

Technische Hochschule Rosenheim

Fakultät für Informatik

## Seminararbeit

im Masterstudiengang Informatik - Schwerpunkt Software Engineering

**Thema:** Optimierungsmethoden des Gradienten  
Abstiegverfahrens bei neuronalen Netzen

**Autor:** Victor Wolf / Victor.Wolf@stud.fh-rosenheim.de  
MatNr. 845615

**Version vom:** 30. Dezember 2019

**Betreuer:** Prof. Dr. Holaubek

## Zusammenfassung

Diese Arbeit wird sich mit verschiedenen Optimierungsalgorithmen des Gradienten Abstiegsverfahren bei neuronalen Netzen beschäftigen und diese auf Basis von Beispieldatensätzen evaluieren. Hierbei wird eine Metrik definiert um die Ergebnis der einzelnen Optimierungsmethode zu vergleichen.

Ein Optimierungsalgorithmus ist eine Möglichkeit die Konvergenz der Fehlerfunktion  $J(\theta)$  des neuronalen Netzes beim Lernen zu verbessern.

Hierbei wird auf den Lern Prozess des Neuronalen Netzes eingegangen. Besonderen Fokus wird der “Gradient Descent”, zu Deutsch Gradienten Abstiegsverfahren, einnehmen, da dies die Grundlage des Lernens darstellt. Dieser sucht im mehrdimensionalen Raum die Minima der nichtlinearen Fehlerfunktion. Die Verbesserung dieser Suche machen sich die Optimierungsalgorithmen zur Aufgabe. Nach der theoretischen Aufarbeitung, werden wir ein paar Eigenschaften über diese Optimierungsmethoden annehmen ,um diese anhand der Testdaten zu überprüfen und mit der Literatur zu vergleichen.

## Abstract

This work will focus on explaining the different optimization methods of the gradient descent algorithm of neural networks and evaluating them on example datasets. We will define a metric to be able to evaluate the performance of the different optimizer. An optimization method is a way to improve the performance of the error function  $J(\theta)$  of the neural network.

Furthermore this work will give a detailed explanation of the learning process of Neural Networks especially focusing on the Gradient Descent, which is the foundation of learning in neural networks. This algorithm aims to find local minima in the Hyperplane of the non-linear error function. The optimization algorithms aim to improve this search. After the Theory, we will assume some properties about those optimization methods and test those assumptions by evaluating the metrics of the neural networks. Then we will compare our results to the literature

# Inhaltsverzeichnis

<b>1</b>	<b>Einleitung</b>	<b>4</b>
<b>2</b>	<b>Theoretische Grundlagen</b>	<b>4</b>
2.1	Neuronale Netze . . . . .	4
2.2	Gradient Descent . . . . .	6
2.3	Optimierungsmethoden . . . . .	7
2.3.1	Stochastic Gradient Descent . . . . .	8
2.3.2	Adagrad . . . . .	8
2.3.3	Adam . . . . .	9
<b>3</b>	<b>Evaluation</b>	<b>10</b>
3.1	Test Datensatz . . . . .	10
3.1.1	Boston House Price . . . . .	10
3.1.2	Breast Cancer . . . . .	11
3.2	Metrik . . . . .	11
3.3	Programm . . . . .	13
3.3.1	Frameworks . . . . .	13
3.3.2	Aufbau . . . . .	13
3.3.3	Netzstruktur . . . . .	15
3.4	Auswertung . . . . .	16
3.4.1	Erwartungen . . . . .	16
3.4.2	Boston House Price Auswertung . . . . .	17
3.4.3	Breast Cancer Auswertung . . . . .	18
3.4.4	Vergleich mit der Literatur . . . . .	18
<b>4</b>	<b>Fazit</b>	<b>18</b>
	<b>Literaturverzeichnis</b>	<b>20</b>
	<b>Eidesstattliche Erklärung</b>	<b>21</b>

# 1 Einleitung

Neuronale Netze sind ein weit verbreitetes Thema. Dabei wird ihnen oft mehr “Magie” zugesprochen als in ihnen eigentlich enthalten ist. Der Lernprozess eines neuronalen Netzes ist nämlich einfach ein sinnvoller Algorithmus, der auf viele Problemstellungen angewandt werden kann. Jedoch kann jeder Algorithmus verbessert werden. Der grundlegende Algorithmus ist hierfür der sogenannte Gradient Descent oder zu deutsch Gradienten Abstiegsverfahren. Dieser weist jedoch verschiedene Probleme auf. Deshalb gibt es Optimierungsalgorithmen, die die Fehler des grundlegenden Algorithmus verbessern wollen. Hierbei ist die Wahl des Optimierungsalgorithmus jedoch nicht immer eindeutig. Diese gibt es reichlich und es ist nicht immer offensichtlich, welcher Algorithmus wo angewandt werden sollte. Deshalb greift sich diese Arbeit drei bekannte Optimierungsalgorithmen heraus und evaluiert diese anhand von geeigneten Metriken. Dabei wird ein Python Programm erstellt, um diese Fragen beantworten zu können. Um die Problematik zu beleuchten, wird erst in die Theorie der neuronale Netze und des Gradienten Abstiegsverfahrens eingeführt. Anschließend werden die verschiedenen Optimierungsalgorithmen theoretisch aufgearbeitet. Im Anschluss wird sich mit den genutzten Metriken und dem Aufbau des Programms beschäftigt. Schlussendlich werden die Ergebnisse ausgewertet und mit der Literatur verglichen.

## 2 Theoretische Grundlagen

### 2.1 Neuronale Netze

Künstliche Neuronale Netze kurz KNNs sind der menschliche Versuch das biologische Nervensystem nachzuahmen. Sie basieren auf der Tatsache der Reizweitergabe. So wird ein Eingangsreiz von Rezeptoren aufgenommen und über verschiedene sogenannter Neuronen weitergegeben. Durch diese Weitergabe wird das Signal verändert, bis ein Ausgangssignal interpretiert werden kann. Diese Funktionsweise macht man sich bei künstlichen Neuronalen Netzen zu nutze. Der Eingangsreiz sind hier die sogenannten “features“, der Ausgangsreiz, eine Klasse oder ein Wert, der interpretiert werden kann. Wir wollen uns hier nun nur auf die “Feed Forward“ Netze fokussieren. Das bedeutet das Neuronen ihre Ausgabe nur in eine Richtung schicken dürfen.

