

Séminaire Olivier Schwander (LIX)

Le 20/03 à 14h, en salle C23

Olivier Schwander, LIX, Polytechnique.

"Simplification et comparaison de modèles de mélanges de familles exponentielles".

En savoir plus

Résumé:

Les modèles de mélange sont un outil universel pour modéliser des densités de probabilités complexes et variées. Le cas le plus connu est le modèle de mélange de lois gaussiennes mais de nombreux résultats ont été étendus à une classe très large de lois de probabilités: les familles exponentielles. Je présenterai des outils génériques de construction de modèles de mélange basés sur une variante de l'algorithme EM et sur la simplification de mélanges. Comme les formules closes pour les divergences usuelles ne sont pas connues et que les méthodes d'approximations existantes sont peu efficaces (Monte-Carlo), je montrerai des exemples de mesures de dissimilarités basées sur la distance de transport de masse entre mélanges.