

Shannon, son entropie et les statistiques

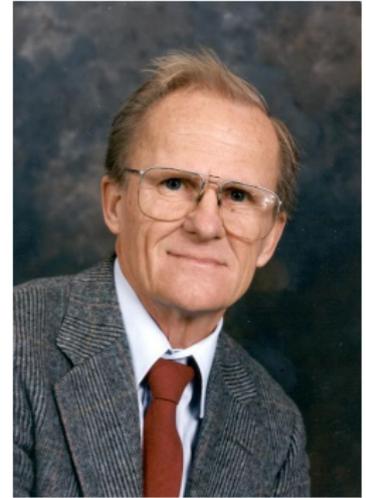
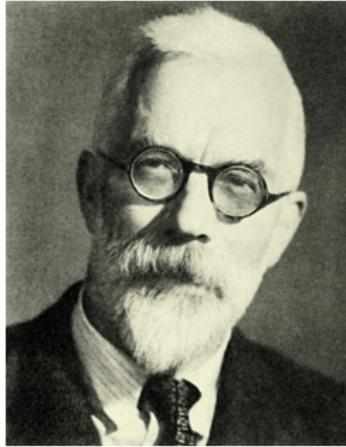
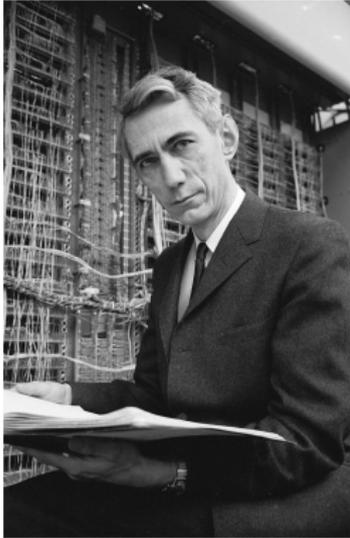


E. Le Penec

École polytechnique

Shannon 100 - 09 février 2017

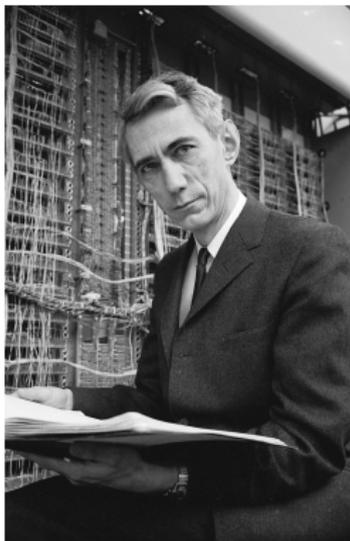
Claude Shannon, son entropie et les statistiques



3 actes

- Compression et entropie (Claude Shannon – 1916-2001)
- Estimation et vraisemblance (Ronald Fisher – 1890-1962)
- Estimation et compression (Jorma Rissanen – 1932-)

Claude Shannon



Claude Shannon – 1916-2001

- Ingénieur en génie électrique **et** mathématicien
- Père de la **théorie de la communication**

A mathematical theory of communication

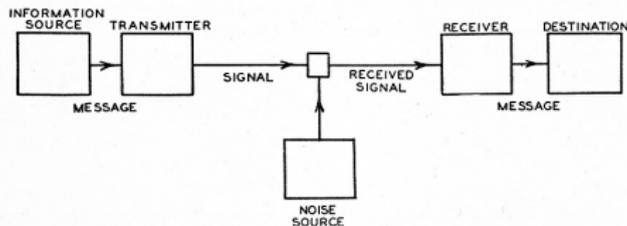
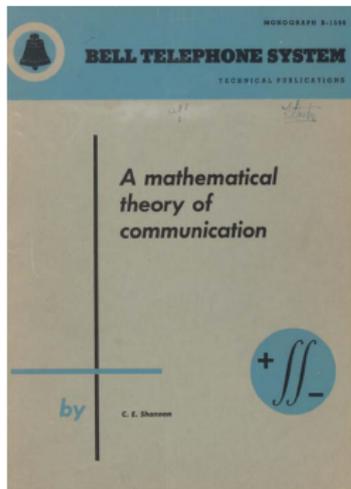


Fig. 1—Schematic diagram of a general communication system.

Article fondateur de 1948

- Modèle de la **transmission d'information**.
- Mise en avant de **limitations intrinsèques**.
- Proposition de **méthodes pratiques** permettant de s'en approcher.
- Contribution **majeure** ayant changé la face du monde !

Le télégraphe, un canal discret sans bruit

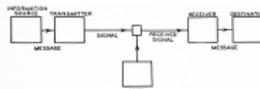


Fig. 1—Schematic diagram of a general communication system.

Communiquer avec un télégraphe

- **Message envoyé** : succession de lettres, de chiffres, d'espace et de signes de ponctuations.
- **Signal envoyé** : succession de points, traits et espaces.
- **Signal reçu** : succession de points, traits et espaces.
- **Message reçu** : succession de lettres, de chiffres, d'espace et de signes de ponctuations.

But

- Message reçu = Message envoyé
- Signal le plus **court** possible...
- **Sans bruit** (hypothèse forte) : Signal envoyé = Signal reçu

Code Morse

INTERNATIONAL MORSE CODE

A	• —	N	— •	1	— • • • •	.	• • • • •
B	— • • •	O	— — •	2	• • • — —	,	— • • • •
C	— • — •	P	— • • •	3	• • • — •	?	• • • — •
D	— • • •	Q	— • — •	4	• • • — •	!	— • • • •
E	•	R	— • • •	5	• • • • •	!	— • • • •
F	• • • •	S	• • •	6	— • • • •	/	— • • • •
G	— • • •	T	— •	7	— • • • •	:	— • • • •
H	• • • •	U	• • —	8	— • • • •	:	— • • • •
I	• •	V	• • • —	9	— • • • •	=	— • • • •
J	• — — —	W	— • — •	0	— — — —	+	— • • • •
K	— • • •	X	— • • •			-	• • • • •
L	• — • •	Y	— • • •			-	• • • • •
M	— —	Z	— • • •			-	• • • • •
						@	• • • • •

Une vieille invention

- Proposé en **1832** par Samuel Morse.
- Version standardisée par l'UIT en 1865.
- **Code** = Correspondance entre symboles du message et suite de symboles du signal.
- **Durée variable** des codes :
 - un tiret dure 3 points
 - espace d'une durée de 1 points entre les *lettres* et de 7 points entre les *mots*.
- **Longueur** du code lié à la **fréquence** de la lettre...