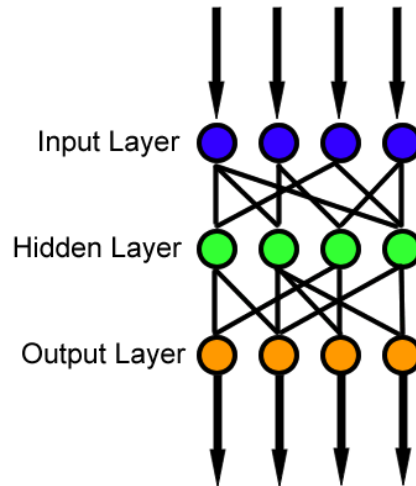


Abbildung 1: Beispiel eines Feed Forward KNNs

KNNs existieren in zwei Zuständen der Trainingsphase und der Arbeitsphase. Die Trainingsphase ist die interessantere und wird in dieser Arbeit beleuchtet. Hier werden durch Optimierung der Fehlerfunktion die Neuronen so “eingestellt”, dass sie eine möglichst gute Vorhersage treffen. In der Arbeitsphase werden dem Netz dann neue Eingangsreize gegeben, die dieses dann interpretieren soll.

Im Folgenden soll nun der Begriff des Neurons formalisiert werden, um die Verbesserungsmöglichkeiten des Gradienten Abstiegsverfahrens in Abschnitt 2.3 nachvollziehen zu können.

**Definition 2.1** [Bur97, Kapitel 1.2] Ein (**formales**) **Neuron** ist eine Funktion  $\kappa : \mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R}^m$  definiert durch:

- eine Aktivierungsfunktion  $T : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$
- ein gewichteter Vektor  $\vec{w} = \{w_1, w_2, \dots, w_n\}$
- und eine Schwelle  $\Theta \in \mathbb{R}$ .

Der Vektor  $\vec{x} = (x_1, x_2, \dots, x_n) \in \mathbb{R}^n$  wird auf den Vektor  $\vec{y} = (y, y, \dots, y) \in \mathbb{R}^m$  mit identischen Komponenten durch die folgende Rechenvorschrift abgebildet

$$\kappa(\vec{x}) := (T(\sum_{i=1}^n w_i x_i - \Theta), \dots, T(\sum_{i=1}^n w_i x_i - \Theta)) = \vec{y} \in \mathbb{R}^m \quad (1)$$

Hier seien ein paar Beispiele für Aktivierungsfunktionen angegeben

- Identität  $T_I$

$$T(x) := x = T_I(x)$$

- Binary step

$$T(x) := \begin{cases} 0, & \text{for } x < 0 \\ 1, & \text{for } x \geq 0 \end{cases} =: T_1(x)$$

- Sigmoid

$$T(x) := \frac{1}{1 + e^{-x}} =: T_S(x)$$

- Tangens hyperbolicus

$$T(x) := \frac{1 + \tanh(x)}{2} =: T_H(x)$$

Dies sind nur ein paar wenige Beispiele. Jede Funktion  $T : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$  die  $\lim_{x \rightarrow -\infty} T(x) = 0$  and  $\lim_{x \rightarrow \infty} T(x) = 1$  erfüllt, kann als Aktivierungsfunktion genutzt werden.

**Definition 2.2** [Mic, Kapitel 2] Die **Fehlerfunktion**  $J(\theta)$  eines Neuronalen Netzes ist eine differenzierbare Funktion für die gilt:

- $J(\theta) = \frac{1}{n} \sum_x J_x$  wobei  $x$  ein Eingabe Datum beschreibt.
- $J(\theta)$  lässt sich aus der Summe der Elemente des Ausgabe Vektors darstellen.

Die erste Eigenschaft bedeutet, dass die gesamte Fehlerfunktion sich auch durch die Fehlerfunktion der einzelnen Eingabe Daten darstellen lässt. Diese Fehlerfunktion wird im nächsten Abschnitt minimiert werden, um eine optimale Parameterbelegung der Gewichte  $\vec{w}$  zu finden. Beispiel für eine solche Funktion wäre der mittlere quadratische Fehler.

## 2.2 Gradient Descent

Der Gradient Descent oder zu Deutsch Gradienten Abstiegsverfahren ist ein Weg eine Zielfunktion  $J(\theta)$  parametrisiert durch  $\theta \in \mathbb{R}^n$  zu minimieren. Man aktualisiert diese Parameter in Richtung des stärksten Abstiegs der Zielfunktion  $\nabla_{\theta} J(\theta)$ . Die Lern Rate  $\mu$  bestimmt dabei die Größe der Aktualisierungsschritte. Das Verfahren folgt also der Richtung des Abstiegs der Oberfläche der Zielfunktion in ein Tal, welches ein lokales Minimum beschreibt. [Rud, Kapitel 1]

Im Fall eines neuronalen Netzes ist die Zielfunktion  $J(\theta)$  die Fehlerfunktion des neuronalen Netzes. Wir brauchen einen solchen Algorithmus, da durch die Aktivierungsfunktion der Neuronen wie in 2.1 beschrieben, die Fehlerfunktion nichtlinear wird und somit die Minima sich nicht mehr analytisch berechnen lassen. Um die Richtung des stärksten Abstiegs der Fehlerfunktion zu bestimmen, benötigen wir den Gradienten.

