

Apprentissage statistique à grande échelle

Francis Bach (francis.bach@ens.fr)

De nombreux problèmes d'apprentissage statistique à grande échelle sont formulés comme l'optimisation d'une fonction convexe dont on n'observe que des gradients bruités: cette fonction est typiquement l'erreur de généralisation, et seulement l'erreur sur une observation est disponible à chaque itération. Les algorithmes utilisés en pratique donnent lieu à des garanties de convergence dont l'étude [1] est le but du mémoire.

References

- [1] F. Bach, E. Moulines. Non-Asymptotic Analysis of Stochastic Approximation Algorithms for Machine Learning. Advances in Neural Information Processing Systems (NIPS), 2011.