Compression de fichiers

- But : **réduire** l'espace nécessaire pour stocker l'information contenue dans un fichier.
- **Compression** : production d'une suite de 0/1 la plus courte possible permettant de **revenir au fichier initial** !

La compression : une transmission sur place

- Transmission \simeq lecture/écriture
- **Message** = suite de 0/1 = fichier d'**entrée**
- **Signal** = suite de 0/1 = fichier de **sortie**
- **Durée** du signal = **longueur** du fichier de sortie

Quel code ?



	Code A	Code B	Code C	Code D
a	10	0	0	0
b	11	10	01	10
c	111	110	011	11

Propriété d'un bon code

- Uniquement décodable :
 - Non singulier (**décodage possible**) :
$$\mathcal{C}(\mathbf{W}) = \mathcal{C}(\mathbf{W}') \quad \text{ssi} \quad \mathbf{W} = \mathbf{W}'.$$
 - Code par extension (**codage facile**) :
$$\mathcal{C}(\mathbf{W}) = \mathcal{C}(W_1) \dots \mathcal{C}(W_{|\mathbf{W}|})$$
- Préfixe (**décodage facile**) : code tel que le code d'un symbole ne peut être le début d'un autre.

- Seul le côté non singulier est indispensable... mais les deux autres ne sont pas (trop) limitant..
- **Bon code** : code tel que les **codes** $\mathcal{C}(\mathbf{W})$ soient **courts**.

Un codage simple

	0	1	2	3	4	5	6	7
0	▶	◀	0	G	P	·	p	
1	⊙	◁	1	A	Q	a	q	
2	⊕	↖	2	B	R	b	r	
3	⊖		3	C	S	c	s	
4	♠	⦿	4	D	T	d	t	
5	♣	♠	5	E	U	e	u	
6	♠	♣	6	F	V	f	v	
7	♠	♣	7	G	W	g	w	
8	♠	♣	8	H	X	h	x	
9	⊙	↘	9	I	Y	i	y	
A	⊙	→	A	J	Z	j	z	
B	⊙	←	B	K	[k	[
C	⊙	↙	C	L	\	l	\	
D	⊙	↗	D	M]	m]	
E	♠	♠	E <td>N</td> <td>^</td> <td>n</td> <td>^</td> <td></td>	N	^	n	^	
F	♠	♠	F <td>O</td> <td>_</td> <td>o</td> <td>_</td> <td>Δ</td>	O	_	o	_	Δ

	8	9	A	B	C	D	E	F
0	C	E	A	α	=			
1	ü	m	i	β	±			
2	é	Ö		Γ	≥			
3	ä	ö	ü	κ	≤			
4	ä	ö	ü	λ	Γ			
5	ä	ö	ü	π	σ	J		
6	ä	ö	ü	τ	π	±		
7	C	ä	ö	τ	π	±	≈	
8	é	ü	ö	τ	π	±	Φ	°
9	é	ü	ö	τ	π	±	Φ	°
A	é	ü	ö	τ	π	±	Φ	°
B	é	ü	ö	τ	π	±	Φ	°
C	é	ü	ö	τ	π	±	Φ	°
D	é	ü	ö	τ	π	±	Φ	°
E	é	ü	ö	τ	π	±	Φ	°
F	é	ü	ö	τ	π	±	Φ	°

Le code le plus simple

- Faire une **liste des symboles** et coder chaque symbole par sa **position** en binaire dans cette liste de taille $|\mathcal{A}| = 2^{\log_2 |\mathcal{A}|}$.
- Code uniquement décodable et préfixe utilisant $\lceil \log_2 |\mathcal{A}| \rceil$ **bits par symbole**.

- **Coût par symbole** d'un message :

$$\frac{|C(\mathbf{W})|}{|\mathbf{W}|} = \frac{1}{|\mathbf{W}|} \sum_{i=1}^{|\mathbf{W}|} \lceil \log_2 |\mathcal{A}| \rceil = \lceil \log_2 |\mathcal{A}| \rceil$$

- Exemple : code ASCII des caractères sur 8 bits.

Une première limitation



\emptyset

0 - 1

00 - 01 - 10 - 11

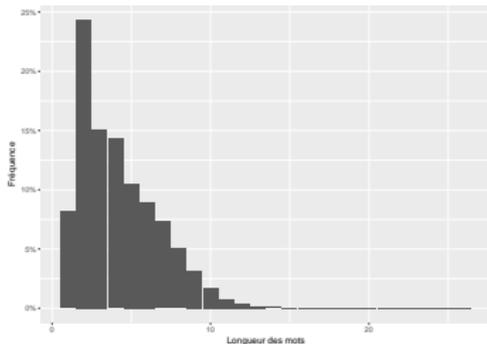
000 - 001 - 010 - 011 - 100 - 101 - 110 - 111

0000 - 0001 - 0010 - 0011 - 0100 - 0101 - 0110 - 0111 - 1000 - 1001 - 1010 - 1011 - 1100 - 1101 - 1110 - 1111

- **Non singulier** : $\mathcal{C}(\mathbf{W}) = \mathcal{C}(\mathbf{W}')$ ssi $\mathbf{W} = \mathbf{W}'$.
- Assure que le **décodage** est **possible**...
- **Contrainte** forte sur la **taille** des codes !

