

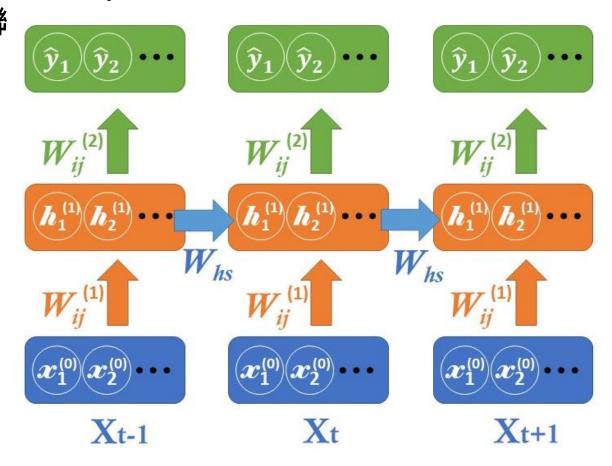
主題六: 遞迴神經網路(RNN)



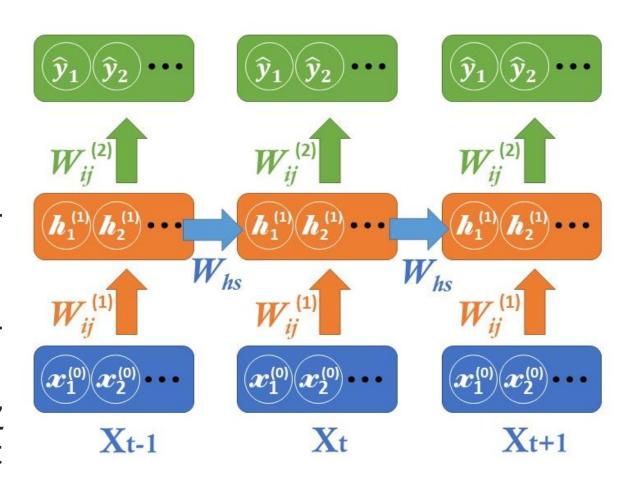
遞迴神經網路RNN

- 遞迴神經網路(Recurrent Neural Network, RNN)

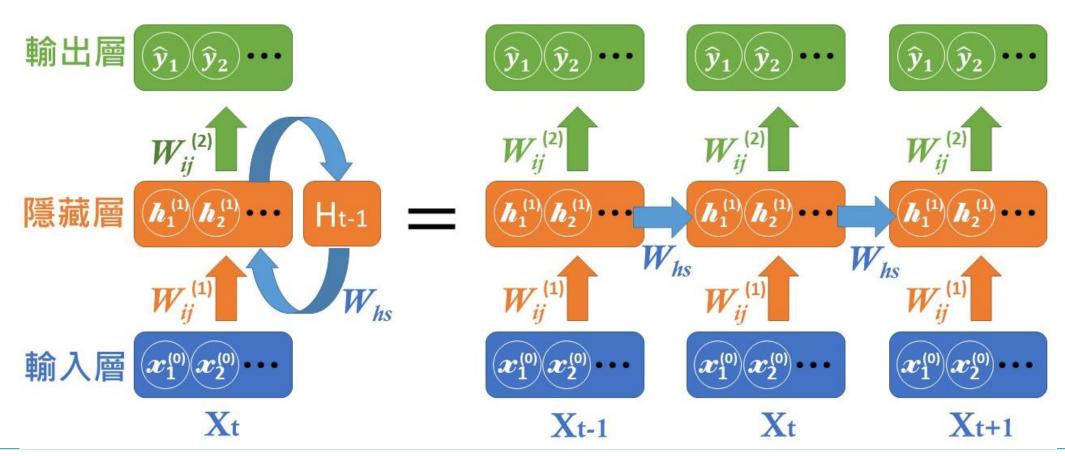
 - 輸入資料間的序列關聯性不一定是時間關係,空間關係也是可以的。
 例:圖片的像素資料也可以將其由上而下,每一列都是一筆輸入資料,他們是有序列關聯性的。



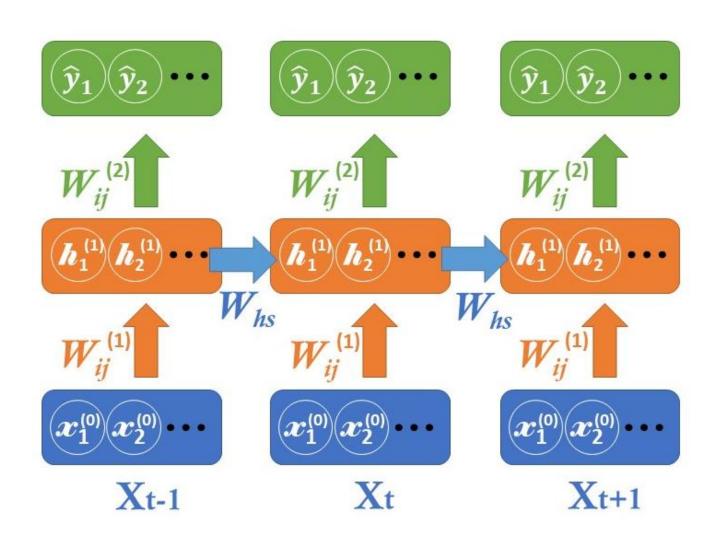
- RNN和前面所介紹的神經網路最大的差異 就是引進了具有記憶功能的「隱藏層狀態 (Hidden State) _
 - RNN記憶的狀態通常是上一個序列樣 本的隱藏層輸出資料H矩陣。
 - RNN神經網路在計算輸出時不是只有 計算當下輸入的樣本資料,而是會把前 一個序列樣本的「隱藏層狀態(Hidden State)」也當作輸入來計算。
 - 這個記憶功能,可以影響到下一個、下 兩個、、、或是下n個State,讓不同的 State之間產生關聯性,幫忙RNN記憶之 前看過樣本的訊息,並結合當前的樣本 訊息得到輸出。



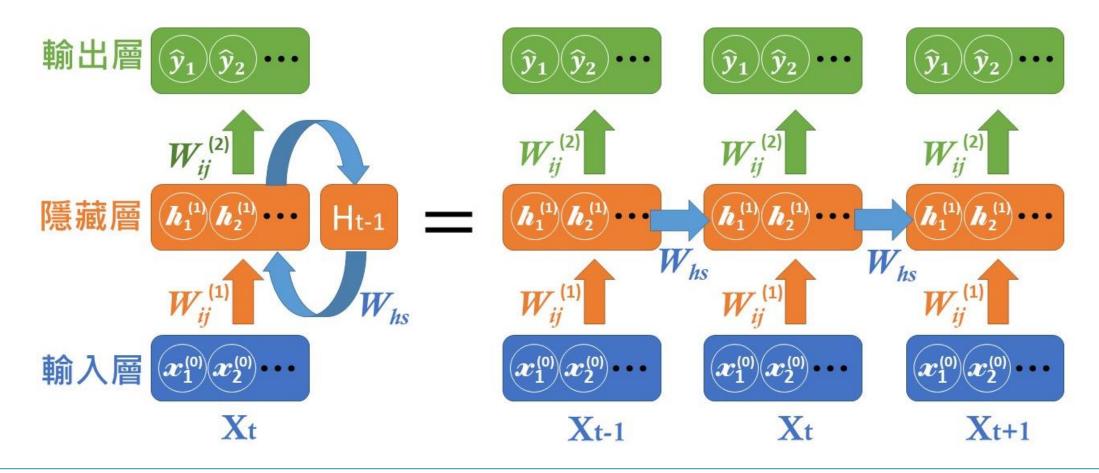
■ RNN的模型:左邊是簡化版,右邊是詳細版,從圖可以看到每一個時間點的輸出都會受到前一次State的影響(記憶)。



