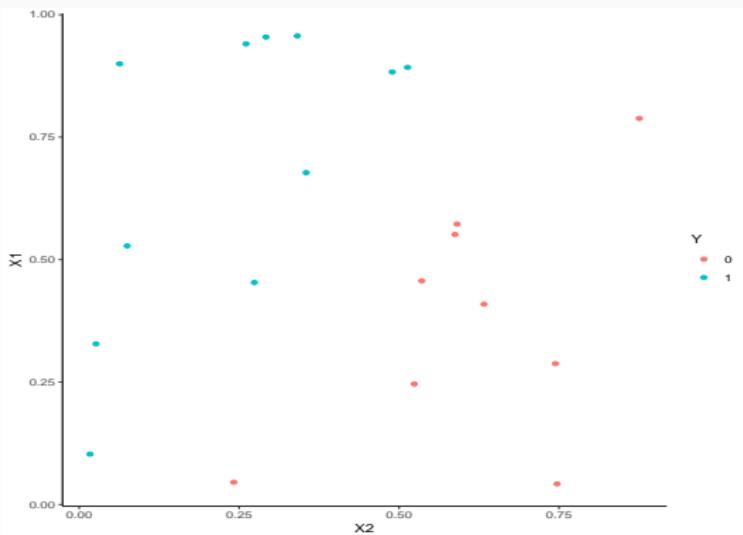
- Si $\alpha_i^* \neq 0$ alors $y_i(x_i^t w^* + b) = 1$ et x_i est sur la marge.
- w^* se calcule uniquement à partir de ces points là.
- Ces points sont appelés les vecteurs supports de la SVM.

Représentation



Le coin R

- La fonction `svm` du package `e1071` permet d'ajuster des **SVM**.



```
> library(e1071)
> mod.svm <- svm(Y ~ ., data=df, kernel="linear", cost=10000000000)
```

La fonction svm

- Les vecteurs supports :

```
> mod.svm$index  
## [1] 6 14 12
```

- $\text{mod.svm\$coefs} = \alpha_i^* y_i$ pour chaque vecteur support

```
> mod.svm$coefs  
## [,1]  
## [1,] 1.898982  
## [2,] 1.905497  
## [3,] -3.804479
```

La fonction svm

- Les vecteurs supports :

```
> mod.svm$index  
## [1] 6 14 12
```

- $\text{mod.svm\$coefs} = \alpha_i^* y_i$ pour chaque vecteur support

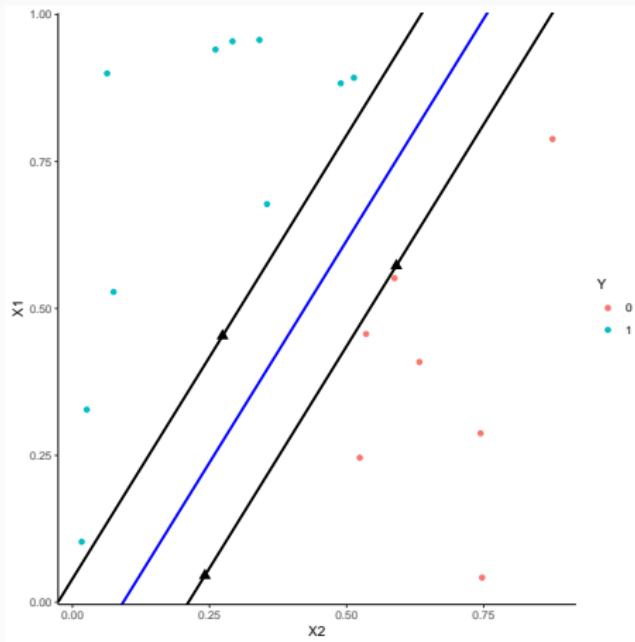
```
> mod.svm$coefs  
##           [,1]  
## [1,] 1.898982  
## [2,] 1.905497  
## [3,] -3.804479
```

- On peut en déduire l'hyperplan séparateur

```
> w <- apply(mod.svm$coefs*df[mod.svm$index,2:3],2,sum)  
> b <- -mod.svm$rho  
> w  
##          X1          X2  
## -0.5470382  0.5427583  
> b  
## [1] -0.4035113
```

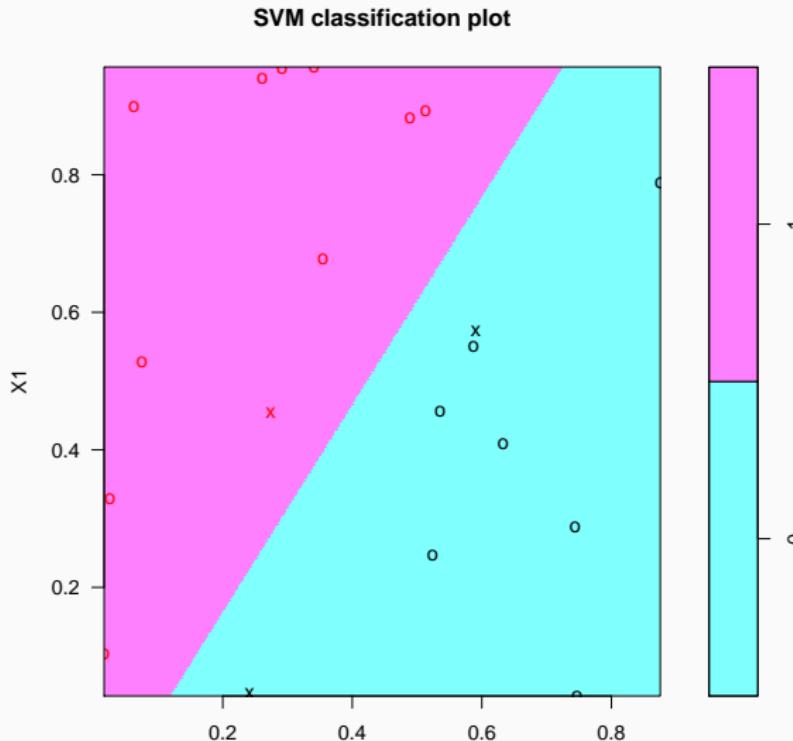
On peut ainsi visualiser

- les vecteurs supports ;
- l'hyperplan séparateur ;
- la marge.



- La fonction **plot** donne aussi une représentation de l'**hyperplan séparateur**.

```
> plot(mod.svm,data=df,fill=TRUE,grid=500)
```



SVM - cas séparable

SVM : cas non séparable

SVM non linéaire : astuce du noyau

Scores et probabilités

Compléments : SVM multi-classes et SVR

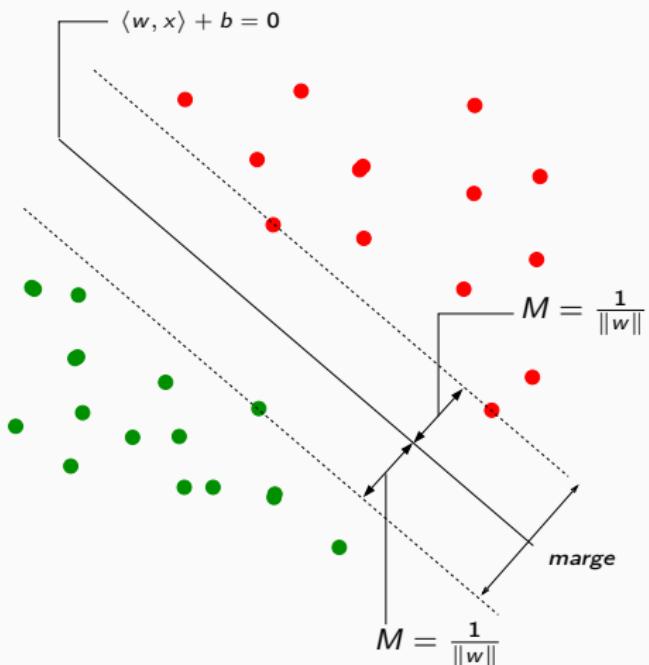
SVM multiclasses

Support vector regression (SVR)

Bibliographie

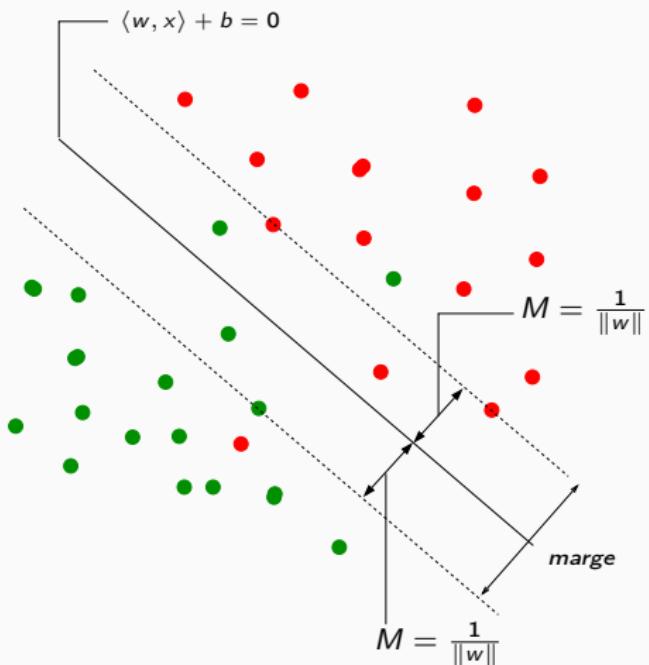
Problème

Dans la vraie vie, les données ne sont (quasiment) jamais linéairement séparables...



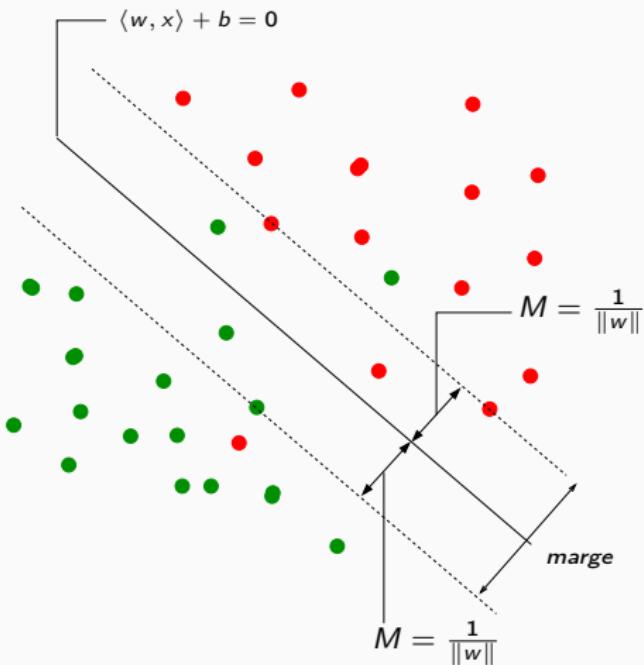
Problème

Dans la vraie vie, les données ne sont (quasiment) jamais linéairement séparables...



Problème

Dans la vraie vie, les données ne sont (quasiment) **jamais linéairement séparables**...



Idée

Autoriser certains points

1. à être **bien classés** mais à l'**intérieur** de la marge ;
2. et/ou à être **mal classés**.

Slack variables

Rappel : cas séparable

$$\min_{w,b} \frac{1}{2} \|w\|^2$$

sous les contraintes $y_i(w^t x_i + b) \geq 1, i = 1, \dots, n.$

- Les contraintes $y_i(w^t x_i + b) \geq 1$ signifient que tous les points se trouvent en dehors de la frontière définie par la **marge** ;

Slack variables

Rappel : cas séparable

$$\min_{w,b} \frac{1}{2} \|w\|^2$$

sous les contraintes $y_i(w^t x_i + b) \geq 1, \quad i = 1, \dots, n.$

- Les contraintes $y_i(w^t x_i + b) \geq 1$ signifient que tous les points se trouvent en dehors de la frontière définie par la **marge** ;
- **Cas non séparable** : le problème ci-dessus n'admet pas de solution !

Slack variables

Rappel : cas séparable

$$\min_{w,b} \frac{1}{2} \|w\|^2$$

sous les contraintes $y_i(w^t x_i + b) \geq 1, i = 1, \dots, n.$

- Les contraintes $y_i(w^t x_i + b) \geq 1$ signifient que tous les points se trouvent en dehors de la frontière définie par la **marge** ;
- **Cas non séparable** : le problème ci-dessus n'admet pas de solution !

Variables ressorts

On introduit des **variables ressorts (slack variables)** positives ξ_1, \dots, ξ_n telles que $y_i(w^t x_i + b) \geq 1 - \xi_i$. 2 cas sont à distinguer :

1. $\xi_i \in [0, 1] \implies$

Slack variables

Rappel : cas séparable

$$\min_{w,b} \frac{1}{2} \|w\|^2$$

sous les contraintes $y_i(w^t x_i + b) \geq 1, i = 1, \dots, n.$

- Les contraintes $y_i(w^t x_i + b) \geq 1$ signifient que tous les points se trouvent en dehors de la frontière définie par la **marge** ;
- **Cas non séparable** : le problème ci-dessus n'admet pas de solution !

Variables ressorts

On introduit des **variables ressorts (slack variables)** positives ξ_1, \dots, ξ_n telles que $y_i(w^t x_i + b) \geq 1 - \xi_i$. 2 cas sont à distinguer :

1. $\xi_i \in [0, 1] \implies$ bien classé mais **dans** la région définie par la **marge** ;

Slack variables

Rappel : cas séparable

$$\min_{w,b} \frac{1}{2} \|w\|^2$$

sous les contraintes $y_i(w^t x_i + b) \geq 1, i = 1, \dots, n.$

- Les contraintes $y_i(w^t x_i + b) \geq 1$ signifient que tous les points se trouvent en dehors de la frontière définie par la **marge** ;
- **Cas non séparable** : le problème ci-dessus n'admet pas de solution !

Variables ressorts

On introduit des **variables ressorts (slack variables)** positives ξ_1, \dots, ξ_n telles que $y_i(w^t x_i + b) \geq 1 - \xi_i$. 2 cas sont à distinguer :

1. $\xi_i \in [0, 1] \implies$ bien classé mais **dans** la région définie par la **marge** ;
2. $\xi_i > 1 \implies$

Slack variables

Rappel : cas séparable

$$\min_{w,b} \frac{1}{2} \|w\|^2$$

sous les contraintes $y_i(w^t x_i + b) \geq 1, i = 1, \dots, n.$

- Les contraintes $y_i(w^t x_i + b) \geq 1$ signifient que tous les points se trouvent en dehors de la frontière définie par la **marge** ;
- **Cas non séparable** : le problème ci-dessus n'admet pas de solution !

Variables ressorts

On introduit des **variables ressorts (slack variables)** positives ξ_1, \dots, ξ_n telles que $y_i(w^t x_i + b) \geq 1 - \xi_i$. 2 cas sont à distinguer :

1. $\xi_i \in [0, 1] \implies$ bien classé mais **dans** la région définie par la **marge** ;
2. $\xi_i > 1 \implies$ **mal classé**.

- Bien entendu, on souhaite avoir le **maximum** de variables ressorts ξ_i **nulles** ;
- Lorsque $\xi_i > 0$, on souhaite que ξ_i soit le **plus petit possible**.

- Bien entendu, on souhaite avoir le **maximum** de variables ressorts ξ_i **nulles**;
- Lorsque $\xi_i > 0$, on souhaite que ξ_i soit le **plus petit possible**.

Cas non séparable : problème d'optimisation (primal)

- Il s'agit de minimiser en (w, b, ξ)

$$\frac{1}{2} \|w\|^2$$

sous les contraintes

$$\left\{ \begin{array}{l} y_i(w^t x_i + b) \geq 1 \end{array} \right.$$

- Bien entendu, on souhaite avoir le **maximum** de variables ressorts ξ_i **nulles**;
- Lorsque $\xi_i > 0$, on souhaite que ξ_i soit le **plus petit possible**.

Cas non séparable : problème d'optimisation (primal)

- Il s'agit de minimiser en (w, b, ξ)

$$\frac{1}{2} \|w\|^2 + C \sum_{i=1}^n \xi_i$$

sous les contraintes

$$\begin{cases} y_i(w^t x_i + b) \geq 1 - \xi_i \\ \xi_i \geq 0, i = 1, \dots, n. \end{cases}$$

- Bien entendu, on souhaite avoir le **maximum** de variables ressorts ξ_i **nulles**;
- Lorsque $\xi_i > 0$, on souhaite que ξ_i soit le **plus petit possible**.

Cas non séparable : problème d'optimisation (primal)

- Il s'agit de minimiser en (w, b, ξ)

$$\frac{1}{2} \|w\|^2 + C \sum_{i=1}^n \xi_i$$

sous les contraintes

$$\begin{cases} y_i(w^t x_i + b) \geq 1 - \xi_i \\ \xi_i \geq 0, i = 1, \dots, n. \end{cases}$$

- $C > 0$ est un paramètre à calibrer (**paramètre de coût**).

- Bien entendu, on souhaite avoir le **maximum** de variables ressorts ξ_i **nulles**;
- Lorsque $\xi_i > 0$, on souhaite que ξ_i soit le **plus petit possible**.

Cas non séparable : problème d'optimisation (primal)

- Il s'agit de minimiser en (w, b, ξ)

$$\frac{1}{2} \|w\|^2 + C \sum_{i=1}^n \xi_i$$

sous les contraintes
$$\begin{cases} y_i(w^t x_i + b) \geq 1 - \xi_i \\ \xi_i \geq 0, i = 1, \dots, n. \end{cases}$$

- $C > 0$ est un paramètre à calibrer (**paramètre de coût**).
- Le **cas séparable** correspond à $C \rightarrow \infty$.

- Les **solutions** de ce nouveau problème d'optimisation s'obtiennent de la **même façon** que dans le cas séparable (Lagrangien, problème dual...).
- L'**hyperplan optimal** est défini par

$$w^* = \sum_{i=1}^n \alpha_i^* y_i x_i$$

et b^* est solution de $y_i(\langle w^*, x_i \rangle + b^*) = 1$ pour tout i tel que $0 < \alpha_i^* < C$.

- Les **solutions** de ce nouveau problème d'optimisation s'obtiennent de la **même façon** que dans le cas séparable (Lagrangien, problème dual...).
- L'**hyperplan optimal** est défini par

$$w^* = \sum_{i=1}^n \alpha_i^* y_i x_i$$

et b^* est solution de $y_i(\langle w^*, x_i \rangle + b^*) = 1$ pour tout i tel que $0 < \alpha_i^* < C$.

Vecteurs supports

- Les x_i tels que $\alpha_i^* > 0$ sont les vecteurs supports ;
- On en distingue 2 types :
 1. ceux **sur la frontière** définie par la marge : $\xi_i^* = 0$;
 2. ceux **en dehors** : $\xi_i^* > 0$ et $\alpha_i^* = C$.

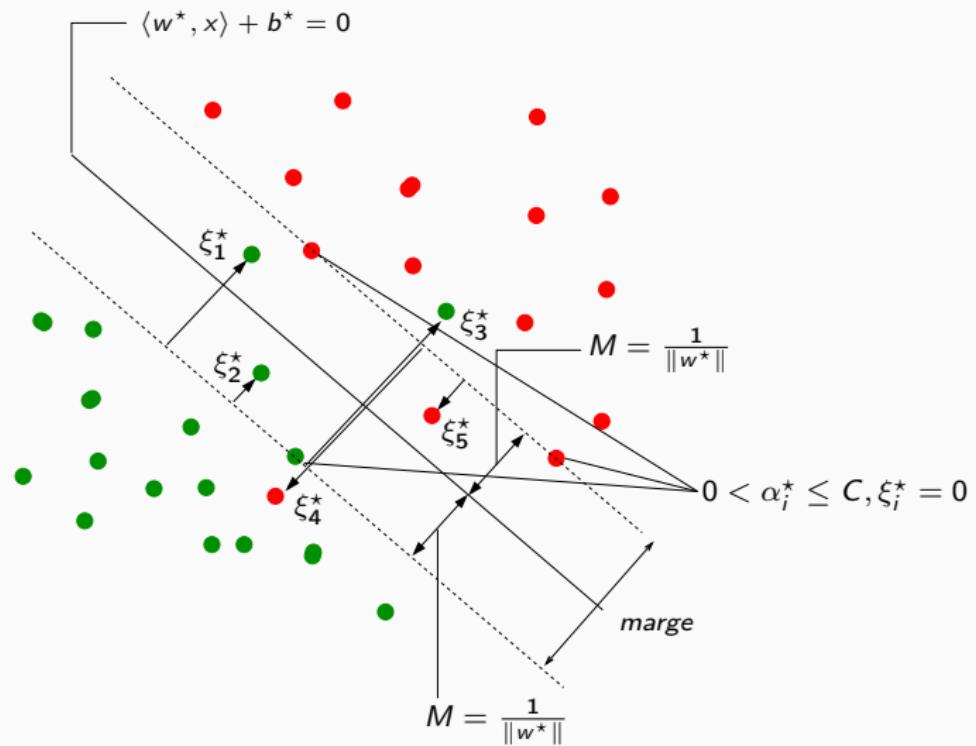
- Les **solutions** de ce nouveau problème d'optimisation s'obtiennent de la **même façon** que dans le cas séparable (Lagrangien, problème dual...).
- L'**hyperplan optimal** est défini par

$$w^* = \sum_{i=1}^n \alpha_i^* y_i x_i$$

et b^* est solution de $y_i(\langle w^*, x_i \rangle + b^*) = 1$ pour tout i tel que $0 < \alpha_i^* < C$.

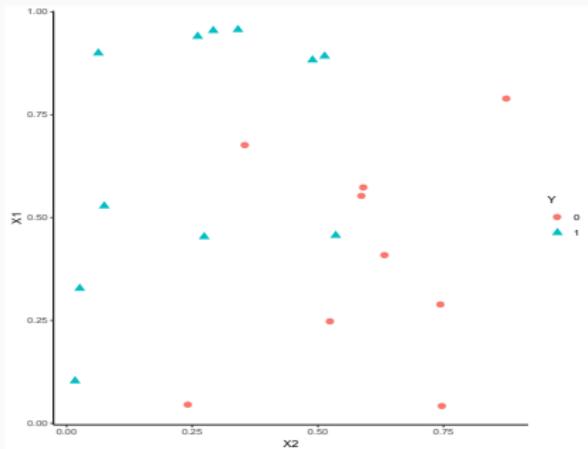
Vecteurs supports

- Les x_i tels que $\alpha_i^* > 0$ sont les vecteurs supports ;
- On en distingue 2 types :
 1. ceux **sur la frontière** définie par la marge : $\xi_i^* = 0$;
 2. ceux **en dehors** : $\xi_i^* > 0$ et $\alpha_i^* = C$.
- Les vecteurs **non supports** vérifient $\alpha_i^* = 0$ et $\xi_i^* = 0$.