Limite de compression

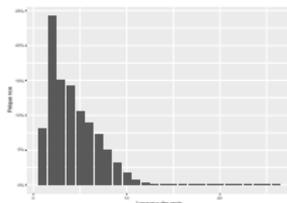
- Pour tout codage \mathcal{C} , si il existe \mathbf{W} tel que $\frac{|\mathcal{C}(\mathbf{W})|}{|\mathbf{W}|} < \log_2 |\mathcal{A}|$
alors il existe \mathbf{W}' tel que $\frac{|\mathcal{C}(\mathbf{W}')|}{|\mathbf{W}'|} > \log_2 |\mathcal{A}|$
 - **Impossible de toujours faire mieux que le codage simple !**
 - Lemme des tiroirs...
-
- **Impossibilité** d'un algorithme de compression qui compresse tout...



Longueur des mots et fréquence

- Mots **les plus courts** sont **les plus utilisés**... ou mots **les plus utilisés** sont **les plus courts** ?
- Phénomène d'évolution naturelle pour **diminuer la longueur moyenne** des phrases !
- Efficacité du français :
 - Codage simple des **100 000 mots en français** possible avec des mots de **4 lettres** uniquement...
 - Pas très pratique pour l'apprentissage humain... mais pas pour un ordinateur...

Code court... en moyenne



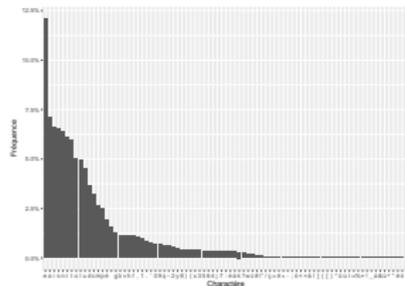
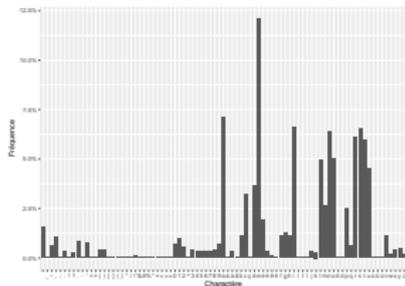
- Comment reprendre ce principe pour des sources quelconques ?
- Trouves des codes **efficaces en moyenne** seulement...

Comportement moyen

- **Loi de probabilité** \mathbb{P} sur les mots \mathbf{W} de taille n (répartition des **fréquences** de tous les mots)
- Coût moyen par caractère pour des mots de taille n :

$$\mathbb{E} \left[\frac{|\mathcal{C}(\mathbf{W})|}{|\mathbf{W}|} \right] = \sum_{\mathbf{W} \in \mathcal{A}^n} \mathbb{P} \{ \mathbf{W} \} \frac{|\mathcal{C}(\mathbf{W})|}{|\mathbf{W}|}$$

- On peut se permettre des **codes longs** pour les **mots peu fréquents** !



Un modèle probabiliste simple des mots

- **Symboles** (lettres) ont une certaine **fréquence** :

$$\mathbb{P}\{A\}$$

- Mots obtenus en tirant de manière **successive et indépendamment** des lettres :

$$\mathbb{P}\{\mathbf{W}\} = \mathbb{P}\{W_1\} \dots \mathbb{P}\{W_i | \mathbf{w}_i\}$$

- **Modélisation grossière** pouvant être améliorée.
- Tous les résultats restent valables pour des sources Markoviennes...

$$\forall C, \quad \mathbb{E} \left[\frac{|C(\mathbf{W})|}{|\mathbf{W}|} \right] \geq H(\mathbb{P})$$

Résultat fondamental obtenu par Shannon

- **Impossible de compresser mieux en moyenne** qu'une quantité notée $H(\mathbb{P})$ dépendant de la source.
- Shannon appelle **entropie** cette quantité dont la formule est

$$H(\mathbb{P}) = \sum_{A \in \mathcal{A}} \mathbb{P}\{A\} (-\log_2 \mathbb{P}\{A\})$$

- Résultat obtenu par un **calcul**...

Entropie et longueur de code

$$\forall \mathcal{C}, \underbrace{\frac{1}{n} \sum_{\mathbf{W} \in \mathcal{A}^n} \mathbb{P}\{\mathbf{W}\} |\mathcal{C}(\mathbf{W})|}_{\mathbb{E}\left[\frac{|\mathcal{C}(\mathbf{W})|}{|\mathbf{W}|}\right]} \geq \underbrace{\frac{1}{n} \sum_{\mathbf{W} \in \mathcal{A}^n} \mathbb{P}\{\mathbf{W}\} (-\log_2 \mathbb{P}\{\mathbf{W}\})}_{\frac{1}{n} H(\mathbb{P}^{\otimes n}) = H(\mathbb{P})}$$

- Modélisation simple utilisée implique

- Loi produit :

$$\mathbb{P}\{\mathbf{W}\} = \prod_{i=1}^{|\mathbf{W}|} \mathbb{P}\{W_i\} \Leftrightarrow (-\log_2 \mathbb{P}\{\mathbf{W}\}) = \sum_{i=1}^{|\mathbf{W}|} (-\log_2 \mathbb{P}\{W_i\})$$

- Entropie des mots de tailles n : $H(\mathbb{P}^{\otimes n}) = nH(\mathbb{P})$

Longueur d'un bon code

- Mots : $|\mathcal{C}(\mathbf{W})| \simeq (-\log_2 \mathbb{P}\{\mathbf{W}\})$

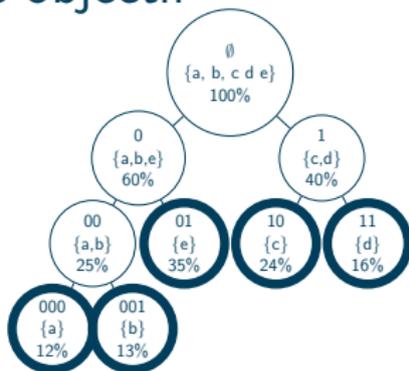
- Caractères dans les mots :

$$\sum_{i=1}^{|\mathbf{W}|} |\mathcal{C}(W_i)| \sim \sum_{i=1}^{|\mathbf{W}|} (-\log_2 \mathbb{P}\{W_i\})$$

