

ОШИБКИ ОЦЕНИВАНИЯ СИГНАЛА С ПОМОЩЬЮ КОМПЛЕКСНОГО АНАЛИЗА СИНГУЛЯРНОГО СПЕКТРА ¹

Голяндина Н. Э., доцент кафедры Статистического Моделирования
СПбГУ, n.golyandina@spbu.ru

Сенов М. А., студент, СПбГУ, senov.mikhail@gmail.com

Аннотация

Анализ сингулярного спектра (singular spectrum analysis, SSA) — непараметрический метод для разложения временного ряда в сумму интерпретируемых компонент, таких как тренд, периодики и шум. Расширение SSA на комплексный случай называется CSSA. В работе проведено теоретическое сравнение CSSA и SSA, примененного отдельно к вещественной и мнимой части, на основе первого порядка ошибки оценки сигнала, где первый порядок рассматривается по величине возмущения. Проведено численное сравнение полной ошибки и первого порядка ошибки на примерах. Для константного сигнала получен явный вид первого порядка ошибки его оценки в случае наличия в ряде выброса.

Введение

Анализ сингулярного спектра (singular spectrum analysis, SSA) [2] — мощный метод анализа временных рядов, не требующий предварительного задания параметрической модели ряда. Метод имеет естественное расширение на случай комплексных временных рядов, называемое Complex SSA (CSSA). Есть класс сигналов, а именно временные ряды, управляемые линейными рекуррентными соотношениями, который позволяет получать для него теоретические результаты относительно свойств метода SSA.

Пусть наблюдаемый комплексный временной ряд имеет вид $X = S + R$. Для получения оценки сигнала \tilde{S} будем использовать метод CSSA. Кроме применения CSSA ко всему ряду, будем также применять метод SSA отдельно к вещественной и мнимой части ряда X .

¹Работа выполнена при поддержке гранта РФФИ 20-01-00067

Для анализа ошибки оценивания сигнала используется теория возмущений [5], которая была применена для случая выделения сигнала методом SSA в ряде работ, см., например, [6].

Хотя теория возмущения Като дает вид полной ошибки, однако ее исследование представляется сложной задачей. Поэтому мы будем рассматривать только первый порядок ошибки в разложении ошибки по величине возмущения.

При этом проведем численное сравнение первого порядка ошибки и полной ошибки для выявления случаев, когда анализ первого порядка ошибки плохо описывает полную ошибку и поэтому его анализ не представляет интереса.

Даже для первого порядка ошибки получение его явного вида — довольно трудоемкая задача. Нам удалось его получить для случая константного сигнала и возмущения в виде выброса. В общем случае результаты касаются сравнения MSE ошибок оценки сигнала методом CSSA и суммарного MSE при применении SSA отдельно к мнимой и вещественной частям.

Алгоритм CSSA

Алгоритм 1.

Вход: Комплексный временной ряд $X = (x_1, \dots, x_N)$, длина окна L , ранг сигнала r .

Выход: Оценка сигнала \tilde{S} .

Алгоритм:

1. **Вложение.** Построим $\mathbf{X} \in \mathbb{R}^{L \times K}$, L -траекторную матрицу ряда X :

$$\mathbf{X} = \mathcal{T}_L X = [X_1 : \dots : X_K],$$

где $K = N - L + 1$, а X_i — векторы L -вложения: $X_i = (x_i, \dots, x_{i+L-1})^T \in \mathbb{R}^L$.

2. **Разложение.** Построим SVD-разложение матрицы \mathbf{X} : $\mathbf{X} = \sum_{k=1}^{\text{rank } \mathbf{X}} \sqrt{\lambda_k} U_k V_k^H = \sum_{k=1}^{\text{rank } \mathbf{X}} \hat{\mathbf{X}}_k$, где U_k , V_k — правые и левые сингулярные векторы матрицы \mathbf{X} соответственно, $\sqrt{\lambda_k}$ — сингулярные числа.

3. **Группировка.** Сгруппируем матрицы компонент сигнала $\hat{\mathbf{S}}$: $\hat{\mathbf{S}} = \sum_{k=1}^r \hat{\mathbf{X}}_k$.