- RNN每個序列點都會有3個權重, 且不同序列的權重都是相同的, 即權重共享:
 - 輸入層到隱藏層的權重 $w_{ii}^{(1)}$
 - 隱藏層到輸出層的權重 $w_{ii}^{(2)}$
 - 當前序列隱藏層H₊到下一個序 列隱藏層 H_{t+1} 的權重 w_{hs}

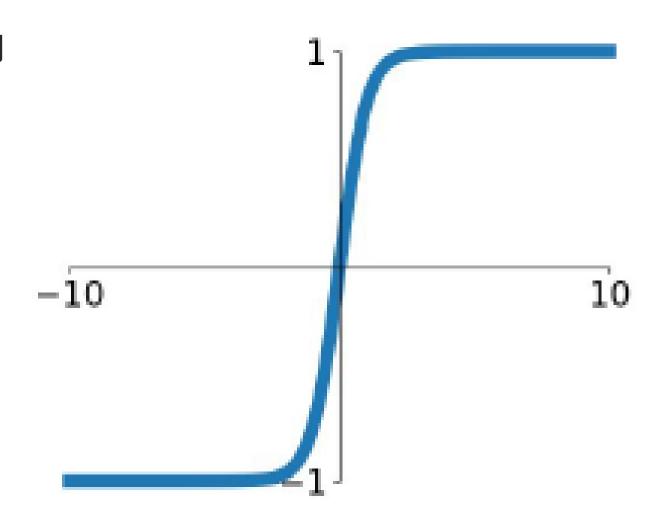


- 時序長短可變:可以處理任意長度的時間序列。
- 上圖中的RNN架構是一個最簡化的架構,較複雜的可以使用深度學習神經網路, 也就是三層以上的隱藏層。



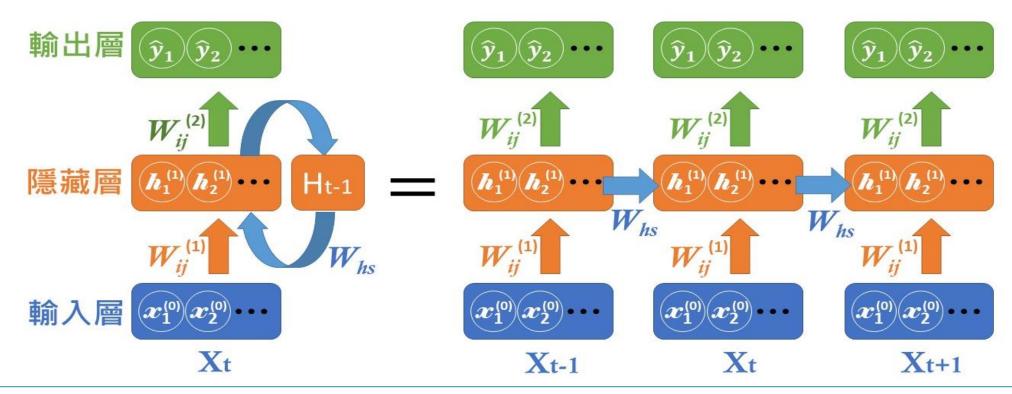
遞迴神經網路的前向傳播

- 遞迴神經網隱藏層的激活函數通常使用 tanh °
 - $tanh(x) = \frac{1-e^{-2x}}{1+e^{-2x}}$ · 函數圖如右圖。
 其微分為 $\frac{df}{dx} = 1 f(x)^2$



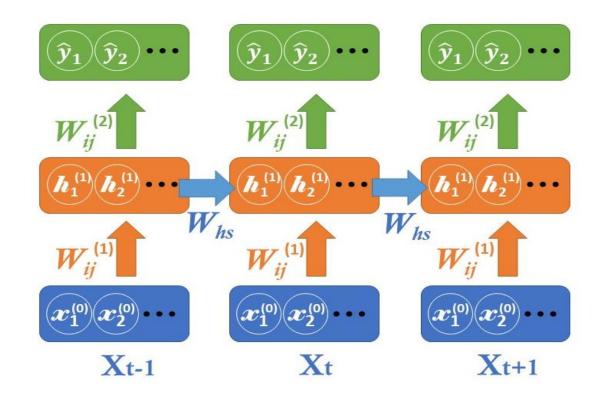
遞迴神經網路的前向傳播

- 第t時序的隱藏層輸出H_t,除了當下時序的輸入X_t外,還必須考慮前一時序的隱藏層狀態H_{t-1}。
 - H_t=tanh([輸入X_t]×[權重W⁽¹⁾]+ [狀態H_{t-1}]×[權重W_{hs}]+[偏值B⁽¹⁾])
 - H_0 初始化為全為零的矩陣,故 H_1 =tanh([輸入 X_0]×[權重 $W^{(1)}$] +[偏值 $B^{(1)}$])



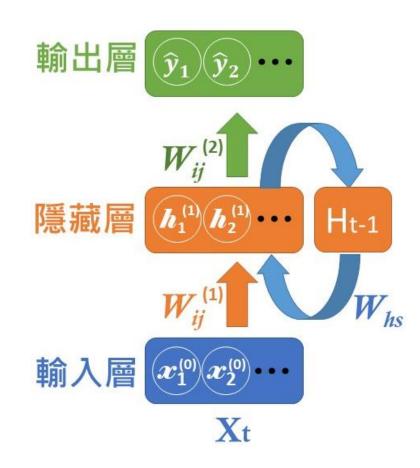
遞迴神經網路的前向傳播

- 假設最後的時序為t = n,其隱藏層到輸出層:
 - 輸入 $[Z_i^{(2)}]$ =[隱藏層輸出 H_n]× $[權重W^{(2)}]$ + $[偏值B^{(2)}]$
 - 輸出根據用途(迴歸、二元分類、多元分類)



遞迴神經網路的反向傳播

- 遞迴神經網路(RNN)的記憶時序反向傳播BPTT全名為 back-propagation through time
- 要考慮由最後時序t=n ⇒t=n-1 ⇒t=n-2、、 ⇒t=1⇒ t=0,2的時間序列反向傳播。
 - ullet 求出Loss值對隱藏層記憶狀態權重 W_{hs} 的梯度 $\frac{\partial L}{\partial W_{hs}}$
- 如同一般多層神經網路,每一時序中由輸出層⇒隱藏層 ⇒輸入層的反向傳播。
 - 求出Loss值對隱藏層權重 $W_{ij}^{(2)}$ 的梯度: $\frac{\partial L}{\partial W_{ij}^{(2)}}$
 - ullet 求出Loss值對輸入層權重 $W_{ij}^{(1)}$ 的梯度: $rac{\partial L}{\partial W_{ij}^{(1)}}$
- 由於各時序的 W_{hs} 、 $W_{ij}^{(2)}$ 、 $W_{ij}^{(1)}$ 權重共享,故各時序的梯度,取平均值作為更新的依據。