Le coin R

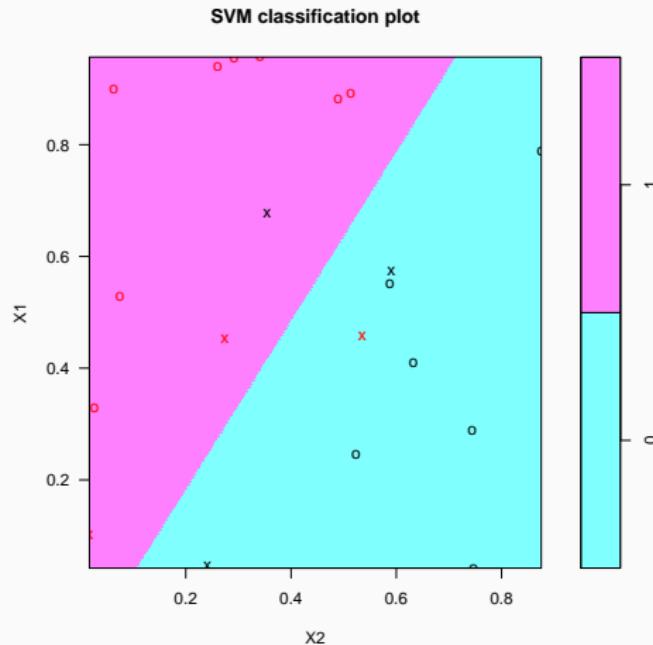
- On utilise la même fonction que dans le **cas séparable** (svm du package e1071);
- L'argument cost correspond à la **constante de régularisation C**.



```
> mod.svm1 <- svm(Y~.,data=df1,kernel="linear",cost=1000)
> mod.svm1$index
## [1] 6 13 14 10 12 15
```

Visualisation de l'hyperplan séparateur

```
> plot(mod.svm1,data=df1,fill=TRUE,grid=500)
```



Choix de C

Ce paramètre régule le **compromis biais/variance** de la svm :

- $C \searrow$: la marge est privilégiée et les $\xi_i \nearrow \Rightarrow$

Choix de C

Ce paramètre régule le **compromis biais/variance** de la svm :

- $C \searrow$: la marge est privilégiée et les $\xi_i \nearrow \Rightarrow$ beaucoup d'observations dans la marge ou **mal classées** (et donc beaucoup de vecteurs supports).

Choix de C

Ce paramètre régule le **compromis biais/variance** de la svm :

- $C \searrow$: la marge est privilégiée et les $\xi_i \nearrow \Rightarrow$ beaucoup d'observations dans la marge ou **mal classées** (et donc beaucoup de vecteurs supports).
- $C \nearrow \Rightarrow \xi_i \searrow$ donc moins d'observations mal classées \Rightarrow

Choix de C

Ce paramètre régule le **compromis biais/variance** de la svm :

- $C \searrow$: la marge est privilégiée et les $\xi_i \nearrow \Rightarrow$ beaucoup d'observations dans la marge ou **mal classées** (et donc beaucoup de vecteurs supports).
- $C \nearrow \Rightarrow \xi_i \searrow$ donc moins d'observations mal classées \Rightarrow **meilleur ajustement** mais petite marge \Rightarrow risque de **surajustement**.

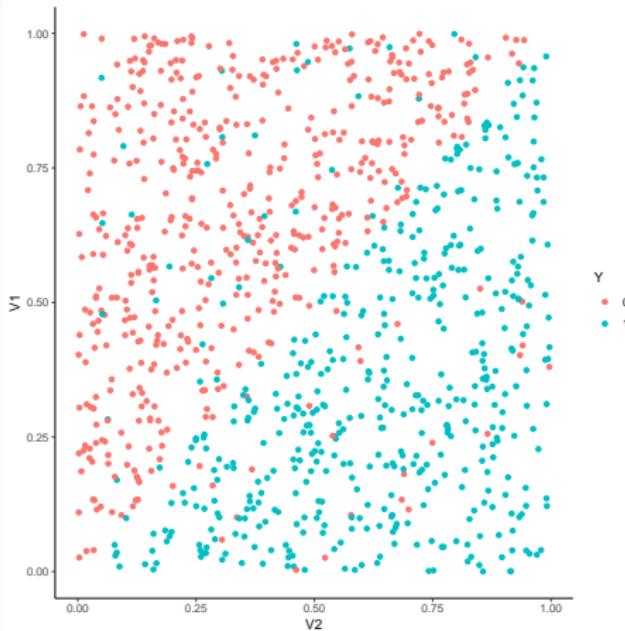
Conclusion

Il est donc très important de bien choisir ce paramètre.

- Le choix est souvent effectué de façon "classique" :
 1. On se donne un **critère de performance** (taux de mal classés par exemple) ;
 2. On **estime la valeur du critère** pour différentes valeurs de C ;
 3. On choisit la valeur de C pour laquelle le **critère estimé est minimum**.

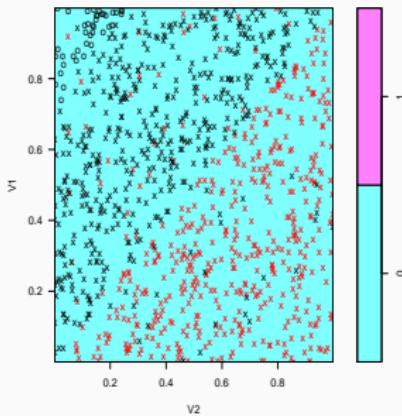
- Le choix est souvent effectué de façon "classique" :
 1. On se donne un **critère de performance** (taux de mal classés par exemple) ;
 2. On **estime la valeur du critère** pour différentes valeurs de C ;
 3. On choisit la valeur de C pour laquelle le **critère estimé est minimum**.
- La fonction **tune.svm** permet de choisir C en estimant le taux de mal classés par **validation croisée**. On peut aussi (bien entendu) utiliser la fonction **train** du package **caret**.

Un exemple

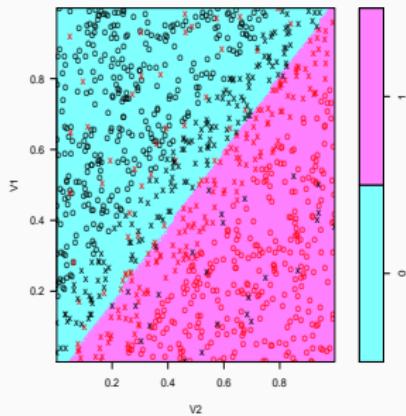


```
> mod.svm1 <- svm(Y~., data=df3, kernel="linear", cost=0.000001)
> mod.svm2 <- svm(Y~., data=df3, kernel="linear", cost=0.1)
> mod.svm3 <- svm(Y~., data=df3, kernel="linear", cost=5)
```

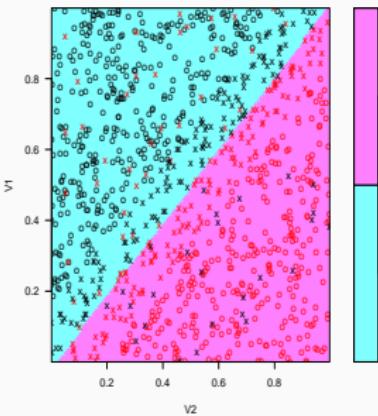
SVM classification plot



SVM classification plot



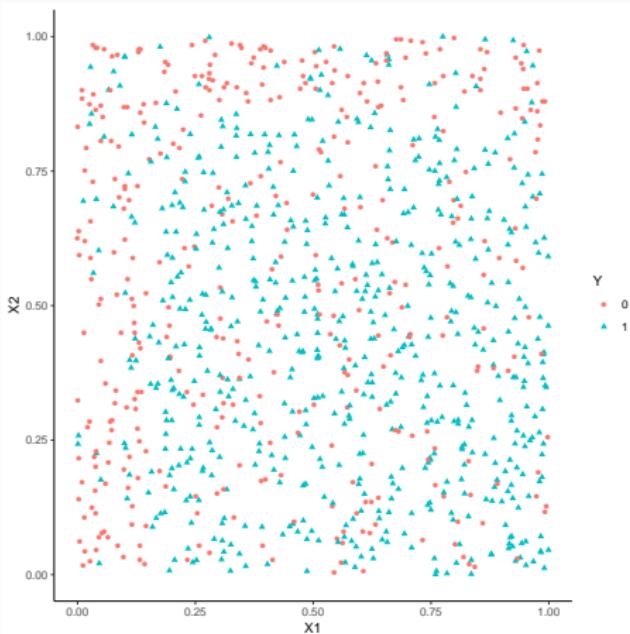
SVM classification plot



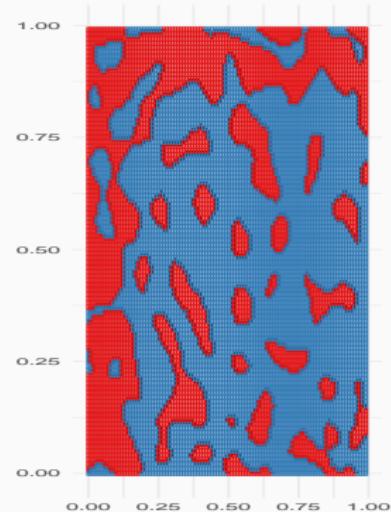
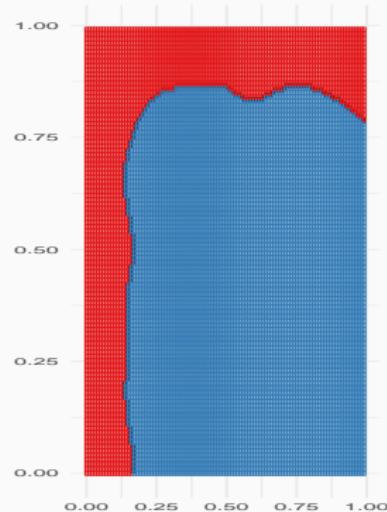
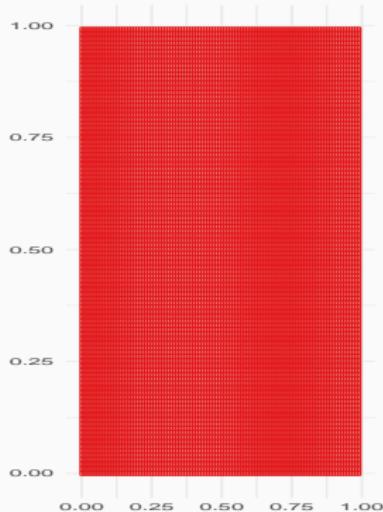
```
> mod.svm1$nSV
## [1] 480 480
> mod.svm2$nSV
## [1] 190 190
> mod.svm3$nSV
## [1] 166 165
```

Un autre exemple

- $n = 1000$ observations.



```
> model1 <- svm(Y~.,data=donnees, cost=0.001,kernel="radial",gamma=5)
> model2 <- svm(Y~.,data=donnees, cost=1,kernel="radial",gamma=5)
> model3 <- svm(Y~.,data=donnees, cost=100000,kernel="radial",gamma=5)
```



Choix de C avec tune

```
> tune.out <- tune(svm,Y~,data=df3,kernel="linear",
+                     ranges=list(cost=c(0.001,0.01,1,10,100,1000)))
> summary(tune.out)
## Parameter tuning of 'svm':
## - sampling method: 10-fold cross validation
## - best parameters:
##   cost
##     1
## - best performance: 0.071
## - Detailed performance results:
##   cost error dispersion
## 1 1e-03 0.142 0.03675746
## 2 1e-02 0.084 0.03373096
## 3 1e+00 0.071 0.02766867
## 4 1e+01 0.072 0.02820559
## 5 1e+02 0.072 0.02820559
## 6 1e+03 0.071 0.02766867
```

```
> bestmod <- tune.out$best.model
> summary(bestmod)
##
## Call:
## best.tune(method = svm, train.x = Y ~ ., data = df3, ranges =
##   list(cost = c(0.001, 0.01, 1, 10, 100, 1000)), kernel = "linear")
##
## Parameters:
##   SVM-Type: C-classification
##   SVM-Kernel: linear
##     cost: 1
##     gamma: 0.5
##
## Number of Support Vectors: 336
##
## ( 168 168 )
##
## Number of Classes: 2
##
## Levels:
## 0 1
```

Choix de C avec caret

```
> library(caret)
> gr <- data.frame(C=c(0.001,0.01,1,10,100,1000))
> ctrl <- trainControl(method="repeatedcv",number=10,repeats=5)
> train(Y~.,data=df3,method="svmLinear",trControl=ctrl,tuneGrid=gr)
## Support Vector Machines with Linear Kernel
## No pre-processing
## Resampling: Cross-Validated (10 fold, repeated 5 times)
## Summary of sample sizes: 900, 900, 900, 900, 900, 900, ...
## Resampling results across tuning parameters:
##   C      Accuracy   Kappa
##   1e-03  0.8700    0.7377051
##   1e-02  0.9188    0.8369121
##   1e+00  0.9304    0.8604317
##   1e+01  0.9292    0.8580356
##   1e+02  0.9294    0.8584333
##   1e+03  0.9294    0.8584333
## Accuracy was used to select the optimal model using the largest value.
## The final value used for the model was C = 1.
```

SVM - cas séparable

SVM : cas non séparable

SVM non linéaire : astuce du noyau

Scores et probabilités

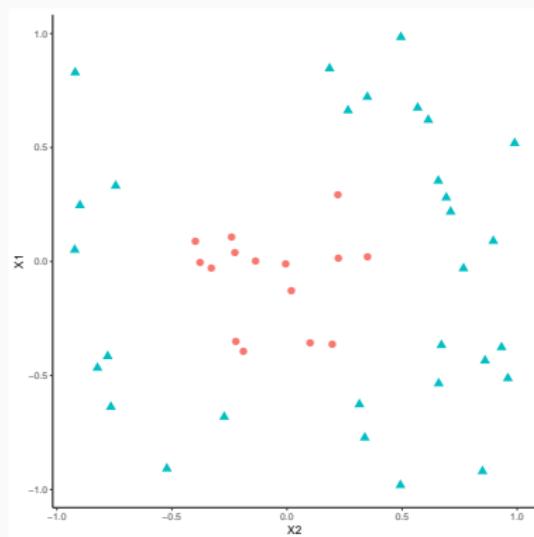
Compléments : SVM multi-classes et SVR

SVM multiclasses

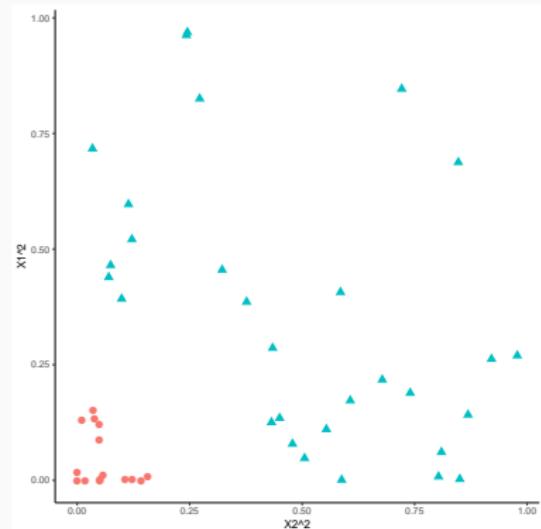
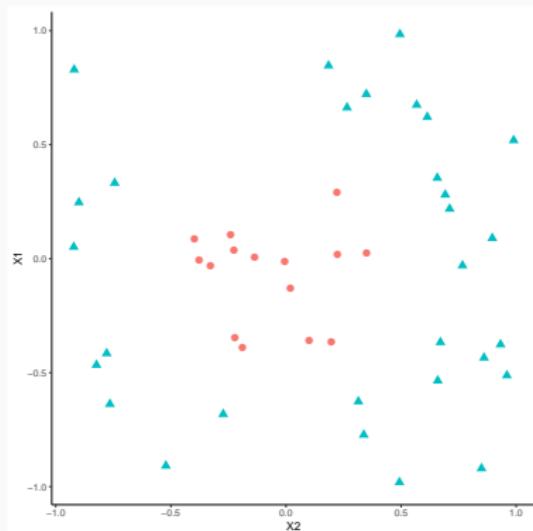
Support vector regression (SVR)

Bibliographie

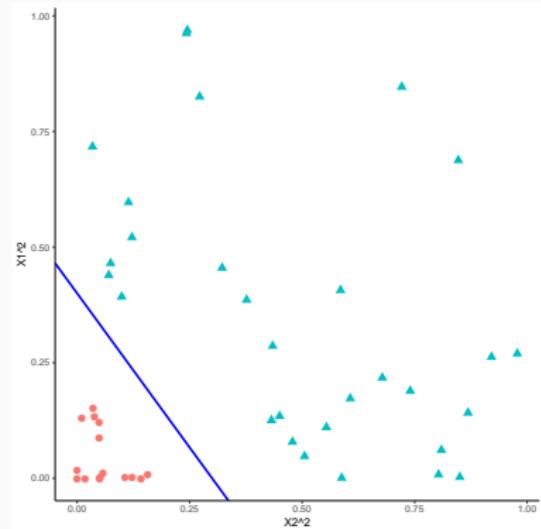
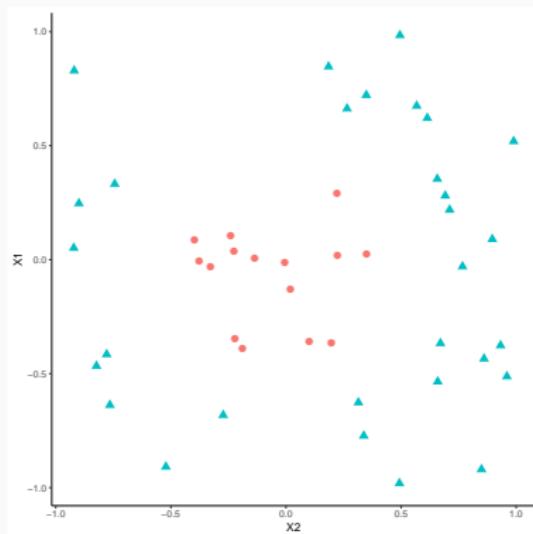
- Les **solutions linéaires** ne sont pas toujours intéressantes.



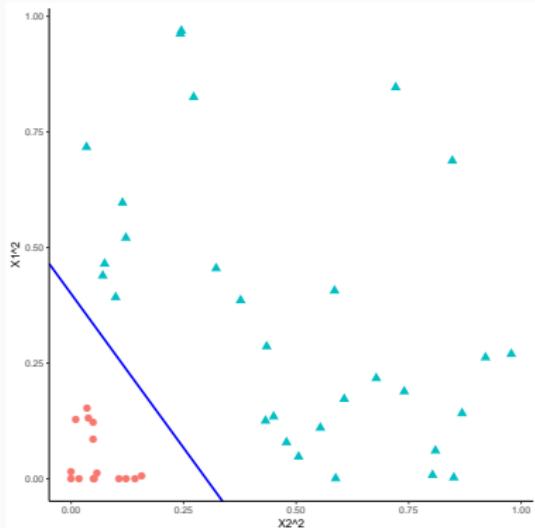
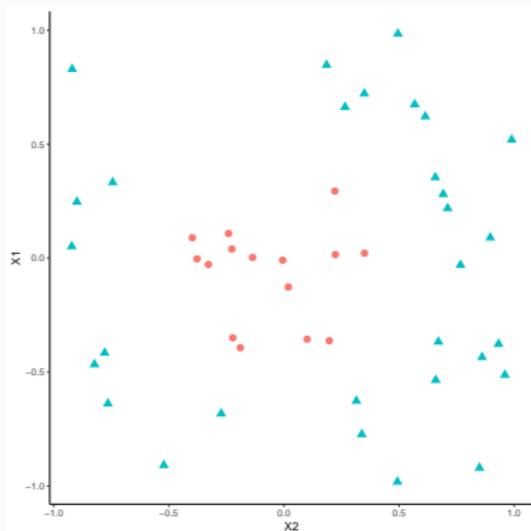
- Les **solutions linéaires** ne sont pas toujours intéressantes.



- Les **solutions linéaires** ne sont pas toujours intéressantes.



- Les **solutions linéaires** ne sont pas toujours intéressantes.



Idée

Trouver une transformation des données telle que les **données transformées** soient **linéairement séparables**.

Noyau

Définition

Soit $\Phi : \mathcal{X} \rightarrow \mathcal{H}$ une application qui va de l'espace des observations \mathcal{X} dans un Hilbert \mathcal{H} . Le **noyau K** entre x et x' associé à Φ est le produit scalaire entre $\Phi(x)$ et $\Phi(x')$:

$$\begin{aligned} K : \mathcal{X} \times \mathcal{X} &\rightarrow \mathbb{R} \\ (x, x') &\mapsto \langle \Phi(x), \Phi(x') \rangle_{\mathcal{H}}. \end{aligned}$$

Noyau

Définition

Soit $\Phi : \mathcal{X} \rightarrow \mathcal{H}$ une application qui va de l'espace des observations \mathcal{X} dans un Hilbert \mathcal{H} . Le **noyau K** entre x et x' associé à Φ est le produit scalaire entre $\Phi(x)$ et $\Phi(x')$:

$$K : \mathcal{X} \times \mathcal{X} \rightarrow \mathbb{R}$$
$$(x, x') \mapsto \langle \Phi(x), \Phi(x') \rangle_{\mathcal{H}}.$$

Exemple

Si $\mathcal{X} = \mathcal{H} = \mathbb{R}^2$ et $\varphi(x_1, x_2) = (x_1^2, x_2^2)$ alors

$$K(x, x') = (x_1 x'_1)^2 + (x_2 x'_2)^2.$$

L'astuce noyau

- L'astuce consiste donc à envoyer les observations x_i dans un espace de Hilbert \mathcal{H} appelé espace de représentation ou feature space...

L'astuce noyau

- L'astuce consiste donc à envoyer les observations x_i dans un espace de Hilbert \mathcal{H} appelé espace de représentation ou feature space...
- en espérant que les données $(\Phi(x_1), y_1), \dots, (\Phi(x_n), y_n)$ soient (presque) linéairement séparables de manière à appliquer une svm sur ces données transformées.

L'astuce noyau

- L'astuce consiste donc à **envoyer les observations** x_i dans un espace de Hilbert \mathcal{H} appelé **espace de représentation** ou **feature space**...
- en espérant que les données $(\Phi(x_1), y_1), \dots, (\Phi(x_n), y_n)$ soient (presque) **linéairement séparables** de manière à **appliquer une svm sur ces données transformées**.

Remarque

1. Beaucoup d'**algorithmes linéaires** (en particulier les SVM) peuvent être appliqués sur $\Phi(x)$ sans calculer explicitement Φ ! Il suffit de pouvoir calculer le noyau $K(x, x')$;

L'astuce noyau

- L'astuce consiste donc à **envoyer les observations** x_i dans un espace de Hilbert \mathcal{H} appelé **espace de représentation** ou **feature space**...
- en espérant que les données $(\Phi(x_1), y_1), \dots, (\Phi(x_n), y_n)$ soient (presque) **linéairement séparables** de manière à **appliquer une svm sur ces données transformées**.

Remarque

1. Beaucoup d'**algorithmes linéaires** (en particulier les SVM) peuvent être appliqués sur $\Phi(x)$ sans calculer explicitement Φ ! Il suffit de pouvoir calculer le noyau $K(x, x')$;
2. On n'a **pas besoin** de connaître l'espace \mathcal{H} ni l'application Φ , il suffit de se **donner un noyau** K !

