

Algorithmes stochastiques et bandits

Jérôme Lelong, Université Grenoble Alpes, LJK

L'explosion du *Big Data* a relancé les domaines de l'apprentissage en ligne et de l'optimisation. Ce nouvel élan met à profit les techniques connues de l'optimisation déterministe et stochastique pour proposer des méthodes novatrices permettant de s'attaquer à des problèmes de grande taille. Ce mini-symposium donnera un aperçu des travaux récents autour de cette thématique.

1. Vianney PERCHET : Highly smooth zero-th order online optimization.
2. Franck IUTZELER : Descente par coordonnées stochastiques dans l'algorithme du point fixe et applications à l'optimisation.
3. Massif ACHAB : SGD with Variance Reduction beyond Empirical Risk Minimization.
4. Gersende FORT : Convergence Analysis of Perturbed Proximal Gradient algorithms for penalized likelihood inference.