

# Deep learning pour les nuls par les nuls

C. Ambroise et S. Donnet pour HappyR

Mai 2018

## Introduction : apprentissage supervisé

## Exemple : reconnaissance de chiffres



Figure 1: Reconnaissance de chiffres écrits à la main

## Exemple : reconnaissance de chiffres

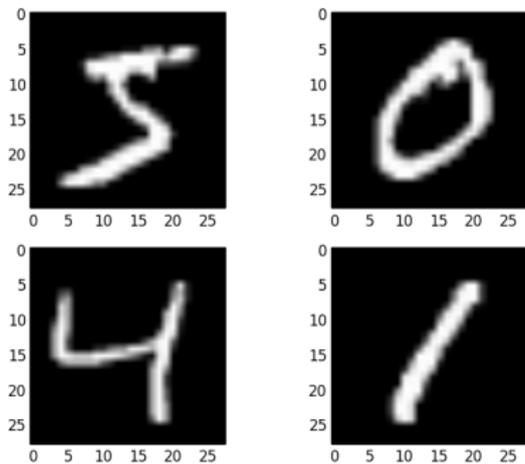


Figure 2: Reconnaissance de chiffres écrits à la main

- ▶ Chaque image  $i$  de chiffre est de taille  $28 \times 28 = 784$  pixels
- ▶ A chaque pixel  $j$  est associé un niveau de gris  $x_i^j \in \{0, \dots, 255\}$

## Example 1: reconnaissance de chiffres

- ▶ Les niveaux de gris stockés dans un vecteur  $\mathbf{x}_i = (x_i^r)_{r=1\dots p}$ ,  
 $p = 784$
- ▶  $y_i \in \{0, \dots, 9\}$  : connu pour l'échantillon d'apprentissage
- ▶  $y$  doit être prédit pour une nouvelle image  $\mathbf{x}$

# Formellement

- ▶ On considère  $n$  objets (images, textes, son...), décrits par  $p$  caractéristiques.
- ▶ Pour chaque objet  $i$ , ces caractéristiques sont stockées dans un vecteur  $\mathbf{x}_i = (x_i^1, \dots, x_i^p)$  de  $\mathbb{R}^p$ .
- ▶ A chaque objet  $i$  est affectée une variable de sortie  $y_i$ .
  - ▶ Si  $y_i \in \mathbb{R}^p$  : on parle de régression
  - ▶ Si  $y_i \in E$  avec  $E$  ensemble fini ( $E = \{0, 1\}$ ;  $E = \{0, \dots, 9\}$ ), on parle de discrimination, classement, reconnaissance de forme
- ▶ **But:** prédire la sortie  $y$  pour un nouvel ensemble de caractéristiques  $\mathbf{x}$
- ▶ **Comment:** apprendre (sur un jeu de données d'apprentissage = training) une règle de prédiction ou classification et fournir cette règle pour l'appliquer à  $\mathbf{x}$

## Autres exemples

- ▶ Reconnaissances de visages sur des photos  $E = \{\text{membres d'une famille}\}$
- ▶ Reconnaissance du bord politique par l'analyse des discours

# Différence entre estimation ou apprentissage?

- ▶ Tradition statistique / estimation :
  - ▶ Notion de modèle centrale avec une finalité explicative
  - ▶ Recherche à approcher la réalité, modèle éventuellement basé sur une théorie physique, économique,
  - ▶ Interprétation du rôle de chaque variable explicative prépondérante dans la démarche.
- ▶ Apprentissage : l'objectif est essentiellement la prédiction,
  - ▶ meilleur modèle n'est pas nécessairement celui qui ajusterait le mieux le vrai modèle.
  - ▶ cadre théorique est différent et les majorations d'erreur requièrent une autre approche : choix basés sur des critères de qualité de prédiction
  - ▶ l'interprétabilité passe au deuxième plan.

