

Métodos de primer orden

Axel Sirota

Facultad de Ciencias Exactas y Naturales

Departamento de Matemática

Hoja de ruta

- 1 **Introducción**
- 2 Convergencia de algoritmos de tipo batch
- 3 Algoritmos estocásticos
- 4 References

Marco teórico del problema

Consideremos una muestra aleatoria $\{x_i, y_i\}_{i \leq N} \subset \mathbb{R}^{d_x} \times \mathbb{R}^{d_y}$ tomada bajo una distribución $\mathbb{P}(x, y)$.

El objetivo del *Machine Learning* es encontrar $h^* \in \mathcal{H} = \{h : \mathbb{R}^{d_x} \rightarrow \mathbb{R}^{d_y}\}$ tal que $R(h) = \mathbb{E}[1[h(x) \neq y]]$ sea mínima.

Dicho contexto es *variacional y estocástico*.

La práctica usual consiste en tomar una dada $\tilde{h} : \mathbb{R}^{d_x} \times \mathbb{R}^d \rightarrow \mathbb{R}^{d_y}$ que surge del conocimiento a priori del problema y tomar:

$$\mathcal{H}_{\tilde{h}} := \{\tilde{h}(\cdot; w) : w \in \mathbb{R}^d\}$$

Marco teórico del problema

Consideremos una muestra aleatoria $\{x_i, y_i\}_{i \leq N} \subset \mathbb{R}^{d_x} \times \mathbb{R}^{d_y}$ tomada bajo una distribución $\mathbb{P}(x, y)$.

El objetivo del *Machine Learning* es encontrar $h^* \in \mathcal{H} = \{h : \mathbb{R}^{d_x} \rightarrow \mathbb{R}^{d_y}\}$ tal que $R(h) = \mathbb{E}[1[h(x) \neq y]]$ sea mínima.

Dicho contexto es *variacional y estocástico*.

La práctica usual consiste en tomar una dada $\tilde{h} : \mathbb{R}^{d_x} \times \mathbb{R}^d \rightarrow \mathbb{R}^{d_y}$ que surge del conocimiento a priori del problema y tomar:

$$\mathcal{H}_{\tilde{h}} := \{\tilde{h}(\cdot; w) : w \in \mathbb{R}^d\}$$

Marco teórico del problema

Consideremos una muestra aleatoria $\{x_i, y_i\}_{i \leq N} \subset \mathbb{R}^{d_x} \times \mathbb{R}^{d_y}$ tomada bajo una distribución $\mathbb{P}(x, y)$.

El objetivo del *Machine Learning* es encontrar $h^* \in \mathcal{H} = \{h : \mathbb{R}^{d_x} \rightarrow \mathbb{R}^{d_y}\}$ tal que $R(h) = \mathbb{E}[1[h(x) \neq y]]$ sea mínima.

Dicho contexto es *variacional y estocástico*.

La práctica usual consiste en tomar una dada $\tilde{h} : \mathbb{R}^{d_x} \times \mathbb{R}^d \rightarrow \mathbb{R}^{d_y}$ que surge del conocimiento a priori del problema y tomar:

$$\mathcal{H}_{\tilde{h}} := \{\tilde{h}(\cdot; w) : w \in \mathbb{R}^d\}$$

Marco teórico del problema

Dada $\ell : \mathbb{R}^{d_y} \times \mathbb{R}^{d_y} \rightarrow \mathbb{R}$ una distancia en \mathbb{R}^{d_y} entonces el objetivo se reduce a minimizar $R(w)$ donde:

$$R(w) = \int_{\mathbb{R}^{d_x} \times \mathbb{R}^{d_y}} \ell(h(x; w), y) dP(x, y) = \mathbb{E}[\ell(h(x; w), y)]$$

Al no conocer \mathbb{P} se optimiza $R_n(w)$:

$$R_n(w) = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n \ell(h(x_i; w), y_i)$$

Que resulta un estimador insesgado de R para cada $w \in \mathbb{R}^d$ por la desigualdad Hoeffding [?]

No obstante, este subconjunto \mathcal{H} parametrizado además debe minimizar $L(h^*, w) = |R(h^*) - R_n(h_w)|$ donde h^* es la función óptima objetivo y h_w es la minimizante de R_n sobre el subconjunto \mathcal{H} .

Marco teórico del problema

Dada $\ell : \mathbb{R}^{d_y} \times \mathbb{R}^{d_y} \rightarrow \mathbb{R}$ una distancia en \mathbb{R}^{d_y} entonces el objetivo se reduce a minimizar $R(w)$ donde:

$$R(w) = \int_{\mathbb{R}^{d_x} \times \mathbb{R}^{d_y}} \ell(h(x; w), y) dP(x, y) = \mathbb{E}[\ell(h(x; w), y)]$$

Al no conocer \mathbb{P} se optimiza $R_n(w)$:

$$R_n(w) = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n \ell(h(x_i; w), y_i)$$

Que resulta un estimador insesgado de R para cada $w \in \mathbb{R}^d$ por la desigualdad Hoeffding [?]

No obstante, este subconjunto \mathcal{H} parametrizado además debe minimizar $L(h^*, w) = |R(h^*) - R_n(h_w)|$ donde h^* es la función óptima objetivo y h_w es la minimizante de R_n sobre el subconjunto \mathcal{H} .

Marco teórico del problema

Dada $\ell : \mathbb{R}^{d_y} \times \mathbb{R}^{d_y} \rightarrow \mathbb{R}$ una distancia en \mathbb{R}^{d_y} entonces el objetivo se reduce a minimizar $R(w)$ donde:

$$R(w) = \int_{\mathbb{R}^{d_x} \times \mathbb{R}^{d_y}} \ell(h(x; w), y) dP(x, y) = \mathbb{E}[\ell(h(x; w), y)]$$

Al no conocer \mathbb{P} se optimiza $R_n(w)$:

$$R_n(w) = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n \ell(h(x_i; w), y_i)$$

Que resulta un estimador insesgado de R para cada $w \in \mathbb{R}^d$ por la desigualdad Hoeffding [?]

No obstante, este subconjunto \mathcal{H} parametrizado además debe minimizar $L(h^*, w) = |R(h^*) - R_n(h_w)|$ donde h^* es la función óptima objetivo y h_w es la minimizante de R_n sobre el subconjunto \mathcal{H} .

Marco teórico del problema

En conclusión, la obtención de dicha h óptima se separa en dos problemas no disjuntos:

- ① Encontrar \mathcal{H} parametrizada por $w \in \mathbb{R}^d$ tal que $L(h^*, w^*)$ sea mínima, donde $w^* = \arg \min_{w \in \mathbb{R}^d} R_n(w)$.
- ② Dado \mathcal{H} parametrizado, hallar $w^* = \arg \min_{w \in \mathbb{R}^d} R_n(w)$.

