

Problèmes inverses et optimisation convexe en traitement du signal et des images

Sandrine Anthoine, Valentin Emiya

M2 IAAA - UE SOAP

1 Introduction et exemples

2 Un problème de déconvolution

3 Résolution par inversion

- Inverser : le calcul
- Inverser : illustration sans et avec bruit

4 Résolution par optimisation

- Formulations
- Optimisation convexe : ISTA

5 Synthèse et conclusion

Sommaire

- 1 Introduction et exemples
- 2 Un problème de déconvolution
- 3 Résolution par inversion
- 4 Résolution par optimisation
- 5 Synthèse et conclusion

Programme de l'UE

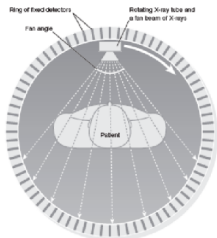
- Bases de traitement du signal (12h) :
 - analyse fréquentielle (Fourier)
 - échantillonnage
 - filtrage
 - représentations
- Calcul scientifique avec JAX (3h)
- **Hybridations avec les problèmes inverses et l'optimisation convexe (8h)**
 - **Problèmes inverses et optimisation convexe : découverte**
problème de déconvolution
algorithme ISTA pour le cas parcimonieux
 - Problèmes inverses et optimisation convexe : approfondissement
 - Hybridation : méthodes Plug-and-Play
 - Hybridation : algorithmes déroulés
- Hybridations avec la physique (4h)

Exemples de problèmes inverses

Projection tomographique

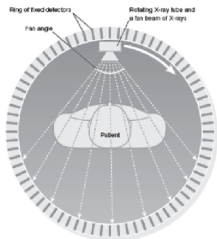
On mesure

On cherche

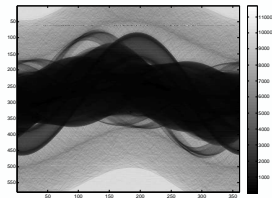


Exemples de problèmes inverses

Projection tomographique



On mesure



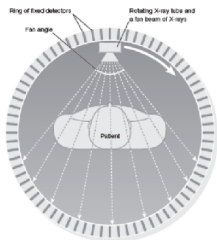
γ

On cherche

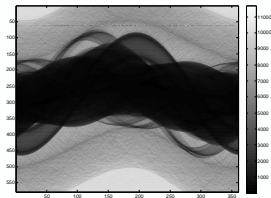
Images : Y. Boursier

Exemples de problèmes inverses

Projection tomographique

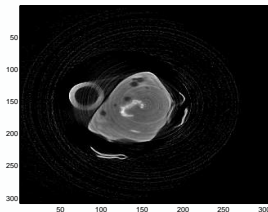


On mesure



y

On cherche



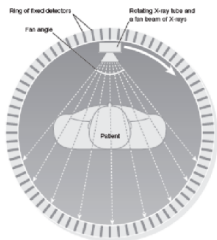
x^0

Images : Y. Boursier

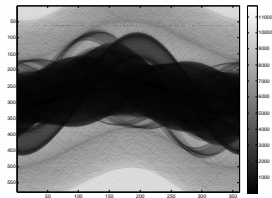
● $y = D_{\sigma}(Ax^0),$

Exemples de problèmes inverses

Projection tomographique

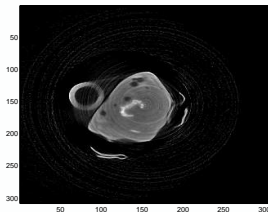


On mesure



y

On cherche



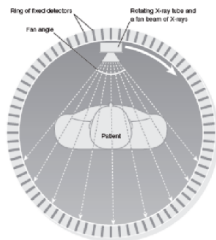
x^0

Images : Y. Boursier

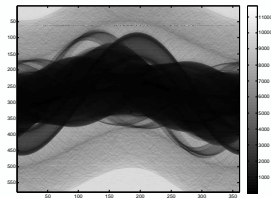
- $y = D_{\sigma}(Ax^0),$
- A opérateur linéaire de projection tomographique

Exemples de problèmes inverses

Projection tomographique

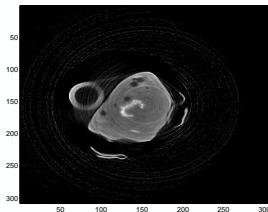


On mesure



y

On cherche



x^0

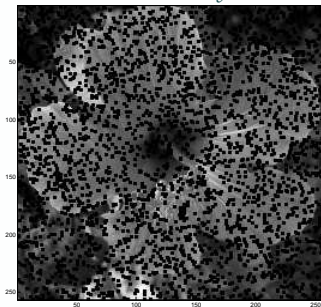
Images : Y. Boursier

- $y = D_\sigma(Ax^0)$,
- A opérateur linéaire de projection tomographique
- D_σ : bruit de Poisson.

