**PONTIFÍCIA UNIVERSIDADE CATÓLICA DE MINAS GERAIS  
NÚCLEO DE EDUCAÇÃO A DISTÂNCIA**

**Pós-graduação *Lato Sensu* em Ciência de Dados e Big Data**

**José Clovis von Zuben Filho**

**PREVISÃO DE RESERVAS HIDROGRÁFICAS PARA PRODUÇÃO**

**DE ENERGIA ELÉTRICA NO BRASIL**

**MODELOS ARIMA E LSTM**

Rio de Janeiro

2021**José Clovis von Zuben Filho**

**PREVISÃO DE RESERVAS HIDROGRÁFICAS PARA PRODUÇÃO**

**DE ENERGIA ELÉTRICA NO BRASIL**

**MODELOS ARIMA E LSTM**

Trabalho de Conclusão de Curso apresentado ao Curso de Especialização em Ciência de Dados e Big Data como requisito parcial à obtenção do título de especialista.

Rio de Janeiro

2021**SUMÁRIO**

[1. Introdução 4](#_Toc69991241)

[1.1. Contextualização 4](#_Toc69991242)

[1.2. O problema proposto 5](#_Toc69991243)

[2. Coleta de Dados 5](#_Toc69991244)

[3. Processamento/Tratamento de Dados 7](#_Toc69991245)

[4. Análise e Exploração dos Dados 9](#_Toc69991246)

[5. Criação de Modelos de Machine Learning 12](#_Toc69991247)

[5.1 Modelo ARIMA (*Autoregressive Integrated Moving Average*) 12](#_Toc69991253)

[5.2 Modelo LSTM 16](#_Toc69991254)

[6. Apresentação dos Resultados 16](#_Toc69991255)

[7. Links 17](#_Toc69991256)

[6 REFERÊNCIAS 18](#_Toc69991257)

[7 APÊNDICE 19](#_Toc69991258)

# Introdução

## Contextualização

Um dos maiores desafios da sociedade para obter uma melhor qualidade de vida, se dá pela previsibilidade de eventos futuros. Na história temos desde o pequeno agricultor em sua lavoura se arriscando com as intemperes do tempo e ataques de possíveis pragas, até os dias atuais em que a falta de chuva impede a geração de energia elétrica e provisiona-se termoelétricas como sistema de retaguarda.

Outrora os problemas em administrar negócios, eram resolvidos pela expertise de longa data de um profissional, que passou por diversas situações até amadurecer na previsão de seus atos. Assim os eventos futuros eram baseados em “feelings” e empirismo técnico e não por dados concretos.

Na década de 1970 houve a introdução de Sistemas Especialistas que simulavam o raciocínio de um profissional, codificando regras de inferência e incertezas, mas com o decorrer do tempo demonstrou-se ser altamente restrito na área de domínio do problema a ser resolvido. A evolução na aquisição de dados com os sistemas de base de dados de Big Data, viabilizaram uma categoria dos Sistemas Especialistas de Previsão, a partir dos dados históricos observados, assim nasce a Ciência de Dados.

Agora o profissional especialista não requer mais confiar no seu “feeling” para prever situações futuras, a Ciência de Dados com suas ferramentas e modelos assume este papel, deixando ao profissional o papel de controle de qualidade.

Este trabalho foca na previsão das reservas de água nos reservatórios brasileiros, analisando séries temporais, para que haja tempo de provisionar recursos antes do desabastecimento.

## O problema proposto

A energia elétrica é um dos bens mais utilizados em nossa vida cotidiana, sem ela hospitais, prédios e casas parariam, a vida foi moldada pela energia elétrica, e seu consumo cresce vertiginosamente, mesmo com diversas fontes de energia, a de usina hidroelétrica responde por aproximadamente 90% no Brasil, seu uso precisa ser muito bem controlado.

Os dados deste trabalho são da empresa ONS (Operador Nacional de Sistema Elétrico), que tem a função principal de controlar os níveis dos reservatórios de água em todo o Brasil, utilizando sensoriamento remoto e internet para disponibilizar os dados histórico.

O principal objetivo deste trabalho é de analisar as séries temporais (data, profundidade em metros) no período de 01/01/2003 até 01/02/2021 de três reservatórios da base de dados, são eles: Furnas, Sobradinho, Belo Monte.

Como o sensoriamento é remoto, sem o fator humano para introduzir erros, faz com que o aspecto de coleta geográfico seja facilmente contornado.