El problema 1 suele tener diferentes enfoques pero ninguno estrictamente teórico, sino que mas bien son basados en el conocimiento a priori del problema

Nos vamos a enfocar en el problema 2 viendo diferentes algoritmos existentes para resolverlo y sus propiedades de convergencia

Marco teórico del problema

En conclusión, la obtención de dicha h óptima se separa en dos problemas no disjuntos:

- ① Encontrar \mathcal{H} parametrizada por $w \in \mathbb{R}^d$ tal que $L(h^*, w^*)$ sea mínima, donde $w^* = \arg \min_{w \in \mathbb{R}^d} R_n(w)$.
- ② Dado \mathcal{H} parametrizado, hallar $w^* = \arg \min_{w \in \mathbb{R}^d} R_n(w)$.

El problema 1 suele tener diferentes enfoques pero ninguno estrictamente teórico, sino que mas bien son basados en el conocimiento a priori del problema

Nos vamos a enfocar en el problema 2 viendo diferentes algoritmos existentes para resolverlo y sus propiedades de convergencia

Algoritmos de primer orden

Comunmente para encontrar $\arg \min_{w \in \mathbb{R}^d} F(w)$ se utilizan algoritmos iterativos de primer orden; es decir, algoritmos que se pueden representar por $g : \mathbb{R}^d \rightarrow \mathbb{R}^d$ ta que $w_n = \underbrace{g \circ \cdots \circ g}_n(w_0)$ y calcular $g(w)$ solo involucra calcular $F(w)$ y $\nabla F(w)$. Se suelen dividir en dos grandes grupos:

De tipo *batch*, donde para cada iteración se utilizan todo el conjunto de datos $\{x_i, y_i\}$. Un ejemplo de esta categoría es el *descenso de gradiente* (GD) dado por $g(w) = w - \alpha_n \sum_{i=1}^N \nabla F(x_i, y_i)$.

De tipo *estocástico*, donde se elije en cada iteración al azar un subconjunto $S \subset \{x_i, y_i\}$ para calcular g . Un ejemplo de esta categoría es el *descenso estocástico de gradiente* (SG) dado por $g(w) = w - \alpha_n \nabla F(x_i, y_i)$ para un i elegido al azar.

Algoritmos de primer orden

Comunmente para encontrar $\arg \min_{w \in \mathbb{R}^d} F(w)$ se utilizan algoritmos iterativos de primer orden; es decir, algoritmos que se pueden representar por $g : \mathbb{R}^d \rightarrow \mathbb{R}^d$ ta que $w_n = \underbrace{g \circ \dots \circ g}_n(w_0)$ y calcular $g(w)$ solo involucra calcular $F(w)$ y $\nabla F(w)$. Se suelen dividir en dos grandes grupos:

De tipo *batch*, donde para cada iteración se utilizan todo el conjunto de datos $\{x_i, y_i\}$. Un ejemplo de esta categoría es el *descenso de gradiente* (GD) dado por $g(w) = w - \alpha_n \sum_{i=1}^N \nabla F(x_i, y_i)$.

De tipo *estocástico*, donde se elije en cada iteración al azar un subconjunto $S \subset \{x_i, y_i\}$ para calcular g . Un ejemplo de esta categoría es el *descenso estocástico de gradiente* (SG) dado por $g(w) = w - \alpha_n \nabla F(x_i, y_i)$ para un i elegido al azar.

Hoja de ruta

- 1 Introducción
- 2 Convergencia de algoritmos de tipo batch**
- 3 Algoritmos estocásticos
- 4 References

Definiciones

Definición (Débilmente convexo)

Decimos que $F : \mathbb{R}^d \rightarrow \mathbb{R}$, tal que $F \in C^1$ es *débilmente convexo* si cumple las siguientes dos propiedades:

- Existe un único w^* tal que $F_{inf} := F(w^*) \leq F(w)$ para todo $w \in \mathbb{R}^n$.
- Para todo $\epsilon > 0$ vale que $\inf_{\|w - w^*\|^2 > \epsilon} (w - w^*) \nabla F(w) > 0$

Definición (Condición de Robbins - Monro)

Si consideramos el algoritmo GD, decimos que los incrementos $\{\alpha_k\}$ cumplen la condición de *Robbins - Monro* (ver [?]) si:

$$\sum_{k=1}^{\infty} \alpha_k = \infty \quad y \quad \sum_{k=1}^{\infty} \alpha_k^2 < \infty$$

Más definiciones

Definición (Condición de *Polyak-Lojasiewicz*)

Decimos que una función $f : \mathbb{R}^d \rightarrow \mathbb{R}$ tal que $f \in C^1$ es *PL*-convexa, o cumple la condición de *Polyak-Lojasiewicz* (ver [?], [?]) si existe $\mu > 0$ tal que para todo $x \in \mathbb{R}^d$ vale:

$$\frac{1}{2} \|\nabla f(x)\|_2^2 \geq \mu (f(x) - f_{\inf})$$

Definición (Función Lipschitz)

Sea $f : \mathbb{R}^d \rightarrow \mathbb{R}$ tal que $f \in C^1$, decimos que es *L-Lipschitz* global si existe $L > 0$ tal que para todos $x, y \in \mathbb{R}^d$ vale:

$$\|\nabla f(x) - \nabla f(y)\|_2 \leq L \|y - x\|_2$$

Resultados de convergencia puntual para GD

Teorema

Sea $F : \mathbb{R}^d \rightarrow \mathbb{R}$ tal que $F \in C^1$ la función objetivo, asumamos que F es débilmente convexo, w^* su mínimo y que existen $A, B \geq 0$ tal que para todo $w \in \mathbb{R}^d$ vale que:

$$\|\nabla F(w)\|^2 \leq A + B \|w - w^*\|^2$$

Luego si consideramos el algoritmo de descenso de gradiente por batch tal que los incrementos $\{\alpha_k\}$ cumplen la condición Robbins - Monro entonces:

$$w_k \xrightarrow[k \rightarrow \infty]{} w^*$$

Idea de la demostración

Sea $h_k = \|w_k - w^*\|^2$, entonces vale que $h_{k+1} - h_k \leq \alpha_k^2 (A + Bh_k)$.
Luego si definimos:

$$\mu_k = \prod_{j=1}^{k-1} \frac{1}{1 + \alpha_j^2 B}$$

$$h'_k = \mu_k h_k$$

Uno ve que $\{h_k\}$ converge pues $h'_{k+1} - h'_k \leq \alpha_k^2 A \mu_k \leq \alpha_k^2 A$.

