

Optimisation stochastique

1 Motivation et quelques rappels

1.1 Un problème d'optimisation "fréquent"

$$\min_{x \in \mathbb{R}^n} h(x) = \min_{x \in \mathbb{R}^n} f(x) + g(x) \quad (1)$$

avec :

- $f : \mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R}$ lisse, à savoir à gradient lipschitzien :
 $\exists L > 0$ tel que $\forall x, y \in \mathbb{R}^n, \|\nabla f(x) - \nabla f(y)\| \leq L\|x - y\|$
- $g : \mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R} \cup \{+\infty\}$ convexe, potentiellement non-lisse.

Exemple :

- $g = 0$: problème d'optimisation lisse non-convexe.
- $g(x) = \lambda\|x\|_1$ avec $\lambda > 0$ régularisation parcimonieuse.
- Reformulation d'un problème d'optimisation avec contraintes :
 $\min_{x \in \mathcal{C}} f(x)$ avec $\mathcal{C} \subset \mathbb{R}^n$ convexe non-vide.

1.2 Exemples d'applications

Exemple 1 : Moindres carrés régularisés

On dispose d'un modèle linéaire :

$$\forall x \in \mathbb{R}^n, f(x, \beta) = x^T \beta \quad \beta \in \mathbb{R}^n \text{ paramètre du modèle}$$

On dispose d'observations $(x_i, y_i) \in (\mathbb{R}^n \times \mathbb{R})^p$ permettant d'estimer β

D'où le problème d'optimisation suivant :

$$\min_{\beta \in \mathbb{R}^n} \frac{1}{2} \sum_{i=1}^p (f(x_i, \beta) - y_i)^2 \quad \Leftrightarrow \quad \min_{\beta \in \mathbb{R}^n} \frac{1}{2} \|X\beta - y\|_2^2 \quad \text{avec } X = \begin{pmatrix} x_1^T \\ \vdots \\ x_p^T \end{pmatrix} \in \mathbb{M}_{p,n}(\mathbb{R}) \quad (2)$$

Texte manquant

- $g(\beta) = \frac{\lambda}{2} \|\beta\|_2^2$: régularisation de Tikhonov.
- $g(\beta) = \lambda \|\beta\|_1$: régularisation parcimonieuse (LASSO).

Figure 1: SVM

iii) $g(\beta) = \frac{\lambda}{2} \|\beta\|_\beta^2 =$

Texte manquant

Exemple 1 : SVM (Séparateurs à Vaste Marge)

On dispose de données $(x_i)_{i \in \{1, \dots, p\}} \in \mathbb{R}^p$ labélisés $(y_i)_{i \in \{1, \dots, p\}} \in \{-1, 1\}^p$

On cherche à construire un hyperplan séparant les données (x_i) selon leurs labels (y_i)

Dans un premier temps, on suppose qu'il existe un tel hyperplan de vecteurs normal $\beta \in \mathbb{R}^n$, passant par l'origine.

Quel hyperplan choisir ?

\Rightarrow Incertitude : nombre de données, répartition dans \mathbb{R}^n , etc...

\Rightarrow Maximiser la distance maximale entre les données et l'hyperplan.

Condition de séparabilité : $\forall i \in \{1, \dots, p\}, y_i(x_i^T \beta) \geq 0$

D'où le problème d'optimisation suivant :

$$\max_{(\beta, M) \in (\mathbb{R}^n \times \mathbb{R}^+)} M \quad \text{s.c.} \quad \forall i \in \{1, \dots, p\}, \quad y_i \frac{(x_i^T \beta)}{\|\beta\|_2} \geq M \quad (3)$$

Remarque : $d(z, \{\beta^T x = 0\}) = \frac{|\beta^T z|}{\|\beta\|_2}$

En pratique, la condition de séparabilité n'est pas vérifiée pour tout $i \in \{1, \dots, p\}$

\Rightarrow Pénalisation des contraintes non satisfaites.

On pose $\forall t \in \mathbb{R}, t^+ = \max(t, 0)$

Ceci conduit à formuler un autre problème d'optimisation :

$$\max_{(\beta, M) \in (\mathbb{R}^n \times \mathbb{R}^+)} M - \lambda \sum_{i=1}^p (1 - y_i \frac{(x_i^T \beta)}{\|\beta\|_2 M})^+ \quad (4)$$

avec : $\|\beta\|_2 = \frac{1}{M}$ et en reformulant pour obtenir un problème de minimisation :

$$\min_{\beta \in \mathbb{R}^n} \|\beta\|_2^2 + \lambda \sum_{i=1}^p (1 - y_i(x_i^T \beta))^+ \quad (5)$$

avec : $\sum_{i=1}^p (1 - y_i(x_i^T \beta))^+$ non-lisse (non différentiable)

1.3 Rappels de convexité

Définition

Soit $\mathcal{C} \subset \mathbb{R}^n$. On dit que \mathcal{C} est convexe si :

$$\forall x, y \in \mathcal{C}, \forall \lambda \in [0, 1], \lambda x + (1 - \lambda)y \in \mathcal{C}$$

Exemples :

- i. partie affine : $\{x_0 + s \text{ avec } s \in S\}$ avec S un sous-espace vectoriel de \mathbb{R}^n et $x_0 \in \mathbb{R}^n$.
- ii. hyperplan : $\{x \in \mathbb{R}^n \text{ tel que } \alpha^T x = \beta\}$
- iii. demi-espace : $\{x \in \mathbb{R}^n \text{ tel que } \alpha^T x \leq \beta\}$
- iv. polyèdre : $\{x \in \mathbb{R}^n \text{ tel que } Ax \leq b\}$ avec $A \in \mathbb{M}_{m,n}(\mathbb{R})$ et $b \in \mathbb{R}^m$.
- v. ellipsoïde : $\{x \in \mathbb{R}^n \text{ tel que } x^T C x \leq 1\}$ avec $C \in \mathbb{S}_n(\mathbb{R})$ (matrice symétrique semi-définie positive).

Propriété

Opérations préservant la convexité :

- intersection
- somme
- multiplication par un scalaire
- produit cartésien
- image réciproque par une application linéaire
- image directe par une application linéaire
- projection : $\{x_1 \text{ tel que } (x_1, x_2) \in \mathcal{C}\}$ avec \mathcal{C} convexe.

Définition - Fonctions convexes

Soit $f : \mathcal{C} \rightarrow \mathbb{R}$ avec $\mathcal{C} \subset \mathbb{R}^n$ convexe.

- f est convexe sur \mathcal{C} si :

$$\forall x, y \in \mathcal{C}, \forall \lambda \in [0, 1], f(\lambda x + (1 - \lambda)y) \leq \lambda f(x) + (1 - \lambda)f(y)$$

- f est strictement convexe sur \mathcal{C} si :

$$\forall x, y \in \mathcal{C}, \forall \lambda \in]0, 1[, f(\lambda x + (1 - \lambda)y) < \lambda f(x) + (1 - \lambda)f(y)$$

Propriété - CNS

Condition Nécessaire de convexité dans le cas dérivable.

