RÉSEAU DE NEURONES - COMPLÉMENTS INTRODUCTION AU DEEP LEARNING

Théo Lopès-Quintas

BPCE Payment Services, Université Paris Dauphine

22 janvier 2024

1	Meilleure descente de gradient		
	1.1	Avec momentum	
	1.2	AdaGrad	
	1.3	RMSProp	
	1.4	Adam	
2	Échéa	Échéancier	
	2.1	Motivation	
	2.2	Classique	
	2.3	Par cycle	
3	Régul	arisation	
	3.1	Dropout	
	3.2	Couche Batch Normalization	

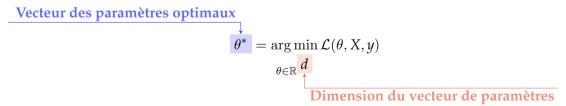
3.3

FORMULATION D'UN PROBLÈME DE MACHINE LEARNING

Dans le cadre supervisé, nous avons accès à un dataset ${\mathcal D}$ défini comme :

Nombre d'informations
$$\mathcal{D} = \left\{ (x_i, y_i) \mid \forall i \leqslant n, \ x_i \in \mathbb{R}^{d'}, y_i \in \mathcal{Y} \right\}$$
Nombre d'observations

Avec $\mathcal{Y} \subseteq \mathbb{R}$ pour un problème de régression et $\mathcal{Y} \subset \mathbb{N}$ dans le cadre d'une classification. Les problèmes de Machine Learning supervisé peuvent souvent s'écrire sous la forme d'une optimisation d'une fonction de perte $\mathcal{L}: \mathbb{R}^d \times \mathcal{M}_{n,d'} \times \mathbb{R}^n \to \mathbb{R}_+$ comme :



Dans la suite, pour simplifier les notations, nous omettrons la dépendance de \mathcal{L} en X (matrice des informations) et y (vecteur réponse). Notons qu'en général, nous avons $d \neq d'$ et dans le cas du deep learning, très souvent d >> d'.

AVEC MOMENTUM

Paramètre du momentum

$$\begin{cases} v_{t+1} &= \bigvee_{t} v_t + (1 - \bigvee_{t}) \nabla \mathcal{L}(\theta_t) \\ \theta_{t+1} &= \theta_t - \eta_t \ v_{t+1} \end{cases}$$

$$Vecteur de vélocité$$
(1)

Avec cette version, on conserve dans la mise à jour des poids la *tendance* de déplacement des poids dans l'espace des paramètres pour accélérer la descente. A noter que la valeur du momentum γ_t doit être dans l'intervalle [0,1].

La descente de gradient avec momentum peut parfois *rater* le minimum et faire machine arrière. Ce phénomène peut être mitigé à l'aide d'un choix précis du *learning rate*. Cet hyper-paramètre est de loin le paramètre le plus sensible sur l'ensemble des schémas que nous présenterons

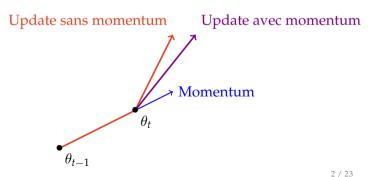


Figure – Effet du momentum sur la mise à jour des poids

ADAGRAD: UNE PREMIÈRE RÉPONSE

$$\begin{cases} g_{t+1} &= g_t + \nabla \mathcal{L}(\theta_t)^2 \quad \text{avec } g_0 = 0 \\ \theta_{t+1} &= \theta_t - \eta \frac{\nabla \mathcal{L}(\theta_t)}{\sqrt{g_{t+1}} + \varepsilon} \end{cases}$$
(AdaGrad, 2011)

Nombre pour éviter des problèmes numériques

Si le gradient a une magnitude plus importante dans une direction, elle sera privilégiée pendant l'optimisation.

AdaGrad [Duchi et al., 2011] propose de normaliser le gradient pour avoir un apprentissage *uniforme*.