# Coleta de Dados

Os dados da ONS são obtidos direto no site da empresa, pelo link <http://www.ons.org.br>, mas também estão disponíveis não tão completos no link <http://dados.gov.br> . A extração dos dados é feita de forma manual, entrando no site da empresa, navegando até a seção “*Resultado da Operação🡪Histórico da Operação🡪Dados Hidrológicos/Níveis*”, nela temos como na figura 1 a opção “Download” que é a extração após preenchimento das informações: escala em dia, período de tempo, nome do reservatório. Nesta tela encontra-se a opção de extração “Crosstab” do gráfico temporal, que tem o formato de arquivo .CSV mais condizente com a leitura que será feita pela biblioteca Pandas do Python.

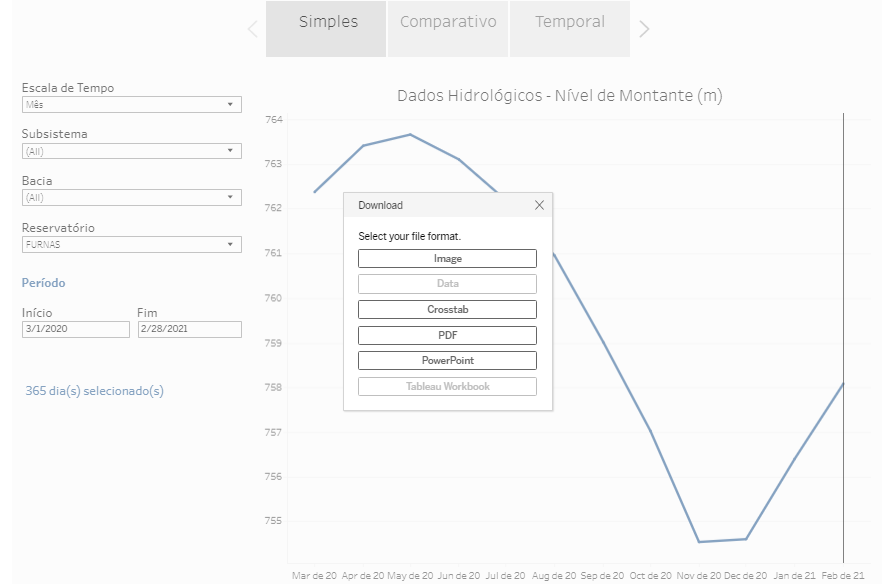


Figura - 1

O arquivo <nome do reservatório>.CSV, vem no formato Unicode padrão UTF-16, com os campos separados por TAB. Duas linhas de cabeçalho devem ser ignoradas na leitura, o valor da profundidade do reservatório vem com vírgula no padrão brasileiro bem como as datas. Para nosso trabalho somente a primeira coluna “data” e a última “profundidade” são necessárias, as demais informações são ignoradas. O arquivo gerado contém duas séries identificadas pela posição onde está a data, se a data estiver na primeira coluna são os valores da primeira série, se estiver na segunda coluna são os valores da segunda série.

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| Nome da coluna/campo | Descrição | Tipo |
| data1 | Data Série #1 | Datetime((DD/MM/AAAA) |
| data2 | Data Série #2 | Datetime((DD/MM/AAAA) |
| data\_inicio\_semana | Data do Início da Semana | Datetime((DD/MM/AAAA) |
| --- | Campo não usado | --- |
| --- | Campo não usado | --- |
| tipo\_extracao | Dia, Mês, Semana | String |
| Nome | Nome do reservatório | String |
| profundidade | Profundidade em metros | Float |

# Processamento/Tratamento de Dados

O processo de extração dos três reservatórios é idêntico, entretanto determinados reservatórios iniciaram suas atividades em anos diferentes, assim vale verificar o gráfico da Figura – 1, para descobrir a data inicial correta.

Uma extração no período de 18 anos, nos dá um volume de amostras entorno de 6.600 registros, mas o tamanho do arquivo não passa de umas centenas de KBytes.

Ao final do processo de extração manual teremos os seguintes datasets:

|  |  |
| --- | --- |
| Nome da coluna/campo | Descrição |
| Furnas.csv | Série com os níveis de profundidade do reservatório de Furnas para treinamento. |
| Sobradinho.csv | Série com os níveis de profundidade do reservatório de Sobradinho para treinamento. |
| BeloMonte.csv | Série com os níveis de profundidade do reservatório de Belo Monte para treinamento. |

Os datasets não tem qualquer campo incompleto ou informação que deva ser tratada/sanitarizada antes do treinamento, assim o comando da Figura - 2 é o suficiente para importação dos dados no Python.