- Caractères : $|\mathcal{C}(\mathbf{A})| \sim (-\log_2 \mathbb{P}\{\mathbf{A}\})$

L'entropie comme objectif

Lettre	Fréq.
a	12%
b	13%
c	24%
d	16%
e	35%



Lettre	Code
a	000
b	001
c	10
d	11
e	01

- Résultat précédent sans intérêt sans **méthode explicite permettant d'obtenir un code quasi optimal...**

Codes efficaces

- **Shannon/Fano** (48) : principe de partitionnement récursif des symboles donnant un code vérifiant $\mathbb{E} \left[\frac{|C(\mathbf{W})|}{|\mathbf{W}|} \right] \leq H(\mathbb{P}) + 2$
- **Huffman** (52) : principe de regroupement récursif des symboles donnant un code vérifiant $\mathbb{E} \left[\frac{|C(\mathbf{W})|}{|\mathbf{W}|} \right] \leq H(\mathbb{P}) + 1$
- **Codage arithmétique** (76) : $\mathbb{E} \left[\frac{|C(\mathbf{W})|}{|\mathbf{W}|} \right] \leq H(\mathbb{P}) + \frac{2}{n}$

L'entropie comme objectif

Lettre	Fréq.
a	12%
b	13%
c	24%
d	16%
e	35%



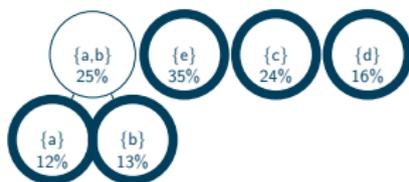
- Résultat précédent sans intérêt sans **méthode explicite permettant d'obtenir un code quasi optimal...**

Codes efficaces

- **Shannon/Fano** (48) : principe de partitionnement récursif des symboles donnant un code vérifiant $\mathbb{E} \left[\frac{|C(\mathbf{W})|}{|\mathbf{W}|} \right] \leq H(\mathbb{P}) + 2$
- **Huffman** (52) : principe de regroupement récursif des symboles donnant un code vérifiant $\mathbb{E} \left[\frac{|C(\mathbf{W})|}{|\mathbf{W}|} \right] \leq H(\mathbb{P}) + 1$
- **Codage arithmétique** (76) : $\mathbb{E} \left[\frac{|C(\mathbf{W})|}{|\mathbf{W}|} \right] \leq H(\mathbb{P}) + \frac{2}{n}$

L'entropie comme objectif

Lettre	Fréq.
a	12%
b	13%
c	24%
d	16%
e	35%



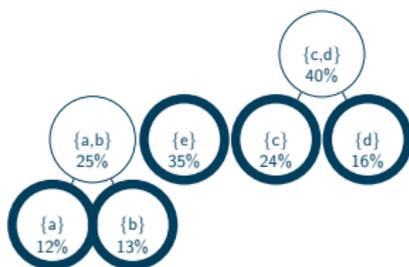
- Résultat précédent sans intérêt sans **méthode explicite permettant d'obtenir un code quasi optimal...**

Codes efficaces

- **Shannon/Fano** (48) : principe de partitionnement récursif des symboles donnant un code vérifiant $\mathbb{E} \left[\frac{|C(\mathbf{W})|}{|\mathbf{W}|} \right] \leq H(\mathbb{P}) + 2$
- **Huffman** (52) : principe de regroupement récursif des symboles donnant un code vérifiant $\mathbb{E} \left[\frac{|C(\mathbf{W})|}{|\mathbf{W}|} \right] \leq H(\mathbb{P}) + 1$
- **Codage arithmétique** (76) : $\mathbb{E} \left[\frac{|C(\mathbf{W})|}{|\mathbf{W}|} \right] \leq H(\mathbb{P}) + \frac{2}{n}$

L'entropie comme objectif

Lettre	Fréq.
a	12%
b	13%
c	24%
d	16%
e	35%



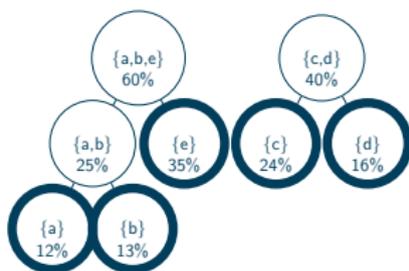
- Résultat précédent sans intérêt sans **méthode explicite permettant d'obtenir un code quasi optimal...**

Codes efficaces

- **Shannon/Fano** (48) : principe de partitionnement récursif des symboles donnant un code vérifiant $\mathbb{E} \left[\frac{|C(\mathbf{W})|}{|\mathbf{W}|} \right] \leq H(\mathbb{P}) + 2$
- **Huffman** (52) : principe de regroupement récursif des symboles donnant un code vérifiant $\mathbb{E} \left[\frac{|C(\mathbf{W})|}{|\mathbf{W}|} \right] \leq H(\mathbb{P}) + 1$
- **Codage arithmétique** (76) : $\mathbb{E} \left[\frac{|C(\mathbf{W})|}{|\mathbf{W}|} \right] \leq H(\mathbb{P}) + \frac{2}{n}$

L'entropie comme objectif

Lettre	Fréq.
a	12%
b	13%
c	24%
d	16%
e	35%



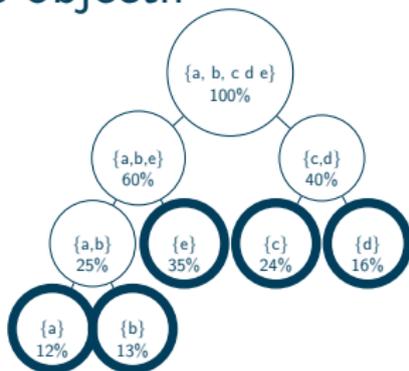
- Résultat précédent sans intérêt sans **méthode explicite permettant d'obtenir un code quasi optimal...**

