

# Apprentissage Automatique

## k-NN, Arbres de décision & méthodes ensemblistes

**S. Herbin**

[stephane.herbin@onera.fr](mailto:stephane.herbin@onera.fr)

## Rappel du dernier cours

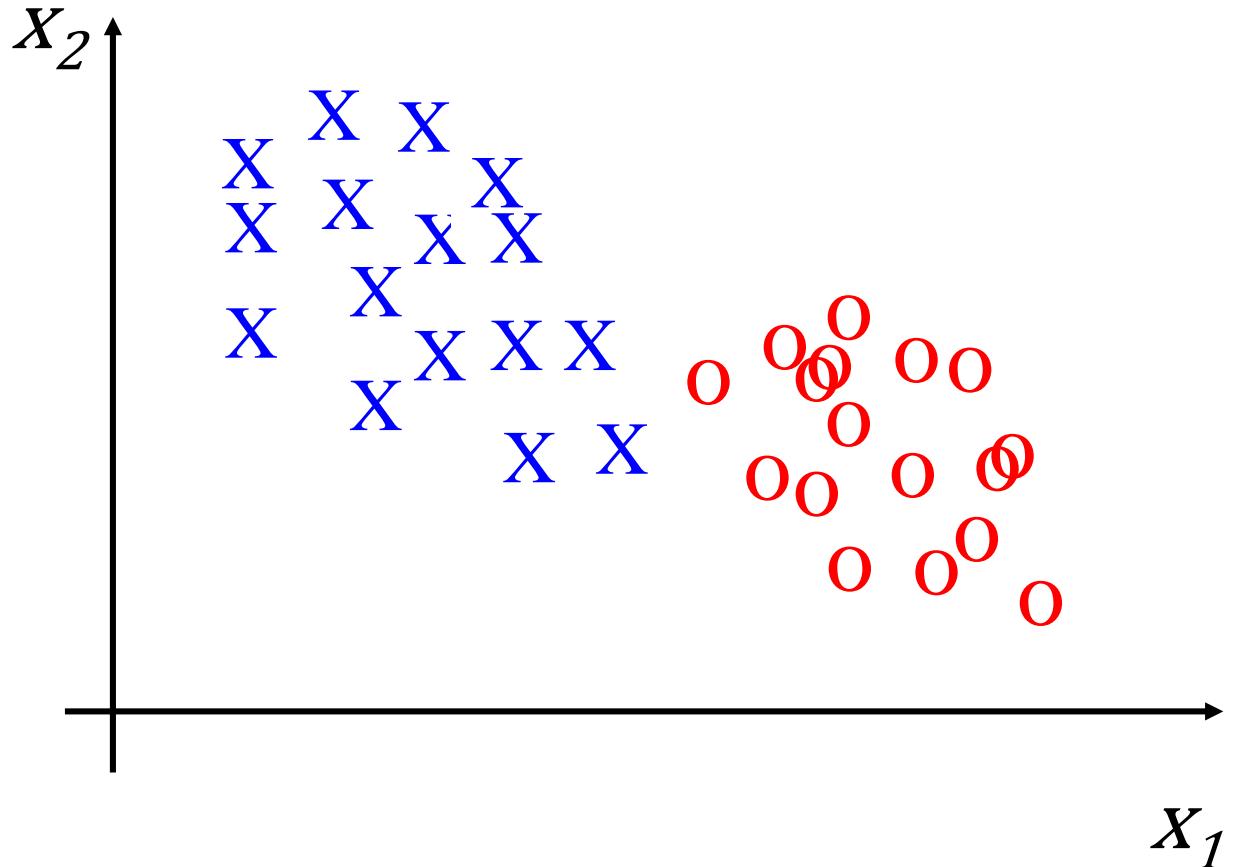
- ▶ Principes généraux d'apprentissage : données apprentissage/validation/test, optimisation, évaluation
- ▶ Deux familles d'algorithmes élémentaires de *classification supervisée* : classifieur Bayésien et discrimination linéaire.

## Objectifs de ce cours

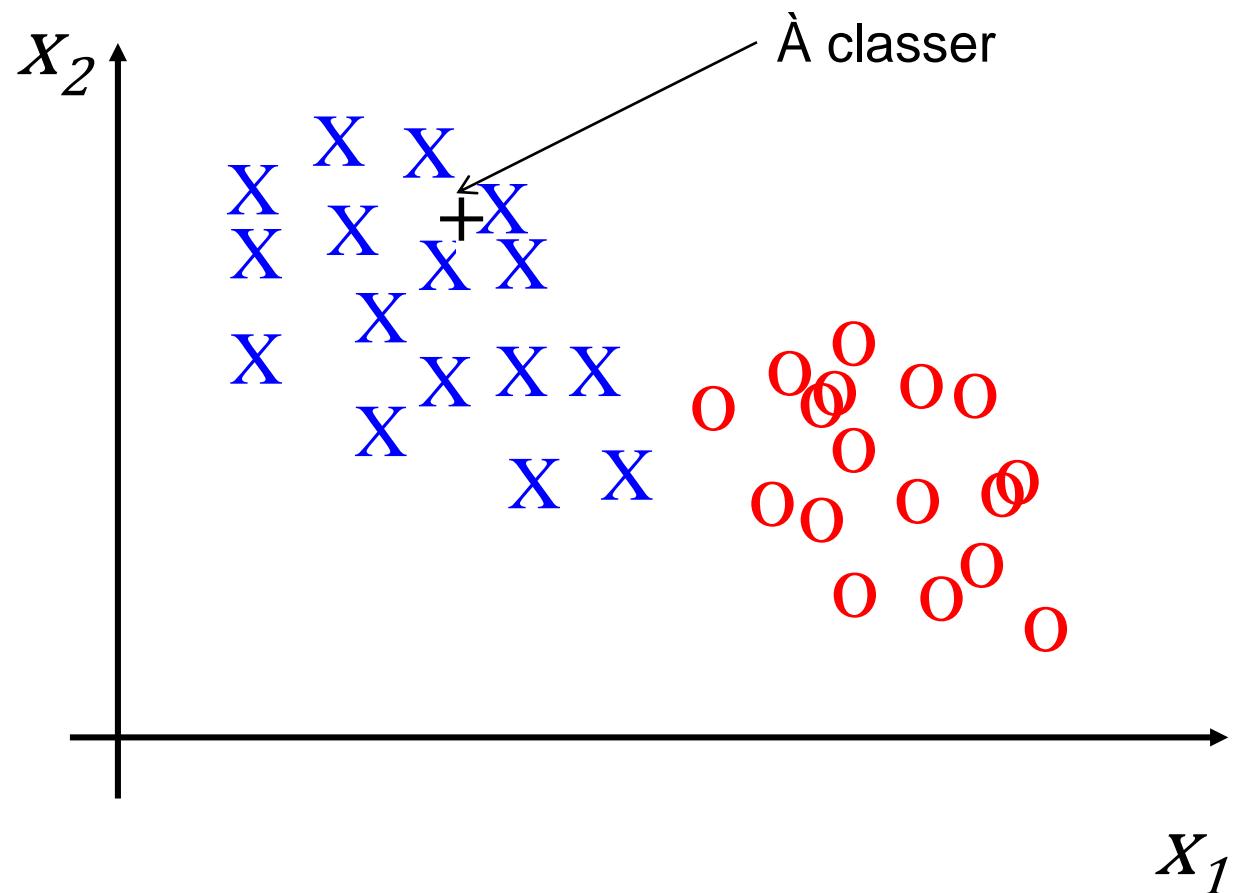
- ▶ Deux nouveaux algorithmes : plus proches voisins et arbre de décision
- ▶ Une stratégie de conception : les approches ensemblistes  
Intuition : « un groupe prend plus souvent des décisions plus sages qu'un individu »