## Et le bon vieux modèle linéaire (généralisé) dans tout ça?

$$y_i \sim \mathcal{F} \quad \text{avec} \quad \phi(\mathbb{E}[y_i]) = \mathbf{x}^T \beta$$

- ▶ Si les dimensions du problèmes ( $n, p$ ) sont raisonnables
- ▶ Si les hypothèses relatives au modèle (linéarité) et aux distributions sont vérifiées
- ▶ ALORS : les techniques statistiques de modélisation tirées du modèle linéaire général sont optimales (maximum de vraisemblance)
- ▶ On ne fera pas mieux, surtout dans le cas d'échantillons de taille restreinte

# MAIS

- ▶ Dès que les hypothèses distributionnelles ne sont pas vérifiées,
- ▶ Dès que les relations supposées entre les variables ou la variable à modéliser ne sont pas linéaires
- ▶ Dès que le volume des données (big data) est important,

On se tournera vers d'autres méthodes qui viennent concurrencer les modèles statistiques rudimentaires.

Deep learning

# Deep learning: introduction

- ▶ Définition (tentative): ensemble de méthodes d'apprentissage cherchant à modéliser les données avec des architectures complexes combinant diverses transformations non-linéaires.

$$\mathbf{x} \mapsto f(\mathbf{x}, \theta) \text{ telle que } y \simeq f(\mathbf{x}, \theta)$$

- ▶ Les briques élémentaires du Deep Learning sont les **réseaux neuronaux**.
- ▶ Ces briques sont combinées pour former des **réseaux de neurones profonds**.

# Domaines d'application

Ces techniques ont permis des progrès significatifs dans les domaines suivants:

- ▶ traitement d'image et de son : reconnaissance faciale, reconnaissance automatique de la parole (transformation d'une voix en texte écrit),
- ▶ vision par ordinateur : imiter la vision humaine (machine voyant plusieurs objets à la fois)
- ▶ Traitement automatique du langage naturel
- ▶ Classification de textes (par exemple détection de spam)

Quantité infinie d'applications potentielles

## Différentes types d'architectures pour les réseaux neuronaux

- ▶ *Les perceptrons multicouches* : les plus vieux et les plus simples
- ▶ *Les réseaux neuronaux convolutifs* : très performants pour le traitement d'image
- ▶ *Les réseaux neuronaux récurrents*, utiles pour les données séquentielles (textes ou séries temporelles)
- ▶ Tous sont basés sur des cascades profondes de couches
- ▶ Requier des algorithmes d'optimisation intelligent (stochastiques en général), une initialisation minutieuse et un choix malin de structure.
- ▶ Résultats impressionnants mais peu de justifications théoriques pour l'instant

# Neurone artificiel

- ▶ **Un neurone** est une application non linéaire en ses paramètres qui, à un vecteur  $\mathbf{x}$  d'entrée associe une sortie  $f(\mathbf{x})$  :
- ▶ Plus précisément, le  $j$ -ième neurone artificiel  $f_j$  s'écrit

$$f_j(\mathbf{x}) = \phi(\langle w_j, \mathbf{x} \rangle + b_j)$$

où

- ▶  $\langle w_j, \mathbf{x} \rangle = \sum_{r=1}^p w_j^r x^r$
- ▶ Les quantités  $w_j = (w_j^1, \dots, w_j^p)$  pondèrent les variables d'entrée  $(x^1, \dots, x^p)$
- ▶  $b_j$  est appelé le biais du neurone  $j$ .
- ▶  $\phi$  est appelée fonction d'activation

