

Bericht

Spezialisierungspraktikum

angefertigt von

Roland Simon Zimmermann

aus Recklinghausen

am Max-Planck-Institut für Dynamik und Selbstorganisation

Bearbeitungszeit: 1. März 2017 bis 29. März 2017

Erstgutachter/in: Prof. Dr. Ulrich Parlitz

Inhaltsverzeichnis

1	Einleitung	1
2	Überblick über Neural Networks	2
3	Echo State Networks	3
3.1	Überblick	3
3.2	Aufbau	3
3.3	Trainingsvorgang	5
3.4	Theoretischer Hintergrund	6
4	Anwendungen	8
4.1	Vorhersage eines Rössler-Systems	8
4.1.1	Vorhersage $x(n) \rightarrow x(n + 48)$	8
4.1.2	Kreuz-Vorhersage $x(n) \rightarrow y(n)$	9
4.2	Vorhersage eines Mackey-Glass-Systems	11
5	Fazit	13
6	Ausblick	14

Nomenklatur

Symbol	Bedeutung
N	Anzahl der Einheiten im Reservoir \mathbf{W}
α	Verlustrate des <i>Leaky Integrators</i>
β	Parameter für den Lernvorgang mittels <i>Tikhonov Regularisierung</i> .
$\rho(\mathbf{W})$	Spektralradius von \mathbf{W}
$\sigma(\mathbf{W})$	Singulärwert von \mathbf{W}
ν_{max}	Maximalwert des hinzugefügten Rauschens $\nu(n)$ für die Erhöhung der Stabilität.
$[\cdot; \cdot]$	Vertikales Aneinanderfügen von Vektoren/Matrizen

1 Einleitung

Mittels *Neuronaler Netzwerke* konnten in den vergangenen Jahren viele Probleme des *Machine Learnings* und der datenbasierten Ereignisvorhersage gelöst werden. Hierbei hat sich allerdings die Vorhersage von Zeitserien lange Zeit als problematisch erwiesen - dies änderte sich erst, als rekurrente Netzwerke vermehrt genutzt wurden. Eine Form dieser Netzwerke sind die ECHO STATE NETWORKS aus dem Bereich des *Reservoir Computings*. Sie stellen einen vereinfachten Ansatz dar, welche teilweise bemerkenswerte Ergebnisse bei der Analyse und Vorhersage von Zeitserien liefern kann.

Dieser Bericht gibt eine Übersicht über die im Spezialisierungspraktikum gewonnen Erkenntnisse bezüglich ECHO STATE NETWORKS. Hierbei wurden zuerst die theoretischen Grundlagen betrachtet und die hierbei gewonnenen Informationen anschließend auf zwei Anwendungsbeispiele bezogen.

Alle Programmierbeispiele während des Praktikums wurden in PYTHON mittels NUMPY und SCIPY erstellt. Die relevanten Auszüge hiervon sind im Anhang zu finden.

2 Überblick über Neural Networks

In den letzten Jahren hat die Technik der Neuronalen Netzwerke erneut stark an Popularität gewonnen. Dies liegt zum einen an der gestiegenen verfügbaren Rechenleistung und zum anderen an der Entwicklung hierfür notwendiger Algorithmen.

Allgemein lassen sich diese Netze in zwei große Gruppen aufteilen: die der FEED FORWARD NEURAL NETWORKS und die der RECURRENT NEURAL NETWORKS, welche im Folgenden als FFNN respektive RNN bezeichnet werden.

Ein FFNN besteht aus mehreren Ebenen, welche jeweils aus verschiedenen nicht-linearen Einheiten zusammengesetzt sind. Hierbei wird die erste für die Eingabe und die letzte Ebene zur Ausgabe eines Signals genutzt. Die Einheiten zweier benachbarter Ebenen sind mit individuellen Gewichten vollständig in Richtung der Ausgabe verbunden. Dies bedeutet, dass jede Einheit x_i^n sein Signal an alle Einheiten der folgenden Ebene x_j^{n+1} mit einem individuellen Gewicht $w_{i \rightarrow j}^n$ weitergibt. Zwischen den Einheiten innerhalb einer Ebene bestehen keinerlei Verbindungen. Damit ein solches Netzwerk Vorhersagen treffen kann, müssen die Gewichte in einem Trainingsvorgang angepasst werden. Dies wurde durch die Entwicklung des BACKPROPAGATION-Algorithmus stark vereinfacht. Hierbei werden die Gewichte so angepasst, dass eine Kostenfunktion minimiert wird [1, S. 225-290].