Figura – 2

import pandas as pd

dataFrame = pd.read\_csv("furnas.csv", index\_col=0, header=2, delimiter='\t',

encoding='utf-16', usecols=[0,6,8],

names=['data','nome','profundidade'],

parse\_dates=['data'], dayfirst=True, decimal=',')

print (dataFrame)

Resultado:

data nome profundidade

2003-03-01 FURNAS 767.340000

2003-03-02 FURNAS 767.350000

2003-03-03 FURNAS 767.370000

... ...

2021-02-26 FURNAS 757.909973

2021-02-27 FURNAS 758.000000

2021-02-28 FURNAS 758.080017

[6575 rows x 2 columns]

# Análise e Exploração dos Dados

Para analisar as tendências das séries temporais, valeu-se do código em Python da Figura – 3 abaixo, para imprimir os gráficos dos três reservatórios.

Figura – 3

df.plot (color='r', title='Reservatório xxx', y=['profundidade'],

xlabel='Data', linewidth=1, kind='line')

plt.grid()

plt.show()

São eles:

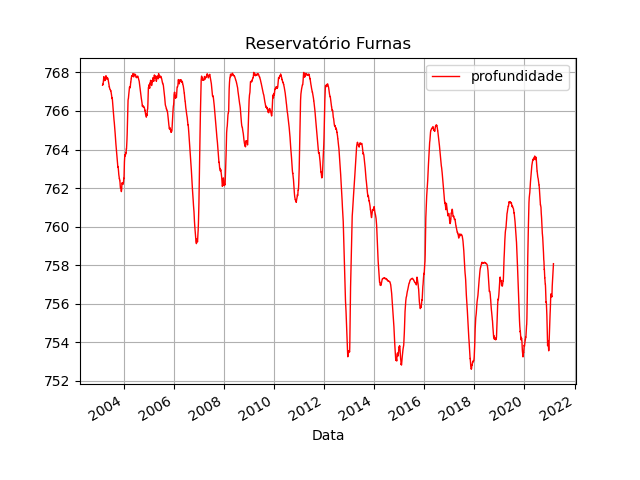
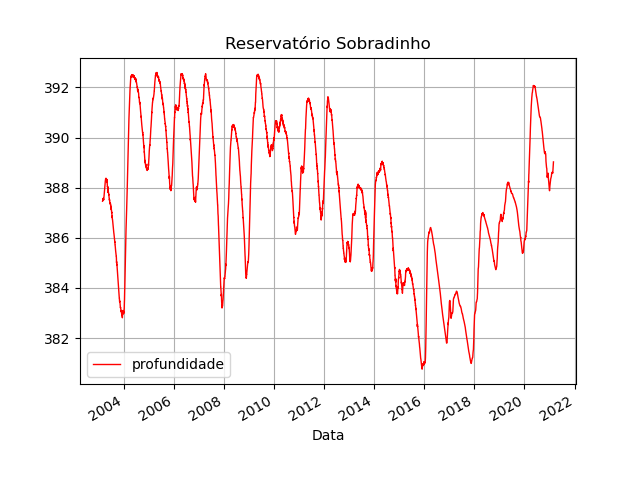


Figura – 4

Este gráfico demonstra o fator sazonalidade da série temporal, bem como uma tendência de queda permanente da profundidade aferida a partir do ano 2014, que leva a crer que houve algum fato histórico que justifique a perda de aproximadamente quatro metros no total do reservatório; desta forma o comportamento dos métodos preditivos deve modelar esta queda.

Figura – 5



Este gráfico demonstra o fator sazonalidade da série temporal, com variações bem acintosas de mais de 10 metros de profundidade no período entre 2013 até 2020, entretanto volta-se lentamente aos valores dos anos de 2004. A seca neste período e a volta a normalidade, demonstra que a região do reservatório de Sobradinho não é resiliente as mudanças climáticas.