SVM dans l'espace original

- Le **problème dual** consiste à maximiser

$$L_D(\alpha) = \sum_{i=1}^n \alpha_i - \frac{1}{2} \sum_{i=1}^n \sum_{k=1}^n \alpha_i \alpha_k y_i y_k \langle \mathbf{x}_i, \mathbf{x}_k \rangle$$

sous les contraintes $\begin{cases} 0 \leq \alpha_i \leq C, \quad i = 1, \dots, n \\ \sum_{i=1}^n \alpha_i y_i = 0. \end{cases}$

- La règle de décision s'obtient en calculant le signe de

$$f(x) = \sum_{i=1}^n \alpha_i^* y_i \langle \mathbf{x}_i, \mathbf{x} \rangle + b^*$$

SVM dans le feature space

- Le **problème dual** consiste à maximiser

$$L_D(\alpha) = \sum_{i=1}^n \alpha_i - \frac{1}{2} \sum_{i=1}^n \sum_{k=1}^n \alpha_i \alpha_k y_i y_k \langle \Phi(x_i), \Phi(x_k) \rangle$$

sous les contraintes

$$\begin{cases} 0 \leq \alpha_i \leq C, \quad i = 1, \dots, n \\ \sum_{i=1}^n \alpha_i y_i = 0. \end{cases}$$

- La règle de décision s'obtient en calculant le signe de

$$f(x) = \sum_{i=1}^n \alpha_i^* y_i \langle \Phi(x_i), \Phi(x) \rangle + b^*.$$

SVM dans le feature space avec un noyau

- Le **problème dual** consiste à maximiser

$$L_D(\alpha) = \sum_{i=1}^n \alpha_i - \frac{1}{2} \sum_{i=1}^n \sum_{k=1}^n \alpha_i \alpha_k y_i y_k K(x_i, x_k)$$

sous les contraintes $\begin{cases} 0 \leq \alpha_i \leq C, \quad i = 1, \dots, n \\ \sum_{i=1}^n \alpha_i y_i = 0. \end{cases}$

- La règle de décision s'obtient en calculant le signe de

$$f(x) = \sum_{i=1}^n \alpha_i^* y_i K(x_i, x) + b^*.$$

Conclusion

- Pour calculer la svm, on n'a **pas besoin de connaître \mathcal{H} ou Φ** , il suffit de connaître K !

Conclusion

- Pour calculer la svm, on n'a **pas besoin de connaître \mathcal{H} ou Φ** , il suffit de connaître K !

Questions

Qu'est-ce qu'un **noyau**? Comment construire un noyau ?

Conclusion

- Pour calculer la svm, on n'a **pas besoin de connaître \mathcal{H} ou Φ** , il suffit de connaître K !

Questions

Qu'est-ce qu'un **noyau**? Comment construire un noyau?

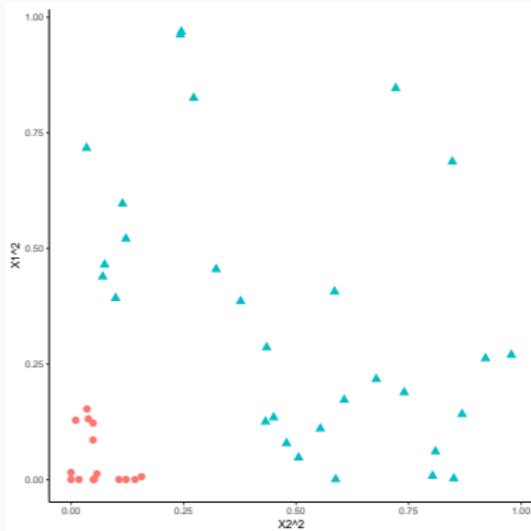
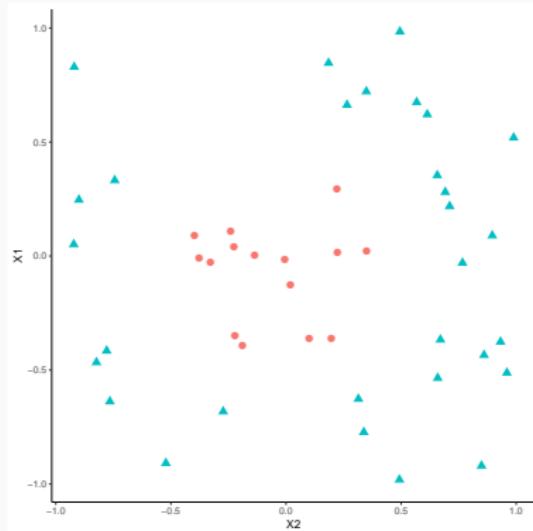
Théorème ([Aronszajn, 1950])

Une fonction $K : \mathcal{X} \times \mathcal{X} \rightarrow \mathbb{R}$ est un **noyau** si et seulement si elle est (symétrique) **définie positive**, c'est-à-dire ssi

1. $K(x, x') = K(x', x) \quad \forall (x, x') \in \mathcal{X}^2$;
2. $\forall (x_1, \dots, x_N) \in \mathcal{X}^N$ et $\forall (a_1, \dots, a_N) \in \mathbb{R}^N$

$$\sum_{i=1}^N \sum_{j=1}^N a_i a_j K(x_i, x_j) \geq 0.$$

Exemple



- Si

$$\begin{aligned}\Phi : \quad \mathbb{R}^2 &\rightarrow \mathbb{R}^3 \\ (x_1, x_2) &\mapsto (x_1^2, \sqrt{2}x_1x_2, x_2^2)\end{aligned}$$

alors $K(x, x') = (x^t x')^2$ (noyau polynomial de degré 2).

Exemples de noyau

1. Linéaire (sur \mathbb{R}^d) : $K(x, x') = x^t x'$.
2. Polynomial (sur \mathbb{R}^d) : $K(x, x') = (x^t x' + 1)^d$.
3. Gaussien (Gaussian radial basis function ou RBF) (sur \mathbb{R}^d)

$$K(x, x') = \exp\left(-\frac{\|x - x'\|}{2\sigma^2}\right).$$

4. Laplace (sur \mathbb{R}) : $K(x, x') = \exp(-\gamma|x - x'|)$.
5. Noyau min (sur \mathbb{R}^+) : $K(x, x') = \min(x, x')$.

Exemples de noyau

1. Linéaire (sur \mathbb{R}^d) : $K(x, x') = x^t x'$.
2. Polynomial (sur \mathbb{R}^d) : $K(x, x') = (x^t x' + 1)^d$.
3. Gaussien (Gaussian radial basis function ou RBF) (sur \mathbb{R}^d)

$$K(x, x') = \exp\left(-\frac{\|x - x'\|}{2\sigma^2}\right).$$

4. Laplace (sur \mathbb{R}) : $K(x, x') = \exp(-\gamma|x - x'|)$.
5. Noyau min (sur \mathbb{R}^+) : $K(x, x') = \min(x, x')$.

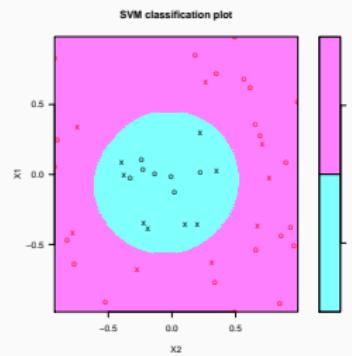
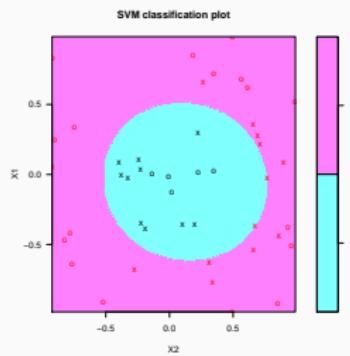
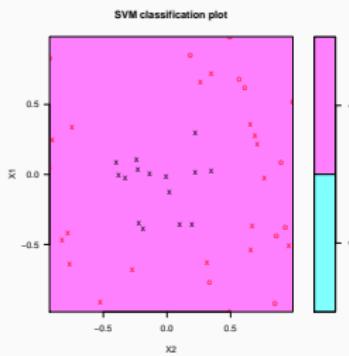
Remarque

N'importe quelle fonction définie positive fait l'affaire... Possibilité de construire des noyaux (et donc de faire des svm) sur des objets plus complexes (courbes, images, séquences de lettres...).

Le coin R - exemple 1

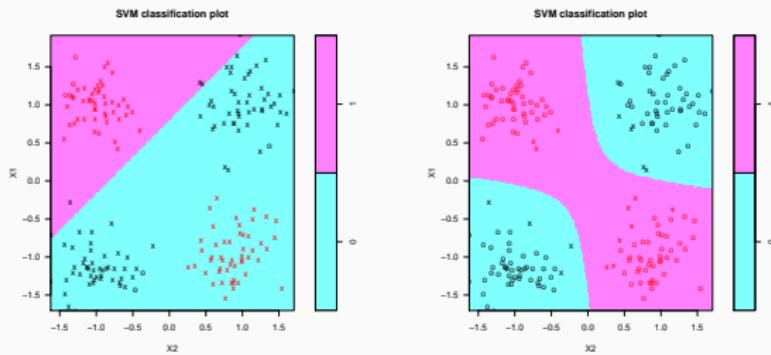
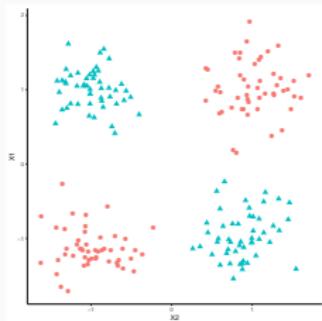
- Argument **kernel** dans la fonction **svm**.

```
> svm(Y~, data=donnees, cost=1, kernel="linear")
> svm(Y~, data=donnees, cost=1, kernel="polynomial", degree=2)
> svm(Y~, data=donnees, cost=1, kernel="radial", gamma=1)
```



Le coin R - exemple 2

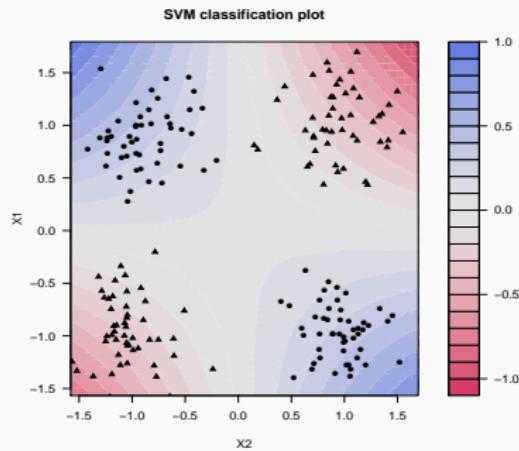
```
> svm(Y~.,data=donnees,kernel="linear",cost=1)
> svm(Y~.,data=donnees,kernel="polynomial",degree=2, cost=1)
```



Le package kernlab

- Il propose un choix plus large de noyaux.

```
> library(kernlab)
> mod.ksvm <- ksvm(Y~., data=donnees, kernel="polydot", kpar=list(degree=2), C=0.001)
> plot(mod.ksvm)
```



SVM - cas séparable

SVM : cas non séparable

SVM non linéaire : astuce du noyau

Scores et probabilités

Compléments : SVM multi-classes et SVR

SVM multiclasses

Support vector regression (SVR)

Bibliographie

- Jusqu'à présent nous avons utiliser la SVM uniquement pour **classer** :
 - 1 si on est d'un **coté de l'hyperplan** $\Rightarrow \sum_{i=1}^n \alpha_i^* y_i K(x_i, x) + b^* \geq 0$;
 - -1 si on est de l'**autre coté** $\Rightarrow \sum_{i=1}^n \alpha_i^* y_i K(x_i, x) + b^* < 0$.

- Jusqu'à présent nous avons utiliser la SVM uniquement pour **classer** :
 - 1 si on est d'un **côté de l'hyperplan** $\Rightarrow \sum_{i=1}^n \alpha_i^* y_i K(x_i, x) + b^* \geq 0$;
 - -1 si on est de l'**autre côté** $\Rightarrow \sum_{i=1}^n \alpha_i^* y_i K(x_i, x) + b^* < 0$.
- **Rappel** : dans le cas linéaire la fonction

$$f(x) = \sum_{i=1}^n \alpha_i^* y_i K(x_i, x) + b^*$$

mesure la **distance entre x et l'hyperplan séparateur**.

- Jusqu'à présent nous avons utiliser la SVM uniquement pour **classer** :
 - 1 si on est d'un **côté de l'hyperplan** $\Rightarrow \sum_{i=1}^n \alpha_i^* y_i K(x_i, x) + b^* \geq 0$;
 - -1 si on est de l'**autre côté** $\Rightarrow \sum_{i=1}^n \alpha_i^* y_i K(x_i, x) + b^* < 0$.
- **Rappel** : dans le cas linéaire la fonction

$$f(x) = \sum_{i=1}^n \alpha_i^* y_i K(x_i, x) + b^*$$

mesure la **distance entre x et l'hyperplan séparateur**.

- **Conclusion** : cette fonction peut être utilisée comme un **score**, puisque sa valeur (absolue) traduit une **confiance** que l'on a dans la prévision.

Probabilités

- La valeur de $f(x)$ est difficilement interprétable en tant que telle.
- Il peut être intéressant de la "ramener" entre 0 et 1 pour l'interpréter comme une estimation de $P(Y = 1|X = x)$.

- La valeur de $f(x)$ est difficilement interprétable en tant que telle.
- Il peut être intéressant de la "ramener" entre 0 et 1 pour l'interpréter comme une estimation de $\mathbf{P}(Y = 1|X = x)$.

Une solution

- Considérer un modèle logistique :

$$\mathbf{P}(Y = 1|X = x) = \frac{1}{1 + \exp(af(x) + b)}$$

- La valeur de $f(x)$ est difficilement interprétable en tant que telle.
- Il peut être intéressant de la "ramener" entre 0 et 1 pour l'interpréter comme une estimation de $\mathbf{P}(Y = 1|X = x)$.

Une solution

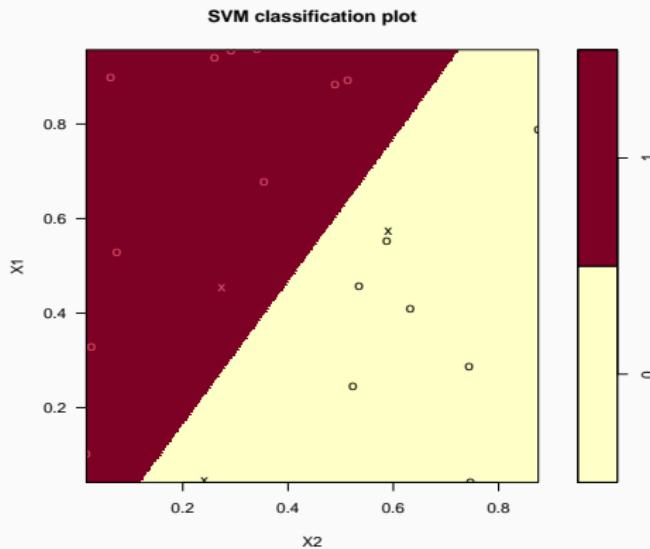
- Considérer un modèle logistique :

$$\mathbf{P}(Y = 1|X = x) = \frac{1}{1 + \exp(af(x) + b)}$$

- et d'estimer a et b par maximum de vraisemblance sur les données $(f(x_i), y_i), i = 1, \dots, n$.

Le coin R

```
> mod.svm <- svm(Y~, data=df, kernel="linear", cost=10000000000, probability=TRUE)
> plot(mod.svm, data=df, fill=TRUE, grid=500)
```



- Nouvelle observation :

```
> newX <- data.frame(X1=0.2,X2=0.6)
```

- Nouvelle observation :

```
> newX <- data.frame(X1=0.2,X2=0.6)
```

- Calcul du **score** et de la **proba** :

```
> predict(mod.svm,newdata=newX,decision.values = TRUE,probability=TRUE)
## 1
## 0
## attr(", "decision.values")
##           0/1
## 1 3.153157
## attr(", "probabilities")
##           0          1
## 1 0.9634021 0.0365979
## Levels: 0 1
```

- Nouvelle observation :

```
> newX <- data.frame(X1=0.2,X2=0.6)
```

- Calcul du **score** et de la **proba** :

```
> predict(mod.svm,newdata=newX,decision.values = TRUE,probability=TRUE)
## 1
## 0
## attr(", "decision.values")
##          0/1
## 1 3.153157
## attr(", "probabilities")
##          0          1
## 1 0.9634021 0.0365979
## Levels: 0 1
```

- On peut retrouver cette proba avec :

```
> a <- mod.svm$probA
> b <- mod.svm$probB
> 1/(1+exp(a*3.153157+b))
## [1] 0.9634021
```

SVM - cas séparable

SVM : cas non séparable

SVM non linéaire : astuce du noyau

Scores et probabilités

Compléments : SVM multi-classes et SVR

SVM multiclasses

Support vector regression (SVR)

Bibliographie

Cible multi-classes ou quantitative

- On a abordé ici uniquement le problème de la **classification binaire** :
 $y_i \in \{-1, 1\}$.
- Les SVM se généralisent aux cas **multi-classes** : $y_i \in \{1, \dots, M\}$
- et à la **régression** : $y_i \in \mathbb{R}$.

SVM - cas séparable

SVM : cas non séparable

SVM non linéaire : astuce du noyau

Scores et probabilités

Compléments : SVM multi-classes et SVR

SVM multiclasses

Support vector regression (SVR)

Bibliographie

- On suppose ici que $y_i \in \{1, \dots, M\}$
- Il existe plusieurs approches pour généraliser les SVM à ce contexte, notamment :

- On suppose ici que $y_i \in \{1, \dots, M\}$
- Il existe plusieurs approches pour généraliser les SVM à ce contexte, notamment :
- One against one

Idée

Faire une SVM binaire sur toutes les paires $(j, k) \in \{1, \dots, M\}^2$ avec $j \neq k$ et choisir le groupe qui gagne le plus souvent.

- On suppose ici que $y_i \in \{1, \dots, M\}$
- Il existe plusieurs approches pour généraliser les SVM à ce contexte, notamment :
- One against one

Idée

Faire une SVM binaire sur toutes les paires $(j, k) \in \{1, \dots, M\}^2$ avec $j \neq k$ et choisir le groupe qui gagne le plus souvent.

- On against all

Idée

Faire une SVM binaire de chaque groupe contre les autres et choisir le groupe qui a la "plus belle victoire".

One against one

Algorithme

1. Pour chaque paire (j, k) , faire la SVM **binaire** avec uniquement les individus des groupes k et j ;
2. On obtient ainsi $M(M - 1)/2$ règles "linéaires" $f_{j,k}(x)$.

One against one

Algorithme

1. Pour chaque paire (j, k) , faire la SVM **binaire** avec uniquement les individus des groupes k et j ;
2. On obtient ainsi $M(M - 1)/2$ **règles "linéaires"** $f_{j,k}(x)$.
3. On calcule pour $j = 1, \dots, M$

$$V(j) = \sum_{k \neq j} \text{signe}(f_{j,k}(x))$$

qui représente le **nombre de fois où on a voté j contre les autres groupes**.

One against one

Algorithme

1. Pour chaque paire (j, k) , faire la SVM **binaire** avec uniquement les individus des groupes k et j ;
2. On obtient ainsi $M(M - 1)/2$ **règles "linéaires"** $f_{j,k}(x)$.
3. On calcule pour $j = 1, \dots, M$

$$V(j) = \sum_{k \neq j} \text{signe}(f_{j,k}(x))$$

qui représente le **nombre de fois où on a voté j contre les autres groupes**.

4. On classe un nouvel individu x dans le groupe qui a **remporté le plus de suffrage** :

$$f(x) = \operatorname{argmax}_j V(j).$$

One against all

Algorithme

1. Faire une SVM binaire avec **tous les individus** de chaque groupe contre les autres.
2. On obtient ainsi M **règles "linéaires"** $f_j(x)$ (groupe j contre les autres).

One against all

Algorithme

1. Faire une SVM binaire avec **tous les individus** de chaque groupe contre les autres.
2. On obtient ainsi M **règles "linéaires"** $f_j(x)$ (groupe j contre les autres).
3. On classe un nouvel individu dans la classe qui a le score le plus élevé :

$$f(x) = \operatorname{argmax}_j f_j(x).$$

Comparaison

- M SVM binaire avec l'approche **one against all** contre $M(M - 1)/2$ avec le **one against one** mais...

Comparaison

- M SVM binaire avec l'approche **one against all** contre $M(M - 1)/2$ avec le **one against one** mais...
- **moins** d'individus dans les **one against one**.

Comparaison

- M SVM binaire avec l'approche **one against all** contre $M(M - 1)/2$ avec le **one against one** mais...
- **moins** d'individus dans les **one against one**.
- Risque de déséquilibre plus fort avec le **one against all** (mais généralement plus rapide).

Comparaison

- M SVM binaire avec l'approche **one against all** contre $M(M - 1)/2$ avec le **one against one** mais...
- **moins** d'individus dans les **one against one**.
- Risque de déséquilibre plus fort avec le **one against all** (mais généralement plus rapide).
- Comme dans le cas binaire, il faut **sélectionner le paramètre de complexité**, le **noyau**, les **paramètres du noyau**...

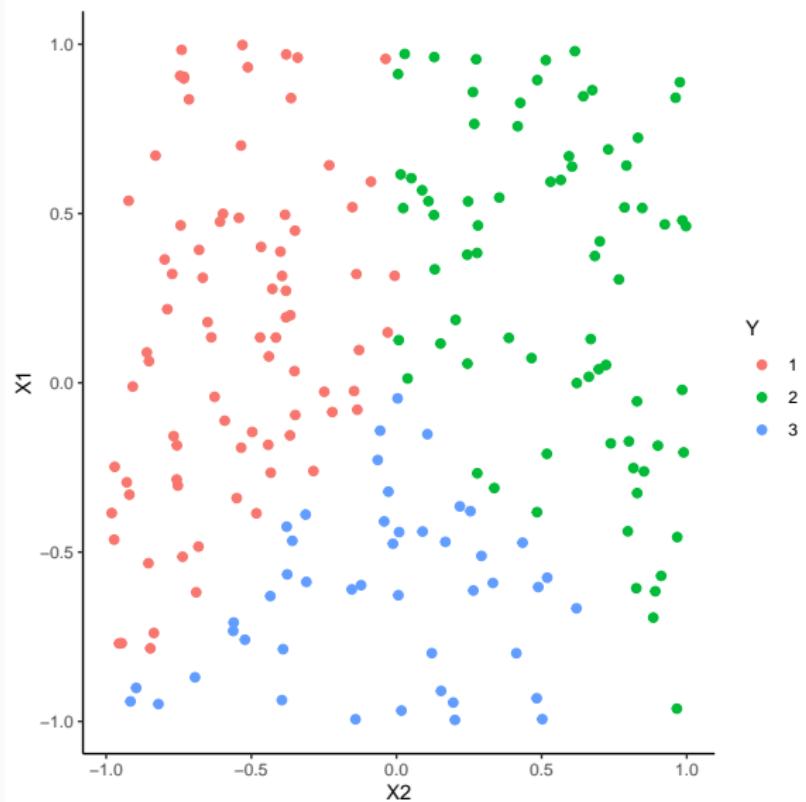
Comparaison

- M SVM binaire avec l'approche **one against all** contre $M(M - 1)/2$ avec le **one against one** mais...
- **moins** d'individus dans les **one against one**.
- Risque de déséquilibre plus fort avec le **one against all** (mais généralement plus rapide).
- Comme dans le cas binaire, il faut **sélectionner le paramètre de complexité**, le **noyau**, les **paramètres du noyau**...