Ein RNN hat einen ähnlichen Aufbau, doch hier können alle Einheiten an alle anderen Einheiten Signale weitergeben und von diesen erhalten. Dies kann die Vorhersage in bestimmten Anwendungsbeispielen wie der Text und Sprachanalyse verbessern. Ein Nachteil ist, dass zum Trainieren nicht mehr der einfachere BACKPROPAGATION-Algorithmus genutzt werden kann, sondern eine für RNNs abgewandelte Form genutzt werden muss. Hierfür werden die verschiedenen Zustände die das RNN im Laufe der Signal-Propagation annimmt nacheinander betrachtet und auf diese zeitliche Entwicklung anschließend der BACKPROPAGATION-Algorithmus angewendet. Diese Methode ist unter dem Namen BACKPROPAGATION THROUGH TIME (BTT) bekannt. Diese ist zum einen rechenaufwendiger aber zum anderen auch instabiler, da das Verschwinden des Gradienten der Kostenfunktion deutlich wahrscheinlicher als bei der gewöhnlichen BACKPROPAGATION ist [10].

3 Echo State Networks

3.1 Überblick

Um die (Leistungs)Probleme der RNN zu umgehen wurden als mögliche Lösung die ECHO STATE NETWORKS von H. Jäger vorgeschlagen [2]. Etwa zeitgleich wurde von W. Maas das Modell der *Liquid State Machines* vorgeschlagen. In diesem Modell steht der biologische Hintergrund im Fokus, doch sind die Ergebnisse denen der ECHO STATE NETWORKS sehr ähnlich [8].

3.2 Aufbau

Ein ESN ist eine Spezialform eines RNNs. Hierbei wird eine auf dem ersten Blick eigenartige Entscheidung getroffen: Während des gesamten Trainingsvorganges werden die Verbindungen der einzelnen Einheiten größtenteils nicht verändert. Es wird versucht durch das *Echo* der vorherigen Signale, welche noch im Netzwerk gespeichert sind, diese Signale zu rekonstruieren - hier raus ergibt sich auch der Name. Im Folgenden wird der Aufbau und anschließend die Funktionsweise eines solchen Netzwerkes beschrieben [6].

Allgemein bildet das Netzwerk S ein zeitliches Signal $\vec{u}(n) \in \mathbb{R}^{N_u}$ auf eine zeitlich variable Ausgabe $\vec{y}(n) \in \mathbb{R}^{N_y}$ für die Zeiten $n = 1, \dots, T$ ab. Zudem besitzt das System ein sogenanntes RESERVOIR aus N nicht-linearen Einheiten. Der innere Zustand des Netzwerkes wird durch diese Einheiten beschrieben und als $s(n) \in \mathbb{R}^N$ bezeichnet.

Die Verbindungen der inneren Einheiten untereinander werden durch die Gewichtsmatrix $\mathbf{W} \in \mathbb{R}^{N \times N}$ beschrieben. Das Eingangssignal wird zusammen mit einem Bias $b_{in} \in \mathbb{R}$ durch die Matrix $\mathbf{W}_{in} \in \mathbb{R}^{N \times (N_u + 1)}$ auf die inneren Einheiten weitergeleitet.

Die zeitliche Entwicklung der inneren Zustände berechnet sich nach der Vorschrift

$$\vec{s}(n) = (1 - \alpha) \cdot \vec{x}(n - 1) + \alpha \cdot f_{in}(\mathbf{W}_{in}[b_{in}; \vec{u}(n)] + \mathbf{W}\vec{x}(n - 1)), \quad (1)$$

wobei f_{in} eine beliebige (meistens *sigmoid*-förmige) Transferfunktion ist, und $[\cdot; \cdot]$ das vertikale Aneinanderfügen von Vektoren beziehungsweise Matrizen bezeichnet. Für diese Zustandsgleichung wurde das Modell eines *Leaky Integrator Neurons* genutzt, wobei $\alpha \in (0, 1]$ die Verlustrate beschreibt. Für $\alpha = 1$ ergibt sich als Spezialfall ein gewöhnliches

Neuron

$$\vec{s}(n) = f_{in}(\mathbf{W}_{in}[b_{in}; \vec{u}(n)] + \mathbf{W}\vec{x}(n-1)). \quad (2)$$

Da für manche Anwendungsfälle auch eine direkte Rückkopplung wünschenswert sein kann, kann man das System noch um eine Ausgabe-Rückkopplung erweitert werden. Diese verbindet die Ausgabe erneut mit den inneren Einheiten durch die Matrix $\mathbf{W}_{fb} \in \mathbb{R}^{N \times N_y}$. Somit ergibt sich

$$\vec{s}(n) = (1 - \alpha) \cdot \vec{x}(n-1) + \alpha \cdot f_{in}(\mathbf{W}_{in}[b_{in}; \vec{u}(n)] + \mathbf{W}\vec{x}(n-1) + \mathbf{W}_{fb}\vec{y}(n)) \quad (3)$$

als Zustandsgleichung.

