# **Tugas 2: Long Short-term Memory (LSTM)**

Oleh: Rifqi Naufal Abdjul (13520062) Fachry Dennis Heraldi (13520139) IF4074 Pembelajaran Mesin Lanjut Semester Ganjil - Tahun Akademik 2023/2024

### Memuat Modul dan Library yang Digunakan

### Fungsi Utilitas dalam Implementasi

Berikut ini adalah fungsi-fungsi yang digunakan untuk membantu dalam operasi yang dilakukan pada pengimplementasian. Fungsi relu dan fungsi sigmoid berlaku sebagai fungsi aktivasi yang digunakan di dense layer

```
In []: @np.vectorize
    def relu(x:np.ndarray):
        return np.maximum(0,x)

        @np.vectorize
    def sigmoid(x:np.ndarray):
        return 1 / (1 + np.exp(-x))
```

### Implementasi Layer Dense

Kelas Dense adalah implementasi dari sebuah fully connected atau dense layer. Di dalam konstruktor ( \_\_init\_\_), diterima beberapa parameter penting seperti units , yang menunjukkan jumlah neuron di layer tersebut, input\_shape , yang merupakan dimensi dari data masukan, serta activation , yang menentukan jenis fungsi aktivasi yang akan digunakan. Variabel-variabel self.units , self.activation , self.weights , self.bias , dan self.\_input\_shape digunakan untuk menyimpan parameter dan data ini.

Metode from\_file memungkinkan pembuatan instance dari kelas Dense menggunakan parameter yang telah disimpan dalam bentuk dictionary.

Metode \_activation digunakan untuk menerapkan fungsi aktivasi. Terdapat pilihan antara ReLU, Sigmoid, atau Linear sebagai fungsi aktivasi.

Metode \_compile digunakan untuk menginisialisasi bobot dan bias. Dipanggil setelah dimensi dari data masukan diketahui. Bobot diinisialisasi sebagai array acak dengan dimensi yang sesuai dengan bentuk masukan dan jumlah unit, sementara bias adalah array acak dengan ukuran yang sama dengan jumlah unit.

Metode \_forward bertujuan untuk melakukan proses utama. Mengambil tensor masukan, melakukan perkalian matriks dengan bobot, menambahkan bias, dan terakhir menerapkan fungsi aktivasi. Keluaran dari fungsi ini adalah tensor yang telah disesuaikan dimensinya dengan parameter units.

Metode \_\_get\_output\_shape mengembalikan bentuk dari tensor keluaran, bertujuan untuk mengetahui bentuk dari data yang akan diteruskan ke layer berikutnya.

```
In [ ]: class Dense:
            """ Dense layer.
            Args:
                units: positive integer, dimensionality of the output space
                input_shape: tuple (batch, channel, height, width), shape of input
                received by the dense layer
                activation: string, 'relu' or 'sigmoid'
            def __init__(self,
                          units,
                          input_shape: tuple = None,
                          activation="linear",
                          weights = None,
                          bias = None):
                # units is positive integer
                if not(isinstance(units, int) and units > 0):
                     raise ValueError("Invalid units. Must be a positive integer.")
                # activation is either 'ReLU' or 'sigmoid'
                if activation not in ["relu", "sigmoid", "linear"]:
                     raise ValueError(
                         "Invalid activation. Must be either 'relu' or 'sigmoid' or
        'linear'."
                     )
                self_units = units
                self_activation = activation
                self_weights = weights
                self.bias = bias
                self._input_shape = input_shape
                 self. is compiled = False
            @classmethod
            def from_file(cls, params):
                kernel = np.array(params['kernel'])
                bias = np.array(params['bias'])
                 return cls(
                     units = kernel.shape[1],
                     input_shape = (1,kernel.shape[0]),
                    weights = kernel,
                    bias = bias
                 )
            def __call__(self, x):
                self.input = x
                 return self._forward(x)
            def _activation(self, x):
                if self.activation == "relu":
                     return relu(x)
                elif self.activation == "sigmoid":
                     return sigmoid(np.float128(x))
                elif self.activation == "linear":
                     return x
            def _compile(self, input_shape: tuple = None, random=True):
                if input_shape is not None:
                     assert input_shape[-2] == 1, "Input must be 1D for dense layer"
                     self._input_shape = np.array(input_shape)
                if random:
                     self.weights = np.random.randn(self._input_shape[-1], self.unit
        s)
                     self.bias = np.random.randn(self.units)
```

```
self._is_compiled = True
    def forward(self, x):
        assert self._is_compiled, "Layer is not compiled"
        # x is N-D tensor with 2D shape (batch_size, input_dim)
        self_x = x
        # Calculate output tensor
        self.y = np.dot(x, self.weights) + self.bias
        # x_dense shape dimension (batch_size, units)
        return self._activation(self.y)
    def    get output shape(self):
        return (1, self.units)
    def __get_param_count(self):
        return ((self._input_shape[0]*self._input_shape[1] + 1) * self.unit
s)
    output_shape = property(__get_output_shape)
    param_count = property(__get_param_count)
```