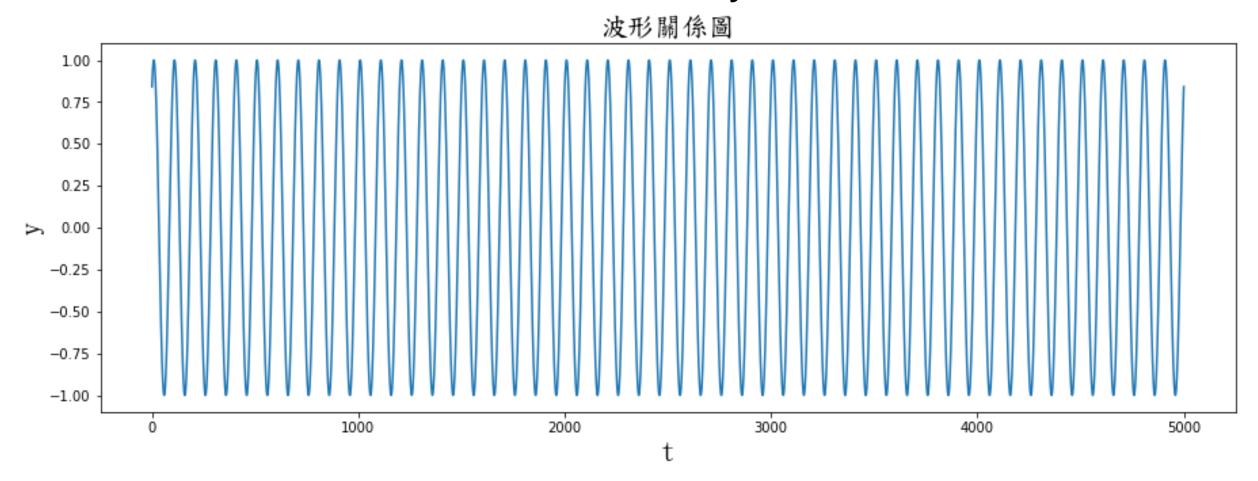


遞迴神經網路的兩大缺失

- 遞迴神經網路從理論上應該可以顧及所有過去時序的依賴,然而實際卻不理想,原因在於梯度消失(vanishinggradient)和梯度爆炸(exploding gradient)問題。
- RNN在做時序的反向傳播時,若時序非常長,從後面時序反向推回前面時序來求梯度時,因為連鎖規則,每一時序的梯度連續相乘非常多次。
 - □ 梯度消失:若時序的梯度有大量介於1和-1之間(即梯度絕對值<1),則推回前面的梯度非常小。
 - □ 梯度爆炸:若時序的梯度有大量大於1或小於-1(即梯度絕對值>1),則推回前面的梯度非常大。
- 梯度爆炸可以用梯度剪裁的方法來避免,將梯度大於1或小於-1的,剪裁為1或-1。
- 梯度消失就無法用剪裁的方法來處理。

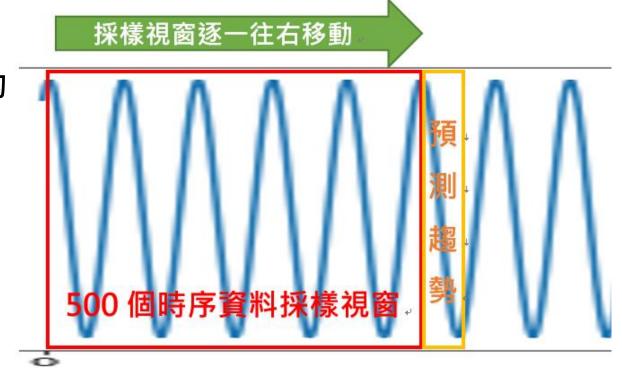
利用RNN預測正弦波動的變化趨勢

■如下圖為一個正弦波動的圖,由5001個點的數據y所組成。



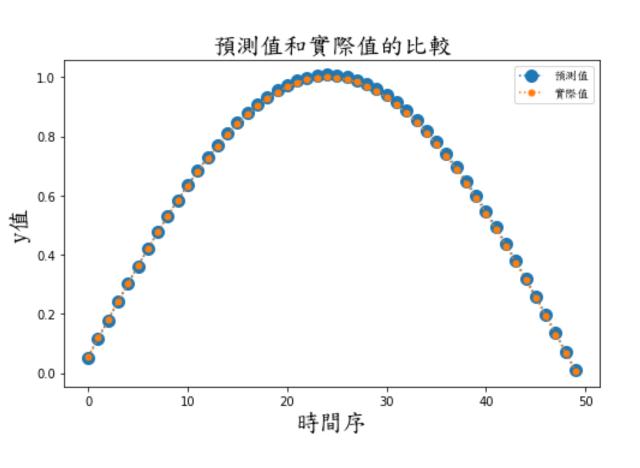
利用RNN預測正弦波動的變化趨勢

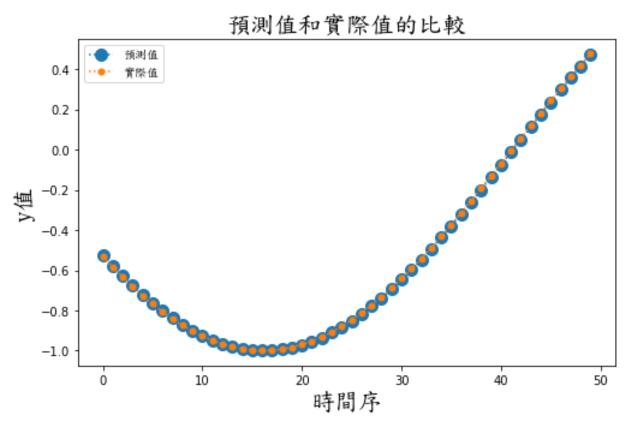
- 如右圖,將數據每500個點(稱為採樣視窗) 切成一個時序輸入特徵,緊接後面50點數 據為預測值,總共可以產生(5001-550)筆的 訓練資料。
- 搭建一個RNN神經網路,輸入訓練資料來學習波動趨勢: 每個樣本有500個時序 輸入層有1個節點 隱藏層有64個節點 輸出層有50個節點