Le coin R

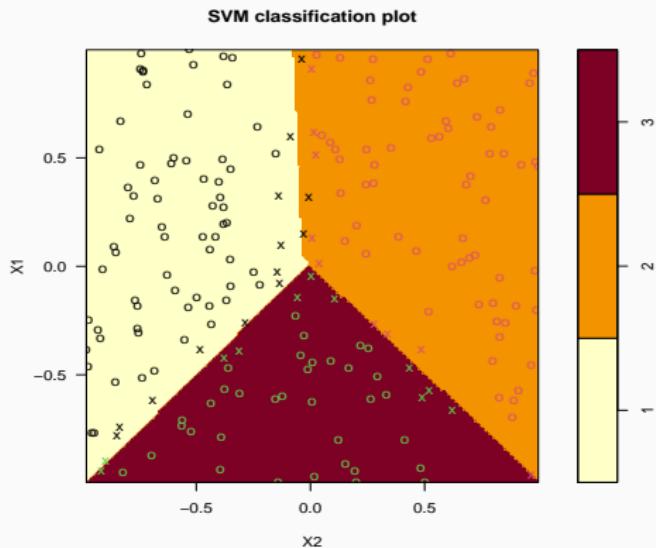
- L'approche **one against one** est plus souvent utilisée.
- C'est le cas par défaut avec **svm** de **e1071** et **ksvm** de **kernlab**.

Exemple



SVM linéaire multi classes

```
> multi <- svm(Y~, data=df, cost=10, kernel="linear")
> plot(multi, data=D, grid=200)
```



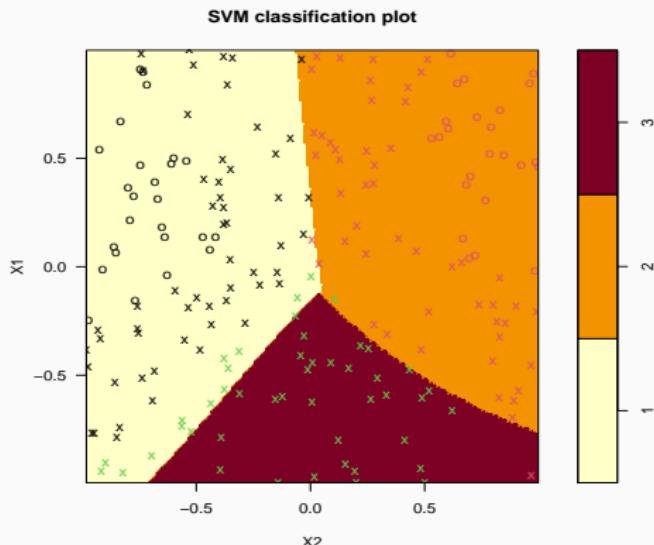
SVM non linéaire multi classes

- Il "suffit" d'utiliser un **noyau**.

SVM non linéaire multi classes

- Il "suffit" d'utiliser un **noyau**.

```
> multi2 <- svm(Y~.,data=df, cost=0.1, kernel="sigmoid")
> plot(multi, data=D, grid=200)
```



SVM - cas séparable

SVM : cas non séparable

SVM non linéaire : astuce du noyau

Scores et probabilités

Compléments : SVM multi-classes et SVR

SVM multiclasses

Support vector regression (SVR)

Bibliographie

- On suppose ici que les y_i sont dans \mathbb{R} .
- On ne va plus chercher l'hyperplan qui sépare au mieux les groupes mais

- On suppose ici que les y_i sont dans \mathbb{R} .
- On ne va plus chercher l'hyperplan qui sépare au mieux les groupes mais
- l'hyperplan (w, b) qui "approche au mieux" les valeurs y_i

$$|\langle w, x_i \rangle + b - y_i| \text{ petits.}$$

Comparaison avec les MCO

- **Approche MCO** (rappel) : on cherche (w, b) qui minimise

$$\sum_{i=1}^n (y_i - \langle w, x_i \rangle - b)^2$$

Comparaison avec les MCO

- **Approche MCO** (rappel) : on cherche (w, b) qui minimise

$$\sum_{i=1}^n (y_i - \langle w, x_i \rangle - b)^2$$

- **Approche SVR** : on veut

1. tous les points à distance de moins de ε de (w, b) ;
2. (w, b) de marge maximale ($\|w\|$ minimale).

Comparaison avec les MCO

- **Approche MCO** (rappel) : on cherche (w, b) qui minimise

$$\sum_{i=1}^n (y_i - \langle w, x_i \rangle - b)^2$$

- **Approche SVR** : on veut

1. tous les points à distance de moins de ε de (w, b) ;
2. (w, b) de marge maximale ($\|w\|$ minimale).

Optimisation SVR

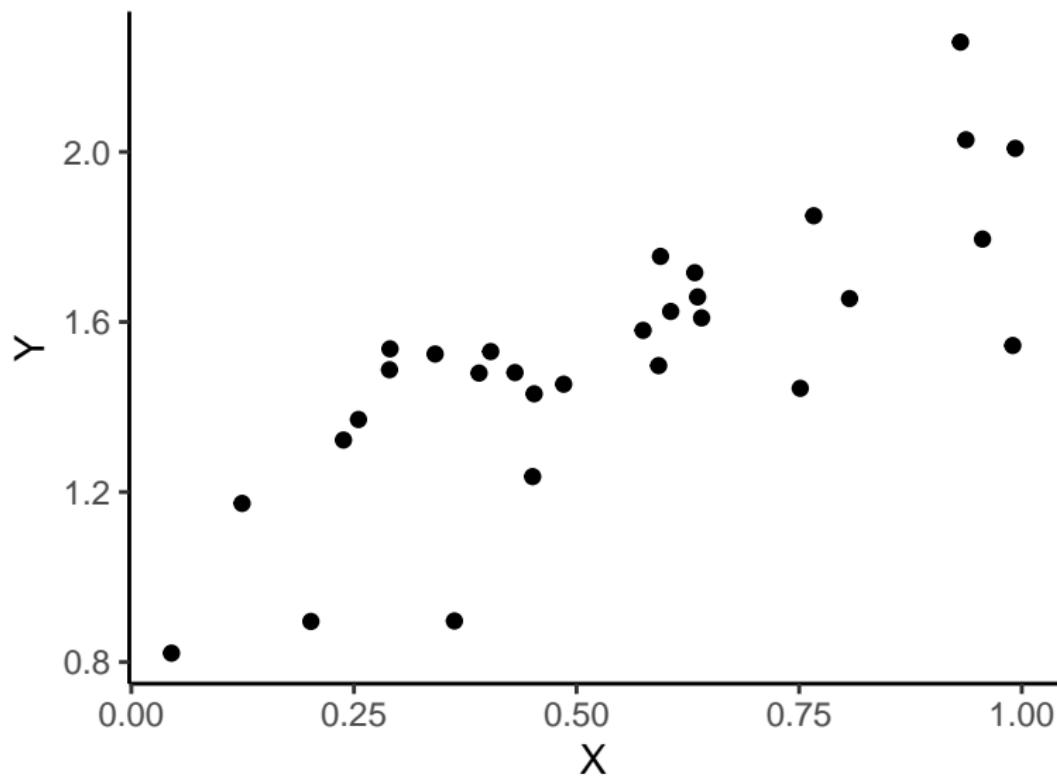
On va chercher à **minimiser la norme de w** en se fixant comme contrainte que les y_i ne soient pas "trop loin" de l'hyperplan :

$$\min_{w,b} \frac{1}{2} \|w\|^2$$

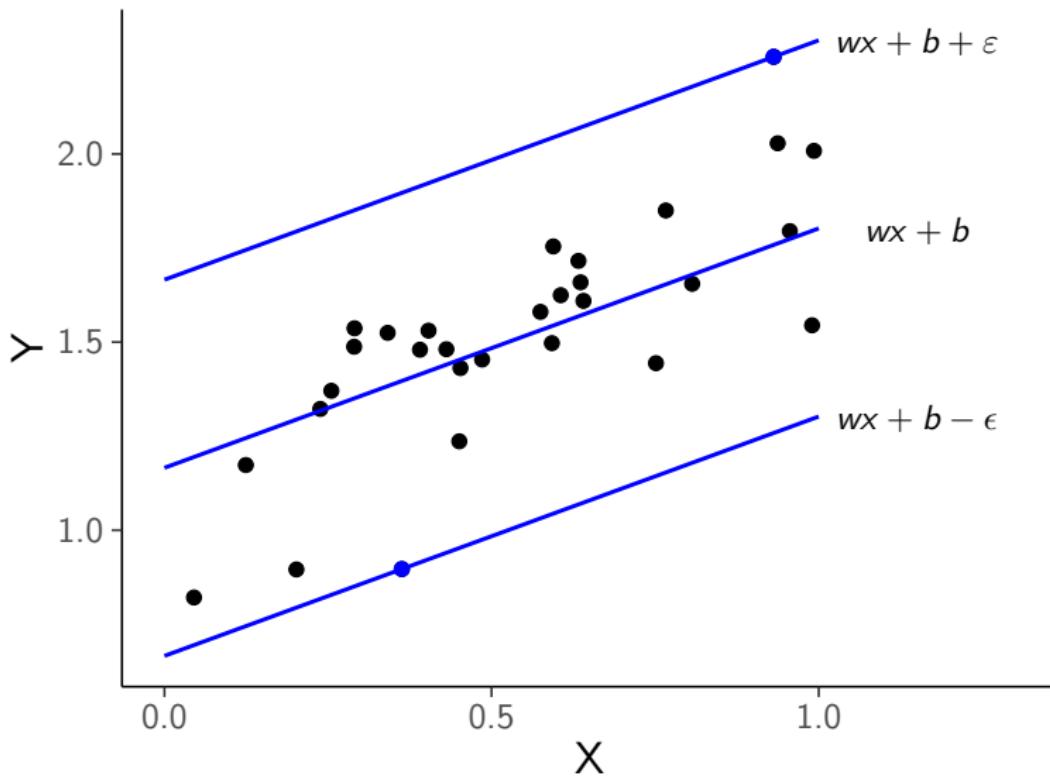
sous les contraintes $|y_i - \langle w, x_i \rangle - b| \leq \varepsilon, i = 1, \dots, n,$

où $\varepsilon \geq 0$ est un paramètre à calibrer par l'utilisateur.

Un exemple en dimension 1

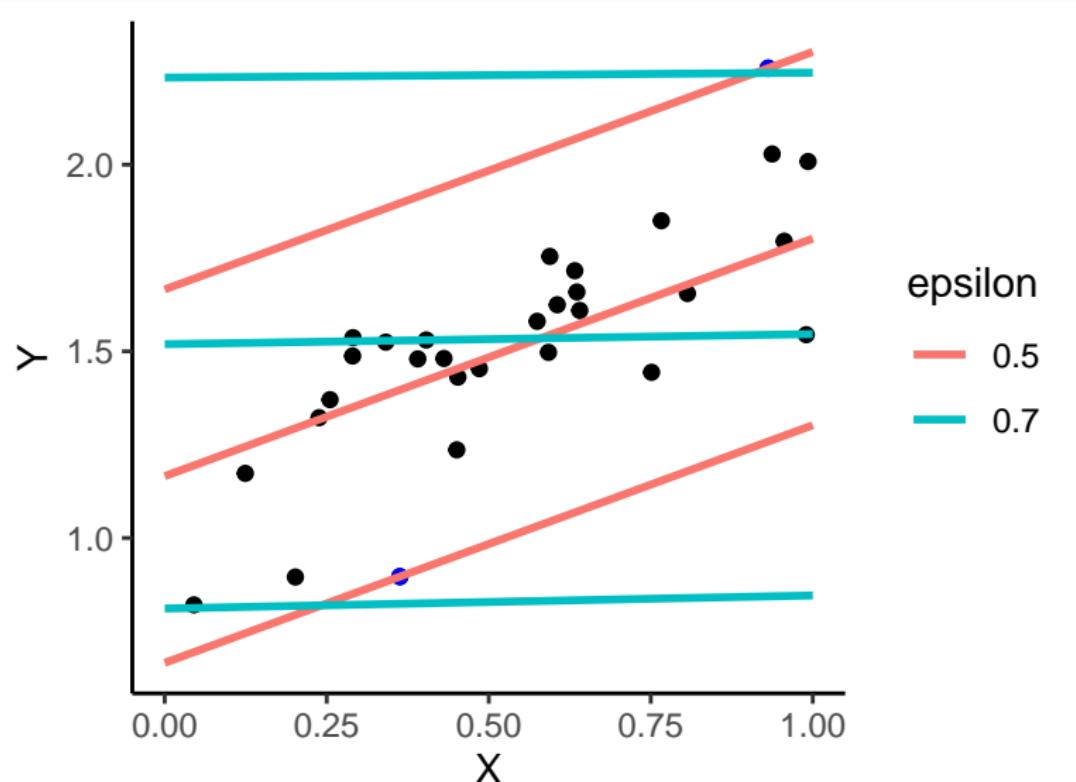


Un exemple en dimension 1



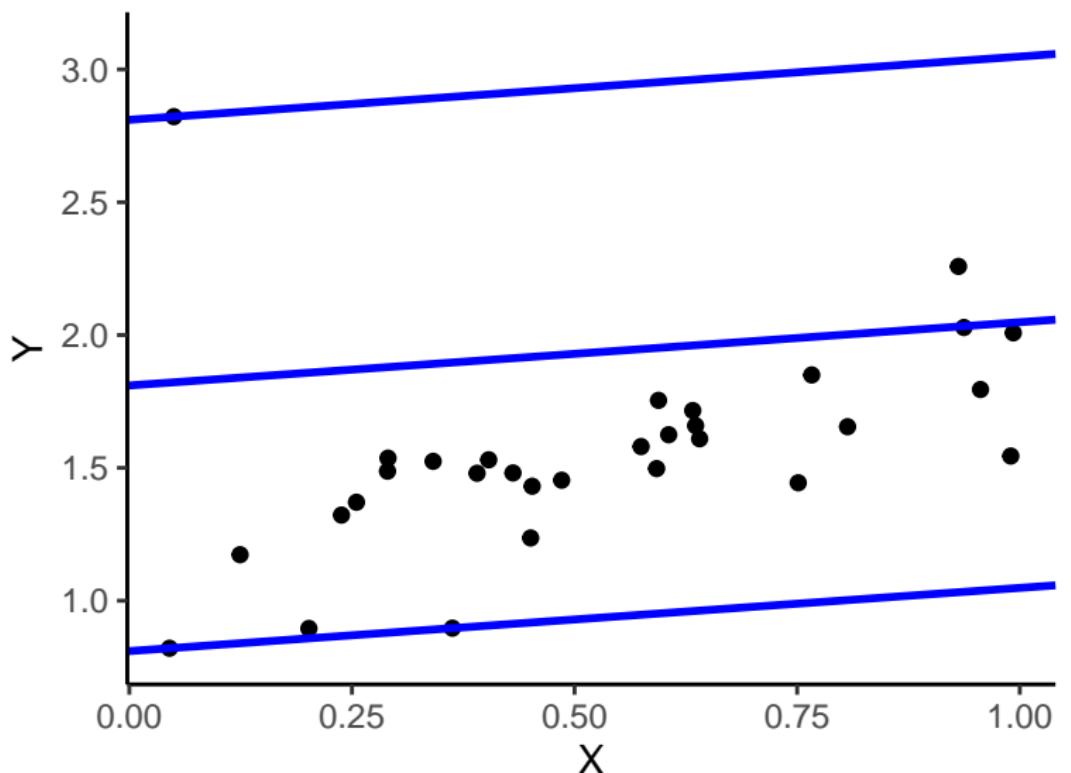
Influence de ε

- Il contrôle le **niveau de tolérance** que l'on se donne.



Alléger la contrainte...

- La contrainte nécessite souvent de prendre des grandes valeurs de ε ...



- Clairement pas satisfaisant de prendre ε trop grand.

- Clairement pas satisfaisant de prendre ε trop grand.

Idée

- Comme pour la SVM binaire, autoriser des observations à se situer en dehors de la marge !
- Comment ?

- Clairement pas satisfaisant de prendre ε trop grand.

Idée

- Comme pour la SVM binaire, autoriser des observations à se situer en dehors de la marge !
- Comment ? En introduisant des slack variables !

SVR cas général

Le problème d'optimisation

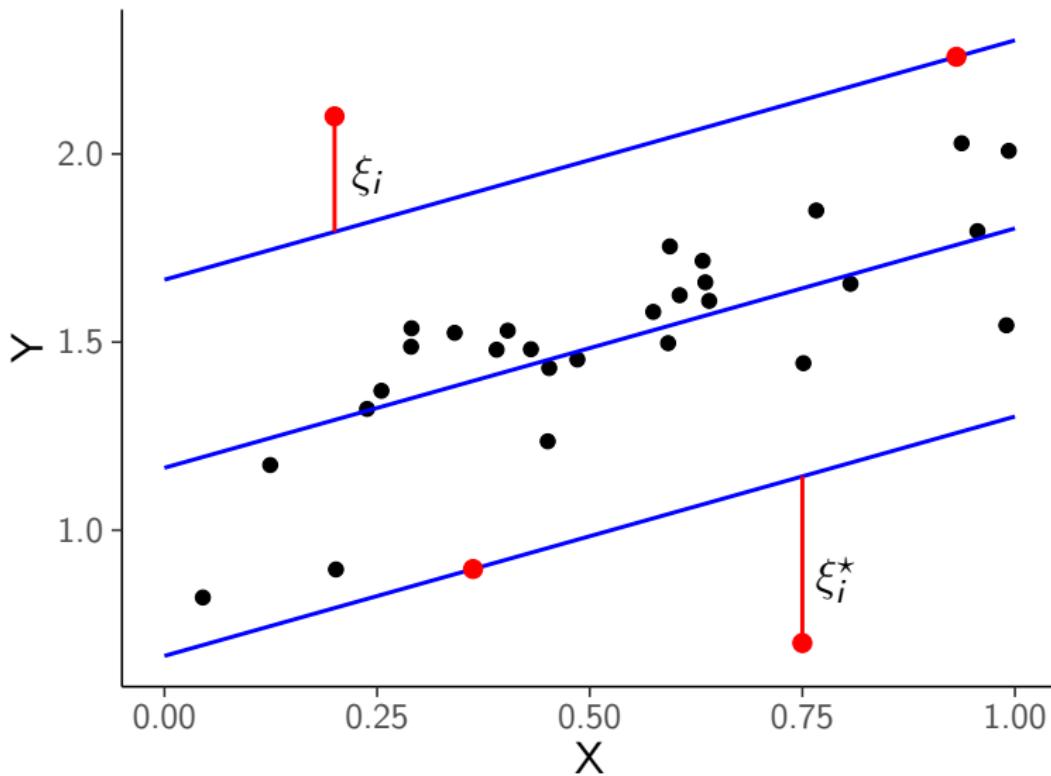
On cherche (w, b, ξ, ξ^*) qui minimise

$$\frac{1}{2} \|w\|^2 + C \sum_{i=1}^n (\xi_i + \xi_i^*)$$

sous les contraintes

$$\begin{cases} y_i - \langle w, x_i \rangle - b \leq \varepsilon + \xi_i, & i = 1, \dots, n, \\ \langle w, x_i \rangle + b - y_i \leq \varepsilon + \xi_i^*, & i = 1, \dots, n \\ \xi_i \geq 0, \xi_i^* \geq 0, & i = 1, \dots, n \end{cases}$$

Slack variables en régression



Rien ne change après...

- Les solutions s'obtiennent en résolvant le **problème dual** $\implies \alpha_i, \alpha_i^*$.

Rien ne change après...

- Les solutions s'obtiennent en résolvant le **problème dual** $\Rightarrow \alpha_i, \alpha_i^*$.
- Les données (les X) sont généralement **centrées-réduites** pour éviter les problèmes d'échelle.

Rien ne change après...

- Les solutions s'obtiennent en résolvant le **problème dual** $\Rightarrow \alpha_i, \alpha_i^*$.
- Les données (les X) sont généralement **centrées-réduites** pour éviter les problèmes d'échelle.
- Les observations vérifiant $\alpha_i^* - \alpha_i = 0$ sont les **vecteurs supports**.

Rien ne change après...

- Les solutions s'obtiennent en résolvant le **problème dual** $\Rightarrow \alpha_i, \alpha_i^*$.
- Les données (les X) sont généralement **centrées-réduites** pour éviter les problèmes d'échelle.
- Les observations vérifiant $\alpha_i^* - \alpha_i = 0$ sont les **vecteurs supports**.
- L'hyperplan optimal se déduit des **vecteurs supports** :

$$w^* = \sum_{i=1}^n (\alpha_i^* - \alpha_i) x_i.$$

- L'**astuce du noyau** reste d'actualité pour prendre en compte de la **non linéarité**.

Rien ne change après...

- Les solutions s'obtiennent en résolvant le **problème dual** $\Rightarrow \alpha_i, \alpha_i^*$.
- Les données (les X) sont généralement **centrées-réduites** pour éviter les problèmes d'échelle.
- Les observations vérifiant $\alpha_i^* - \alpha_i = 0$ sont les **vecteurs supports**.
- L'hyperplan optimal se déduit des **vecteurs supports** :

$$w^* = \sum_{i=1}^n (\alpha_i^* - \alpha_i) x_i.$$

- L'**astuce du noyau** reste d'actualité pour prendre en compte de la **non linéarité**.
- Il faut **sélectionner** C , le noyau (et ses paramètres) ainsi que ε ...

Le coin R

- Là aussi, pas grand chose ne change.

```
> svm(Y~.,data=df,kernel="linear",epsilon=0.5, cost=100)
##
## Call:
## sum(formula = Y ~ ., data = df, kernel = "linear", epsilon = 0.5,
##      cost = 100)
##
##
## Parameters:
##      SVM-Type:  eps-regression
##      SVM-Kernel: linear
##              cost: 100
##              gamma: 1
##              epsilon: 0.5
##
##
## Number of Support Vectors:  14
```

Conclusion

- Algorithme machine learning pouvant être utilisé en **régression** et en **classification supervisée**.

Conclusion

- Algorithme machine learning pouvant être utilisé en **régression** et en **classification supervisée**.
- Méthode **linéaire** mais prise en compte possible de la **non linéarité** grâce à l'**astuce du noyau**.

Conclusion

- Algorithme machine learning pouvant être utilisé en **régression** et en **classification supervisée**.
- Méthode **linéaire** mais prise en compte possible de la **non linéarité** grâce à l'**astuce du noyau**.
- **Calibration difficile** : beaucoup de paramètres
 1. paramètre de cout C
 2. noyau
 3. paramètres du noyau
 4. seuil de tolérance ε pour la régression

Conclusion

- Algorithme machine learning pouvant être utilisé en **régression** et en **classification supervisée**.
- Méthode **linéaire** mais prise en compte possible de la **non linéarité** grâce à l'**astuce du noyau**.
- **Calibration difficile** : beaucoup de paramètres
 1. paramètre de cout C
 2. noyau
 3. paramètres du noyau
 4. seuil de tolérance ε pour la régression
- et souvent **peu d'information a priori** sur la valeur de ces paramètres...

SVM - cas séparable

SVM : cas non séparable

SVM non linéaire : astuce du noyau

Scores et probabilités

Compléments : SVM multi-classes et SVR

SVM multiclasses

Support vector regression (SVR)

Bibliographie

Références i

-  Aronszajn, N. (1950).
Theory of reproducing kernels.
Transactions of the American Mathematical Society, 68 :337–404.
-  Fromont, M. (2015).
Apprentissage statistique.
Université Rennes 2, diapos de cours.