Finalmente, como podemos deducir que $\sum_{k=1}^{\infty} \alpha_k (w_k - w^*) \nabla F(w_k) < \infty$,
entonces como los incrementos cumple la condicion de Robbins Monro
uno obtiene que $w_k \xrightarrow[k \rightarrow \infty]{} w^*$.

Idea de la demostración

Sea $h_k = \|w_k - w^*\|^2$, entonces vale que $h_{k+1} - h_k \leq \alpha_k^2 (A + Bh_k)$.
Luego si definimos:

$$\mu_k = \prod_{j=1}^{k-1} \frac{1}{1 + \alpha_j^2 B}$$

$$h'_k = \mu_k h_k$$

Uno ve que $\{h_k\}$ converge pues $h'_{k+1} - h'_k \leq \alpha_k^2 A \mu_k \leq \alpha_k^2 A$.

Finalmente, como podemos deducir que $\sum_{k=1}^{\infty} \alpha_k (w_k - w^*) \nabla F(w_k) < \infty$,
entonces como los incrementos cumple la condicion de Robbins Monro
uno obtiene que $w_k \xrightarrow[k \rightarrow \infty]{} w^*$.

Resultados de convergencia puntual para GD

Teorema

Sea $F : \mathbb{R}^d \rightarrow \mathbb{R}$ la función objetivo tal que $F \in C^1$, F es L -Lipshitz y PL -convexa; entonces el algoritmo descenso de gradiente por batch con incremento fijo $\alpha_k = \frac{1}{L}$ cumple:

$$F(w_k) - F_{inf} \leq \left(1 - \frac{\mu}{L}\right)^k (F(w_1) - F_{inf})$$

Idea de la demostración

Por las implicancias de ser L –Lipschitz y PL –convexa tenemos:

$$F(w_{k+1}) - F(w_k) \leq -\frac{1}{2L} \|\nabla F(w_k)\|_2^2 \leq -\frac{\mu}{L} (F(w_k) - F_{inf})$$

Luego:

$$F(w_{k+1}) - F_{inf} \leq \left(1 - \frac{\mu}{L}\right) (F(w_k) - F_{inf}) \leq \left(1 - \frac{\mu}{L}\right)^k (F(w_1) - F_{inf})$$

Caso no convexo

Bajo qué casos el algoritmo GD converge (en alguna forma) con objetivos no convexos?

Para responder esto, sea $g : M \rightarrow M$ la fórmula del algoritmo de primer orden en $M \subset \mathbb{R}^N$ una subvariedad sin borde de dimensión d .

Definición

Sea $f : M \rightarrow \mathbb{R}$ tal que $f \in C^2$ y $x^* \in \mathbb{R}^d$, luego decimos que x^* es un *punto silla estricto* de f si es un punto crítico y $\lambda_{\min}(\nabla^2 f(x^*)) < 0$

Notaremos M^* al conjunto de puntos silla estrictos de f .

Definición

Sea:

$$\mathcal{A}_g^* := \left\{ x : g(x) = x \quad \max_i |\lambda_i(Dg(x))| > 1 \right\}$$

A este conjunto lo llamaremos el conjunto de *puntos fijos inestables*

Caso no convexo

Bajo qué casos el algoritmo GD converge (en alguna forma) con objetivos no convexos?

Para responder esto, sea $g : M \rightarrow M$ la fórmula del algoritmo de primer orden en $M \subset \mathbb{R}^N$ una subvariedad sin borde de dimensión d .

Definición

Sea $f : M \rightarrow \mathbb{R}$ tal que $f \in C^2$ y $x^* \in \mathbb{R}^d$, luego decimos que x^* es un *punto silla estricto* de f si es un punto crítico y $\lambda_{\min}(\nabla^2 f(x^*)) < 0$

Notaremos M^* al conjunto de puntos silla estrictos de f .

Definición

Sea:

$$\mathcal{A}_g^* := \left\{ x : g(x) = x \quad \max_i |\lambda_i(Dg(x))| > 1 \right\}$$

A este conjunto lo llamaremos el conjunto de *puntos fijos inestables*

Caso no convexo

Bajo qué casos el algoritmo GD converge (en alguna forma) con objetivos no convexos?

Para responder esto, sea $g : M \rightarrow M$ la fórmula del algoritmo de primer orden en $M \subset \mathbb{R}^N$ una subvariedad sin borde de dimensión d .

Definición

Sea $f : M \rightarrow \mathbb{R}$ tal que $f \in C^2$ y $x^* \in \mathbb{R}^d$, luego decimos que x^* es un *punto silla estricto* de f si es un punto crítico y $\lambda_{\min}(\nabla^2 f(x^*)) < 0$

Notaremos M^* al conjunto de puntos silla estrictos de f .

Definición

Sea:

$$\mathcal{A}_g^* := \left\{ x : g(x) = x \quad \max_i |\lambda_i(Dg(x))| > 1 \right\}$$

A este conjunto lo llamaremos el conjunto de *puntos fijos inestables*

Caso no convexo

Teorema

Sea $g \in C^1(M)$ tal que $\det(Dg(x)) \neq 0$ para todo $x \in M$, luego el conjunto de puntos iniciales que convergen por g a un punto fijo inestable tiene medida cero:

$$\mu\left(\left\{x_0 : \lim_k g^k(x_0) \in \mathcal{A}_g^*\right\}\right) = 0$$

Corolario

Bajo las mismas hipótesis si agregamos que $M^ \subseteq \mathcal{A}_g^*$ entonces*

$$\mu\left(\left\{x_0 : \lim_k g^k(x_0) \in M^*\right\}\right) = 0$$

Caso no convexo

Teorema

Sea $g \in C^1(M)$ tal que $\det(Dg(x)) \neq 0$ para todo $x \in M$, luego el conjunto de puntos iniciales que convergen por g a un punto fijo inestable tiene medida cero:

$$\mu\left(\left\{x_0 : \lim_k g^k(x_0) \in \mathcal{A}_g^*\right\}\right) = 0$$

Corolario

Bajo las mismas hipótesis si agregamos que $M^ \subseteq \mathcal{A}_g^*$ entonces*

$$\mu\left(\left\{x_0 : \lim_k g^k(x_0) \in M^*\right\}\right) = 0$$

Algoritmos de tipo batch estándar

Además del algoritmo GD, en la optimización de tipo batch existen dos algoritmos muy usuales:

El algoritmo de punto próximo está dado por la iteración:

$$x_{k+1} = g(x_k) \triangleq \arg \min_{z \in M} f(z) + \frac{1}{2\alpha} \|x_k - z\|_2^2$$

Por otro lado, si definimos $g_i(x) = x - \alpha \sum_{j \in S_i} e_j^T \nabla f(x)$ entonces el algoritmo de descenso de coordenadas por bloques está dado por:

$$x_{k+1} = g(x_k) \triangleq g_b \circ g_{b-1} \circ \cdots \circ g_1(x_k)$$

Algoritmos de tipo batch estándar

Además del algoritmo GD, en la optimización de tipo batch existen dos algoritmos muy usuales:

