

Решение седловых задач с небольшой размерностью одной из групп переменных

Егор Гладин

Научный руководитель: д.ф.-м.н. Гасников А.В.

Московский физико-технический институт

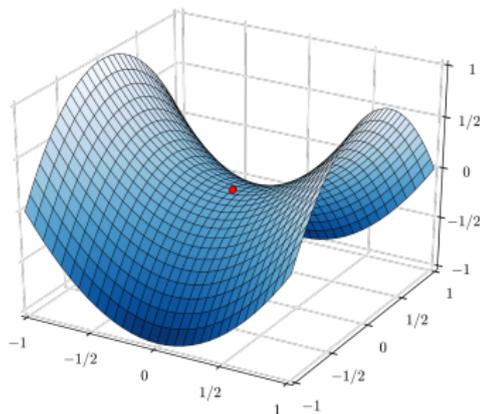
Москва
16.06.2021 г

Седловыми называются задачи вида

$$\min_{x \in \mathcal{X}} \max_{y \in \mathcal{Y}} f(x, y).$$

Решение (**седловая точка**):

$$(x_*, y_*) \in \mathcal{X} \times \mathcal{Y} : f(x_*, y) \leq f(x_*, y_*) \leq f(x, y_*)$$



[wikipedia.org/wiki/Saddle_point#
/media/File:Saddle_point.svg](https://wikipedia.org/wiki/Saddle_point#/media/File:Saddle_point.svg)

Приложения

- машинное обучение;
- компьютерная графика;
- теория игр;
- теория оптимального транспорта.

Градиентные методы

Особенности

- Обычно требуется гладкость f ;
- Сильно зависят от обусловленности задачи;
- Хорошо подходят для большой размерности.

Методы секущей плоскости

Особенности

- **Не** требуется гладкость f ;
- Сходятся линейно не требуя сильной выпуклости;
- **Не** подойдут для большой размерности.

$$\min_{x \in \mathcal{X}} \max_{y \in \mathbb{R}^{n_y}} f(x, y), \quad (1)$$

где

- ❶ $\mathcal{X} \subset \mathbb{R}^{n_x}$ — выпуклое компактное множество с непустой внутреннейностью;
- ❷ размерность n_x небольшая ($n_x < 100$);
- ❸ непрерывная функция $f(x, y)$ выпукла по x и μ -сильно вогнута по y ;
- ❹ для каждого $x \in \mathcal{X}$ функция $f(x, \cdot)$ является L -гладкой, т.е.

$$\|\nabla_y f(x, y) - \nabla_y f(x, y')\|_2 \leq L \|y - y'\|_2 \quad \forall y, y' \in \mathbb{R}^{n_y}.$$

Оракулы первого порядка

Доступны $\nabla_x f$ и $\nabla_y f$.

Смешанный оракул

Доступны только $\nabla_x f$ и $f(x, y)$.

Цель

Предложить **эффективный** подход к решению описанного класса задач.

Критерий эффективности — сложность (число вызовов оракула).

Задачи:

- 1 Разработать подход, сложность которого N зависит от точности ε как

$$N \sim \log^k \frac{1}{\varepsilon}, \quad k \leq 2$$

и от числа обусловленности $\kappa = \frac{L}{\mu}$ как $N \sim \sqrt{\kappa}$;

- 2 Доказать оценку скорости сходимости;
- 3 Провести численный эксперимент.

Рассмотрим функцию

$$g(x) = \underbrace{\max_{y \in \mathbb{R}^{n_y}} f(x, y)}_{\text{“внутренняя задача”}} \quad , \quad (2)$$

и перепишем исходную задачу (1) следующим образом:

$$\underbrace{\min_{x \in \mathcal{X}} g(x)}_{\text{“внешняя задача”}} \quad . \quad (3)$$

Идея

- Решать задачу (2) приближённо.
- Воспринимать (3) как задачу с неточным оракулом;

$$\min_{x \in Q} f(x). \quad (4)$$

Суть метода:

- алгоритм производит последовательность пар $(A^{(t)}, b^{(t)}) \in \mathbb{R}^{m_t \times n} \times \mathbb{R}^{m_t}$ таких, что множество $\{x \in \mathbb{R}^n : A^{(t)}x > b^{(t)}\}$ содержит решение;
- на каждом шаге к текущему множеству либо добавляется ограничение, чтобы увеличить его размер, либо убирается наименее “полезное”, если их слишком много.

Теорема² (Гладин)

Сходимость метода Вайды с δ -субградиентом:

$$f(x^N) - f(x_*) = O\left(n^{1.5} e^{-\frac{\gamma N}{2n}}\right) + \delta. \quad (5)$$

где $\gamma > 0$ — параметр алгоритма.

¹Vaidya, “A new algorithm for minimizing convex functions over convex sets”

²Gladin и др., “Solving smooth min-min and min-max problems by mixed oracle algorithms”

$$\min_{y \in \mathbb{R}^n} f(y). \quad (6)$$

Пусть $\tau > 0$, $y \in \mathbb{R}^n$. Введём обозначение:

$$\text{grad}_f(y, \tau, \mathbf{e}) = \frac{n}{\tau} (f(y + \tau \mathbf{e}) - f(y)) \mathbf{e}, \quad (7)$$

где \mathbf{e} равномерно распределён на единичной сфере в \mathbb{R}^n .