## Modèle basique à un neurone

On explique la variable de sortie  $y$  par

$$y \simeq f(\mathbf{x}, \theta) = \phi(\langle w, \mathbf{x} \rangle + b)$$

Si  $\phi(z) = z$  et un seul neurone  $\Rightarrow$  modèle linéaire simple

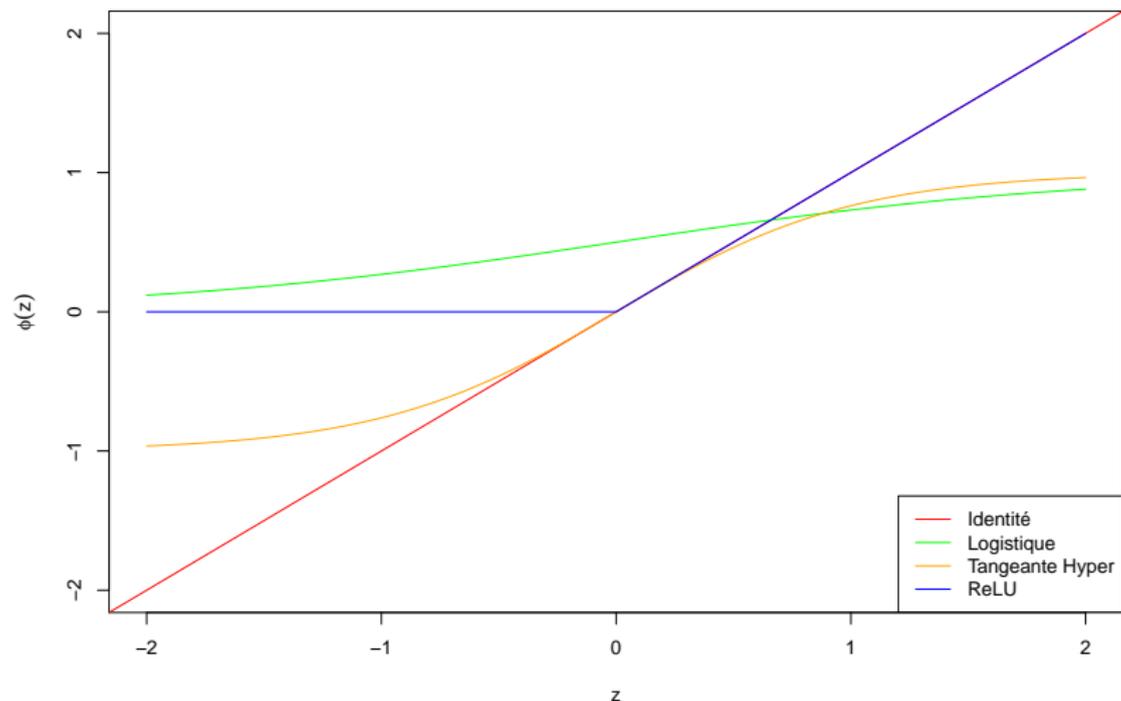
## Choix de la fonction d'activation $\phi$

- ▶ Si  $Y \in \{0, 1\}$  et on souhaite prédire  $P(Y = 1|x)$  : la logistique  
 $\phi(z) = \frac{1}{1+e^{-z}} \in [0, 1]$
- ▶ *Généralisation*: Si  $Y \in E$  ( $E$  espace fini) et prédiction de  $P(Y = e|x)$  : *softmax*

$$\phi(z) = \left( \frac{e^{z_e}}{\sum_{e \in E} e^{z_e}} \right)_{e \in E}$$

- ▶ La fonction tangente hyperbolique:  $\phi = \tanh : \mathbb{R} \mapsto [-1, 1]$
- ▶ La fonction de seuil:  $\phi(z) = 1_{z>s} \in \{0, 1\}$
- ▶ La partie positive: **rectified linear unit (ReLU)**  
 $\phi(z) = \max(z, 0)$ 
  - ▶ Permet de prédire des valeurs positives. Continue mais non dérivable

# Propriétés



Différentes propriétés de différentiabilité : important au moment de l'optimisation des  $w$  et  $b$

# Réseaux de neurones ou perceptrons multicouches

- ▶ Structure composée de différentes couches cachées de neurones dont la sortie sert d'entrée aux neurones de la couche suivante
- ▶ Les fonctions d'activations sont les mêmes dans les différentes couches, seule la dernière est différente (à adapter à l'objectif : classification ou régression)

## Exemple

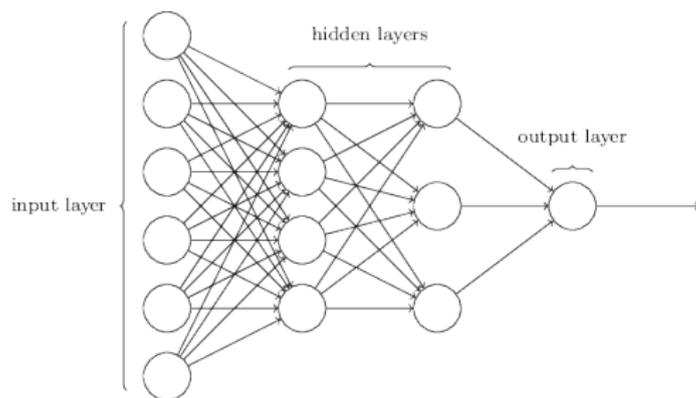


Figure 3: Exemple de réseau de neurones

- ▶ Input layer : autant de noeuds que de variables  $x^r$  :  $p$
- ▶ Hidden layer : nombre de neurones à fixer (ici 4 puis 3)
- ▶ Output layer : 1 noeud =  $y$