Codes efficaces

- **Shannon/Fano** (48) : principe de partitionnement récursif des symboles donnant un code vérifiant $\mathbb{E} \left[\frac{|C(\mathbf{W})|}{|\mathbf{W}|} \right] \leq H(\mathbb{P}) + 2$
- **Huffman** (52) : principe de regroupement récursif des symboles donnant un code vérifiant $\mathbb{E} \left[\frac{|C(\mathbf{W})|}{|\mathbf{W}|} \right] \leq H(\mathbb{P}) + 1$
- **Codage arithmétique** (76) : $\mathbb{E} \left[\frac{|C(\mathbf{W})|}{|\mathbf{W}|} \right] \leq H(\mathbb{P}) + \frac{2}{n}$

L'entropie comme objectif

Lettre	Fréq.
a	12%
b	13%
c	24%
d	16%
e	35%



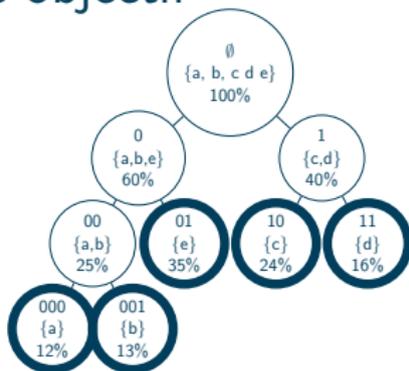
- Résultat précédent sans intérêt sans **méthode explicite permettant d'obtenir un code quasi optimal...**

Codes efficaces

- **Shannon/Fano** (48) : principe de partitionnement récursif des symboles donnant un code vérifiant $\mathbb{E} \left[\frac{|C(\mathbf{W})|}{|\mathbf{W}|} \right] \leq H(\mathbb{P}) + 2$
- **Huffman** (52) : principe de regroupement récursif des symboles donnant un code vérifiant $\mathbb{E} \left[\frac{|C(\mathbf{W})|}{|\mathbf{W}|} \right] \leq H(\mathbb{P}) + 1$
- **Codage arithmétique** (76) : $\mathbb{E} \left[\frac{|C(\mathbf{W})|}{|\mathbf{W}|} \right] \leq H(\mathbb{P}) + \frac{2}{n}$

L'entropie comme objectif

Lettre	Fréq.
a	12%
b	13%
c	24%
d	16%
e	35%



Lettre	Code
a	000
b	001
c	10
d	11
e	01

- Résultat précédent sans intérêt sans **méthode explicite permettant d'obtenir un code quasi optimal...**

Codes efficaces

- **Shannon/Fano** (48) : principe de partitionnement récursif des symboles donnant un code vérifiant $\mathbb{E} \left[\frac{|C(\mathbf{W})|}{|\mathbf{W}|} \right] \leq H(\mathbb{P}) + 2$
- **Huffman** (52) : principe de regroupement récursif des symboles donnant un code vérifiant $\mathbb{E} \left[\frac{|C(\mathbf{W})|}{|\mathbf{W}|} \right] \leq H(\mathbb{P}) + 1$
- **Codage arithmétique** (76) : $\mathbb{E} \left[\frac{|C(\mathbf{W})|}{|\mathbf{W}|} \right] \leq H(\mathbb{P}) + \frac{2}{n}$



Entropie et complexité (Interprétation *a posteriori*)

- Complexité de la **source** et pas des messages.
- **Information** moyenne apportée par chaque symbole.
- Propriété de l'entropie compatible avec le côté information :
 - $H(X, Y) \leq H(X) + H(Y)$ (information commune à X et Y)
 - $H(X|Y) \leq H(X)$ (transfert d'information à partir de X)
- **Autres entropies ou mesure de complexité** :
 - Entropie métrique (mesure de la taille),
 - Entropie en physique statistique (mesure du désordre),
 - Complexité individuelle (longueur du code le plus court permettant de générer la suite) (Kolmogorov),

Que faire lorsque la loi est inconnue ?

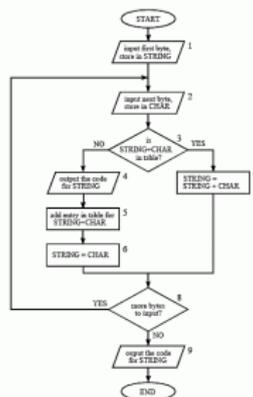
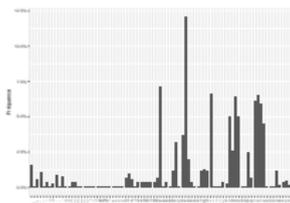


FIGURE 27-7
LZW compression flowchart. The variable, CHAR, is a single byte. The variable, STRING, is a variable length sequence of bytes. Data are read from the input file (line 1, & 2) as single bytes, and written to the compressed file (line 4) as 12 bit codes. Table 27-5 shows an example of this algorithm.

- En pratique \mathbb{P} n'est **pas forcément connue...**
- Pas de problème pour l'analyse mais problème pour **l'implémentation !**

Il suffit d'estimer (deviner) \mathbb{P} ...

- **Explicitement** : Huffman, Codage arithmétique...
- **Implicitement** : Approche dictionnaire (LZW, ZIP...)