An Hand der inneren Zustände lassen sich nun noch die sogenannten erweiterten inneren Zustände $x(n) = [b_{out}; \vec{s}(n); \vec{u}(n)] \in \mathbb{R}^{1+N_u+N}$ definieren, wobei b_{out} ein *Bias* für die Ausgabe darstellt.

Aus diesen erweiterten inneren Zuständen kann nun die Ausgabe $\vec{y}(n)$ konstruiert werden. Dies kann entweder im Sinne einer Linearkombination durch die Ausgangsmatrix $\mathbf{W}_{out} \in \mathbb{R}^{(1+N_u+N) \times N_y}$ oder durch andere nicht lineare Klassifizierer wie beispielsweise einer SUPPORT VECTOR MACHINE (SVM) durchgeführt werden. Im Folgenden wird nur der Fall einer Linearkombination betrachtet, da sich für die anderen Methoden ein analoges Verfahren ergibt. In diesem Fall berechnet sich die Ausgabe mittels

$$\vec{y}(n) = f_{out}(\mathbf{W}_{out}\vec{x}(n) = \mathbf{W}_{out}[b_{out}; \vec{s}(n); \vec{u}(n)]), \quad (4)$$

wobei f_{out} die Transferfunktion der Ausgabe ist.

Während die Matrix \mathbf{W}_{out} durch den Trainingsvorgang bestimmt wird, werden die Matrizen \mathbf{W}_{in} und \mathbf{W} a priori generiert und festgelegt. Hierbei hat sich für das Generieren der Eingangsmatrix eine zufällige Anordnung von zufälligen Gleitkommazahlen zwischen -1.0 und 1.0 als geschickt herausgestellt. Falls ein Feedback gewünscht ist, also Gleichung 3 genutzt wird, wird \mathbf{W}_{fb} gleichartig konstruiert. Auf das Generieren der inneren Matrix \mathbf{W} wird in Abschnitt 3.4 genauer eingegangen.

3.3 Trainingsvorgang

Nachdem der Aufbau des Netzwerkes definiert ist, ergibt sich nun die Frage, wie man den Trainingsvorgang durchführt.

Hierfür wird für die Zeiten $n = 0, \dots, T_0$ das ESN mit dem Signal $\vec{u}(n)$ betrieben, wobei T_0 die *transiente Zeit* beschreibt. Hierdurch soll das System aus seinem zufällig gewähltem Anfangszustand in einen charakteristischen Zustand übergehen. Anschließend wird das System für Zeiten $n < T$ weiter betrieben und die erweiterten Zustände $\vec{x}(n)$ als Spalten in der *Zustandsmatrix* $\mathbf{X} \in \mathbb{R}^{(1+N_u+N) \times T}$ gesammelt. Analog dazu werden die gewünschten Ausgaben $\vec{y}(n)$ nach dem Anwenden der Inversen f_{out}^{-1} der Ausgabe-Transferfunktion f_{out} auch als Spalten in der *Ausgabematrix* $\mathbf{Y} \in \mathbb{R}^{N_y \times T}$ gesammelt. Nun wird eine Lösung der Gleichung

$$\mathbf{Y} = \mathbf{W}_{out} \mathbf{X} \quad (5)$$

für \mathbf{W}_{out} gesucht. Hierfür stehen mehrere Verfahren zur Verfügung, von denen zwei prominente erwähnt sein sollen. Zum einen kann die Lösung durch eine *Tikhonov Regularisierung* mittels der Regularisierung $\beta \cdot \|\vec{W}_i\|^2$ mit der Konstante β erhalten werden. Hierbei steht \vec{W}_i für die jeweils i -te Zeile der Gewichtsmatrix. Das Verfahren

$$\mathbf{W}_{out} = \mathbf{Y} \mathbf{X}^T (\mathbf{X} \mathbf{X}^T + \beta \mathbf{I})^{-1} \quad (6)$$

ist sehr leistungsstark, aber auch teilweise numerisch instabil. Es kann allerdings bei geeigneter Wahl von β die besten Ergebnisse erzielen [6].

Zum anderen kann zur Lösung die *Moore-Penrose-Pseudoinverse* \mathbf{X}' genutzt werden, so dass für die Ausgabematrix

$$\mathbf{W}_{out} = \mathbf{Y} \mathbf{X}' \quad (7)$$

folgt. Dieses Verfahren ist zwar sehr rechenaufwendig aber dafür numerisch stabil [4, 6]. Nichts desto trotz, kann allerdings auf Grund des Fehlens einer Regularisierung leicht der Effekt des OVERFITTINGS auftreten. Dieser kann umgangen werden, indem in der Zustandsgleichung 1/3 eine leichte normalverteilte Störung $\vec{v}(n)$ der Größenordnung 1×10^{-1} bis 1×10^{-5} addiert wird. Dieser Ansatz beruht auf Empirie, da eine mathematische Begründung hierfür noch nicht vollständig gelungen ist [2, 6].