El algoritmo de punto próximo está dado por la iteración:

$$x_{k+1} = g(x_k) \triangleq \arg \min_{z \in M} f(z) + \frac{1}{2\alpha} \|x_k - z\|_2^2$$

Por otro lado, si definimos $g_i(x) = x - \alpha \sum_{j \in S_i} e_j^T \nabla f(x)$ entonces el algoritmo de descenso de coordenadas por bloques está dado por:

$$x_{k+1} = g(x_k) \triangleq g_b \circ g_{b-1} \circ \cdots \circ g_1(x_k)$$

Algoritmos de tipo batch estándar

Además del algoritmo GD, en la optimización de tipo batch existen dos algoritmos muy usuales:

El algoritmo de punto próximo está dado por la iteración:

$$x_{k+1} = g(x_k) \triangleq \arg \min_{z \in M} f(z) + \frac{1}{2\alpha} \|x_k - z\|_2^2$$

Por otro lado, si definimos $g_i(x) = x - \alpha \sum_{j \in S_i} e_j^T \nabla f(x)$ entonces el algoritmo de descenso de coordenadas por bloques está dado por:

$$x_{k+1} = g(x_k) \triangleq g_b \circ g_{b-1} \circ \cdots \circ g_1(x_k)$$

Un marco de demostración común

Teorema

Sea $F : \mathbb{R}^d \rightarrow \mathbb{R}$ tal que $F \in C^2$ la función objetivo con Hessiano acotado con constante L , w^* algún mínimo local de F ; entonces el algoritmo descenso de gradiente por batch con incremento fijo $\alpha < \frac{1}{L}$ cumple:

$$w_k \xrightarrow[k \rightarrow \infty]{c.t.p.} w^*$$

Teorema

Sea $F : \mathbb{R}^d \rightarrow \mathbb{R}$ tal que $F \in C^2$ la función objetivo con Hessiano acotado con constante L , w^* algún mínimo local de F ; entonces el algoritmo punto próximo con incremento fijo $\alpha < \frac{1}{L}$ cumple:

$$w_k \xrightarrow[k \rightarrow \infty]{c.t.p.} w^*$$

Un marco de demostración común

Teorema

Sea $F : \mathbb{R}^d \rightarrow \mathbb{R}$ tal que $F \in C^2$ la función objetivo con Hessiano acotado por bloques con constante L_b , w^ algún mínimo local de F ; entonces el algoritmo descenso de gradiente por coordenadas con incremento fijo $\alpha < \frac{1}{L_b}$ cumple:*

$$w_k \xrightarrow[k \rightarrow \infty]{\text{c.t.p.}} w^*$$

Idea de las demostraciones

En los tres casos las hipótesis llevan a demostrar que:

- ① $\det(Dg)(x) \neq 0$
- ② $M^* \subset \mathcal{A}_g^*$

Luego con eso uno concluye que $\mu(\{x_0 : \lim_k g^k(x_0) \in M^*\}) = 0$ por lo que el conjunto de puntos iniciales tales que el algoritmo en cuestión converge a un punto silla estricto en 0. Como ya sabemos que el algoritmo no converge a máximos locales se concluye que:

$$w_k \xrightarrow[k \rightarrow \infty]{c.t.p.} w^*$$

Donde w^* es mínimo local.

Convergencia exponencial de GD

¿El descenso de gradiente inicializado aleatoriamente generalmente escapa de los puntos de silla en tiempo polinomial?

Definición

Dado $B \in \mathbb{R}^d$ decimos que $B \in \text{poly}(d)$ si existe $p \in \mathbb{R}[X]$ tal que $p(d) = B$. Asimismo decimos que una iteración de un algoritmo w_k esta a $\Omega(f(k))$ de w^* si existe $K \in \mathbb{N}$ tal que $|w^* - w_k| \geq Kf(k)$

Teorema

Consideremos el algoritmo descenso de gradiente por batch con w_0 elegido uniformemente en $[-1, 1]^d$; luego existe $F : \mathbb{R}^d \mapsto \mathbb{R}$ función objetivo B -acotada, l -Lipshitz, μ -Lipshitz en el Hessiano con $B, l, \mu \in \text{poly}(d)$ tal que si $\alpha_k = \alpha \leq \frac{1}{l}$ entonces w_k va a estar a $\Omega(1)$ de cualquier mínimo para todo $k \leq e^{\Omega(d)}$

Convergencia exponencial de GD

¿El descenso de gradiente inicializado aleatoriamente generalmente escapa de los puntos de silla en tiempo polinomial?

Definición

Dado $B \in \mathbb{R}^d$ decimos que $B \in \text{poly}(d)$ si existe $p \in \mathbb{R}[X]$ tal que $p(d) = B$. Asimismo decimos que una iteración de un algoritmo w_k esta a $\Omega(f(k))$ de w^* si existe $K \in \mathbb{N}$ tal que $|w^* - w_k| \geq Kf(k)$

Teorema

Consideremos el algoritmo descenso de gradiente por batch con w_0 elegido uniformemente en $[-1, 1]^d$; luego existe $F : \mathbb{R}^d \mapsto \mathbb{R}$ función objetivo B -acotada, l -Lipshitz, μ -Lipshitz en el Hessiano con $B, l, \mu \in \text{poly}(d)$ tal que si $\alpha_k = \alpha \leq \frac{1}{l}$ entonces w_k va a estar a $\Omega(1)$ de cualquier mínimo para todo $k \leq e^{\Omega(d)}$

Convergencia exponencial de GD

¿El descenso de gradiente inicializado aleatoriamente generalmente escapa de los puntos de silla en tiempo polinomial?

