

# Методы оптимизации

## Лекция 9: Введение в стохастическую оптимизацию

Александр Катруца

Физтех-школа прикладной математики и информатики  
Московский физико-технический институт



9 ноября 2020 г.

## На прошлой лекции

- ▶ Метод сопряжённых градиентов
- ▶ Метод тяжёлого шарика
- ▶ Ускоренный градиентный метод Нестерова

# Что нам известно?

- ▶ Детерминированные методы первого порядка

## Что нам известно?

- ▶ Детерминированные методы первого порядка
- ▶ Нижние оценки для методов первого порядка

## Что нам известно?

- ▶ Детерминированные методы первого порядка
- ▶ Нижние оценки для методов первого порядка
- ▶ Методы, которые достигают этих оценок

## Что нам известно?

- ▶ Детерминированные методы первого порядка
- ▶ Нижние оценки для методов первого порядка
- ▶ Методы, которые достигают этих оценок

## Вопросы

- ▶ Как изменятся методы при введении стохастичности в задачу?
- ▶ Как оценивать сходимость в таком случае?

# Зачем вводить стохастику?

- ▶ Для большого числа переменных может быть очень долго вычислять точный градиент

# Зачем вводить стохастику?

- ▶ Для большого числа переменных может быть очень долго вычислять точный градиент
- ▶ Стохастического градиента может быть достаточно для решения задачи



# Зачем вводить стохастику?

- ▶ Для большого числа переменных может быть очень долго вычислять точный градиент
- ▶ Стохастического градиента может быть достаточно для решения задачи
- ▶ Иногда параметры задачи измеряются с естественной погрешностью

## Как ввести случайность в задачу?

- Известные параметры задачи – случайные величины с известным распределением

$$\begin{aligned} \min & x_1 + x_2 \\ \text{s.t. } & w_1 x_1 + x_2 \geq 0 \\ & w_2 x_1 + x_2 \geq 0 \\ & x_{1,2} \geq 0, \end{aligned}$$

где  $w_1 \sim \mathcal{U}[0, 4]$ ,  $w_2 \sim \mathcal{U}[2, 3]$

## Как ввести случайность в задачу?

- ▶ Известные параметры задачи – случайные величины с известным распределением

$$\begin{aligned} \min \quad & x_1 + x_2 \\ \text{s.t.} \quad & w_1 x_1 + x_2 \geq 0 \\ & w_2 x_1 + x_2 \geq 0 \\ & x_{1,2} \geq 0, \end{aligned}$$

где  $w_1 \sim \mathcal{U}[0, 4]$ ,  $w_2 \sim \mathcal{U}[2, 3]$

- ▶ Целевая функция – матожидание некоторой другой функции

$$\min f(x) := \mathbb{E}_\omega[F(x, \omega)]$$

## Как ввести случайность в задачу?

- ▶ Известные параметры задачи – случайные величины с известным распределением

$$\begin{aligned} \min \quad & x_1 + x_2 \\ \text{s.t.} \quad & w_1 x_1 + x_2 \geq 0 \\ & w_2 x_1 + x_2 \geq 0 \\ & x_{1,2} \geq 0, \end{aligned}$$

где  $w_1 \sim \mathcal{U}[0, 4]$ ,  $w_2 \sim \mathcal{U}[2, 3]$

- ▶ Целевая функция – матожидание некоторой другой функции

$$\min f(x) := \mathbb{E}_\omega[F(x, \omega)]$$

- ▶ Частный случай

$$\min \frac{1}{N} \sum_{i=1}^N f(x_i)$$

# SAA vs SA

- ▶ Стохастическая аппроксимация (SA)

# SAA vs SA

- ▶ Стохастическая аппроксимация (SA)
  - ▶ Сгенерировать  $\omega^k$  i.i.d.