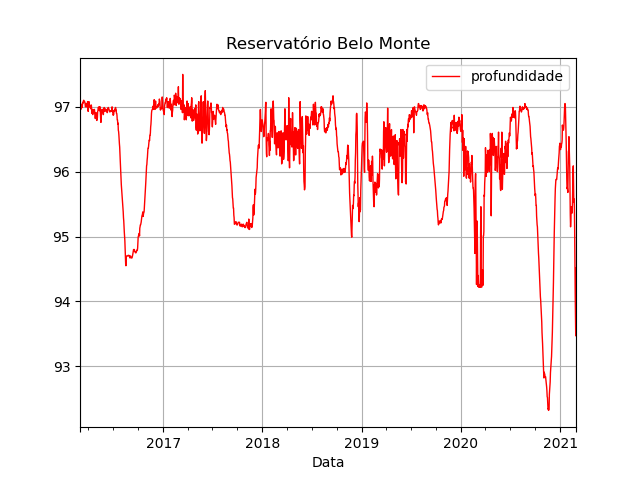


Figura – 6

Este reservatório é o mais recente dentre os escolhidos no trabalho, e demonstra grande variações provocadas por períodos curtos de dois à três meses provavelmente causado por intervenções de manutenção técnica. Assim os valores de baixa profundidade deveriam ser desprezados pela modelagem, já que não representam o comportamento real.

# Criação de Modelos de Machine Learning

A criação dos modelos de aprendizado de máquina neste tópico, se faz utilizando as ferramentas Python/PyCharm configurado para utilizar o pacote Anaconda para gerenciar a configuração das bibliotecas que são importadas. Neste ambiente foca-se nos dados do reservatório de Sobradinho para demonstrar o roteiro de implementação.



## Modelo ARIMA (*Autoregressive Integrated Moving Average*)

ARIMA é um modelo de média móvel autorregressiva integrada, utilizada nas séries temporais para previsão. Ela requer que seja feita uma avaliação prévia de seu comportamento para obter parâmetros de chamada das suas funções.

### Verificar se é uma série temporal estacionária

Uma série temporal é dita estacionária se as suas propriedades estatísticas, tais como a média e variância permanecem constantes ao longo do tempo.

Um dos métodos para identificar se a série temporal é estacionária é método ADF (*Augmented Dickey Fuller*), se ele retornar o valor p-value1 abaixo de 0,05 fica comprovado que é estacionária. Na biblioteca statsmodels esta função não necessita de ajustes finos para obter um resultado confiável, mas é possível otimizar a função através de seus parâmetros como (e.g.: autolag:”AIC” ou “BIC”).

**from** statsmodels.tsa.stattools **import** adfuller

print(**"p-value:"**, adfuller(dataFrame)[1])

Figura - 7

Como o resultado do p-value = 7.847096790972202e-05 foi bem inferior a 0,05 constata-se que a série deste reservatório é estacionária, como esperado pela avaliação do gráfico feita anteriormente.

Se neste teste a série não fosse dada como estacionária, utiliza-se o método de diferenciação para criar uma nova série até que o resultado do teste passe. A biblioteca Pandas disponibiliza este recurso na forma: dataFrame.diff() para criar uma série diferencial D=1, dataFrame.diff().diff() para criar uma série diferencial D=2.

1 – p-value: valor aproximado baseado no método MacKinnon (1994, 2010).

### Obter os valores dos parâmetros p, d e q

O P representa o “modelo AR” do ARIMA, D o “I” e Q o “MA”, eles são os parâmetros mais importantes na chamada da função ARIMA na biblioteca *statsmodels.*

A forma convencional de obtê-los é a plotagem dos gráficos pirulitos “lollipop”: ACF para obter o parâmetro P que é a autocorrelação e o PACF para obter o parâmetro Q. O parâmetro D é o grau diferencial da série, mas como esta série é estacionária sem ter passado por método de diferenciação ele assume o valor D=0 (zero). Abaixo segue as funções para plotar os gráficos ACF e PACF e os gráficos gerados.

**from matplotlib import pyplot plt as plt**

**from** statsmodels.graphics.tsaplots **import** plot\_acf, plot\_pacf

plot\_acf(df.diff().diff().dropna(),lags=40)  
plot\_pacf(df.diff().diff().dropna(),lags=40)  
plt.show()

