
SONG CAI, University of British Columbia

Deux algorithmes rapides pour l'estimation de type L^1 en régression

Nous proposons deux algorithmes pour minimiser les fonctions objectif de type L^1 en régression. Le premier est fondé sur un mélange de descente de coordonnées et de descente rapide pour relâcher les deux problèmes de la descente de coordonnées pour les fonctions non lisses : convergence vers des nœuds locaux non optimaux et vitesse de convergence lente. Le second est une méthode de relaxation qui trouve une direction de descente "intelligente" à chaque étape d'itération pour éviter le phénomène de convergence en zigzag dans les algorithmes de descente de coordonnées et de descente rapide. Les deux algorithmes sont efficaces et fonctionnent bien.