

Méthodes d'ensemble

Véronique Tremblay

Objectif

- Brève introduction aux méthodes d'ensemble

Méthodes d'ensemble

Une méthode d'ensemble est un ensemble de modèles dont les prédictions sont combinées d'une certaine manière afin d'obtenir une prédiction généralement plus stable.

Instabilité

Un algorithme pour construire un modèle de prédiction est dit **instable** si de petits changements dans les données d'apprentissage engendrent de grands changements dans le modèle et possiblement aussi dans les valeurs prédites par ce dernier.

Les différentes stratégies ensemblistes

- *bagging* et forêts aléatoires

Les différentes stratégies ensemblistes

- *bagging* et forêts aléatoires
- *boosting*, *gradient boosting* et *xgboost*

Les différentes stratégies ensemblistes

- *bagging* et forêts aléatoires
- *boosting*, *gradient boosting* et *xgboost*
- *stacking*