Figura– 8

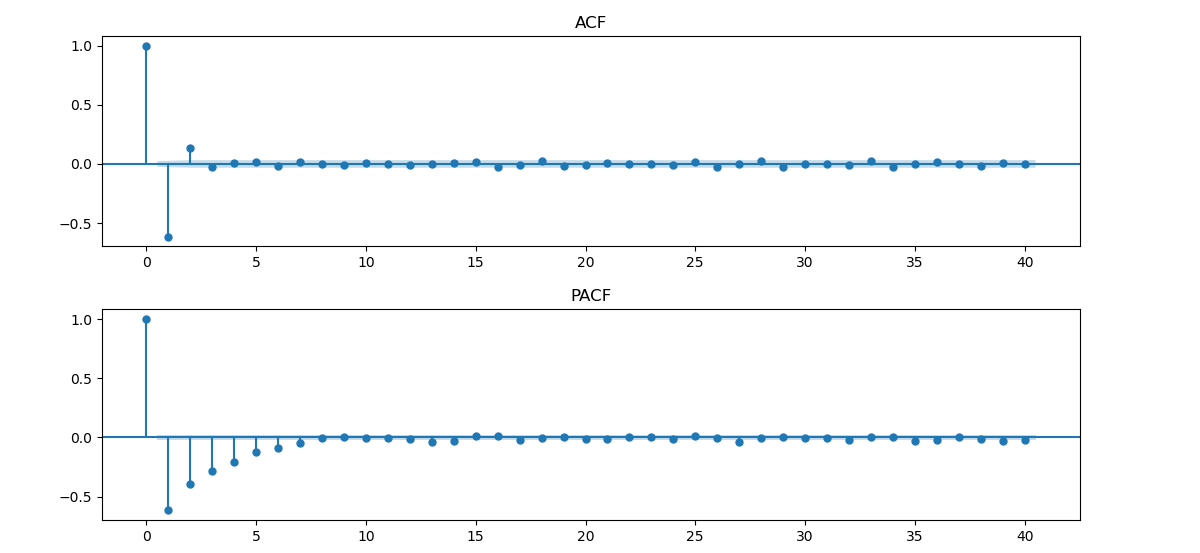


Figura - 9

Para obter o termo P:

O gráfico ACF tem uma mudança do primeiro *lollipop* do segundo?

* 1. Se não houver: P=0;
  2. Se houver: olhe para o gráfico PACF e conte quantos *lollipops* estão fora antes de retornar para zona crítica, em nosso caso são 8 (oito). A zona crítica está marcada por uma faixa azulada em torno do eixo horizontal.

Para obter o termo Q:

O gráfico PACF tem uma mudança do primeiro *lollipop* do segundo?

1. Se não houver: Q=0;
2. Se houver: olhe para o gráfico ACF e conte quantos *lollipops* estão fora antes de retornar para zona crítica, em nosso caso são 1 (um).

### Treinamento e previsão pelo modelo ARIMA

A biblioteca statsmodels permite que se faça divisão da massa de dados em parte para treinamento e outra para teste, assim pode-se comparar se o modelo convergiu corretamente, entretanto como a biblioteca também permite avaliar se houve falha no modelo através de um sumário estatístico, segue-se esta última abordagem. Abaixo segue a figura que demonstra as funções utilizadas neste processo.

arima = ARIMA(df, order=(8,0,1))

model\_fit = arima.fit()  
print(model\_fit.summary())  
prediction=model\_fit.get\_prediction(start=**'2021-03-01'**,end=**'2022-03-01'**)  
predicted\_values = prediction.predicted\_mean  
confidence\_intervals = prediction.conf\_int(alpha=0.05)