Troisième partie III

Agrégation

Bagging et forêts aléatoires

Bagging

Forêts aléatoires

Boosting

Algorithmes de gradient boosting

Choix des paramètres

Bibliographie

Les approches que nous allons étudier sont basées sur l'**agrégation** :

1. construire un grand nombre de **classificateurs "simples"** g_1, \dots, g_B

Les approches que nous allons étudier sont basées sur l'**agrégation** :

1. construire un grand nombre de **classificateurs "simples"** g_1, \dots, g_B
2. que l'on **agrège**

$$\hat{g}(x) = \frac{1}{B} \sum_{k=1}^B g_k(x).$$

Les approches que nous allons étudier sont basées sur l'**agrégation** :

1. construire un grand nombre de **classificateurs "simples"** g_1, \dots, g_B
2. que l'on **agrège**

$$\hat{g}(x) = \frac{1}{B} \sum_{k=1}^B g_k(x).$$

Questions

1. **Intérêt d'agréger ?**
2. Comment construire les g_k pour que \hat{g} soit **performant** ?

Bagging et forêts aléatoires

Bagging

Forêts aléatoires

Boosting

Algorithmes de gradient boosting

Choix des paramètres

Bibliographie

Cadre

- Idem que précédemment, on cherche à expliquer une variable Y par d variables explicatives X_1, \dots, X_d .

Cadre

- Idem que précédemment, on cherche à expliquer une variable Y par d variables explicatives X_1, \dots, X_d .
- Pour simplifier on se place en régression : Y est à valeurs dans \mathbb{R} mais tout ce qui va être fait s'étant directement à la classification binaire ou multiconnexion.

- Idem que précédemment, on cherche à expliquer une variable Y par d variables explicatives X_1, \dots, X_d .
- Pour simplifier on se place en régression : Y est à valeurs dans \mathbb{R} mais tout ce qui va être fait s'étant directement à la classification binaire ou multiconnexion.
- Notations :
 - (X, Y) un couple aléatoire à valeurs dans $\mathbb{R}^d \times \mathbb{R}$.
 - $\mathcal{D}_n = (X_1, Y_1), \dots, (X_n, Y_n)$ un n -échantillon i.i.d. de même loi que (X, Y) .

Bagging et forêts aléatoires

Bagging

Forêts aléatoires

Boosting

Algorithmes de gradient boosting

Choix des paramètres

Bibliographie

- Le **bagging** désigne un ensemble de méthodes introduit par Léo Breiman [[Breiman, 1996](#)].
- **Bagging** : vient de la contraction de **Bootstrap Aggregating**.
- **Idée** : plutôt que de construire un seul estimateur, en construire un grand nombre (sur des échantillons **bootstrap**) et les **agréger**.

Pourquoi agréger ?

- On se place dans le modèle de **régression**.

$$Y = m(X) + \varepsilon.$$

- On note

$$\hat{m}_B(x) = \frac{1}{B} \sum_{k=1}^B m_k(x)$$

un estimateur de m obtenu en **agrégant** B estimateurs m_1, \dots, m_B .

Pourquoi agréger ?

- On se place dans le modèle de régression.

$$Y = m(X) + \varepsilon.$$

- On note

$$\hat{m}_B(x) = \frac{1}{B} \sum_{k=1}^B m_k(x)$$

un estimateur de m obtenu en agrégeant B estimateurs m_1, \dots, m_B .

- Rappels : $\hat{m}_B(x) = \hat{m}_B(x; (X_1, Y_1), \dots, (X_n, Y_n))$ et
 $m_k(x) = m_k(x; (X_1, Y_1), \dots, (X_n, Y_n))$ sont des variables aléatoires.

Pourquoi agréger ?

- On se place dans le modèle de **régression**.

$$Y = m(X) + \varepsilon.$$

- On note

$$\hat{m}_B(x) = \frac{1}{B} \sum_{k=1}^B m_k(x)$$

un estimateur de m obtenu en **agrégeant** B estimateurs m_1, \dots, m_B .

- **Rappels** : $\hat{m}_B(x) = \hat{m}_B(x; (X_1, Y_1), \dots, (X_n, Y_n))$ et
 $m_k(x) = m_k(x; (X_1, Y_1), \dots, (X_n, Y_n))$ sont des **variables aléatoires**.
- On peut **mesurer l'intérêt d'agréger** en comparant les performances de $\hat{m}_B(x)$ à celles des $m_k(x)$, $k = 1, \dots, B$ (en comparant, par exemple, le **biais** et la **variance** de ces estimateurs).

Biais et variance

- **Hypothèse :** les variables aléatoires m_1, \dots, m_B sont i.i.d.

- Hypothèse : les variables aléatoires m_1, \dots, m_B sont i.i.d.
 - Biais :

$$\mathbf{E}[\hat{m}_B(x)] = \mathbf{E}[m_k(x)].$$

Conclusion

Agréger ne modifie pas le biais.

Biais et variance

- Hypothèse : les variables aléatoires m_1, \dots, m_B sont i.i.d.
 - Biais :

$$\mathbf{E}[\hat{m}_B(x)] = \mathbf{E}[m_k(x)].$$

Conclusion

Agréger ne modifie pas le biais.

- Variance :

$$\mathbf{V}[\hat{m}_B(x)] = \frac{1}{B} \mathbf{V}[m_k(x)].$$

Conclusion

Agréger tue la variance.

- Les conclusions précédentes sont vraies sous **l'hypothèse** que les variables aléatoires m_1, \dots, m_B sont i.i.d.

- Les conclusions précédentes sont vraies sous **l'hypothèse** que les variables aléatoires m_1, \dots, m_B sont i.i.d.
- Les estimateurs m_1, \dots, m_B étant construits sur le même échantillon, **l'hypothèse d'indépendance n'est clairement pas raisonnable !**

- Les conclusions précédentes sont vraies sous l'hypothèse que les variables aléatoires m_1, \dots, m_B sont i.i.d.
- Les estimateurs m_1, \dots, m_B étant construits sur le même échantillon, l'hypothèse d'indépendance n'est clairement pas raisonnable !

Idée

Atténuer la dépendance entre les estimateurs $m_k, k = 1, \dots, B$ en introduisant de nouvelles sources d'aléa.

Idée : échantillons bootstrap

- Echantillon **initial** :

1	2	3	4	5	6	7	8	9	10
---	---	---	---	---	---	---	---	---	----

Idée : échantillons bootstrap

- Echantillon **initial** :

1	2	3	4	5	6	7	8	9	10
---	---	---	---	---	---	---	---	---	----

- Echantillons **bootstrap** :

3	4	6	10	3	9	10	7	7	1	m_1
2	8	6	2	10	10	2	9	5	6	m_2
2	9	4	4	7	7	2	3	6	7	m_3
6	1	3	3	9	3	8	10	10	1	m_4
3	7	10	3	2	8	6	9	10	2	m_5
⋮									⋮	
7	10	3	4	9	10	10	8	6	1	m_B

Idée : échantillons bootstrap

- Echantillon initial :

1	2	3	4	5	6	7	8	9	10
---	---	---	---	---	---	---	---	---	----

- Echantillons bootstrap :

3	4	6	10	3	9	10	7	7	1	m_1
2	8	6	2	10	10	2	9	5	6	m_2
2	9	4	4	7	7	2	3	6	7	m_3
6	1	3	3	9	3	8	10	10	1	m_4
3	7	10	3	2	8	6	9	10	2	m_5
:									:	
7	10	3	4	9	10	10	8	6	1	m_B

- A la fin, on agrège :

$$\hat{m}_B(x) = \frac{1}{B} \sum_{k=1}^B m_k(x).$$

Bagging

- Les m_k ne vont pas être construits sur l'échantillon

$\mathcal{D}_n = (X_1, Y_1), \dots, (X_n, Y_n)$, mais sur des **échantillons bootstrap** de \mathcal{D}_n .

Bagging

- Les m_k ne vont pas être construits sur l'échantillon

$\mathcal{D}_n = (X_1, Y_1), \dots, (X_n, Y_n)$, mais sur des **échantillons bootstrap** de \mathcal{D}_n .

Bagging

Entrées :

- $x \in \mathbb{R}^d$ l'observation à prévoir, \mathcal{D}_n l'échantillon
- un régresseur (arbre CART, 1 plus proche voisin...)
- B le nombre d'estimateurs que l'on agrège.

Bagging

- Les m_k ne vont pas être construits sur l'échantillon $\mathcal{D}_n = (X_1, Y_1), \dots, (X_n, Y_n)$, mais sur des **échantillons bootstrap** de \mathcal{D}_n .

Bagging

Entrées :

- $x \in \mathbb{R}^d$ l'observation à prévoir, \mathcal{D}_n l'échantillon
- un régresseur (arbre CART, 1 plus proche voisin...)
- B le nombre d'estimateurs que l'on agrège.

Pour $k = 1, \dots, B$:

1. Tirer un échantillon **bootstrap** dans \mathcal{D}_n
2. Ajuster le régresseur sur cet échantillon bootstrap : $m_k(x)$

Sortie : L'estimateur $\hat{m}_B(x) = \frac{1}{B} \sum_{k=1}^B m_k(x)$.

Tirage de l'échantillon bootstrap

- Les tirages bootstrap sont représentés par B variables aléatoires $\theta_k, k = 1, \dots, B.$

Tirage de l'échantillon bootstrap

- Les tirages bootstrap sont représentés par B variables aléatoires $\theta_k, k = 1, \dots, B$.
- Les tirages bootstrap sont généralement effectués selon la même loi et de façon indépendante : $\theta_1, \dots, \theta_B$ sont i.i.d. de même loi que θ .

Tirage de l'échantillon bootstrap

- Les tirages bootstrap sont représentés par B variables aléatoires $\theta_k, k = 1, \dots, B$.
- Les tirages bootstrap sont généralement effectués selon la même loi et de façon indépendante : $\theta_1, \dots, \theta_B$ sont i.i.d. de même loi que θ .
- 2 techniques sont généralement utilisées :
 1. tirage de n observations avec remise ;
 2. tirage de $\ell < n$ observation sans remise.

Tirage de l'échantillon bootstrap

- Les tirages bootstrap sont représentés par B variables aléatoires $\theta_k, k = 1, \dots, B$.
- Les tirages bootstrap sont généralement effectués selon la même loi et de façon indépendante : $\theta_1, \dots, \theta_B$ sont i.i.d. de même loi que θ .
- 2 techniques sont généralement utilisées :
 1. tirage de n observations avec remise ;
 2. tirage de $\ell < n$ observation sans remise.

Conséquence

Les estimateurs agrégés contiennent 2 sources d'aléa (échantillon et tirage bootstrap) :

$$m_k(x) = m(x, \theta_k, \mathcal{D}_n).$$

Choix du nombre d'itérations

- Deux paramètres sont à choisir : le nombre d'itérations B et le régresseur.

Choix du nombre d'itérations

- Deux paramètres sont à choisir : le nombre d'itérations B et le régresseur.
- On a d'après la loi des grands nombres

$$\begin{aligned}\lim_{B \rightarrow \infty} \hat{m}_B(x) &= \lim_{B \rightarrow \infty} \frac{1}{B} \sum_{k=1}^B m_k(x) = \lim_{B \rightarrow \infty} \frac{1}{B} \sum_{k=1}^B m(x, \theta_k, \mathcal{D}_n) \\ &= \mathbf{E}_{\theta}[m(x, \theta, \mathcal{D}_n)] = \bar{m}(x, \mathcal{D}_n) \quad p.s | \mathcal{D}_n.\end{aligned}$$

Choix du nombre d'itérations

- Deux paramètres sont à choisir : le nombre d'itérations B et le régresseur.
- On a d'après la loi des grands nombres

$$\begin{aligned}\lim_{B \rightarrow \infty} \hat{m}_B(x) &= \lim_{B \rightarrow \infty} \frac{1}{B} \sum_{k=1}^B m_k(x) = \lim_{B \rightarrow \infty} \frac{1}{B} \sum_{k=1}^B m(x, \theta_k, \mathcal{D}_n) \\ &= \mathbf{E}_{\theta}[m(x, \theta, \mathcal{D}_n)] = \bar{m}(x, \mathcal{D}_n) \quad p.s | \mathcal{D}_n.\end{aligned}$$

- Lorsque B est grand, \hat{m}_B se "stabilise" vers l'estimateur bagging $\bar{m}(x, \mathcal{D}_n)$.

Choix du nombre d'itérations

- Deux paramètres sont à choisir : le nombre d'itérations B et le régresseur.
- On a d'après la loi des grands nombres

$$\begin{aligned}\lim_{B \rightarrow \infty} \hat{m}_B(x) &= \lim_{B \rightarrow \infty} \frac{1}{B} \sum_{k=1}^B m_k(x) = \lim_{B \rightarrow \infty} \frac{1}{B} \sum_{k=1}^B m(x, \theta_k, \mathcal{D}_n) \\ &= \mathbf{E}_{\theta}[m(x, \theta, \mathcal{D}_n)] = \bar{m}(x, \mathcal{D}_n) \quad p.s | \mathcal{D}_n.\end{aligned}$$

- Lorsque B est grand, \hat{m}_B se "stabilise" vers l'estimateur bagging $\bar{m}(x, \mathcal{D}_n)$.

Conséquence importante

Le nombre d'itérations B n'est pas un paramètre à calibrer, il est conseillé de le prendre le plus grand possible en fonction du temps de calcul.

Choix du régresseur

Propriété : biais et variance

On a $\mathbf{E}[\hat{m}_B(x)] = \mathbf{E}[m_k(x, \theta_k, \mathcal{D}_n)]$ et

$$\mathbf{V}[\hat{m}_B(x)] = \rho(x)\mathbf{V}[m(x, \theta_k, \mathcal{D}_n)] + \frac{1 - \rho(x)}{B}\mathbf{V}[m(x, \theta_k, \mathcal{D}_n)]$$

où $\rho(x) = \text{corr}(m(x, \theta_k, \mathcal{D}_n), m(x, \theta_{k'}, \mathcal{D}_n))$ pour $k \neq k'$.

Choix du régresseur

Propriété : biais et variance

On a $\mathbf{E}[\hat{m}_B(x)] = \mathbf{E}[m_k(x, \theta_k, \mathcal{D}_n)]$ et

$$\mathbf{V}[\hat{m}_B(x)] = \rho(x)\mathbf{V}[m(x, \theta_k, \mathcal{D}_n)] + \frac{1 - \rho(x)}{B}\mathbf{V}[m(x, \theta_k, \mathcal{D}_n)]$$

où $\rho(x) = \text{corr}(m(x, \theta_k, \mathcal{D}_n), m(x, \theta_{k'}, \mathcal{D}_n))$ pour $k \neq k'$.

Conclusion

- Bagger ne modifie pas le biais.

Choix du régresseur

Propriété : biais et variance

On a $\mathbf{E}[\hat{m}_B(x)] = \mathbf{E}[m_k(x, \theta_k, \mathcal{D}_n)]$ et

$$\mathbf{V}[\hat{m}_B(x)] = \rho(x)\mathbf{V}[m(x, \theta_k, \mathcal{D}_n)] + \frac{1 - \rho(x)}{B}\mathbf{V}[m(x, \theta_k, \mathcal{D}_n)]$$

où $\rho(x) = \text{corr}(m(x, \theta_k, \mathcal{D}_n), m(x, \theta_{k'}, \mathcal{D}_n))$ pour $k \neq k'$.

Conclusion

- Bagger ne modifie pas le biais.
- B grand $\implies \mathbf{V}[\hat{m}_B(x)] \approx \rho(x)\mathbf{V}[\hat{m}_k(x, \theta_k(\mathcal{D}_n))]$

Choix du régresseur

Propriété : biais et variance

On a $\mathbf{E}[\hat{m}_B(x)] = \mathbf{E}[m_k(x, \theta_k, \mathcal{D}_n)]$ et

$$\mathbf{V}[\hat{m}_B(x)] = \rho(x)\mathbf{V}[m(x, \theta_k, \mathcal{D}_n)] + \frac{1 - \rho(x)}{B}\mathbf{V}[m(x, \theta_k, \mathcal{D}_n)]$$

où $\rho(x) = \text{corr}(m(x, \theta_k, \mathcal{D}_n), m(x, \theta_{k'}, \mathcal{D}_n))$ pour $k \neq k'$.

Conclusion

- Bagger ne modifie pas le biais.
- B grand $\implies \mathbf{V}[\hat{m}_B(x)] \approx \rho(x)\mathbf{V}[\hat{m}_k(x, \theta_k(\mathcal{D}_n))] \implies$ la variance diminue d'autant plus que la corrélation entre les prédicteurs diminue.

Choix du régresseur

Propriété : biais et variance

On a $\mathbf{E}[\hat{m}_B(x)] = \mathbf{E}[m_k(x, \theta_k, \mathcal{D}_n)]$ et

$$\mathbf{V}[\hat{m}_B(x)] = \rho(x)\mathbf{V}[m(x, \theta_k, \mathcal{D}_n)] + \frac{1 - \rho(x)}{B}\mathbf{V}[m(x, \theta_k, \mathcal{D}_n)]$$

où $\rho(x) = \text{corr}(m(x, \theta_k, \mathcal{D}_n), m(x, \theta_{k'}, \mathcal{D}_n))$ pour $k \neq k'$.

Conclusion

- Bagger ne modifie pas le biais.
- B grand $\implies \mathbf{V}[\hat{m}_B(x)] \approx \rho(x)\mathbf{V}[\hat{m}_k(x, \theta_k(\mathcal{D}_n))] \implies$ la variance diminue d'autant plus que la corrélation entre les prédicteurs diminue.
- Il est donc nécessaire d'agréger des estimateurs sensibles à de légères perturbations de l'échantillon.

Choix du régresseur

Propriété : biais et variance

On a $\mathbf{E}[\hat{m}_B(x)] = \mathbf{E}[m_k(x, \theta_k, \mathcal{D}_n)]$ et

$$\mathbf{V}[\hat{m}_B(x)] = \rho(x)\mathbf{V}[m(x, \theta_k, \mathcal{D}_n)] + \frac{1 - \rho(x)}{B}\mathbf{V}[m(x, \theta_k, \mathcal{D}_n)]$$

où $\rho(x) = \text{corr}(m(x, \theta_k, \mathcal{D}_n), m(x, \theta_{k'}, \mathcal{D}_n))$ pour $k \neq k'$.

Conclusion

- Bagger ne modifie pas le biais.
- B grand $\implies \mathbf{V}[\hat{m}_B(x)] \approx \rho(x)\mathbf{V}[\hat{m}_k(x, \theta_k(\mathcal{D}_n))] \implies$ la variance diminue d'autant plus que la corrélation entre les prédicteurs diminue.
- Il est donc nécessaire d'agréger des estimateurs sensibles à de légères perturbations de l'échantillon.
- Les arbres sont connus pour posséder de telles propriétés.

Bagging et forêts aléatoires

Bagging

Forêts aléatoires

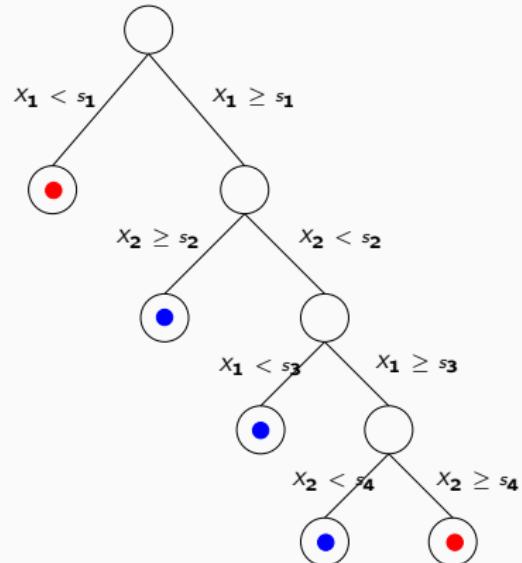
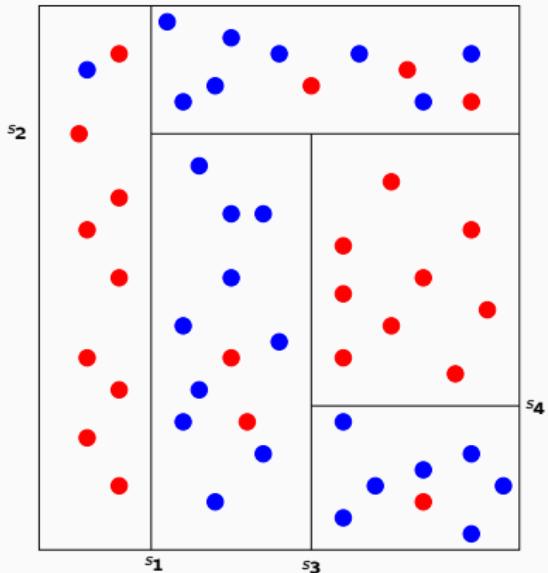
Boosting

Algorithmes de gradient boosting

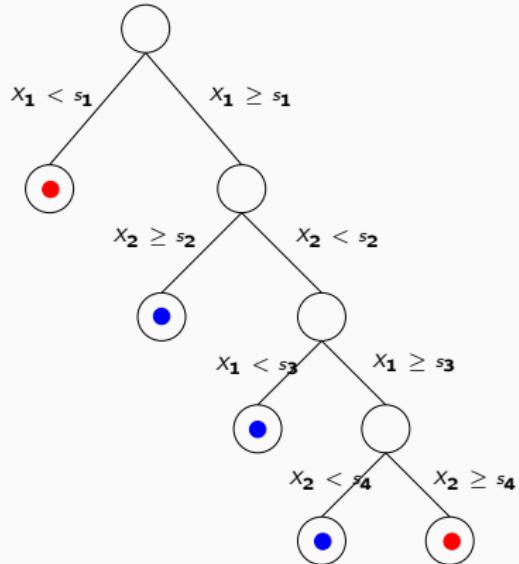
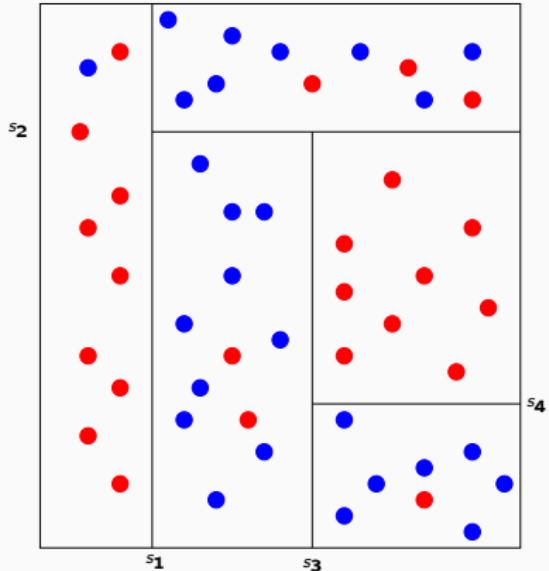
Choix des paramètres

Bibliographie

Rappels sur les arbres



Rappels sur les arbres



Paramètre à calibrer

Profondeur

- petite : biais \nearrow , variance \searrow
- grande : biais \searrow , variance \nearrow

Définition

- Comme son nom l'indique, une **forêt aléatoire** est définie à partir d'un ensemble d'arbres.

Définition

- Comme son nom l'indique, une **forêt aléatoire** est définie à partir d'un ensemble d'arbres.

Définition

Soit $T_k(x)$, $k = 1, \dots, B$ des prédicteurs par arbre ($T_k : \mathbb{R}^d \rightarrow \mathbb{R}$). Le prédicteur des **forêts aléatoires** est obtenu par agrégation de cette collection d'arbres :

$$\hat{T}_B(x) = \frac{1}{B} \sum_{k=1}^B T_k(x).$$

Forêts aléatoires

- Forêts aléatoires = collection d'arbres.