**Definition 2.3** [Kön02] Der **Gradient**  $\nabla$  der total differenzierbaren Funktion  $f : \mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R}$  im Punkt  $a \in \mathbb{R}$  ist im Falle des Standard Skalar Produkts definiert durch:

$$\nabla f := \frac{\partial f}{\partial x_1} \hat{e}_1 + \dots + \frac{\partial f}{\partial x_n} \hat{e}_n \quad (2)$$

In einfachen Worte gefasst, ist der Gradient die Ableitung einer mehrdimensionalen Funktion, deren Funktionswerte man sich als Gebirge vorstellen kann. Hierbei ist der Gradient, in einen Punkt, ein Vektor, der in die Richtung des stärksten Anstiegs zeigt. Um die Richtung des stärksten Abstiegs zu erhalten, welche wir beim Gradienten Abstiegsverfahren benötigen, müssen wir nur den negativen Gradienten berechnen.

Mit diesem Wissen können wir nun den Standard Gradient Descent Algorithmus definieren.

**Definition 2.4** [Rud, Kapitel 2.1] Der sogenannte **batch gradient descent**, berechnet den Gradienten der Kostenfunktion für den gesamten Datensatz. Jedes Update der Parameter ist definiert durch

$$\theta = \theta - \eta \cdot \nabla_{\theta} J(\theta) \quad (3)$$

wobei  $\eta$  die Lern Geschwindigkeit beschreibt.

Als Algorithmus würde der batch gradient descent folgendermaßen aussehen.

```

1 for i in range(nb_epochs):
2     params_grad = evaluate_gradient(loss_function, data, params)
3     params = params - learning_rate * params_grad

```

wobei `nb_epochs` die Anzahl der Iterationen beschreibt. Diese Implementierung beschreibt die grundsätzliche Idee aber hat mehrere Nachteile. Da wir den Gradienten für den gesamten Datensatz berechnen ist diese Methode sehr langsam und nicht möglich für Datensätze, die nicht in den Arbeitsspeicher passen. Außerdem konvergiert dieser Algorithmus nur sehr langsam gegen ein lokales Minimum. Zusätzlich ist die Wahl der perfekten Lern Geschwindigkeit oft schwierig.

Zusätzlich benötigt man den Backpropagation Algorithmus um dieses Verfahren auf ein gesamtes neuronales Netz anzuwenden. Dieser ist aber ebenfalls sehr komplex und wird deshalb hier nicht behandelt. Er kann in [Mic, Kapitel 2] nachgelesen werden.

## 2.3 Optimierungsmethoden

Im vorherigen Abschnitt haben wir die Grundlagen des Gradienten Abstiegsverfahren kennengelernt und gesehen, dass dieses Probleme mit sich bringt. Die folgenden Opti-

mierungsmethoden verbessern das grundsätzliche batch gradient descent Verfahren in die ein oder andere Richtung.

### 2.3.1 Stochastic Gradient Descent

**Definition 2.5** [Rud, Kapitel 2.2] Der Aktualisierungsschritt des **stochastic gradient descent** ist definiert durch

$$\theta = \theta - \eta \cdot \nabla_{\theta} J(\theta; x^{(i)}; y^{(i)}) \quad (4)$$

Der Unterschied zum **batch gradient descent** ist nur, dass der Aktualisierungsschritt für jedes einzelne Datum ausgeführt wird. Das macht den Algorithmus wesentlich schneller, aber lässt ihn ebenfalls stärker schwanken, während er ein lokales Minimum sucht. Dies kann positiv wie negativ sein, da eine solche Schwankung den Algorithmus Ebenen schneller überwinden lässt, aber manchmal auch Minima überspringen lässt. Um eine gut Konvergenz zu gewährleisten, erweitert man den Algorithmus noch um zwei Eigenschaften.

- Die  $x^{(i)}, y^{(y)}$  werden jede Iteration zufällig angeordnet
- Die Lern Geschwindigkeit  $\eta$  wird linear verkleinert.

Der stochastic gradient descent kann durch folgende Eigenschaft noch erweitert werden.

$$\theta = \theta - \eta \cdot \nabla_{\theta} J(\theta; x^{(i:i+n)}; y^{(i:i+n)}) \quad (5)$$

Nun wird nicht mehr für jedes einzelne Datum der Gradient berechnet, sondern für einen Teilmenge der Größe  $n$ . In mancher Literatur, wird dieser Algorithmus noch einmal extra als **Mini-batch gradient descent** benannt. [Rud, Kapitel 2.3]. In den Implementierungen wird hier jedoch meist keine Unterscheidung mehr getroffen. [C<sup>+</sup>15]

### 2.3.2 Adagrad

Der Adagrad Algorithmus erweitert den Stochastic Gradient Descent noch weiter. Bisher wurde die Lern Geschwindigkeit  $\eta$  entweder konstant gelassen oder linear verkleinert. Die Lern Geschwindigkeit hat somit keinen Bezug auf die Trainingsdaten. Hier setzt Adagrad an. Er verändert die Lern Geschwindigkeit im Verhältnis zur Dichte des jeweiligen Parameters.

Deshalb hängt der Algorithmus diesmal auch von jedem einzelnen Elemente von  $\theta$ , bezeichnet als  $\theta_i$  ab.



**Definition 2.6** [Rud, Kapitel 4.3] Der **Adagrad** Algorithmus ist definiert durch den Aktualisierungsschritt

$$\theta_{t+1,i} = \theta_{t,i} - \frac{\eta}{\sqrt{G_{t,ii} + \epsilon}} \cdot g_{t,i} \quad (6)$$

wobei  $g_{t,i}$  definiert ist durch

$$g_{t,i} = \nabla_{\theta_t} J(\theta_{t,i}) \quad (7)$$

und  $G_t \in \mathbb{R}^{d \times d}$  ist eine diagonal Matrix, wobei die Diagonalelemente  $i, i$ , die Summe der Quadrate der Gradienten zum zugehörigen Parameter  $\theta_i$  bis zum Zeitpunkt  $t$  sind und  $\epsilon > 0$

Dies bringt eine große Erleichterung im Vergleich zu den bisherigen Algorithmen. Durch die automatische und variable Anpassung der Lern Geschwindigkeit gewinnt man eine einfachere Implementierung und bessere Ergebnisse.