利用RNN、GRU、LSTM預測波動的變化趨勢

■ 以動畫顯示連續100個時序資料經模型預測的50個輸出值和實際值間的差異,如右圖。

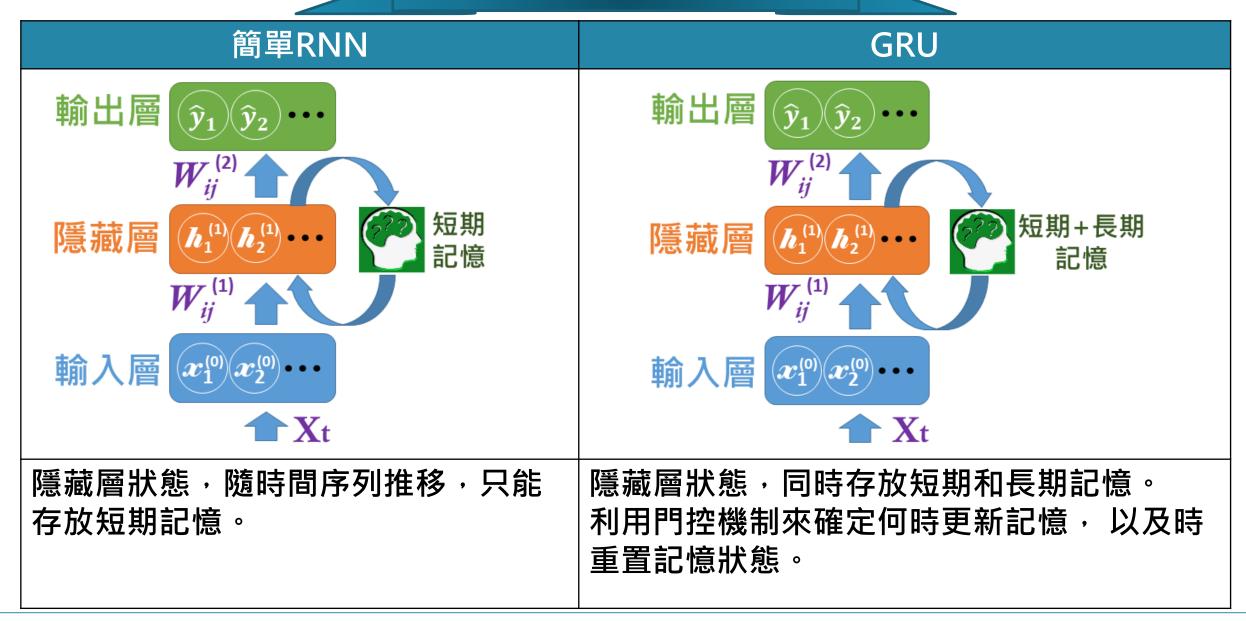




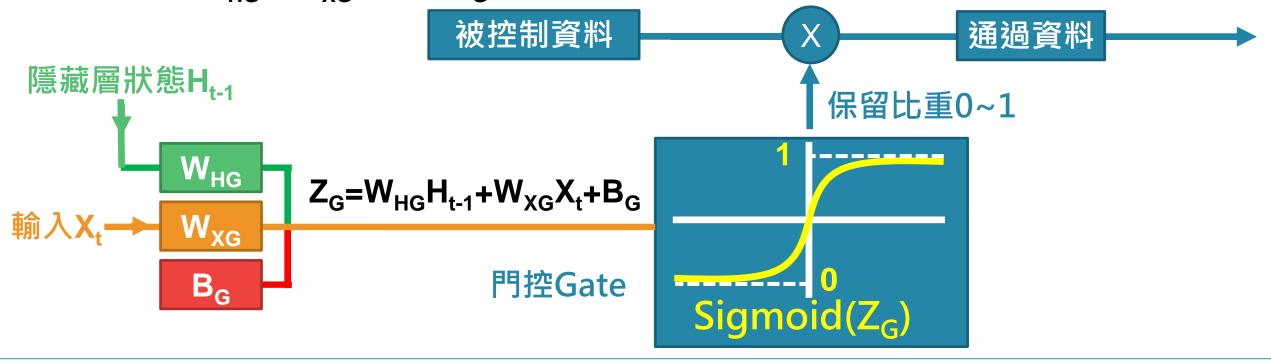


門控迴圈單元 (GRU)

GRU和簡單RNN的比較

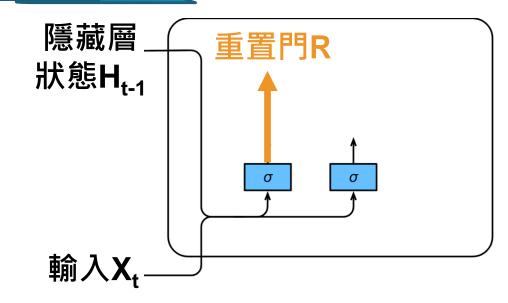


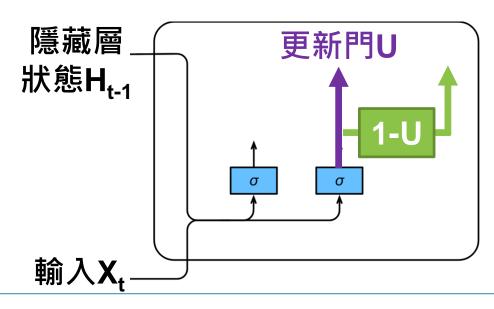
- 門控機制:參酌要考慮的記憶資料H_{t-1}和當前資料X_t來產生一個數值,再經過 sigmoid函數轉換數值為0~1之間,做為門控輸出。
- 將要控制的資料去乘以這個數值,藉以調整資料要保留(通過)的比重。
 - □若門控輸出為0,則要控制的資料會被清除。
 - □若門控輸出為1,則要控制的資料會被完全保留。
- 門控權重W_{HG}、W_{XG}和偏值B_G在訓練過程中透過優化法做調整。



GRU的門控(Gate)種類

- 重置門(Reset Gate):控制過去隱藏層狀態 H_{t-1} 要考慮多少比重用來計算隱藏層暫態 $\widehat{H_t}$,即舊記憶的影響程度。
 - $R = Sigmoid(W_{HR}H_{t-1} + W_{XR}X_t + B_R)$
- 更新門(Update Gate):控制過去隱藏層狀態H_{t-1} 要考慮多少比重用來計算新隱藏層H_t輸出,即舊記憶的保留程度。
 - $U=Sigmoid(W_{HU}H_{t-1}+W_{XU}X_t+B_U)$
- 更新門的剩餘值(1-U):用來控制隱藏層暫態Ĥ_t要考慮多少比重用來計算新隱藏層H_t輸出,即要記住多少新記憶。



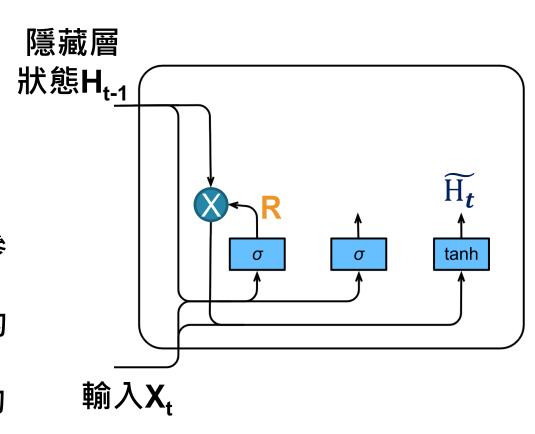


隱藏層的暫態Ĥ

■ 隱藏層暫態 \widetilde{H}_t ,同時考慮當下事件資料 X_t 及過去 隱藏層狀態 H_{t-1} 。

$$\widetilde{H}_t = \tanh(X_t W_{XH} + (R \otimes H_{t-1}) W_{HH} + B_H)$$

- 過去隱藏層狀態H_{t-1}經過重置門R控制多少比重參 與。
 - 口若R=1:完整保留記憶狀態,即為簡單RNN的 運作方式。
 - 口若R=0:記憶狀態完全歸零,即為一般MLP的 運作方式。

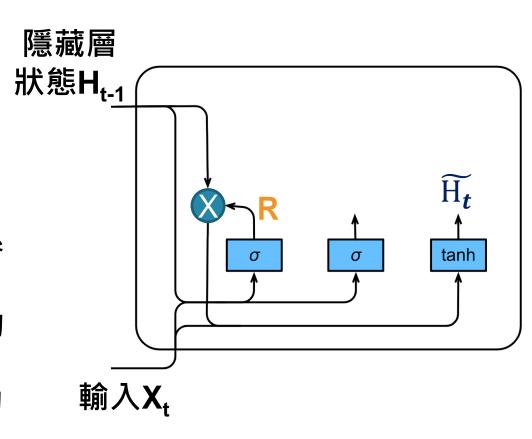


隱藏層的暫態Ĥ

■ 隱藏層暫態 \widetilde{H}_t ,同時考慮當下事件資料 X_t 及過去 隱藏層狀態 H_{t-1} 。

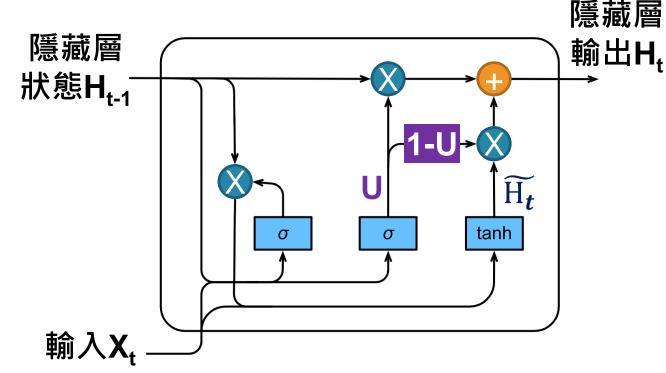
$$\widetilde{H}_t = \tanh(X_t W_{XH} + (R \otimes H_{t-1}) W_{HH} + B_H)$$