Exemples de problèmes inverses

Inpainting

On mesure y

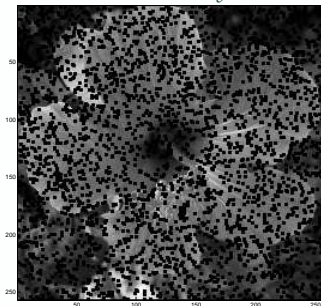


On cherche x^0

Exemples de problèmes inverses

Inpainting

On mesure y



On cherche x^0



- $y = D_\sigma(Ax^0)$,
- A est un masque : $(Ax^0)[i, j] = x^0[i, j]$ ou $(Ax^0)[i, j] = 0$.
- $D_\sigma = \text{Id}$: pas de bruit (ici).

Notion de problème inverse

Résoudre un problème inverse c'est

- estimer un objet x^o
- à partir de mesures indirectes y et
- d'information sur l'opérateur "direct" A qui transforme l'objet en les mesures $y = A(x)$.

On peut étudier les problèmes inverses selon plusieurs points de vue : EDP, statistique...

→ Ici, on étudie les problèmes inverses en traitement du signal et des images.

Notion de problème inverse

Résoudre un problème inverse c'est

- estimer un objet x^o
- à partir de mesures indirectes y et
- d'information sur l'opérateur "direct" A qui transforme l'objet en les mesures $y = A(x)$.

On peut étudier les problèmes inverses selon plusieurs points de vue : EDP, statistique...

→ Ici, on étudie les problèmes inverses en traitement du signal et des images.

Modèle du problème direct :

$$y = D_\sigma(Ax^o)$$

- y : mesures/observations
- x^o : objet à estimer/signal original
- A : opérateur linéaire
- D_σ : perturbation de paramètre σ

Objectif :

Estimer x^o à partir des mesures y , de A et d'informations sur D_σ .

Opérateur A linéaire

A est linéaire si

Soient $y \in \mathbb{R}^N$, $x \in \mathbb{R}^N$, $\alpha \in \mathbb{R}$:

- $A(y + x) = A(y) + A(x)$
- $A(\alpha y) = \alpha A(y)$

Conséquences :

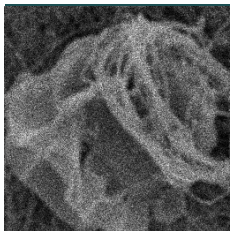
- A peut se représenter par une matrice de $\mathbb{R}^{M \times N}$ (qu'on appelle encore A).
- Si $y = A(x)$ alors
 - $y[i] = \sum_{j=1}^N A[i, j]x[j]$.
 - $A[i, j]$ permet de calculer la contribution du pixel j de l'objet x à la i -ème mesure $y[i]$, c'est $A[i, j]x[j]$.

Sommaire

- 1 Introduction et exemples
- 2 Un problème de déconvolution**
- 3 Résolution par inversion
- 4 Résolution par optimisation
- 5 Synthèse et conclusion

Quel est le problème direct ?

Déconvolution en microscopie

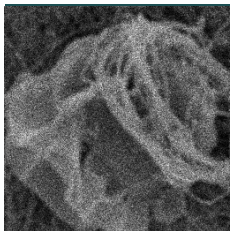
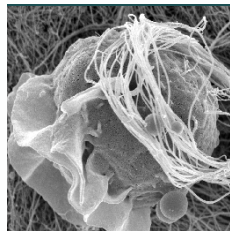


y

Images : C. Chaux

Quel est le problème direct ?

Déconvolution en microscopie

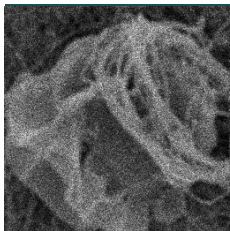
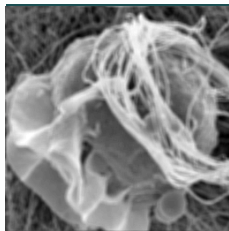
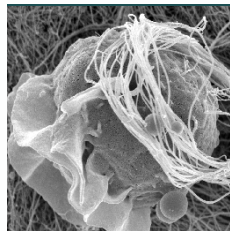
 y  x^0

Images : C. Chaux

- $y = D_{\sigma}(Ax^0)$

Quel est le problème direct ?