Adagrad hat jedoch einen Nachteil, durch die quadrierten summierten Gradienten unter dem Bruch konvergiert die Veränderung der Parameter gegen null. Deshalb kann Adagrad situationsbedingt auch schlechter als die bisherig vorgestellten Algorithmen sein.

### 2.3.3 Adam

[Die15] Adaptive Moment Estimation (Adam) ist ein Weiterer Algorithmus, der sich wie Adagrad adaptiv an den jeweiligen Parameter anpasst. Er versucht aber gleichzeitig das Problem der summierten Gradienten zu umgehen.

**Definition 2.7** Der **ADAM** Algorithmus ist definiert durch den Aktualisierungsschritt

$$\theta_{t+1} = \theta_t + \frac{\eta}{\sqrt{\hat{v}_t + \epsilon}} \hat{m}_t \quad (8)$$

wobei

$$\hat{m}_t = \frac{\beta_1 m_{t-1} + (1 - \beta_1) g_t}{1 - \beta_1^t} \quad (9)$$

und

$$\hat{v}_t = \frac{\beta_2 v_{t-1} + (1 - \beta_2) g_t^2}{1 - \beta_2^t} \quad (10)$$

wobei  $\hat{m}_t$  den Mittelwert des Gradienten über die Zeit beschreibt und  $\hat{v}_t$  die Varianz.  $\beta_1$  und  $\beta_2$  sind dabei Zerfall Raten, die bestimmen, wieviel Einfluss die vergangenen Gradienten auf den neuen Wert nehmen.

Adam ist deswegen ein sehr beliebter Optimierungsalgorithmus, da er nicht nur adaptiv für jeden einzelnen Parameter arbeitet, sondern durch die Anpassung mit Mittelwert und Varianz der vergangenen Gradienten statistisches Wissen über die Beschaffenheit der Oberfläche mit einbringt.

## 3 Evaluation

In diesem Kapitel wollen wir uns jetzt mit der Analyse der einzelnen Optimierungsmethoden beschäftigen. Mithilfe des vorherigen Kapitels wollen wir nachweisen, dass ein theoretisch besserer Algorithmus auch wirklich besser arbeitet. Was in diesem Fall “besser” bedeutet soll ebenfalls geklärt werden.

### 3.1 Test Datensatz

Um ein neuronales Netz zu bewerten, brauchen wir zunächst einige Test Daten, hierbei werden die beiden frei verfügbaren Datensätze, der *Boston House Price* Datensatz und der *Breast Cancer* Datensatz, benutzt. Beide sind im *scikit-learn* Paket [PVG<sup>+</sup>11] enthalten.

#### 3.1.1 Boston House Price

Der *Boston House Price* Datensatz besteht aus einem Regressionsproblem. Das bedeutet, dass wir eine reelle Zahl mit unserem Netz voraussagen wollen, nämlich den Preis eines Hauses in Boston. Damit das das Netz lernen kann gibt es einige explanatorische Variablen wie unter anderem

- **CRIM**: Die Verbrechensrate pro Kopf.
- **RM**: Die Anzahl der Räume im Haus.
- **TAX**: Steuer die auf das Grundstück gezahlt werden muss.
- **DIS**: gewichteter Abstand zum Zentrum von Boston.

Mit diesen, insgesamt 13 Hilfsvariablen soll das Netz den Haus Preis voraussagen.

	CRIM	ZN	INDUS	CHAS	NOX	RM	AGE	DIS	RAD	TAX	PTRATIO	B	LSTAT
0	0.00632	18.0	2.31	0.0	0.538	6.575	65.2	4.0900	1.0	296.0	15.3	396.90	4.98
1	0.02731	0.0	7.07	0.0	0.469	6.421	78.9	4.9671	2.0	242.0	17.8	396.90	9.14
2	0.02729	0.0	7.07	0.0	0.469	7.185	61.1	4.9671	2.0	242.0	17.8	392.83	4.03

Abbildung 2: Beispiel des Boston Datensatzes

### 3.1.2 Breast Cancer

Der *Breast Cancer* Datensatz hingegen besteht aus einem binären Klassifikationsproblem. Das bedeutet, dass das Netz nur “ja” oder “nein” kodiert als eins oder null, voraussagen soll. Hierbei bedeutet ein Ja, dass diese Person Brustkrebs hat. Hier gibt es wieder einige explanatorische Variablen, die dem Netz helfen sollen zu lernen. Diese sind Eigenschaften des Nukleus einer entommenen Brustzelle

- **radius:** Radius des Nukleus
- **texture:** Standardabweichung der Graustufenwerte
- **symmetry:** Symmetrie des Nukleus
- **smoothness:** Lokale Abweichung der Radius Länge

Insgesamt besteht der Datensatz aus 30 solchen Variablen.

	mean radius	mean texture	mean perimeter	mean area	mean smoothness	mean compactness	mean concavity	mean concave points	mean symmetry	mean fractal dimension
0	17.99	10.38	122.80	1001.0	0.11840	0.27760	0.30010	0.14710	0.2419	0.07871
1	20.57	17.77	132.90	1326.0	0.08474	0.07864	0.08690	0.07017	0.1812	0.05667
2	19.69	21.25	130.00	1203.0	0.10960	0.15990	0.19740	0.12790	0.2069	0.05999

Abbildung 3: Beispiel des Breast Cancer Datensatzes

## 3.2 Metrik

Bevor wir mit dem Vergleich der verschiedenen Optimierungsmethoden der Gradienten beginnen können, brauchen wir ein Maß für die Güte eines Ergebnisses. Dafür müssen wir eine Metrik definieren. Sinnvoll ist es ein neuronales Netz daran zu messen, wieviel es richtig bewertet hat. Richtig ist im Falle des *Breast Cancer* Datensatzes einfach ob das Netz ja zu ja und nein zu nein gesagt hat. Im Falle des *Boston House Price* Datensatzes ist richtig, wenn der Abstand vom vorhergesagten zum echten Preis möglichst klein ist. Dies gibt uns eine Vielzahl von Metriken die diese Voraussetzungen erfüllen.