Метод производит **три последовательности**:

- $y_{k+1} := t_k z_k + (1 - t_k) w_k$ with $t_k := \frac{2}{k+2}$
- $w_{k+1} := y_{k+1} - \frac{1}{2L} \mathbf{g}_{k+1}$, где $\mathbf{g}_{k+1} := \text{grad}_f(y_{k+1}, \tau, \mathbf{e}_{k+1})$.
- $z_{k+1} := \arg \min_{z \in \mathbb{R}^n} \left\{ \alpha_{k+1} \langle \mathbf{g}_{k+1}, z - z_k \rangle + \frac{1}{2} \|z_k - z\|_2^2 \right\}$, где $\alpha_k := \frac{k+1}{96n^2 L}$.

³Dvurechensky, Gorbunov и Gasnikov, “An accelerated directional derivative method for smooth stochastic convex optimization”

Предлагаемый подход:

Применять метод Вайды ко внешней задаче (3);

Решать внутреннюю задачу (2) с помощью

- Быстрого градиентного метода в случае оракула 1-го порядка;
- метода ARDD для сильно выпуклых функций в случае оракула 0-го порядка.

Теорема (Гладин)

Описанный подход находит ε -решение задачи (3) после

- $N_x = O\left(n_x \log \frac{1}{\varepsilon}\right)$ вычислений $\partial_x f$,
- $N_y = O\left(n_x \sqrt{\frac{L}{\mu}} \log^2 \frac{1}{\varepsilon}\right)$ вычислений $\nabla_y f$ **или** $n_y \cdot N_y$ вычислений $f(x, y)$.

Цель — создать вредоносный объект $y' = y_0 + y \in \mathbb{R}^{n_y}$, способный обмануть m моделей машинного обучения.

Оптимизационная задача:

$$\max_{y \in \mathbb{R}^{n_y}} \min_{w \in \mathcal{P}} \sum_{i=1}^m w_i \mathcal{L}_i(y) - \frac{\gamma}{2} \|y\|_2^2,$$

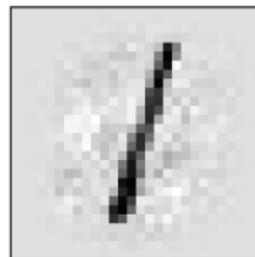
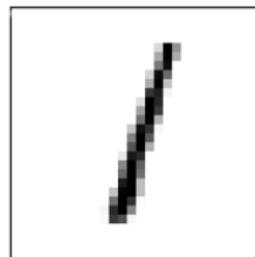
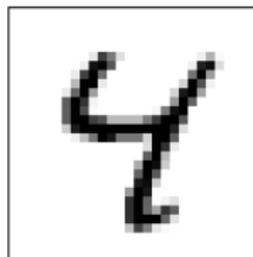
где \mathcal{P} — вероятностный симплекс, \mathcal{L}_i — функция потерь модели i .

Эксперимент:

- функция потерь \mathcal{L} — кросс-энтропия;
- выборка — MNIST (изображения рукописных цифр);
- атакуемые модели: две логистические регрессии, обученные на разных половинах выборки, и две SVM, обученные на разных половинах выборки.

Атаки привели к падению
точности классификации:

Model	Acc _{orig}	Acc _{advers}
SVM #1	0.94	0.34
SVM #2	0.94	0.36
LogReg #1	0.96	0.44
LogReg #2	0.96	0.44



- 1 Предложен подход к решению седловых задач, получены его оценки сложности;
- 2 Разработанный подход накладывает менее жёсткие требования к задаче, но не уступает существующим методам по скорости сходимости;
- 3 Эксперименты иллюстрируют потенциал подхода для практических применений.

Статьи:

- 1 Egor Gladin и Karina Zaynullina. “Ellipsoid method for convex stochastic optimization in small dimension”. в: *arXiv preprint arXiv:2011.04462* (2020)
- 2 Egor Gladin и др. “Solving smooth min-min and min-max problems by mixed oracle algorithms”. в: *arXiv preprint arXiv:2103.00434* (2021)
- 3 Egor Gladin, Mohammad Alkousa и Alexander Gasnikov. “On solving convex min-min problems with smoothness and strong convexity in one variable group and small dimension of the other”. в: *arXiv preprint arXiv:2102.00584* (2021)
- 4 Egor Gladin и др. “Solving strongly convex-concave composite saddle point problems with a small dimension of one of the variables”. в: *arXiv preprint arXiv:2010.02280* (2020)

Конференции:

- Moscow Conference on Combinatorics and Applications 2021;
- Theory and Numerics of Inverse and Ill-posed Problems 2021;
- Quasilinear Equations, Inverse Problems and Their Applications 2020;
- Intelligent Data Processing: Theory and Applications 2020;
- 63rd MIPT Scientific Conference 2020 (award-winning talk);
- 62nd MIPT Scientific Conference 2019 (award-winning talk).