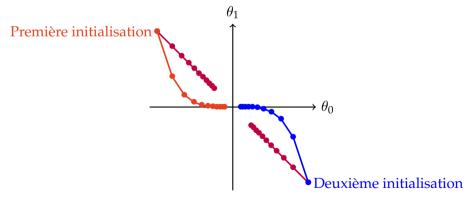


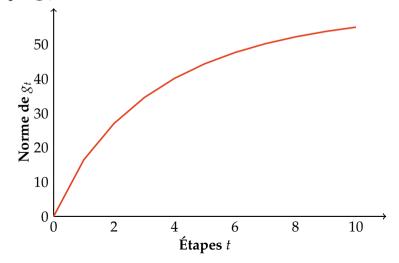
Figure – 10 étapes de descente de gradient pour la fonction $f(x, y) = x^2 + 3y^2$ avec AdaGrad pour deux initialisations différentes

3 / 23

ADAGRAD: RÉPONSE IMPARFAITE

$$\begin{cases} g_{t+1} &= g_t + \nabla \mathcal{L}(\theta_t)^2 \quad \text{avec } g_0 = 0 \\ \theta_{t+1} &= \theta_t - \eta \frac{\nabla \mathcal{L}(\theta_t)}{\sqrt{g_{t+1}} + \varepsilon} \end{cases}$$
 (AdaGrad, 2011)

Cependant avec ce schéma, AdaGrad tend à avoir un apprentissage qui ralenti au fil de l'entraînement puisque $(g_t)_t$ est croissante.



RMSPROP: DEUXIÈME RÉPONSE

Contrôle la *mémoire* des précédents gradients, $\alpha \ge 0$ $\begin{cases} g_{t+1} &= \alpha g_t + (1 - \alpha) \nabla \mathcal{L}(\theta_t)^2 \quad \text{avec } g_0 = 0 \\ \theta_{t+1} &= \theta_t - \eta \frac{\nabla \mathcal{L}(\theta_t)}{\sqrt{g_{t+1}} + \varepsilon} \end{cases}$ (RMSProp, 2012)

RMSProp [Hinton et al., 2012] cherche aussi à permettre un apprentissage uniforme dans toutes les directions, mais le fait avec une moyenne mobile exponentielle. Cela permet à $(g_t)_t$ de pouvoir décroître.

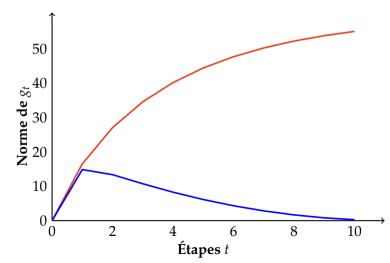


Figure – Norme de g_t pour RMSProp et AdaGrad

ADAM: COMBINER ADAGRAD ET RMSPROP

$$\begin{cases} m_{t+1} &= \beta_1 m_t + (1 - \beta_1) \nabla \mathcal{L}(\theta_t) & \text{avec } m_0 = 0 \\ \hat{m}_{t+1} &= \frac{m_{t+1}}{1 - \beta_1^{t+1}} \\ v_{t+1} &= \beta_2 v_t + (1 - \beta_2) \nabla \mathcal{L}(\theta_t)^2 & \text{avec } v_0 = 0 \\ \hat{v}_{t+1} &= \frac{v_{t+1}}{1 - \beta_2^{t+1}} \\ \theta_{t+1} &= \theta_t - \eta \frac{\hat{m}_{t+1}}{\sqrt{\hat{v}_{t+1} + \varepsilon}} \end{cases}$$
(Adam, 2014)

Adam [Kingma and Ba, 2015] s'est rapidement imposé comme un excellent schéma d'optimisation pour l'apprentissage d'un réseau de neurones. Il ressemble à une version accélérée de RMSProp, étudions plus en détail ses moyennes mobiles.

ADAM: CORRECTION DU BIAIS DE L'INITIALISATION

Si l'on reprend une partie d'Adam, par exemple pour la suite $(v_t)_{t\in\mathbb{N}}$:

$$\begin{cases} v_{t+1} &= \beta_2 v_t + (1 - \beta_2) \nabla \mathcal{L}(\theta_t)^2 & \text{avec } v_0 = 0 \\ \hat{v}_{t+1} &= \frac{v_{t+1}}{1 - \beta_2^{t+1}} \end{cases}$$

On remarque que:

$$v_{t} = \beta_{2}v_{t-1} + (1 - \beta_{2})\mathcal{L}(\theta_{t})^{2}$$

$$= \beta_{2}^{2}v_{t-2} + (1 - \beta_{2})\left[\beta_{2}\mathcal{L}(\theta_{t-1})^{2} + \mathcal{L}(\theta_{t})^{2}\right]$$

$$= \beta_{2}^{t}v_{0} + (1 - \beta_{2})\sum_{i=1}^{t}\beta_{2}^{t-i}\mathcal{L}(\theta_{i})^{2}$$

Si l'on suppose que les gradients sont identiquement distribués, on obtient :

$$\mathbb{E}\left[v_t\right] = (1 - \beta_2) \mathbb{E}\left[\mathcal{L}(\theta_t)^2\right] \sum_{i=1}^t \beta_2^{t-i} \quad \Longleftrightarrow \quad \mathbb{E}\left[v_t\right] = \mathbb{E}\left[\mathcal{L}(\theta_t)^2\right] (1 - \beta_2^t)$$

D'où on déduis la correction apportée par la suite $(\hat{v}_t)_{t\in\mathbb{N}}$. Le calcul est le même pour la suite $(\hat{m}_t)_{t\in\mathbb{N}}$.