4. *Диагональное усреднение.* Применим процедуру диагонального усреднения (проекция в норме Фробениуса на линейное пространство ганкелевых матриц): $\tilde{\mathbf{S}} = \mathcal{H}\hat{\mathbf{S}}$, затем сопоставим полученным Ганкелевым матрицам ряды длины N : $\tilde{\mathbf{S}} = \mathcal{T}_L^{-1}\tilde{\hat{\mathbf{S}}}$.

L -Рангом временного ряда называется ранг его траекторной матрицы. Для дальнейших рассуждений потребуется знание рангов конкретных рядов. Из [3] известно, что ранг комплексного сигнала, вещественная и мнимая часть которого являются синусоидами с одинаковой частотой ω , $0 < \omega < 0.5$, равен 2, если сдвиг между синусоидами не равен $\pi/2$, и равен 1 в случае комплексной экспоненты. Ранг вещественного синусоидального сигнала, равен 2 при тех же ограничениях на частоту. Ранги же комплексной и вещественной констант равны 1 — их можно рассматривать как частный случай с $\omega = 0$.

Применение теории возмущений к SSA и CSSA

Наблюдаем комплексный временной ряд \mathbf{X} длины N , данный ряд представляется как $\mathbf{X} = \mathbf{S} + \mathbf{R}$, где \mathbf{S} — сигнал ранга r , \mathbf{R} — возмущение. Возьмем некоторую длину окна L , $L > r$.

В [6] вводится разложение восстановления сигнала в модели $\mathbf{S}(\delta) = \mathbf{S} + \delta\mathbf{R}$, что соответствует $\mathbf{H}(\delta) = \mathbf{H} + \delta\mathbf{E}$, где $\mathbf{H}(\delta) = \mathcal{T}_L\mathbf{S}(\delta)$, $\mathbf{H} = \mathbf{S}(\delta)\mathbf{S}$, $\delta\mathbf{E} = \delta\mathbf{R}$, и рассматривается линейный по δ член ошибки восстановления, называемый первым порядком ошибки восстановления.

Рассмотрим возмущение ряда \mathbf{R} с $\delta = 1$, его траекторная матрица \mathbf{E} . Первый порядок ошибки восстановления обозначим как $\mathbf{F}^{(1)} = \mathcal{H}(\mathbf{H}^{(1)})$.

На основе результатов из [8, стр.12] и теоремы 2.1 из [6] была получена следующая формула для $\mathbf{H}^{(1)}$ в случае достаточно маленького возмущения.

$$\mathbf{H}^{(1)} = \mathbf{P}_0\mathbf{E}\mathbf{Q}_0^\perp + \mathbf{P}_0^\perp\mathbf{E}, \quad (1)$$

где \mathbf{P}_0^\perp — проектор на пространство столбцов \mathbf{H} , \mathbf{Q}_0^\perp — проектор на пространство строк \mathbf{H} , $\mathbf{P}_0 = \mathbf{I} - \mathbf{P}_0^\perp$, \mathbf{I} — единичная матрица.

Сравнение CSSA и SSA в случае совпадающих пространств сигналов

Обозначим за:

$\mathbf{F}^{(1)} = (f_1^{(1)}, \dots, f_N^{(1)})$ первый порядок ошибки восстановления \mathbf{S} с возмущением \mathbf{R} метода CSSA,

$F_{\text{Re}}^{(1)} = (f_{\text{Re},1}^{(1)}, \dots, f_{\text{Re},N}^{(1)})$ первый порядок ошибки восстановления $\text{Re}(S)$ с возмущением $\text{Re}(R)$ метода SSA,

$F_{\text{Im}}^{(1)} = (f_{\text{Im},1}^{(1)}, \dots, f_{\text{Im},N}^{(1)})$ первый порядок ошибки восстановления $\text{Im}(S)$ с возмущением $\text{Im}(R)$ метода SSA.

Теорема 1. Пусть пространства столбцов траекторных матриц рядов S , $\text{Re}(S)$ и $\text{Im}(S)$ совпадают и то же самое верно для пространств строк. Тогда при любом, достаточно малым, возмущении R

$$F^{(1)} = F_{\text{Re}}^{(1)} + iF_{\text{Im}}^{(1)}.$$

Теорема непосредственно следует из линейности вхождения E в формулу (1) и линейности диагонального усреднения.

Заметим, что хотя в утверждении теоремы возмущение R может быть любым по форме, однако теорема имеет практическое применение только если первый порядок ошибки адекватно описывает полную ошибку.