## Plus proches voisins

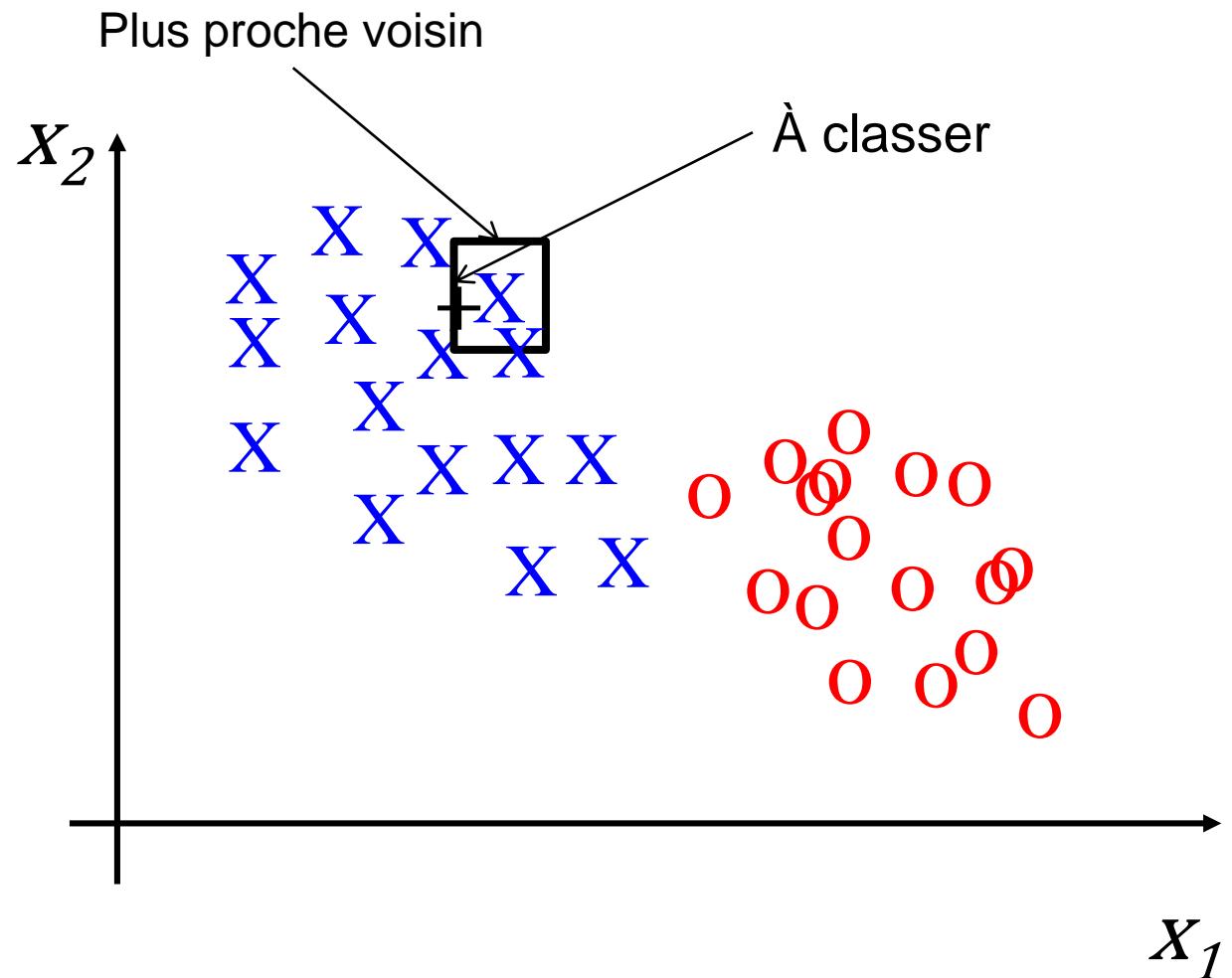
# Classification ppv



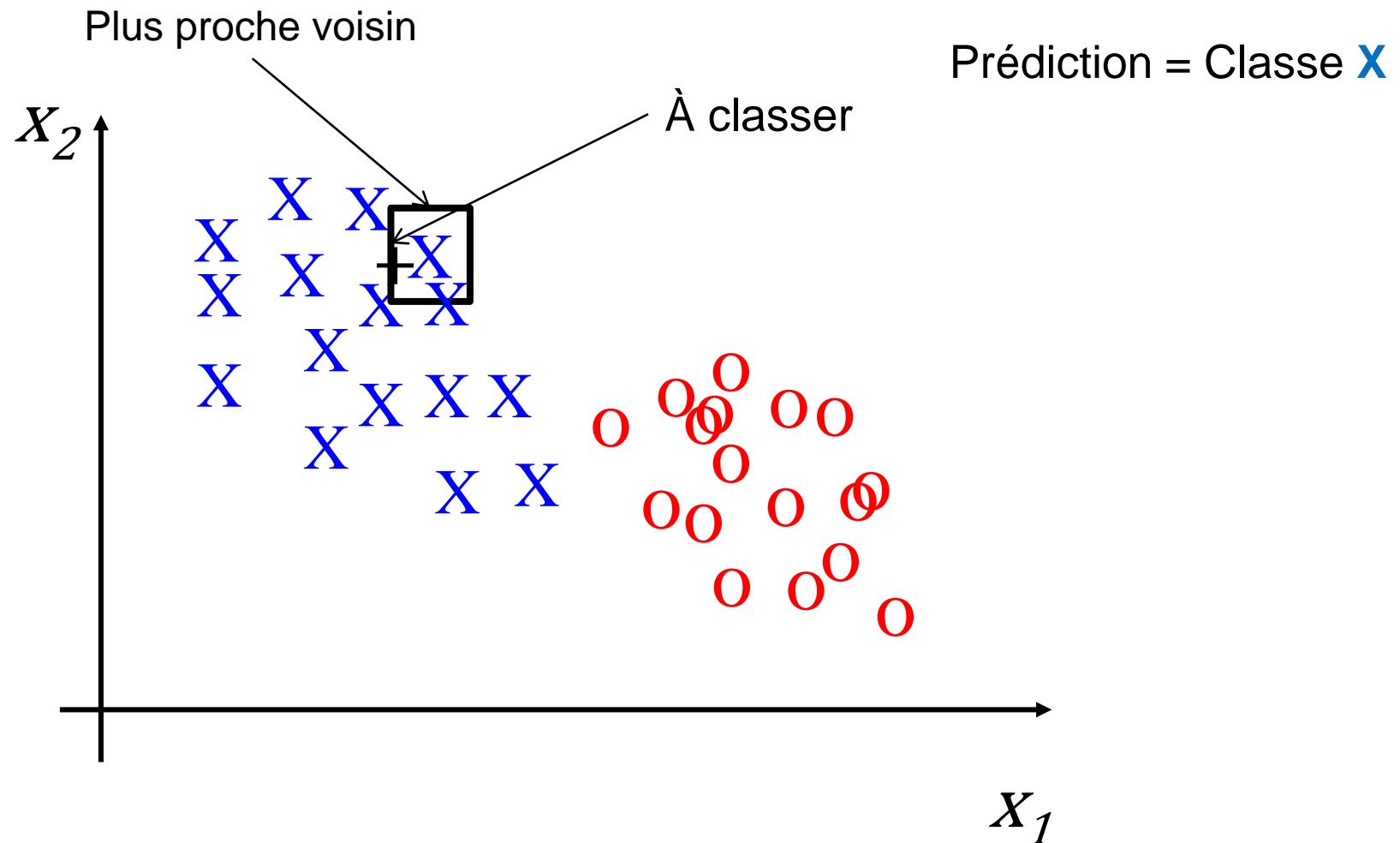
# Classification ppv



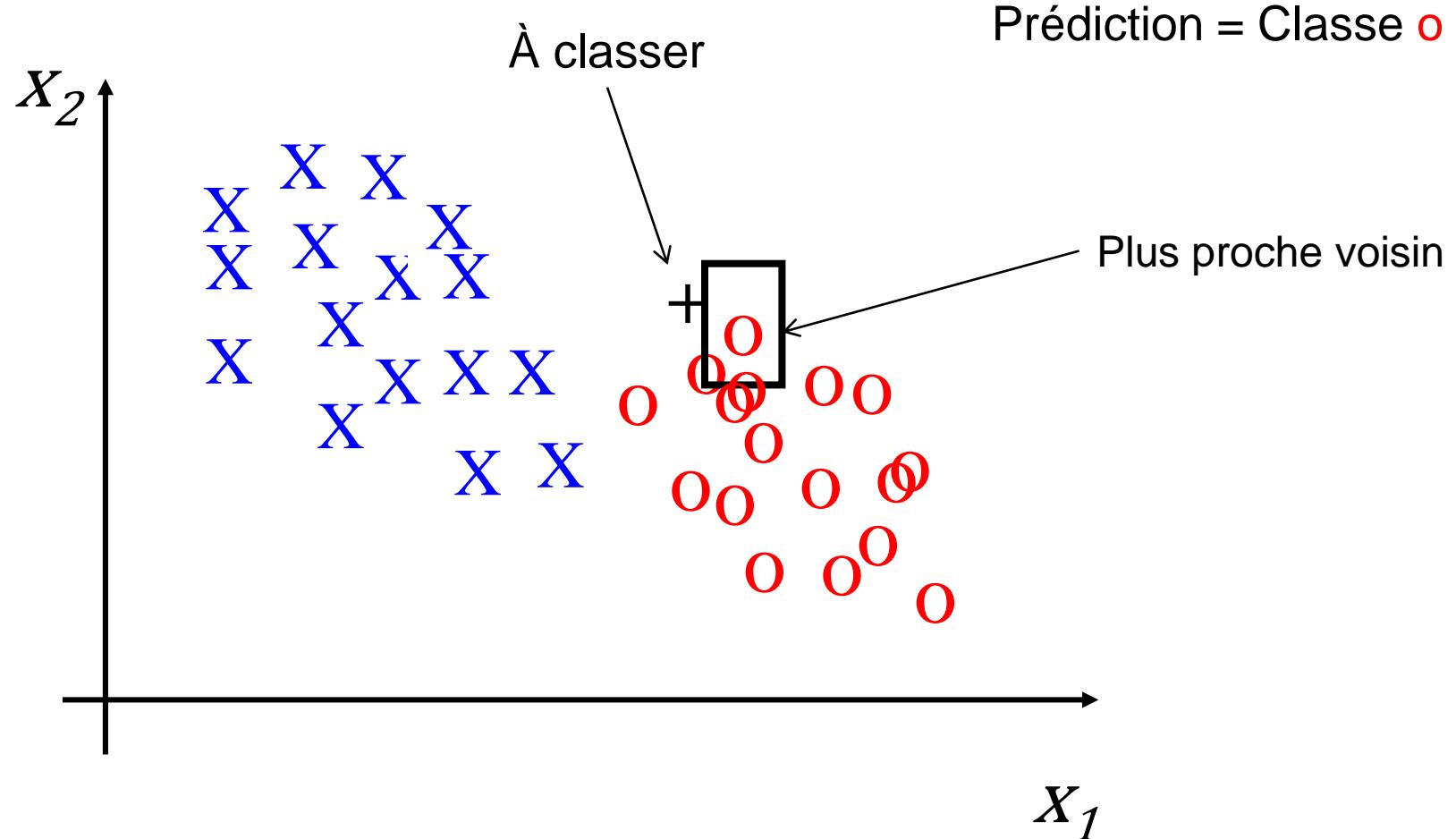
# Classification ppv



# Classification ppv



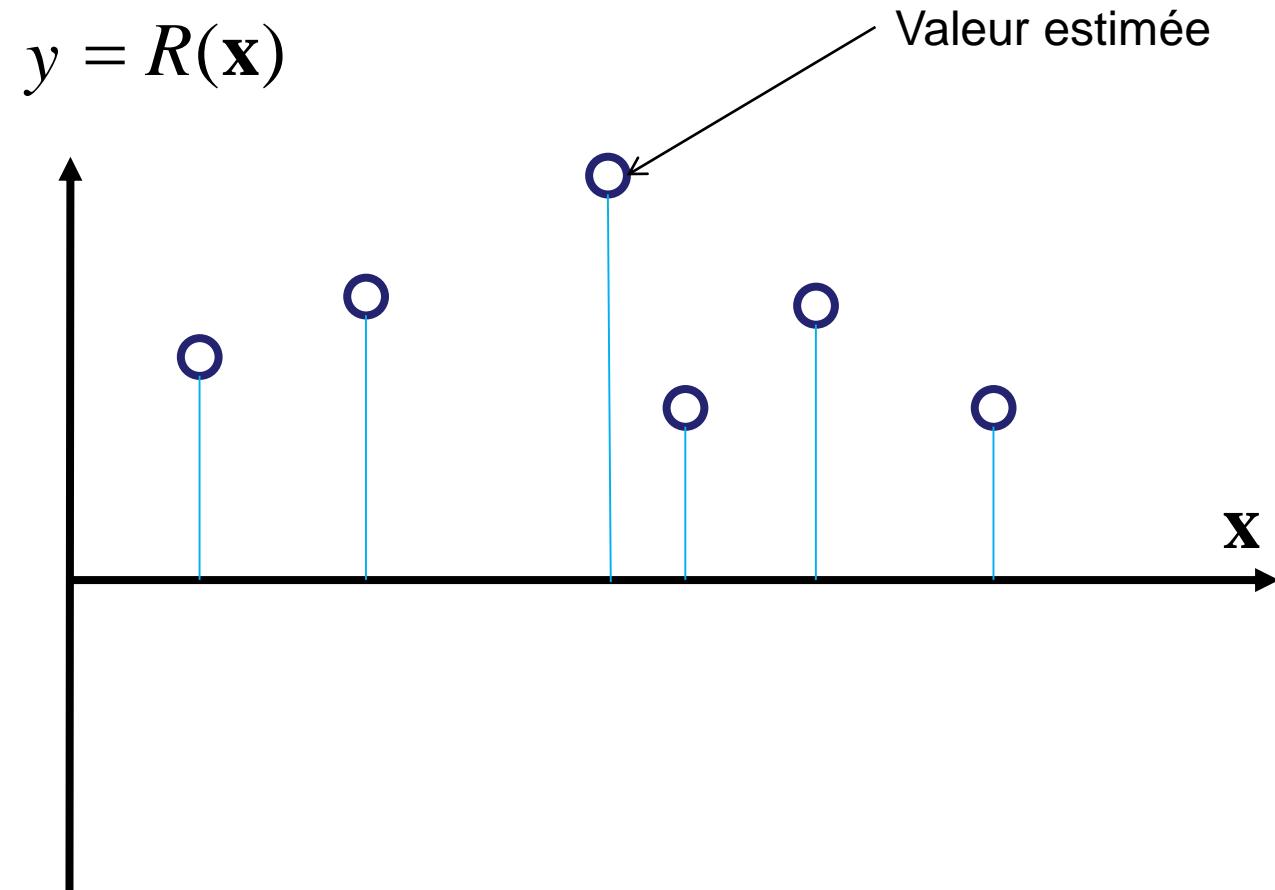
# Classification ppv



# Plus proche(s) voisin(s)

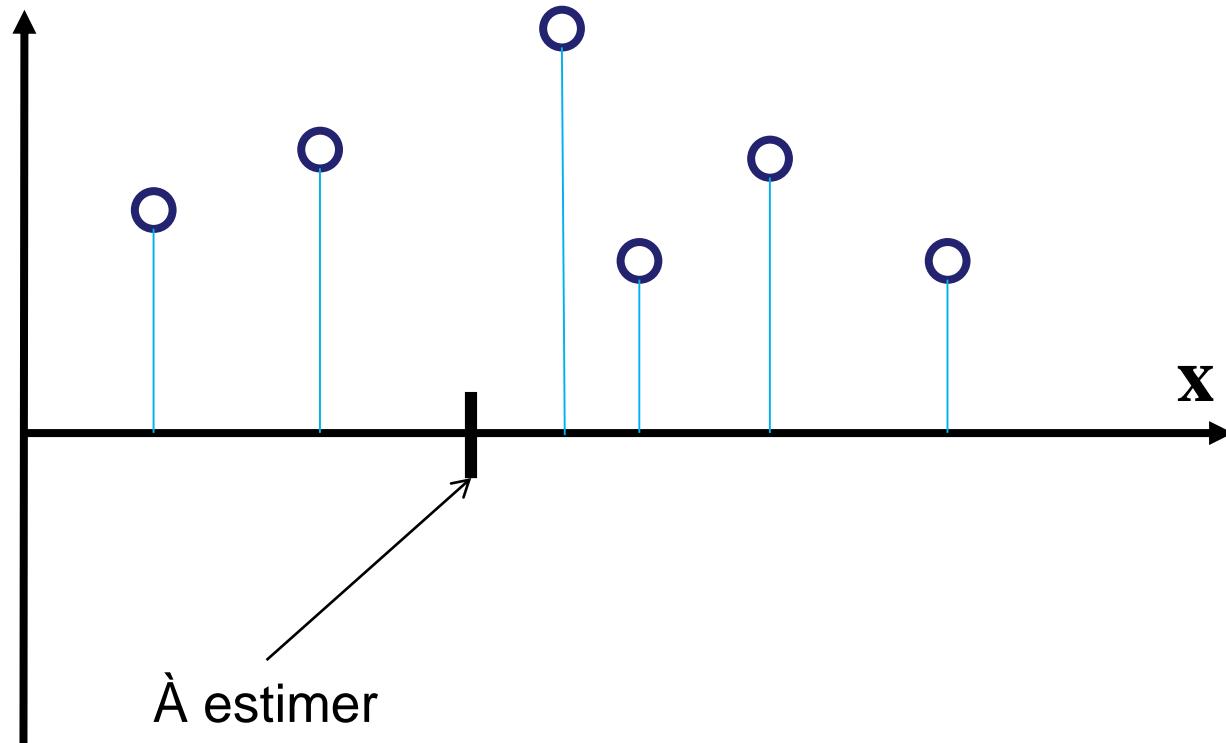
- Principe:
  - Deux échantillons **proches** dans l'espace de représentation ont les mêmes prédictions
  - Pour prédire, il suffit de trouver l'exemple annoté **le plus** proche, et d'associer son annotation (étiquette, valeur...)
- Que veut dire « proche »?
  - Nécessite la définition d'une métrique ou mesure de similarité  $d(x, x')$
  - Plusieurs métriques possibles: distance euclidienne (L2), city-block (L1), Minkowski, Mahalanobis...
  - On peut aussi « apprendre » la métrique ou mesure de similarité
- Que veut dire « le plus proche »?
  - Base d'échantillons annotés  $\mathcal{L} = \{(x_1, y_1), (x_2, y_2), \dots (x_N, y_N)\}$
  - Recherche de l'échantillon le plus proche:  $i^* = \arg \min_i d(x, x_i)$
  - Attribue comme prédiction l'annotation du plus proche:  $y^* = y_{i^*}$

