

TRAVAUX DIRIGÉS N° 3 : Séparateurs linéaires

Stéphan CLÉMENÇON <stephan.clemencon@telecom-paristech.fr>
Emilie CHAUTRU <emilie.chautru@mines-paristech.fr>

EXERCICE 1. On se place dans le cadre de la classification binaire : soient un descripteur aléatoire X à valeurs dans \mathbb{R} muni de sa tribu des Boréliens, et un label aléatoire Y valant 0 ou 1.

Soit $\mathbb{G} := \{g : \mathbb{R} \rightarrow \{0, 1\}\}$ l'ensemble des classifieurs adaptés à ce contexte. L'erreur de classification est définie comme l'application $L : g \in \mathbb{G} \mapsto \mathbb{P}(Y \neq g(X)) \in [0, 1]$ et on note $L^* := \inf_{g \in \mathbb{G}} L(g)$.

Dans cet exercice, on s'intéresse à la famille des classifieurs linéaires sur \mathbb{R}

$$\mathcal{G} := \{g_{(x,y)} : z \in \mathbb{R} \mapsto y \mathbb{1}_{\{z \leq x\}} + (1-y) \mathbb{1}_{\{z > x\}} : (x, y) \in \mathbb{R} \times \{0, 1\}\}.$$

Pour $(x, y) \in \mathbb{R} \times \{0, 1\}$, l'erreur de classification de $g_{(x,y)} \in \mathcal{G}$ est notée plus simplement $L(x, y)$. On pose $L_0 := \inf_{(x,y) \in \mathbb{R} \times \{0,1\}} L(x, y)$.

- 1) Exprimer l'erreur de classification d'un élément quelconque de \mathcal{G} en fonction des lois conditionnelles de X sachant Y . On utilisera les notations $F_y(x) := \mathbb{P}\{X \leq x \mid Y = y\}$ pour $(x, y) \in \mathbb{R} \times \{0, 1\}$ et $p := \mathbb{P}(Y = 1)$.

- 2) En faisant tendre x vers $-\infty$, montrer que $L_0 \leq \frac{1}{2}$.

- 3) Montrer que $L_0 = \frac{1}{2} - \sup_{x \in \mathbb{R}} \left| p F_1(x) - (1-p) F_0(x) - p + \frac{1}{2} \right|$. Simplifier l'expression quand $p = \frac{1}{2}$.

Indication. Pour tout $(a, b) \in \mathbb{R}^2$ on peut écrire $\min(a, b) = \frac{a + b - |a - b|}{2}$.

- 4) Montrer que $L_0 = \frac{1}{2}$ si et seulement si $L^* = \frac{1}{2}$.

- 5) Montrer l'inégalité de Chebychev-Cantelli : pour toute variable aléatoire réelle Z de carré intégrable et tout $t \geq 0$,

$$\mathbb{P}(Z - \mathbb{E}(Z) \geq t) \leq \frac{\mathbb{V}(Z)}{\mathbb{V}(Z) + t^2}.$$

- 6) Supposons maintenant que X est de carré intégrable. Pour $y \in \{0, 1\}$, on note alors respectivement m_y et σ_y^2 l'espérance et la variance de la loi conditionnelle de X sachant $Y = y$. Montrer que

$$L_0 \leq \left(1 + \frac{(m_0 - m_1)^2}{(\sigma_0 + \sigma_1)^2} \right)^{-1}.$$

Indication. Utiliser l'inégalité démontrée à la question précédente.

- 7) Discuter de la performance du minimiseur empirique pris dans la classe \mathcal{G} et des limites des classifieurs linéaires.