- 過去隱藏層狀態H_{t-1}經過重置門R控制多少比重參 與。
 - 口若R=1:完整保留記憶狀態,即為簡單RNN的 運作方式。
 - 口若R=0:記憶狀態完全歸零,即為一般MLP的 運作方式。



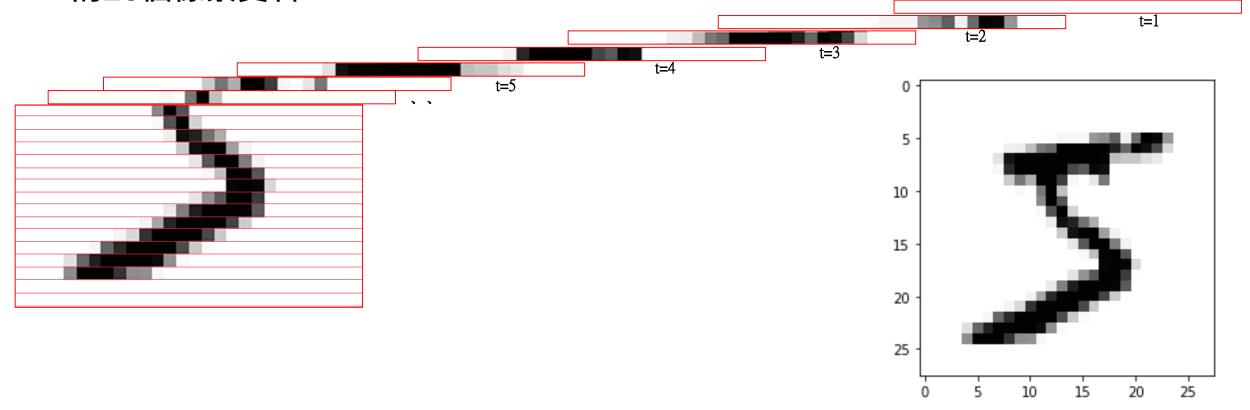
隱藏層的輸出狀態H

- 隱藏層輸出狀態 H_t · 同時考慮隱藏層 暫態 \widetilde{H}_t 及過去隱藏層狀態 H_{t-1} 。 $H_t = U \otimes H_{t-1} + (1-U) \otimes \widetilde{H}_t$
- 過去隱藏層狀態H_{t-1}經過更新門U控制 多少比重參與;隱藏層暫態 H_t經過1-U控制多少比重參與。
 - 口若U=1:只保留記憶狀態,忽略當下的事件訊息X,,不會加入記憶中。
 - 口若U=0:將記憶狀態完全清除,用目前的隱藏層暫態取代。

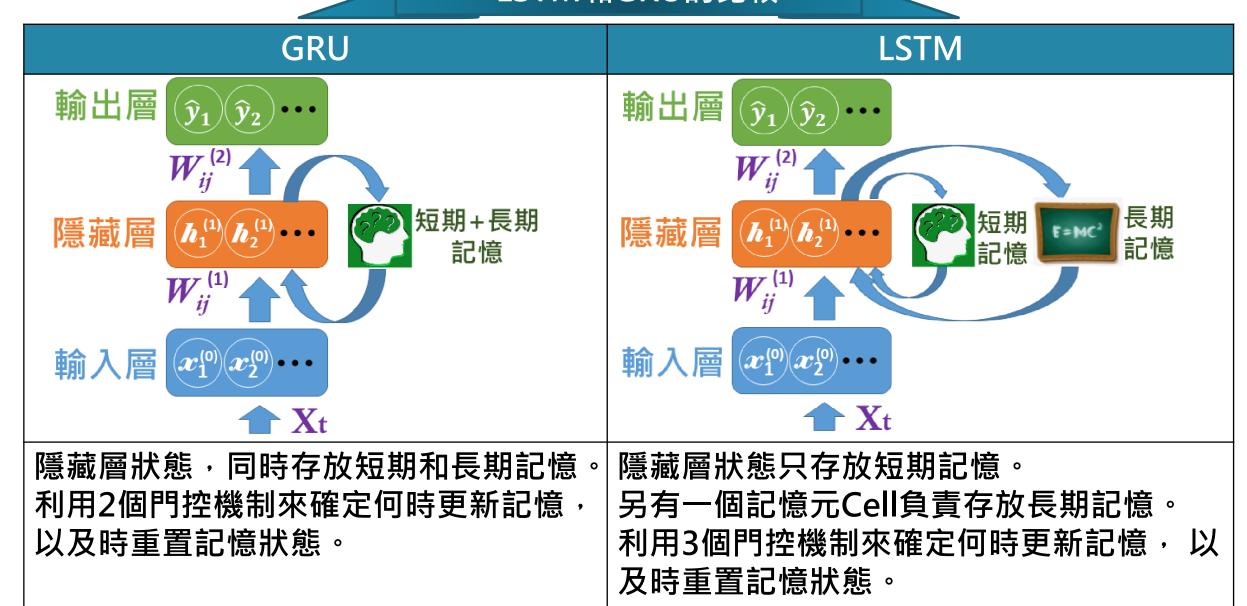


利用GRU訓練Mnist手寫數字辨識的模型

- 圖片可視為有空間序列關係的資料,故亦可以透過RNN來訓練模型,來做圖片的辨識。
- 如下圖將Mnist圖片,由上而下切成t=1~t=28個序列資料,每一個序列為一整列的28個像素資料。

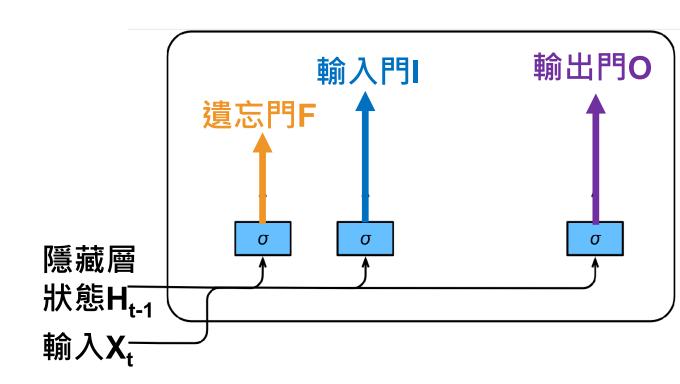






LSTM的門控(Gate)種類

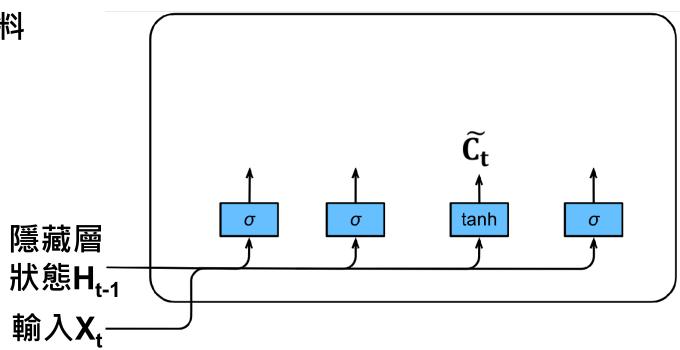
- 遺忘門(Forget Gate):用來重置記憶單元的內容,控制記憶單元C_{t-1}要保留多少比重。 F=Sigmoid(H_{t-1}W_{HF}+X_tW_{XF}+B_F)
- 輸入門(Input Gate):用來控制記憶單元暫態 \tilde{C}_t 要考慮多少比重用來計算新記憶單元 \mathbf{C}_t ,即要加入多少新記憶。 $\mathsf{I=Sigmoid}(\mathbf{H}_{t-1}\mathbf{W}_{\mathsf{HI}}+\mathbf{X}_t\mathbf{W}_{\mathsf{XI}}+\mathbf{B}_{\mathsf{I}})$
- ■輸出門(Output Gate):用來決定將 資料輸出到隱藏層狀態H_t的比重。 O=Sigmoid(H_{t-1}W_{HO}+X_tW_{XO}+B_O)