Soit $f : \Omega \rightarrow \mathbb{R}$ avec Ω ouvert de \mathbb{R}^n et $\mathcal{C} \subset \Omega$ convexe.

- Si f est dérivable sur Ω , alors f est convexe sur \mathcal{C} convexe si et seulement si

$$\begin{aligned} \forall x, y \in \mathcal{C}, f(y) &\geq f(x) + f'(x)(y - x) \\ \Leftrightarrow \forall x, y \in \mathcal{C}, f(y) &\geq f(x) + \nabla f(x)^T(y - x) \end{aligned}$$

- Si f est deux fois dérivable sur Ω , alors f est convexe sur \mathcal{C} convexe si et seulement si

$$\begin{aligned} \forall x \in \mathcal{C}, f''(x)(y - x, y - x) &\geq 0 \\ \Leftrightarrow \forall x \in \mathcal{C}, (y - x)^T \nabla^2 f(x)(y - x) &\geq 0 \end{aligned}$$

Propriété

- f convexe sur \mathcal{C} convexe $\Rightarrow \alpha f$ convexe sur \mathcal{C} convexe pour $\alpha > 0$
- Combinaisons linéaires à coefficients positifs de fonctions convexes sont convexes
- Soit f convexe sur \mathcal{C} convexe. Soit $A \in \mathbb{M}_{m,n}(\mathbb{R})$ et $b \in \mathbb{R}^m$.
Alors $\mathcal{C}' = \{x \in \mathbb{R}^n \text{ tel que } Ax + b \in \mathcal{C}\}$ est convexe et $x \mapsto f(Ax + b)$ est convexe sur \mathcal{C}' .
- Soit $(f_i)_{i \in \{1, \dots, m\}}$ convexes sur $(\mathcal{C}_i)_{i \in \{1, \dots, m\}}$
Alors $\max_{i \in \{1, \dots, m\}} f_i$ convexe sur $\bigcap_{i=1}^m \mathcal{C}_i$.
- Soit $g : \mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R}$ convexe sur $\mathcal{C} \subset \mathbb{R}^n$
Soit $h : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ croissante et convexe sur \mathcal{C}' tel que $g(\mathcal{C}) \subset \mathcal{C}'$
Alors $h \circ g$ est convexe sur \mathcal{C} .
- Soit $g : \mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R}^p$ avec $\forall i \in \{1, \dots, p\}$, g_i convexe sur \mathbb{R}^n
Soit $h : \mathbb{R}^p \rightarrow \mathbb{R}$ croissante et convexe vis-à-vis de chacun de ses arguments.
Alors $f : \mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R}$ est convexe sur \mathbb{R}^n
$$x \mapsto h \circ g(x) = h(g_1(x), \dots, g_p(x))$$

1.4 Régularité des fonctions convexes

Définition - Epigraphe

Soit $f : \mathcal{C} \rightarrow \mathbb{R}$

On appelle *épigraphe* de f , noté $\varepsilon(f)$, l'ensemble suivant :

$$\varepsilon(f) = \{(x, w) \in \mathcal{C} \times \mathbb{R} \text{ tel que } f(x) \leq w\}$$

Propriété

Soit $f : \mathcal{C} \rightarrow \mathbb{R}$ avec $\mathcal{C} \subset \mathbb{R}^n$ convexe.

f est convexe sur \mathcal{C} si et seulement si $\varepsilon(f)$ est convexe.

Preuve :

i) Supposons f convexe sur \mathcal{C} convexe

$$\forall x, y \in \mathcal{C}, \forall \lambda \in [0, 1], f(\lambda x + (1 - \lambda)y) \leq \lambda f(x) + (1 - \lambda)f(y)$$

Soient $(x_1, w_1) \in \varepsilon(f)$ et $(x_2, w_2) \in \varepsilon(f)$ et $\lambda \in [0, 1]$

$$f(\lambda x_1 + (1 - \lambda)x_2) \leq \lambda f(x_1) + (1 - \lambda)f(x_2) \leq \lambda w_1 + (1 - \lambda)w_2$$

$$\Rightarrow \lambda(x_1, w_1) + (1 - \lambda)(x_2, w_2) \in \varepsilon(f)$$

ii) Supposons $\varepsilon(f)$ convexe

Soit $x, y \in \mathcal{C}$ et $\lambda \in [0, 1]$

$$(x, f(x)), (y, f(y)) \in \varepsilon(f)$$

$$\Rightarrow \lambda(x, f(x)) + (1 - \lambda)(y, f(y)) \in \varepsilon(f)$$

$$\Rightarrow (\lambda x + (1 - \lambda)y, \lambda f(x) + (1 - \lambda)f(y)) \in \varepsilon(f)$$

$$\Rightarrow f(\lambda x + (1 - \lambda)y) \leq \lambda f(x) + (1 - \lambda)f(y)$$

Propriété - Inégalité de Jensen

Soit $f : \mathcal{C} \rightarrow \mathbb{R}$ avec $\mathcal{C} \subset \mathbb{R}^n$ convexe.

Soit $x_1, \dots, x_p \in \mathcal{C}$ et $\lambda_1, \dots, \lambda_p \in \mathbb{R}^+$ tel que $\sum_{i=1}^p \lambda_i = 1$.

$$\text{Alors } f(\sum_{i=1}^p \lambda_i x_i) \leq \sum_{i=1}^p \lambda_i f(x_i)$$

Propriété

Soit $f : \mathcal{C} \rightarrow \mathbb{R}$ avec $\mathcal{C} \subset \mathbb{R}^n$ convexe. Soit $x_0 \in \overset{\circ}{\mathcal{C}}$

f est continue en x_0 .

Preuve :

Soit $x_0 \in \overset{\circ}{\mathcal{C}}$. Soit Δ un simplexe inclus dans $\overset{\circ}{\mathcal{C}}$ et contenant x_0 .

Notons $(s_i)_{i \in \{1, \dots, n+1\}}$ les sommets de Δ .

$\forall x \in \Delta$, $\exists! (\lambda_i)_{i \in \{1, \dots, n+1\}} \in \mathbb{R}^{n+1}$ tel que $\lambda_i \geq 0$ et $\sum_{i=1}^{n+1} \lambda_i = 1$ et $x = \sum_{i=1}^{n+1} \lambda_i s_i$ (coordonnées barycentriques de x vis-à-vis de Δ).

d'où

$$f(x) \leq \sum_{i=1}^{n+1} \lambda_i f(s_i) \text{ par convexité de } f \text{ et inégalité de Jensen.}$$

$$\leq \max_{i \in \{1, \dots, n+1\}} f(s_i) \text{ car } \sum_{i=1}^{n+1} \lambda_i = 1$$

Donc f est majorée sur Δ .

En particulier, $\forall \delta > 0$ tel que $B(x_0, \delta) \subset \Delta$, f est majorée sur $B(x_0, \delta)$.

Fixons un tel δ et notons M un majorant de f sur $B(x_0, \delta)$.