Nachdem das Training beschrieben wurde, ergibt sich somit der folgende Funktionsablauf für das Betreiben eines ESN:

1. Zufälliges Generieren der Matrizen $\mathbf{W}_{in}, \mathbf{W}_{fb}$ und Konstruktion der Matrix \mathbf{W}
2. Einspeisen des Signals $u(n)$ und Konstruktion der Zustandsmatrix \mathbf{X} und der Ausgabematrix \mathbf{Y}
3. Berechnung der Ausgabematrix \mathbf{W}_{out}
4. Einspeisen des Signals $u(n)$ für Vorhersagen des Signales $y(n)$ für $n > T$

3.4 Theoretischer Hintergrund

Um die mathematischen Eigenschaften beschreiben zu können, sind zuerst zwei Definitionen nötig [11].

Definition 1 (Kompatibler Zustand). *Sei $S : X \times U \rightarrow X$ ein ESN mit der Zustandsgleichung $\vec{x}_{n+1} = F(\vec{x}_n, \vec{u}_{n+1})$. Eine Folge von Zuständen $(\vec{x}_n)_n$ ist kompatibel mit der Eingangsfolge $(\vec{u}_n)_n$, wenn $\vec{x}_{n+1} = F(\vec{x}_n, \vec{u}_{n+1}), \forall n \leq 0$ erfüllt ist.*

Definition 2 (Echo State Eigenschaft (ESP)). *Ein ESN $S : X \times U \rightarrow X$ besitzt die Echo State Eigenschaft genau dann wenn eine Nullfolge $(\delta_n)_{n \geq 0}$ existiert, sodass für alle Zustandsfolgen $(\vec{x}_n)_n, (\vec{x}'_n)_n$ die kompatibel mit der Eingangsfolge $(\vec{u}_n)_n$ sind gilt, dass $\forall n \geq 0 \|\vec{x}_n - \vec{x}'_n\| < \delta_n$*

Dies bedeutet, dass nachdem das Netzwerk lang genug betrieben worden ist, der Zustand nicht mehr von dem beliebig gewähltem Anfangszustand abhängt. Diese Eigenschaft ist für notwendig, damit das ESN Vorhersagen treffen kann [3].

Nun stellt sich die Frage, wann ein Netzwerk diese Eigenschaft besitzt. Es wird schnell klar, dass dies nur durch die Gewichtsmatrix \mathbf{W} bestimmt wird. Betrachtet man die Zustandsgleichung des Netzwerkes, so lässt sich auf Grund des *Banachschen Fixpunktsatzes* erkennen, dass die *ESP* vorliegt, sobald $\|\vec{x}_{n+1} - \vec{x}'_{n+1}\| < \|\vec{x}_n - \vec{x}'_n\|$ für zwei kompatible Zustände $\vec{x}_n \neq \vec{x}'_n$ erfüllt ist [2]. Hier raus ergibt sich, dass die *ESP* vorliegt, wenn

$$|1 - \alpha(1 - \sigma_{max}(\mathbf{W}))| < 1 \quad (8)$$

erfüllt ist, wobei $\sigma_{max}(\mathbf{W})$ der größte Singulärwert ist [5].

Weitergehend ist bekannt, dass für Systeme bei denen der Spektralradius $\rho(\mathbf{W}) > 1$ ist

diese Eigenschaft nicht vorliegen kann, sofern $\vec{u}_n = 0$ möglich ist [2, 5].

Hier raus ergab sich lange Zeit die falsche Annahme, dass für Systeme mit $\rho(\mathbf{W}) < 1$ die Eigenschaft stets garantiert ist. Wie allerdings gezeigt werden konnte, ist dies nicht der Fall [11]. Stattdessen konnte gezeigt werden, dass eine hinreichende Bedingung durch

$$\rho(\alpha|\mathbf{W}| + (1 - \alpha)\mathbf{I}) < 1 \quad (9)$$

gegeben ist - wobei als Betrag der Matrix hier das elementweise Betragsnehmen gemeint ist. Dies ist äquivalent dazu, dass $\rho(|\mathbf{W}|) < 1$ gilt. Diese Bedingung ist weniger einschränkend als 8 [11].

Darauf basierend kann nun eine Methode nach [11] angegeben werden, um die Gewichtsmatrix \mathbf{W} zu konstruieren:

1. Generiere zufällige Matrix \mathbf{W} mit $|\mathbf{W}| = \mathbf{W}$
2. Skaliere \mathbf{W} , sodass 9 erfüllt ist.
3. Wechsel zufällig das Vorzeichen von ungefähr der Hälfte aller Einträge.

