

Apprentissage Statistique et Données Massives

Philippe Besse

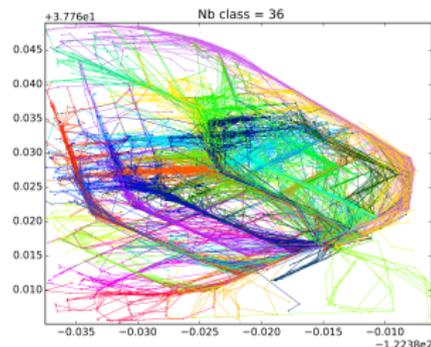
Université de Toulouse
INSA – Dpt GMM
Institut de Mathématiques – ESP
UMR CNRS 5219

Big Data

- Croissance exponentielle du Volume
- Variété, Vélocité
- Valorisation et analyse (ML)
- Passage à l'échelle Volume
- Méthodes d'apprentissage *vs.* Nouvelles technologies

Point de vue "pédagogique"

- De Statisticien à *Data Scientist*
- Quelles compétences ?
- Quelques Exemples



◀ Trajectoires GPS

Domaines et objectifs très variés

- **E-commerce** : recommandations et **Réseaux** sociaux
- **Publique** : administrations, santé et (*open data*)
- **Recherche** Météo, Biologie, Astronomie...
- **Industrie** : défaillance, fraudes, maintenance...

Réellement massives ?

- **Seuils** technologiques (RAM, Disque)
- **Préparation** (*munging*) des données (Python-pandas)
- Données **distribuées** :
Hadoop distributed file system



Ferme de données

Réalité ou confusion ?

- Aspects sociétaux et **Datafication** du quotidien
- **big data** vs. big brother (NSA)
Information / prévision de comportement moyen / individuel
- **Assurances** et asymétrie d'information
Segmentation **vs.** mutualisation des risques



Question

La **Science des données** est-elle une **Nouvelle** Science ?

Volume et "nouveaux" paradigmes

1990s MO *Data Mining* & **Expérimentation**

2000s GO *Bioinformatique* & **Parcimonie** ($p \gg n$)

2010s TO *Science des données* & **Optimisation**

Nouveau terme d'erreur

- **Erreur** d'approximation vs. d'estimation (biais / variance)
- **Erreur** d'*optimisation*
 - **Contrainte** de ressources (temps, RAM, nb processeurs)
 - **Taille** échantillon vs. temps d'exécution & mémoire
 - Méthodes **disponibles** pour données distribuées

Nouveaux modèles économiques

- **Eldorado** de la pub en ligne (*advertising*)
- **Cloud computing** : SaaS, IaaS, PaaS, DaaS, ITaaS...
 - **Marges** sur matériels et logiciels (*open source*)
 - **Amazon** (WS), Microsoft (Azure),
 - **Google cloud**, IBM (Analytics), ...
 - **Python** et *Enthought*, *Continuum analytics*
 - **Spark** (Databricks), H2O (Oxdata), RHadoop (Revolution Analytics – Microsoft)

Nouvelles Méthodes stat ou ML ?

- **Hadoop** et *MapReduce* pour paralléliser
- **Retour** vers le futur (SVD, k-means, logistique, RF...)
- **Obligation** de collaborer entre Maths, Info
 - Michael Jordan (SFdS 13/10/2015)
 - GDR **MADICS** du CNRS (juin 2015)

Nouveaux problèmes d'optimisation

- **Optimisation** convexe et parcimonie (Candes & Tao, 2010)
- **Gradient stochastique** (données distribuées ou en flux)
- **Librairies** d'algorithmes parallélisés