## Réseau de neurones: formellement

On note  $J_\ell$  le nombre de neurones de la couche  $\ell$

- ▶ Couche 0 :  $h^0(\mathbf{x}) = \mathbf{x} \in \mathbb{R}^p$
- ▶ Pour les couches cachées  $\ell = 1 \dots L$ :
  - ▶ On crée  $J_\ell$  neurones : pour tout  $j = 1 \dots J_\ell$  :

$$\begin{aligned}a_j^{(\ell)}(\mathbf{x}) &= b_j^{(\ell)} + \sum_{m=1}^{J_{\ell-1}} W_{jm}^{(\ell)} h_m^{(\ell-1)}(\mathbf{x}) \\ &= b_j^{(\ell)} + \langle W_j^{(\ell)}, h^{(\ell-1)}(\mathbf{x}) \rangle\end{aligned}$$

$$h_j^{(\ell)}(\mathbf{x}) = \phi(a_j^{(\ell)}(\mathbf{x}))$$

- ▶ Vectoriellement :

$$\mathbf{a}^{(\ell)}(\mathbf{x}) = \mathbf{b}^{(\ell)} + W^{(\ell)} h^{(\ell-1)}(\mathbf{x}) \in \mathbb{R}^{J_\ell}$$

$$\mathbf{h}^{(\ell)}(\mathbf{x}) = \phi(\mathbf{a}^{(\ell)}(\mathbf{x}))$$

où  $W^{(\ell)}$  est une matrice  $J_\ell \times J_{\ell-1}$

## Réseau de neurones: formellement

- Pour la dernière couche :  $\ell = L + 1$ :

$$a^{(L+1)}(\mathbf{x}) = b^{(L+1)} + W^{(L+1)}h^{(L)}(\mathbf{x}) \in \mathbb{R}^J$$

$$h^{(L+1)}(\mathbf{x}) = \psi(a^{(L+1)}(\mathbf{x}))$$

## Réseau de neurones: finalement

- ▶  $W^{(\ell)}$  est une matrice de poids de taille  $J_\ell$  lignes et  $J_{\ell-1}$  colonnes
- ▶  $W^{(L+1)}$  est une matrice de poids de taille 1 lignes et  $J_L$  colonnes si  $y \in \mathbb{R}$

▶

$$\mathbf{x} \mapsto f(\mathbf{x}, \theta) = \psi(a^{(L+1)}(\mathbf{x}))$$

- ▶ Si on fait de la régression  $\psi(z) = z$ ,
- ▶ Si on fait de la classification en deux classes,  $\psi$  est la sigmoïde (prédiction dans  $[0, 1]$ ).
- ▶ Si on fait de la classification en plusieurs classes :  $\psi = \textit{softmax}$

## Réseau de neurones:

- ▶ Architecture basique puisque chaque couche dépend de la couche précédente et non des neurones de la même couche ( $\Rightarrow$  réseaux de neurones récurrents)
- ▶ Paramètres de l'architecture:
  - ▶ nombre de couches
  - ▶ nombre de neurones dans chaque couche
  - ▶ fonctions d'activation des couches cachées ( $\phi$ ) et de la dernière ( $\psi$ )
- ▶ Pour la dernière fonction  $\psi$ , guidé par le problème
  - ▶ Si régression :  $\psi = id$  ou  $g$
  - ▶ Si classification sigmoïde ( $\{0, 1\}$ ) ou softmax (classification avec plus de deux catégories)

# Réseaux neuronaux récurrents

- ▶ La sortie d'un neurone peut servir d'entrée à un neurone de la même couche ou d'une couche précédente.