記憶單元暫態 \widetilde{C}_t

■ 記憶單元暫態 \tilde{C}_t ,同時考慮當下事件資料 X_t 及過去隱藏層狀態 H_{t-1} 。

$$\widetilde{C_t} = \tanh(X_tW_{XC} + H_{t-1}W_{HC} + B_C)$$

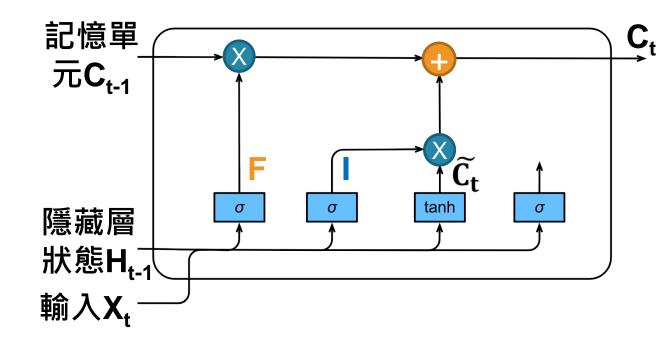


記憶單元輸出狀態C

■ 記憶單元的輸出狀態 \mathbf{C}_{t} · 同時考慮記憶單元暫態 \widetilde{C}_{t} 及過去過去記憶單元 \mathbf{C}_{t-1} 的保留狀態。

$$C_t = F \otimes C_{t-1} + I \otimes \widetilde{C_t}$$

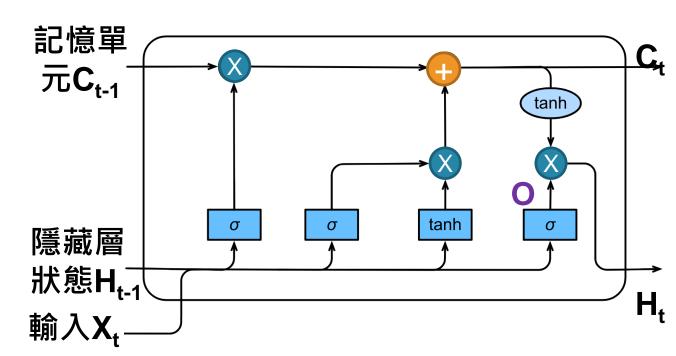
- 過去記憶單元 C_{t-1} 經過遺忘門F控制多少比重參與;記憶單元暫態 C_t 經過輸入門控制多少比重參與。
 - 口若F=1、I=0:只保留記憶狀態,忽略當下的事件訊息X_t,不會加入記憶中。
 - 口若F=0、I=1:將記憶狀態完全清除,用目前的記憶單元暫態取代。



■ 記憶單元的輸出狀態 \mathbf{C}_{t} · 同時考慮記憶單元暫態 \widetilde{C}_{t} 及過去過去記憶單元 \mathbf{C}_{t-1} 的保留狀態。

$$C_t = F \otimes C_{t-1} + I \otimes \widetilde{C_t}$$

- 過去記憶單元 C_{t-1} 經過遺忘門F控制多少比重參與;記憶單元暫態 C_t 經過輸入門控制多少比重參與。
 - 口若F=1、I=0:只保留記憶狀態,忽略當下的事件訊息X_t,不會加入記憶中。
 - 口若F=0、I=1:將記憶狀態完全清除,用目前的記憶單元暫態取代。



利用LSTM訓練股價的預測趨勢

■ 在資料集\股價資料目錄內,有各公司自2009年起10年內的股價資料:

欄位1:交易日期

欄位2:交易量

欄位3:開盤價

欄位4:收盤價

欄位5:盤中最高價

欄位6:盤中最低價

欄位7:還原權值股價

	А	В	С	D	E	F	G
1	date	volume	open	close	high	low	adjclose
2	2009/1/2	20238000	16.01	16.99	17.04	15.75	14.50893
3	2009/1/5	25421400	16.8	17.62	18.36	16.78	15.04693
4	2009/1/6	38858500	18.07	19.58	19.93	18	16.72071
5	2009/1/7	30848100	19.07	18.1	19.38	17.76	15.45684
6	2009/1/8	21116300	17.9	18.82	18.98	17.65	16.0717
7	2009/1/9	35802100	18.97	19.06	19.98	18.69	16.27665
8	2009/1/12	49187500	20.08	18.79	20.95	18.07	16.04608
9	2009/1/13	31384000	18.27	18.86	19.58	17.86	16.10585
10	2009/1/14	39491900	18.25	17.19	18.46	16.96	14.67973

- 請取前面2000筆交易資料作為訓練資料,其後做為測試資料。
- 搭建一個LSTM神經網路:

時序為20天

輸入層的節點為6個,即欄位2~7為特徵資料

隱藏層有512個節點

輸出層有1個節點,即預測第21的受盤價

■ 以測試資料集測試訓練完成的模型,其準確度。



自然語言與其特性

- 何謂自然語言:自然演化而成的語言,基本上人類所使用的語言都算是自然語言 (中文,英文,韓文,法文,手語等)。
- 自然語言的特性:
 - □人類的語言具高度曖昧性,一句話可能有多重的意思或隱喻。
 - □ 一段文字中不同的停頓點,停頓點不同,對文字的理解也不同。
 - □ 人們不斷創造新詞,語言學家越來越難建立規則(文法及語意學)來規範語文。

努力才能成功 — 努力 才 能 成功

他的領導才能很突出 — 他的領導 才能很突出

自然語言處理NLP

■ 自然語言的處理 (NLP Natural Language Processing):專注在如何讓計算機處理並分析大量(人類的)自然語言數據。

■ NLP 常見的研究主題:

- □語音辨識
- □自然語言理解
- □機器翻譯
- □自然語言的生成

發展自然語言處理的兩個方向

■ 人類對一段語音或文字的理解流程:

單字 (word)

片語 (Phrase) 句子 (Sentence) 文法 (Syntax) 語意 (Semantics)

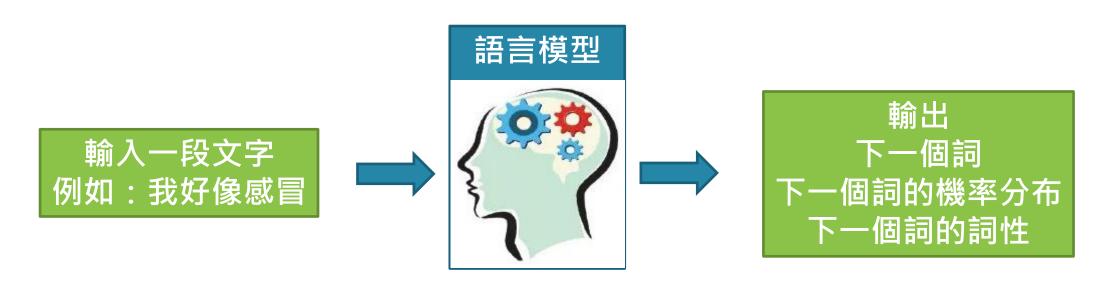
規則基準 (Rule-based Method)