Texte manquant

$$\Rightarrow f(\delta) \leq 2f(x_0) - M$$

$$\begin{aligned} \text{Bilan : } 2f(x_0) - M &\leq f(z) \leq M, \forall z \in B(x_0, \delta) \\ \Rightarrow f &\text{ est bornée sur } B(x_0, \delta) \end{aligned}$$

$$\text{Soit } K > 0 \text{ tel que } \forall z \in B(x_0, \delta), |f(z)| \leq K$$

On montre que f est lipschitzienne sur $B(x_0, \frac{\delta}{2})$
Soit $x, y \in B(x_0, \frac{\delta}{2})$, $x \neq y$

$$\text{On pose : } \begin{cases} x' = x - \frac{\delta}{2} \frac{y-x}{\|y-x\|} \\ y' = y + \frac{\delta}{2} \frac{y-x}{\|y-x\|} \end{cases}$$

$$\begin{aligned} \text{Alors } x' \in B(x_0, \delta) : \|x' - x_0\| &= \|x - \frac{\delta}{2} \frac{y-x}{\|y-x\|} - x_0\| \leq \|x - x_0\| + \frac{\delta}{2} < \delta \\ \text{De même, } y' \in B(x_0, \delta) \end{aligned}$$

$$\text{D'où } |f(x')| \leq K \text{ et } |f(y')| \leq K$$

$$\text{De plus, } x = \frac{2\|y-x\|}{2\|y-x\|+\delta} x' + \frac{\delta}{2\|y-x\|+\delta} y = \lambda x' + (1-\lambda)y' \text{ avec } \lambda = \frac{2\|y-x\|}{2\|y-x\|+\delta} \in]0, 1[$$

$$\begin{aligned} \text{Par convexité de } f \text{ sur } \mathcal{C} : f(x) &\leq \lambda f(x') + (1-\lambda)f(y') \\ \Rightarrow f(x) - f(y) &\leq \lambda(f(x') - f(y')) \leq 2K\lambda \leq \frac{4K}{2\|y-x\|+\delta} \|y-x\| \\ \Rightarrow |f(x) - f(y)| &\leq \frac{4K}{\delta} \|y-x\| \end{aligned}$$

$$\begin{aligned} \text{De même, } y &= \lambda y' + (1-\lambda)x \text{ et de la même manière, on montre que } |f(y) - f(x)| \leq \\ \frac{4K}{\delta} \|y-x\| \\ \Rightarrow |f(x) - f(y)| &\leq \frac{4K}{\delta} \|y-x\| \end{aligned}$$

Bilan : f est lipschitzienne sur $B(x_0, \frac{\delta}{2})$
En particulier, f est continue en x_0

2 Sous-différentiel d'une fonction

2.1 Sous-gradient et sous différentiel

Définition - Sous-différentiel et sous-gradient

Soit $f : \mathcal{C} \rightarrow \mathbb{R}$ avec $\mathcal{C} \subset \mathbb{R}^n$ convexe. Soit $x \in \mathcal{C}$ et $g \in \mathbb{R}^n$
 g est appelé *sous-gradient* de f en x si :

$$\forall y \in \mathcal{C}, f(y) \geq g^T(y - x) + f(x)$$

On appelle *sous-différentiel* de f en x , noté $\partial f(x)$, l'ensemble des sous-gradients de f en x :

$$\partial f(x) = \{g \in \mathbb{R}^n \text{ tel que } \forall y \in \mathcal{C}, f(y) \geq g^T(y - x) + f(x)\}$$

Exemple : $f : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}, f(x) = |x|$

Soit $x \in \mathbb{R}$

- si $x < 0$, alors $f(x) = -x$
Soit $g \in \mathbb{R}$ tel que $\forall y \in \mathbb{R}, f(y) \geq g(y - x) + f(x)$
 - Soit $y \leq 0$, $f(y) = -y = -y + x - x = -(y - x) + f(x) \geq g(y - x) + f(x)$
avec $g = -1$
 - Soit $y > 0$, $f(y) = y \geq -y + x - x \geq -(y - x) + f(x) \geq g(y - x) + f(x)$
avec $g = -1$

Donc $\partial f(x) = \{-1\}$

- si $x > 0$, $\partial f(x) = \{1\}$ (même raisonnement)
- si $x = 0$, $\partial f(x) = [-1, 1]$

Propriété

Soit $f : \mathcal{C} \rightarrow \mathbb{R}$ avec $\mathcal{C} \subset \mathbb{R}^n$ convexe. Soit $x \in \mathcal{C}$
Alors $\partial f(x)$ est un convexe non-vide.

Preuve :

Supposons $\partial f(x) = \emptyset$

alors $\partial f(x) = \bigcap_{y \in \mathcal{C}} \{g \in \mathbb{R}^n \text{ tel que } f(y) \geq g^T(y - x) + f(x)\}$

or, $\forall y \in \mathcal{C}$, $\{g \in \mathbb{R}^n \text{ tel que } f(y) \geq g^T(y - x) + f(x)\}$ est convexe (demi-espace)
et fermé (comme image réciproque d'un fermé par une application continue ψ)

$$\psi : \mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R}$$

$$g \mapsto f(y) - f(x) - g^T(y - x)$$

$\Rightarrow \partial f(x)$ est convexe et fermé comme intersections de parties convexes et fermées.

Propriété

Soit $f : \mathcal{C} \rightarrow \mathbb{R}$ avec $\mathcal{C} \subset \mathbb{R}^n$ convexe. Soit $x \in \overset{\circ}{\mathcal{C}}$ tel que f est continue en x . Alors $\partial f(x)$ est borné.

Preuve :

Soit $x \in \overset{\circ}{\mathcal{C}}$ tel que f est continue en x .

$x \in \overset{\circ}{\mathcal{C}} : \exists y_1 > 0$ tel que $B(x, y_1) \subset \mathcal{C}$

f continue en $x : \forall \varepsilon > 0, \exists y_2 > 0$ tel que $\forall y \in B(x, y_2), |f(y) - f(x)| < \varepsilon$

Posons $\eta = \min(y_1, y_2)$

Montrons que $\partial f(x)$ est borné.

Supposons le contraire.

$\forall M > 0, \exists g \in \partial f(x)$ tel que $\|g\|_2 > M$

Soit $M > 0$. Fixons un tel g tel que $\|g\|_2 > M \Rightarrow g \neq 0$

Soit $y = x + \frac{\eta}{2} \frac{g}{\|g\|_2}$

d'où $\|y - x\|_2 = \frac{\eta}{2} < \eta \Rightarrow y \in B(x, \eta) \subset \mathcal{C}$

Par définition de $g : f(y) \geq g^T(y - x) + f(x)$

$\Rightarrow f(y) - f(x) \geq \frac{\eta}{2} \|g\|_2 > \frac{\eta}{2} M$ avec $M = \frac{2}{\eta}$

$\Rightarrow |f(y) - f(x)| > \varepsilon$

Or, $y \in B(x, \eta) \Rightarrow y \in B(x, y_2) \Rightarrow |f(y) - f(x)| < \varepsilon$

D'où $\varepsilon < |f(y) - f(x)| < \varepsilon$: contradiction.

Donc $\partial f(x)$ est borné.

Propriété

Soit $f : \mathcal{C} \rightarrow \mathbb{R}$ avec $\mathcal{C} \subset \mathbb{R}^n$ convexe.