## Justification théorique

Hornik (1991) a prouvé que toute fonction régulière bornée de  $\mathbb{R}^p$  dans  $\mathbb{R}$  peut être approchée pour un réseau de neurones avec une couche cachée contenant un nombre fini de neurones et ayant la même fonction d'activation et  $\psi = id$ .

- ▶ Théorème intéressant d'un point de vue théorique
- ▶ En pratique : nombre de neurones de la couche cachée peut être très grand.
- ▶ Force du deep learning : dans le nombre de couches cachées

## Estimation des paramètres

# Fonction de perte

- ▶ Paramètres à estimer :  $\theta =$  poids  $W^{(\ell)}$  et biais  $b_j^{(\ell)}$
- ▶ Classiquement : estimation par maximisation de la (log)-vraisemblance
- ▶ Fonction de perte:  $= -\log$  vraisemblance
  - ▶ Cas de la régression :  $Y \sim \mathcal{N}(f(\mathbf{x}, \theta), I)$

$$\ell(f(\mathbf{x}, \theta), Y) = \|Y - f(\mathbf{x}, \theta)\|^2$$

- ▶ Cas de la classification  $\{0, 1\}$  :  $Y \sim \mathcal{B}(1, f(\mathbf{x}, \theta))$

$$\ell(f(\mathbf{x}, \theta), Y) = -Y \log(f(\mathbf{x}, \theta)) - (1 - Y) \log(1 - f(\mathbf{x}, \theta))$$

(cross-entropy)

- ▶ Cas de la classification multiclass

$$\ell(f(\mathbf{x}, \theta), Y) = - \sum_{e \in E} \mathbf{1}_{Y=e} \log p_{\theta}(Y = e | \mathbf{x})$$

## Fonction de perte : remarque

- ▶ Idéalement on voudrait minimiser l'erreur de classification mais cette fonction n'est pas dérivable. . .
- ▶ On lui préférera la “cross-entropy”

## Risque empirique pénalisé

- ▶ Expected loss :  $\mathbb{E}_Y[\ell(f(\mathbf{x}, \theta), Y)]$
- ▶ Risque empirique : on considère un échantillon d'entraînement  $(\mathbf{x}_i, Y_i)_{i=1\dots n}$

$$L_n(\theta) = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n \ell(f(\mathbf{x}_i, \theta), Y_i)$$

- ▶ Pénalisation :

$$L_n(\theta) = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n \ell(f(\mathbf{x}_i, \theta), Y_i) + \lambda \Omega(\theta)$$

avec par exemple  $\Omega(\theta) = \sum_{\ell, i, j} W_{ij}^{(\ell)}$

# Descente de gradient stochastique. Rumelhart et al (1988)

- ▶ Choisir un vecteur initial de paramètres  $\theta$ , et un taux d'apprentissage  $\eta$
- ▶ Répéter jusqu'à ce qu'un minimum approché (assez précisément) soit obtenu:
  - ▶ Diviser aléatoirement l'échantillon d'apprentissage en  $B$  sous-échantillons (batch) de taille  $m$
  - ▶ Pour chacun des batch  $B$  poser:

$$\theta := \theta - \eta \frac{1}{m} \sum_{i \in B} \nabla_{\theta} \ell(f(\mathbf{x}_i, \theta), Y_i) + \lambda \nabla_{\theta} \Omega(\theta)$$

## Remarques:

- ▶ Chaque itération est appelée *epoch*.
- ▶ Le nombre d'epochs est un paramètre à régler.

# Calcul du gradient pour la régression

- ▶  $Y \in \mathbb{R}$ .
- ▶  $R_i = \ell(f(\mathbf{x}_i, \theta), Y_i) = (Y_i - f(\mathbf{x}_i, \theta))^2$
- ▶ Fonctions d'activation  $\psi$  et  $\phi$  quelconques

