

Technische Hochschule Rosenheim

Fakultät für Informatik

Seminararbeit

im Masterstudiengang Informatik - Schwerpunkt Software Engineering

Thema:	Optimierungsmethoden des Gradienten Abstiegverfahrens bei neuronalen Netzen
Autor:	Victor Wolf victorwolf@outlook.de MatNr. 845615
Version vom:	12. Dezember 2019
Betreuer:	Prof. Dr. Holaubek

Zusammenfassung

Diese Arbeit wird sich mit verschiedenen Optimierungsmethoden neuronaler Netze beschäftigen und Sie auf Basis von Beispiel Datensätzen evaluieren, wie dem Boston House Price Datensatz. Hierbei wird eine Metrik definiert um die Ergebnis der einzelnen Optimierungsmethode zu vergleichen.

Eine Optimierungsmethode 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 abstieg, einnehmen, da dies die Grundlage des Lernens darstellt. Dieser sucht im mehrdimensionalen Raum die Minima der nichtlinearen Fehlerfunktion und es gibt verschiedene Möglichkeiten diese Suche zu verbessern. Nach der theoretischen Aufarbeitung, werden wir ein paar Eigenschaften über diese Optimierungsmethoden annehmen und diese anhand der Test Daten überprüfen.

Abstract

This work will focus on explaining the different optimization methods of neural networks and evaluating them on example datasets like the boston house price data. 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 and there are multiple ways to improve its search. After the Theory, we will assume some properties about those optimization methods and test those assumptions by evaluating the metrics of these neural networks.

Inhaltsverzeichnis

1	Einleitung	4
2	Theoretische Grundlagen	4
2.1	Neuronale Netze	4
2.2	Gradient Descent	6
2.3	Optimierungsmethoden	7
2.3.1	Stochastic Gradient Descent	7
2.3.2	Adagrad	8
2.3.3	Adam	8
3	Evaluation	9
4	Fazit	9
	Literaturverzeichnis	10
	Eidesstattliche Erklärung	11

1 Einleitung

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.

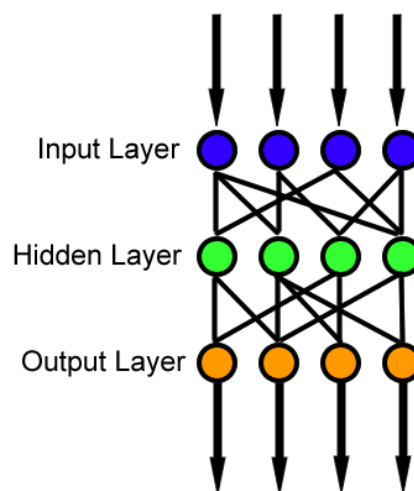


Abbildung 1: Beispiel eines Feed Forward KNNs

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.

Im Folgenden soll nun der Begriff des Neurons formalisiert werden, um die Verbesserungsmöglichkeiten des Gradienten Verfahrens 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. Beispiele 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 μ 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** ∇ 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.

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 η 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 Optimierungsmethoden 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 η 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. [Fra]

2.3.2 Adagrad

Der Adagrad Algorithmus erweitert den Stochastic Gradient Descent noch weiter. Bisher wurde die Lern Geschwindigkeit η 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 θ , bezeichnet als θ_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 $G_t \in R^{d \times d}$ ist eine diagonal Matrix, wobei die Diagonalelemente i,i , die Summe der Quadrate der Gradienten zum zugehörigen Parameter θ_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]

3 Evaluation

4 Fazit

Literaturverzeichnis

- [Bur97] BURKHARD LENZE: *Einführung in die Mathematik neuronaler Netze*. Berlin : Logos Verlag, 1997
- [Die15] DIEDERIK P. KINGMA AND JIMMY LEI BA: *Adam: a Method for Stochastic Optimization*. 2015
- [Fra] FRANÇOIS CHOLLET: *Keras Documentation*. <https://keras.io/>
- [Kön02] KÖNIGSBERGER: *Analysis 2*. Springer Berlin Heidelberg, 2002. – ISBN 3540435808
- [Mic] MICHAEL NIELSEN: *Neural Networks and Deep Learning*. <http://neuralnetworksanddeeplearning.com/index.html>
- [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 :