- $\forall x \in \overset{\circ}{\mathcal{C}}, \partial f(x) \neq \emptyset$ (Et $\partial f(x)$ compact convexe non-vide)
- Si f dérivable en $x \in \overset{\circ}{\mathcal{C}}$, alors $\partial f(x) = \{\nabla f(x)\}$

Preuve :

i) Soit $\mathcal{C} \subset \mathbb{R}^n$ convexe non-vide.

Soit $x_0 \in \mathcal{C}^c \cup (\overline{\mathcal{C}} \setminus \overset{\circ}{\mathcal{C}})$

alors $\exists \alpha \in \mathbb{R}^n \setminus \{0\}$ tel que $\sup_{z \in \mathcal{C}} \alpha^T z \leq \alpha^T x_0$

Texte manquant

Soit $x \in \overset{\circ}{\mathcal{C}}$

Texte manquant

ii) On suppose de plus f dérivable en $x \in \overset{\circ}{\mathcal{C}}$

- f convexe sur \mathcal{C} convexe et dérivable en $x \in \overset{\circ}{\mathcal{C}}$
 $\Rightarrow \forall y \in \mathcal{C}, f(y) \geq \nabla f(x)^T(y - x) + f(x)$
 $\Rightarrow \nabla f(x) \in \partial f(x)$
 $\Rightarrow \{\nabla f(x)\} \subset \partial f(x)$
- Soit $g \in \partial f(x)$
 $\forall y \in \mathcal{C}, f(y) \geq g^T(y - x) + f(x)$
Or, $x \in \overset{\circ}{\mathcal{C}} : \exists N \in \mathbb{N}$ tel que $y_N = x + \frac{u}{N} \in \mathcal{C}$ avec $u \in \mathbb{R}^n$

Fixons un tel N .

$$\forall n \geq N, f(y_n) \geq \frac{1}{n}g^T u + f(x)$$

Or, f dérivable en x :

$$\begin{aligned} f(y_n) &= f(x) + \frac{1}{n}\nabla f(x)^T u + \frac{1}{n}\|u\|_2 \varepsilon\left(\frac{1}{n}u\right) \text{ avec } \varepsilon(h) \xrightarrow{h \rightarrow 0} 0 \\ \Rightarrow f(x) + \frac{1}{n}\nabla f(x)^T u + \frac{1}{n}\|u\|_2 \varepsilon\left(\frac{1}{n}u\right) &\geq \frac{1}{n}g^T u + f(x) \\ \Rightarrow (\nabla f(x) - g)^T u + \|u\|_2 \varepsilon\left(\frac{1}{n}u\right) &\geq 0 \end{aligned}$$

$$\begin{aligned} \text{A la limite : } (\nabla f(x) - g)^T u &\geq 0, \forall u \in \mathbb{R}^n \\ \Rightarrow g &= \nabla f(x) \end{aligned}$$

$$\text{Donc } \partial f(x) \subset \{\nabla f(x)\}$$

$$\text{Bilan : } \partial f(x) = \{\nabla f(x)\}$$

Propriété

Soit $f : \mathcal{C} \rightarrow \mathbb{R}$ avec $\mathcal{C} \subset \mathbb{R}^n$ convexe. Soit $x^* \in \mathcal{C}$
Alors x^* est un minimum global de f sur \mathcal{C} si et seulement si $0 \in \partial f(x^*)$

Preuve :

$0 \in \partial f(x^*) \Leftrightarrow \forall y \in \mathcal{C}, f(y) \geq 0^T(y - x^*) + f(x^*) = f(x^*) \Leftrightarrow x^*$ est un minimum global de f sur \mathcal{C}

2.2 Calculs de sous-gradients

Pour simplifier, on suppose avoir (f_i) convexes sur \mathbb{R}^n

Propriété

- Soit $(\alpha_1, \alpha_2) \in (\mathbb{R}_+^*)^2$. On pose $f = \alpha_1 f_1 + \alpha_2 f_2$.
Alors $\partial f(x) = \alpha_1 \partial f_1(x) + \alpha_2 \partial f_2(x)$
- Soit $h : x \mapsto f(Ax + b)$ avec $A \in \mathbb{M}_{m,n}(\mathbb{R})$ et $b \in \mathbb{R}^m$
Alors $\partial h(x) = A^T \partial f(Ax + b)$
- Soit $f : x \mapsto \max_{i \in \{1, \dots, m\}} f_i(x)$
Soit $I_0 = \{i \in \{1, \dots, m\} \text{ tel que } f_i(x) = f(x)\}$
Alors $\forall g \in \partial f_{I_0}(x), g \in \partial f(x)$
- Soit $f : x \mapsto \sup_{a \in A} f_a(x)$
Soit $I_0 = \{a \in A \text{ tel que } f_a(x) = f(x)\}$
Alors $\forall g \in \partial f_{I_0}(x), g \in \partial f(x)$
Texte manquant

3 Algorithmes de sous-gradient

3.1 Algorithme du sous-gradient

On considère le problème suivant :

$$\min_{x \in \mathbb{R}^n} f(x) \quad \text{avec } f \text{ convexe sur } \mathbb{R}^n. \quad (6)$$

On suppose que f admet au moins un minimum $x^* \in \mathbb{R}^n$

On a l'Algorithme suivant :

Entrées : $x_0 \in \mathbb{R}^n$

Tant que

Texte manquant

Remarque : f est convexe sur \mathbb{R}^n

$\Rightarrow \forall x \in \mathbb{R}^n, \partial f(x) \neq \emptyset$

et $\partial f(x)$ est un compact convexe de \mathbb{R}^n

Soit $k \in \mathbb{N}$

$$\begin{aligned} \|x_{k+1} - x^*\|_2^2 &= \|x_k - \alpha_k g_k - x^*\|_2^2 \\ &= \|x_k - x^*\|_2^2 - 2\alpha_k g_k^T (x_k - x^*) + \alpha_k^2 \|g_k\|_2^2 \end{aligned}$$

Texte manquant

On pose : $f_{best}^k = \min_{j \in \{1, \dots, k\}} f(x_j)$

On a :

$$2 \sum_{l=1}^k \alpha_l (f(x_l) - f^*) \leq \|x_1 - x^*\|_2^2 + \sum_{l=1}^k \|g_l\|_2^2$$

$$\Rightarrow 0 \leq f_{best}^k - f(x^*) \leq \frac{\|x_1 - x^*\|_2^2 + \sum_{l=1}^k \|g_l\|_2^2}{2 \sum_{l=1}^k \alpha_l}$$

Soit $R > 0$ tel que $\|x_1 - x^*\| \leq R$

$$\text{On a donc : } 0 \leq f_{best}^k - f(x^*) \leq \frac{R^2 + \sum_{l=1}^k \|g_l\|_2^2}{2 \sum_{l=1}^k \alpha_l}$$

On suppose de plus : $\exists a > 0$ tel que $\forall l \in \mathbb{N}^*, \|g_l\| \leq a$

$$\Rightarrow 0 \leq f_{best}^k - f(x^*) \leq \frac{R^2 + a^2 \sum_{l=1}^k \alpha_l^2}{2 \sum_{l=1}^k \alpha_l}$$

Quelle stratégie de pas α_l choisir ?