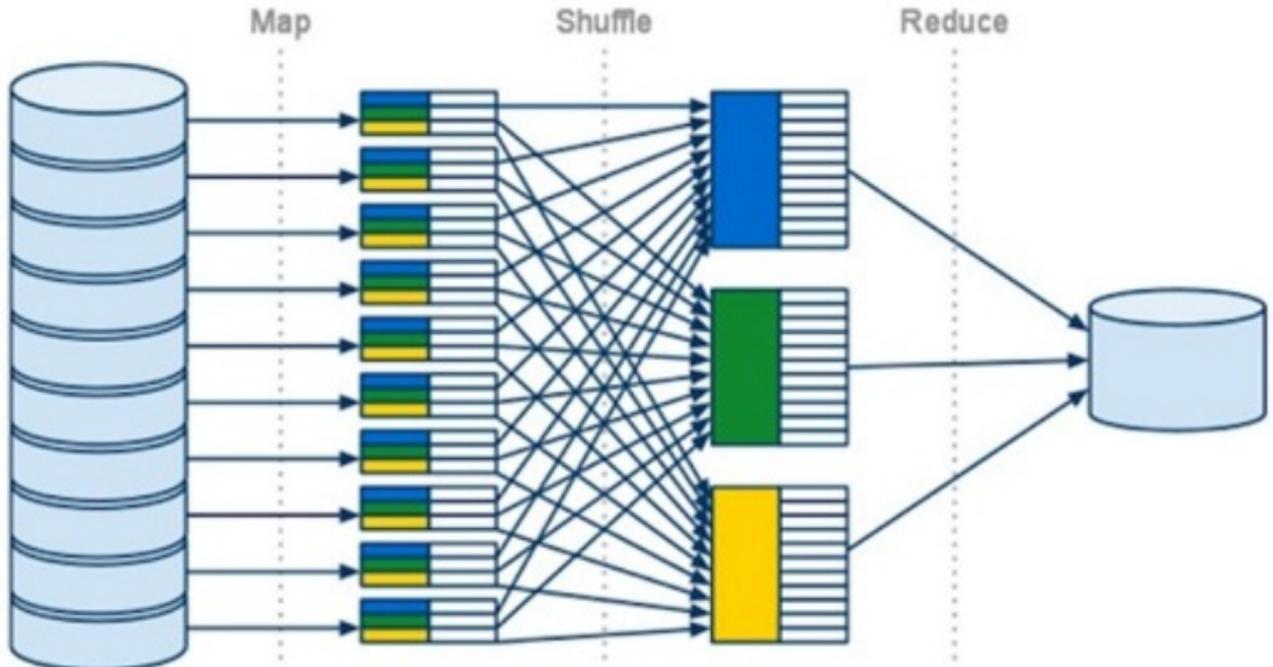
En résumé

- Exemple d'Amazon Web Service Machine Learning
 - *Utiliser une technologie d'apprentissage-machine puissante sans avoir besoin de maîtriser les algorithmes et techniques de l'apprentissage-machine (sic !)*
 - *Cloud* mais qu'avec modèle linéaire ou logistic
 - Pénalisation *Lasso*, *Ridge*, mais ... manuelle
- Science des données
 - Nouveau *packaging*
 - Nouveaux enjeux
 - Explosion de nouvelles technologies
 - Problèmes d'optimisation



Hadoop

- Environnement : Google puis **Apache**
- **Hadoop Distributed File System** (HDFS)
- Données hétérogènes **distribuées**
- Distribution : Cloudera, Hortonworks, Oracle, IBM...
- Parallélisation : **Map Reduce**



Hadoop Distributed File System (HDFS)

Classification par centres mobiles ($\approx k$ -means)

- Définition d'une **distance** euclidienne (ou non : PAM)
- Algorithme de **Forgy**
 - **Initialisation** des k centres
 - **Itération** des étapes *MapReduce*
 - **Map** : Affectation de chaque individu (**valeur**) au centre (**clef**) le plus proche
 - **Reduce** : Calcul des **centres** des individus de même **clef**
 - **Mise à jour** des centres
- **Problème** : accès disques à chaque itération
- Solution actuelle : **Spark** (*Resilient Distributed Dataset*)

Logiciels de Statistique & Hadoop

-   python™ (Scikit Learn)  , Knime, Weka...
- Bibliothèques R : `bigmemory`, `parallel`, `snow`...
- **RHadoop** (*Revolution Analytics*)
- Bibliothèque **Java** d'apprentissage (Apache) : 