Forêts aléatoires

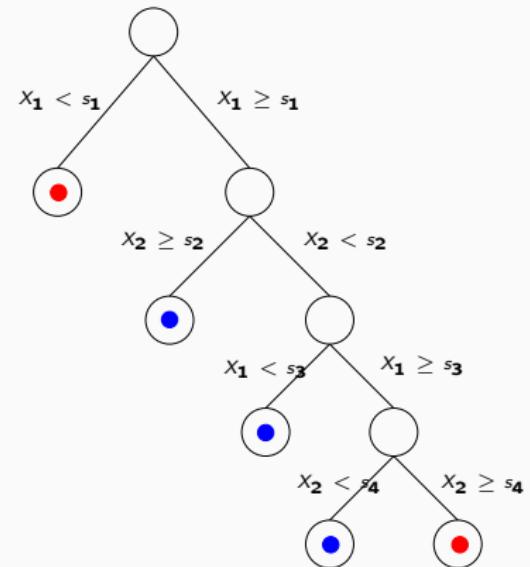
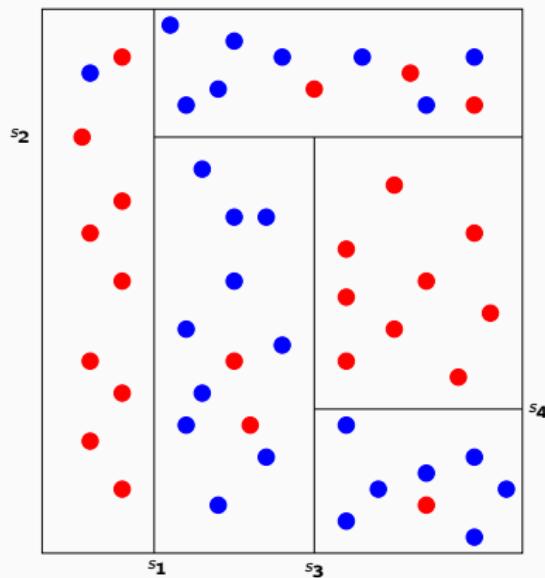
- Forêts aléatoires = collection d'arbres.
- Les forêts aléatoires les plus utilisées sont (de loin) celles proposées par Léo Breiman (au début des années 2000).

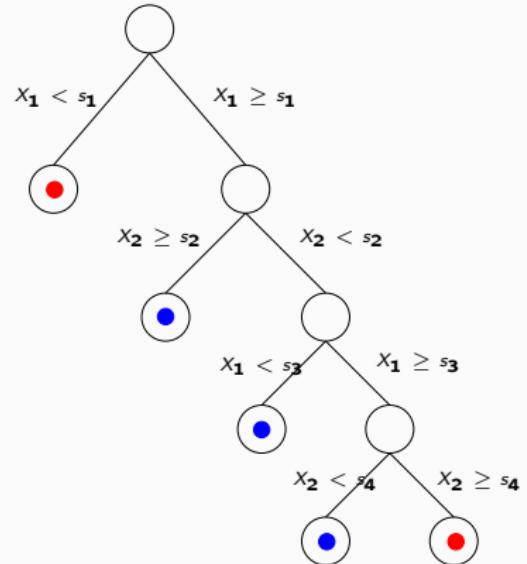
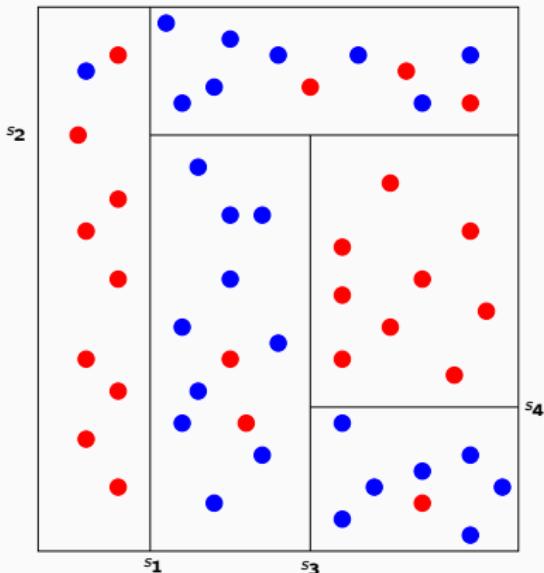
Forêts aléatoires

- Forêts aléatoires = collection d'arbres.
- Les forêts aléatoires les plus utilisées sont (de loin) celles proposées par Léo Breiman (au début des années 2000).
- Elles consistent à agréger des arbres construits sur des échantillons bootstrap.

Forêts aléatoires

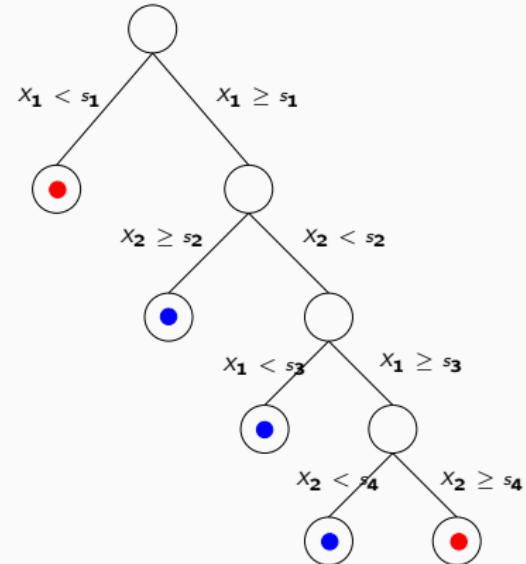
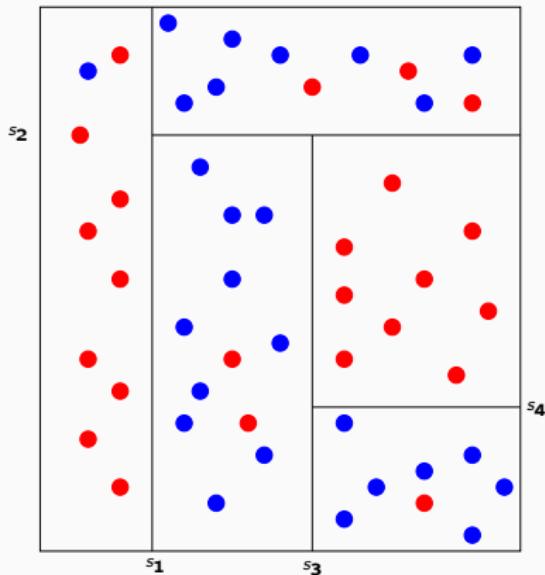
- Forêts aléatoires = collection d'arbres.
- Les forêts aléatoires les plus utilisées sont (de loin) celles proposées par Léo Breiman (au début des années 2000).
- Elles consistent à agréger des arbres construits sur des échantillons bootstrap.
- On pourra trouver de la doc à l'url
<http://www.stat.berkeley.edu/~breiman/RandomForests/>
et consulter la thèse de Robin Genuer [Genuer, 2010].





Arbres pour forêt

- Breiman propose de sélectionner la "meilleure" variable dans un ensemble composé uniquement de m variables choisies aléatoirement parmi les d variables initiales.



Arbres pour forêt

- Breiman propose de sélectionner la "meilleure" variable dans un ensemble composé uniquement de m variables choisies aléatoirement parmi les d variables initiales.
- Objectif : diminuer la corrélation entre les arbres que l'on agrège.

Algorithme : randomforest

Entrées :

- $x \in \mathbb{R}^d$ l'observation à prévoir, \mathcal{D}_n l'échantillon ;
- B nombre d'arbres ; n_{max} nombre max d'observations par nœud
- $m \in \{1, \dots, d\}$ le nombre de variables candidates pour découper un nœud.

Algorithme : randomforest

Entrées :

- $x \in \mathbb{R}^d$ l'observation à prévoir, \mathcal{D}_n l'échantillon ;
- B nombre d'arbres ; n_{max} nombre max d'observations par nœud
- $m \in \{1, \dots, d\}$ le nombre de variables candidates pour découper un nœud.

Pour $k = 1, \dots, B$:

1. Tirer un échantillon **bootstrap** dans \mathcal{D}_n
2. Construire un **arbre CART** sur cet échantillon **bootstrap**, chaque coupure est sélectionnée en minimisant la fonction de coût de CART sur un ensemble de **m variables choisies au hasard** parmi les d . On note $T(., \theta_k, \mathcal{D}_n)$ l'arbre construit.

Sortie : l'estimateur $T_B(x) = \frac{1}{B} \sum_{k=1}^B T(x, \theta_k, \mathcal{D}_n)$.

Commentaires

- Si on est en discrimination (Y qualitative), l'étape d'agrégation consiste à faire **voter les arbres à la majorité**.

Commentaires

- Si on est en discrimination (Y qualitative), l'étape d'agrégation consiste à faire **voter les arbres à la majorité**.
- Il y a deux sources d'aléa présentes dans θ_k : le **tirage bootstrap** et **les m variables sélectionnées** à chaque étape de la construction de l'arbre.

Commentaires

- Si on est en discrimination (Y qualitative), l'étape d'agrégation consiste à faire **voter les arbres à la majorité**.
- Il y a deux sources d'aléa présentes dans θ_k : le **tirage bootstrap** et **les m variables sélectionnées** à chaque étape de la construction de l'arbre.
- Méthode **simple à mettre en oeuvre** et déjà **implémentée** sur la plupart des logiciels statistiques (sur R, il suffit de lancer la fonction `randomForest` du package `randomForest`).

Commentaires

- Si on est en discrimination (Y qualitative), l'étape d'agrégation consiste à faire **voter les arbres à la majorité**.
- Il y a deux sources d'aléa présentes dans θ_k : le **tirage bootstrap** et **les m variables sélectionnées** à chaque étape de la construction de l'arbre.
- Méthode **simple à mettre en oeuvre** et déjà **implémentée** sur la plupart des logiciels statistiques (sur R, il suffit de lancer la fonction `randomForest` du package `randomForest`).
- Estimateur connu pour fournir des **estimations précises** sur des données complexes (beaucoup de variables, données manquantes...).

Commentaires

- Si on est en discrimination (Y qualitative), l'étape d'agrégation consiste à faire **voter les arbres à la majorité**.
- Il y a deux sources d'aléa présentes dans θ_k : le **tirage bootstrap** et **les m variables sélectionnées** à chaque étape de la construction de l'arbre.
- Méthode **simple à mettre en oeuvre** et déjà **implémentée** sur la plupart des logiciels statistiques (sur R, il suffit de lancer la fonction `randomForest` du package `randomForest`).
- Estimateur connu pour fournir des **estimations précises** sur des données complexes (beaucoup de variables, données manquantes...).
- Estimateur **peu sensible** au choix de ses paramètres (B , n_{max} , $m...$)

Choix des paramètres

- B : réglé... le plus grand possible.

Choix des paramètres

- B : réglé... le plus grand possible.

Intérêt du bagging (rappel)

Diminuer la variance des estimateurs qu'on agrège :

$$\mathbf{V}[\hat{T}_B(x)] = \rho(x)\mathbf{V}[T(x, \theta_k, \mathcal{D}_n)] + \frac{1 - \rho(x)}{B}\mathbf{V}[T(x, \theta_k, \mathcal{D}_n)]$$

Choix des paramètres

- B : réglé... le plus grand possible.

Intérêt du bagging (rappel)

Diminuer la variance des estimateurs qu'on agrège :

$$\mathbf{V}[\hat{T}_B(x)] = \rho(x)\mathbf{V}[T(x, \theta_k, \mathcal{D}_n)] + \frac{1 - \rho(x)}{B}\mathbf{V}[T(x, \theta_k, \mathcal{D}_n)]$$

Conséquence

- Le biais n'étant pas amélioré par "l'agrégation bagging", il est recommandé d'agréger des estimateurs qui possèdent un **biais faible** (**contrairement au boosting**).

Choix des paramètres

- B : réglé... le plus grand possible.

Intérêt du bagging (rappel)

Diminuer la variance des estimateurs qu'on agrège :

$$\mathbf{V}[\hat{T}_B(x)] = \rho(x)\mathbf{V}[T(x, \theta_k, \mathcal{D}_n)] + \frac{1 - \rho(x)}{B}\mathbf{V}[T(x, \theta_k, \mathcal{D}_n)]$$

Conséquence

- Le biais n'étant pas amélioré par "l'agrégation bagging", il est recommandé d'agréger des estimateurs qui possèdent un **biais faible** (**contrairement au boosting**).
- Arbres "profonds", peu d'observations dans les nœuds terminaux.

Choix des paramètres

- B : réglé... le plus grand possible.

Intérêt du bagging (rappel)

Diminuer la variance des estimateurs qu'on agrège :

$$\mathbf{V}[\hat{T}_B(x)] = \rho(x)\mathbf{V}[T(x, \theta_k, \mathcal{D}_n)] + \frac{1 - \rho(x)}{B}\mathbf{V}[T(x, \theta_k, \mathcal{D}_n)]$$

Conséquence

- Le biais n'étant pas amélioré par "l'agrégation bagging", il est recommandé d'agréger des estimateurs qui possèdent un biais faible (contrairement au boosting).
- Arbres "profonds", peu d'observations dans les nœuds terminaux.
- Par défaut dans randomForest, $n_{max} = 5$ en régression et 1 en classification.

Choix de m

- Il est en **relation avec la corrélation** entre les arbres $\rho(x)$.

Choix de m

- Il est en **relation avec la corrélation** entre les arbres $\rho(x)$.
- Ce paramètre a une influence sur le compromis biais/variance de la forêt.

Choix de m

- Il est en **relation avec la corrélation** entre les arbres $\rho(x)$.
- Ce paramètre a une influence sur le compromis biais/variance de la forêt.
- $m \searrow$

Choix de m

- Il est en **relation avec la corrélation** entre les arbres $\rho(x)$.
- Ce paramètre a une influence sur le compromis biais/variance de la forêt.
- $m \searrow$
 1. tendance à se rapprocher d'un **choix "aléatoire"** des variables de découpe des arbres

Choix de m

- Il est en **relation avec la corrélation** entre les arbres $\rho(x)$.
- Ce paramètre a une influence sur le compromis biais/variance de la forêt.
- $m \searrow$
 1. tendance à se rapprocher d'un **choix "aléatoire"** des variables de découpe des arbres \implies les arbres sont de plus en plus différents

Choix de m

- Il est en **relation avec la corrélation** entre les arbres $\rho(x)$.
- Ce paramètre a une influence sur le compromis biais/variance de la forêt.
- $m \searrow$
 1. tendance à se rapprocher d'un **choix "aléatoire"** des variables de découpe des arbres \implies les arbres sont de plus en plus différents $\implies \rho(x) \searrow \implies$ **la variance de la forêt diminue.**

Choix de m

- Il est en **relation avec la corrélation** entre les arbres $\rho(x)$.
- Ce paramètre a une influence sur le compromis biais/variance de la forêt.
- $m \searrow$
 1. tendance à se rapprocher d'un **choix "aléatoire"** des variables de découpe des arbres \implies les arbres sont de plus en plus différents $\implies \rho(x) \searrow \implies$ **la variance de la forêt diminue.**
 2. mais... le biais des arbres \nearrow

Choix de m

- Il est en **relation avec la corrélation** entre les arbres $\rho(x)$.
- Ce paramètre a une influence sur le compromis biais/variance de la forêt.
- $m \searrow$
 1. tendance à se rapprocher d'un **choix "aléatoire"** des variables de découpe des arbres \implies les arbres sont de plus en plus différents $\implies \rho(x) \searrow \implies$ **la variance de la forêt diminue.**
 2. mais... le biais des arbres $\nearrow \implies$ le **biais de la forêt ↗**.

Choix de m

- Il est en **relation avec la corrélation** entre les arbres $\rho(x)$.
- Ce paramètre a une influence sur le compromis biais/variance de la forêt.
- $m \searrow$
 1. tendance à se rapprocher d'un **choix "aléatoire"** des variables de découpe des arbres \implies les arbres sont de plus en plus différents $\implies \rho(x) \searrow \implies$ **la variance de la forêt diminue.**
 2. mais... le biais des arbres $\nearrow \implies$ le **biais de la forêt \nearrow .**
- Inversement lorsque $m \nearrow$.

Choix de m

- Il est en **relation avec la corrélation** entre les arbres $\rho(x)$.
- Ce paramètre a une influence sur le compromis biais/variance de la forêt.
- $m \searrow$
 1. tendance à se rapprocher d'un **choix "aléatoire"** des variables de découpe des arbres \implies les arbres sont de plus en plus différents $\implies \rho(x) \searrow \implies$ **la variance de la forêt diminue.**
 2. mais... le biais des arbres $\nearrow \implies$ le **biais de la forêt \nearrow .**
- Inversement lorsque $m \nearrow$.

Conclusion

- Il est recommandé de comparer les performances de la forêt pour **plusieurs valeurs de m .**
- Par défaut $m = d/3$ en régression et \sqrt{d} en classification.

Application sur les données spam

```
> library(randomForest)
> foret1 <- randomForest(type ~ ., data=spam)
> foret1
##
## Call:
##   randomForest(formula = type ~ ., data = spam)
##           Type of random forest: classification
##                   Number of trees: 500
## No. of variables tried at each split: 7
##
##           OOB estimate of  error rate: 4.52%
## Confusion matrix:
##           nonspam spam class.error
## nonspam     2708   80  0.02869440
## spam        128 1685  0.07060121
```

Mesure de performance

- Comme pour les autres classifieurs et régresseurs il convient de définir des critères qui permettent de **mesurer la performance des forêts aléatoires.**

Mesure de performance

- Comme pour les autres classifieurs et régresseurs il convient de définir des critères qui permettent de **mesurer la performance des forêts aléatoires**.
- Exemples :
 - Erreur de prédiction : $\mathbf{E}[(Y - \hat{T}_B(X))^2]$ en régression ;
 - Probabilité d'erreur : $\mathbf{P}(Y \neq \hat{T}_B(X))$ en classification.

Mesure de performance

- Comme pour les autres classifieurs et régresseurs il convient de définir des critères qui permettent de **mesurer la performance des forêts aléatoires**.
- Exemples :
 - Erreur de prédiction : $\mathbf{E}[(Y - \hat{T}_B(X))^2]$ en régression ;
 - Probabilité d'erreur : $\mathbf{P}(Y \neq \hat{T}_B(X))$ en classification.
- Comme pour les autres méthodes, ces critères peuvent être évalués par **apprentissage/validation** ou **validation croisée**.

Mesure de performance

- Comme pour les autres classifieurs et régresseurs il convient de définir des critères qui permettent de **mesurer la performance des forêts aléatoires**.
- Exemples :
 - Erreur de prédiction : $\mathbf{E}[(Y - \hat{T}_B(X))^2]$ en régression ;
 - Probabilité d'erreur : $\mathbf{P}(Y \neq \hat{T}_B(X))$ en classification.
- Comme pour les autres méthodes, ces critères peuvent être évalués par **apprentissage/validation** ou **validation croisée**.
- La phase **bootstrap** des algorithme bagging permet de définir une nouvelle méthode d'estimation de ces critères : méthode **OOB (Out Of Bag)**.

Erreurs Ouf Of Bag

- Pour chaque observation (X_i, Y_i) de \mathcal{D}_n , on désigne par \mathcal{I}_B l'ensemble des arbres de la forêt qui **ne contiennent pas cette observation** dans leur échantillon bootstrap.
- La prévision de Y au point X_i se fait selon

$$\hat{Y}_i = \frac{1}{|\mathcal{I}_B|} \sum_{k \in \mathcal{I}_B} T(X_i, \theta_k, \mathcal{D}_n).$$

Erreurs Ouf Of Bag

- Pour chaque observation (X_i, Y_i) de \mathcal{D}_n , on désigne par \mathcal{I}_B l'ensemble des arbres de la forêt qui **ne contiennent pas cette observation** dans leur échantillon bootstrap.
- La prévision de Y au point X_i se fait selon

$$\hat{Y}_i = \frac{1}{|\mathcal{I}_B|} \sum_{k \in \mathcal{I}_B} T(X_i, \theta_k, \mathcal{D}_n).$$

Estimateurs Ouf Of Bag

- L'**erreur de prédiction** est estimée par $\frac{1}{n} \sum_{i=1}^n (\hat{Y}_i - Y_i)^2$.
- La **probabilité d'erreur** est estimée par $\frac{1}{n} \sum_{i=1}^n \mathbf{1}_{\hat{Y}_i \neq Y_i}$.

Exemple

3	4	6	10	3	9	10	7	7	1	m_1
2	8	6	2	10	10	2	9	5	6	m_2
2	9	4	4	7	7	2	3	6	7	m_3
6	1	3	3	9	3	8	10	10	1	m_4
3	7	10	3	2	8	6	9	10	2	m_5
7	10	3	4	9	10	10	8	6	1	m_6

Exemple

3	4	6	10	3	9	10	7	7	1	m_1
2	8	6	2	10	10	2	9	5	6	m_2
2	9	4	4	7	7	2	3	6	7	m_3
6	1	3	3	9	3	8	10	10	1	m_4
3	7	10	3	2	8	6	9	10	2	m_5
7	10	3	4	9	10	10	8	6	1	m_6

- Les échantillons 2, 3 et 5 ne contiennent pas la première observation, donc

$$\hat{Y}_1 = \frac{1}{3}(m_2(X_1) + m_3(X_1) + m_5(X_1)).$$

- On fait de même pour toutes les observations $\implies \hat{Y}_2, \dots, \hat{Y}_n$.

Exemple

3	4	6	10	3	9	10	7	7	1	m_1
2	8	6	2	10	10	2	9	5	6	m_2
2	9	4	4	7	7	2	3	6	7	m_3
6	1	3	3	9	3	8	10	10	1	m_4
3	7	10	3	2	8	6	9	10	2	m_5
7	10	3	4	9	10	10	8	6	1	m_6

- Les échantillons 2, 3 et 5 ne contiennent pas la première observation, donc

$$\hat{Y}_1 = \frac{1}{3}(m_2(X_1) + m_3(X_1) + m_5(X_1)).$$

- On fait de même pour toutes les observations $\implies \hat{Y}_2, \dots, \hat{Y}_n$.
- On estime l'erreur selon

$$\frac{1}{n} \sum_{i=1}^n (\hat{Y}_i - Y_i)^2.$$

Exemple

- On construit la forêt avec $m = 1$:

```
> foret2 <- randomForest(type ~ ., data=spam, mtry=1)
> foret2
##
## Call:
##   randomForest(formula = type ~ ., data = spam, mtry = 1)
##           Type of random forest: classification
##                   Number of trees: 500
## No. of variables tried at each split: 1
##
##       OOB estimate of  error rate: 8.06%
## Confusion matrix:
##   nonspam  spam class.error
## nonspam    2725    63  0.02259684
## spam        308 1505  0.16988417
```

Exemple

- On construit la forêt avec $m = 1$:

```
> foret2 <- randomForest(type ~ ., data=spam, mtry=1)
> foret2
##
## Call:
##   randomForest(formula = type ~ ., data = spam, mtry = 1)
##           Type of random forest: classification
##                   Number of trees: 500
## No. of variables tried at each split: 1
##
##       OOB estimate of  error rate: 8.06%
## Confusion matrix:
##   nonspam  spam class.error
## nonspam    2725    63  0.02259684
## spam        308 1505  0.16988417
```

Remarque

L'erreur OOB est de 8.06%, elle est de 4.52% lorsque $m = 7$.

Importance des variables

- Un des reproches souvent fait aux forêts est l'aspect **boîte noire** et **manque d'interprétabilité** par rapport aux modèles paramétriques tels que le modèle logistique.