Figura - 10

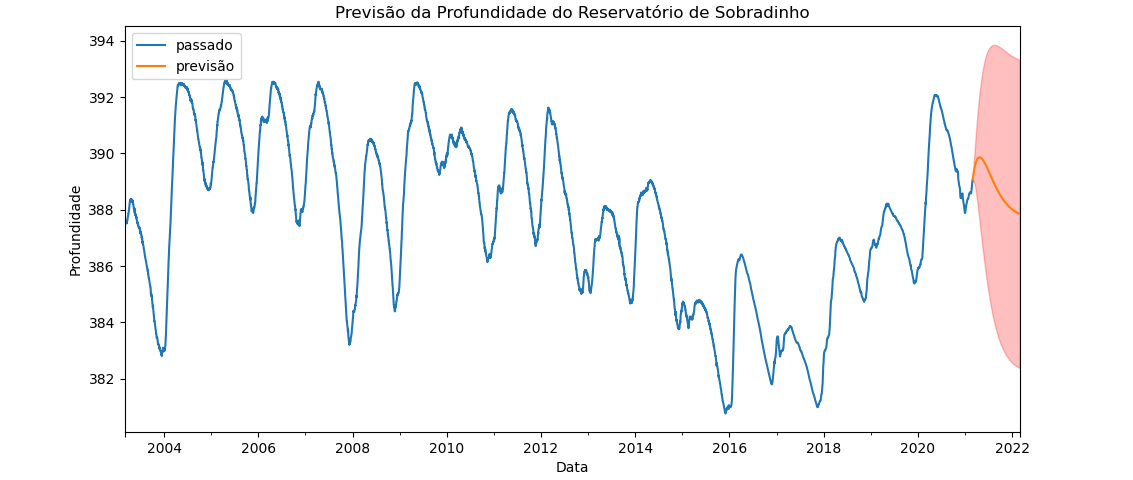


Figura - 11

### Treinamento e previsão pelo modelo ARIMA Sazonal

O tratamento da sazonalidade na biblioteca ARIMA é feita através da introdução de novo parâmetro o seasonal\_order=(P,D,Q,M), ele é obtido da mesma forma que o p,d,q anterior, somente que deve-se considerar o período em que ocorre o padrão da sazonalidade, e M é um valor que identifica se ela ocorre no dia, mês, ano com valores (e.g. 7, 12, 365).

A mudança no gráfico pode ser pequena assim, olhar o sumário e identificar se diminuiu os índices AIC, BIC e p>[z], são importantes para manter a escolha dos parâmetros.

## Modelo Redes Neurais Recorrentes - LSTM (*Long Short Term Memory*)

A LSTM é uma variação adequada das Redes Neurais Recorrentes (RNN), para cenários de classificação e previsão de séries temporais, ela difere das redes neurais artificiais unidirecionais onde os sinais da entrada seguem direto para a saída sem feedback na mesma camada. Então a saída de uma camada não alimenta a mesma camada. As Redes Neurais Recorrentes (RNN) ou retroalimentadas são capazes de ter os sinais seguindo ambos os sentidos.

Para implementa esta arquitetura, utiliza-se a ferramenta Python/PyCharm, importando as bibliotecas “TensorFlow/Keras”, que contém o modelo sequencial do LSTM.

Para efeito de velocidade de desenvolvimento pode-se agrupar os dados dos reservatórios por mês ao invés de dias, reduzindo o tempos de processamento, mas em contrapartida o modelo fica ligeiramente mais errado.

### Dividir a amostragem de dados obtida em treinamento e teste e normalizá-las.

Considerando que já se tem na variável new\_data o “Dataframe” carregado com duas colunas: data e profundidade, pode-se iniciar o processamento, com a divisão da amostragem no grupo de treinamento e teste e depois normalizá-los para intervalos entre 0 e 1.

*# GRUPO DE TREINAMENTO E TESTE*

dataset = new\_data.values  
train\_size = int(len(dataset) \* 0.67)  
test\_size = len(dataset) - train\_size  
train, test = dataset[0:train\_size,:], dataset[train\_size:len(dataset),:]  
*# NORMALIZA DADOS*scaler = MinMaxScaler(feature\_range=(0, 1))  
scaled\_dataset = scaler.fit\_transform(dataset)

Figura - xx

### Formatação dos dados para os parâmetros da função de modela.

Uma das partes mais trabalhosas no modelo LSTM é a formatação dos parâmetros que são entregues para a função “fit()” do TensorFlow/Keras, a visualização destes parâmetros é importante para o entendimento da forma de processamento.

Inicialmente temos uma série temporal representada por data e valor, que deve gerar dois parâmetros para a função “fit()”, o TrainX e o TrainY.

O TrainY é um vetor simples contendo todos os valores da série, retirando os primeiros N valores que compõe a primeira janela, ou seja, o valor de “lookback” selecionado, neste caso com o valor 3. Desta forma usando a série abaixo, temos:

Série: 10, 11, 12, 13, 14, 15, 16

TrainY = [13, 14, 15, 16]

Já o TrainX é uma matrix 3-D, e para obtê-la temos duas etapas de transformação:

1) Criar uma matriz 2-D onde o número de colunas é o tamanho do LOOKBACK selecionado, ele é o parâmetro que define a janela de quantos valores passados são avaliados. Assim temos para série de exemplo acima com loopback=3, o seguinte TrainX:

TrainX = [[10, 11, 12], [11, 12, 13], [12, 13, 14], [13, 14, 15], [14, 15, 16]]

1. Dar um “reshape”, na matriz 2-D acima para virar 3-D, ficando assim.

TrainX = [[[10], [11], [12]], [[11], [12], [13]], [[12], [13], [14]], [[13], [14], [15]], [[14], [15], [16]]]

Assim na definição do input\_shape na criação da camada LSTM, passa-se uma matrix (3 x 1).

