

光滑在线凸优化

张利军
南京大学

时间: 6月23日, 14:00 - 15:00

腾讯会议: 542723012

链接: <https://meeting.tencent.com/dm/96Z0RSPi4IUm>

摘要:

在许多实际应用中, 决策的改变会带来额外的损失, 例如服务器开关对硬件的损耗、股票买卖缴纳的手续费。为了控制决策的变化, 近年来光滑在线凸优化受到了学术界的关注。在这种学习范式中, 每一轮迭代学习器会同时遭受任务相关的损失(称为击中代价), 以及改变决策导致的额外损失(称为转换代价)。本报告将讨论两种衡量光滑在线凸优化性能的准则: 考虑转换代价的动态遗憾、考虑转换代价的自适应遗憾, 并介绍我们近期的研究进展。我们提出了一系列考虑转换代价的在线凸优化算法, 能够取得次线性的遗憾, 并在多种场景下达到理论最优。