- Comment **estimer** $\mathbb{P}\{A\}$ en observant un message \mathbf{W} , c-à-d la liste des symboles $W_1, \dots, W_{|\mathbf{W}|}$!
- Réponse naturelle : **proportion observée**

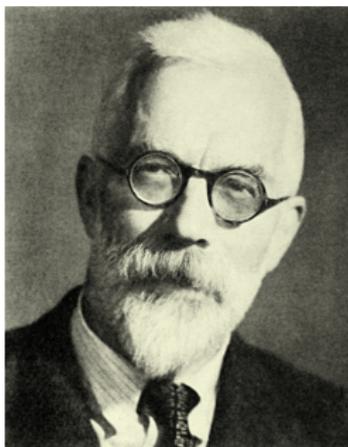
$$\mathbb{P}\{A\} \sim \frac{\text{Nb d'occurrences de } A}{|\mathbf{W}|}$$

- Difficile de faire mieux avec un modèle aussi simple.

Estimation paramétrique

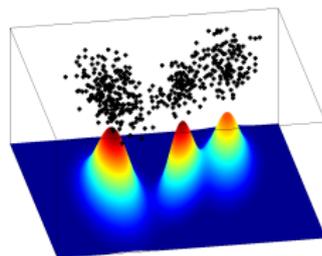
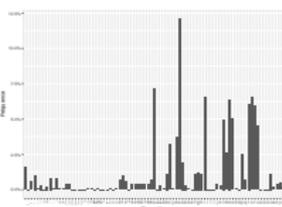
- Observation de X_1, \dots, X_n **indépendants de même loi** \mathbb{P} .
- Estimation de \mathbb{P} par une **loi** \mathbb{P}_θ décrite par des **paramètres** $\theta \in \mathbb{R}^p$.

- Modèle précédent : **Histogramme = Multinomiale** de paramètres $\theta \in \mathbb{R}^{|\mathcal{A}|-1}$ donnant les proportions (sauf une...)



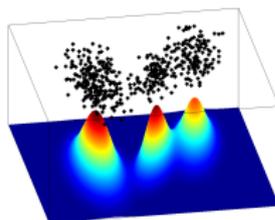
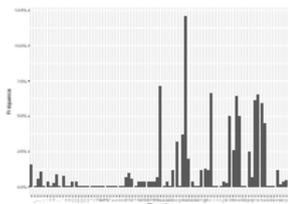
Ronald Fisher – 1890-1962

- Statisticien **et** biologiste
- **Systematisation** des techniques d'estimation.
- Un des fondateurs des statistiques modernes.



Comment choisir parmi **plusieurs** hypothèses ?

- Comment choisir de manière **systematique** les paramètres θ de \mathbb{P}_θ ?
- Principes de **compétition** entre les paramètres :
 - recherche des **paramètres les plus probables étant données les observations** (Bayes)
 - recherche des **paramètres dans lequel les observations sont les plus probables** (Fisher)
- Principes **similaires** mais pas de notion de loi sur les paramètres chez Fisher.



Choix parmi une famille de loi paramétrée \mathbb{P}_θ

- Famille de **loi de probabilité \mathbb{P}_θ définie à θ fixé** par

$$\mathbf{X} \mapsto \mathbb{P}_\theta\{\mathbf{X}\}$$

- **Vraisemblance à observation \mathbf{X} fixée** donne la probabilité de \mathbf{X} dans le modèle \mathbb{P}_θ :

$$\theta \mapsto \mathbb{P}_\theta\{\mathbf{X}\}$$

- **Principe du maximum de vraisemblance** : choix de $\hat{\theta}$ via

$$\hat{\theta} = \underset{\theta}{\operatorname{argmax}} \mathbb{P}_\theta\{\mathbf{X}\}$$

- Donne l'estimateur empirique par les proportions dans le cas de l'histogramme...
- Existence de résultat théorique sur l'efficacité de la méthode.

- Cadre classique : $\mathbb{P}_\theta\{\mathbf{X}\} = \prod_{i=1}^n \mathbb{P}_\theta\{X_i\}$

Maximum de vraisemblance et minimum de $-\log$ vraisemblance

- **Reformulation** du maximum de vraisemblance :

$$\begin{aligned}\hat{\theta} &= \operatorname{argmax}_{\theta} \mathbb{P}_\theta\{\mathbf{X}\} = \operatorname{argmax}_{\theta} \prod_{i=1}^n \mathbb{P}_\theta\{X_i\} \\ &= \operatorname{argmin}_{\theta} \sum_{i=1}^n (-\log_2 \mathbb{P}_\theta\{X_i\})\end{aligned}$$

- **But** : rendre $\mathbb{E}[\mathbb{P}_\theta\{X\}]$ grand, c-à-d $\mathbb{E}[(-\log_2 \mathbb{P}_\theta\{X\})]$ petit.

- **Interprétation** de l'objectif en terme de divergence de Kullback-Leibler

$$\text{KL}(\mathbb{P}, \mathbb{P}_\theta) = \mathbb{E} \left[-\log_2 \frac{\mathbb{P}_\theta\{X\}}{\mathbb{P}\{X\}} \right] = \mathbb{E} [(-\log_2 \mathbb{P}_\theta\{X\})] - H(\mathbb{P})$$

- **Analogie avec la compression** si on pense à $(-\log_2 \mathbb{P}_\theta\{X\})$ comme la longueur du code associé à X ...

Compression/Estimation



Compression

- **Mots** $\mathbf{W} = W_1 \dots W_W$
provenant d'une source de
loi \mathbb{P} connue.

- **Code minimisant**
$$\mathbb{E} [C(A)]$$

- **But** : rendre petit
$$\sum_{i=1}^{|\mathbf{W}|} C(W_i)$$

Estimation

- **Observations**
 $\mathbf{X} = (X_1, \dots, X_n)$ i.i.d. de
loi \mathbb{P} inconnue.