Statt dieser Vorschrift wurde zuvor oftmals \mathbf{W} zufälliger generiert und anschließend nur $\rho(\mathbf{W})$ skaliert, was mitunter zu instabilen Systemen geführt hat.

4 Anwendungen

Um den Aufwand für die spätere Benutzung zu reduzieren ist zuerst eine allgemeine Implementation des ESNs geschrieben worden, welche nun anhand zweier exemplarischer Systeme getestet worden ist.

4.1 Vorhersage eines Rössler-Systems

Eine erste Anwendung um die Möglichkeiten eines ESN zu demonstrieren besteht in der Vorhersage des Verhaltens eines *Rössler-Systems*

$$\begin{aligned}\dot{x} &= -(y + z) \\ \dot{y} &= x + 0.25 \cdot y \\ \dot{z} &= 0.4 + (x - 8.5) \cdot z.\end{aligned}\tag{10}$$

Dieses System zeigt ein chaotisches Verhalten und stellt somit eine herausfordernde Aufgabe für die zeitliche Vorhersage dar.

Hierbei werden zwei verschiedene Aufgaben betrachtet: (a) die Vorhersage von $x(n+50) := x'(n)$ durch die Kenntnis von $x(n)$ und (b) die Kreuz-Vorhersage $y(n)$ durch $x(n)$. Für beide Aufgaben wurde das System für jeweils 6000 Schritte mit einer Abtastrate $\Delta t = 0.1$ in Analogie zu [9] simuliert, wobei die Hälfte der Daten für das Training und der Rest für die Testergebnisse verwendet worden ist.

4.1.1 Vorhersage $x(n) \rightarrow x(n+48)$

Für diese erste Aufgabe ist durch eine GRIDSEARCH ein geeignetes System gefunden worden, dessen Parameter in der Tabelle 2 dargestellt sind. Hierfür wurde ein größerer Bereich des Hyperparameterraumes systematisch abgetastet und die jeweilige Leistung des sich ergebenden ESNs ermittelt, um anschließend die bestmöglichen Parameter zu wählen. Als Maß für diese Optimierung wurde der *Mean Square Error (MSE)*

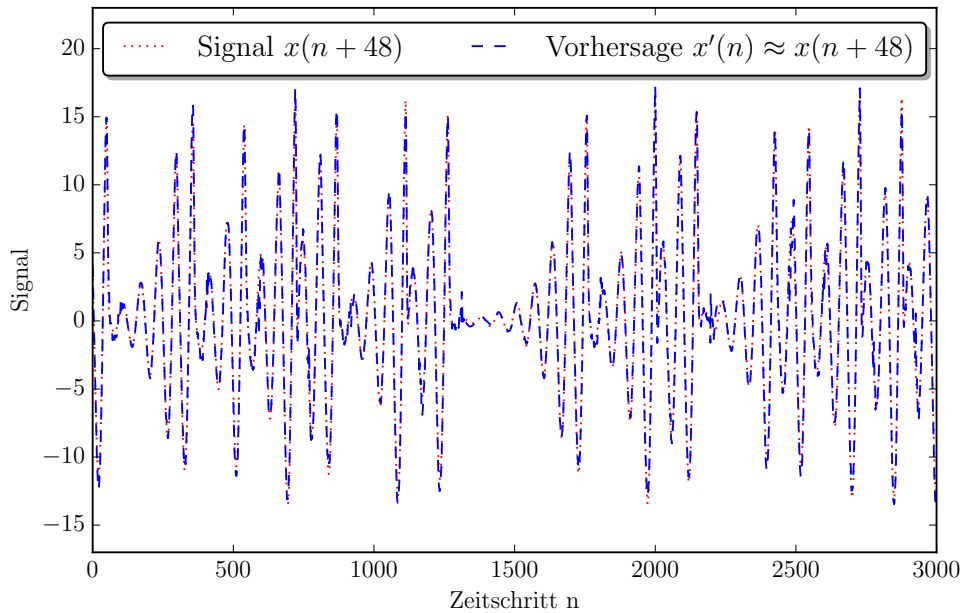
$$MSE = \sum_n (x(n+48) - x'(n))^2\tag{11}$$

zwischen der Vorhersage $x'(n)$ und dem tatsächlichen Wert $x(n+48)$ benutzt.

Variable	Wert für (a)	Wert für (b)
N	300	500
α	0.10	0.20
$\rho(\mathbf{W})$	0.035	0.7
ν_{max}	0.01	0.01

Tab. 2: Auflistung der Parameter für das jeweilige ESN für (a) und (b).