Definición

Dado $B \in \mathbb{R}^d$ decimos que $B \in \text{poly}(d)$ si existe $p \in \mathbb{R}[X]$ tal que $p(d) = B$. Asimismo decimos que una iteración de un algoritmo w_k esta a $\Omega(f(k))$ de w^* si existe $K \in \mathbb{N}$ tal que $|w^* - w_k| \geq Kf(k)$

Teorema

Consideremos el algoritmo descenso de gradiente por batch con w_0 elegido uniformemente en $[-1, 1]^d$; luego existe $F : \mathbb{R}^d \mapsto \mathbb{R}$ función objetivo B -acotada, l -Lipshitz, μ -Lipshitz en el Hessiano con $B, l, \mu \in \text{poly}(d)$ tal que si $\alpha_k = \alpha \leq \frac{1}{l}$ entonces w_k va a estar a $\Omega(1)$ de cualquier mínimo para todo $k \leq e^{\Omega(d)}$

Intuición acerca de la demostración: Parte 1

Escapar de dos puntos silla consecutivos

Sean $L > \gamma > 0$ y $f \in [0, 3] \times [0, 3]$ dada por:

$$f(x_1, x_2) = \begin{cases} -\gamma x_1^2 + Lx_2^2 & \text{si } (x_1, x_2) \in [0, 1] \times [0, 1] \\ L(x_1 - 2)^2 - \gamma x_2^2 & \text{si } (x_1, x_2) \in [1, 3] \times [0, 1] \\ L(x_1 - 2)^2 + L(x_2 - 2)^2 & \text{si } (x_1, x_2) \in [1, 3] \times [1, 3] \end{cases}$$

Notemos que f tiene dos puntos silla estrictos en $(0, 0)$ y $(2, 0)$, mientras que tiene un óptimo en $(2, 2)$.

Intuición acerca de la demostración: Parte 1

Escapar de dos puntos silla consecutivos

Sean $L > \gamma > 0$ y $f \in [0, 3] \times [0, 3]$ dada por:

$$f(x_1, x_2) = \begin{cases} -\gamma x_1^2 + Lx_2^2 & \text{si } (x_1, x_2) \in [0, 1] \times [0, 1] \\ L(x_1 - 2)^2 - \gamma x_2^2 & \text{si } (x_1, x_2) \in [1, 3] \times [0, 1] \\ L(x_1 - 2)^2 + L(x_2 - 2)^2 & \text{si } (x_1, x_2) \in [1, 3] \times [1, 3] \end{cases}$$

Notemos que f tiene dos puntos silla estrictos en $(0, 0)$ y $(2, 0)$, mientras que tiene un óptimo en $(2, 2)$.

Intuición acerca de la demostración: Parte 1

Escapar de dos puntos silla consecutivos

Sean $L > \gamma > 0$ y $f \in [0, 3] \times [0, 3]$ dada por:

$$f(x_1, x_2) = \begin{cases} -\gamma x_1^2 + L x_2^2 & \text{si } (x_1, x_2) \in [0, 1] \times [0, 1] \\ L(x_1 - 2)^2 - \gamma x_2^2 & \text{si } (x_1, x_2) \in [1, 3] \times [0, 1] \\ L(x_1 - 2)^2 + L(x_2 - 2)^2 & \text{si } (x_1, x_2) \in [1, 3] \times [1, 3] \end{cases}$$

Notemos que f tiene dos puntos silla estrictos en $(0, 0)$ y $(2, 0)$, mientras que tiene un óptimo en $(2, 2)$.

Intuición acerca de la demostración: Parte 2

Sean $U = [0, 1]^2$, $V = [1, 3] \times [0, 1]$ y $W = [1, 3]^2$ entornos respectivos de los tres puntos críticos, supongamos que $w_0 = (x_1^0, x_2^0) \in U$ y definamos:

$$k_1 = \inf_{x_1^k \geq 1} k = \min_{x_1^k \geq 1} k$$

$$k_2 = \inf_{x_2^k \geq 1} k = \min_{x_2^k \geq 1} k$$

Notemos que como la dirección de escape en $(0, 0)$ es por x_1 y *luego* por x_2 (por el cambio de comportamiento de f) podemos concluir que k_1, k_2 están bien definidos y que $k_2 \geq k_1 \geq 0$.

Vamos a probar que $k_2 = Ck_1$ con $C > 1$.

Intuición acerca de la demostración: Parte 2

Sean $U = [0, 1]^2$, $V = [1, 3] \times [0, 1]$ y $W = [1, 3]^2$ entornos respectivos de los tres puntos críticos, supongamos que $w_0 = (x_1^0, x_2^0) \in U$ y definamos:

$$k_1 = \inf_{x_1^k \geq 1} k = \min_{x_1^k \geq 1} k$$

$$k_2 = \inf_{x_2^k \geq 1} k = \min_{x_2^k \geq 1} k$$

Notemos que como la dirección de escape en $(0, 0)$ es por x_1 y *luego* por x_2 (por el cambio de comportamiento de f) podemos concluir que k_1, k_2 están bien definidos y que $k_2 \geq k_1 \geq 0$.

Vamos a probar que $k_2 = Ck_1$ con $C > 1$.

Intuición acerca de la demostración: Parte 3

Las iteraciones de GD en este caso van a ser:

$$(x_1^{k+1}, x_2^{k+1}) = \begin{cases} ((1 + 2\alpha\gamma) x_1^k, (1 - \alpha 2L) x_2^k) & \text{si } x_1 \leq 1 \\ ((1 - 2L\alpha) x_1^k + 4L\alpha, (1 + 2\alpha\gamma) x_2^k) & \text{si } x_1 \geq 1, x_2 \leq 1 \\ ((1 - 2L\alpha) x_1^k + 4L\alpha, (1 - 2L\alpha) x_2^k + 4L\alpha) & \text{si } x_1 \geq 1, x_2 \geq 1 \end{cases}$$

Intuición acerca de la demostración: Parte 4

Luego evaluando en k_1 y k_2 :

$$\begin{aligned}x_1^{k_1} &= (1 + 2\alpha\gamma)^{k_1} x_1^0 \\x_2^{k_1} &= (1 - 2\alpha L)^{k_1} x_1^0\end{aligned}$$

$$\begin{aligned}x_1^{k_2} &= (1 - 2L\alpha)^{k_2 - k_1} (1 + 2\alpha\gamma)^{k_1} x_1^0 + K \geq 1 \quad K \text{ constante} \\x_2^{k_2} &= (1 + 2\alpha\gamma)^{k_2 - k_1} (1 - 2\alpha L)^{k_1} x_2^0 \geq 1\end{aligned}$$

concluimos que:

$$k_2 \geq \frac{2\alpha(L + \gamma)k_1 - \log(x_2^0)}{2\alpha\gamma} \geq \frac{L + \gamma}{\gamma} k_1$$

Intuición acerca de la demostración: Conclusiones

Esta f que presentamos tiene varios problemas:

- ① No es continua ni mucho menos C^2
- ② No podemos asegurar que f sea L -Lipschitz o μ -Lipschitz en el hessiano
- ③ Los puntos críticos están en el borde del dominio, lo que no es ideal
- ④ No está definida en todo \mathbb{R}^d

La clave va a ser usar splines para resolver los primeros puntos, espejar f para hacer los puntos extremales interiores, asignar d puntos críticos similares para generar el tiempo exponencial en d y extender esa función \tilde{f} a \mathbb{R}^d con el Teorema de extensión de Whitney. Aunque la demostración es larga y tediosa, la idea clave es la vista aquí.