# SAA vs SA

- ▶ Стохастическая аппроксимация (SA)
  - ▶ Сгенерировать  $\omega^k$  i.i.d.
  - ▶ Вычислить стохастический градиент  $G(x, \omega^k)$

# SAA vs SA

- ▶ Стохастическая аппроксимация (SA)
  - ▶ Сгенерировать  $\omega^k$  i.i.d.
  - ▶ Вычислить стохастический градиент  $G(x, \omega^k)$
  - ▶ Использовать его в стохастическом градиентном спуске



# SAA vs SA

- ▶ Стохастическая аппроксимация (SA)
  - ▶ Сгенерировать  $\omega^k$  i.i.d.
  - ▶ Вычислить стохастический градиент  $G(x, \omega^k)$
  - ▶ Использовать его в стохастическом градиентном спуске
- ▶ Усреднённая по сэмплам аппроксимация (SAA)

# SAA vs SA

- ▶ Стохастическая аппроксимация (SA)
  - ▶ Сгенерировать  $\omega^k$  i.i.d.
  - ▶ Вычислить стохастический градиент  $G(x, \omega^k)$
  - ▶ Использовать его в стохастическом градиентном спуске
- ▶ Усреднённая по сэмплам аппроксимация (SAA)
  - ▶ Сгенерировать  $N$  сэмплов  $\omega_1, \dots, \omega_N$

# SAA vs SA

- ▶ Стохастическая аппроксимация (SA)
  - ▶ Сгенерировать  $\omega^k$  i.i.d.
  - ▶ Вычислить стохастический градиент  $G(x, \omega^k)$
  - ▶ Использовать его в стохастическом градиентном спуске
- ▶ Усреднённая по сэмплам аппроксимация (SAA)
  - ▶ Сгенерировать  $N$  сэмплов  $\omega_1, \dots, \omega_N$
  - ▶ Вычислить эмпирическую оценку целевой функции
$$\hat{f}_N = \frac{1}{N} \sum_{i=1}^N F(x, \omega_i)$$

# SAA vs SA

- ▶ Стохастическая аппроксимация (SA)
  - ▶ Сгенерировать  $\omega^k$  i.i.d.
  - ▶ Вычислить стохастический градиент  $G(x, \omega^k)$
  - ▶ Использовать его в стохастическом градиентном спуске
- ▶ Усреднённая по сэмплам аппроксимация (SAA)
  - ▶ Сгенерировать  $N$  сэмплов  $\omega_1, \dots, \omega_N$
  - ▶ Вычислить эмпирическую оценку целевой функции
$$\hat{f}_N = \frac{1}{N} \sum_{i=1}^N F(x, \omega_i)$$
  - ▶ Минимизировать  $\hat{f}_N$  вместо исходной функции  $f$

# Постановка задачи

$$\min_{x \in \mathbb{R}^n} \frac{1}{N} \sum_{i=1}^N f_i(x)$$

- ▶  $f_i(x)$  могут быть невыпуклыми
- ▶  $n$  может быть порядка  $10^6$  и больше
- ▶  $N$  также может быть очень большим

## Пример 1

- ▶ Стохастическая оценка следа матрицы

$$\text{trace}(A) = \text{trace}(AI) = \text{trace}(A\mathbb{E}_z z z^\top) = \mathbb{E}_z(z^\top A z),$$

где  $z$  – вектор из стандартного нормального распределения или распределения Радемахера

- ▶ Матожидание заменим на несмещённую оценку  $\hat{f}_N$  как в SAA подходе
- ▶ Минимизируем  $\hat{f}_N$  для фиксированных  $z_i$  из предыдущего пункта

## Пример 2

- ▶ Задача классификации
- ▶ Функция ошибки  $\ell$  аддитивна по объектам обучающей выборки

$$\min_w \frac{1}{N} \sum_{i=1}^N \ell(w|x_i)$$

- ▶ Интерпретация через эмпирический риск и приближение истинного распределения данных