ADAM: INTERPRÉTATION DU LEARNING RATE

Puisque les suites $(\hat{v}_t)_{t\in\mathbb{N}}$ et $(\hat{m}_t)_{t\in\mathbb{N}}$ sont des estimateurs non biaisés de $\mathbb{E}\left[\mathcal{L}(\theta_t)\right]$ et $\mathbb{E}\left[\mathcal{L}(\theta_t)^2\right]$, on doit pouvoir obtenir une information sur la mise à jour des paramètres.

On considère une variable aléatoire X telle que $\mathbb{E}[X]$ existe et $\mathbb{E}[X^2]$ existe et n'est pas nulle. Alors, puisque la fonction $x \mapsto x^2$ est une fonction convexe, avec l'inégalité de Jensen on a :

$$\mathbb{E}\left[X^{2}\right] \geqslant \mathbb{E}\left[X\right]^{2} \Longleftrightarrow \frac{\mathbb{E}\left[X\right]^{2}}{\mathbb{E}\left[X^{2}\right]} \leqslant 1 \Longleftrightarrow \frac{\left|\mathbb{E}\left[X\right]\right|}{\sqrt{\mathbb{E}\left[X^{2}\right]}} \leqslant 1$$

Dans notre cas, avec les mêmes hypothèses pour $\mathcal{L}(\theta_t)$ que pour X, on définit $\Delta_t = \theta_t - \theta_{t-1}$ et on a :

$$egin{array}{lcl} \Delta_t &=& \eta rac{\hat{m}_t}{\sqrt{\hat{v}_t}} & ext{donc} & |\Delta_t| = \eta rac{|\hat{m}_t|}{\sqrt{\hat{v}_t}} \ |\Delta_t| &\sim& \eta rac{|\mathbb{E}\left[\mathcal{L}(heta_t)
ight]|}{\sqrt{\mathbb{E}\left[\mathcal{L}(heta_t)
ight]^2}} & ext{ainsi} & |\Delta_t| \lesssim \eta \end{array}$$

QUEL OPTIMIZER CHOISIR?

De nombreuses autres possibilités existent, et chaque année plusieurs optimiseurs sont proposés. C'est pourquoi [Schmidt et al., 2021] propose de comparer équitablement quinze optimiseurs sur différentes tâches. Il en ressort deux informations :

- Adam est l'optimiseur le plus performant sur le plus de tâches, sans pour autant être clairement supérieur. RMSProp et l'accélération de Nesterov restant des alternatives très intéressantes.
- ► Choisir les meilleurs hyperparamètres est tout aussi efficace voire plus efficace que de changer d'optimiseur.

Perhaps the most important takeaway from our study is hidden in plain sight: the field is in danger of being drowned by noise. Different optimizers exhibit a surprisingly similar performance distribution compared to a single method that is re-tuned or simply re-run with different random seeds. It is thus questionable how much insight the development of new methods yields, at least if they are conceptually and functionally close to the existing population.

— Robin Schmidt, Frank Schneider et Philipp Hennig (2021)

IL FAUT UN ÉCHÉANCIER POUR SGD

On se place dans le cadre d'une optimisation d'une fonction de perte \mathcal{L} non convexe, mais β -smooth. On conserve les hypothèses (??) de l'annexe de la séance 1, et on note $\theta^* = \arg\min_{\theta \in \mathbb{R}^d} \mathcal{L}\left(\theta\right)$

Théorème 1 (Pas de descente décroissant)

On considère une descente de gradient stochastique avec η_t une suite décroissante telle que $\eta_t \in \left[0, \frac{1}{\beta}\right]$ et que :

$$\sum_{t=0}^{+\infty} \eta_t = +\infty \quad et \quad \sum_{t=0}^{+\infty} \eta_t^2 < +\infty$$

Alors, pour tout $T \ge 1$:

$$\lim_{T o +\infty} \mathbb{E} \left[rac{1}{\sum_{t=0}^{T-1} \eta_t} \sum_{t=0}^{T-1} \eta_t \|
abla \mathcal{L}\left(heta_t
ight) \|^2
ight] = 0$$

Nous n'avons plus cette fois une convergence dans un intervalle proche du minimum, mais une convergence vers un point de gradient nul. D'où la nécessité d'avoir un échéancier pour le choix du learning rate. De même pour Nesterov, nous avions besoin d'un échéancier pour le momentum.