Importance des variables

- Un des reproches souvent fait aux forêts est l'aspect **boîte noire** et **manque d'interprétabilité** par rapport aux modèles paramétriques tels que le modèle logistique.
- Il existe un **indicateur** qui permet de mesurer l'**importance des variables** présentes dans le modèle.
- Comme l'erreur OOB, ce critère est basé sur le fait que toutes les observations **ne sont pas utilisées** pour construire les arbres de la forêt.

- Soit OOB_k l'échantillon Out Of Bag associé au k^{eme} arbre : il contient les observations qui ne sont pas dans le k^{eme} échantillon bootstrap.

- Soit OOB_k l'échantillon Out Of Bag associé au k^{eme} arbre : il contient les observations qui ne sont pas dans le k^{eme} échantillon bootstrap.
- Soit E_{OOB_k} l'erreur de prédiction de l'arbre k mesurée sur cet échantillon :

$$E_{OOB_k} = \frac{1}{|OOB_k|} \sum_{i \in OOB_k} (T(X_i, \theta_k, \mathcal{D}_n) - Y_i)^2.$$

- Soit OOB_k l'échantillon Out Of Bag associé au k^{eme} arbre : il contient les observations qui ne sont pas dans le k^{eme} échantillon bootstrap.
- Soit E_{OOB_k} l'erreur de prédiction de l'arbre k mesurée sur cet échantillon :

$$E_{OOB_k} = \frac{1}{|OOB_k|} \sum_{i \in OOB_k} (T(X_i, \theta_k, \mathcal{D}_n) - Y_i)^2.$$

- Soit OOB_k^j l'échantillon OOB_k dans lequel on a perturbé aléatoirement les valeurs de la variable j et $E_{OOB_k^j}$ l'erreur de prédiction de l'arbre k mesurée sur cet échantillon :

$$E_{OOB_k}^j = \frac{1}{|OOB_k^j|} \sum_{i \in OOB_k^j} (T(X_i^j, \theta_k, \mathcal{D}_n) - Y_i)^2,$$

- Soit OOB_k l'échantillon Out Of Bag associé au k^{eme} arbre : il contient les observations qui ne sont pas dans le k^{eme} échantillon bootstrap.
- Soit E_{OOB_k} l'erreur de prédiction de l'arbre k mesurée sur cet échantillon :

$$E_{OOB_k} = \frac{1}{|OOB_k|} \sum_{i \in OOB_k} (T(X_i, \theta_k, \mathcal{D}_n) - Y_i)^2.$$

- Soit OOB_k^j l'échantillon OOB_k dans lequel on a perturbé aléatoirement les valeurs de la variable j et $E_{OOB_k^j}$ l'erreur de prédiction de l'arbre k mesurée sur cet échantillon :

$$E_{OOB_k}^j = \frac{1}{|OOB_k^j|} \sum_{i \in OOB_k^j} (T(X_i^j, \theta_k, \mathcal{D}_n) - Y_i)^2,$$

Définition

L'importance de la j^{eme} variable est définie par

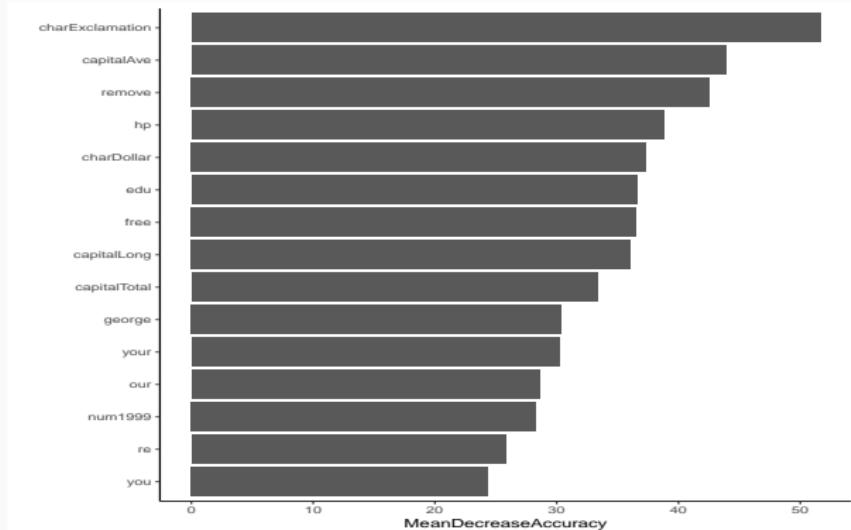
$$Imp(X_j) = \frac{1}{B} \sum_{k=1}^B (E_{OOB_k}^j - E_{OOB_k}).$$

Exemple

- L'importance s'obtient facilement avec le package `randomForest`

```
> foret <- randomForest(type ~ ., data=spam, importance=TRUE)
> Imp <- importance(foret, type=1) %>% as.data.frame() %>%
+   mutate(variable=names(spam)[-58]) %>% arrange(desc(MeanDecreaseAccuracy))
> head(Imp)
##   MeanDecreaseAccuracy      variable
## 1      52.88382 charExclamation
## 2      48.69346          remove
## 3      42.21059    capitalAve
## 4      38.86023    charDollar
## 5      38.85976            hp
## 6      37.77500  capitalLong
```

```
> ggplot(Imp[1:15,]) + aes(x=reorder(variable,MeanDecreaseAccuracy),  
+                               y=MeanDecreaseAccuracy)+  
+   geom_bar(stat="identity")+coord_flip()+xlab("")+theme_classic()
```



⇒ Partie 4.1 du tuto

Bagging et forêts aléatoires

Bagging

Forêts aléatoires

Boosting

Algorithmes de gradient boosting

Choix des paramètres

Bibliographie

- Le terme **Boosting** s'applique à des méthodes générales permettant de produire des décisions précises à partir de **règles faibles** (weaklearner).
- Historiquement, le **premier** algorithme boosting est **adaboost** [Freund and Schapire, 1996].
- Il a ensuite été montré que cet algorithme peut-être vu comme **un cas particulier d'algorithmes** de descente de gradient \Rightarrow **gradient boosting**.
- C'est cette **famille d'algorithmes** que nous présentons dans cette partie.

Bagging et forêts aléatoires

Bagging

Forêts aléatoires

Boosting

Algorithmes de gradient boosting

Choix des paramètres

Bibliographie

- (X, Y) couple aléatoire à valeurs dans $\mathbb{R}^d \times \mathcal{Y}$. Etant donnée \mathcal{G} une famille de règles, on se pose la question de trouver la meilleure règle dans \mathcal{G} .
- Choisir la règle qui minimise une fonction de perte, par exemple

$$\mathcal{R}(g) = \mathbf{E}[\ell(Y, g(X))].$$

Problème : la fonction de perte n'est pas calculable.

- (X, Y) couple aléatoire à valeurs dans $\mathbb{R}^d \times \mathcal{Y}$. Etant donnée \mathcal{G} une famille de règles, on se pose la question de trouver la meilleure règle dans \mathcal{G} .
- Choisir la règle qui minimise une fonction de perte, par exemple

$$\mathcal{R}(g) = \mathbf{E}[\ell(Y, g(X))].$$

Problème : la fonction de perte n'est pas calculable.

- **Idée** : choisir la règle qui minimise la version empirique de la fonction de perte :

$$\mathcal{R}_n(g) = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n \ell(Y_i, g(X_i)).$$

- On considère \mathcal{G} l'ensemble des arbres binaires et on veut trouver la meilleure combinaison linéaire d'arbres binaires.

Un premier problème

Trouver $g(x) = \sum_{m=1}^M \alpha_m h_m(x) \in \mathcal{G}$ qui minimise

$$\mathcal{R}_n(g) = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n \ell(Y_i, g(X_i)).$$

- On considère \mathcal{G} l'ensemble des arbres binaires et on veut trouver la meilleure combinaison linéaire d'arbres binaires.

Un premier problème

Trouver $g(x) = \sum_{m=1}^M \alpha_m h_m(x) \in \mathcal{G}$ qui minimise

$$\mathcal{R}_n(g) = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n \ell(Y_i, g(X_i)).$$

sans solution...

- Pas de solution explicite.
- Nécessité de trouver un algorithme pour approcher la solution.

Descente de gradient

- Idée : utiliser un algorithme de descente de gradient de type Newton-Raphson.

Descente de gradient

- Idée : utiliser un algorithme de descente de gradient de type Newton-Raphson.
- Algorithme récursif :
 - itération m : g_m
 - itération $m + 1$: on ajoute à g_m un nouvel arbre binaire h_{m+1} tel que le risque $\mathcal{R}_n(g_m + \lambda h_{m+1})$ diminue le plus fortement ($\lambda \in \mathbb{R}^+$ petit).

Descente de gradient

- Idée : utiliser un algorithme de descente de gradient de type Newton-Raphson.
 - Algorithme récursif :
 - itération m : g_m
 - itération $m + 1$: on ajoute à g_m un nouvel arbre binaire h_{m+1} tel que le risque $\mathcal{R}_n(g_m + \lambda h_{m+1})$ diminue le plus fortement ($\lambda \in \mathbb{R}^+$ petit).
 - Approche classique : utiliser l'opposé du gradient
 $f_{m+1}(x) = -\nabla \mathcal{R}_n(g_m)(x)$
- $$g_{m+1}(x) = g_m(x) + \lambda f_{m+1}(x).$$

Descente de gradient

- Idée : utiliser un algorithme de descente de gradient de type Newton-Raphson.
- Algorithme récursif :
 - itération m : g_m
 - itération $m + 1$: on ajoute à g_m un nouvel arbre binaire h_{m+1} tel que le risque $\mathcal{R}_n(g_m + \lambda h_{m+1})$ diminue le plus fortement ($\lambda \in \mathbb{R}^+$ petit).
 - Approche classique : utiliser l'opposé du gradient
 $f_{m+1}(x) = -\nabla \mathcal{R}_n(g_m)(x)$

$$g_{m+1}(x) = g_m(x) + \lambda f_{m+1}(x).$$

Une restriction

Chaque élément de la suite doit être une combinaison d'arbres et f_{m+1} n'est pas (forcément) un arbre.

- Pour trouver l'arbre le plus proche du gradient f_{m+1} , on cherche un arbre h qui minimise

$$\frac{1}{n} \sum_{i=1}^n (f_{m+1}(X_i) - h(X_i))^2.$$

- Si on désigne par

$$U_i = f_{m+1}(X_i) = -\nabla \mathcal{R}_n(g_m)(X_i) = -\frac{\partial}{\partial g(x_i)} \ell(y_i, g(x_i)) \Big|_{g(x_i)=g_{m-1}(x_i)},$$

la solution h_{m+1} s'obtient en ajustant un arbre sur l'échantillon $(X_1, U_1), \dots, (X_n, U_n)$.

- Pour trouver l'arbre le plus proche du gradient f_{m+1} , on cherche un arbre h qui minimise

$$\frac{1}{n} \sum_{i=1}^n (f_{m+1}(X_i) - h(X_i))^2.$$

- Si on désigne par

$$U_i = f_{m+1}(X_i) = -\nabla \mathcal{R}_n(g_m)(X_i) = -\frac{\partial}{\partial g(x_i)} \ell(y_i, g(x_i)) \Big|_{g(x_i)=g_{m-1}(x_i)},$$

la solution h_{m+1} s'obtient en ajustant un arbre sur l'échantillon $(X_1, U_1), \dots, (X_n, U_n)$.

Mise à jour de l'algorithme

$$g_{m+1}(x) = g_m(x) + \lambda h_{m+1}(x).$$

Gradient Boost Algorithm [Friedman, 2001] : FGD

- $d_n = (x_1, y_1), \dots, (x_n, y_n)$ l'échantillon, λ un paramètre de régularisation tel que $0 < \lambda \leq 1$.
 - M le **nombre d'itérations**.
 - paramètres de l'arbre (nombre de coupures...)
1. Initialisation : $g_0(\cdot) = \operatorname{argmin}_c \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n \ell(y_i, c)$
 2. Pour $m = 1$ à M :
 - a) Calculer l'opposé du gradient $-\frac{\partial}{\partial g(x_i)} \ell(y_i, g(x_i))$ et l'évaluer aux points $g_{m-1}(x_i)$:
$$U_i = -\frac{\partial}{\partial g(x_i)} \ell(y_i, g(x_i)) \Big|_{g(x_i)=g_{m-1}(x_i)}, \quad i = 1, \dots, n.$$
 - b) **Ajuster un arbre** sur l'échantillon $(x_1, U_1), \dots, (x_n, U_n)$, on note h_m l'arbre ainsi défini.
 - c) **Mise à jour** : $g_m(x) = g_{m-1}(x) + \lambda h_m(x)$. - 3. **Sortie** : la suite de règles $(g_m(x))_m$.

Commentaires

- Il est facile de voir que chaque règle g_m s'écrit

$$g_m(x) = g_0 + \lambda \sum_{k=1}^m h_k(x)$$

où les h_k sont des arbres binaires.

⇒ ces règles sont donc bien des combinaisons d'arbres.

Commentaires

- Il est facile de voir que chaque règle g_m s'écrit

$$g_m(x) = g_0 + \lambda \sum_{k=1}^m h_k(x)$$

où les h_k sont des arbres binaires.

⇒ ces règles sont donc bien des combinaisons d'arbres.

- Plusieurs paramètres sont à choisir ou à calibrer par l'utilisateur :
 - fonction de perte ℓ ;
 - nombre d'itérations M ;
 - paramètre de régularisation λ ;
 - paramètres de l'arbre (nombre de coupures notamment).

Bagging et forêts aléatoires

Bagging

Forêts aléatoires

Boosting

Algorithmes de gradient boosting

Choix des paramètres

Bibliographie

Choix de la fonction de perte

- La fonction de perte $\ell(y, g(x))$ doit remplir 2 conditions :
 1. mesurer une **erreur** : prendre des valeurs élevées lorsque y est loin de $g(x)$ et faibles dans le cas inverse.
 2. être régulière : notamment **dérivable et convexe** en son second argument.

Choix de la fonction de perte

- La fonction de perte $\ell(y, g(x))$ doit remplir 2 conditions :
 1. mesurer une **erreur** : prendre des valeurs élevées lorsque y est loin de $g(x)$ et faibles dans le cas inverse.
 2. être régulière : notamment **dérivable et convexe** en son second argument.

Exemple

- Classification binaire avec Y dans $\{-1, 1\}$:
 1. $\ell(y, g(x)) = \exp(-yg(x)) \Rightarrow$ **adaboost** ;
 2. $\ell(y, g(x)) = \log(1 + \exp(-2yg(x))) \Rightarrow$ **logitboost** ;

Choix de la fonction de perte

- La fonction de perte $\ell(y, g(x))$ doit remplir 2 conditions :
 1. mesurer une **erreur** : prendre des valeurs élevées lorsque y est loin de $g(x)$ et faibles dans le cas inverse.
 2. être régulière : notamment **dérivable et convexe** en son second argument.

Exemple

- Classification binaire avec Y dans $\{-1, 1\}$:
 1. $\ell(y, g(x)) = \exp(-yg(x)) \Rightarrow$ **adaboost** ;
 2. $\ell(y, g(x)) = \log(1 + \exp(-2yg(x))) \Rightarrow$ **logitboost** ;
- Régression avec Y dans \mathbb{R} : $\ell(y, g(x)) = 0.5(y - g(x))^2 \Rightarrow$ **L_2 -boosting**.

Remarque

- Pour le L_2 -boosting, les U_i de l'étape 2.a de l'algorithme FGD s'écrivent

$$U_i = -\frac{\partial}{\partial g(x_i)} \ell(y_i, g(x_i)) \Big|_{g(x_i)=g_{m-1}(x_i)} = y_i - g_{m-1}(x_i).$$

Remarque

- Pour le L_2 -boosting, les U_i de l'étape 2.a de l'algorithme FGD s'écrivent

$$U_i = -\frac{\partial}{\partial g(x_i)} \ell(y_i, g(x_i)) \Big|_{g(x_i)=g_{m-1}(x_i)} = y_i - g_{m-1}(x_i).$$

- Ces quantités correspondent aux résidus du régresseur à l'étape $m - 1$.

Remarque

- Pour le L_2 -boosting, les U_i de l'étape 2.a de l'algorithme FGD s'écrivent

$$U_i = -\frac{\partial}{\partial g(x_i)} \ell(y_i, g(x_i)) \Big|_{g(x_i)=g_{m-1}(x_i)} = y_i - g_{m-1}(x_i).$$

- Ces quantités correspondent aux résidus du régresseur à l'étape $m - 1$.

Interprétation

- L'estimateur à l'étape m est construit en faisant une régression sur les résidus correspondants à l'estimateur à l'étape $m - 1$.
- On "corrige" g_{m-1} en cherchant à expliquer "l'information restante" qui est contenue dans les résidus.

- L'algorithme L_2 -boosting (simplifié) peut alors s'écrire.

L_2 -boosting - autre version

1. Initialisation g_0 .
2. Pour $m = 1$ à M :
 - a) Calculer les résidus $U_i = y_i - g_{m-1}(x_i)$, $i = 1, \dots, n$.
 - b) Ajuster la règle faible sur $(x_1, U_1), \dots, (x_n, U_n) \Rightarrow h_m$.
 - c) Mise à jour : $g_m(x) = g_{m-1}(x) + \lambda h_m(x)$.

- L'algorithme L_2 -boosting (simplifié) peut alors s'écrire.

L_2 -boosting - autre version

1. Initialisation g_0 .
2. Pour $m = 1$ à M :
 - a) Calculer les résidus $U_i = y_i - g_{m-1}(x_i)$, $i = 1, \dots, n$.
 - b) Ajuster la règle faible sur $(x_1, U_1), \dots, (x_n, U_n) \Rightarrow h_m$.
 - c) Mise à jour : $g_m(x) = g_{m-1}(x) + \lambda h_m(x)$.

Remarque importante [Bühlmann and Yu, 2003,
Bühlmann and Hothorn, 2007, Cornillon et al., 2014]

Il a été montré (sous certaines hypothèses) qu'à chaque itération :

- Le biais **diminue** : $B(g_m) \leq B(g_{m-1})$.
- La variance **augmente** $V(g_m) \geq V(g_{m-1})$.

- L'algorithme L_2 -boosting (simplifié) peut alors s'écrire.

L_2 -boosting - autre version

1. Initialisation g_0 .
2. Pour $m = 1$ à M :
 - a) Calculer les résidus $U_i = y_i - g_{m-1}(x_i)$, $i = 1, \dots, n$.
 - b) Ajuster la règle faible sur $(x_1, U_1), \dots, (x_n, U_n) \Rightarrow h_m$.
 - c) Mise à jour : $g_m(x) = g_{m-1}(x) + \lambda h_m(x)$.

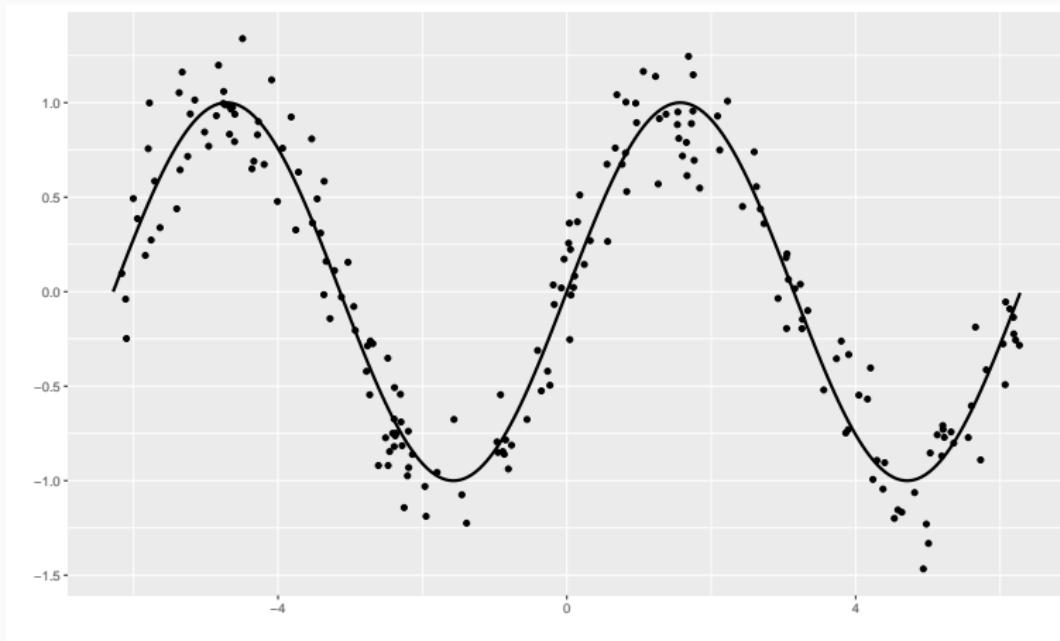
Remarque importante [Bühlmann and Yu, 2003,
Bühlmann and Hothorn, 2007, Cornillon et al., 2014]

Il a été montré (sous certaines hypothèses) qu'à chaque itération :

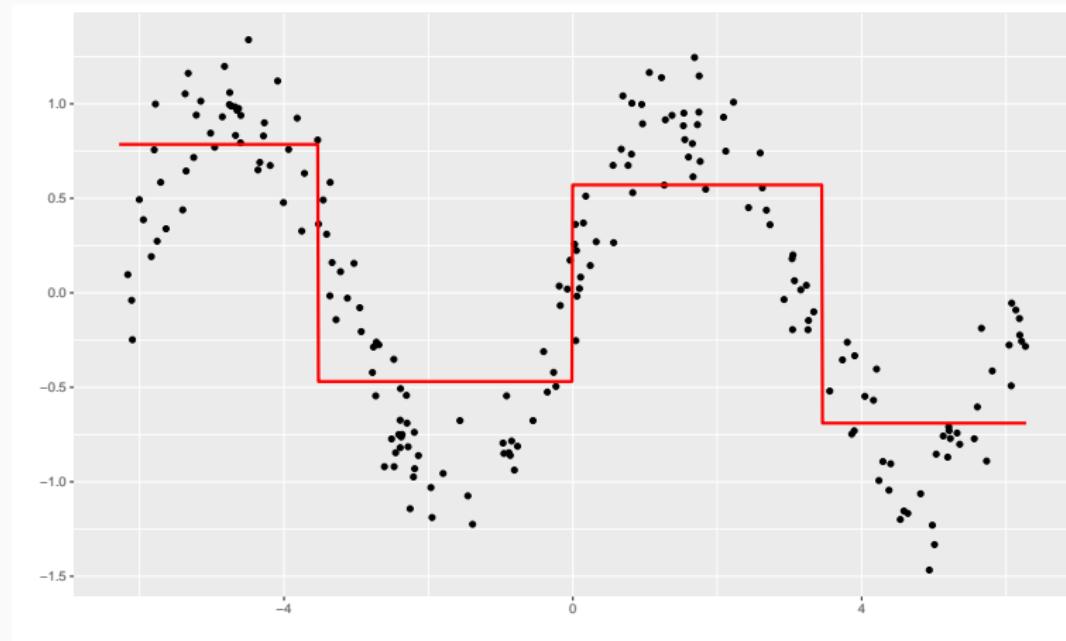
- Le biais **diminue** : $B(g_m) \leq B(g_{m-1})$.
- La variance **augmente** $V(g_m) \geq V(g_{m-1})$.
- D'où l'importance d'utiliser des règles **faibles** : beaucoup de biais et peu de variance (des arbres avec peu de noeuds terminaux par exemple). 199