# Régression PPV

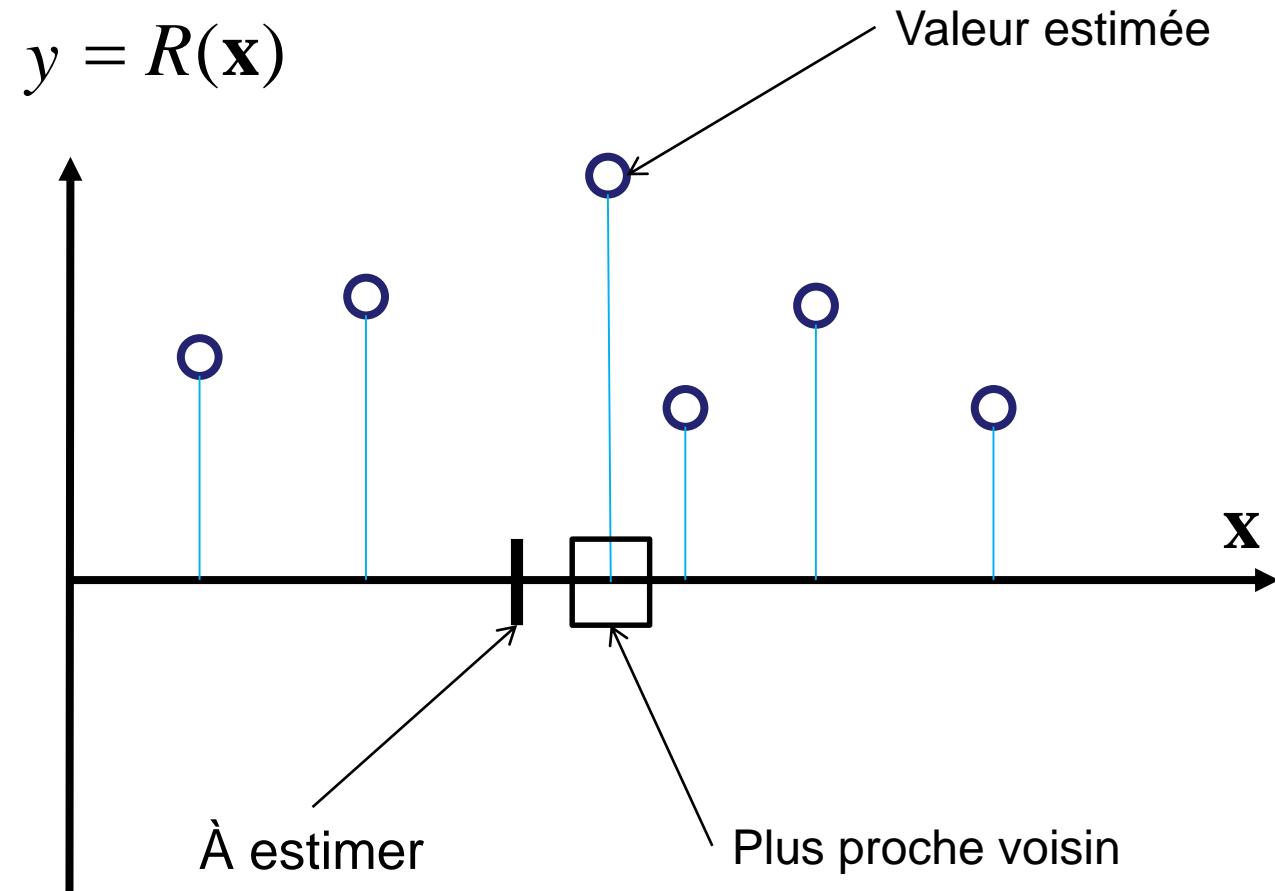


# Régression PPV

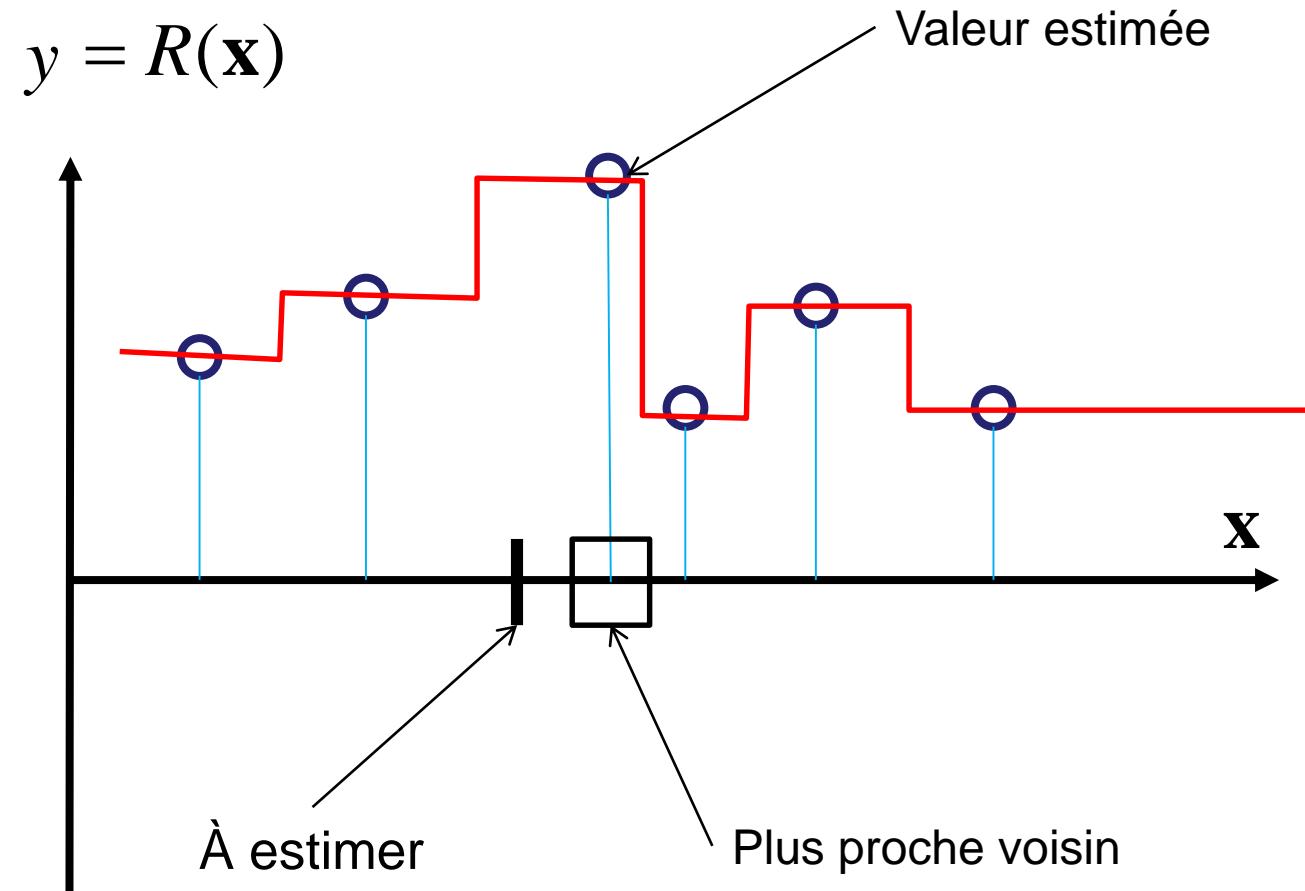
$$y = R(\mathbf{x})$$



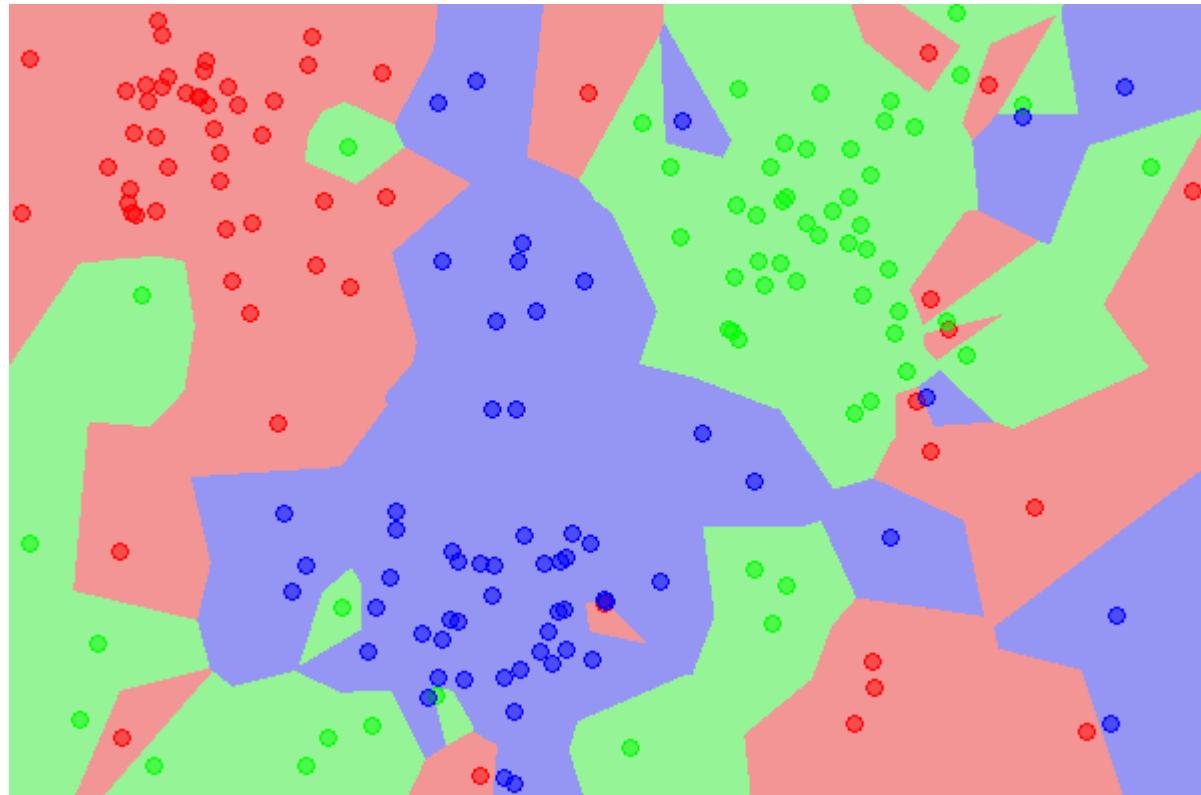
# Régression PPV



# Régression PPV



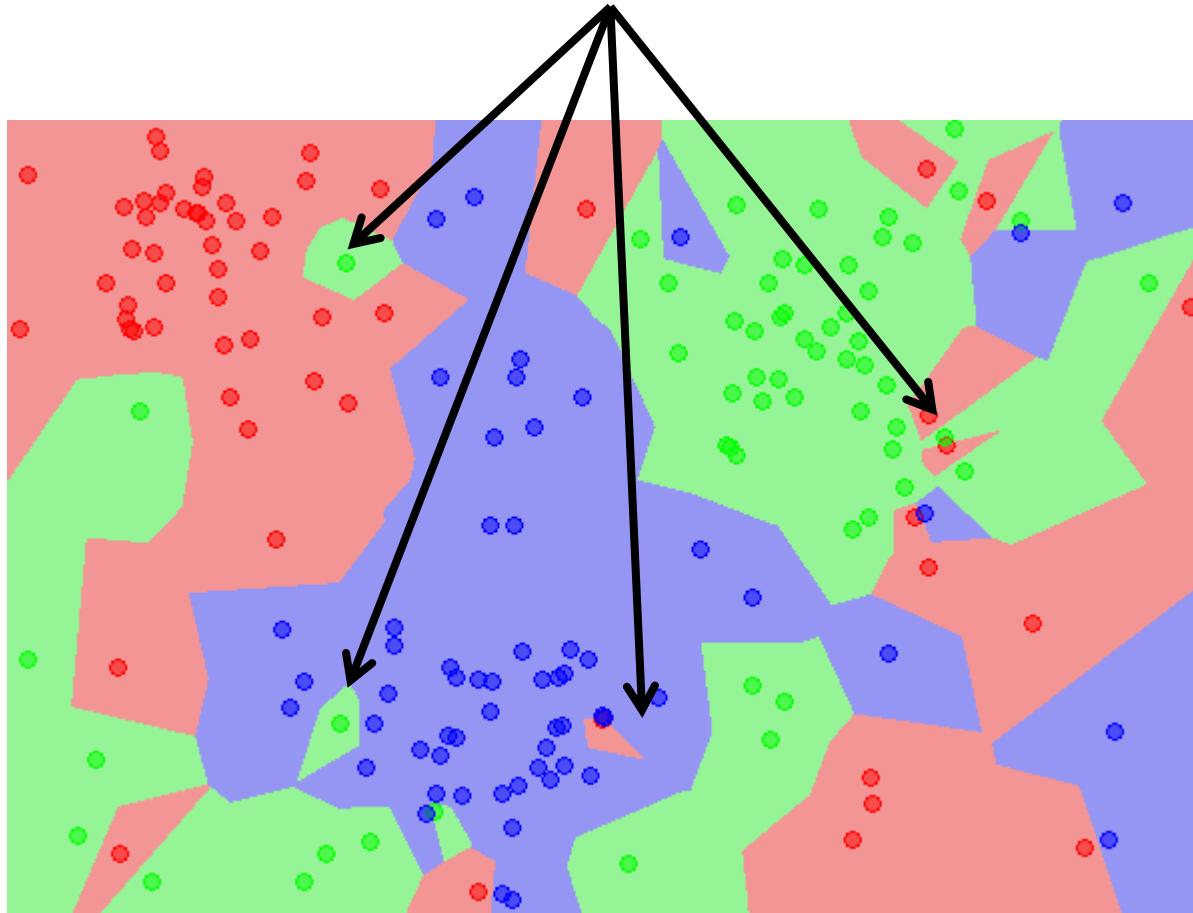
# Fonction de classification



Chaque échantillon définit une région homogène de l'espace de représentation

# Fonction de classification

Données bruitées → Régions isolées → mauvaise régularité des prédictions



Chaque échantillon définit une région homogène de l'espace de représentation

# k-plus proches voisins (« k-NN »)

- Principe: décision à partir de plusieurs exemples de la base de données d'apprentissage
- On ordonne les échantillons d'apprentissage en fonction de leur distance à la donnée à classer:

$$d(\mathbf{x}, \mathbf{x}_{(1)}) \leq d(\mathbf{x}, \mathbf{x}_{(2)}) \leq \dots \leq d(\mathbf{x}, \mathbf{x}_{(N)})$$

- On choisit les  $k$  plus proches
- On prédit en choisissant la classe recueillant le plus de votes

$$y^* = \arg \max_y \sum_{i=1}^k \delta(y, y_{(i)})$$

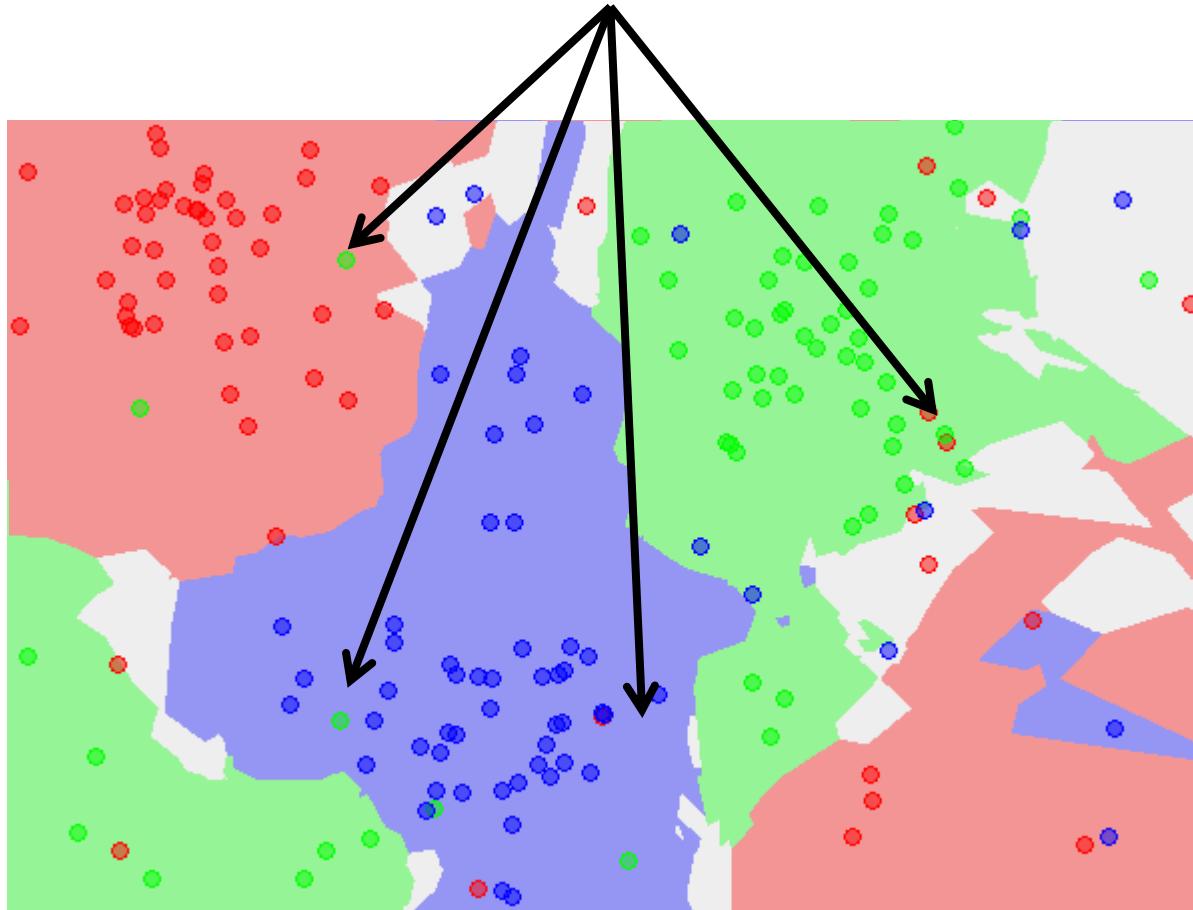
Où  $\delta$  est la fonction de Kronecker (elle vaut 1 si égal, 0 sinon)