CLASSIQUE

Les succès de l'ensemble des schémas précédents sont conditionnés à un bon choix du learning rate η , même dans le cas adaptatif. Il est possible de le conserver constant pour la totalité de l'entraînement mais il existe des **échéanciers** pour modifier η au cours de l'entraînement.

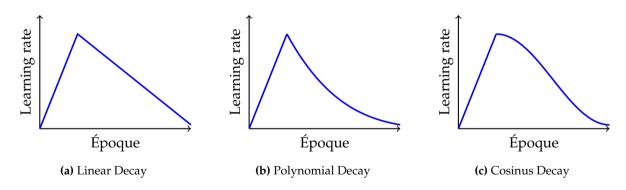


Figure – Exemples d'échanciers du learning rate avec échauffements

Il n'y a pas de consensus sur l'utilisation ou non d'un échauffement. De même, ces échéanciers tendent vers 0, mais il est plus utile de le conserver à une valeur non nulle.

PAR CYCLE

L'article *Cyclical Learning Rates for Training Neural Network* [Smith, 2017] propose une nouvelle manière de définir un échéancier ¹

The essence of this learning rate policy comes from the observation that increasing the learning rate might have a short term negative effect and yet achieve a longer term beneficial effect — Leslie Smith (2015)

La première manière de faire varier la valeur est triangulaire :

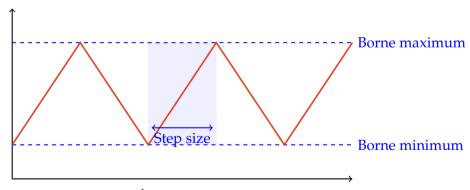
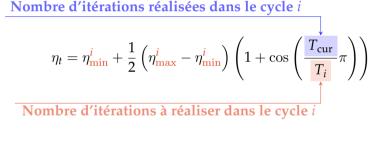


Figure – Échéancier triangulaire pour le learning rate

^{1.} A noter que cette proposition est antérieure à Attention is all you need, elle s'applique donc à l'ensemble des réseaux par construction.

PAR CYCLE ET AVEC RESTART

L'échéancier cosinus introduit en 2016 dans l'article *SGDR* : *Stochastic gradient descent with warm restart* [Loshchilov and Hutter, 2016] est devenu standard dans les réseaux Transformers ².



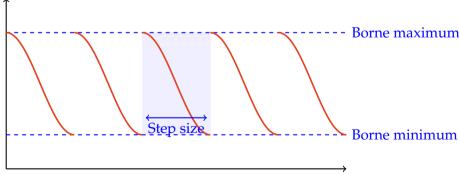


Figure – Échéancier cosinus pour le learning rate

DROPOUT

Le dropout [Srivastava et al., 2014] est introduit en 2014 par Nitish Srivastava, Geoffrey Hinton, Alex krizhevsky, Ilya Sutskever et Ruslan Salakhutinov. Lors de l'entraînement, le dropout va *supprimer* de la chaîne d'entraînement des neurones avec une proportion 1 - p à chaque couche, dont l'input, sauf l'output. On obtient à chaque passe forward un sous-ensemble du réseau initial.

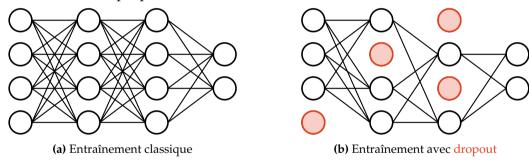


Figure – Réseau de neurones avec et sans dropout

L'exploitation du réseau de neurones nécessite comportement déterministe. Classiquement, la prédiction finale d'un ensemble est construite en faisant la moyenne arithmétique des prédictions. Ici, conserver l'ensemble des réseaux est trop coûteux en mémoire, donc nous allons approcher ce comportement en faisant la moyenne géométrique : chaque poids est multipliés par la proportion p de dropout.