Desta forma pode-se entender que para cada valor de TrainY temos uma matriz 2-D (3x1) representando os valores passados. Assim temos TrainX como o domínio e TrainY como a Imagem.

### Criação do modelo e previsão.

A biblioteca permite através da chamada “model.add()” modelar a quantidade de camadas, tipo de camada e número de neurônios, a função “model.compile()” define a otimização dos pesos internos e finalmente o “model.fit()” cria o modelo, que pode ser gravado em um arquivo no formato “.h5”. O número de “epochs” refere-se a quantidade de rodadas de treinamento que serão feitas com os mesmos dados, algo importante de ajuste quando se tem quantidades pequenas de amostras, nesta caso epochs=10 para dados por mês e 100 para amostras agrupadas por mês.

Figura - xx

*# GRUPO DE TREINAMENTO E TESTE*

dataset = new\_data.values

model = Sequential()  
model.add(LSTM(NUMERO\_NEURONIOS, input\_shape=(trainX.shape[1], 1)))  
model.add(Dense(1))  
model.compile(loss=**'mean\_squared\_error'**, optimizer=**'adam'**)  
model.fit(trainX, trainY, epochs=EPOCHS, batch\_size=1, verbose=2)

Para previsão chama-se a função “model.predict()” com os dados de teste, assim pode-se comparar seja pela impressão de um gráfico ou pelo cálculo do erro médio quadrádico chamando a função matth.sqrt(TesteY, testPredict), neste caso recupera-se os valores originais das profundidades antes.

testPredict = model.predict(testX)  
testPredict = scaler.inverse\_transform(testPredict)  
testY = scaler.inverse\_transform([testY])  
testScore = math.sqrt(mean\_squared\_error(testY[0], testPredict[:,0]))  
print(**'Test Score: %.2f RMSE'** % (testScore))

Figura - xx

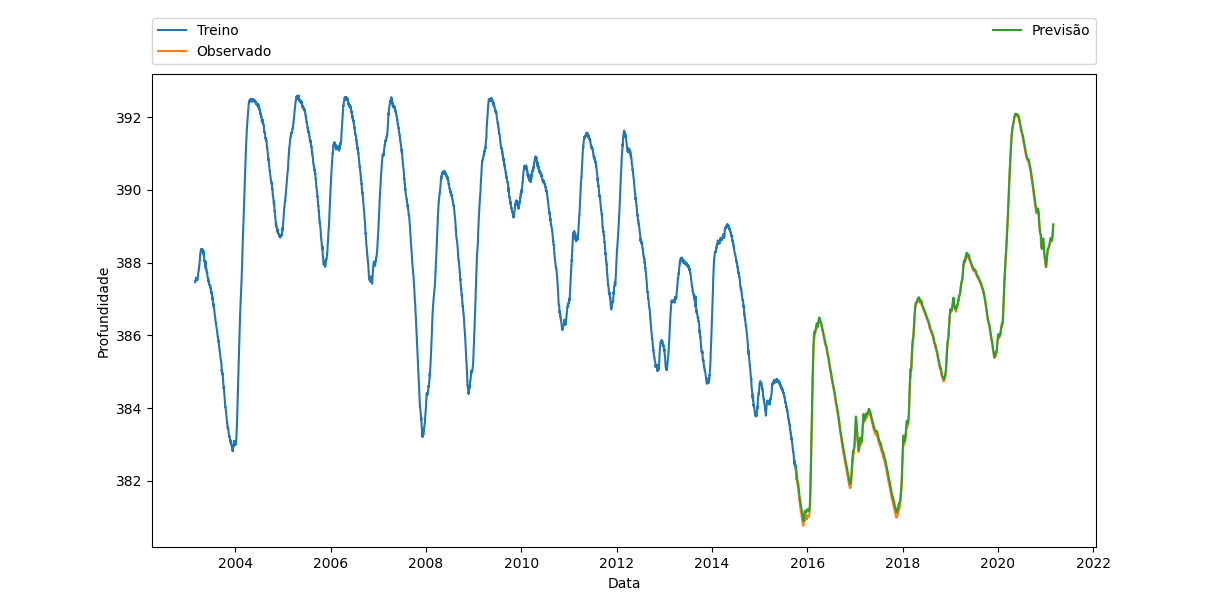


Figura – xx

# Apresentação dos Resultados

O resultado dos testes em ambos os modelos LSTM e ARIMA, demonstrou que a previsão dos níveis dos reservatórios é totalmente viável mesmo quando se há fatores climáticos e não previsíveis. Neste caso a modelagem LSTM tende a ser melhor que o ARIMA que também apresentou bons resultados, mas a capacidade de esquecimento do LSTM torna-se importante para questões de imprevisibilidade.