Hadoop & Après

- Hive, pig...
- **Spark** Zaharia et al. (2012)
Scala, Java, **Python** (pyspark),
(SparkR) & MLlib,



Méthodes échelonnables (*scalable*)

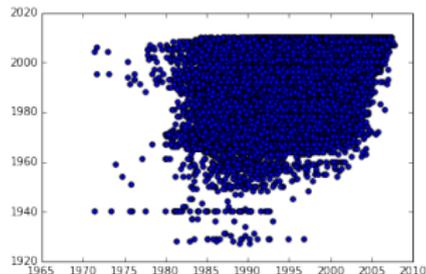
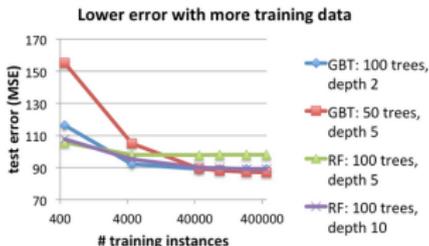
- *RHadoop* : *k-means*, régression, régression logistique...
- *MLib* de Spark : *k-means*, SVD, NMF (ALS), régression linéaire et logistique avec pénalisations, SVM linéaires, classifieur bayésien naïf, Arbre, Forêt Aléatoire, Boosting
- **Enfinement peu de méthodes**
- Mais passage direct à l'échelle "volume"

Implémentations des forêts aléatoires

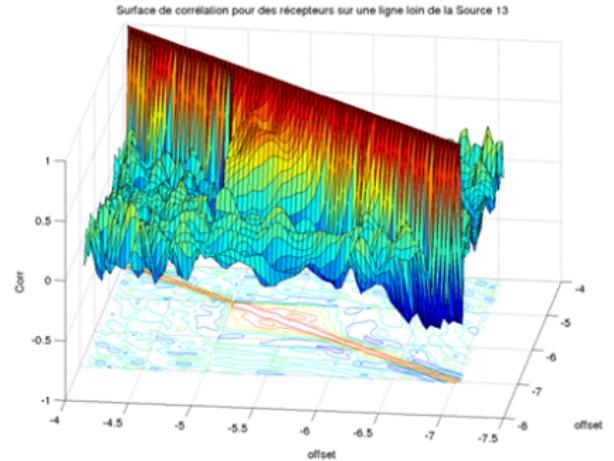
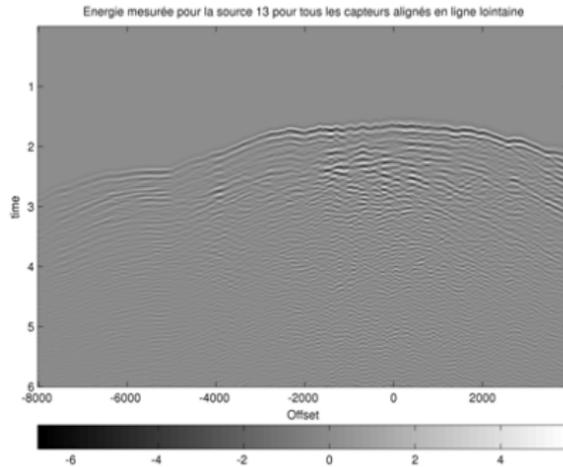
- Python (`scikit-learn`) **équivalente** à R (`randomForest`)
- `nntree`, `mtry`
- **MLlib** de Spark
 - `maxDepth`, `minInstancesPerNode`
 - `featureSubsetStrategy`
 - `subsamplingRate`
 - `maxBins` (32) < n
 - `maxMemoryInMB`, `useNodeIdCache`,
`checkpointDir`, `checkpointInterval`

Données massives et "information"

- Compenser un signal faible (sismique inverse)
- Représentativité
 - Fiasco de *Google flu trend*
 - Exhaustivité et mesure d'audience (Médiamétrie)
Philippe Tassi (SFdS 13/10/2015)
- Qualité des variables (*features*)
 - Million Song Dataset : benchmark de Databricks