- Si pas de max (ambiguïté sur la prédiction) on ne décide pas!
- On peut aussi pondérer les votes:

$$y^* = \arg \max_y \sum_{i=1}^k K(\mathbf{x}, \mathbf{x}_{(i)}) \delta(y, y_{(i)})$$

# Fonction de classification 5 ppv

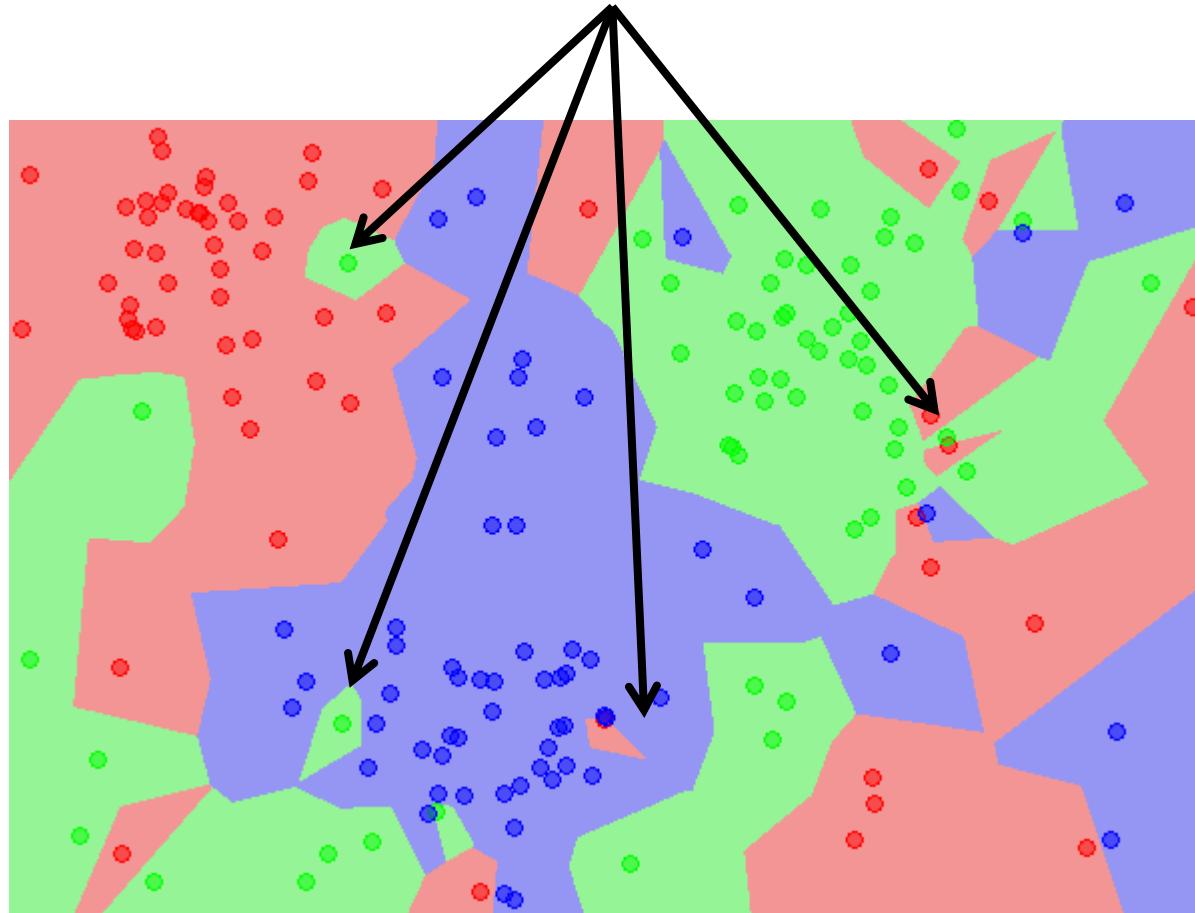
Données bruitées → Régions isolées → mauvaise régularité des prédictions



Chaque échantillon définit une région homogène de l'espace de représentation

# Fonction de classification 1 ppv

Données bruitées → Régions isolées → mauvaise régularité des prédictions



Chaque échantillon définit une région homogène de l'espace de représentation

# Propriétés statistiques

Bornes statistiques asymptotiques ( $N \rightarrow \infty$ )

$$E \leq E_{kNN} \leq E \left( 2 - \frac{LE}{L-1} \right)$$

Où  $E$  est l'erreur théorique optimale (Bayes),  $L$  est le nombre de classes et  $E_{kNN}$  est l'erreur des k-pvv.

« L'erreur du k-NN est au plus deux fois moins bonne que l'erreur minimale théorique. »

# Coût de la prédiction du k-ppv

- Calcul de la prédiction dépend pour chaque exemple  $x$  d'un calcul + tri par rapport aux  $N$  exemples de la base:

$$d(x, x_{(1)}) \leq d(x, x_{(2)}) \leq \dots \leq d(x, x_{(N)})$$

- Pour  $N$  et  $d$  grands, coût important de la recherche exhaustive  $O(Nd)$ . Il existe:

- Des algorithmes efficaces de recherche pour problèmes de tailles moyennes (KDtree)

J. Friedman, J. L. Bentley, and R. A. Finkel, "An algorithm for finding best matches in logarithmic expected time," *ACM Transaction on Mathematical Software*, vol. 3, no. 3, pp. 209–226, 1977.

- Des algorithmes d'approximation pour les grandes bases ( $>10^6$ ).

Jegou, H., Douze, M., & Schmid, C. (2011). Product quantization for nearest neighbor search. *IEEE transactions on pattern analysis and machine intelligence*, 33(1), 117-128.

- Autre manière: pré-calculer les surfaces de séparation entre classes. La complexité de prédiction est alors liée à la complexité de la surface et/ou de son approximation. On verra comment d'autres approches permettent de l'estimer directement.

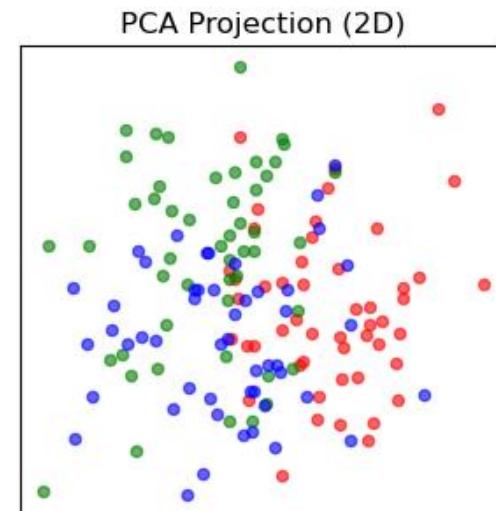
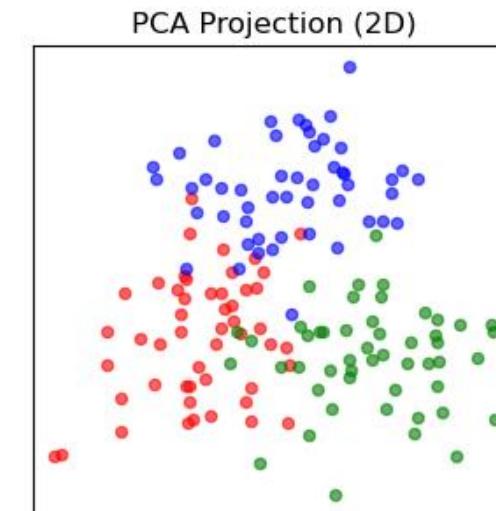
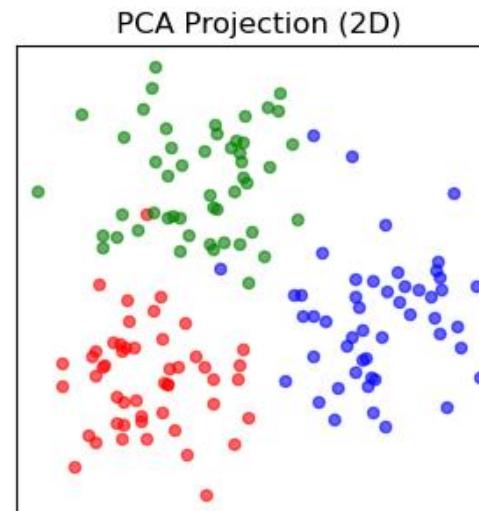
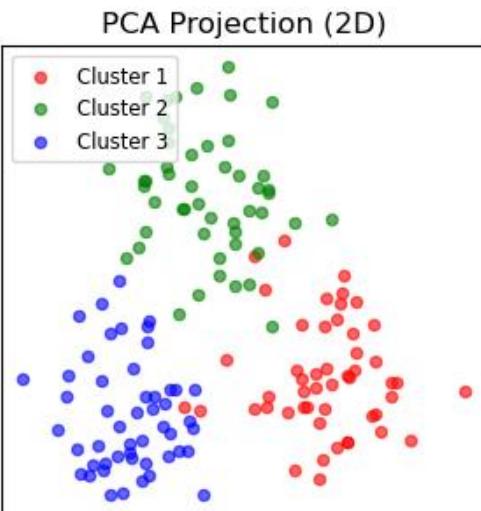
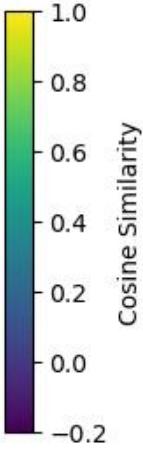
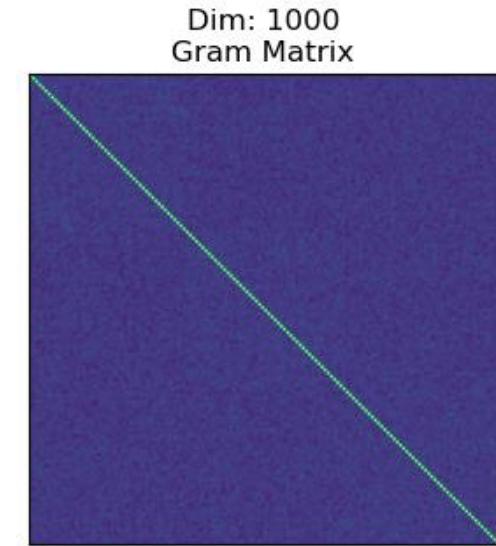
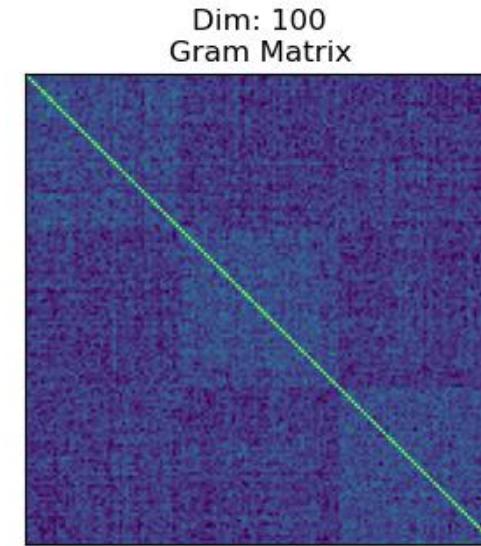
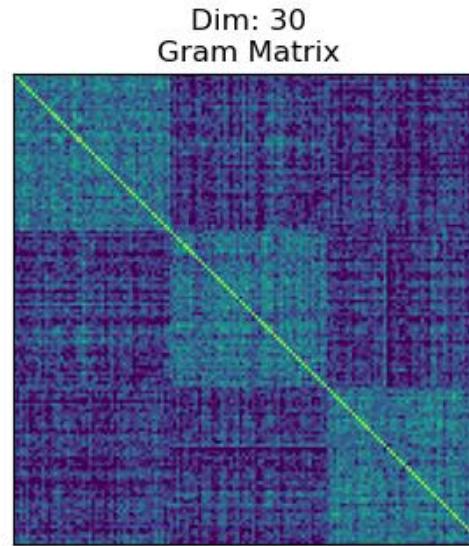
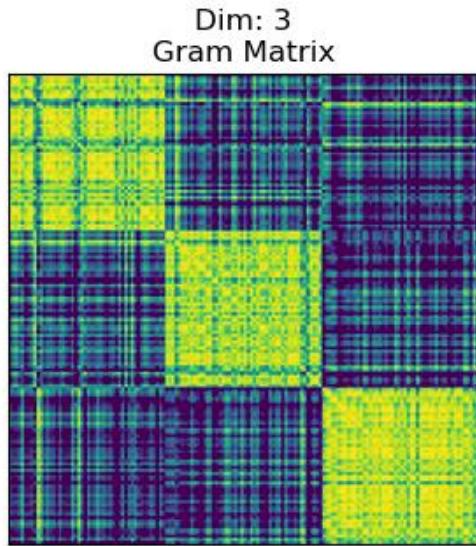
# La malédiction des grandes dimensions