Déconvolution en microscopie

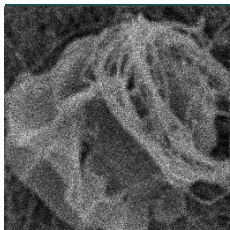
 y  Ax^0  x^0

Images : C. Chaux

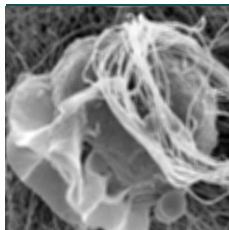
- $y = D_\sigma(Ax^0)$
- $D_\sigma(Ax^0) = Ax^0 + b$: où b bruit gaussien de variance σ^2 .

Quel est le problème direct ?

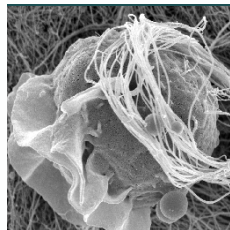
Déconvolution en microscopie



$$y = h \star x^o + b$$



$$Ax^o = h \star x^o$$



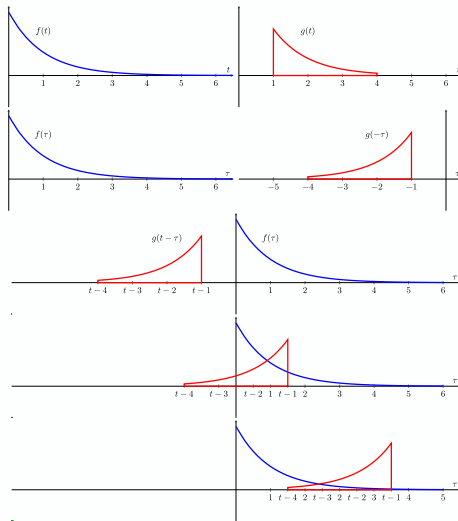
$$x^o$$

Images : C. Chaux

- $y = D_\sigma(Ax^o)$
- $D_\sigma(Ax^o) = Ax^o + b$: où b bruit gaussien de variance σ^2 .
- $Ax^o = h \star x^o$: produit de convolution

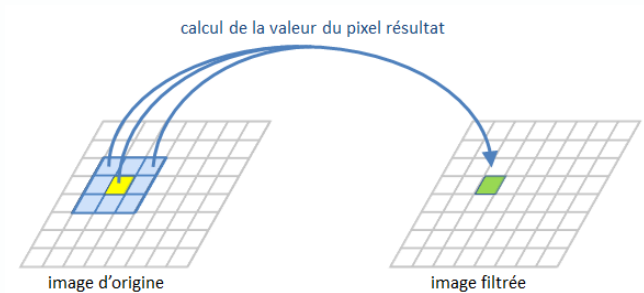
$$(h \star x^o)(s) = \sum_k h[k]x^o[s - k] = \sum_k h[s - k]x^o[k]$$

Rappel : convolution (1D)



[By Krishnavedala - Own work, CC BY-SA 3.0, <https://commons.wikimedia.org/w/index.php?curid=37067808>]

Rappel : convolution 2D



Problème de déconvolution

Modèle direct :

$$y = h \star x^o + b$$

Problème inverse : déconvolution

Comment estimer x^o à partir de y et h ?
Comment inverser le processus de convolution ?

Sommaire

- 1 Introduction et exemples
- 2 Un problème de déconvolution
- 3 **Résolution par inversion**
 - Inverser : le calcul
 - Inverser : illustration sans et avec bruit
- 4 Résolution par optimisation
- 5 Synthèse et conclusion

Sommaire

- 1 Introduction et exemples
- 2 Un problème de déconvolution
- 3 **Résolution par inversion**
 - **Inverser : le calcul**
 - Inverser : illustration sans et avec bruit
- 4 Résolution par optimisation
- 5 Synthèse et conclusion

Déconvolution par inversion

Modèle direct sans bruit : $y = D_\sigma(Ax^o)$ avec A convolution par h et $D_\sigma = I$

$$y = h \star x^o$$

Solution par inversion :

Rappel transformée de Fourier : $\mathcal{F}(h)[k, l] = \sum_{n=0}^{N-1} \sum_{m=0}^{M-1} h[k, l] e^{-\frac{i2\pi kn}{N}} e^{-\frac{i2\pi lm}{M}}$.

$$y = h \star x^o$$

Déconvolution par inversion

Modèle direct sans bruit : $y = D_\sigma(Ax^o)$ avec A convolution par h et $D_\sigma = I$

$$y = h \star x^o$$

Solution par inversion :

Rappel transformée de Fourier : $\mathcal{F}(h)[k, l] = \sum_{n=0}^{N-1} \sum_{m=0}^{M-1} h[k, l] e^{-\frac{i2\pi kn}{N}} e^{-\frac{i2\pi lm}{M}}$.

$$\begin{aligned} y &= h \star x^o \\ \mathcal{F}(y) &= \mathcal{F}(h \star x^o) \\ \mathcal{F}(y) &= \mathcal{F}(h)\mathcal{F}(x^o) \\ \frac{\mathcal{F}(y)}{\mathcal{F}(h)} &= \mathcal{F}(x^o) \quad \text{si } \mathcal{F}(h)[k, l] \neq 0 \\ \mathcal{F}^{-1}\left(\frac{\mathcal{F}(y)}{\mathcal{F}(h)}\right) &= x^o \end{aligned}$$

Conclusion : on me donne y et h , j'estime x définit par $x = \mathcal{F}^{-1}\left(\frac{\mathcal{F}(y)}{\mathcal{F}(h)}\right)$ donc $x = x^o$!