# Стохастический градиентный спуск (SGD)

$$x_{k+1} = x_k - \alpha_k h_k,$$

где

- ▶  $h_k = f'_{i_k}(x_k)$ ,  $i_k \in \{1, \dots, N\}$  выбирается случайно
- ▶  $h_k = \frac{1}{|\mathcal{I}_k|} \sum_{i \in \mathcal{I}_k} f'_i(x_k)$ ,  $\mathcal{I}_k \subset \{1, \dots, N\}$  – некоторое подмножество индексов, обычно, фиксированной мощности  $|\mathcal{I}_k| = m$

## Свойства

1. Несмещённая оценка градиента

$$\mathbb{E}[h_k] = f'(x_k)$$

2. Большая дисперсия



# Сходимость

## Теорема

Пусть  $f$  выпуклая функция с Липшицевым градиентом с константой  $L$ . Тогда если SGD генерирует  $h_k$  такие что  $\text{Var}(h_k) \leq \sigma^2$  и  $\alpha_k \leq \frac{1}{L}$  тогда

$$\mathbb{E}[f(\bar{x}_k)] - f^* \leq \frac{\|x_0 - x^*\|_2^2}{\alpha_k k} + \frac{\alpha_k \sigma^2}{2}$$

В частности после  $k = \frac{(\sigma^2 + L\|x^* - x_0\|_2^2)}{\varepsilon^2}$  итераций при условии  $\alpha_k = \frac{1}{\sqrt{k}}$  получим решение с точностью  $2\varepsilon$

# Общий подход к уменьшению дисперсии

- ▶ Пусть  $X_\omega$  даёт несмещённую оценку для параметра  $x$ :  
 $\mathbb{E}_\omega[X_\omega] = x$

## Общий подход к уменьшению дисперсии

- ▶ Пусть  $X_\omega$  даёт несмещённую оценку для параметра  $x$ :  
 $\mathbb{E}_\omega[X_\omega] = x$
- ▶ Пусть  $Z_\omega = X_\omega - Y_\omega$  так что  $\mathbb{E}_\omega[Y_\omega] \approx 0$

## Общий подход к уменьшению дисперсии

- ▶ Пусть  $X_\omega$  даёт несмещённую оценку для параметра  $x$ :  
 $\mathbb{E}_\omega[X_\omega] = x$
- ▶ Пусть  $Z_\omega = X_\omega - Y_\omega$  так что  $\mathbb{E}_\omega[Y_\omega] \approx 0$
- ▶ Тогда  $\mathbb{E}_\omega[X_\omega] = \mathbb{E}_\omega[Z_\omega] = x$

## Общий подход к уменьшению дисперсии

- ▶ Пусть  $X_\omega$  даёт несмещённую оценку для параметра  $x$ :  
 $\mathbb{E}_\omega[X_\omega] = x$
- ▶ Пусть  $Z_\omega = X_\omega - Y_\omega$  так что  $\mathbb{E}_\omega[Y_\omega] \approx 0$
- ▶ Тогда  $\mathbb{E}_\omega[X_\omega] = \mathbb{E}_\omega[Z_\omega] = x$
- ▶  $\text{Var}(Z_\omega) = \text{Var}(X_\omega) + \text{Var}(Y_\omega) - 2\text{Cov}(X_\omega, Y_\omega) \ll \text{Var}(X_\omega)$   
если  $Y_\omega$  сильно коррелирует с  $X_\omega$

# Общий подход к уменьшению дисперсии

- ▶ Пусть  $X_\omega$  даёт несмещённую оценку для параметра  $x$ :  
 $\mathbb{E}_\omega[X_\omega] = x$
- ▶ Пусть  $Z_\omega = X_\omega - Y_\omega$  так что  $\mathbb{E}_\omega[Y_\omega] \approx 0$
- ▶ Тогда  $\mathbb{E}_\omega[X_\omega] = \mathbb{E}_\omega[Z_\omega] = x$
- ▶  $\text{Var}(Z_\omega) = \text{Var}(X_\omega) + \text{Var}(Y_\omega) - 2\text{Cov}(X_\omega, Y_\omega) \ll \text{Var}(X_\omega)$   
если  $Y_\omega$  сильно коррелирует с  $X_\omega$