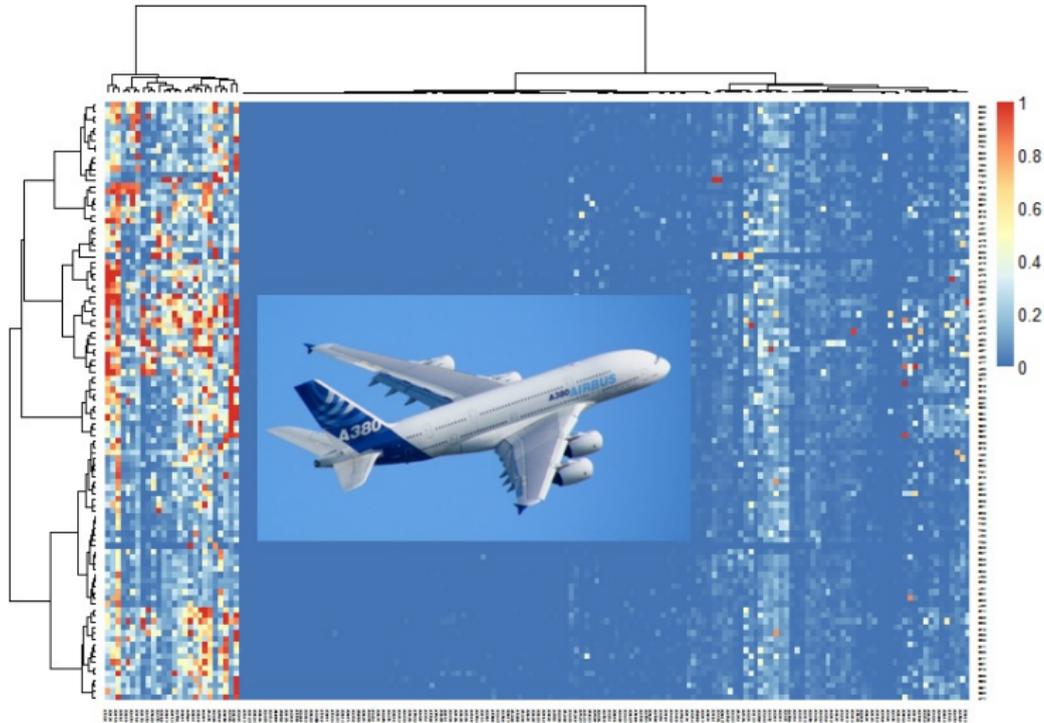
Base UCI — Crédit : Databricks — Année observée vs. prédite



Sismique inverse

Méthode × Technologie

- Critéo (*advertising*) : régression logistique et *group lasso*
- Tinyclues (profilage) : factorisation non négative
- CDiscount (catégorisation) : régressions logistiques
- Deepki (bâtiments) : random forest et boosting
- Airbus (essais en vol) : archivage Hadoop (Oracle)
- IRT Saint-Exupéry (images satellites) : boosting (Spark)



Analyse des messages d'incidents en vol (700 000 en 6 mois)

Conclusion

- **Platform as a service** Amazon WS : +50% par an
- **Software as a Service** : Watson, AWS ML, tensor flow...
- Hadoop Spark **MLlib**
- Optimiser la base d'apprentissage ?
- **Gartner Hype Cycle** : *Trough of Disillusionment of ML*
- **Sélection** "naturelle" des technologies

THE WALL STREET JOURNAL

Subscribe Now | Sign In

[Home](#) [World](#) [U.S.](#) [Politics](#) [Economy](#) [Business](#) [Tech](#) [Markets](#) [Opinion](#) [Arts](#) [Life](#) [Real Estate](#) [Q](#)


Investors Hedge
Bets on Crude-Oil
Revival



HEARD ON THE STREET
Why the Fed Has
the Stock Market
Spooked



Global Stocks
Pressured After Fed
Keeps Options Open



Figure 1: Gartner Hype Cycle for Intelligent Analytics and Data Science, 2016



MARKETS

U.S. Government Uses Race Test for \$80 Million in Payments

Checks are ready for minority borrowers allegedly discriminated against on Ally Financial auto loans