- Lorsque la dimension  $d$  de l'espace de représentation augmente, les points sont tous aussi proches ou aussi loin.
- On peut montrer, pour une distribution quelconque de  $N$  points tirés de manière indépendante dans  $[0,1]^d$ , que:

$$\lim_{d \rightarrow \infty} E \left[ \frac{d_{\max} - d_{\min}}{d_{\min}} \right] = 0$$

- Ce n'est plus vrai si les distributions ont une structure...heureusement!
- On peut interpréter les techniques de Machine Learning comme des moyens de repérer les bonnes corrélations entre données.
- Conséquence pour les approches « plus proches voisins »:
  - Ca ne marche que pour les faibles dimensions
  - Ou il faut **réduire** les dimensions de représentation avant de calculer les distances → apprentissage non supervisé

# Exemple de l'impact de la dimension des données



# Comportement des PPV

- Avantages
  - Schéma flexible, facile à mettre en œuvre, dépendant de la définition d'une similarité entre données.
  - Bonnes propriétés statistiques ( $N \rightarrow \infty$ )
- Mais...
  - Temps de calcul prohibitif pour grandes bases
    - Algorithmes efficaces de recherche optimaux ou sous-optimaux
  - Régularité dépend des données, pas de l'apprentissage
    - Le k-PPV (« kNN ») pour lisser et réduire le bruit
  - Malédiction des grandes dimensions (« Curse of dimensionality »)
    - Réduire la dimension de représentation

# « Plus proches voisins »: résumé

- Hypothèse de régularité = Si observations proches, même comportement
- Deux questions:
  - Que veut dire « proche »?
  - Comment trouver les plus proches?
- Apprentissage
  - Aucun
- Prédiction
  - Tri des distances aux échantillons + vote
- Quand l'utiliser? (limitations)
  - Efficace sur petits problèmes (dimensions & nombre d'exemples)
  - Pb du « curse of dimensionality » + temps de calcul
  - Disposer d'une mesure de similarité adaptée aux données

## Arbres de décision

# Explicabilité I

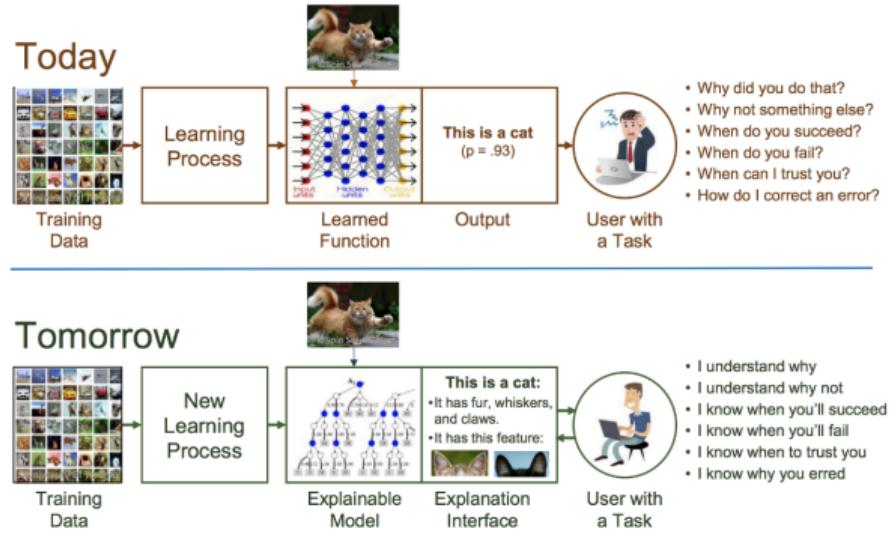


Figure 1 – Program XAI de la Darpa

<https://www.darpa.mil/program/explainable-artificial-intelligence>

## Explicabilité II

- ▶ Beaucoup de fonctions de prédiction sont opaques (réseaux de neurones) : il est souvent difficile de comprendre la logique de leur calcul.
- ▶ **Explicabilité** : Fournir des éléments de compréhension du fonctionnement des prédicteurs est un des éléments pour construire une Intelligence Artificielle de confiance.

On va décrire un prédicteur plus facilement interprétable : l'arbre de décision.

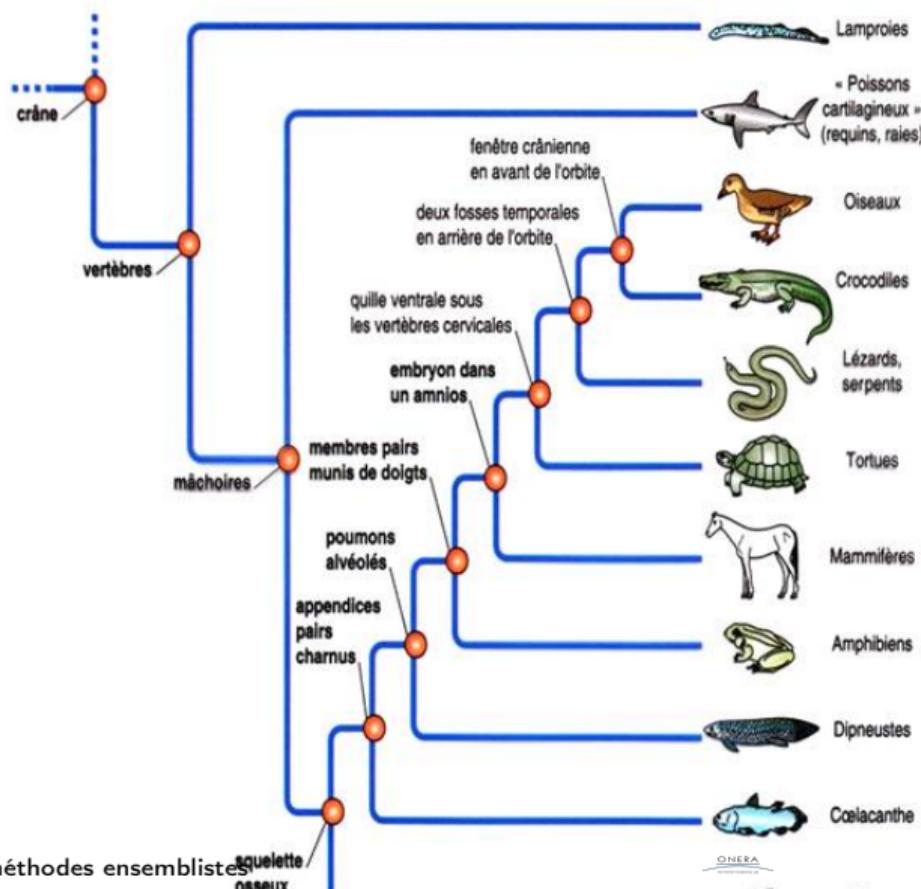
## Jeux de déduction



- Quelle meilleure question poser ? (Comment fait <https://fr.akinator.com/> ?)



# Classification hiérarchique



## Analyse préliminaire

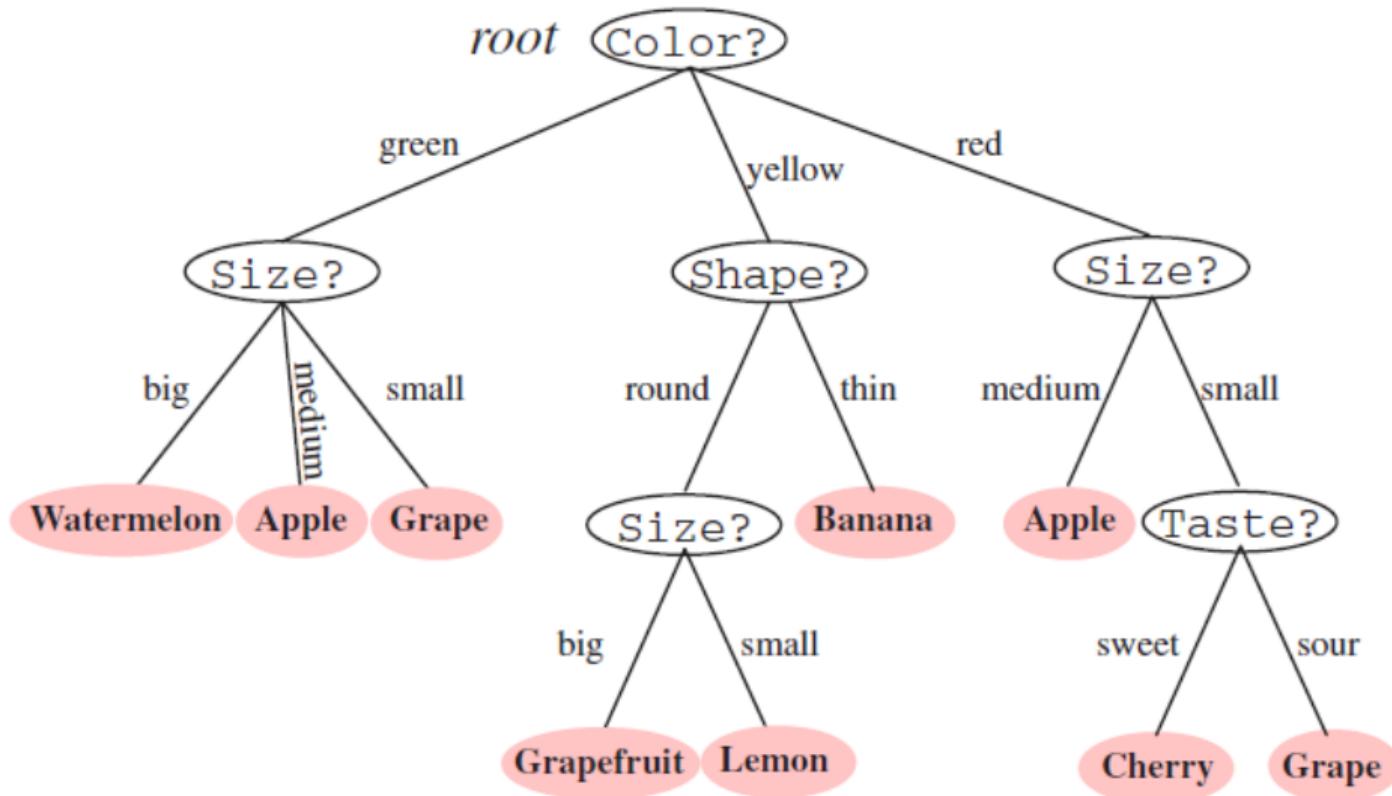
Qu'y a-t-il de commun à ces exemples ?

- ▶ Décompose une prédiction globale en une **séquence de décisions** (questions+réponses) locales pour
- ▶ **sélectionner** une prédiction pré-calculée.

Les séquences de décisions peuvent être représentées globalement par un **arbre de décision**.

→ La question du jour : comment construire les séquences de décision (l'arbre) pour une bonne prédiction ?

## Exemple d'arbre



# Arbres de décision [3, 9]

## Principe

- ▶ Prédiction en posant une séquence de questions fermées (= nombre fini de réponses possibles)
- ▶ Questions organisées sous forme d'arbre : la question suivante dépend de la réponse à la question précédente

## Types de questions

- ▶ Sur la valeur d'un attribut caractéristique : «  $x$  est rouge ? »
- ▶ Sur la véracité d'une clause logique :  $rouge(x) \wedge rond(x) = \text{True?}$
- ▶ Sur l'appartenance à un intervalle ou un sous-ensemble :  $\mathbf{1}_{x>0.5}$

## Prédiction

- ▶ Estimation de la valeur prédite à partir des données pour lesquelles la séquence de questions est vraie

# Arbres de décision : ils décrivent un prédicteur

## Structure

- ▶ **Données** représentées par des attributs (ex : couleur, taille, valeur numérique ou discrète)
- ▶ **Nœud de décision** associé à un **test** ou une **question** sur un des attributs
- ▶ **Branche** représente une réponse à la question
- ▶ **Nœud terminal** ou **feuille** définit la prédiction
- ▶ Le **chemin** aboutissant à la feuille contient la séquence des questions/réponses  
⇒ explicabilité de la prédiction

## Fonction de prédiction

- ▶ Les questions découpent (partitionnent) l'espace des données à chaque étape
- ▶ Le nœud terminal représente un élément de la partition
- ▶ Toutes les données codées par le nœud terminal ont la même prédiction
- ▶ L'arbre code une fonction *constante par morceaux*

# Arbres de décision et partition I

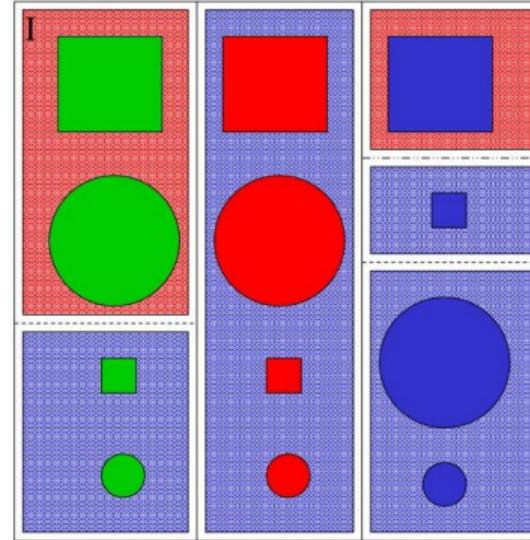
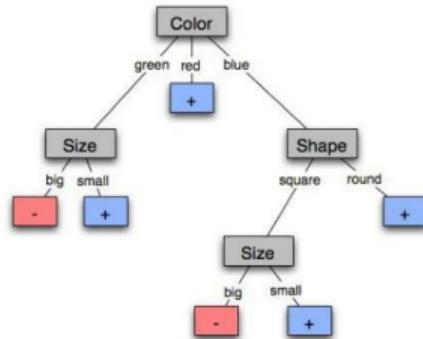


Figure 2 – Partition sur des données symboliques. Les questions portent sur la valeur d'un attribut discret.