Hierbei wurde der Trainingsvorgang mittels der *Tikhonov Regularisierung* nach Gleichung 6 durchgeführt. Im Training konnte ein Fehler von $MSE = 0.625$ erreicht werden, wobei sich im Testvorgang der Fehler zu $MSE = 0.270$ ergeben hat. Ein graphischer Vergleich zwischen der dem Signal $x(t)$ und der Vorhersage $v(n)$ ist in Abbildung 1 zu finden.

Abb. 1: Darstellung des Signals $x(n+48)$ und der Vorhersage $x'(n) \approx x(n+48)$.

4.1.2 Kreuz-Vorhersage $x(n) \rightarrow y(n)$

Auch hierfür konnte sehr schnell durch eine GRIDSEARCH ein geeignetes System gefunden werden. Als Maß wurde ebenfalls der MSE benutzt. Die gefundenen Parameter sind ebenso in der Tabelle 2 dargestellt.

Für das Auslesen wurde eine Linearkombination genutzt, wobei die Lösung \mathbf{W}_{out} mittels der Pseudoinversen nach Gleichung 7 bestimmt worden ist. Hierbei wurde für den Trainingsvorgang ein Fehler $MSE_{train} = 0.0025$ und für den Testvorgang von $MSE_{test} =$

0.0001 bestimmt. Die Darstellung der Vorhersage $v(n)$ und des ermittelten Fehlers sind in den Abbildungen 2/3 zu finden.

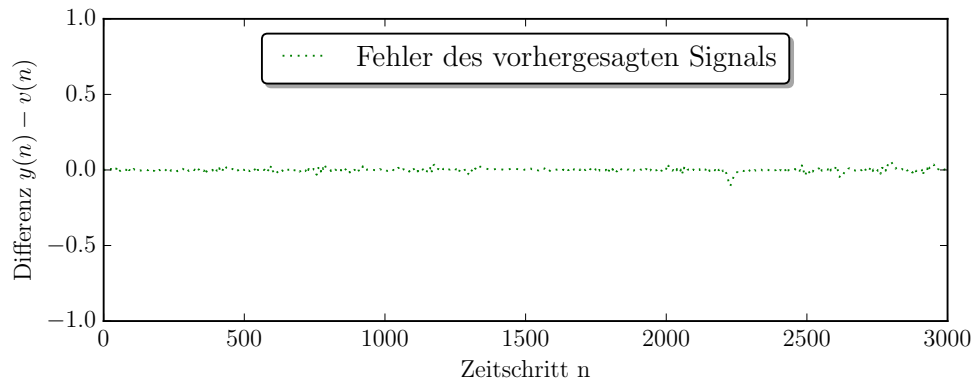


Abb. 2: Darstellung des Fehlers $y(n) - v(n)$ zwischen dem Signal $y(n)$ und der Vorhersage $v(n)$.

Im Vergleich zu anderen Publikationen [9] ergibt sich ein ähnlicher Fehler. Leider können hierbei nur die Graphen verglichen werden, da keine expliziten Fehler angegeben sind.

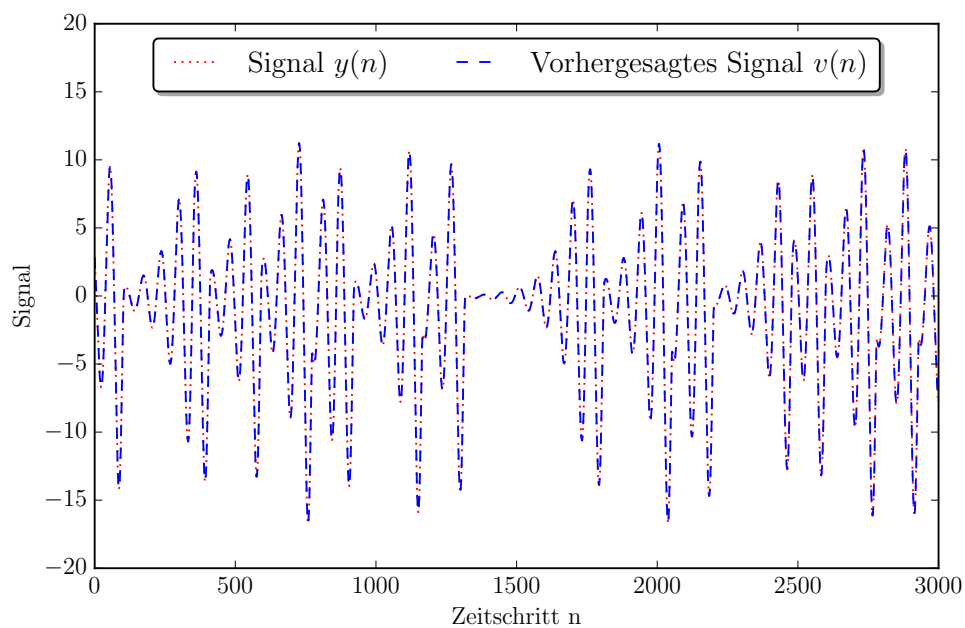


Abb. 3: Darstellung des Signals $y(n)$ und der Vorhersage $v(n)$.