Случайное возмущение

Рассмотрим случайное возмущение R .

Для дальнейших рассуждений приведём известный результат.

Лемма 1. Пусть $\zeta = \xi + i\eta$. Тогда $\mathbb{D}\zeta = \mathbb{D}\xi + \mathbb{D}\eta$.

Следствие 1 (из теоремы 1). Пусть выполнены условия теоремы 1. Тогда для любого l , $1 \leq l \leq N$,

$$\mathbb{D}f_l^{(1)} = \mathbb{D}f_{\text{Re},l}^{(1)} + \mathbb{D}f_{\text{Im},l}^{(1)}. \quad (2)$$

Утверждение получается автоматически из теоремы 1 и леммы 1.

Случай двух зашумленных синусоид

Пусть сигнал S имеет вид

$$s_l = A \cos(2\pi\omega l + \phi_1) + iB \cos(2\pi\omega l + \phi_2), \quad (3)$$

где $0 < \omega \leq 0.5$ и $0 \leq \phi_i < 2\pi$. Заметим, что случай $|\psi_2 - \psi_1| = \pi/2$ и $A = B$ соответствует комплексной экспоненте.

Пусть возмущение R — шум, случайный вектор с нулевым матожиданием и достаточно малой дисперсией.

Следствие 2 (из теоремы 1). Для комплексного ряда вида (3), кроме случая $|\psi_2 - \psi_1| = \pi/2$ и $A = B$, выполняется формула (2).

Выполнение условий теоремы 1 (совпадение столбцовых и строковых траекторных пространств сигналов) для ряда вида (3) следует из результатов работы [3].

Замечание 1. Численные эксперименты, проведённые в [1], показывают, что для сигнала в виде комплексной экспоненты суммарная MSE CSSA-оценки сигнала равна полусумме суммарных MSE SSA-оценок сигнала его вещественной и мнимой частей. Численные эксперименты, проведённые нами (не приведены), показывают, что для сигнала в виде комплексной экспоненты MSE CSSA-оценки сигнала равны полусумме MSE SSA-оценок сигнала его вещественной и мнимой частей для каждой точки ряда.

Случай константных сигналов с выбросом

Рассматриваем сигнал $\mathbf{S} = (c_1 + ic_2, \dots, c_1 + ic_2)$, возмущённый выбросом $a_1 + ia_2$ на позиции k , т.е. ряд \mathbf{R} состоит из нулей кроме значения $a_1 + ia_2$ на k -м месте. Исходя из теоремы 1, достаточно уметь вычислять первый порядок ошибки восстановления сигнала $\mathbf{S} = (c, \dots, c)$, возмущённого выбросом a на позиции k .

В работе [7] была получена частный случай формулы (1) для вещественных сигналов единичного ранга:

$$\mathbf{H}^{(1)} = -U^T \mathbf{E} V U V^T + U U^T \mathbf{E} + \mathbf{E} V V^T,$$

где U, V — сингулярные вектора матрицы \mathbf{H} .

Подстановкой $U = \{1/\sqrt{L}\}_{i=1}^L$, $V = \{1/\sqrt{K}\}_{i=1}^K$, $K = N - L + 1$ и последующим диагональным усреднением матрицы $\mathbf{H}^{(1)}$ был получен явный вид первого порядка ошибки восстановления.

Приведем результат для случая $k \leq \min(L/2, K - L)$ и $L < K$

$$f_l^{(1)} = \frac{a}{LK} \begin{cases} (L + K - k), & 1 \leq l \leq k \\ \frac{1}{l}(L + K - l)k, & k < l \leq L \\ \frac{1}{L}K(L + k - l), & L < l < L + k \\ 0, & L + k \leq l \leq K \\ \frac{1}{N-l+1}(K - l)(L - k), & K < l < K + k \\ -k, & K + k \leq l \leq N \end{cases}.$$

Замечание 2. Из данной формулы видно, что при фиксированном L первый порядок ошибки не стремится к 0 с ростом N , тогда как численные эксперименты показывают, что полная ошибка восстановления стремится к 0 с ростом N . Как показано в следующем разделе, это следствие того, что полная ошибка не описывается ее первым порядком. Если же L и K пропорциональны N , то первый порядок ошибки стремится к нулю.