- Pas constant : $\forall l \in \{1, \dots, k\}, \alpha_l = \alpha > 0$

$$\text{On a donc : } 0 \leq f_{best}^k - f(x^*) \leq \frac{R^2 + k a^2 \alpha^2}{2 k \alpha} \xrightarrow[k \rightarrow \infty]{} \frac{a^2 \alpha}{2}$$

$$\Rightarrow f_{best}^k \in B_f(f(x^*), \frac{a^2 \alpha}{2})$$

- $\forall l \in \{1, \dots, k\}, \alpha_l > 0$

•

$$\forall l \in \mathbb{N}, \alpha_l = \frac{\gamma_l}{g_l} \quad \text{avec} \quad \gamma_l > 0$$

$$\lim_{l \rightarrow \infty} \gamma_l = 0$$

$$\sum_{l=1}^{\infty} \gamma_l = \infty$$

Texte manquant

$$\begin{aligned} \forall k \geq N_1 + 1, \quad 0 \leq f_{best}^k - f(x^*) &\leq \frac{R^2 + a^2 \sum_{l=1}^{N_1} \alpha_l^2}{2 \sum_{l=1}^k \alpha_l} + \frac{a^2 \sum_{l=N_1+1}^k \alpha_l^2}{2 \sum_{l=1}^k \alpha_l} \\ &= \frac{R^2 + a^2 \sum_{l=1}^{N_1} \alpha_l^2}{2 \sum_{l=1}^k \alpha_l} + \frac{\varepsilon \sum_{l=N_1+1}^k \alpha_l^2}{2 \sum_{l=1}^k \alpha_l} \end{aligned}$$

De plus, $\sum_{l=1}^k \alpha_l \rightarrow \infty$

$$\exists N_2 \in \mathbb{N} \text{ tel que } \forall k \geq N_2, \sum_{l=1}^k \alpha_l^2 \geq \frac{R^2 + a^2 \sum_{l=1}^{N_1} \alpha_l^2}{\varepsilon}$$

D'où $\forall k \geq \max(N_1 + 1, N_2), 0 \leq f_{best}^k - f(x^*) \leq \frac{\varepsilon}{2} + \frac{\varepsilon}{2} = \varepsilon$

Donc $f_{best}^k \xrightarrow[k \rightarrow \infty]{} f(x^*)$

Remarque : On s'intéresse à la stratégie de pas qui minimise $\psi(\alpha) = \frac{R^2 + a^2 \|\alpha\|_2^2}{2\|\alpha\|_1}$

avec $\alpha \in (\mathbb{R}_+^*)^k$

Avec une telle stratégie de pas, il pourra être nécessaire de faire $\mathcal{O}(\frac{1}{\varepsilon})$ itérations pour atteindre $|f_{best}^k - f(x^*)| \leq \varepsilon$

Pour $\varepsilon = 10^{-3}$, on a 10^6 itérations : l'algorithme est très long dans le pire des cas.

3.2 Algorithme du sous-gradient projeté

Soit $f : \mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R}$ convexe. On considère le problème suivant :

$$\min_{x \in \mathcal{C}} f(x) \quad \text{avec } \mathcal{C} \text{ partie convexe, fermée, non-vide de } \mathbb{R}^n. \quad (7)$$

On suppose que (7) admette au moins une solution $x^* \in \mathcal{C}$

Remarque : \mathcal{C} partie convexe fermée non-vide de \mathbb{R}^n :

La projection orthogonale sur \mathcal{C} , notée $\Pi_{\mathcal{C}}$, est 1-lipschitzienne :

$$\forall (x, y) \in (\mathbb{R}^n)^2, \|\Pi_{\mathcal{C}}(x) - \Pi_{\mathcal{C}}(y)\|_2 \leq \|x - y\|_2$$

Idee Projection orthogonale sur \mathcal{C} des itérations de l'algorithme du sous-gradient.

On a l'algorithme suivant :

Entrées : $x_0 \in \mathbb{R}^n$

Tant que

- Calculer $g_k \in \partial f(x_k)$
- $x_{k+1} = \Pi_{\mathcal{C}}(x_k - \alpha_k g_k)$

Fin Tant que

Y'a-t-il convergence ?

Soit $z_{k+1} = x_k - \alpha_k g_k \in \mathbb{R}^n$ avec $g_k \in \partial f(x_k)$ et $\alpha_k > 0$

$$\begin{aligned} \|z_{k+1} - x^*\|_2^2 &= \|x_k - \alpha_k g_k - x^*\|_2^2 \\ &\leq \|x_k - x^*\|_2^2 - 2\alpha_k (f(x_k) - f(x^*)) + \alpha_k^2 \|g_k\|_2^2 \end{aligned}$$

$$\begin{aligned}
\text{Or, } \|x_k - x^*\|_2^2 &= \|\Pi_{\mathcal{C}}(z_{k+1}) - \Pi_{\mathcal{C}}(x^*)\|_2^2 \quad \text{car } x^* \in \mathcal{C} \Rightarrow \Pi_{\mathcal{C}}(x^*) = x^* \\
&\leq \|z_{k+1} - x^*\|_2^2 \quad \text{car } \Pi_{\mathcal{C}} \text{ est 1-lipschitzienne} \\
&\leq \|x_k - x^*\|_2^2 - 2\alpha_k(f(x_k) - f(x^*)) + \alpha_k^2 \|g_k\|_2^2
\end{aligned}$$

On retrouve les mêmes contraintes de convergence que pour l'algorithme du sous-gradient.

Notamment, on a besoin de $\mathcal{O}(\frac{1}{\varepsilon})$ itérations pour atteindre $|f_{best}^k - f(x^*)| \leq \varepsilon$

Remarque : $\Pi_{\mathcal{C}}$ peut être difficile à calculer en pratique selon ce qu'est \mathcal{C}

3.3 Cas particulier : contraintes convexes d'inégalité

On considère le problème suivant :

$$\begin{cases} \min_{x \in \mathbb{R}^n} f(x) & \text{avec } f \text{ et } (f_i)_{i \in \{1, \dots, p\}} \text{ convexe sur } \mathbb{R}^n \\ \forall i \in \{1, \dots, p\}, f_i(x) \leq 0 \end{cases} \quad (8)$$

En posant $\mathcal{C} = \{x \in \mathbb{R}^n \text{ tel que } \forall i \in \{1, \dots, p\}, f_i(x) \leq 0\}$

Le problème (8) devient :

$$\min_{x \in \mathcal{C}} f(x) \quad \text{avec } \mathcal{C} \text{ convexe} \quad (9)$$

Il est possible d'utiliser l'algorithme du sous-gradient projeté, mais $\Pi_{\mathcal{C}}$ peut être difficile à calculer.

Quelles autres stratégies ?

On cherche un algorithme qui respecte les contraintes à chaque itérations.