Déconvolution par inversion

Modèle direct sans bruit : $y = D_{\sigma}(Ax^o)$ avec A convolution par h et $D_{\sigma} = I$

$$y = h \star x^o$$

Solution par inversion :

Rappel transformée de Fourier : $\mathcal{F}(h)[k, l] = \sum_{n=0}^{N-1} \sum_{m=0}^{M-1} h[k, l] e^{-\frac{i2\pi kn}{N}} e^{-\frac{i2\pi lm}{M}}$.

$$\begin{aligned} y &= h \star x^o \\ \mathcal{F}(y) &= \mathcal{F}(h \star x^o) \\ \mathcal{F}(y) &= \mathcal{F}(h)\mathcal{F}(x^o) \\ \frac{\mathcal{F}(y)}{\mathcal{F}(h)} &= \mathcal{F}(x^o) \quad \text{si } \mathcal{F}(h)[k, l] \neq 0 \\ \mathcal{F}^{-1}\left(\frac{\mathcal{F}(y)}{\mathcal{F}(h)}\right) &= x^o \end{aligned}$$

Conclusion : on me donne y et h , j'estime x définit par $x = \mathcal{F}^{-1}\left(\frac{\mathcal{F}(y)}{\mathcal{F}(h)}\right)$ donc $x = x^o$!
→ ceci est peut-être trop... simple !

Déconvolution par inversion

Modèle direct sans bruit : $y = D_\sigma(Ax^o)$ avec A convolution par h et $D_\sigma = I$

$$y = h \star x^o$$

Solution par inversion :

Rappel transformée de Fourier : $\mathcal{F}(h)[k, l] = \sum_{n=0}^{N-1} \sum_{m=0}^{M-1} h[k, l] e^{-\frac{i2\pi kn}{N}} e^{-\frac{i2\pi lm}{M}}$.

$$\begin{aligned} y &= h \star x^o \\ \mathcal{F}(y) &= \mathcal{F}(h \star x^o) \\ \mathcal{F}(y) &= \mathcal{F}(h)\mathcal{F}(x^o) \\ \frac{\mathcal{F}(y)}{\mathcal{F}(h)} &= \mathcal{F}(x^o) \quad \text{si } \mathcal{F}(h)[k, l] \neq 0 \\ \mathcal{F}^{-1}\left(\frac{\mathcal{F}(y)}{\mathcal{F}(h)}\right) &= x^o \end{aligned}$$

Conclusion : on me donne y et h , j'estime x défini par $x = \mathcal{F}^{-1}\left(\frac{\mathcal{F}(y)}{\mathcal{F}(h)}\right)$ donc $x = x^o$!
→ ceci est peut-être trop... simple ! Ajoutons du bruit.

Déconvolution par inversion

Modèle direct **bruité** : $y = D_\sigma(Ax^o)$ avec A convolution par h et D_σ **bruit additif gaussien**

$$y = h \star x^o + b$$

avec $(b[k])_k$ variables aléatoires i.i.d gaussiennes centrées ($\sim \mathcal{N}(0, \sigma^2)$).

Solution par inversion :

Rappel transformée de Fourier : $\mathcal{F}(h)[k, l] = \sum_{n=0}^{N-1} \sum_{m=0}^{M-1} h[k, l] e^{-\frac{i2\pi kn}{N}} e^{-\frac{i2\pi lm}{M}}$.

$$\begin{aligned} y &= h \star x^o + b \\ \mathcal{F}(y) &= \mathcal{F}(h \star x^o) + \mathcal{F}(b) \\ \mathcal{F}(y) &= \mathcal{F}(h)\mathcal{F}(x^o) + \mathcal{F}(b) \\ \frac{\mathcal{F}(y)}{\mathcal{F}(h)} &= \mathcal{F}(x^o) + \frac{\mathcal{F}(b)}{\mathcal{F}(h)} \quad \text{si } \mathcal{F}(h)[k, l] \neq 0 \\ \mathcal{F}^{-1}\left(\frac{\mathcal{F}(y)}{\mathcal{F}(h)}\right) &= x^o + \mathcal{F}^{-1}\left(\frac{\mathcal{F}(b)}{\mathcal{F}(h)}\right) \end{aligned}$$