COUCHE Batch Normalization

Sergey Ioffe et Christian Szegedy publie en 2015 l'article *Batch normalization : Accelerating deep network training by reducing internal covariate shift* [Ioffe and Szegedy, 2015] où l'on peut lire :

Training Deep Neural Networks is complicated by the fact that the distribution of each layer's inputs changes during training, as the parameters of the previous layers change. This slows down the training by requiring lower learning rates and careful parameter initialization, and makes it notoriously hard to train models with saturating nonlinearities

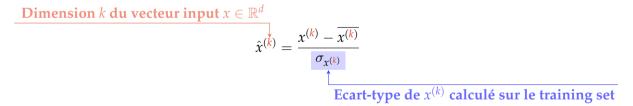
— Sergey Ioffe, Christian Szegedy (2015)

Ce phénomène est appelé l'*internal covariate shift* et fait partie de la famille des *shifts* qui existent en Machine Learning ³. Pour essayer de contrer ses effets est proposé une nouvelle couche dans un réseau de neurones : Batch Normalization.

3. Il s'agit de l'ensemble des changements qui peuvent se produire pendant l'entraînement ou l'utilisation d'un algorithme. Par exemple le changement de distribution entre le dataset de train et le dataset de test.

COUCHE Batch Normalization: PREMIÈRE APPROXIMATION

L'idée est de pousser l'idée de normaliser les inputs à l'ensemble des couches, pas seulement la première. Si nous le faisions systématiquement avec l'ensemble du dataset, alors nous devons calculer les nouvelles valeurs pour normaliser pour chaque couche à chaque époques. Donc calculer des matrices de variance-covariance ainsi que leurs racine carré inverse : c'est très coûteux. Pour tout de même approcher l'idée de normaliser chaque couche, l'article propose une première simplification. La première est que chaque dimensions du vecteur d'input sera normalisée indépendamment :



Ce genre de transformation, appliqué à chaque couche, peut changer ce que chaque couche *représente*. Normaliser les inputs d'une fonction d'activation sigmoid les contraints à être proche de 0 donc du régime presque linéaire de sigmoid.

COUCHE Batch Normalization: SECONDE APPROXIMATION

Pour ne pas le perdre, on introduit deux paramètres pour chaque couche $l\leqslant L$ que le réseau va apprendre pour permettre de conserver le pouvoir de représentation du réseau. Si l'on note z l'output de la couche Batch-Normalization, on a :

$$z^{(\mathbf{k})} = \gamma^{(\mathbf{k})} \hat{x}^{(\mathbf{k})} + \beta^{(\mathbf{k})}$$

Les paires $(\gamma^{(k)}, \beta^{(k)})$ sont apprises avec le modèle. Si l'on utilise une descente de gradient stochastique alors on ne peut plus utiliser l'ensemble du dataset pour normaliser. C'est ici qu'intervient la seconde simplification : chaque mini-batch \mathcal{B} produit une estimation de la moyenne et de la variance.

$$\hat{x}_i = \frac{1}{m} \sum_{j=1}^m x_j$$

$$\hat{x}_i = \frac{x_i - \mu_B}{\sqrt{\sigma_B^2 + \varepsilon}}$$

$$\varepsilon > 0 \text{ pour prévenir les instabilités numériques}$$

$$\sigma_B^2 = \frac{1}{m} \sum_{j=1}^m (x_i - \mu_B)^2$$

Et le résultat de la couche de batch-normalization comme : $z_i = \gamma \hat{x}_i + \beta$

COUCHE Batch Normalization: EN PRATIQUE

L'introduction de celle nouvelle brique dans l'architecture d'un réseau de neurones permet d'accélérer sa convergence, de manière saine, si l'on modifie également le reste des paramètres. Dans l'article, et dans la pratique, il est conseillé quand on utilise Batch Normalization d'augmenter le learning rate et de supprimer ou réduire le dropout par exemple.

Position de la couche

Si l'article est clair sur la position de cette couche par rapport à l'activation (fonction d'activation puis Batch Normalization), dans la pratique ce n'est pas ce qui semble fonctionner le mieux. En témoigne le commentaire de François Chollet ⁴ suite à une question sur GitHub:

I haven't gone back to check what they are suggesting in their original paper, but I can guarantee that recent code written by Christian [Szegedy] applies relu before BN. It is still occasionally a topic of debate, though.

— François Chollet (2016)

Par expérience, nous conseillons de suivre cette recommandation.

^{4.} François Chollet est un chercheur chez Google qui a, entre autre, écrit Keras et un des livres références (si ce n'est le) sur le Deep Learning.