## Dérivées partielles de $R_i$ par rapport aux poids de la dernière couche

- ▶ Dérivées de  $R_i = (Y_i - f(\mathbf{x}_i, \theta))^2 = (Y_i - h^{(L+1)}(\mathbf{x}_i))^2$  par rapport à  $(W_j^{(L+1)})_{j=1\dots J_L}$



$$\begin{aligned} f(\mathbf{x}, \theta) &= h^{(L+1)}(\mathbf{x}) \\ &= \psi(a^{(L+1)}(\mathbf{x})) \\ &= \psi\left(b^{(L+1)} + \sum_{j=1}^{J_L} W_j^{(L+1)} h_j^{(L)}(\mathbf{x})\right) \end{aligned}$$



$$\frac{\partial R_i}{\partial W_j^{(L+1)}} = -2(Y_i - f(\mathbf{x}_i, \theta)) \psi'(a^{(L+1)}(\mathbf{x}_i)) h_j^{(L)}(\mathbf{x}_i)$$

## Dérivées partielles de $R_i$ par rapport aux poids de l'avant-dernière couche

- ▶ Dérivées de  $R_i = \left( Y_i - h^{(L+1)}(\mathbf{x}_i) \right)^2$  par rapport à  $(W_{jm}^{(L)})_{j=1 \dots J_L, m=1 \dots J_{L-1}}$



$$\frac{\partial R_i}{\partial W_{jm}^{(L)}} = -2(Y_i - f(\mathbf{x}_i, \theta)) \psi' \left( a^{(L+1)}(\mathbf{x}_i) \right) \frac{\partial}{\partial W_{jm}^{(L)}} a^{(L+1)}(\mathbf{x}_i)$$

## Dérivées partielles de $R_i$ par rapport aux poids de l'avant-dernière couche

$$\begin{aligned}a^{(L+1)}(\mathbf{x}) &= b^{(L+1)} + \sum_{j=1}^{J_L} W_j^{(L+1)} h_j^{(L)}(\mathbf{x}) \\ &= b^{(L+1)} + \sum_{j=1}^{J_L} W_j^{(L+1)} \phi \left( b_j^{(L)} + \sum_{m=1}^{J_{L-1}} W_{jm}^{(L)} h_m^{(L-1)}(\mathbf{x}) \right)\end{aligned}$$

$$\begin{aligned}\frac{\partial}{\partial W_{jm}^{(L)}} a^{(L+1)}(\mathbf{x}_i) &= W_j^{(L+1)} \phi' \left( b_j^{(L)} + \sum_{m=1}^{J_{L-1}} W_{jm}^{(L)} h_m^{(L-1)}(\mathbf{x}_i) \right) \\ &\quad \times h_m^{(L-1)}(\mathbf{x}_i) \\ &= W_j^{(L+1)} \phi'(a_j^L(\mathbf{x}_i)) h_m^{(L-1)}(\mathbf{x}_i)\end{aligned}$$

## Forward Backward (en travaillant un peu) (à chaque itération)

- ▶ Etant données des paramètres courant
- ▶ **Etape de forward** : De la couche 1 vers la couche  $L + 1$ , on calcule les  $a_j^\ell(\mathbf{x}_i), \phi(a_j^\ell(\mathbf{x}_i))$
- ▶ **Etape de backward** : De la couche  $L + 1$  vers la couche 1, on calcule les dérivées partielles (formule de mise à jour par récurrence)

# Réglages de l'algorithme

- ▶  $\eta$ : taux d'apprentissage de la descente de gradient
  - ▶ si  $\eta$  trop petit, convergence très lente avec possiblement atteinte d'un minimum local
  - ▶ si  $\eta$  trop grand, oscillation autour d'un optimum sans stabilisation
  - ▶ choix adaptatif du  $\eta$  ( $\eta$  décroissant)
- ▶ Calculs en batch permet de ne pas avoir à stocker trop de quantités dans le forward / backward
- ▶ Evidemment multiples autres versions de l'algorithme de maximisation (momentum correction, Nesterov accelerated gradient, etc. . . )

Réseaux neuronaux plus complexes

## Réseaux neuronaux convolutifs (LeNet by LeCun et al., 1998)

- ▶ Lors du passage de l'image au vecteur : perte de la cohérence spatiale des images (formes...)
- ▶ Réseaux neuronaux convolutifs ont révolutionné l'analyse d'images (LeCun)
- ▶ CNN (convolutive neuronal networks) : composés de différentes couches de convolution, pooling et couches complètement connectées.