Conclusion : on me donne y et h , j'estime x défini par $x = \mathcal{F}^{-1}\left(\frac{\mathcal{F}(y)}{\mathcal{F}(h)}\right)$ donc
 $x = x^o + \mathcal{F}^{-1}\left(\frac{\mathcal{F}(b)}{\mathcal{F}(h)}\right)!$

Sommaire

- 1 Introduction et exemples
- 2 Un problème de déconvolution
- 3 **Résolution par inversion**
 - Inverser : le calcul
 - **Inverser : illustration sans et avec bruit**
- 4 Résolution par optimisation
- 5 Synthèse et conclusion

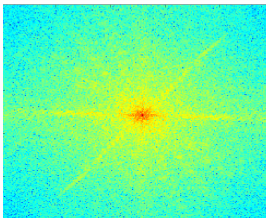
Les effets de la convolution

h est un “filtre gaussien” ($\sigma = 10$)

Image originale x^0



$$X^o = \mathcal{F}(x^o)$$



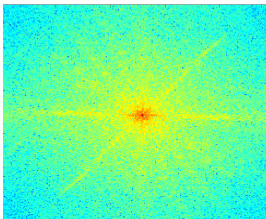
Les effets de la convolution

h est un “filtre gaussien” ($\sigma = 10$)

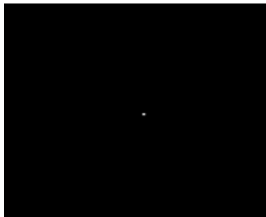
Image originale x^0



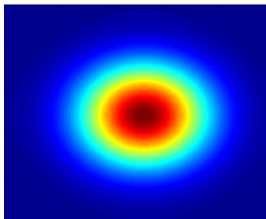
$$X^0 = \mathcal{F}(x^0)$$



Filtre h



$$\times H$$



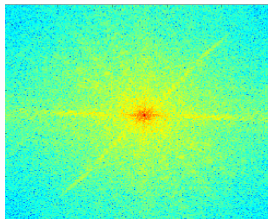
Les effets de la convolution

h est un "filtre gaussien" ($\sigma = 10$)

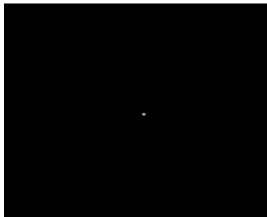
x^0



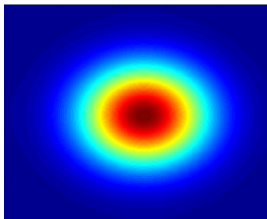
$X^0 = \mathcal{F}(x^0)$



$\star h$



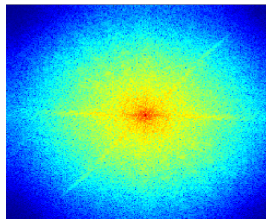
$\times H$



mesure $y = h \star x^0$



$Y = H \times X^0$



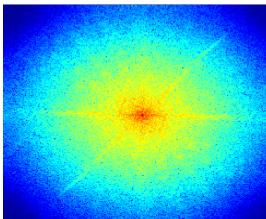
Déconvolution

Inversion du filtre : sans bruit, reconstruction parfaite

Image mesurée $y = h \star x^0$



y



Déconvolution

Inversion du filtre : sans bruit, reconstruction parfaite

Image mesurée $y = h \star x^0$

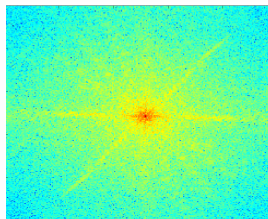
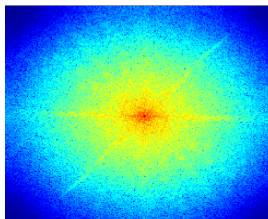


Y

Reconstruction



Y/H



Déconvolution

Inversion du filtre : sans bruit, reconstruction parfaite

Image mesurée $y = h \star x^0$



y

Reconstruction

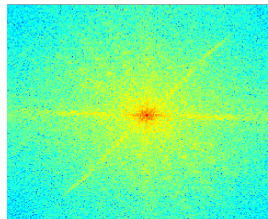
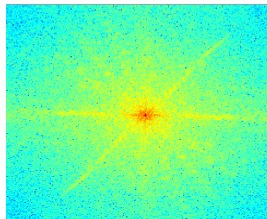
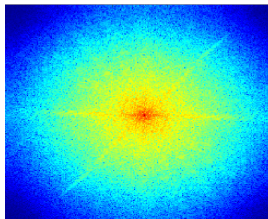


y/H

Image originale x^0



x^0



Déconvolution

Inversion du filtre : effet du bruit ($b \sim \mathcal{N}(0, 10)$)

$$y = h \star x^0 + b$$



$$Y = H \times X^0 + B$$

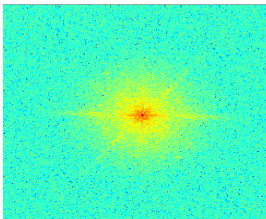
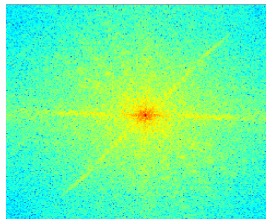