- **Paramètres θ** minimisant
$$\sum_{i=1}^n (-\log_2 \mathbb{P}_\theta \{X_i\})$$

- **But** : rendre petit
$$\mathbb{E} [-\log_2 \mathbb{P}_\theta \{X\}]$$

Lien

- **Dualité modèle/code** :
$$\mathbb{P}_\theta \{X\} \sim 2^{-|C(X)|} \Leftrightarrow (-\log_2 \mathbb{P}_\theta \{A\}) \sim |C(A)|$$

- **Dualité KL/entropie** :
$$\text{KL}(\mathbb{P}, \mathbb{P}_\theta) = \mathbb{E} [-\log_2 \mathbb{P}_\theta \{X\}] - H(\mathbb{P}) \sim \mathbb{E} [C(A)] - H(\mathbb{P})$$

Compression/Estimation



Compression

- Trouver un **code** rendant **petite la longueur moyenne** pour une source de **loi \mathbb{P} connue**.
- L'utiliser sur un mot tiré au hasard selon \mathbb{P} .
- **But** : différence entre la longueur observée et l'optimale petite.

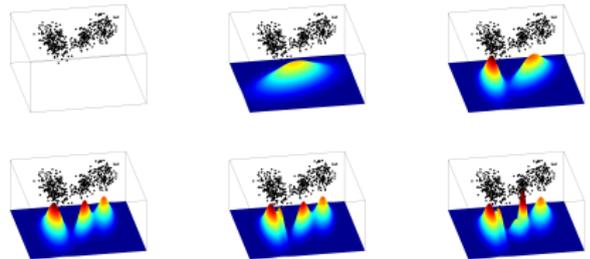
Estimation

- Trouver des **paramètres** rendant **petite la - log vraisemblance** d'une observation de **loi \mathbb{P} inconnue**.
- Les utiliser pour dire des choses sur la loi \mathbb{P} .
- **But** : différence entre la loi estimée et la vraie loi petite.

Lien

- Équivalence entre **code et loi de probabilité**.
- Équivalence entre les **objectifs**.
- Utilisation différente...

Choisir parmi des modèles



- Modèles de **complexité variable** :
 - Modèles simples avec peu de paramètres,
 - Modèles compliqués avec beaucoup de paramètres.

La théorie du complot

- **Plus** de **supputations** permettent **toujours** de **mieux** s'adapter aux **observations...**
- Mais ne garantissent **pas** **une bonne explication.**

Le sur-apprentissage

- **Plus** de **paramètres** permettent **toujours** de **mieux** s'adapter aux **observations...**
- Mais ne garantissent **pas** **une bonne estimation.**

Guillaume d'Ockham

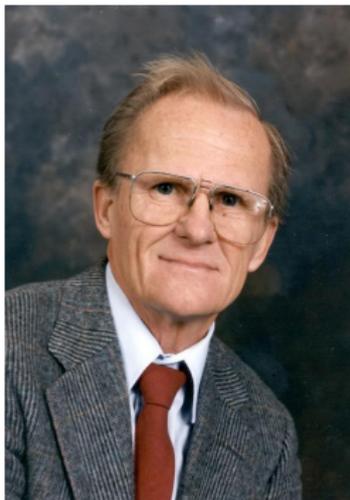


Guillaume d'Ockham – (1285 - 1347)

- Moine **et** philosophe.
- Inventeur du rasoir... d'Ockham.

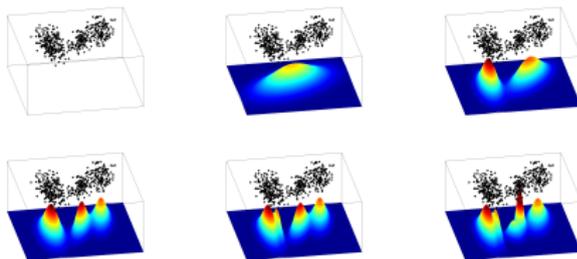
Pluralitas non est ponenda sine necessitate

- *Les multiples ne doivent pas être utilisés sans nécessité.*
- Principe de **concision** : minimum possible d'hypothèses...
- Albert Einstein (1934) : *Tout doit être le plus simple possible, mais pas plus simple que ça.*
- **Pas** un critère **très précis**...



Jorma Rissanen – 1932-

- Théoricien de l'information (frontière **math/info**)
- Inventeur du codage arithmétique et père du principe MDL
- Kolmogorov Medal (2006) and Claude E. Shannon Award (2009).

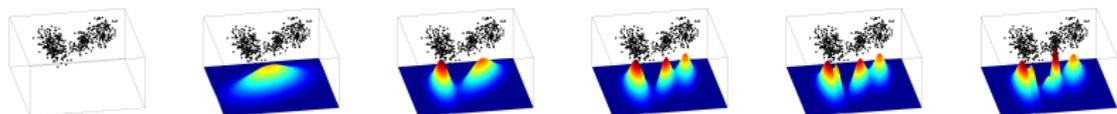


$$\min \mathcal{C}(\mathbf{X}, \theta)$$

Minimum Description Length

- Repenser l'**estimation** en terme de **codage**.
- Idée clé : coder à la fois le **message** (les observations) **et** les **paramètres** !
- Principe MDL : Recherche du modèle rendant la **description** (le code) **de longueur minimale**.
- Principe explicite de **concision**... à la définition du code près !

MDL et code en deux étapes

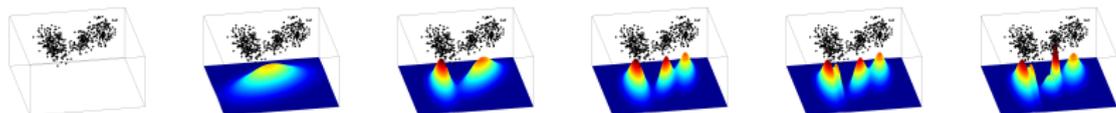


$$\mathcal{C}(\mathbf{X}, \theta) \sim \sum_{i=1}^n (-\log_2 \mathbb{P}_\theta\{X_i\}) + \log_2 |\Theta|$$

Code en deux étapes - θ et X_i discrets

- **Codage en deux temps** : codage du **paramètre θ** suivi du codage des **observations X_i** avec la loi \mathbb{P}_θ .
- **Coût** de codage :
 - Paramètres : $\sim \log_2 |\Theta|$,
codage par la position dans la liste...
 - Observations : $\sum_{i=1}^n -\log_2 \mathbb{P}_\theta\{X_i\}$,
minimum pour θ **maximum de vraisemblance**.
- **Pb** : la plupart du temps les paramètres et les observations sont continues...