## Arbres de décision et partition II

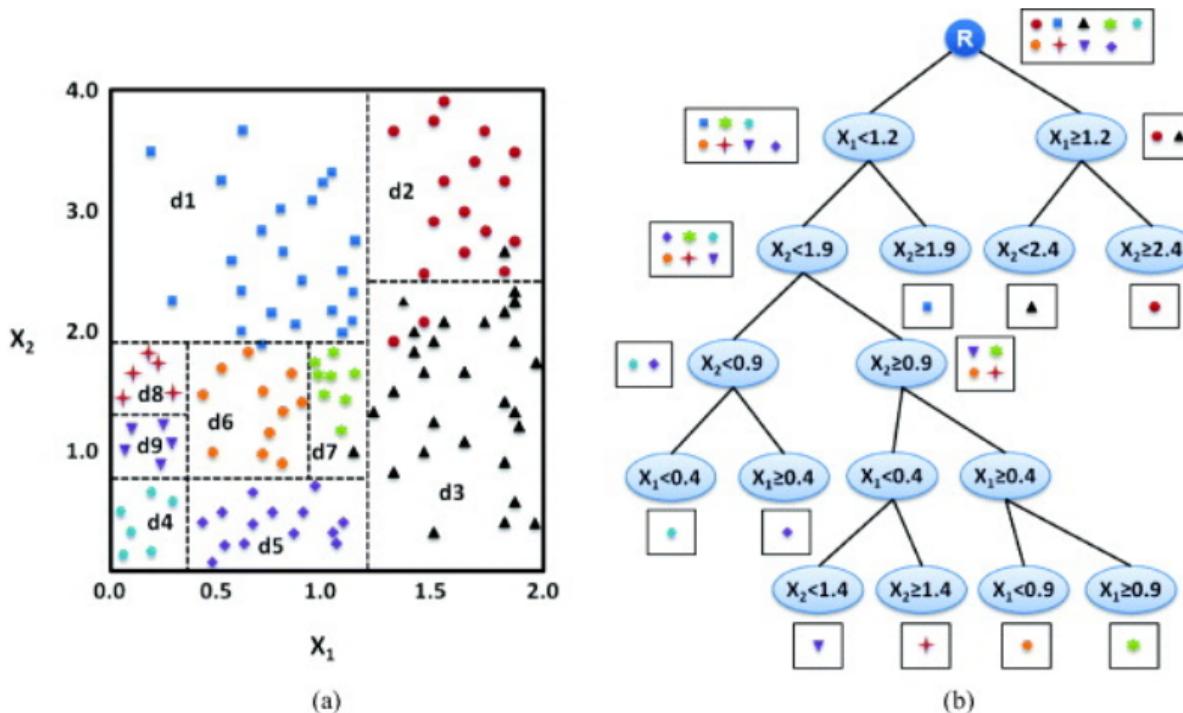


Figure 3 – Prédiction multi-classe. Les questions sont des tests comparant la valeur d'une dimension à un seuil.

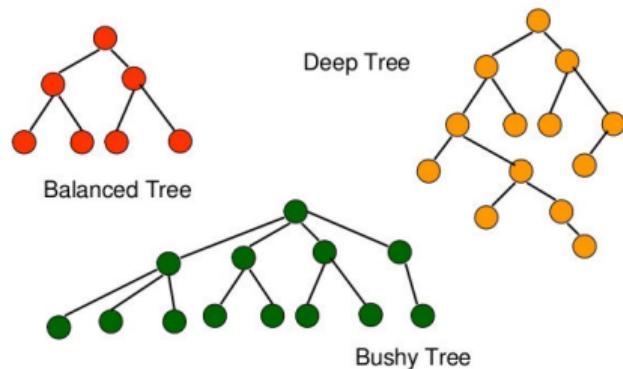
# Arbres de décision : problématiques

Globales :

- ▶ Quelle structure choisir ? (profond, équilibré,...) ?
- ▶ Combien de découpages par noeud ? (binaire, plus)
- ▶ Quand s'arrêter de découper ?

Locales :

- ▶ Quel attribut choisir, et quel test lui appliquer ?
- ▶ Si l'arbre est trop grand, comment l'élaguer ?
- ▶ Si une feuille n'est pas pure, quelle prédiction attribuer ?



## Arbres de décision : apprentissage

- ▶ Soit  $\mathcal{L} = \{(x_j, y_j)\}_{j \leq N}$  un ensemble d'apprentissage.
- ▶ Chaque donnée  $x_j$  est caractérisée par ensemble d'**attributs**  $x_j = \{a_i^j\}_{1 \leq i \leq M}$ , avec  $a_i^j$  à valeurs numériques ou symboliques.
- ▶ On dispose d'une collection de tests (ou questions)  $\mathcal{T}$  sur les attributs = fonctions à valeurs discrètes, par ex. binaire, sur les valeurs d'un seul attribut.
- ▶ Apprentissage = définir une procédure qui calcule l'ensemble des tests et leur organisation en arbre à partir des données
- ▶ Critère d'optimalité globale envisageable : compromis entre complexité/taille de l'arbre et qualité de prédiction.
- ▶ C'est un problème NP-complet, donc non praticable ! [10]
- ➡ Heuristique assurant un arbre cohérent avec les données d'apprentissage.

# Arbres de décision : algorithme élémentaire

## Principe général

Construction incrémentale d'un arbre.

## Trois étapes

1. Identifier un nœud et décider s'il est **terminal**
2. Si un nœud n'est pas terminal, choisir un **test** fonction des données (question) et des **branches** possibles.
3. Si un nœud est terminal, lui associer une **prédiction** (une classe, une valeur, etc.)
4. Revenir en 1. tant que tous les nœuds ne sont pas terminaux.

## Remarques

- ▶ il est courant de n'utiliser que des tests *binaires* (vrai/faux).
- ▶ il existe des formulations non récursives plus globales non optimales [8].

## Arbres de décision : comment choisir le bon test ?

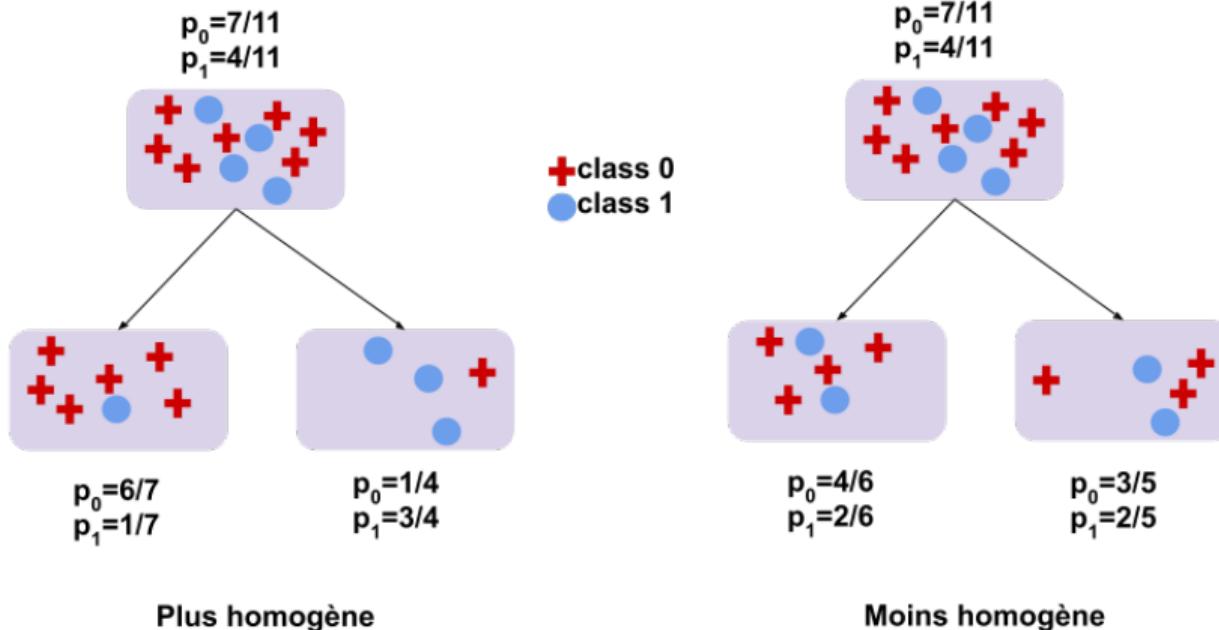
- ▶ On dispose d'une population de données  $D$  en chaque nœud, c'est-à-dire un ensemble de données vérifiant la séquence des tests du chemin menant au nœud.
- ▶ Un test associe une réponse unique parmi  $J$  possibles pour chaque donnée, et répartit les données en  $J$  sous-populations  $\{D_j\}_{j \in \{1, \dots, J\}}$ .
- ▶ On dispose d'un critère d'homogénéité  $I(D)$  caractérisant une population  $D$ .
- ▶ Apprentissage = choix du test  $T^*$  maximisant le gain moyen en homogénéité (ou réduction en hétérogénéité) :

$$T^* = \arg \max_{T \in \mathcal{T}} I(D) - \sum_j p(D_j | D, T) I(D_j)$$

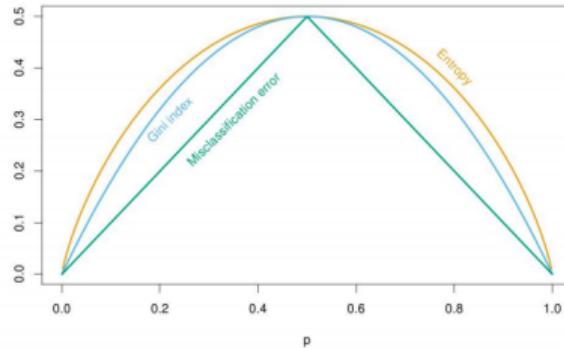
où  $p(D_j | D, T) = |D_j| / |D|$  est la proportion de données de  $D$  répondant  $j$  au test et  $I(D_j)$  est la mesure d'hétérogénéité de la population  $D_j$

Remarque : En pratique, le nombre de tests à évaluer peut être très grand. La recherche du  $\arg \max$  peut faire intervenir des heuristiques sous-optimales.

# Arbres de décision : test et homogénéité



# Arbres de décision : critères d'homogénéité en classification



## Trois critère usuels

- ▶ Entropie :  $I(D) = - \sum_k p_k(D) \log_2(p_k(D))$
- ▶ Indice de Gini :  $I(D) = \sum_k p_k(D)(1 - p_k(D))$
- ▶ Indice d'erreur :  $I(D) = 1 - \max_k(p_k(D))$

où  $p_k(D) = N_k(D)/|D|$  est la probabilité d'avoir une donnée de classe  $k$  dans  $D$ .  
Ils sont maximaux lorsque la répartition des classes est équiprobable.

Pour la régression, on utilise la variance d'estimation comme critère d'homogénéité

# Quand s'arrêter ?

## Critères structuraux

- ▶ Profondeur maximale
- ▶ Nombre de feuilles minimal

## Critères statistiques

- ▶ Indice d'homogénéité minimal
- ▶ Nombre minimal de données en chaque noeud (avant ou après répartition)

# Que prédire ?

On exploite la population de données associée à chaque feuille de l'arbre.

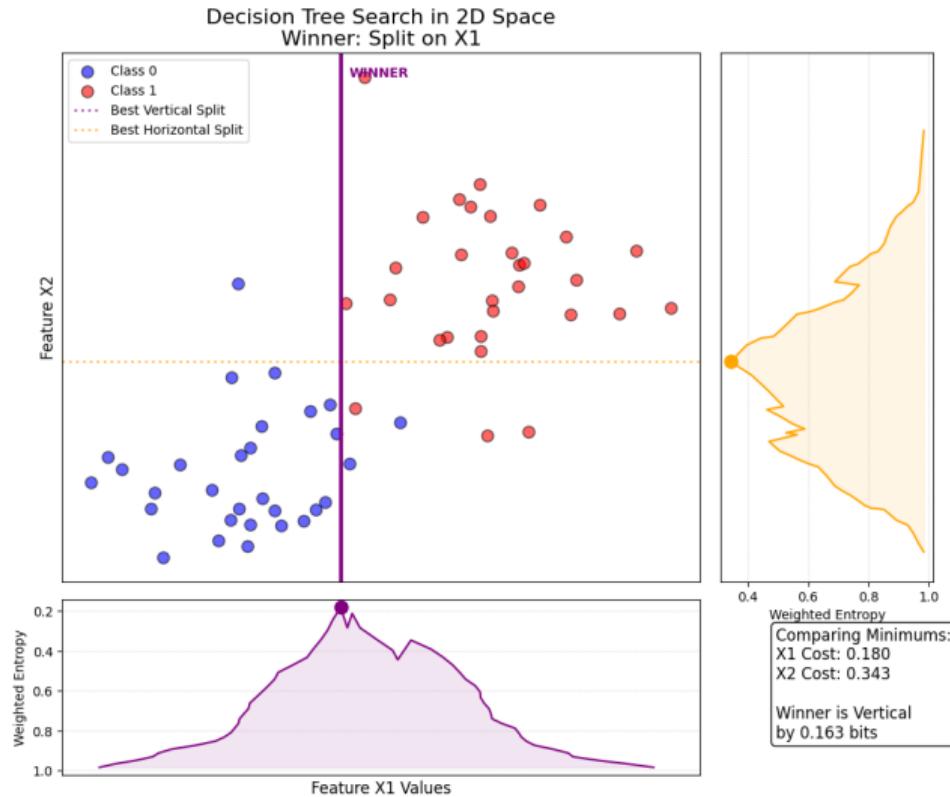
## Classification

- ▶ Classe la plus probable
- ▶ Distribution de classes

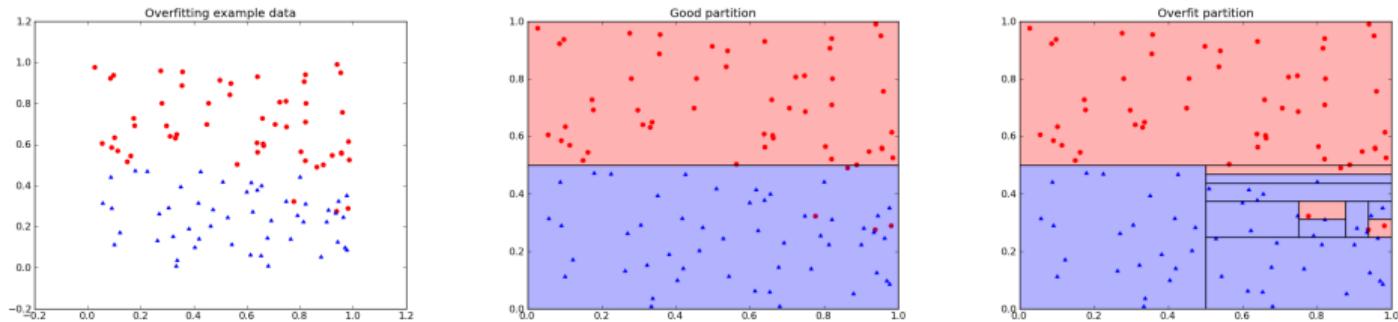
## Régression

- ▶ Moyenne, médiane de la population

# Recherche du meilleur test (attributs continus)



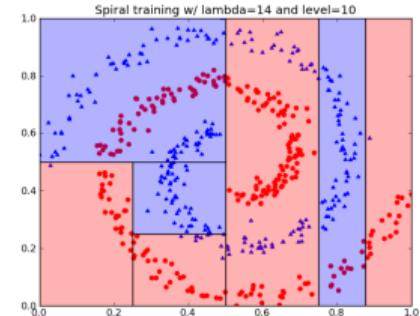
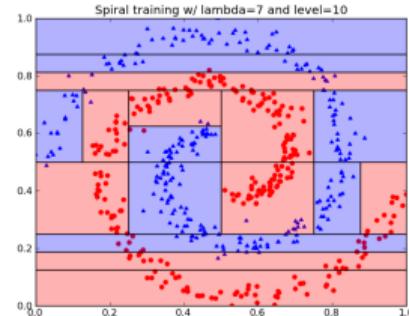
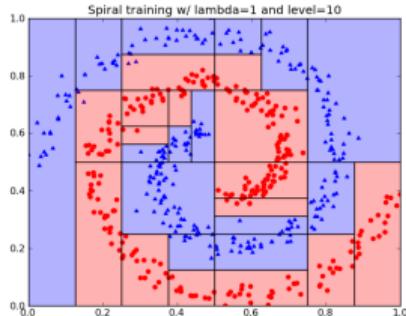
# Arbres de décision : comportement statistique I