## Рецепт по уменьшению дисперсии

Найти такую оценку  $Y$ , что

1. Матожидание близко к 0
2. Сильно коррелирует с данной оценкой  $X$

# Stochastic average gradient (Schmidt, Le Roux, Bach 2013)

- ▶ Инициализация  $x_0$  и  $g_i^0 = x_0, i = \{1, \dots, N\}$
- ▶ На  $k$ -ой итерации выбираем  $i_k$  и обновляем  $g_{i_k}^k = f'_{i_k}(x_k)$
- ▶  $x_{k+1} = x_k - \alpha_k \frac{1}{N} \sum_{i=1}^N g_i^k$
- ▶ Более наглядная запись

$$x_{k+1} = x_k - \alpha_k \left( \frac{1}{N} g_{i_k}^{(k+1)} - \frac{1}{N} g_{i_k}^k + \frac{1}{N} \sum_{i=1}^N g_i^k \right)$$

## Уменьшение дисперсии

- ▶  $X = g_{i_k}^{(k+1)}$  и  $\mathbb{E}_\omega[X] = f'(x_k)$
- ▶  $Y = g_{i_k}^k - \sum_{i=1}^N g_i^k$  и  $\mathbb{E}_\omega[Y] \neq 0$
- ▶  $\|X - Y\|_2 = \|(g_{i_k}^{(k+1)} - g_{i_k}^k) + \sum_{i=1}^N g_i^k\|_2 \rightarrow 0, k \rightarrow \infty$
- ▶ Дисперсия итоговой оценки стремится к 0



# Сходимость для $L$ -выпуклой функции

## Теорема

Пусть  $f_i$  дифференцируемы с Липшицевым градиентом,  
 $\bar{x}^{(k)} = \frac{1}{k} \sum_{i=0}^{k-1} x_i$ ,  $\alpha_k = \frac{1}{16L}$  и инициализация

$$g_i^0 = f'_i(x_0) - f'(x_0), \quad i = 1, \dots, N$$

даёт

$$\mathbb{E}[f(\bar{x}^{(k)})] - f(x^*) \leq \frac{48n}{k}(f(x_0) - f^*) + \frac{128L}{k}\|x_0 - x^*\|_2^2$$

# Сравнение

- ▶ SAG

$$\frac{48n}{k}(f(x_0) - f^*) + \frac{128L}{k}\|x_0 - x^*\|_2^2$$

Зависимость от  $n$  в первом слагаемом!

- ▶ GD

$$\frac{L\|x_0 - x^*\|_2^2}{k}$$

- ▶ SGD

$$\frac{\|x_0 - x^*\|_2^2 + \sigma^2}{2\sqrt{k}}$$

# Сходимость для $L$ -выпуклой и $\mu$ -сильно выпуклой функции

## Теорема

При тех же предположениях, что и в теореме для  $L$ -выпуклой функции выполнено следующее

$$\mathbb{E}[f(\bar{x}^{(k)})] - f(x^*) \leq \left(1 - \min\left\{\frac{\mu}{16L}, \frac{1}{8n}\right\}\right)^k \left(\frac{3}{2}(f(x_0) - f^*) + \frac{4L}{n}\|x^* - x_0\|_2^2\right)$$

- ▶ Адаптируется к сильной выпуклости
- ▶ Аналогичен GD
- ▶ SGD даёт только  $\mathcal{O}(1/k)$

# Комментарии

- ▶ Для SAG необходима аккуратная настройка
- ▶ Начальное приближение лучше получать после одной эпохи SGD + сохранение  $g_i^0$
- ▶ Выбор  $\alpha_k$

# SAGA (Defazio, Bach, Lacoste-Julien 2014)

Аналогично SAG, но

$$x_{k+1} = x_k - \alpha_k \left( g_{i_k}^{(k+1)} - g_{i_k}^k + \frac{1}{N} \sum_{i=1}^N g_i^k \right)$$