Image originale x^0



X^0



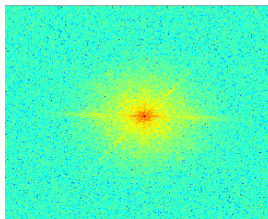
Déconvolution

Inversion du filtre : effet du bruit ($b \sim \mathcal{N}(0, 10)$)

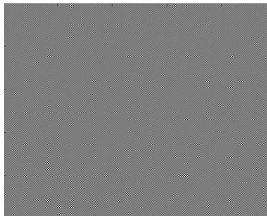
$$y = h \star x^0 + b$$



$$Y = H \times X^0 + B$$



$$\text{Résultat : } x = \mathcal{F}^{-1}\left(\frac{Y}{H}\right)$$



$$\frac{Y}{H} = X^0 + B/H$$

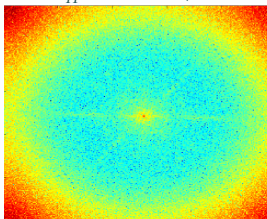
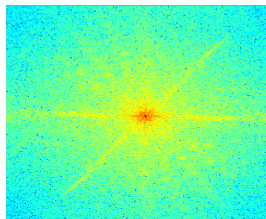


Image originale x^0



$$X^0$$



Inversion de l'opérateur A

$$y = h \star x^o$$

ou plus généralement

$$y = Ax^o$$

A^{-1} peut exister mais

- être difficile à calculer
- amener à des erreurs numériques...

Inversion de l'opérateur A

$$y = h \star x^o$$

ou plus généralement

$$y = Ax^o$$

A^{-1} peut exister mais

- être difficile à calculer
- amener à des erreurs numériques...

$$y = Ax^o + b$$

Le bruit sur les mesures apporte une source d'instabilité supplémentaire : plus A est mal-conditionnée, plus l'instabilité est grande et le résultat mauvais.

Sommaire

- 1 Introduction et exemples
- 2 Un problème de déconvolution
- 3 Résolution par inversion
- 4 Résolution par optimisation
 - Formulations
 - Optimisation convexe : ISTA
- 5 Synthèse et conclusion

Sommaire

- 1 Introduction et exemples
- 2 Un problème de déconvolution
- 3 Résolution par inversion
- 4 Résolution par optimisation**
 - Formulations
 - Optimisation convexe : ISTA
- 5 Synthèse et conclusion

Résolution par optimisation

Modèle direct avec bruit additif gaussien

$$y = Ax^0 + b$$

Problème inverse

$$\arg \min_x \|Ax - y\|_2^2 + R(x)$$

avec R régularisation choisie en fonction du problème

Remarque

- si A est inversive et $R = 0$, on trouve la solution par inversion
- si $R = 0$ et A pas inversible, quelle est la solution ?

Résolution par optimisation

Modèle direct avec bruit additif gaussien

$$y = Ax^0 + b$$

Problème inverse

$$\arg \min_x \|Ax - y\|_2^2 + R(x)$$

avec R régularisation choisie en fonction du problème

Remarque

- si A est inversive et $R = 0$, on trouve la solution par inversion
- si $R = 0$ et A pas inversible, quelle est la solution ?

$$x = A^+ y = (A^T A)^{-1} A^T y$$

(A^+ pseudo-inverse de A)

même problème d'instabilité que pour l'inversion

Résolution par optimisation

Modèle direct avec bruit additif gaussien

$$y = Ax^0 + b$$

Problème inverse

$$\arg \min_x \|Ax - y\|_2^2 + R(x)$$

avec R régularisation choisie en fonction du problème

Remarque

- si A est inversive et $R = 0$, on trouve la solution par inversion
- si $R = 0$ et A pas inversible, quelle est la solution ?

$$x = A^+ y = (A^T A)^{-1} A^T y$$

(A^+ pseudo-inverse de A)

même problème d'instabilité que pour l'inversion

- si $R \neq 0$, on régularise : solution plus stable

Exemples de problème inverse avec régularisation

Modèle direct avec bruit additif gaussien

$$y = Ax^0 + b$$

Exemple 1 : problème inverse avec régularisation de Tikhonov

$$\arg \min_x \|Ax - y\|_2^2 + \lambda \|x\|_2^2 \text{ avec } \lambda > 0$$

Vous reconnaissez...