4.2 Vorhersage eines Mackey-Glass-Systems

Als nächste Anwendung wird ein *Mackey-Glass-System*

$$\dot{x}(t) = \beta \frac{x(t - \tau)}{1 + x(t - \tau)^n} - \gamma x(t) \quad (12)$$

betrachtet, wobei $\tau = 17, n = 10, \beta = 0.2$ gewählt wurden. Dies ist eine beliebte Aufgabe im Bereich der Vorhersagen chaotischer Zeitreihen.

Für dieses System wurde in Analogie zu [7] die Vorhersage $x(n) \rightarrow x(n + 84)$ betrachtet, wobei die Parameter aus Tabelle 3 genutzt wurden. Hierfür wurden mittels der expliziten *Euler-Diskretisierung*

$$x(t + 1) = x(t) + \Delta_t \cdot \left(\beta \frac{x(t - \tau)}{1 + x(t - \tau)^n} - \gamma x(t) \right) \quad (13)$$

Werte für $0 \leq t \leq 4000$ simuliert, wobei $\Delta_t = 1 \times 10^{-2}$ die zeitliche Diskretisierungskonstante ist. Nun sind die ersten 2000 Werte für den Trainings und die anderen für den Test-Vorgang genutzt worden. Es wurde zur Lösung erneut die *Tikhonov Regularisierung* nach Gleichung 6 benutzt.

Variable	Wert
N	1000
α	0.20
$\rho(\mathbf{W})$	1.25
ν_{max}	1×10^{-4}
β	1×10^{-8}

Tab. 3: Auflistung der benutzten Parameter des ESN.

Interessant ist, dass der Spektralradius größer 1.0 ist. Dies widerspricht nicht direkt den Aussagen aus Abschnitt 3.4, da diese nur für Signale getroffen werden konnten, welche auch null sein können. Um dies auszuschließen ist ein konstanter *Bias* von 1.0 als weiteres Eingangssignal genutzt worden.

Eine Darstellung der Ergebnisse ist in Abbildung 4 zu sehen. Hierbei wurde der *MSE* für die gesamte Trainingsphase als $MSE_{train} = 0.0042$ und der der Testphase als $MSE_{test} = 9 \times 10^{-5}$ bestimmt.

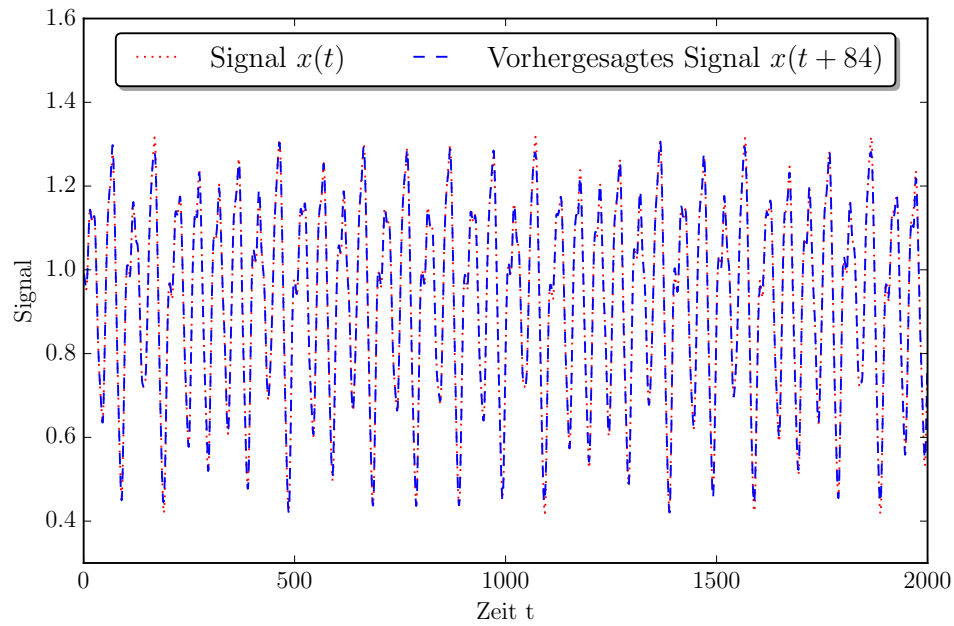


Abb. 4: Darstellung des Signals $x(t)$ und der Vorhersage $x(t + 84)$.