## Sur-apprentissage

- ▶ Un arbre trop précis risque de mal généraliser (cf. k-NN)
- ▶ Les arbres peuvent être mal équilibrés, par exemple lorsque les distributions ont des attributs corrélés
- ▶ On peut utiliser des techniques d'élagage (« pruning ») pour améliorer a posteriori la qualité des arbres

# Arbres de décision : comportement statistique II



La complexité peut être contrôlée

- ▶ en limitant la profondeur
- ▶ en minorant le gain en homogénéité
- ▶ en ajoutant une pénalisation de complexité dans le coût
- ▶ en garantissant une bonne estimation des coûts (par ex. un nombre minimal d'échantillons par noeud)

# Arbres de décision : Résumé

## Points clés des arbres de décision

- + Interprétabilité
- + Apprentissage et classification rapides et efficaces, y compris en grande dimension.
- Tendance au surapprentissage (mais moyen de contrôle de la complexité)
- Sensibilité au bruit et aux points aberrants, instabilité

## Utilisations

- + Classification ou régression...
- + Capable de traiter des données numériques, mais aussi symboliques

## Méthodes ensemblistes

# Méthodes ensemblistes

## Définition

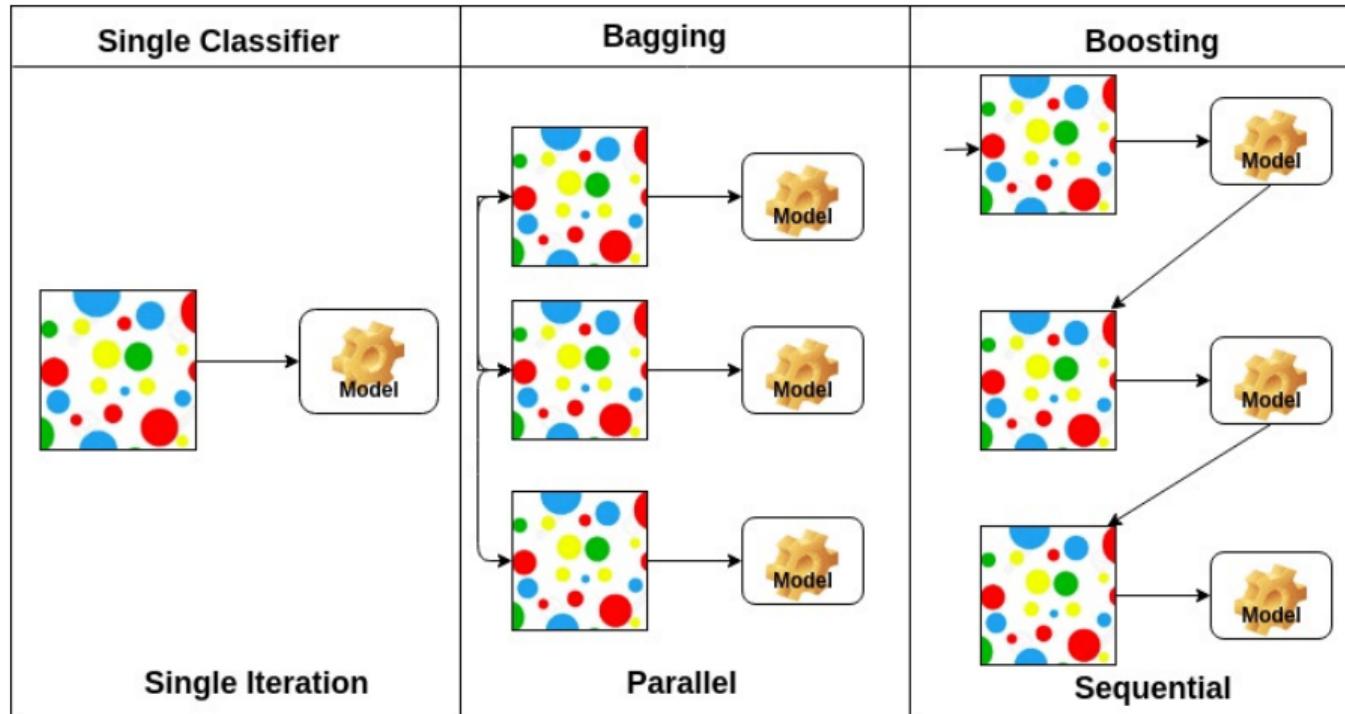
- ▶ Méthodes agrégeant des *ensembles* de classifieurs ;
- ▶ Produire une variété de classifieurs : en échantillonnant différemment les données, en modifiant les structures de classifieurs ;
- ▶ Classe finale = fusion des prédictions.

## Principe

- ▶ *L'union fait la force* : tirer parti de plusieurs classifieurs peu performants (« faibles ») pour construire un classifieur performant (« fort »)
  - ⇒ *Réduit la variance* d'apprentissage et moyenne les erreurs

# Méthodes ensemblistes

Deux grandes approches : bagging et boosting



## Bagging [1]

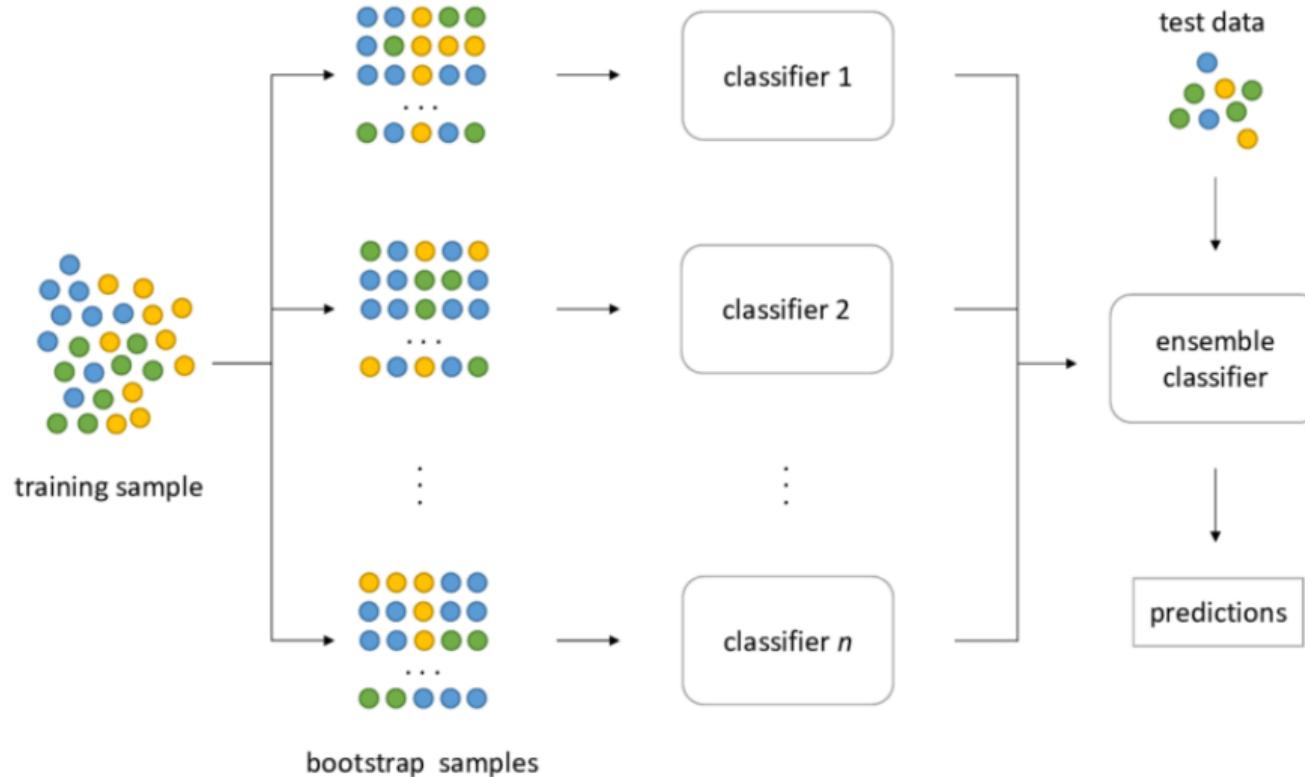
### Génération de jeux de données multiples

- ▶ Construction de  $\tilde{X}_1, \dots, \tilde{X}_K$  par tirage avec remise sur  $X$ .
- ▶  $\tilde{X}_k$  similaires, mais pas trop (proba d'un exemple de ne pas être sélectionné  $p = (1 - 1/N)^N$ . Quand  $N \rightarrow \infty$ ,  $p \rightarrow 0.3679$ .)
- ▶ Entraîner  $K$  fois le même algorithme  $f_k$  (arbre, réseau de neurones, SVM..) sur chaque  $\tilde{X}_k$  et agréger par vote majoritaire ou moyenne  $f(x) = \frac{1}{K} \sum f_k(x)$

### Conséquence

- ▶ Chaque classifieur commet des erreurs différentes, liées à  $\tilde{X}_k \rightarrow$  l'agrégat a une plus faible variance d'apprentissage
- ▶ Méthode pour *régulariser* le processus de prédiction.

# Bagging

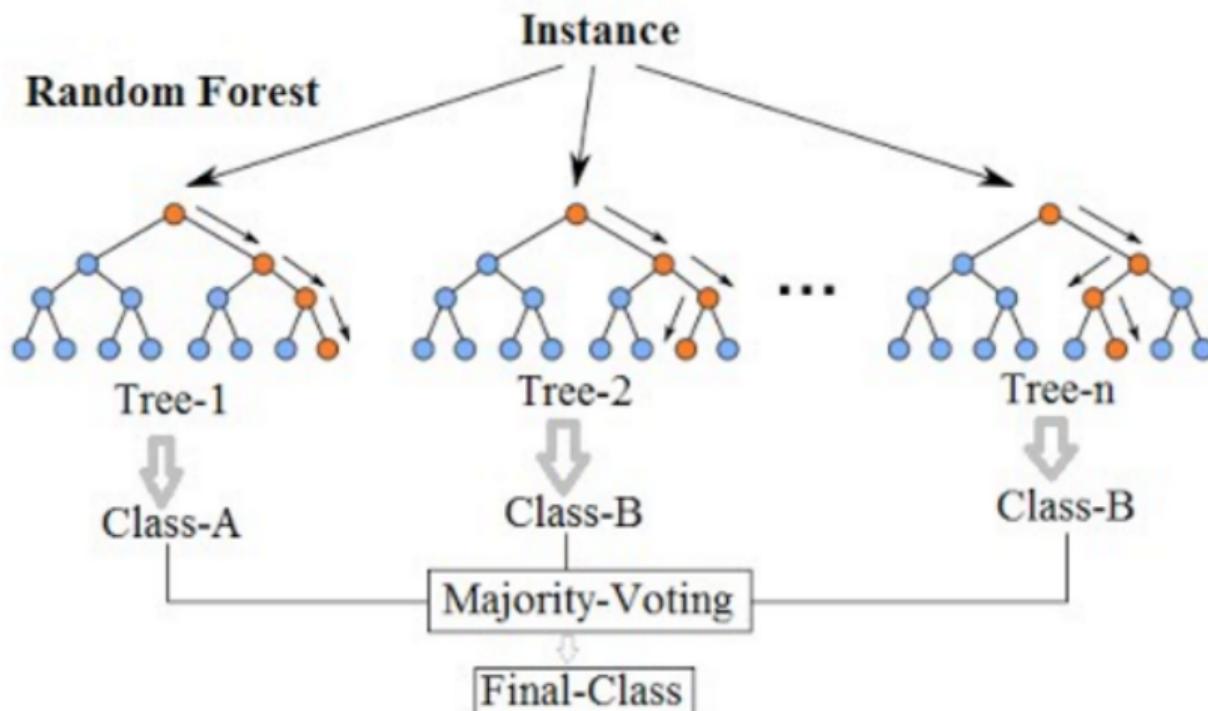


## Random Forests [2]

### Forêts aléatoires ou *Random forests*

- ➡ Combiner hasard et bagging pour construire un ensemble d'arbres de décision encore plus varié (=forêt)
  
- ▶ La partie calculatoire des arbres de décision est la construction incrémentale de leur structure (meilleure paire attribut & test)
- ▶ Structure = paramètre de contrôle des arbres (profondeur max, critère de pureté des noeuds, nombre d'échantillons par noeud...) + aléatoire sur attributs/données/tests

## Random Forest Simplified



# Random Forests

Forêts aléatoires ou *Random forests*

Algorithme :

**POUR**  $k = 1 \dots K$  :

- ▶ Bagging : tirage de  $\tilde{X}_k$  de même taille que  $X$
- ▶ Tirage (avec remise) de  $q$  attributs  $A_i$  parmi les  $M$  possibles
- ▶ Construction de l'arbre  $G_k$  avec des seuils aléatoires
- ▶ Construction de  $f_k$  la fonction de décision de  $G_k$  dont les feuilles sont remplies avec  $\tilde{X}_k$

**Aggrégation** :

- ▶  $f(x) = \frac{1}{K} \sum f_k(x)$  (régression)
- ▶  $f(x) = \text{Vote majoritaire}(f_1(x), \dots, f_K(x))$

## Intérêt des approches ensemblistes

On introduit une source d'aléatoire supplémentaire : choix des splits, du sous ensemble de variables, etc.