Entrées : $x_0 \in \mathbb{R}^n$

Tant que

- Calculer $g_k \in \mathbb{R}^n$ tel que :
 - $g_k \in \partial f(x_k)$ si $x_k \in \mathcal{C}$
 - $g_k \in \partial f_i(x_k)$ tel que $f_i(x_k) > 0$.
- $x_{k+1} = x_k - \alpha_k g_k$

Fin Tant que

On pose $f_{best}^k = \min_{j \in \{1, \dots, k\}} f(x_j)$ avec $x_j \in \mathcal{C}$

On suppose de plus que : $\exists x_l \in \mathbb{R}^n$ tel que $\forall i \in \{1, \dots, p\}, f_i(x_l) < 0$ et $f(x_l) \neq f(x^*)$ (avec x^* solution de (9))

Avec (α_l) tel que :
$$\begin{cases} \forall l \in \mathbb{N}^*, \alpha_l > 0 \\ \sum \alpha_l = \infty \\ \sum \alpha_l^2 < \infty \end{cases}$$

Alors $f_{best}^k \xrightarrow[k \rightarrow \infty]{} f(x^*)$

Preuve :

Supposons le contraire : $\exists \varepsilon > 0$ tel que $\forall N \in \mathbb{N}, \exists k \geq N$ tel que $f_{best}^k \geq f(x^*) + \varepsilon$
En particulier, $f_{best}^N \geq f_{best}^k \geq f(x^*) + \varepsilon, \forall N \in \mathbb{N}$

Soit $\lambda \in [0, 1]$. On pose $\tilde{x} = (1 - \lambda)x^* + \lambda x_l \in \mathcal{C}$ (par convexité de \mathcal{C})

Par convexité de f ,
$$\begin{aligned} f(\tilde{x}) &\leq (1 - \lambda)f(x^*) + \lambda f(x_l) \\ &\leq f(x^*) + \lambda(f(x_l) - f(x^*)) \end{aligned}$$

Texte manquant

$\forall i \in \{1, \dots, p\}, f_i(\tilde{x}) \leq (1 - \lambda)f_i(x^*) + \lambda f_i(x_l)$ par convexité de f_i
Or, $f_i(x^*) \leq 0$ car $x^* \in \mathcal{C}$ et $f_i(x_l) < 0$ par définition de x_l

$$\begin{aligned} f_i(\tilde{x}) &\leq \lambda f_i(x_l) \\ &\leq \lambda \max_{i \in \{1, \dots, p\}} f_i(x_l) \\ &\leq -\mu \quad \text{avec } \mu = \lambda \max_{i \in \{1, \dots, p\}} f_i(x_l) > 0 \end{aligned}$$

D'où $\exists(\tilde{x}, \mu) \in \mathcal{C} \times \mathbb{R}_+^*$ tel que
$$\begin{cases} f(\tilde{x}) \leq f(x^*) + \frac{\varepsilon}{2} \\ \forall i \in \{1, \dots, p\}, f_i(\tilde{x}) \leq -\mu \end{cases}$$

$$\begin{aligned} \forall k \in \mathbb{N}, \quad \|x_{k+1} - \tilde{x}\|_2^2 &= \|x_k - \alpha_k g_k - \tilde{x}\|_2^2 \\ &= \|x_k - \tilde{x}\|_2^2 - 2\alpha_k g_k^T(x_k - \tilde{x}) + \alpha_k^2 \|g_k\|_2^2 \end{aligned}$$

- 1er cas : $x_k \in \mathcal{C}$

Alors $g_k \in \partial f(x_k)$ et $\|x_{k+1} - \tilde{x}\|_2^2 \leq \|x_k - \tilde{x}\|_2^2 - 2\alpha_k(f(x_k) - f(\tilde{x})) + \alpha_k^2 \|g_k\|_2^2$
Or, $x_k \in \mathcal{C}$

Texte manquant

4 Méthodes proximales

4.1 Fonction proximale

Soit $h : \mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R}$ convexe. On définit la fonction proximale de h , noté prox_h , par :

$$\forall x \in \mathbb{R}^n, \quad \text{prox}_h(x) = \underset{u \in \mathbb{R}^n}{\operatorname{argmin}} \left\{ h(u) + \frac{1}{2} \|u - x\|_2^2 \right\} \quad (10)$$

Exemple :

i) $h = 0$ alors $\forall x \in \mathbb{R}^n, \text{prox}_h(x) = x$

ii) *Texte manquant*

iii) $\forall x \in \mathbb{R}^n, h(x) = \lambda \|x\|_1$ avec $\lambda > 0$

Alors prox_h est appelé *Seuillage doux*, et est défini par :

$$\forall i \in \{1, \dots, n\}, \quad [\text{prox}_h(x)]_i = \begin{cases} x_i - \lambda & \text{si } x_i > \lambda \\ 0 & \text{si } |x_i| \leq \lambda \\ x_i + \lambda & \text{si } x_i < -\lambda \end{cases} \quad (11)$$

4.2 Méthode du gradient proximal

On s'intéresse au problème d'optimisation suivant :

$$\min_{x \in \mathbb{R}^n} f(x) = g(x) + h(x) \quad (12)$$

Avec :

- g convexe et dérivable sur \mathbb{R}^n
- h convexe, potentiellement non-lisse (mais telle que prox_h soit facile à calculer)

Entrées : $x_0 \in \mathbb{R}^n$

Tant que

- $x_{k+1} = \text{prox}_{\alpha_k} h(x_k - \alpha_k \nabla g(x_k))$

et α_k obtenue depuis :

- i) $\forall k \in \mathbb{N}, \alpha_k = \alpha > 0$ (pas constant)
- ii) Recherche linéaire

Exemple :

- i) $h = 0 : x_{k+1} = x_k - \alpha_k \nabla g(x_k)$ (méthode de descente de gradient)

- ii) $h(x) = \begin{cases} 1 & \text{si } x \in \mathcal{C} \\ +\infty & \text{sinon} \end{cases}$ avec \mathcal{C} convexe fermée non-vide de \mathbb{R}^n $x_{k+1} = \Pi_{\mathcal{C}}(x_k - \alpha_k \nabla g(x_k))$ (méthode du gradient projeté)
- iii) $h(x) = \lambda \|x\|_1$ avec $\lambda > 0$
Seuillage doux pour minimiser $f(x) = g(x) + \lambda \|x\|_1$

Remarque :

i)

$$\begin{aligned} x_{k+1} &= \operatorname{argmin}_{u \in \mathbb{R}^n} \left\{ \alpha_k h(u) + \frac{1}{2} \|u - x_k + \alpha_k \nabla g(x_k)\|_2^2 \right\} \\ &= \operatorname{argmin}_{u \in \mathbb{R}^n} \left\{ h(u) + \frac{1}{2\alpha_k} \|u - x_k\|_2^2 + 2\alpha_k \nabla g(x_k)^T (u - x_k) + \alpha^2 \|\nabla g(x_k)\|_2^2 \right\} \\ &= \operatorname{argmin}_{u \in \mathbb{R}^n} \left\{ h(u) + g(x_k) + \nabla g(x_k)^T (u - x_k) + \frac{1}{2\alpha_k} \|u - x_k\|_2^2 + \frac{\alpha_k}{2} \|\nabla g(x_k)\|_2^2 \right\} \\ &= \operatorname{argmin}_{u \in \mathbb{R}^n} \left\{ h(u) + g(x_k) + \nabla g(x_k)^T (u - x_k) + \frac{1}{2\alpha_k} \|u - x_k\|_2^2 \right\} \end{aligned}$$

