

Apprentissage statistique a grande echelle

Francis Bach (francis.bach@ens.fr)

December 17, 2014

De nombreux problèmes d'apprentissage statistique 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

1 References

[1] F. Bach and E. Moulines. Non-strongly-convex smooth stochastic approximation with convergence rate $O(1/n)$. Technical report, HAL 00831977, 2013. To appear in Advances in Neural Information Processing Systems (NIPS)