Dies ist eine starke Verbesserung im Vergleich zu dem besten Ergebnis aus [7] mit $MSE = 0.0014$, wobei anzumerken ist, dass dort eine kleinere Trainings- und Testphase gewählt worden ist.

5 Fazit

Wie die Ergebnisse aus 4 zeigen, bieten ECHO STATE NETWORKS eine gute Möglichkeit zur Vorhersage und Kreuz-Vorhersage von zeitlichen Messreihen. Hierbei konnten teilweise sogar die bisherigen Ergebnisse, welche mit anderen Methoden erzielt worden ist, übertroffen werden. Es hat sich gezeigt, dass für die meisten Anwendungen bereits eine kleine Reservoirgröße $N \leq 2000$ ausreichend ist. Dies hatte zur Folge, dass sowohl der Trainings als auch der Testvorgang sehr schnell und ressourcenschonend durchgeführt werden konnten.

Ein Nachteil ist, dass die Modelle über viele Hyperparameter verfügen, welche alle anwendungsspezifisch angepasst werden müssen. In den meisten Fällen konnten diese allerdings relativ schnell so eingestellt werden, dass zufriedenstellende Ergebnisse erzielt werden konnten. Hierbei hat es sich als sehr hilfreich erwiesen erst grobe Parameterbereiche abzutasten um eine Vorauswahl von vielversprechenden Hyperparametern zu finden, bevor diese fein abgetastet werden.

6 Ausblick

Für das Schreiben dieses Berichts hat sich die Wahl der L^AT_EX-Umgebung als gut geeignet herausgestellt. Die optische Darstellung von mathematischen Ausdrücken sowie des erklärenden Textes ist hierbei intuitiver umzusetzen als bei den bekannten Alternativen. Hierbei wurde die benutzte Literatur über ZOTERO und BIBTEX direkt in den L^AT_EX-Quellcode eingebunden und zitiert.

Für die Literaturrecherche ist der Dienst GOOGLE SCHOLAR benutzt worden, welcher eine umfassende Datenbank besitzt.

Das Programmieren der Anwendungsbeispiele wurde mit der Sprache PYTHON und den bekannten Frameworks NUMPY und SCIPY umgesetzt. Diese Entscheidung wurde hauptsächlich durch die große Flexibilität dieser Sprache und der ausreichenden Leistung der Bibliotheken beeinflusst. Die hierbei entstandenen Grafiken wurden mit der PYPLOT Bibliothek umgesetzt.

Dieses gesamte Vorgehen hat sich im Laufe des Praktikums als gut erwiesen und wird somit auch in der anschließenden Bachelorarbeit weiterverfolgt werden.

Literatur

- [1] Cristopher M. Bishop. *Pattern Recognition and Machine Learning*. Springer, Cambridge, 2006. ISBN 0-387-31073-8.
- [2] H. Jäger. The “echo state” approach to analysing and training recurrent neural networks - with an erratum note. *GMD Report*, 148, 2001/2010.
- [3] H. Jäger. A tutorial on training recurrent neural networks, covering bppt, rtrl, ekf and the “echo state network” approach. *GMD Report*, 159:48 ff., 2002.
- [4] H. Jäger. Long short-term memory in echo state networks: Details of a simulation study. Technical report, Jacobs University Bremen - School of Engineering and Science, 2012.
- [5] H. Jäger, M. Lukoševičiusa, D. Popovici, and U. Siewert. Optimization and applications of echo state networks with leaky- integrator neurons. *Neural Networks*, 20: 335–352, 2007.
- [6] M. Lukoševičiusa and H. Jäger. Reservoir computing approaches to recurrent neural network training. *Computer Science Review*, 3(3):127–149, 2009.
- [7] C. H. L´opez-Caraballo, I. Salfate, J. A. Lazz´us, P. Rojas, M Rivera, and L Palma-Chilla. Mackey–glass noisy chaotic time series prediction by a swarm-optimized neural network. *Journal of Physics: Conference Series*, 720(1), 2016.
- [8] Wolfgang Maass. Liquid State Machines: Motivation, Theory, and Applications. In *Computability in Context*. Imperial College Press, 2011.
- [9] U. Parlitz and A. Hornstein. Dynamical prediction of chaotic time series. *Chaos and Complexity Letters*, 1(2):135–144, 2005.
- [10] R. Pascanu, T. Mikolov, and Y. Bengio. On the difficulty of training recurrent neural networks. *Proceedings of the 30th International Conference on Machine Learning*, 28, 2013.
- [11] I. Yildiz, H. Jäger, and S. Kiebel. Re-visiting the echo state property. *Neural Networks*, 35:1–9, 2012.