Exemples de problème inverse avec régularisation

Modèle direct avec bruit additif gaussien

$$y = Ax^0 + b$$

Exemple 1 : problème inverse avec régularisation de Tikhonov

$$\arg \min_x \|Ax - y\|_2^2 + \lambda \|x\|_2^2 \text{ avec } \lambda > 0$$

Vous reconnaissez...

quoi ?

Exemples de problème inverse avec régularisation

Modèle direct avec bruit additif gaussien

$$y = Ax^0 + b$$

Exemple 1 : problème inverse avec régularisation de Tikhonov

$$\arg \min_x \|Ax - y\|_2^2 + \lambda \|x\|_2^2 \text{ avec } \lambda > 0$$

Vous reconnaissez...

Ridge regression !

Exemples de problème inverse avec régularisation

Modèle direct avec bruit additif gaussien

$$y = Ax^0 + b$$

Exemple 1 : problème inverse avec régularisation de Tikhonov

$$\arg \min_x \|Ax - y\|_2^2 + \lambda \|x\|_2^2 \text{ avec } \lambda > 0$$

Vous reconnaissez...

Ridge regression !

Intérêt ?

Exemples de problème inverse avec régularisation

Modèle direct avec bruit additif gaussien

$$y = Ax^0 + b$$

Exemple 1 : problème inverse avec régularisation de Tikhonov

$$\arg \min_x \|Ax - y\|_2^2 + \lambda \|x\|_2^2 \text{ avec } \lambda > 0$$

Vous reconnaissez...

Ridge regression !

Intérêt ?

Contrainte sur la norme l_2 de la solution.

Solution ?

Exemples de problème inverse avec régularisation

Modèle direct avec bruit additif gaussien

$$y = Ax^0 + b$$

Exemple 1 : problème inverse avec régularisation de Tikhonov

$$\arg \min_x \|Ax - y\|_2^2 + \lambda \|x\|_2^2 \text{ avec } \lambda > 0$$

Vous reconnaissez...

Ridge regression !

Intérêt?

Contrainte sur la norme l_2 de la solution.

Solution?

$$x = \left(A^T A + \lambda I \right)^{-1} A^T y$$

Exemples de problème inverse avec régularisation

Modèle direct avec bruit additif gaussien

$$y = Ax^0 + b$$

Exemple 2 : problème inverse avec régularisation parcimonieuse

$$\arg \min_x \|Ax - y\|_2^2 + \lambda \|x\|_1 \text{ avec } \lambda > 0$$

Vous reconnaissez...

Exemples de problème inverse avec régularisation

Modèle direct avec bruit additif gaussien

$$y = Ax^0 + b$$

Exemple 2 : problème inverse avec régularisation parcimonieuse

$$\arg \min_x \|Ax - y\|_2^2 + \lambda \|x\|_1 \text{ avec } \lambda > 0$$

Vous reconnaissez...

quoi ?

Exemples de problème inverse avec régularisation

Modèle direct avec bruit additif gaussien

$$y = Ax^0 + b$$

Exemple 2 : problème inverse avec régularisation parcimonieuse

$$\arg \min_x \|Ax - y\|_2^2 + \lambda \|x\|_1 \text{ avec } \lambda > 0$$

Vous reconnaissez...

Lasso!

Exemples de problème inverse avec régularisation

Modèle direct avec bruit additif gaussien

$$y = Ax^0 + b$$

Exemple 2 : problème inverse avec régularisation parcimonieuse

$$\arg \min_x \|Ax - y\|_2^2 + \lambda \|x\|_1 \text{ avec } \lambda > 0$$

Vous reconnaissez...

Lasso!

Intérêt?

Exemples de problème inverse avec régularisation

Modèle direct avec bruit additif gaussien

$$y = Ax^0 + b$$

Exemple 2 : problème inverse avec régularisation parcimonieuse

$$\arg \min_x \|Ax - y\|_2^2 + \lambda \|x\|_1 \text{ avec } \lambda > 0$$

Vous reconnaissez...

Lasso!

Intérêt?

Solution avec un faible nombre de valeurs non-nulles et beaucoup de zéros (parcimonie).

Solution?

Exemples de problème inverse avec régularisation

Modèle direct avec bruit additif gaussien

$$y = Ax^0 + b$$

Exemple 2 : problème inverse avec régularisation parcimonieuse

$$\arg \min_x \|Ax - y\|_2^2 + \lambda \|x\|_1 \text{ avec } \lambda > 0$$

Vous reconnaissez...