## En une image

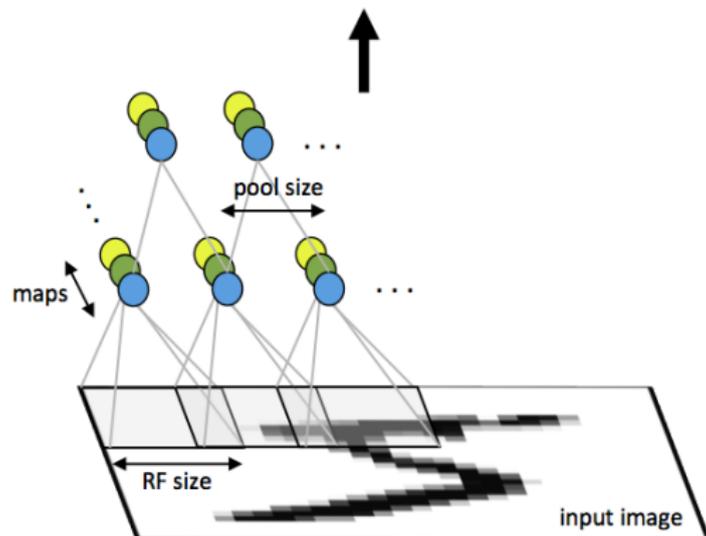


Figure 4: Architecture d'un réseau de neurone convolutif (crédit Stanford)

## Couche de convolution

- ▶ Image  $\mathcal{I}(u, v)$  : chaque pixel  $(u, v)$  est décrit par  $C$  niveaux de couleurs (channels), par exemple RGB (bleu, vert, rouge)  $\Rightarrow$  tableau de taille  $(M, N, C)$
- ▶ Chaque neurone basée sur une combinaison linéaire des signaux sur une petite région de l'image

$$K_{u,v} * \mathcal{I}(c) = \sum_{n=-k}^k \sum_{m=-k}^k K_I(n, m, c) \mathcal{I}(u + m, v + n, c)$$

$$h_{u,v} = \phi(K_{u,v} * \mathcal{I}(c) + b_{u,v})$$

- ▶ On obtient un nouveau neurone en déplaçant cette fenêtre
  - ▶ si on déplace peu : redondance de l'information
  - ▶ si on déplace beaucoup : perte d'information

## Couche de pooling (subsampling)

- ▶ Faire des moyennes ou prendre des max sur des petites régions
- ▶  $\phi$  peut être appliquée avant ou après le pooling
- ▶ Permet de réduire la dimension (nombre de variables à traiter) mais aussi de rendre le réseau moins sensible aux translations éventuelles de l'image

## Ensuite

- ▶ Après plusieurs couches et convolution / pooling, on applique une ou plusieurs couches des *fully connected layers* (= réseau montré avant)

# Vers des architectures de réseaux de plus en plus complexes

- ▶ Réseaux maintenant beaucoup plus complexes
- ▶ Possible de le traiter grâce aux cartes GPU (Graphical Processor Unit)
- ▶ Résultats du *Large Scale Visual Recognition Challenge (ILSVRC)*

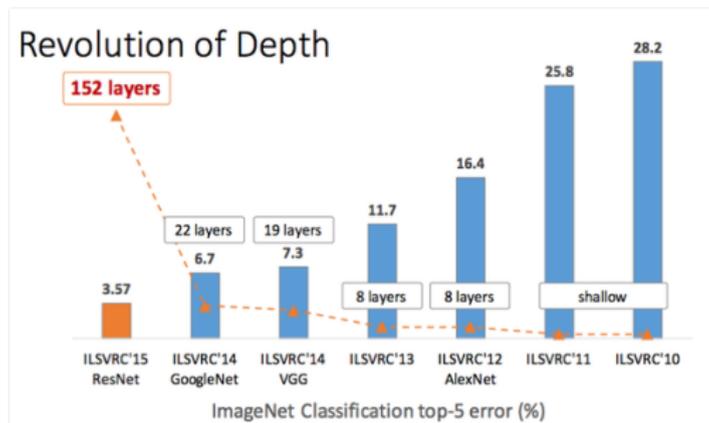


Figure 5: Taux d'erreur et nombre de couches