Intuición acerca de la demostración: Conclusiones

Esta f que presentamos tiene varios problemas:

- ① No es continua ni mucho menos C^2
- ② No podemos asegurar que f sea l -Lipschitz o μ -Lipschitz en el hessiano
- ③ Los puntos críticos están en el borde del dominio, lo que no es ideal
- ④ No está definida en todo \mathbb{R}^d

La clave va a ser usar splines para resolver los primeros puntos, espejar f para hacer los puntos extremales interiores, asignar d puntos críticos similares para generar el tiempo exponencial en d y extender esa función \tilde{f} a \mathbb{R}^d con el Teorema de extensión de Whitney. Aunque la demostración es larga y tediosa, la idea clave es la vista aquí.

Hoja de ruta

- 1 Introducción
- 2 Convergencia de algoritmos de tipo batch
- 3 Algoritmos estocásticos**
- 4 References

Descenso estocástico

En el contexto estocástico vamos a analizar el algoritmo de descenso estocástico generalizado (DE) dado por:

Algorithm 1: Descenso Estocastico (DE)

```

1 Input:  $w_1 \in \mathbb{R}^d$  el inicio de la iteración,  $\{\xi_k\}$  iid
2 for  $k \in \mathbb{N}$  do
3   Generar una muestra de la variable aleatoria  $\xi_k$ 
4   Calcular el vector estocástico  $g(w_k, \xi_k)$ 
5   Elegir  $\alpha_k > 0$ 
6    $w_{k+1} \leftarrow w_k - \alpha_k g(w_k, \xi_k)$ 
  
```

Donde $g(w_k, \xi_k)$ puede ser varias estimaciones del gradiente como por ejemplo:

$$g(w_k, \xi_k) = \begin{cases} \nabla f(w_k, \xi_k) \\ \frac{1}{n_k} \sum_{i=1}^{n_k} \nabla f(w_k, \xi_{k,i}) \end{cases}$$

Lemas fundamentales

Definamos ahora $\mathbb{E}_{\xi_k} [\cdot] := \mathbb{E}_{P_k} [\cdot | w_k]$ la esperanza condicional bajo la distribución de ξ_k dado w_k .

Lema

Si F es Lipschitz , entonces las iteraciones del algoritmo DE satisfacen que para todo $k \in N$:

$$\begin{aligned} \mathbb{E}_{\xi_k} [F(w_{k+1})] - F(w_k) &\leq -\alpha_k \nabla F(w_k)^T \mathbb{E}_{\xi_k} [g(w_k, \xi_k)] \\ &\quad + \frac{1}{2} \alpha_k^2 \mathbb{E}_{\xi_k} [\|g(w_k, \xi_k)\|_2^2] \end{aligned}$$

Notemos que si $g(w_k, \xi_k)$ es un estimador insesgado de $\nabla F(w_k)$ entonces del lema:

$$\mathbb{E}_{\xi_k} [F(w_{k+1})] - F(w_k) \leq -\alpha_k \|\nabla F(w_k)\|^2 + \frac{1}{2} \alpha_k^2 \mathbb{E}_{\xi_k} [\|g(w_k, \xi_k)\|_2^2]$$

Lemas fundamentales

Definamos ahora $\mathbb{E}_{\xi_k} [\cdot] := \mathbb{E}_{P_k} [\cdot | w_k]$ la esperanza condicional bajo la distribución de ξ_k dado w_k .

Lema

Si F es Lipschitz , entonces las iteraciones del algoritmo DE satisfacen que para todo $k \in N$:

$$\begin{aligned} \mathbb{E}_{\xi_k} [F(w_{k+1})] - F(w_k) &\leq -\alpha_k \nabla F(w_k)^T \mathbb{E}_{\xi_k} [g(w_k, \xi_k)] \\ &\quad + \frac{1}{2} \alpha_k^2 \mathbb{E}_{\xi_k} [\|g(w_k, \xi_k)\|_2^2] \end{aligned}$$

Notemos que si $g(w_k, \xi_k)$ es un estimador insesgado de $\nabla F(w_k)$ entonces del lema:

$$\mathbb{E}_{\xi_k} [F(w_{k+1})] - F(w_k) \leq -\alpha_k \|\nabla F(w_k)\|^2 + \frac{1}{2} \alpha_k^2 \mathbb{E}_{\xi_k} [\|g(w_k, \xi_k)\|_2^2]$$

Lemas fundamentales

Hipótesis (Acotaciones al primer y segundo momento de g)

Supongamos que dada F función objetivo y g la estimación del gradiente en DE vale:

- ① *Existe $U \subset \mathbb{R}^d$ tal que $\{w_k\} \subset U$ y que existe F_{inf} tal que $F|_U \geq F_{inf}$*
- ② *Existen $\mu_G \geq \mu \geq 0$ tal que para todo $k \in \mathbb{N}$ valen:*

$$\nabla F(w_k)^T \mathbb{E}_{\xi_k} [g(w_k, \xi_k)] \geq \mu \|\nabla F(w_k)\|_2^2$$

Y

$$\|\mathbb{E}_{\xi_k} [g(w_k, \xi_k)]\|_2 \leq \mu_G \|\nabla F(w_k)\|_2$$

- ③ *Existen $M, M_V \geq 0$ tal que para todo $k \in \mathbb{N}$:*

$$\mathbb{V}_{\xi_k} [g(w_k, \xi_k)] \leq M + M_V \|\nabla F(w_k)\|_2^2$$

Lemas fundamentales

Notemos que si vale la hipótesis en los momentos de g entonces:

$$\mathbb{E}_{\xi_k} \left[\|g(w_k, \xi_k)\|_2^2 \right] \leq M + M_G \|\nabla F(w_k)\|_2^2 \quad M_G := M_V + \mu_G^2 \geq \mu^2 \geq 0$$

Lema

Bajo la hipótesis en los momentos de g y si F es Lipschitz entonces las iteraciones del algoritmo DE satisfacen para todo $k \in \mathbb{N}$:

$$\mathbb{E}_{\xi_k} [F(w_{k+1})] - F(w_k) \leq -\mu\alpha_k \|\nabla F(w_k)\|_2^2 + \frac{1}{2}\alpha_k^2 L \mathbb{E}_{\xi_k} [\|g(w_k, \xi_k)\|_2^2]$$

$$\mathbb{E}_{\xi_k} [F(w_{k+1})] - F(w_k) \leq -\left(\mu - \frac{1}{2}\alpha_k L M_G\right) \alpha_k \|\nabla F(w_k)\|_2^2 + \frac{1}{2}\alpha_k^2 L M$$

Lemas fundamentales

Notemos que si vale la hipótesis en los momentos de g entonces:

$$\mathbb{E}_{\xi_k} \left[\|g(w_k, \xi_k)\|_2^2 \right] \leq M + M_G \|\nabla F(w_k)\|_2^2 \quad M_G := M_V + \mu_G^2 \geq \mu^2 \geq 0$$