遵循上面的流程來了解文字或語音的意義除了必須為每個階段建立龐大的資料庫,各階段間的交互規則更是複雜,可能是天文數字。

機器學習 (Machine Learning)

設計神經網路,改為提供大量字句當作輸入,讓機器自我學習,產生適當的回應

機器學習的語言模型



語言模型的分類:

- 統計語言模型:統計的方法去解決語言模型的問題(條件概率)。
- 神經網路語言模型:用神經網路的方法去解決語言模型的問題。

統計語言模型簡介

■ 訓練過程:從大量的文本資料中去統計每一個單詞出現下個單詞的機率。

例如:P(天氣|今天)、P(氣溫|今天) 、P(新聞|今天)、、、

P(很好|天氣)、P(晴朗|天氣)、P(涼爽|天氣)、、、

■ 推測過程:依據句子出現單詞的順序,利用條件機率的鍊式法則,求出這個句子 的機率。

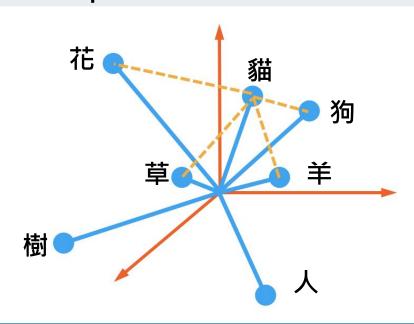
P(今天天氣晴朗,想去野餐)

- = P(天氣|今天)x P(晴朗|天氣) x P(想|晴朗) x P(去野餐|想)
- 如果句子很長,前面的條件機率很小,我們可以指定只計算前N 個單詞的條件機率,稱為N元語言模型(N-gram)。

語言表示的種類

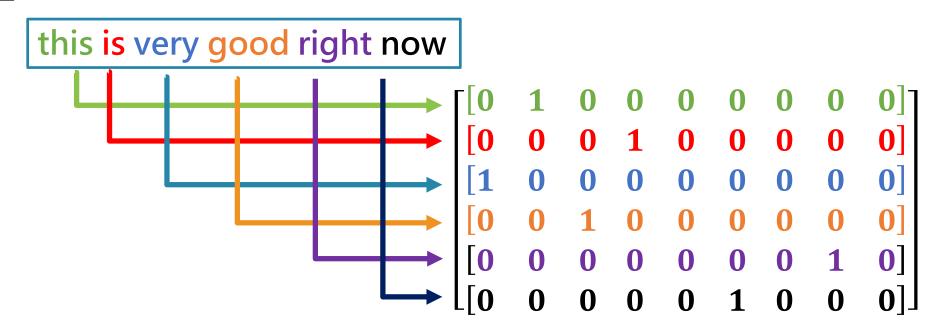
詞袋模型 BOW(Bag of Word)	詞向量模型(Word Embedding)		
將句子分詞後,裝進一個袋子裡,並給唯一的識別 編碼。	將每一個編碼後的詞語映射到高維度的向量當中。		
不考慮其詞法與語序,即每個詞語都是獨立的。	考慮詞語位置關係,通過求餘弦的方式,可以判斷 兩個詞語之間的關係。		
不須經過訓練	需經過神經網路模型的訓練		
常見的有one-hot、TF-IDF、Huffman編碼。	基於CBOW和Skip-Gram演算法的神經網路模型。		





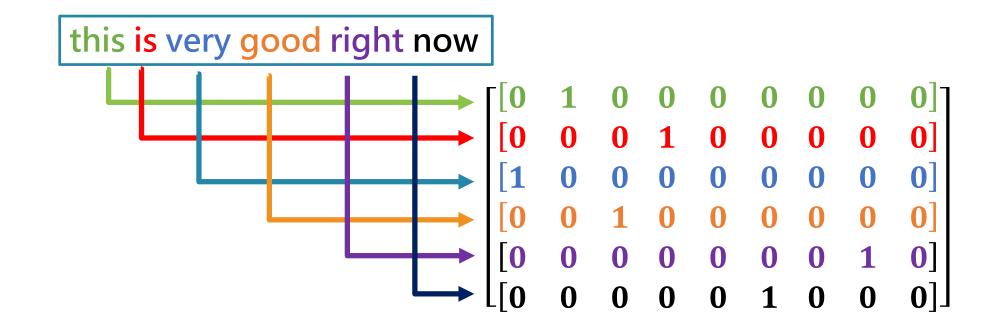
One-Hot 表示字、詞的步驟

- 將文本中的文字敘述(句子),取出所有的單字(單詞),建立一個沒有重複單字(單詞) 的詞庫。
- 資料庫中的單字可以用one hot encode來表示,即每個單字都是多維向量中的獨立 向量。
- 依序將句子中的單字化為one hot encode的向量,組成一個有序不定長度的序列,稱為句向量。



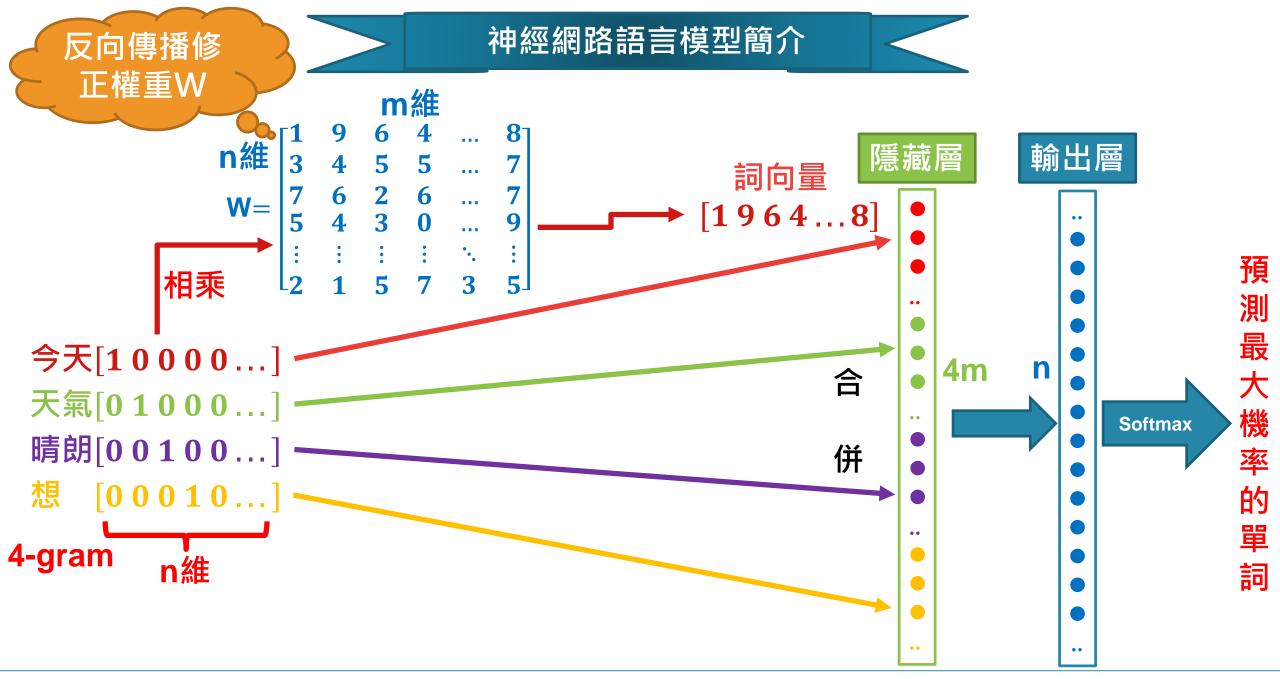
One Hot 表示字、詞的問題

- 維度爆炸問題:若詞庫內的單詞數量有10000個,One-Hot編碼的維度將達10000個維度。
- 稀疏矩陣:One-Hot編碼中,大量維度都是0、所含有效訊息很少,會很難訓練。
- 向量垂直:每一個單詞都只佔有一個維度,彼此間毫無相干,相互投影(餘弦相關度)都是零。