Günstiger Weise benötigen wir bereits durch das Training des neuronalen Netzes eine Gütefunktion die angibt ob sich die Parameter in die richtige Richtung bewegen. Diese ist die in Abschnitt 2.1 bereits besprochene Fehlerfunktion des Netzes. Diese sollte unsere erste Form einer Metrik sein um das Neuronale Netz zu bewerten.

Für den *Boston House Price* Datensatz ist diese Fehlerfunktion die *mittlere quadratische Abweichung*.

**Definition 3.1** [FHK<sup>+</sup> 16, S.344] Die **mittlere quadratische Abweichung** für eine Stichprobe  $x_1, \dots, x_n$  mit Schätzwerten  $\hat{x}_1, \dots, \hat{x}_n$  ist definiert durch

$$\frac{1}{n} \sum_{i=1}^n (\hat{x}_i - x_i)^2 \quad (11)$$

Dies ist die typische Fehlerfunktion für Regressionsprobleme. Man mag sich fragen warum diese quadriert wird und nicht der absolute Abstand zum echten Wert genommen wird, wie vorher überlegt. Diese Funktion ist aber diejenige aus der wir den Gradienten berechnen wollen, also muss sie differenzierbar sein, was das Quadrat gewährleistet.

Für den *Breast Cancer* Datensatz ist diese Funktion jedoch unzureichend, da nur null oder eins im Wertebereich der mittleren quadratischen Abweichung vorkommen würden. Da es sich hier um ein binäres Klassifikationsproblem handelt, eignet sich die *binäre Kreuzentropie*.

**Definition 3.2** [RK04] Die **binäre Kreuzentropie** für eine Stichprobe  $x_1, \dots, x_n$  mit Schätzwerten  $\hat{x}_1, \dots, \hat{x}_n$  ist definiert durch

$$\frac{1}{n} \sum_{i=1}^n x_i \log(\hat{x}_i) + (1 - x_i) \log(1 - \hat{x}_i) \quad (12)$$

wobei  $\log$  der natürliche Logarithmus ist.

Diese Fehlerfunktion ist geeignet für Wertebereiche zwischen null und eins. Also genau passend für ein zwei Klassen Klassifikationsproblem.

Diese beiden Fehlerfunktionen geben uns eine erste Idee für die Güte des neuronalen Netzes und deren Prädiktion und damit auch einen Indikator, welches Netz den besseren Optimierungsalgorithmus besitzt, wenn sonst alle Parameter gleich bleiben. Zusätzlich nehmen wir um mehr Vergleichbarkeit zu schaffen eine weitere Fehlerfunktion hinzu, die nur der Evaluierung der besseren Optimierungsmethode dient und nicht für das Gradienten Abstiegsverfahren genutzt wird. Im Falle des *Boston House Price* Datensatzes benutzen wir noch den *Mittleren absoluten Fehler*.

**Definition 3.3** Der **Mittlere absolute Fehler** für eine Stichprobe  $x_1, \dots, x_n$  mit Schätzwerten  $\hat{x}_1, \dots, \hat{x}_n$  ist definiert durch

$$\frac{1}{n} \sum_{i=1}^n |\hat{x}_i - x_i| \quad (13)$$

Dies ist die intuitivere Definition des Fehlers und ist somit geeignet um die Optimierungsmethoden zu vergleichen.

Für den *Breast Cancer* Datensatz benutzen wir zusätzlich die *Accuracy*, um die Ergebnisse des neuronalen Netzes vergleichbarer zu machen.

**Definition 3.4** Die **Accuracy** einer Stichprobe der Größe  $n$  ist definiert durch

$$Accuracy = \frac{\text{Anzahl korrekter Voraussagen}}{n} \quad (14)$$

Diese ist ebenfalls das intuitivere Verständnis der Güte eines neuronalen Netzes und hilft somit bei der Auswertung der Optimierungsalgorithmen.

### 3.3 Programm

Für einen Aufbau eines solchen Netzes und die Anwendung des Gradienten Abstiegsverfahrens gibt es bereits verschiedenste Frameworks. Diese stehen vor Allem in *Python* zur Verfügung, da diese eine der vorrangigen KI Sprachen ist. Aus diesem Grund wird das folgende Programm für die Auswertung der Optimierungsalgorithmen, auf unseren zwei Test Datensätzen, ebenfalls in *Python* implementiert sein.

#### 3.3.1 Frameworks

Um uns die Arbeit zu erleichtern und um die Optimierungsalgorithmen, sowie das neuronale Netz nicht selbst implementieren zu müssen benutzen wir einige Frameworks.

- **Keras** [C<sup>+</sup>15]: Ein Framework, um neuronale Netze durch ein “Baustein” artiges Prinzip aufzubauen.
- **Scikit-learn** [PVG<sup>+</sup>11]: Ein Framework, welches viele machine learning- sowie Vorverarbeitungsalgorithmen als Funktionsaufruf zur Verfügung stellt.
- **Pandas** [McK10]: Ein Framework, was uns tabellenartige Datenstrukturen zur Verfügung stellt, welche die Weiterverarbeitung vereinfachen.
- **Numpy** [Oli ]: Ein Framework für wissenschaftliche Berechnungen in Python, wie zum Beispiel Matrizenmultiplikation.

#### 3.3.2 Aufbau

Die Idee hinter dem Aufbau des Python Programms war eine Objekt orientierte Klassenlandschaft zu erstellen, um möglichst allgemein die verschiedenen Optimierungsalgorithmen an unterschiedlichen Neuronalen Netzen und Datensätzen zu testen. Das folgende UML-Diagramm veranschaulicht diese Prämisse.