Lema

Bajo la hipótesis en los momentos de g y si F es Lipschitz entonces las iteraciones del algoritmo DE satisfacen para todo $k \in \mathbb{N}$:

$$\mathbb{E}_{\xi_k} [F(w_{k+1})] - F(w_k) \leq -\mu\alpha_k \|\nabla F(w_k)\|_2^2 + \frac{1}{2}\alpha_k^2 L \mathbb{E}_{\xi_k} \left[\|g(w_k, \xi_k)\|_2^2 \right]$$

$$\mathbb{E}_{\xi_k} [F(w_{k+1})] - F(w_k) \leq -\left(\mu - \frac{1}{2}\alpha_k L M_G\right) \alpha_k \|\nabla F(w_k)\|_2^2 + \frac{1}{2}\alpha_k^2 L M$$

Convergencia en L1

Teorema

Sea $F : \mathbb{R}^d \rightarrow \mathbb{R}$ tal que $F \in C^1$ la función objetivo tal que existe F_{inf} valor mínimo, F es L -Lipshitz, F es fuertemente convexa y supongamos además que g tiene varianza acotada; entonces el algoritmo descenso estocástico de gradiente generalizado con incremento fijo

$0 < \alpha_k = \alpha \leq \frac{\mu}{LM_G}$ cumple:

$$\mathbb{E}[F(w_k) - F_{inf}] \xrightarrow[k \rightarrow \infty]{} \frac{\alpha LM}{2c\mu}$$

Esquema de la demostración

Usando que F es Lipschitz y fuertemente convexa con la condición sobre α tenemos para todo $k \in \mathbb{N}$ vale:

$$\mathbb{E}_{\xi_k} [F(w_{k+1}) - F(w_k)] \leq -\alpha\mu c (F(w_k) - F_{inf}) + \frac{1}{2}\alpha^2 LM$$

Luego si restamos F_{inf} y tomamos esperanza total:

$$\mathbb{E} [F(w_{k+1}) - F_{inf}] - \frac{\alpha LM}{2c\mu} (1 - \alpha c\mu) \left(\mathbb{E} [F(w_k) - F_{inf}] - \frac{\alpha LM}{2c\mu} \right)$$

Luego deducimos inductivamente que:

$$\mathbb{E} [F(w_{k+1}) - F_{inf}] - \frac{\alpha LM}{2c\mu} \leq (1 - \alpha c\mu)^k \left(F(w_1) - F_{inf} - \frac{\alpha LM}{2c\mu} \right)$$

Convergencia en L1

Teorema

Sea $F : \mathbb{R}^d \rightarrow \mathbb{R}$ tal que $F \in C^1$ la función objetivo tal que existe F_{\inf} valor mínimo, F es L -Lipshitz, F es fuertemente convexa; supongamos además que g tiene varianza acotada y que los incrementos α_k cumplen:

$$\alpha_k = \frac{\beta}{\gamma + k} \quad \text{para algún } \beta > \frac{1}{c\mu} \text{ y } \gamma > 0 \text{ tal que } \alpha_1 \leq \frac{\mu}{LM_G}$$

Luego el algoritmo descenso estocástico de gradiente generalizado cumple::

$$\mathbb{E}[R(w_k) - R^*] = \mathcal{O}\left(\frac{1}{k}\right)$$

Esquema de la demostración

Usando que F es Lipschitz y fuertemente convexa con la condición sobre α tenemos para todo $k \in \mathbb{N}$ vale:

$$\mathbb{E}_{\xi_k} [F(w_{k+1})] - F(w_k) \leq -\alpha_k c \mu (F(w_k) - F(w_*)) + \frac{1}{2} \alpha_k^2 LM$$

Luego restando F_{inf} , tomando esperanza y reordenando vale:

$$\mathbb{E} [F(w_{k+1}) - F_{inf}] \leq (1 - \alpha_k c \mu) \mathbb{E} [F(w_k) - F_{inf}] + \frac{1}{2} \alpha_k^2 LM$$

Luego inductivamente:

$$\mathbb{E} [F(w_{k+1}) - F_{inf}] \leq \frac{\eta}{\gamma + k + 1}$$

Convergencia en L1

Teorema

Sea $F : \mathbb{R}^d \rightarrow \mathbb{R}$ tal que $F \in C^1$ la función objetivo tal que existe F_{\inf} valor mínimo, F es L -Lipshitz, F es fuertemente convexa; supongamos además que existe $M \geq 0$ y $\xi \in (0, 1)$ tal que para todo $k \in \mathbb{N}$:

$$\mathbb{V}_{\xi_k} [g(w_k, \xi_k)] \leq M \xi^{k-1}$$

Luego el algoritmo descenso estocástico de gradiente generalizado con incremento fijo $0 < \alpha_k = \alpha \leq \min \left\{ \frac{\mu}{L\mu_G^2}, \frac{1}{\mu} \right\}$ cumple:

$$\mathbb{E} [R(w_k) - R^*] = \mathcal{O}(\rho^k)$$

Esquema de la demostración

Por el lema, la condición de α y las hipótesis sobre F y g vale que:

$$\mathbb{E}[F(w_{k+1}) - F_{inf}] \leq (1 - c\mu\alpha) \mathbb{E}[F(w_k) - F_{inf}] + \frac{1}{2}\alpha^2 LM\xi^{k-1}$$

E inductivamente se prueba que:

$$\mathbb{E}[F(w_{k+1}) - F_{inf}] \leq \omega\rho^k$$

Convergencia en L1

Teorema

Sea $F : \mathbb{R}^d \rightarrow \mathbb{R}$ tal que $F \in C^1$ la función objetivo, F es L -Lipshitz y supongamos además que g tiene varianza acotada. Luego el algoritmo descenso estocástico de gradiente generalizado con incremento fijo

$0 < \alpha_k = \alpha \leq \frac{\mu}{LM_G}$ cumple:

$$\mathbb{E} \left[\frac{1}{K} \sum_{k=1}^K \|\nabla F(w)_k\|^2 \right] \xrightarrow[k \rightarrow \infty]{} \frac{\alpha LM}{\mu}$$

Esquema de la demostración

Recordemos del lema si tomamos esperanza total e imponemos la condición de α tenemos:

$$\mathbb{E}[F(w_{k+1})] - \mathbb{E}[F(w_k)] \leq -\frac{1}{2}\alpha\mu\mathbb{E}[\|\nabla F(w_k)\|_2^2] + \frac{1}{2}\alpha^2 LM$$