Lasso!

Intérêt?

Solution avec un faible nombre de valeurs non-nulles et beaucoup de zéros (parcimonie).

Solution?

Pas de solution analytique

Exemples de problème inverse avec régularisation

Modèle direct avec bruit additif gaussien

$$y = Ax^0 + b$$

Exemple 2 : problème inverse avec régularisation parcimonieuse

$$\arg \min_x \|Ax - y\|_2^2 + \lambda \|x\|_1 \text{ avec } \lambda > 0$$

Vous reconnaissez...

Lasso!

Intérêt?

Solution avec un faible nombre de valeurs non-nulles et beaucoup de zéros (parcimonie).

Solution?

Pas de solution analytique

Pas de descente de gradient : $\|x\|_1$ non différentiable

Exemples de problème inverse avec régularisation

Modèle direct avec bruit additif gaussien

$$y = Ax^0 + b$$

Exemple 2 : problème inverse avec régularisation parcimonieuse

$$\arg \min_x \|Ax - y\|_2^2 + \lambda \|x\|_1 \text{ avec } \lambda > 0$$

Vous reconnaissez...

Lasso!

Intérêt?

Solution avec un faible nombre de valeurs non-nulles et beaucoup de zéros (parcimonie).

Solution?

Pas de solution analytique

Pas de descente de gradient : $\|x\|_1$ non différentiable

Quel(s) algorithm(e)s ?

Sommaire

- 1 Introduction et exemples
- 2 Un problème de déconvolution
- 3 Résolution par inversion
- 4 Résolution par optimisation
 - Formulations
 - Optimisation convexe : ISTA
- 5 Synthèse et conclusion

Comment résoudre le Lasso ?

Problème d'optimisation :

$$\arg \min_x \|Ax - y\|_2^2 + \lambda \|x\|_1 \text{ avec } \lambda > 0$$

- Fonction non différentiable à cause de $\|x\|_1$, $|\cdot|$ étant non-différentiable en 0.
 - Mais **fonction convexe** : pas de minima locaux, on peut *facilement* descendre vers un minimum global.
- **Optimisation convexe**, nombreux algorithmes efficaces reposant sur la notion de sous-gradient et d'opérateur proximal.
- Ici, l'opérateur proximal associé à $\lambda |\cdot|$ est le seuillage doux.

Iterative Soft Thresholding Algorithm (ISTA) pour résoudre le Lasso

Problème d'optimisation :

$$\arg \min_x \|Ax - y\|_2^2 + \lambda \|x\|_1 \text{ avec } \lambda > 0$$

Algorithme 1 ISTA

Entrées: $A \in \mathbb{R}^{N \times M}$, $y \in \mathbb{R}^N$, $\lambda > 0$,

$\eta > 0$, N_{iter}

1: $x \leftarrow 0_M$

2: **pour** $i = 0 \dots N_{\text{iter}} - 1$ **faire**

3: $u \leftarrow x - 2\eta A^T (Ax - y)$

4: $x \leftarrow S_{\lambda\eta}(u)$

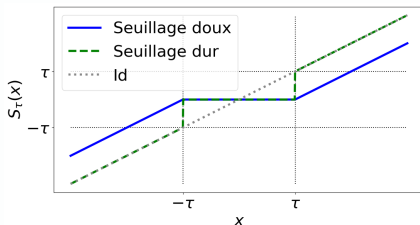
5: **fin pour**

Sorties: x

Alternance entre

- une étape de descente de gradient sur le terme $\|Ax - y\|_2^2$ (l. 3)
- une étape de seuillage doux (l. 4) avec la fonction de seuillage doux de seuil τ

$$S_\tau(x) = \text{sign}(x) \max(0, |x| - \tau)$$



Sommaire

- 1 Introduction et exemples
- 2 Un problème de déconvolution
- 3 Résolution par inversion
- 4 Résolution par optimisation
- 5 Synthèse et conclusion**

Synthèse

- On s'intéresse à **inverser un modèle direct** de la forme $y = D_\sigma(Ax^o)$ avec un opérateur linéaire connu A et une dégradation D_σ .

Cas particulier aujourd'hui :

$A \equiv$ convolution par h ,

$D_\sigma \equiv$ bruit additif gaussien,

x^o parcimonieux.

- Formulation via un problème d'optimisation régularisé
- Résolution par méthode d'optimisation convexe

Lasso

ISTA

La suite :

- TP : mise en œuvre du cas particulier ci-dessus
- Prochaine séance : cas général
opérateurs, bruits, régularisations, 2D/image, applications, algos
- Ensuite : approches hybrides optimisation/apprentissage.