- Feeling.csv資料檔含有78筆描述心情的英文句子,並標示0(悲觀)、1(樂觀)二元分類。
- 請用one hot encode 將詞庫內的單字(詞)做編碼,組成句向量,取最長句子長度為時序,不足的以0補足長度。
- 搭建一個RNN神經網路: 時序為最長句子的長度 輸入層的節點由單字one hot encode的維度來決定 隱藏層有64個節點 輸出層有1個節點。
- 以測試資料集測試訓練完成的模型,其準確度。
- 自己輸入表達情緒樂觀和悲觀的語句,讓訓練好的模型做判斷,看看是否判斷正確。

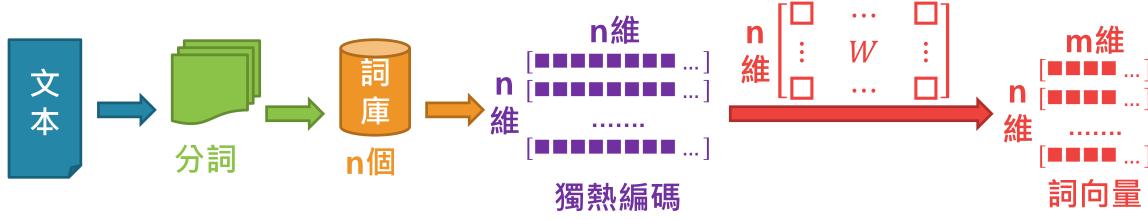




詞向量(Word Embedding)

m維

■ 詞向量可以看成是神經網路語言模型的重要副產品。

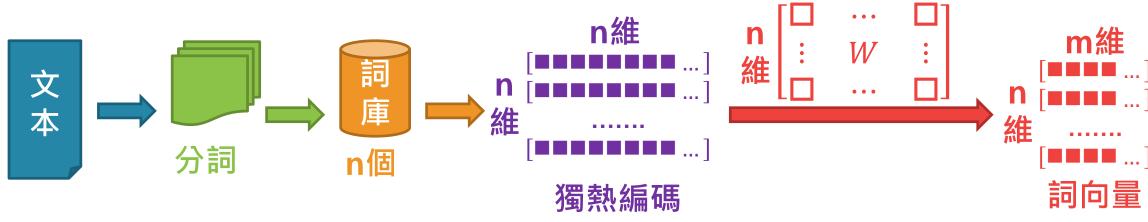


- 可以彈性調整神經網路語言模型W權重的行數(m維),來控制詞向量的維度。
- 詞向量的維度越高, 其所能提供的資訊也就越多, 計算結果的可靠性就更值得信賴。
- 詞性和語意相近的單詞,經過訓練後的詞向量相似度會比較高。
- Word2vector模型是由Google在2013年提出的,把字詞換成向量表達的一個預訓練模型。

詞向量(Word Embedding)

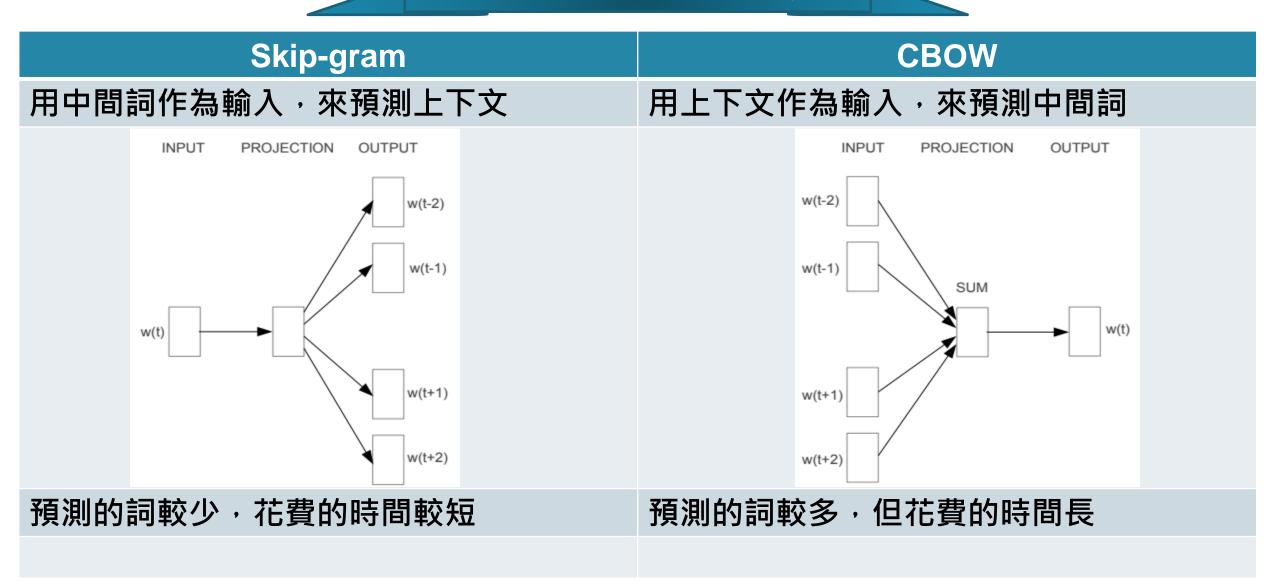
m維

■ 詞向量可以看成是神經網路語言模型的重要副產品。



- 可以彈性調整神經網路語言模型W權重的行數(m維),來控制詞向量的維度。
- 詞向量的維度越高, 其所能提供的資訊也就越多, 計算結果的可靠性就更值得信賴。
- 詞性和語意相近的單詞,經過訓練後的詞向量相似度會比較高。
- Word2vector模型是由Google在2013年提出的,把字詞換成向量表達的一個預訓練模型。

Word2vector兩種訓練模型



gensim

- gensim 是使用 google 釋出的 word2vec 模型的套件,可找到字的向量、相似字,計算向量之間的相似度。
- 語法: gensim.models.word2vec.Word2Vec(參數)
- 參數說明:
 - □ sentences:這是要訓練的句子集合
 - □ size:這是訓練出的詞向量會有幾維
 - □ alpha:機器學習中的學習率,這東西會逐漸收斂到 min_alpha
 - □ sg:sg=1表示採用skip-gram·sg=0表示採用cbow
 - □ window:能往左往右看幾個字的意思
 - □ workers:執行緒數目
 - □ min_count:若這個詞出現的次數小於min_count,那他就不會被視為訓練對象

神經網路處理自然語言的重點

- 如何把單字或詞轉換為變數,輸入神經網路。
- 字句有長有短,即input 變數數目不等,回應也是一樣的狀況,output 變數數目 也不等。
- 語文會有上下文的關係,斷章取義常會扭曲全文代表的意義。
- 文字前後間有很強的連結關係,故神經網路必須有記憶力機制,能參酌之前的判斷,預測準確率就會高很多。
- 『遞迴神經網路』演算法,它是『自然語言處理』領域最常使用的神經網路模型, 能額外考慮上下文的關係,準確率就會顯著提高。
 - 例:如果餐館的服務生要從顧客的聊天中,聽到她喜歡吃辣,就可以預測顧客晚 餐會點麻婆豆腐的機率比較高。