

Séminaire de Probabilités et Statistique

Mardi 15 mai à 14h00

Laboratoire Dieudonné

Salle de Conférences

Olivier Wintenberger

(Université Paris 6)

Apprentissage en ligne robuste et adaptatif avec BOA

L'exposé traite d'abord de sélection d'experts en ligne. En étudiant le lien avec le problème martingale associé, on améliore l'algorithme à poids exponentiel de référence en pénalisant par un terme de variation quadratique. L'optimalité de l'algorithme, nommé BOA, est prouvé en théorie et dans les applications. Nous traiterons ensuite de régression sous des hypothèses de parcimonies. Nous verrons comment adapter BOA à ce problème afin d'obtenir un algorithme efficace qui admet des vitesses rapides sous la condition générale de Łojasiewicz.