Die wichtigste Klasse hier ist der **DataEvaluator**. Er verallgemeinert das Konzept einer Testklasse, die Neuronale Netze zu bestimmten Datensätzen auswertet. Was dabei ausgewertet wird, wird allgemein gehalten. Die konkrete Implementierung erfolgt in

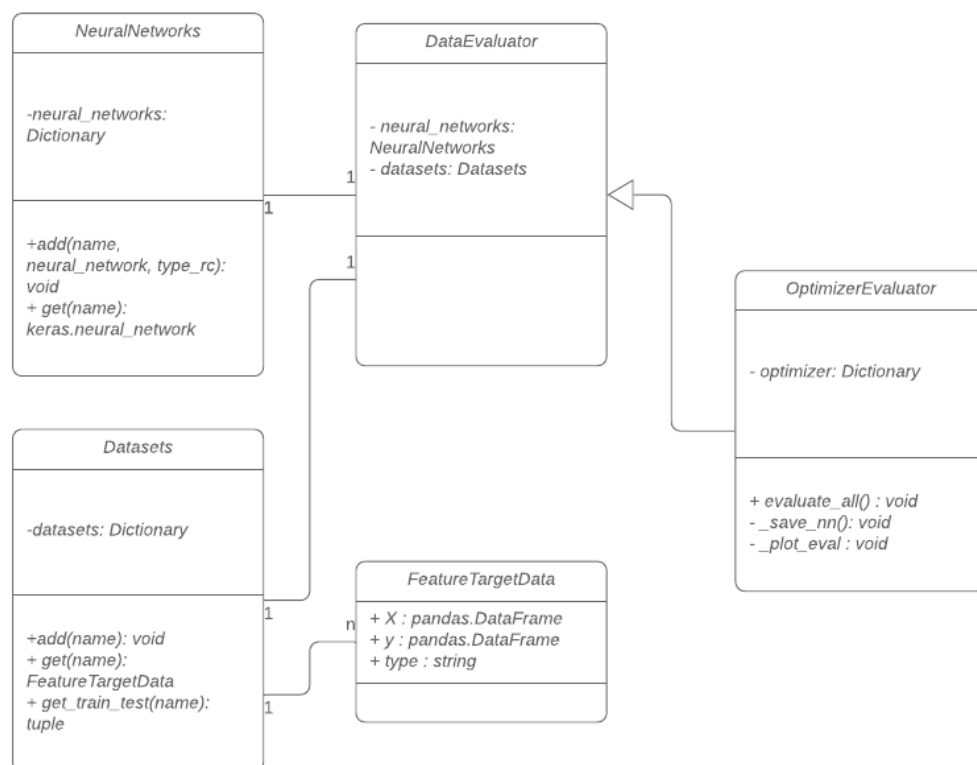


Abbildung 4: UML-Diagramm des Python Programms

der `OptimizerEvaluator` Klasse, die mit der `evaluate_all` Methode die eigentliche Auswertung der Optimierungsalgorithmen übernimmt. Diese erbt von `DataEvaluator` und besitzt somit dessen Attribute, die vom Typ `NeuralNetworks` und `Datasets` sind. Diese besitzen jeweils ein dictionary Attribut, in dem sie nach dem key value Prinzip ihre jeweiligen Inhalte speichern. In `Datasets` werden die Auszuwertenden Datensätze gespeichert. Diese Datensätze sind vom Typ `FeatureTargetData`.

Dieser neue Datentyp wird benötigt um später einfach zwischen explanatorischen Variablen und Zielvariablen zu unterscheiden. In `X` werden die explanatorischen Variablen gespeichert und in `y` die Zielvariable. Zusätzlich speichern wir die Art der Vorhersage, die auf dem Datensatz möglich ist. Also entweder “Regression” oder “Klassifikation”. Wir benötigen diese Information, um später die richtigen Metriken auszuwählen. Wie in Abschnitt 3.2 erläutert, benutzen wir verschiedene Metriken für Regressions- und Klassifikationsprobleme.

In der `Neural Networks` Klasse werden die neuronalen Netze, die uns das Keras Framework zur Verfügung stellt gespeichert. Dabei wird nur deren Struktur gespeichert. Die Gewichte werden erst später angepasst, wenn wir das Netz auf einen Datensatz trainieren.

### 3.3.3 Netzstruktur

Oftmals steht und fällt ein neuronales Netz mit seiner vorher festgelegten Struktur. Diese kann das Netz nicht selbst lernen, sondern muss vom Menschen vorgegeben werden. Da unser Hauptfokus jedoch der Vergleich der Optimierungsalgorithmen ist, und nicht der Aufbau eines perfekten neuronalen Netzes, ist die Netzstruktur eher zweitrangig. Zusätzlich sind die Testdatensätze eher einfachere Probleme, die auch simple neuronale Netzstrukturen gut lernen können. Wichtig ist nur, dass wir immer den gleichen Netzaufbau für jede Optimierung benutzen um Vergleichbarkeit zu schaffen.

Im folgenden soll die Netzstruktur, die wir für die Regressionsprobleme des *Boston House Price* Datensatzes benutzen erläutert werden.

```
1 _regression_NN_boston = Sequential()
2 _regression_NN_boston.add(
3     Dense(units=160, activation='relu', input_shape=(13,)))
4 _regression_NN_boston.add(Dense(units=64, activation='relu'))
5 _regression_NN_boston.add(Dense(units=1, activation='linear'))
```

Diese Definition ist für das *Keras* Framework gedacht. Hier definiert man jede Ebene des Netzes nacheinander. Wir initialisieren das Netz mit dem `Sequential` Konstruktor. Das bedeutet, dass wir ein normales feed forward Netz bauen wollen, wie in Abschnitt 2.1 erläutert. Nun fügen wir die erste Ebene des Netzes hinzu. Diese ist `Dense`, was bedeutet, dass jedes Neuron mit jedem verknüpft ist. Außerdem sind insgesamt 160 Neuronen in dieser Ebene. Die Anzahl der Neuronen ist üblicherweise ein Indikator dafür, wie komplex das Netz ist und vor Allem wie komplex das Problem ist, welches

das Netz versucht zu lösen. Für diese einfache Problematik sollten 160 Neuronen jedoch ausreichen

In dieser Ebene verwenden wir die nichtlineare Aktivierungsfunktion *Relu*, wie in Definition 2.1 bereits erläutert, wird diese nichtlineare Funktion benötigt um nichtlineare Probleme zu lösen und macht somit das Gradienten Abstiegsverfahren erst notwendig. Da es sich hier um eine innere Schicht eines feed forward Netzes handelt ist die Wahl von Relu eindeutig. Diese hat sich in den letzten Jahren als beste Aktivierungsfunktion für innere Schichten herausgestellt. [GBC16, S. 226] Der Parameter `input_shape` gibt an wie viele explanatorische Variablen dem Netz zugeführt werden. Wie in Abschnitt 3.1.1 besprochen, besitzt der *Boston House Price* Datensatz 13 explanatorische Variablen. Mit diesem Prinzip wird noch eine innere Schicht hinzugefügt und schließlich die Ausgabeschicht die nur aus einem einzigen Neuron besteht, da wir hier die Zahl für den Preis erwarten.