Luego si usamos la hipótesis de g y que $F_{inf} \leq \mathbb{E}[F(w_k)]$ para todo $k \in \mathbb{N}$ vale:

$$\mathbb{E}\left[\sum_{k=1}^K \|\nabla F(w)_k\|_2^2\right] \leq \frac{K\alpha LM}{\mu} + \frac{2(F(w_1) - F_{inf})}{\mu\alpha}$$

Convergencia en L1

Teorema

Sea $F : \mathbb{R}^d \rightarrow \mathbb{R}$ tal que $F \in C^2$ la función objetivo, F es L -Lipshitz y $w \mapsto \|\nabla F(w)\|_2^2$ sea L -Lipshitz; supongamos además que g tiene varianza acotada y que los incrementos cumplen la condición de Robbins Monro. Luego el algoritmo descenso estocástico de gradiente generalizado con incrementos decrecientes cumple:

$$\lim_{k \rightarrow \infty} \mathbb{E} \left[\|\nabla F(w_k)\|^2 \right] = 0$$

Idea de la demostración

Sea $G(w) := \|\nabla F(w)\|_2^2$ y sea L_G la constante de Lipschitz de $\nabla G(w) = 2\nabla^2 F(w)\nabla F(w)$, luego:

$$G(w_{k+1}) - G(w_k) \leq -\alpha_k \nabla G(w_k)^T g(w_k, \xi_k) + \frac{1}{2} \alpha_k L_G \|g(w_k, \xi_k)\|_2^2$$

Si tomamos esperanza condicional a ξ_k y usamos que F es Lipschitz y g tiene momentos acotados entonces:

$$\begin{aligned} \mathbb{E}_{\xi_k} [G(w_{k+1}) - G(w_k)] &\leq 2\alpha_k \|\nabla F(w_k)\|_2 \|\nabla^2 F(w_k)\|_2 \|\mathbb{E}_{\xi_k} [g(w_k, \xi_k)]\|_2 + \\ &\quad \frac{1}{2} \alpha_k^2 L_G \mathbb{E}_{\xi_k} [\|g(w_k, \xi_k)\|_2^2] \\ &\leq 2\alpha_k L_{\mu_G} \|\nabla F(w_k)\|_2^2 + \\ &\quad \frac{1}{2} \alpha_k^2 L_G (M + M_V \|\nabla F(w_k)\|_2^2) \end{aligned}$$

Idea de la demostración: Continuación

Tomando esperanza total:

$$\begin{aligned}\mathbb{E}[G(w_{k+1})] - \mathbb{E}[G(w_k)] &\leq 2\alpha_k L\mu_G \mathbb{E}[\|\nabla F(w_k)\|_2^2] \\ &\quad + \frac{1}{2}\alpha_k^2 L_G (M + M_V \mathbb{E}[\|\nabla F(w_k)\|_2^2])\end{aligned}$$

Luego:

$$\lim_{N \rightarrow \infty} 2L\mu_G \sum_{k=K}^{K+N} \mathbb{E}[\alpha_k \|\nabla F(w_k)\|_2^2] + \frac{1}{2}L_G \left(M \sum_{k=K}^{K+N} \alpha_k^2 + M_V \sum_{k=K}^{K+N} \mathbb{E}[\alpha_k^2 \|\nabla F(w_k)\|_2^2] \right) = 0$$

Se concluye que $\mathbb{E}[G(w_k)]$ debe ser convergente, y por los teoremas anteriores tenemos $\mathbb{E}[\|\nabla F(w_k)\|_2^2] = \mathbb{E}[G(w_k)] \rightarrow 0$

Convergencia c.t.p.

Teorema

Sea $F : \mathbb{R}^d \rightarrow \mathbb{R}$ tal que $F \in C^1$ la función objetivo tal que existe F_{\inf} valor mínimo, F es débilmente convexo; supongamos además que g tiene varianza acotada y que los incrementos cumplen la condición de Robbins Monro. Luego el algoritmo descenso estocástico de gradiente generalizado con incremento decrecientes cumple:

$$w_k \xrightarrow[k \rightarrow \infty]{c.t.p.} w^*$$

$$(w_k - w^*)^T \nabla F(w_k) \xrightarrow[k \rightarrow \infty]{c.t.p.} 0$$

Convergencia c.t.p. : Hipótesis

Hipótesis

Sea $F : \mathbb{R}^d \rightarrow \mathbb{R}$ función objetivo y g un estimador insesgado de ∇F tal que ambos cumplen:

- ① $F \in C^3$
- ② Existe $w^* \in \mathbb{R}^d$ tal que $F_{\inf} = F(w^*) \leq F(w)$ para todo $w \in U$ entorno.
- ③ $F(w) \geq 0$ para todo $w \in \mathbb{R}^d$
- ④ Los incrementos cumplen la condición de Robbins Monro
- ⑤ Existe $B_2 \geq 0$ tal que:

$$\mathbb{E} \left[\|g(w_k, \xi_k)\|^2 \right] \leq B_2 \|w\|^2$$

Convergencia c.t.p. : Hipótesis continuación

Hipótesis

- ⑥ Para $j = 3, 4$ existen $A_j, B_j \geq 0$ tal que:

$$\mathbb{E} \left[\|g(w_k, \xi_k)\|^j \right] \leq A_j + B_j \|w\|^j$$

- ⑦ Existe $D > 0$ tal que:

$$\inf_{(w)^2 > D} w^T \nabla F(w) > 0$$

Convergencia c.t.p. : Teorema

Teorema

Bajo todas las hipótesis mencionadas anteriormente, el algoritmo descenso estocástico de gradiente generalizado con incrementos decrecientes cumple:






$$F(w_k) \xrightarrow[k \rightarrow \infty]{c.t.p.} F_\infty$$

$$\nabla F(w_k) \xrightarrow[k \rightarrow \infty]{c.t.p.} 0$$

Hoja de ruta

- 1 Introducción
- 2 Convergencia de algoritmos de tipo batch
- 3 Algoritmos estocásticos
- 4 References**

References I

-  L. Berezansky, E. Braverman, L. Idels, *Nicholson's blowflies differential equation revisited: main results and open problems*. Appl. Math. Model, **34**, (2010) 1405–1417.
-  H. Freedman, P. Moson, *Persistence definitions and their connections*, Proc. Am. Math. Soc. 109, 4 (1990), 1025–1033.
-  A. Fonda, *Uniformly persistent semidynamical systems* Proc. Am. Math. Soc. 104, 1 (1988)
-  H. Smith, H. Thieme, *Dynamical Systems and Population Persistence*. American Mathematical Society, 2011.
-  J. So, J. S. Yu, *Global attractivity and uniform persistence in Nicholson's blowflies*, Diff. Eqns. Dynam. Syst. **2** (1) (1994) 11–18

Thanks for your attention!