Lorsque les prédicteurs individuels sont sans biais (c'est le cas avec les arbres), la variance du prédicteur ensembliste est :

$$\text{var} \left( \hat{f}_D(\mathbf{x}) \right) = \rho\sigma^2 + \frac{1 - \rho}{K}\sigma^2$$

$\sigma$  variance d'un prédicteur individuel et  $\rho$  corrélation entre deux prédicteurs.

On voit que l'on a intérêt à construire des prédicteurs individuels indépendants ( $\rho \approx 0$ ), et en grand nombre ( $K$  grand).

# Random Forests : Résumé

## Points clés des forêts aléatoires

- + Bonnes performances
- + Arbres plus décorrélés que par simple bagging
- + Grandes dimensions
- + Robustesse
- Temps d'entraînement (mais aisément parallélisable).

## Utilisation

- ▶ Choix d'une faible profondeur (2 à 5), autres hyper-paramètres à estimer par validation croisée
- ▶ Classification et régression
- ▶ Données numériques et symboliques

# Boosting [5]

## Principe

- ▶  $X = \{(x_i, y_i)\}_{i=1}^N$  un ensemble de données où  $y_i \in \{-1, 1\}$
- ▶  $H$  un ensemble ou une famille de classifieurs  $f \mapsto -1, 1$ , pas forcément performants → appelés *weak learners*

Objectif du boosting :

- ▶ Construire un classifieur performant  $F(x) = \sum_{k=1}^K \alpha_k f_k(x)$   
→ appelé *strong learner*
- ▶ Moyenne pondérée des *weak learners*
- ⇒ Comment trouver les poids ?

# Boosting

## AdaBoost

- ▶ Adaboost = « Adaptive boosting algorithm », algorithme minimisant l'erreur globale de  $F$  de manière itérative
- ▶ Principe : à chaque itération  $k$ , modifier  $F^k$  de manière à *donner plus de poids aux données difficiles* (mal-classées) qui permettent de corriger les erreurs commises par  $F^{k-1}$

# Boosting

## AdaBoost : algorithme

Initialiser les poids liés aux données :

$$d^0 \leftarrow (\frac{1}{K}, \frac{1}{K}, \dots, \frac{1}{K})$$

POUR  $t = 1 \dots K$  :

- ▶ Entrainer  $f_k$  sur les données  $X$  pondérées par  $d^{k-1}$   
 $(f_k = \arg \min_f \sum_i d_i^{k-1} [y_i \neq f(x_i)])$
- ▶ Prédire  $\hat{y} = y^i \leftarrow f_k(x_i), \forall i$
- ▶ Calculer l'erreur pondérée  $\epsilon^k \leftarrow \sum_i d_i^{k-1} [y_i \neq \hat{y}_i]$
- ▶ Calculer les paramètres adaptatifs  $\alpha^k \leftarrow \frac{1}{2} \log \left( \frac{1-\epsilon^k}{\epsilon^k} \right)$
- ▶ Re-pondérer les données  $d^k = d_i^k \leftarrow d_i^{k-1} \exp(-\alpha^k y_i \hat{y}_i)$

Classifieur (pondéré) final :  $F(x) = \operatorname{sgn} \left( \sum_{k=1}^K \alpha_k f_k(x) \right)$

# Boosting

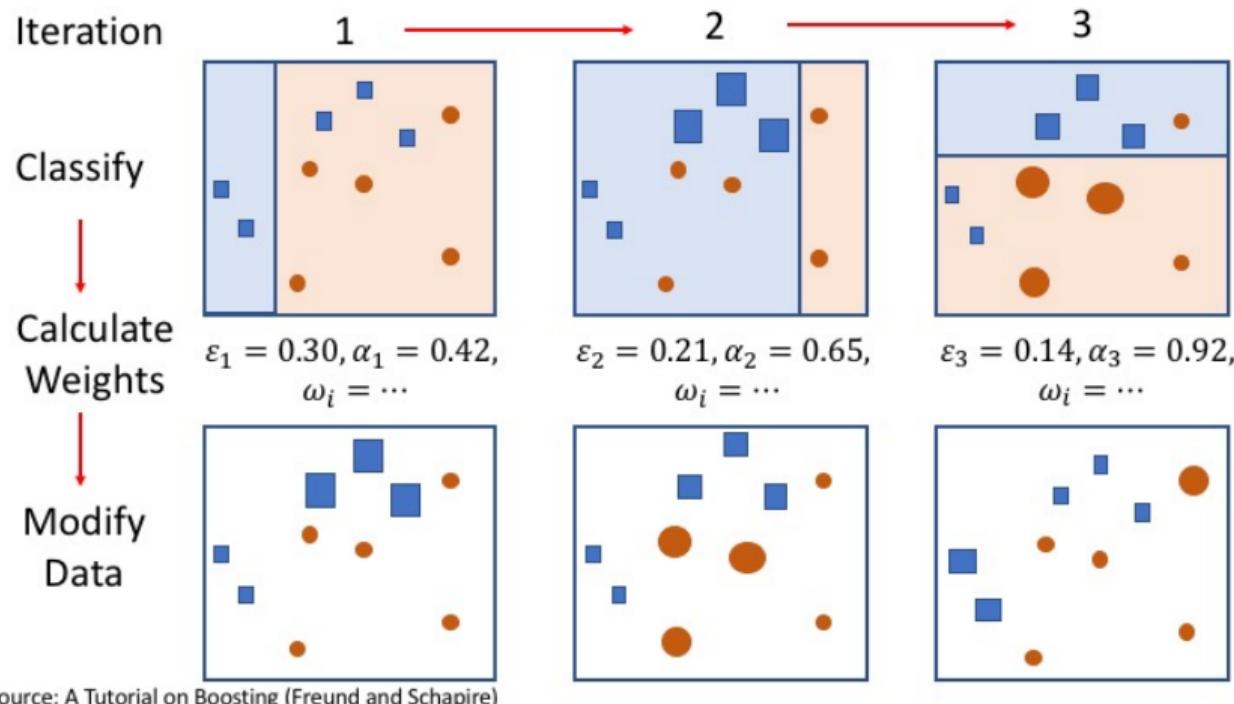
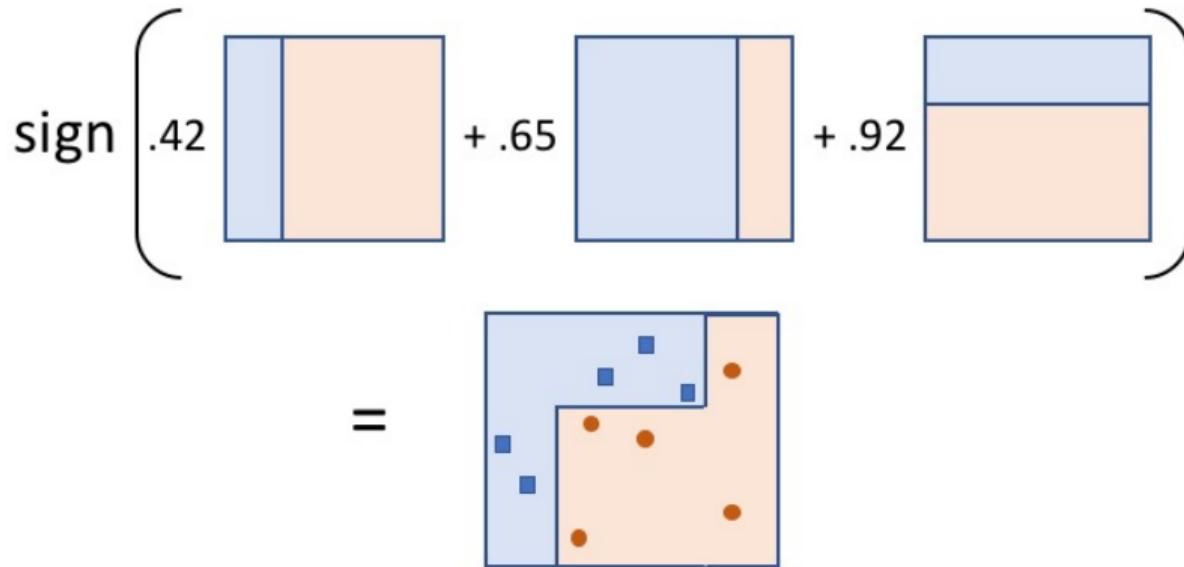


Figure 4 – Apprentissage séquentiel des classificateurs et des pondérations.

## Boosting



Source: A Tutorial on Boosting (Freund and Schapire)

Figure 5 – Classifieur final.

# Gradient Boosting [6, 7]

## Gradient Boosting

Variante : version additive pas-à-pas

- ▶  $X = \{(x_i, y_i)\}_{i=1}^N$  un ensemble de données où  $y_i \in \{-1, 1\}$
- ▶  $H$  un ensemble de classifieurs  $f \mapsto -1, 1$ , pas forcément performants → appelés *weak learners*

Objectif du gradient boosting :

- ▶ Construire itérativement un classifieur performant  
 $F_T(x) = \sum_{t=1}^T \alpha_t f_t(x) = F_{T-1}(x) + \alpha_T f_T(x)$  où  $f_t$  est l'un des weak learners  $h$ .
- ▶ Il s'agit à chaque étape de minimiser le risque empirique :  
 $\mathcal{L}(F_T) = \sum_{n=1}^N l(y_n, F_T(x_n))$  où  $l$  est un coût (*loss*)

# Gradient Boosting

## Coûts

- ▶ Adaboost → gradient boost avec fonction de coût  $l(y, f(x)) = \exp(-y.f(x))$
- ▶ Adaboost peut être vu comme la construction itérative d'un classifieur optimal par minimisation du risque empirique à chaque pas.
- ▶ Cadre plus général : d'autres pénalités sont possibles :
  - ▶ LogitBoost :  $l(y, f(x)) = \log_2 (1 + \exp [-2y.f(x)])$
  - ▶  $L_2$  Boost :  $l(y, f(x)) = (y - f(x))^2/2$
  - ▶ DoomII :  $l(y, f(x)) = 1 - \tanh(y.f(x))$
  - ▶ Savage :  $l(y, f(x)) = \frac{1}{(1+\exp(2y.f(x)))^2}$
- ▶ DoomII et Savage sont non-convexes → plus robustes aux données bruitées

# Gradient Boosting

## Pourquoi Gradient Boosting ?

- ▶ Chaque étape minimise le risque empirique :  $\mathcal{L}(F_T) = \sum_{n=1}^N l(y_n, F_T(x_n))$  où  $l$  est un coût (*loss*)
- ▶ Lors de la variante additive d'adaboost,  $\alpha_T f_T(x)$  peut donc être vu comme le *weak learner* qui approxime le mieux le pas d'une descente de gradient dans l'espaces des fonctions de classification
- ▶ Une version exacte de la descente de gradient donne les Gradient Boosting Models :  $F_T(x) = F_{T-1}(x) + \alpha_T \sum_{i=1}^N \nabla_{F_{T-1}} l(y_i, f_{T-1}(x_i))$

# Boosting : Résumé

---

## Points clés du boosting

- ▶ Agrégation adaptative de classificateurs moyens
- + Résultats théoriques sur la convergence et l'optimalité du classifieur final
- + Très efficace (améliore n'importe quel ensemble de classificateurs)
- + Assez facile à mettre en oeuvre (moins vrai pour Gradient Boosting)
- Sensibilité aux données aberrantes, surapprentissage

## Utilisations

- ▶ Choix du *weak learner* : ne doit pas être trop bon, sinon surapprentissage
- ▶ Choix de la pénalité en fonction du bruit des données
- ▶ Variantes pour la classification et la régression

# Cours n°2 : Arbres de décision et méthodes ensemblistes

## Notions phares du jour

- ▶ Arbres de décision (vote, homogénéité)
- ▶ Aggrégation de classifieurs
- ▶ Bagging, Random Forests
- ▶ Boosting, GradientBoost

## Concepts généraux

- ▶ Classification / régression
- ▶ Bagging et randomisation (Forêts aléatoires)
- ▶ Construction adaptative à partir de *weak learners* et optimisation dans l'espace des classifieurs (Boosting)

# Références |

- [1] Leo Breiman.  
Bagging predictors.  
*Machine learning*, 24(2) :123–140, 1996.
- [2] Leo Breiman.  
Random forests.  
*Machine learning*, 45(1) :5–32, 2001.
- [3] Leo Breiman, Jerome H Friedman, Richard A Olshen, and Charles J Stone.  
*Classification and regression trees*.  
Routledge, 2017.
- [4] Tianqi Chen and Carlos Guestrin.  
Xgboost : A scalable tree boosting system.  
In *Proceedings of the 22nd ACM SIGKDD international conference on knowledge discovery and data mining*, pages 785–794, 2016.
- [5] Yoav Freund and Robert E Schapire.  
A decision-theoretic generalization of on-line learning and an application to boosting.  
*Journal of computer and system sciences*, 55(1) :119–139, 1997.
- [6] Jerome H Friedman.  
Greedy function approximation : a gradient boosting machine.  
*Annals of statistics*, pages 1189–1232, 2001.
- [7] Jerome H Friedman.  
Stochastic gradient boosting.  
*Computational statistics & data analysis*, 38(4) :367–378, 2002.
- [8] Donald Geman and Bruno Jedynak.  
Model-based classification trees.  
*IEEE Transactions on Information Theory*, 47(3) :1075–1082, 2001.

## Références II

- [9] Trevor Hastie, Robert Tibshirani, and Jerome Friedman.  
*The elements of statistical learning.*  
Springer, 2009.
- [10] Hyafil Laurent and Ronald L Rivest.  
Constructing optimal binary decision trees is np-complete.  
*Information processing letters*, 5(1) :15–17, 1976.