Численное сравнение первого порядка ошибки и полной ошибки оценивания сигнала

Для случая зашумленных гармоник рассмотрен пример с сигналом $s_l = \cos(2\pi l/10) + i \cos(2\pi l/10 + \pi/4)$, $\sigma^2 = 0.1$, $N = 49$, $L = 2$. Результат для одной из реализаций шума представлен на рис. 1.

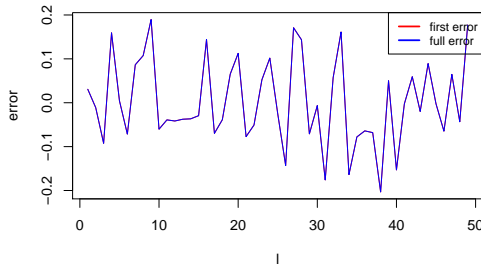


Рис. 1: Вещественные части первого порядка и полной ошибок.

Из графика видно, что ошибки совпадают даже при маленьком L . Из экспериментов, результат совпадения для комплексной экспоненты такой же.

Для случая возмущения в виде выброса был рассмотрен пример с сигналом $s_l = 1 + il$, с возмущением в виде выброса $a_1 + ia_2 = 10 + i10$ на позиции $k = L - 1$. Результаты представлены в таблице 1.

Таблица 1: Максимальное различие первого порядка и полной ошибок.

N	50	100	400	1600
$L = N/2$	0.1313	0.0419	0.0033	0.0002
$L = 20$	0.3074	0.1965	0.5655	0.6720

Численные результаты показывают, что для случая зашумленных гармоник первый порядок адекватно оценивает полную ошибку восстановления сигнала в каждой точке при любых рассматриваемых параметрах сигналов.

Однако для случая возмущения в виде выброса это верно только когда L и K пропорциональны N .

Все численные результаты были получены при помощи пакета [4].

Заключение

В работе удалось подвести теоретическую базу под имеющиеся ранее численные результаты ([1]) по сравнению CSSA и SSA для двух зашумленных гармоник с одинаковой частотой и сдвигом, не равным $\pi/2$. Для зашумленной комплексной экспоненты был получен более общий, нежели имеющиеся ранее, численный результат. Результаты показывают, что только в случае сигнала в виде комплексной экспоненты применение CSSA имеет смысл с точки зрения уменьшения ошибки восстановления сигнала.

Для константного ряда с выбросами был получен явный вид первого порядка ошибок оценки сигнала в каждой точке.

Для обоих случаев было численно исследовано соотношение между первым порядком ошибки и полной ошибкой. В случае случайного возмущения оказалось, что первый порядок ошибки практически совпадает с полной ошибкой. Однако в случае неслучайного возмущения выбросом это не так и требуются дополнительные условия на пропорциональность длины окна L длине ряда N .

Литература

- [1] N. Golyandina, A. Korobeynikov, A. Shlemov, and K. Usevich. Multivariate and 2D extensions of singular spectrum analysis with the Rssa package. *Journal of Statistical Software*, 67(2):1–78, 2015.

- [2] N. Golyandina, V. Nekrutkin, and A. Zhigljavsky. *Analysis of Time Series Structure: SSA and Related Techniques*. Chapman&Hall/CRC, 2001.
- [3] Д. Степанов, Н. Голяндина. Варианты метода "Гусеница"-SSA для прогноза многомерных временных рядов. *Труды IV Международной конференции "Идентификация систем и задачи управления" SICPRO'05*. Москва, 2005, с. 1831-1848.
- [4] A. Korobeynikov, A. Shlemov, K. Usevich, and N. Golyandina. *Rssa: A collection of methods for singular spectrum analysis* <http://CRAN.R-project.org/package=Rssa>, 2021. R package version 1.04.
- [5] T. Kato. Perturbation theory for linear operators. *Springer-Verlag*, 1966.
- [6] V. Nekrutkin. Perturbation expansions of signal subspaces for long signals. *Statistics and Its Interface.*, Vol.3, P. 297-319, 2010.
- [7] V. Nekrutkin. Perturbations in SSA. *Manuscript*, 2008.
- [8] А. Константинов. Некоторые задачи анализа временных рядов (теория методов "Singal Subspace"). *Курсовая работа, науч. рук. В. Некруткин*, 2018.