

S minaire Transport Optimal

vendredi 8 mars 2019,

UFR Sciences d'Angers, b timent L,

organis  par Fabien Panloup, Nicolas Delanoue et David Rousseau.



La SFR Math-STIC vous propose un s minaire autour du probl me de transport optimal avec des  clairages fondamentaux en informatique, signal-image, math matiques et des focus applicatifs de la th orie du transport optimal en traitement d'images et des donn es.

Accueil caf  12H30-13H00.

- 13h00-14h00 : Introduction au transport optimal, Nicolas Delanoue (Ma tre de conf rences HDR, Laboratoire LARIS - Universit  d'Angers)
- 14h00-15h00 : Optimal transport for target shift and feature selection, Ievgen Redko (Ma tre de conf rences, UMR CNRS 5516, Universit  Jean Monnet, Saint-Etienne)
- 15h00-16h00 : Application du transport optimal   l'adaptation de domaine, Nicolas Courty (Ma tre de conf rences, Laboratoire IRISA, Universit  de Bretagne Sud, Vannes)

R sum  de l'expos  de Nicolas Delanoue : voir page suivante.

R sum  de l'expos  de Ievgen Redko :

Optimal transport (OT) is a powerful tool that allows to align two probability measures in an optimal way. In this talk, I will present several contributions of OT related to a particular machine learning setting called domain adaptation (DA): a situation that occurs when a classifier is learned and trained on data samples drawn from different probability distributions. More precisely, I will introduce a new algorithm for DA based on feature selection with OT and its application to medical imaging as well as a proportion estimation algorithm allowing to handle efficiently the mismatch between the training and test class proportions.

R sum  de l'expos  de Nicolas Courty :

Dans cet expos  nous d crivons comment la th orie du transport optimal peut  tre appliqu e dans un probl me concret apparaissant en apprentissage machine : l'adaptation de domaines. Celui-ci d crit un sc nario o  les donn es en test diff rent des donn es d'apprentissage. C'est par exemple le cas lorsque l'on cherche   exploiter des donn es massives et labellis es disponibles sur le web pour un probl me de classification ad-hoc et pour lequel on ne dispose que de tr s peu de labels.

Plusieurs m thodes seront expos es, partant des principes g n raux du transport (OT-DA), puis utilisant une version am lior e de la fonction de c t (JDOT). Nous verrons aussi finalement comment cette strat gie peut  tre utilis e pour entra ner des r seaux profonds.

Introduction au transport optimal

Nicolas Delanoue

Mars 2019

Cet exposé est une introduction au transport optimal, peu de pré-requis sont nécessaires. Le problème du transport optimal a été formalisé par le mathématicien Gaspard Monge en 1781 : soient X et Y deux espaces métriques séparables et de Radon), $c : X \times Y \rightarrow [0, +\infty]$ une fonction mesurable, étant donné des mesures μ sur X et ν sur Y , la formulation de Monge du problème de transport optimal est issue de la recherche du plan de transport $T : X \rightarrow Y$ qui réalise l'infimum :

$$\inf_{T: X \rightarrow Y} \left\{ \int_X c(x, T(x)) d\mu(x) \mid T_*(\mu) = \nu \right\} \quad (1)$$

Depuis Kantorovitch, le problème (généralisé) est formulé avec la théorie de la mesure. Étant données les mesures de probabilité μ sur X et ν sur Y , le problème de transport optimal est suivant:

$$\begin{aligned} \min_{\pi \in \mathcal{B}(X \times Y)} & \int_{X \times Y} c(x, y) d\pi(x, y) \\ \text{subject to} & P_X \pi = \mu, \\ & P_Y \pi = \nu \end{aligned} \quad (2)$$

où $P_X \pi$ est la marginale de π sur X , et $\mathcal{B}(X \times Y)$ la famille des mesures de probabilités sur $X \times Y$.

Durant l'exposé, je rappellerai ces deux formulations et expliciterai leurs différences. En particulier, le problème (2) est un problème de programmation linéaire en dimension infinie. Après avoir rappelé ce qu'est la dualité en dimension finie, on présentera le dual de programme linéaire 2 :

$$\begin{aligned} \sup_{\phi, \psi \in \mathcal{C}_b(X, Y)} & \int_X \phi(x) d\mu(x) + \int_Y \psi(y) d\nu(y) \\ \text{subject to} & \phi(x) + \psi(y) \leq c(x, y). \end{aligned} \quad (3)$$

Tout au long de la présentation, des exemples et des interprétations permettront d'illustrer les problèmes et leurs solutions.