Avec : $g(x_k) + \nabla g(x_k)^T (u - x_k) + \frac{1}{2\alpha_k} \|u - x_k\|_2^2$ LE modèle quadratique *dégénéré* de g en x_k

- ii) $u = \operatorname{prox} h(x) \Leftrightarrow 0 \in \partial \rho(u)$ avec $\rho(u) = h(u) + \frac{1}{2} \|u - x\|_2^2$
 $\Leftrightarrow 0 \in \partial h(u) + \{u - x\}$
 $\Leftrightarrow x - u \in \partial h(u)$

iii) La méthode du gradient proximal peut se réécrire :

$$x_{k+1} = x_k + \alpha_k G_{\alpha_k}(x_k) \text{ avec } G_{\alpha_k}(x) = \frac{1}{\alpha}(x - \operatorname{prox} \alpha h(x - \alpha \nabla g(x)))$$

En effet,

$$\begin{aligned} x_k - \alpha_k G_{\alpha_k}(x_k) &= \operatorname{prox} \alpha_k h(x_k - \alpha_k \nabla g(x_k)) \\ &\Leftrightarrow x_k \alpha_k \nabla g(x_k) - x_k + \alpha_k G_{\alpha_k}(x_k) \in \partial \alpha_k h(x_k - \alpha_k G_{\alpha_k}(x_k)) \quad \text{par ii)} \\ &\Leftrightarrow \alpha_k [G_{\alpha_k}(x_k) - \nabla g(x_k)] \in \partial \alpha_k h(x_k - \alpha_k G_{\alpha_k}(x_k)) \\ &\Leftrightarrow G_{\alpha_k}(x_k) - \nabla g(x_k) \in \partial h(x_k - \alpha_k G_{\alpha_k}(x_k)) \\ &\Leftrightarrow G_{\alpha_k}(x_k) \in \partial h(x_k - \alpha_k G_{\alpha_k}(x_k)) + \{\nabla g(x_k)\} \end{aligned}$$

De plus, $G_{\alpha_k}(x_k) = 0 \Leftrightarrow 0 \in \partial h(x_k) + \{\nabla g(x_k)\} \Leftrightarrow x_k$ est un minimum de f

D'où : tout point fixe de la suite des itérés du gradient proximal est un minimum de f

Recherche linéaire : backtracking et condition d'arrêt modifiée

Entrées : $\alpha_0 > 0$, $\beta \in]0, 1[$, $x_k \in \mathbb{R}^n$, $\nabla g(x_k) \in \mathbb{R}^n$

Tant que

- $\alpha_{l+1} = \beta \alpha_l$
- Critère d'arrêt :

$$g(x_k - \alpha_l G_{\alpha_l}(x_k)) \leq g(x_k) - \alpha_l G_{\alpha_l}(x_k)^T \nabla g(x_k) + \frac{\alpha_l}{2} \|G_{\alpha_l}(x_k)\|_2^2$$

Fin Tant que

4.3 Recherche linéaire (choix des pas) et convergence de l'algorithme

Propriété

On suppose que ∇g est L -lipschitzienne avec $L > 0$:

$$\forall (x, y) \in (\mathbb{R}^n)^2, \|\nabla g(x) - \nabla g(y)\|_2 \leq L \|x - y\|_2$$

Alors l'algorithme de recherche linéaire s'arrête sur $\alpha_l \geq \min(\alpha_0, \frac{\beta}{L}) := \alpha_{min}$

Preuve :

$$\begin{aligned} \nabla g \text{ est } L\text{-lipschitzienne} &\Rightarrow \forall (x, y) \in (\mathbb{R}^n)^2, g(y) \leq g(x) + \nabla g(x)^T (y - x) + \frac{L}{2} \|y - x\|_2^2 \\ \Rightarrow g(x_k - \alpha_l G_{\alpha_l}(x_k)) &\leq g(x_k) - \alpha_l G_{\alpha_l}(x_k)^T \nabla g(x_k) + \frac{L}{2} \alpha_l^2 \|G_{\alpha_l}(x_k)\|_2^2 \end{aligned}$$

La condition est valide pour tout $\alpha_l \in]0, \frac{1}{L}[$

Donc à l'arrêt de la recherche linéaire, $\alpha_l \geq \min(\alpha_0, \frac{\beta}{L})$

Propriété

On suppose que ∇g est L -lipschitzienne. A l'arrêt de la recherche linéaire $(\alpha_k, G_{\alpha_k}(x_k))$, on a :

$$\forall z \in \mathbb{R}^n, f(x_k - \alpha_k G_{\alpha_k}(x_k)) \leq f(z) + G_{\alpha_k}(x_k)^T (x_k - z) - \frac{\alpha_k}{2} \|G_{\alpha_k}(x_k)\|_2^2$$

Preuve : Par définition du critère d'arrêt de la recherche linéaire :

$$\begin{aligned} g(x_k - \alpha_k G_{\alpha_k}(x_k)) &\leq g(x_k) - \alpha_k G_{\alpha_k}(x_k)^T \nabla g(x_k) + \frac{\alpha_k}{2} \|G_{\alpha_k}(x_k)\|_2^2 \\ &\leq g(x_k) + \alpha_k G_{\alpha_k}(x_k)^T (G_{\alpha_k}(x_k) - \nabla g(x_k)) - \frac{\alpha_k}{2} \|G_{\alpha_k}(x_k)\|_2^2 \end{aligned}$$

On a : $G_{\alpha_k}(x_k) - \nabla g(x_k) \in \partial h(x_k - \alpha_k G_{\alpha_k}(x_k))$

Donc : $\forall z \in \mathbb{R}^n, h(z) \geq [G_{\alpha_k}(x_k) - \nabla g(x_k)]^T (z - x_k + \alpha_k G_{\alpha_k}(x_k)) + h(x_k - \alpha_k G_{\alpha_k}(x_k))$