A obtenção e preparação dos dados é simples, e como a coleta de dados é feita por instrumentos, dificilmente dados errados e fora da curva precisam ser eliminados, o processamento de 6500 mesmo na modelagem LSTM, levou seis minutos de processamento, para a maior configuração de processamento para um ótimo resultado de previsão.

Testes com variação do número de camadas no LSTM demonstrou que duas camadas são ótimas para o que foi exigido e para o ARIMA seguindo o modelo “pirulito” alcança-se facilmente os parâmetros P e Q, para ajuste do modelo. Quando o ajuste dos parâmetros não é bem-feito pode-se ver nos gráficos como do apêndice Figura – 100.

Fazer o agrupamento por mês dos valores aferidos de profundidade ao invés de por dia como vem da fonte de dados, demonstrou uma piora da previsão, algo um tanto quanto inesperado, visto que reservatórios tendem a ter pequenas variações.

A visível que a modelagem por LSTM é mais trabalhosa, devido as transformações de matrizes para o formato das funções do modelo, enquanto o ARIMA e até a Profet que não está neste trabalho, são muito superiores no sentido facilidade de implementação.

# Links

Aqui você deve disponibilizar os links para o vídeo com sua apresentação de 5 minutos e para o repositório contendo os dados utilizados no projeto, scripts criados, etc.

Link para o vídeo: youtube.com/...

Link para o repositório: github.com/...

# REFERÊNCIAS

Um projeto/relatório técnico de Ciência de Dados não requer revisão bibliográfica. Portanto, a inclusão das referências não é obrigatória. No entanto, caso você deseje incluir referências relacionadas às tecnologias ou às metodologias usadas em seu trabalho, relacione-as de acordo com o modelo a seguir.

SOBRENOME DO AUTOR, Nome do autor. **Título do livro ou artigo.** Cidade: Editora, ano.

SOBRENOME DO AUTOR, Nome do autor. **Título do livro ou artigo.** Cidade: Editora, ano.

SOBRENOME DO AUTOR, Nome do autor. **Título do livro ou artigo.** Cidade: Editora, ano.

SOBRENOME DO AUTOR, Nome do autor. **Título do livro ou artigo.** Cidade: Editora, ano.

SOBRENOME DO AUTOR, Nome do autor. **Título do livro ou artigo.** Cidade: Editora, ano.

SOBRENOME DO AUTOR, Nome do autor. **Título do livro ou artigo.** Cidade: Editora, ano.

3

MacKinnon, J.G. 1994. “Approximate asymptotic distribution functions for unit-root and cointegration tests. *Journal of Business and Economic Statistics* 12, 167-76.

# APÊNDICE

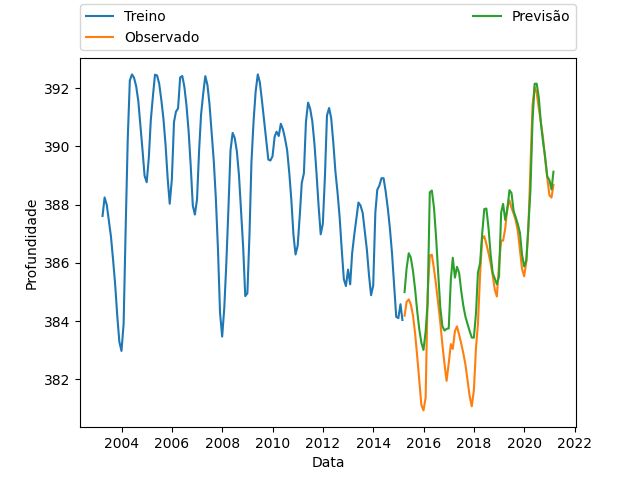


Figura – 100 (LSTM com ajuste malfeito)