Für den *Breast Cancer* Datensatz ergibt sich ein ähnlicher Aufbau.

```
1 _classification_NN_breast_cancer = Sequential()
2 _classification_NN_breast_cancer.add(
3     Dense(40, input_shape=(30,), activation='relu'))
4 _classification_NN_breast_cancer.add(Dense(20, activation='relu'))
5 _classification_NN_breast_cancer.add(Dense(1, activation='sigmoid'))
```

Nur das hier in der Ausgabeschicht die *Sigmoid* Funktion verwendet wird, da wir eine Zahl zwischen null und eins erwarten. Nämlich die Wahrscheinlichkeit für Brustkrebs.

## 3.4 Auswertung

Nun ist alles bereit um die verschiedenen Netze mit unterschiedlichen Optimierungsalgorithmen zu trainieren und diese anschließend mit den Metriken aus Abschnitt 3.2 zu bewerten.

### 3.4.1 Erwartungen

Wir werden die drei vorgestellten Algorithmen

- Stochastic Gradient Descent
- Adagrad
- ADAM

anwenden und ihre Performance mithilfe der Metriken messen. Der *Stochastic Gradient Descent* ist dabei der simpelste Algorithmus. Also würden wir erwarten, dass dieser die schlechtesten Ergebnisse liefert. *Adagrad* und *ADAM* sind ähnlich, jedoch benutzt



ADAM noch mehr Informationen als Adagrad. *ADAM* sollte somit die beste Performance haben. Adagrad sollte aber auch nicht schlecht sein, da beide Datensätze eher klein sind und somit eine adaptive Anpassung der Gewichte wichtig ist.

### 3.4.2 Boston House Price Auswertung

Für die Auswertung des *Boston House Price* Datensatzes haben wir den *MSE* (in der Abbildung 5 unter Loss) und den *MAE* als Metrik ausgewählt. Umso niedriger diese Werte sind, desto besser hat das Netz den Hauspreis vorausgesagt.

	Loss	Mae
adam	11.83	2.64
sgd		
adagrad		

Abbildung 5: Boston House Price Auswertung

In Abbildung 5 ist klar zu erkennen das keine Werte unter den beiden Optimierungsmethoden *SGD* und *Adagrad* eingetragen wurden. Das liegt daran dass diese Optimierungsalgorithmen nicht konvergiert sind.

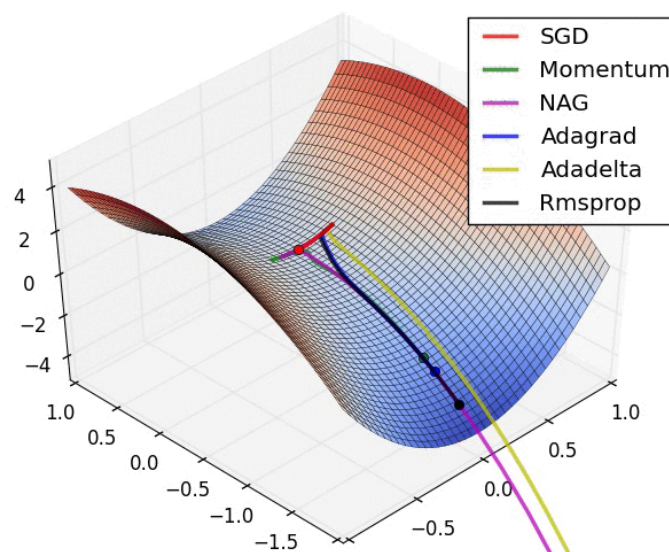


Abbildung 6: Visualisierung Divergenz - Quelle: <https://imgur.com/a/Hqolp>

In Abbildung 6 sehen wir die Oberfläche für ein solches Ergebnis. Die Algorithmen starten offensichtlich in der Nähe eines Sattelpunkts und folgen einem unendlichen Abstieg. Bei *ADAM* passiert dies jedoch nicht. Dieser ist offensichtlich wesentlich robuster gegenüber solchen Sattelpunkten. Ein anderer Grund für eine solche Divergenz könnte beim Stochastic Gradient Descent auch eine unpassende Lernrate  $\eta$  sein. Oft können solche Divergenzen auch durch eine schlechte Parametrisierung des Lernraums entstehen. Dadurch, dass die Distanzen in einem 13 dimensionalen Raum sehr groß werden,

können solche Divergenzen begünstigt werden. Die Variablen wurden jedoch vor dem Training normalisiert, weswegen dieser Grund ausgeschlossen werden kann.

### 3.4.3 Breast Cancer Auswertung

Für die Auswertung des *Breast Cancer* Datensatzes benutzen wir die Metriken der *binären Kreuzentropie* (in Abbildungen 7 als Loss benannt) und die Accuracy. Die binäre Kreuzentropie soll dabei möglichst klein sein, wogegen die Accuracy möglichst nah bei eins sein sollte, um ein besseres Ergebnis zu liefern.