De plus,

$$\begin{aligned}
g(x_k - \alpha_k G_{\alpha_k}(x_k)) + h(x_k - \alpha_k G_{\alpha_k}(x_k)) &\leq g(x_k) + h(x_k - \alpha_k G_{\alpha_k}(x_k)) \\
&\quad + \alpha_k G_{\alpha_k}(x_k)^T (G_{\alpha_k}(x_k) - \nabla g(x_k)) \\
&\quad - \frac{\alpha_k}{2} \|G_{\alpha_k}(x_k)\|_2^2 \\
&\Leftrightarrow f(x_k - \alpha_k G_{\alpha_k}(x_k)) \leq g(x_k) + h(x_k - \alpha_k G_{\alpha_k}(x_k)) \\
&\quad + \alpha_k G_{\alpha_k}(x_k)^T (G_{\alpha_k}(x_k) - \nabla g(x_k)) \\
&\quad - \frac{\alpha_k}{2} \|G_{\alpha_k}(x_k)\|_2^2
\end{aligned}$$

$$\text{Or, } h(x_k - \alpha_k G_{\alpha_k}(x_k)) \leq h(z) + [G_{\alpha_k}(x_k) - \nabla g(x_k)]^T (x_k - z - \alpha_k G_{\alpha_k}(x_k))$$

$$\begin{aligned}
\Rightarrow f(x_k - \alpha_k G_{\alpha_k}(x_k)) &\leq g(x_k) + h(z) + \alpha_k G_{\alpha_k}(x_k)^T (G_{\alpha_k}(x_k) - \nabla g(x_k)) \\
&\quad + [G_{\alpha_k}(x_k) - \nabla g(x_k)]^T (x_k - z - \alpha_k G_{\alpha_k}(x_k)) \\
&\quad - \frac{\alpha_k}{2} \|G_{\alpha_k}(x_k)\|_2^2
\end{aligned}$$

$$f(x_k - \alpha_k G_{\alpha_k}(x_k)) \leq g(x_k) + h(z) + [G_{\alpha_k}(x_k) - \nabla g(x_k)]^T (x_k - z) - \frac{\alpha_k}{2} \|G_{\alpha_k}(x_k)\|_2^2$$

Or, g est convexe et dérivable sur \mathbb{R}^n d'où : $\forall z \in \mathbb{R}^n, g(z) \geq \nabla g(x_k)^T (z - x_k) + g(x_k)$
 $\Rightarrow g(x_k) \leq g(z) + \nabla g(x_k)^T (x_k - z)$

Texte manquant

Convergence :

On suppose que ∇g est L -lipschitzienne.

On suppose également que $\forall k \in \mathbb{N}, \alpha_k = \frac{1}{L}$ ou α_k est obtenu à partir de l'algorithme de recherche linéaire.

$$\forall z \in \mathbb{R}^n, \quad f(x_{k+1}) \leq f(z) + G_{\alpha_k}(x_k)^T (x_k - z) - \frac{\alpha_k}{2} \|G_{\alpha_k}(x_k)\|_2^2$$

- Avec $z = x_k$: $f(x_{k+1}) \leq f(x_k) - \frac{\alpha_k}{2} \|G_{\alpha_k}(x_k)\|_2^2$
Si x_k n'est pas un minimum de f , alors $\|G_{\alpha_k}(x_k)\|_2^2 \neq 0$ (méthode de descente)
- Avec $z = x^*$: $f(x_{k+1}) \leq f(x^*) + G_{\alpha_k}(x_k)^T (x_k - x^*) - \frac{\alpha_k}{2} \|G_{\alpha_k}(x_k)\|_2^2$
 $\Rightarrow 0 \leq f(x_{k+1}) - f(x^*) \leq G_{\alpha_k}(x_k)^T (x_k - x^*) - \frac{\alpha_k}{2} \|G_{\alpha_k}(x_k)\|_2^2$

$$\begin{aligned}
\text{Or,} \quad \|x_k - x^*\|_2^2 - \|x_{k+1} - x^*\|_2^2 &= \|x_k - x^*\|_2^2 - \|x_k - \alpha_k G_{\alpha_k}(x_k) - x^*\|_2^2 \\
&= 2\alpha_k G_{\alpha_k}(x_k)^T (x_k - x^*) - \alpha_k^2 \|G_{\alpha_k}(x_k)\|_2^2 \\
&= 2\alpha_k \left[G_{\alpha_k}(x_k)^T (x_k - x^*) - \frac{\alpha_k}{2} \|G_{\alpha_k}(x_k)\|_2^2 \right]
\end{aligned}$$

$$\Rightarrow G_{\alpha_k}(x_k)^T(x_k - x^*) - \frac{\alpha_k}{2} \|G_{\alpha_k}(x_k)\|_2^2 = \frac{1}{2\alpha_k} [\|x_k - x^*\|_2^2 - \|x_{k+1} - x^*\|_2^2]$$

$$\text{Et donc : } 0 \leq f(x_{k+1}) - f(x^*) \leq \frac{1}{2\alpha_k} [\|x_k - x^*\|_2^2 - \|x_{k+1} - x^*\|_2^2]$$

$$\text{D'où : } 0 \leq \sum_{l=0}^{k-1} [f(x_{l+1}) - f(x^*)] \leq \frac{1}{2} \sum_{l=0}^{k-1} \frac{1}{\alpha_l} [\|x_l - x^*\|_2^2 - \|x_{l+1} - x^*\|_2^2]$$

x^* est un minimum de f sur $\mathbb{R}^n \Leftrightarrow \forall z \in \mathbb{R}^n, f(z) \geq f(x^*)$

En posant $f_{best}^k = \min_{l \in \{0, \dots, k\}} f(x_l)$, on a :

$$0 \leq k(f_{best}^k - f(x^*)) \leq \frac{1}{2} \sum_{l=0}^{k-1} \frac{1}{\alpha_l} [\|x_l - x^*\|_2^2 - \|x_{l+1} - x^*\|_2^2]$$

En posant $\alpha^* = \begin{cases} \frac{1}{L} & \text{si stratégie de pas constant} \\ \alpha_{min} & \text{si recherche linéaire} \end{cases}$, on a :

$$0 \leq k(f_{best}^k - f(x^*)) \leq \frac{1}{2\alpha^*} \|x_0 - x^*\|_2^2$$

Soit $R \geq \|x_0 - x^*\|_2^2$:

$$\text{Alors } 0 \leq f_{best}^k - f(x^*) \leq \frac{R^2}{2\alpha^*} \frac{1}{k}$$

$$\text{Donc } f_{best}^k \xrightarrow[k \rightarrow \infty]{} f(x^*)$$

On atteint $0 \leq f_{best}^k - f(x^*) \leq \varepsilon$ (avec $\varepsilon > 0$) au plus tard si $k \geq \frac{2\alpha^*}{R^2} \frac{1}{\varepsilon}$

Donc $\mathcal{O}(\frac{1}{\varepsilon})$ itérations pour atteindre la précision ε sur la valeur de $f(x^*)$

4.4 Méthode accélérée du gradient proximal

Sous les mêmes hypothèses que la méthode du gradient proximal, on pose l'algorithme suivant : (algorithme FISTA : Fast Iterative Shrinkage-Thresholding Algorithm)

Entrées : $x_0 \in \mathbb{R}^n$

$y_0 = x_0$

Tant que

- $x_k = \text{prox } \alpha_k h(y_{k-1} - \alpha_k \nabla g(y_{k-1}))$
- $y_k = x_k + \frac{k-1}{k+2}(x_k - x_{k-1})$

Fin Tant que

Algorithme de recherche linéaire :

Entrées : $t_0 = \alpha_{k-1}$, $\beta \in]0, 1[$

Tant que

- $t_l = \beta t_{l-1}$
- Critère d'arrêt :
$$g(y_{k-1} - t_l \nabla g(y_{k-1})) \leq g(y_{k-1}) - t_l G_{t_l}(y_{k-1})^T \nabla g(y_{k-1}) + \frac{t_l}{2} \|G_{t_l}(y_{k-1})\|_2^2$$

Fin Tant que