PROBLÈME DE LA RÉGULARISATION

[Krogh and Hertz, 1991] montre qu'avoir un réseau de neurones avec une magnitude de poids faible permet de limiter le sur-apprentissage.

Une manière classique pour régulariser un réseau de neurones est de modifier la fonction de perte que l'on optimise. Le plus souvent on exploite la régularisation \mathcal{L}_2 :

$$\mathcal{L}_{\lambda}(w) = \mathcal{L}(w) + \frac{\lambda}{2} \|w\|_{2}^{2} \text{ avec } \lambda \geqslant 0$$

Dans le cas d'une descente de gradient classique, cela donne le schéma d'optimisation :

$$w_{t+1} = w_t - \eta_t \nabla \mathcal{L}_{\lambda}(w_t)$$
 par définition de la descente de gradient
$$= w_t - \eta_t \nabla \mathcal{L}(w_t) - \eta_t \lambda w_t$$
 par définition de \mathcal{L}_{λ}

Le terme supplémentaire $\eta_t \lambda w_t$ est appelé le weight decay.

Problème de la régularisation

Mais si l'on considère une descente de gradient avec momentum :

$$v_{t+1} = \beta v_t + (1 - \beta) \nabla \mathcal{L}_{\lambda}(w_t) \quad \text{par d\'efinition}$$

$$= \beta v_t + (1 - \beta) \left[\nabla \mathcal{L}(w_t) + \lambda w_t \right] \quad \text{par d\'efinition de } \mathcal{L}_{\lambda}$$

$$w_{t+1} = w_t - \eta_t \left(\beta v_t + (1 - \beta) \left[\nabla \mathcal{L}(w_t) + \lambda w_t \right] \right)$$

$$= w_t - \eta_t \beta v_t - \eta_t (1 - \beta) \nabla \mathcal{L}(w_t) - \eta_t (1 - \beta) \lambda w_t$$

Autrement dit, nous avons une propagation de la régularisation dans le schéma de descente, ce qui n'est pas souhaité. Pour conserver le comportement observé dans une descente de gradient classique, [Loshchilov and Hutter, 2019] propose simplement de modifier le schéma de descente plutôt que la fonction de perte.

Ainsi, dès lors que l'on utilise une méthode *adaptative*, il faut préférer le **weight decay** à la régularisation \mathcal{L}_2 . L'omniprésence d'Adam dans la littérature a amené à la création d'AdamW qui est Adam intégrant le weight decay.

BIBLIOGRAPHIE I

Duchi, J., Hazan, E., and Singer, Y. (2011).

Adaptive subgradient methods for online learning and stochastic optimization.

Journal of machine learning research.

Hinton, G., Srivastava, N., and Swersky, K. (2012).

Neural networks for machine learning lecture 6a overview of mini-batch gradient descent.

Cited on.

Hoffmann, J., Borgeaud, S., Mensch, A., Buchatskaya, E., Cai, T., Rutherford, E., Casas, D. d. L., Hendricks, L. A., Welbl, J., Clark, A., et al. (2022).

Training compute-optimal large language models.

arXiv preprint arXiv:2203.15556.

Ioffe, S. and Szegedy, C. (2015).

Batch normalization: Accelerating deep network training by reducing internal covariate shift.

International conference on machine learning.

Kingma, D. P. and Ba, J. (2015).

Adam: A method for stochastic optimization.

In International Conference on Learning Representations (ICLR).

BIBLIOGRAPHIE II

The Example 1 Krogh, A. and Hertz, J. (1991).

A simple weight decay can improve generalization.

Advances in neural information processing systems.

Loshchilov, I. and Hutter, F. (2016).

Sgdr: Stochastic gradient descent with warm restarts. *arXiv* preprint arXiv: 1608.03983.

lackspace Loshchilov, I. and Hutter, F. (2019).

Decoupled weight decay regularization.

International Conference on Learning Representations (ICLR).

Schmidt, R. M., Schneider, F., and Hennig, P. (2021).

Descending through a crowded valley-benchmarking deep learning optimizers. In *International Conference on Machine Learning*. PMLR.

Smith, L. N. (2017).

Cyclical learning rates for training neural networks.

In 2017 IEEE winter conference on applications of computer vision (WACV), pages 464–472. IEEE.

Srivastava, N., Hinton, G., Krizhevsky, A., Sutskever, I., and Salakhutdinov, R. (2014). Dropout: a simple way to prevent neural networks from overfitting. *The journal of machine learning research.*

BIBLIOGRAPHIE III