- ▶ Несмещённая оценка:  $\mathbb{E}[Y] = 0$
- ▶ Дисперсия выше, чем у SAG
- ▶ Аналогичный анализ уменьшения дисперсии
- ▶ Обобщается на композитные задачи
- ▶ Оценки сходимости для двух классов выпуклых функций аналогичны SAG
- ▶ Детали реализации аналогичны SAG

# SVRG (Johnson, Zhang 2013)

- ▶ Инициализация  $\bar{x}_0$

- ▶ Цикл  $k = 1, 2, \dots$

- ▶  $\bar{x} = \bar{x}_0$

- ▶  $\bar{\mu} = f'(\bar{x})$

- ▶  $x_0 = \bar{x}_0$

- ▶ Цикл  $m = 1, \dots, l$

- ▶ Случайно выбрать  $i_m \in \{1, \dots, N\}$

- ▶

$$x_{m+1} = x_m - \alpha(f'_{i_m}(x_m) - f'_{i_m}(\bar{x}) + \bar{\mu})$$

- ▶  $\bar{x}_0 = x_l$

# Особенности

- ▶ Аналог SAGA
- ▶ Гораздо более простое доказательство
- ▶ Зависит от размера эпох

# Недостатки методов уменьшения дисперсии

- ▶ Требуют вычисления точного градиента
- ▶ Зависят от дополнительных параметров
- ▶ Нет универсального способа запуска



# Безградиентные методы

## Зачем нужны?

- ▶ Целевая переменная — дискретная
- ▶ Градиент вычислить сложно и долго

# Безградиентные методы

## Зачем нужны?

- ▶ Целевая переменная — дискретная
- ▶ Градиент вычислить сложно и долго

## Примеры

- ▶ Все задачи про принятие решений и выбор элемента из конечного множества
- ▶ Подбор гиперпараметров в моделях машинного обучения
- ▶ Параметры скаляризации для задач многокритериальной оптимизации

# Имитация отжига

- ▶ Аналогия процедуры в металлургии, при которой происходит кристаллизация вещества при постепенном понижении температуры
- ▶ Основные шаги алгоритма
  - ▶ Инициализация начальной точки и параметров
  - ▶ На каждой итерации происходит обновление параметров с некоторой вероятностью, которая зависит от температуры

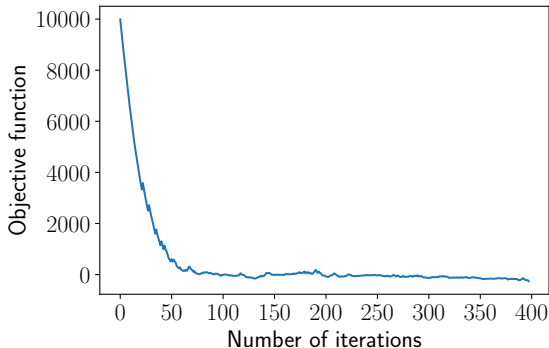
$$\mathbb{P}(\mathbf{x}_k \rightarrow \mathbf{x}^*) = \begin{cases} 1 & f(\mathbf{x}^*) < f(\mathbf{x}_k) \\ \exp\left(-\frac{f(\mathbf{x}^*) - f(\mathbf{x}_k)}{T/k}\right) & f(\mathbf{x}^*) > f(\mathbf{x}_k) \end{cases}$$

- ▶ Подбор знаменателя — эвристика

## Пример задачи

Задача о разбиении вершин графа с матрицей  $\mathbf{W}$

$$\begin{aligned} \min \mathbf{x}^\top \mathbf{W} \mathbf{x} \\ \text{s.t. } x_i \in \{-1, 1\} \end{aligned}$$



$$\alpha_k = 1/k$$

- ▶ Различные способы появления случайности
- ▶ SAA vs SA
- ▶ Наличие шума приводит к замедлению SGD
- ▶ Различные способы усреднения градиентов приводят к ускорению
- ▶ Завышенные требования для реальных задач
- ▶ Безградиентные методы: имитация отжига