	Loss $\Upsilon$	Accuracy $\Upsilon$
adam	0.12	0.96
sgd	17.2	0.5
adagrad	22.06	0.5

Abbildung 7: Breast Cancer Auswertung

Hier sehen wir ebenfalls, dass *ADAM* die besten Ergebnisse zeigt. Die beiden anderen Optimierungsalgorithmen zeigen deutlich stärkere Fluktuationen auf. Interessant ist hier, dass der *Stochastic Gradient Descent* besser performt als *Adagrad*. Dies liegt wahrscheinlich an der wie in Abschnitt 2.3.2 besprochenen Summierung der Gradienten, welche *Adagrad* irgendwann stoppen lässt ein Minimum zu suchen.

### 3.4.4 Vergleich mit der Literatur

In der Literatur ist ebenfalls oft die Rede von *ADAM* als go-to Optimierungsalgorithmus, da er sehr robust ist und man kein Parametertuning benötigt um gut Ergebnisse zu bekommen. *Adagrad* hat offensichtlich Probleme mit Konvergenz, wie wir ebenfalls nachweisen konnte und ist daher nur in seltenen Fällen benutzbar, da die adaptive Anpassung der Parameter ebenfalls von *ADAM* besser durchgeführt wird. Jedoch scheint der *Stochastic Gradient Descent* ebenfalls sehr wirkungsvoll zu sein. Das Problem ist jedoch, dass der *Stochastic Gradient Descent* eine gute Lernrate braucht, die nicht offensichtlich ist, wie wir in der Auswertung gesehen haben. Außerdem braucht man eine gute Initialisierung und der Algorithmus braucht deutlich länger. [Rud, Abschnitt 4.10]

## 4 Fazit

Zusammengefasst kommt die Literatur auf ein ähnliches Ergebnis, wie die Auswertung der zwei Datensätze. Der *ADAM* Optimierungsalgorithmus ist ein robuster und einfach zu benutzender Algorithmus, der für die meisten neuronalen Netze gute Ergebnisse

liefert. Das macht ihn am besten für eine Erstausswertung, wie wir sie hier auch hatten. Wenn die Struktur der Daten nicht bekannt ist und man schnelle Ergebnisse braucht sollte man den *ADAM* Algorithmus wählen. Jedoch kann es in besonderen Fällen von Vorteil sein einen anderen Algorithmus wählen, wie den *Stochastic Gradient Descent*. Jedoch ist das sehr datenabhängig.

## Literaturverzeichnis

- [Bur97] BURKHARD LENZE: *Einführung in die Mathematik neuronaler Netze*. Berlin : Logos Verlag, 1997
- [C<sup>+</sup>15] CHOLLET, François u. a.: *Keras*. <https://keras.io>, 2015
- [Die15] DIEDERIK P. KINGMA AND JIMMY LEI BA: *Adam: a Method for Stochastic Optimization*. 2015
- [FHK<sup>+</sup>16] FAHRMEIR, Ludwig ; HEUMANN, Christian ; KÜNSTLER, Rita ; PI-GEOT, Iris ; TUTZ, Gerhard: *Statistik: Der Weg zur Datenanalyse*. 8., überarbeitete und ergänzte Auflage. Berlin and Heidelberg : Springer Spektrum, 2016 (Springer-Lehrbuch). <http://dx.doi.org/10.1007/978-3-662-50372-0>. <http://dx.doi.org/10.1007/978-3-662-50372-0>. – ISBN 9783662503713
- [GBC16] GOODFELLOW, Ian ; BENGIO, Yoshua ; COURVILLE, Aaron: *Deep learning*. Cambridge, Massachusetts and London, England : MIT Press, 2016 <http://www.deeplearningbook.org/>. – ISBN 9780262035613
- [Kön02] KÖNIGSBERGER: *Analysis 2*. Springer Berlin Heidelberg, 2002. – ISBN 3540435808
- [McK10] MCKINNEY, Wes: Data Structures for Statistical Computing in Python. In: WALT, Stéfan van d. (Hrsg.) ; MILLMAN, Jarrod (Hrsg.): *Proceedings of the 9th Python in Science Conference*, 2010, S. 51 – 56
- [Mic] MICHAEL NIELSEN: *Neural Networks and Deep Learning*. <http://neuralnetworksanddeeplearning.com/index.html>
- [Oli ] OLIPHANT, Travis: *NumPy: A guide to NumPy*. USA: Trelgol Publishing. <http://www.numpy.org/>. Version: 2006–. – [Online; accessed <today>]
- [PVG<sup>+</sup>11] PEDREGOSA, F. ; VAROQUAUX, G. ; GRAMFORT, A. ; MICHEL, V. ; THIRION, B. ; GRISEL, O. ; BLONDEL, M. ; PRETTENHOFER, P. ; WEISS, R. ; DUBOURG, V. ; VANDERPLAS, J. ; PASSOS, A. ; COURNAPEAU, D. ; BRUCHER, M. ; PERROT, M. ; DUCHESNAY, E.: Scikit-learn: Machine Learning in Python. In: *Journal of Machine Learning Research* 12 (2011), S. 2825–2830
- [RK04] RUBINSTEIN, Reuven Y. ; KROESE, Dirk P.: *The cross-entropy method: A unified approach to combinatorial optimization, Monte-Carlo Simulation and machine learning*. New York, NY : Springer, 2004 (Information science and statistics). – ISBN 9780387212401
- [Rud] RUDER, Sebastian: *An overview of gradient descent optimization algorithms*. <http://arxiv.org/pdf/1609.04747v2>

## **Eidesstattliche Erklärung**

### Eidesstattliche Erklärung zur Seminararbeit

Ich versichere, die von mir vorgelegte Arbeit selbstständig verfasst zu haben. Alle Stellen, die wörtlich oder sinngemäß aus veröffentlichten oder nicht veröffentlichten Arbeiten anderer entnommen sind, habe ich als entnommen kenntlich gemacht. Sämtliche Quellen und Hilfsmittel, die ich für die Arbeit benutzt habe, sind angegeben. Die Arbeit hat mit gleichem Inhalt bzw. in wesentlichen Teilen noch keiner anderen Prüfungsbehörde vorgelegen.

*Unterschrift :*

*Ort, Datum :*