Illustration

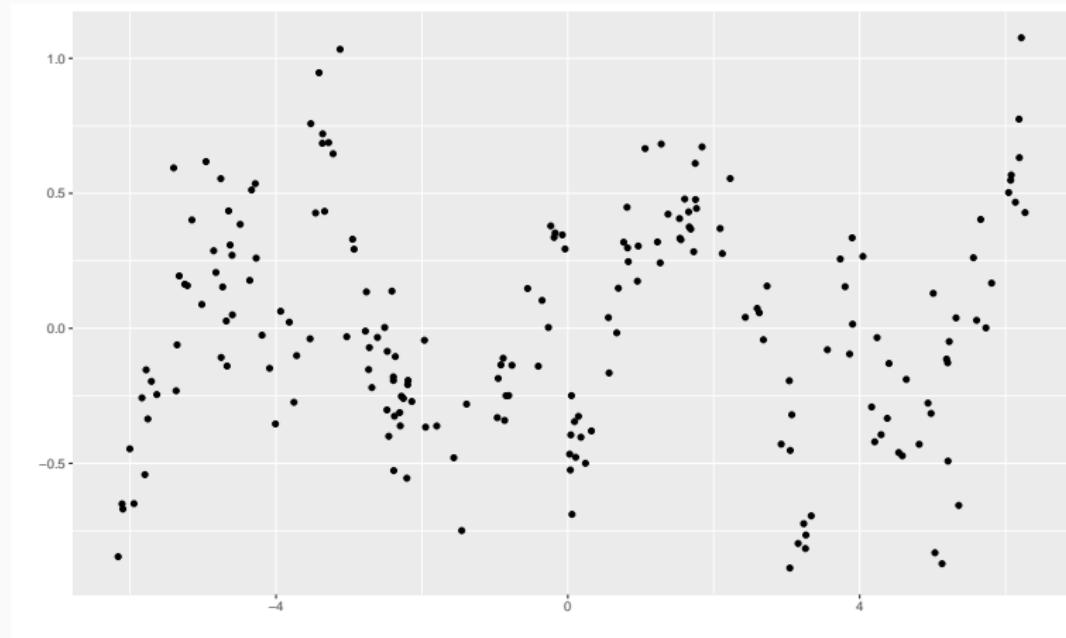
On considère l'échantillon suivant



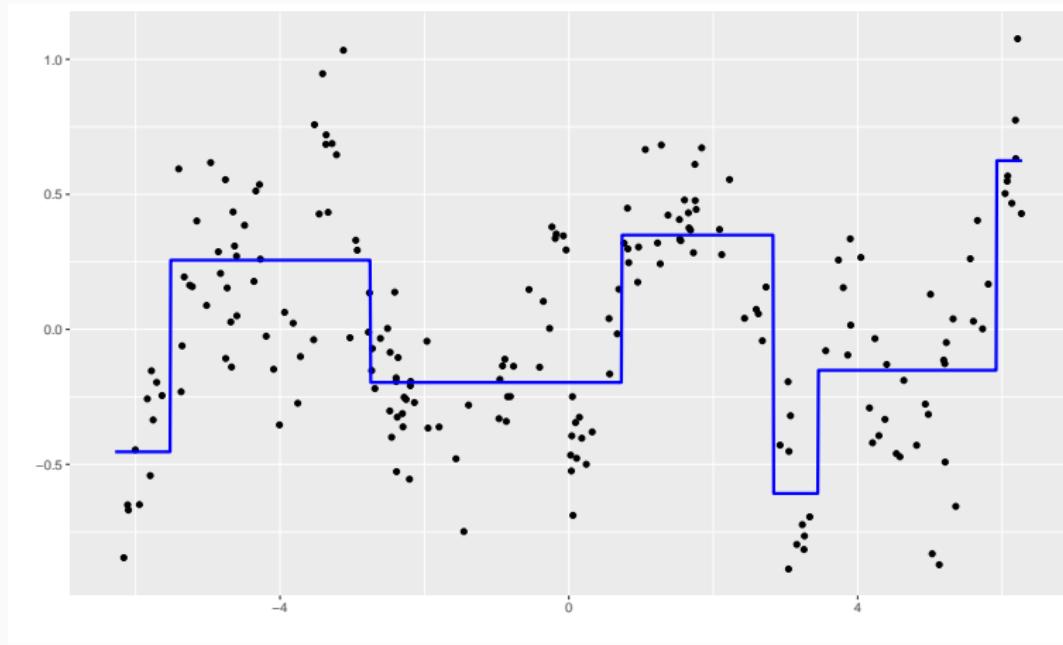
On ajuste un premier arbre simple :



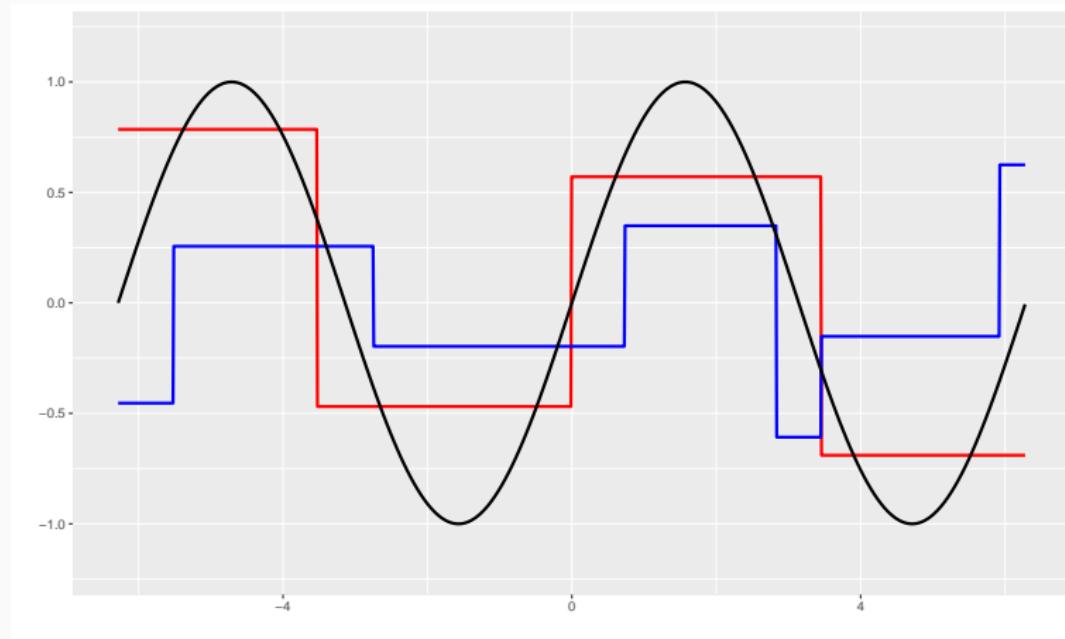
On calcule les résidus :



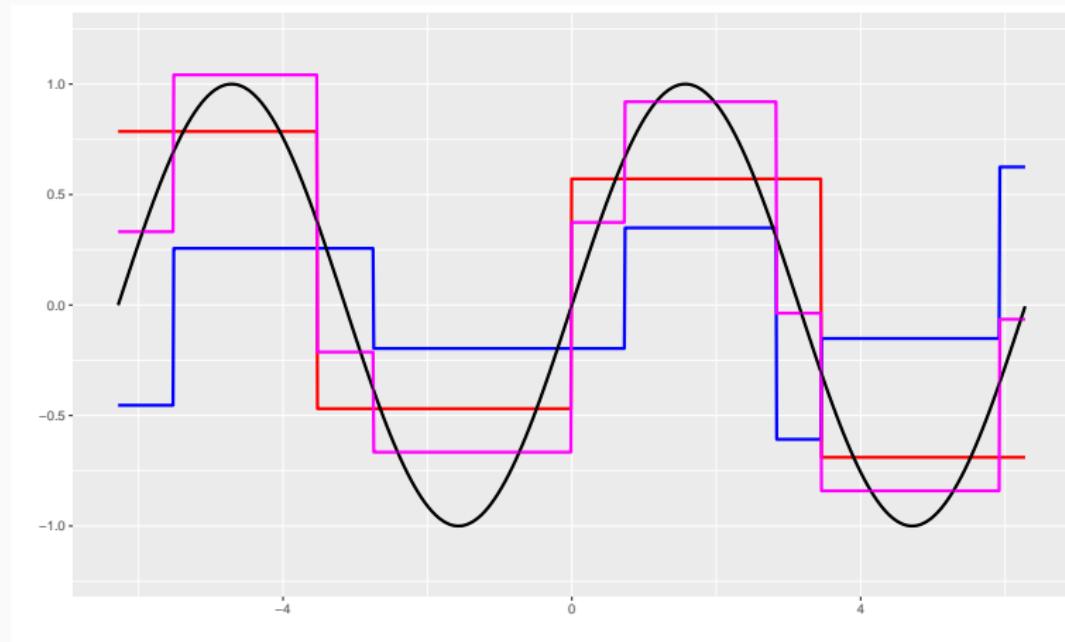
On ajuste un nouvel arbre sur les résidus :



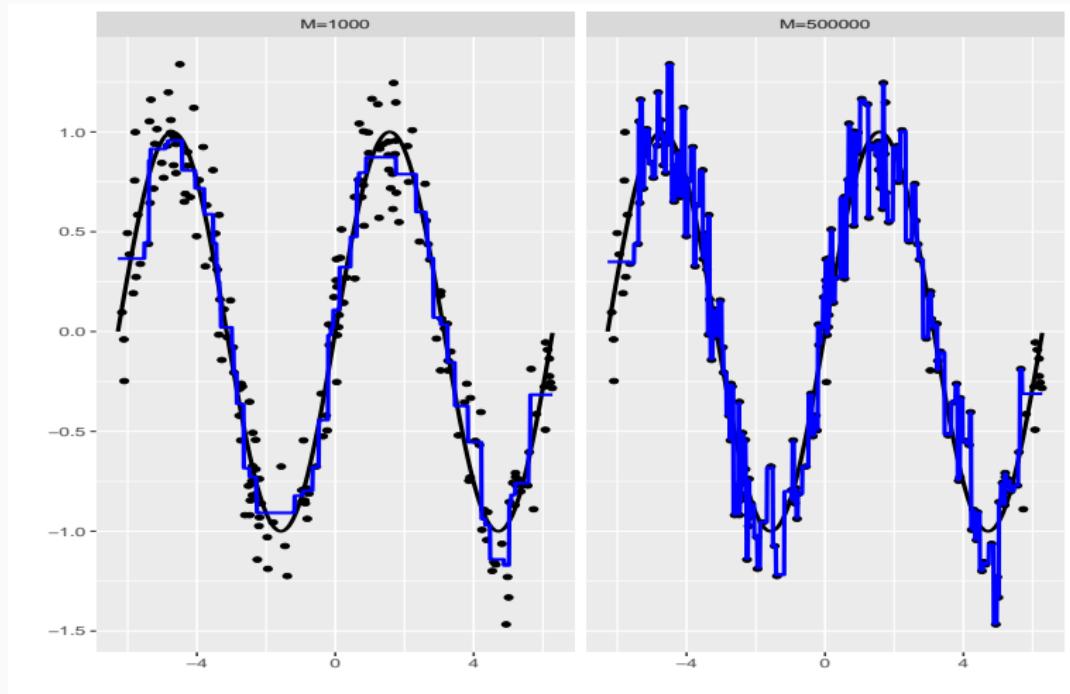
On obtient ainsi 2 arbres :



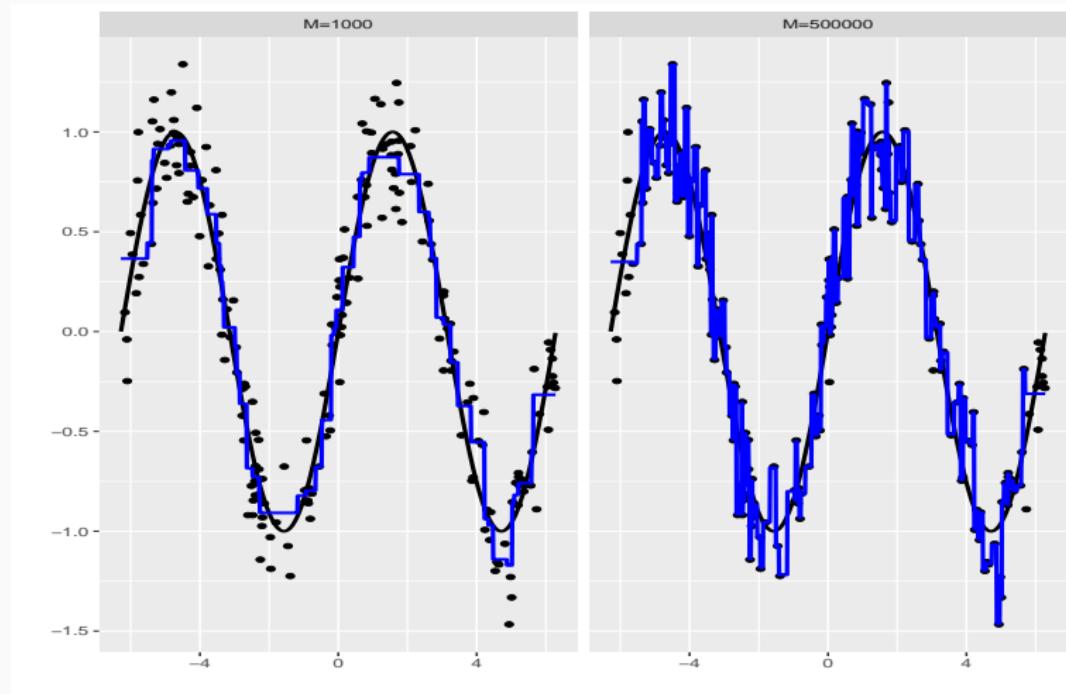
Que l'on ajoute pour déduire un nouvel estimateur (2 itérations)...



- Pour 1,000 et 500,000 itérations, on obtient :



- Pour 1,000 et 500,000 itérations, on obtient :



Remarque importante

L'algorithme sur-ajuste si le nombre d'itérations est (trop) grand.

Choix de m et λ

- Le choix du nombre d'itérations est **crucial** pour les estimateurs boosting.

Choix de m et λ

- Le choix du nombre d'itérations est **crucial** pour les estimateurs boosting.
- Si m est trop **grand** on **sur-ajuste** (estimateurs avec peu de biais mais beaucoup de variance) et réciproquement si m est trop petit.

Choix de m et λ

- Le choix du nombre d'itérations est crucial pour les estimateurs boosting.
- Si m est trop grand on sur-ajuste (estimateurs avec peu de biais mais beaucoup de variance) et réciproquement si m est trop petit.
- Le paramètre de régularisation λ représente le pas de la descente de gradient.
- Ce paramètre est lié à m : un λ grand nécessitera peu d'itérations et réciproquement.

Choix de m et λ

- Le choix du nombre d'itérations est crucial pour les estimateurs boosting.
- Si m est trop grand on sur-ajuste (estimateurs avec peu de biais mais beaucoup de variance) et réciproquement si m est trop petit.
- Le paramètre de régularisation λ représente le pas de la descente de gradient.
- Ce paramètre est lié à m : un λ grand nécessitera peu d'itérations et réciproquement.

En pratique

- On considère 2 ou 3 valeurs (petites) pour λ (0.1, 0.01) ;
- Pour chaque λ , on choisit le meilleur m en utilisant des techniques de type validation croisée.

- L'algorithme étant construit pour une **fonction de perte ℓ** donnée, il est d'usage d'utiliser **la même fonction de perte** pour sélectionner m .
- On va donc chercher le nombre d'itérations qui **minimise la perte** :

$$\hat{m} = \operatorname{argmin}_{m \leq M} \mathbf{E}[\ell(Y, g_m(X))].$$

- L'algorithme étant construit pour une **fonction de perte** ℓ donnée, il est d'usage d'utiliser **la même fonction de perte** pour sélectionner m .
- On va donc chercher le nombre d'itérations qui **minimise la perte** :

$$\hat{m} = \operatorname{argmin}_{m \leq M} \mathbf{E}[\ell(Y, g_m(X))].$$

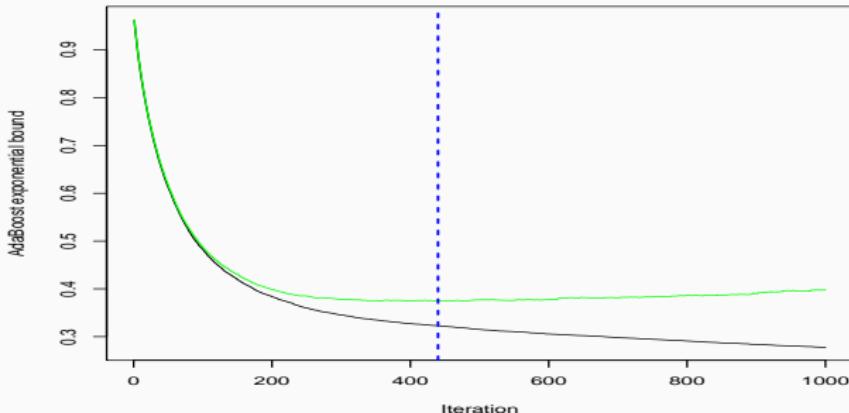
- L'espérance ci-dessus étant **inconnue** en pratique, elle est approchée par des algorithmes de **validation croisée**.

- La fonction `gbm` du package `gbm` [Ridgeway, 2006] permet de faire du gradient boosting. Elle admet notamment comme paramètres :
 1. fonction de perte (`distribution`)
 2. nombre d'itérations maximal M (`n.trees`)
 3. nombre de nœuds terminaux des arbres plus 1 (`interaction.depth`)
 4. paramètre de régularisation λ (`shrinkage`)
 5. paramètres pour la validation croisée (`train.fraction` pour la validation hold out ou `cv.folds` pour la validation croisée).

- La fonction `gbm` du package `gbm` [Ridgeway, 2006] permet de faire du gradient boosting. Elle admet notamment comme paramètres :
 1. fonction de perte (`distribution`)
 2. nombre d'itérations maximal M (`n.trees`)
 3. nombre de nœuds terminaux des arbres plus 1 (`interaction.depth`)
 4. paramètre de régularisation λ (`shrinkage`)
 5. paramètres pour la validation croisée (`train.fraction` pour la validation hold out ou `cv.folds` pour la validation croisée).
- La fonction `gbm.perf` permet de sélectionner le nombre d'itérations.

Exemple

```
> library(gbm)
> set.seed(1234)
> spam1 <- spam
> spam1$type <- as.numeric(spam1$type)-1
> ada <- gbm(type~,data=spam1,distribution="adaboost",cv.folds=5,
+             n.trees=1000,shrinkage=0.05)
> mopt <- gbm.perf(ada)
> mopt
## [1] 440
```



Conclusion

- Les algorithmes **randomforest** et **boosting** agrègent des arbres :

$$\hat{g}_m(x) = \sum_{k=1}^m \alpha_k h_k(x).$$

- Pour être efficace les arbres h_k doivent être des **règles faibles** (**weaklearner**), donc des arbres **peu performants** :

Conclusion

- Les algorithmes **randomforest** et **boosting** agrègent des arbres :

$$\hat{g}_m(x) = \sum_{k=1}^m \alpha_k h_k(x).$$

- Pour être efficace les arbres h_k doivent être des **règles faibles** (**weaklearner**), donc des arbres **peu performants** :
 - **randomforest** : arbres **très profonds** avec beaucoup de variance et peu de biais ;
 - **boosting** : arbres **peu profonds** avec peu de variance et beaucoup de biais.

Conclusion

- Les algorithmes **randomforest** et **boosting** agrègent des arbres :

$$\hat{g}_m(x) = \sum_{k=1}^m \alpha_k h_k(x).$$

- Pour être efficace les arbres h_k doivent être des **règles faibles** (**weaklearner**), donc des arbres **peu performants** :
 - **randomforest** : arbres **très profonds** avec beaucoup de variance et peu de biais ;
 - **boosting** : arbres **peu profonds** avec peu de variance et beaucoup de biais.

Résumé

- Agrégation RF : réduction de **variance** ;
- Agrégation boosting : réduction de **biais**.

Conclusion

- Les algorithmes **randomforest** et **boosting** agrègent des arbres :

$$\hat{g}_m(x) = \sum_{k=1}^m \alpha_k h_k(x).$$

- Pour être efficace les arbres h_k doivent être des **règles faibles** (**weaklearner**), donc des arbres **peu performants** :
 - **randomforest** : arbres **très profonds** avec beaucoup de variance et peu de biais ;
 - **boosting** : arbres **peu profonds** avec peu de variance et beaucoup de biais.

Résumé

- Agrégation RF : réduction de **variance** ;
- Agrégation boosting : réduction de **biais**.
- \Rightarrow Partie 4.2 du tuto

Bagging et forêts aléatoires

Bagging

Forêts aléatoires

Boosting

Algorithmes de gradient boosting

Choix des paramètres

Bibliographie

Références i

-  Aronszajn, N. (1950).
Theory of reproducing kernels.
Transactions of the American Mathematical Society, 68 :337–404.
-  Breiman, L. (1996).
Bagging predictors.
Machine Learning, 26(2) :123–140.
-  Bühlmann, P. and Hothorn, T. (2007).
Boosting algorithms : regularization, prediction and model fitting.
Statistical Science, 22 :477–505.

-  Bühlmann, P. and Yu, B. (2003).
Boosting with the l_2 loss : regression and classification.
Journal of American Statistical Association, 98 :324–339.
-  Cornillon, P., Hengartner, N., and Matzner-Lø ber, E. (2014).
Recursive bias estimation for multivariate regression smoothers.
ESAIM : Probability and Statistics, 18(483-502).
-  Devroye, L. and Krzyżak, A. (1989).
An equivalence theorem for l_1 convergence of the kernel regression estimate.
Journal of statistical Planning Inference, 23 :71–82.

-  Freund, Y. and Schapire, R. (1996).
Experiments with a new boosting algorithm.
In *Proceedings of the Thirteenth International Conference on Machine Learning*.
-  Freund, Y. and Schapire, R. (1997).
A decision-theoretic generalization of online learning and an application to boosting.
Journal of Computer and System Sciences, 55 :119–139.
-  Freund, Y. and Schapire, R. (1999).
A short introduction to boosting.
Journal of Japanese Society for Artificial Intelligence, 14(5) :771–780.

-  Friedman, J. H. (2001).
Greedy function approximation : A gradient boosting machine.
Annals of Statistics, 29 :1189–1232.
-  Fromont, M. (2015).
Apprentissage statistique.
Université Rennes 2, diapos de cours.
-  Genuer, R. (2010).
Forêts aléatoires : aspects théoriques, sélection de variables et applications.
PhD thesis, Université Paris XI.

Références v

-  Györfi, L., Kohler, M., Krzyzak, A., and Harro, W. (2002).
A Distribution-Free Theory of Nonparametric Regression.
Springer.
-  Hastie, T., Tibshirani, R., and Friedman, J. (2009).
The Elements of Statistical Learning : Data Mining, Inference, and Prediction.
Springer, second edition.
-  Ridgeway, G. (2006).
Generalized boosted models : A guide to the gbm package.
-  Stone, C. J. (1977).
Consistent nonparametric regression.
Annals of Statistics, 5 :595–645.

-  Vapnik, V. (2000).
The Nature of Statistical Learning Theory.
Springer, second edition.
-  Vert, J. (2014).
Support vector machines and applications in computational biology.
disponible à l'url <http://cbio.ensmp.fr/~jvert/svn/kernelcourse/slides/kernel2h/kernel2h.pdf>.