

D-23 Thompson Samplingによるベイズ的最適化

南賢太郎 (東大), 小宮山 純平 (東大), 佐藤一誠 (東大), 中川 裕志 (東大)

概要

- ○高コスト,非凸な未知関数の 最適化
- 。ガウス過程の事後分布からの サンプリングによる,ベイズ 的最適化アルゴリズムを提案

提案手法の特長

- 。ステップ幅設定不要
- 。性能は既存手法と同等
- 。並列化対応

応用

◦機械学習のハイパーパラメータ 自動チューニング

Hartmann 3-dim function