MDL et code en deux étapes

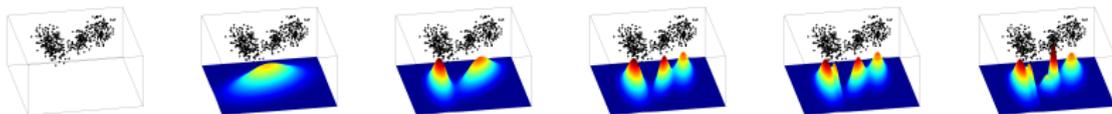


$$C(\mathbf{X}, \theta) \sim \sum_{i=1}^n (-\log_2 \mathbb{P}_\theta\{X_i\}) + \frac{\log_2(n)}{2} D_\Theta$$

Code en deux étapes - θ (et X_i) continu

- **Codage en deux temps après discrétisation** : codage du **paramètre discrétisé $\tilde{\theta}$ suivi** du codage des **observations discrétisées \tilde{X}_i** avec la loi $\mathbb{P}_{\tilde{\theta}}$.
- Différence **négligeable** si la discrétisation est en $1/\sqrt{n}$...
- **Coût** de codage :
 - Paramètres : $\sim D_\Theta \log_2(n)/2$,
lien avec une notion de **dimension entropique métrique**...
 - Observations : $\sum_{i=1}^n -\log_2 \mathbb{P}_{\tilde{\theta}}\{\tilde{X}_i\} \sim \sum_{i=1}^n -\log_2 \mathbb{P}_\theta\{X_i\}$,
minimum pour θ **maximum de vraisemblance**.
- Amélioration possible avec un codage implicite de θ ...

MDL et code en deux étapes

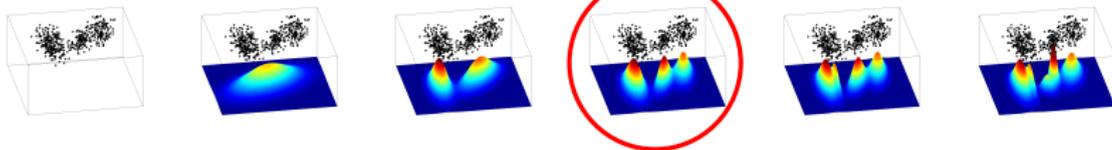


$$C(\mathbf{X}, \theta) \sim \sum_{i=1}^n (-\log_2 \mathbb{P}_{\theta}\{X_i\}) + \frac{\log_2(n)}{2} D_{\Theta}$$

Minimum Description Length et Équilibre Biais/Variance

- Principe de **pénalisation** par la dimension sans autre justification qu'**heuristique** !
- **Équilibre** entre l'**amélioration** du codage par complexification des modèles et le **coût** lié à cette complexité.
- Principe d'**équilibre** entre le **biais** et la **variance** (entre la **qualité** du modèle et la **difficulté** à en estimer les paramètres)
- **Preuves** d'efficacité ont **ensuite** été **obtenues**...

MDL et code en deux étapes



$$C(\mathbf{X}, \theta) \sim \sum_{i=1}^n (-\log_2 \mathbb{P}_{\theta}\{X_i\}) + \frac{\log_2(n)}{2} D_{\Theta}$$

Minimum Description Length et Équilibre Biais/Variance

- Principe de **pénalisation** par la dimension sans autre justification qu'**heuristique** !
- **Équilibre** entre l'**amélioration** du codage par complexification des modèles et le **coût** lié à cette complexité.
- Principe d'**équilibre** entre le **biais** et la **variance** (entre la **qualité** du modèle et la **difficulté** à en estimer les paramètres)
- **Preuves** d'efficacité ont **ensuite** été **obtenues**...

Parcours entre compression et estimation autour de Shannon et son entropie

- Le coeur de la théorie du codage, (**Shannon**)
- Lien avec le principe de maximum de vraisemblance, (**Fisher**)
- Esquisse de la combinaison possible entre codage et estimation pour la sélection de modèles (**Rissanen**)

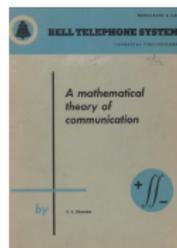
Puissance de la modélisation mathématiques

- **démontrer** des limitations intrinsèques,
 - **évaluer** la qualité des algorithmes,
 - **réinterpréter** des méthodes déjà connues,
 - **proposer** des nouvelles...
-
- Compléments d'information :
 - Erwan.Le-Pennec@polytechnique.edu
 - <http://www.cmap.polytechnique.fr/~lepenne>

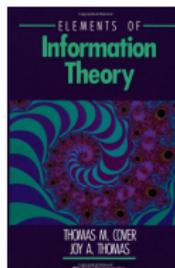
Pour aller plus loin



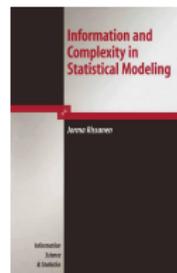
1925



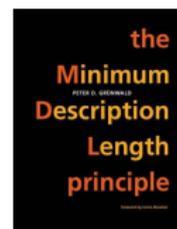
1948



1991



2007



2007

Références

- **C. Shannon**, *A mathematical theory of communication*
- **Th. Cover and J. Thomas**, *Elements of Information Theory*
- **R. Fisher**, *Statistical Methods for Research Workers*
- **J. Rissanen**, *Information and complexity in statistical modeling*
- **P. Grünwald**, *The Minimum Description Length principle*
- **Autres pistes** : Information de Fisher, Inégalités statistiques liées à la théorie de l'information, Codage par dictionnaire et modèle stationnaire, Complexité de Kolmogorov...