### Implementasi Layer LSTM

Kelas LSTM adalah kelas yang mengimplementasikan model Long Short-Term Memory. Di awal, kelas diinisialisasi dengan parameter seperti units, yang mendefinisikan jumlah neuron atau unit di dalam LSTM. Parameter input\_shape mendefinisikan bentuk dari input yang akan diberikan ke layer ini, sedangkan weights berisi bobot dari layer yang bisa disediakan pada saat inisialisasi atau dihasilkan secara otomatis kemudian.

Selanjutnya, metode from\_file memungkinkan pembuatan instance dari kelas LSTM menggunakan parameter yang telah disimpan dalam bentuk dictionary. Ini sangat berguna terutama saat ingin memuat model yang telah dilatih sebelumnya. Ketika layer dipanggil dengan suatu input, metode \_\_call\_\_ akan menginisialisasi hidden state dan cell state, lalu melaksanakan operasi forward propagation untuk setiap timestep pada input yang diberikan.

Salah satu metode penting lainnya adalah \_compile , yang berfungsi untuk menginisialisasi atau mengatur ulang bobot layer berdasarkan bentuk input dan metode inisialisasi bobot yang diinginkan, apakah secara acak atau dengan pola tertentu. Namun, inti dari operasi LSTM terdapat pada metode \_forward . Di sini, semua operasi internal layer LSTM, seperti forget gate, input gate, cell state, dan output gate, dijalankan untuk memutuskan informasi apa yang harus dilupakan, diperbarui, atau ditampilkan dari cell state ke hidden state.

Untuk membantu di luar kelas, ada metode \_\_get\_output\_shape yang mengembalikan bentuk dari output layer dan \_\_get\_param\_count yang menghitung total parameter yang digunakan oleh layer. Jumlah parameter ini penting untuk dipahami karena berkaitan dengan kompleksitas model dan kapasitasnya untuk mempelajari fitur dari data.

```
In [ ]: class LSTM:
            def __init__(self, units, input_shape: tuple = None, weights=None):
                # units is positive integer
                if not(isinstance(units, int) and units > 0):
                    raise ValueError("Invalid units. Must be a positive integer.")
                self_units = units
                self_weights = weights
                self. input shape = input shape
                self._is_compiled = False
            @classmethod
            def from_file(cls, params):
                weights = \{\}
                for param, value in params.items():
                    weights[param] = np.array(value)
                input_shape, units = weights['W_f'].shape
                return cls(
                    units = units,
                    input_shape = (1, input_shape),
                    weights = weights
                )
            def __call__(self, x):
                self._h_prev = np.zeros(self.units)
                self._c_prev = np.zeros(self.units)
                self.input = x # (x's shape = (timestep, features))
                for i in range(len(x)):
                  self. forward(x[i])
                return self._h_prev
            def compile(self, input shape: tuple = None, random=True):
                if input shape is not None:
                    assert input_shape[-2] == 1, "Input must be 1D for dense layer"
                    self._input_shape = np.array(input_shape)
                input_size = self._input_shape[-1]
                if self.weights is None:
                  self.weights = {}
                  if random:
                       for key in ['W_f', 'W_i', 'W_c', 'W_o']:
                         self.weights[key] = np.random.randn(self.units, input_size)
                       for key in ['U_f', 'U_i', 'U_c', 'U_o']:
                         self.weights[key] = np.random.randn(self.units, self.units)
                       for key in ['b_f', 'b_i', 'b_c', 'b_o']:
                         self.weights[key] = np.random.randn(self.units, 1)
                  else:
                       for key in ['W_f', 'W_i', 'W_c', 'W_o']:
                        self.weights[key] = np.arange(self.units * input_size).resha
        pe(self.units, input_size)
                       for key in ['U_f', 'U_i', 'U_c', 'U_o']:
                         self.weights[key] = np.arange(self.units * self.units).resha
        pe(self.units, self.units)
                      for key in ['b_f', 'b_i', 'b_c', 'b_o']:
                        self.weights[key] = np.arange(self.units).reshape(self.unit
        s,1)
                self._h_prev = np.zeros(self.units)
                self._c_prev = np.zeros(self.units)
                self._is_compiled = True
            def _forward(self, x):
                assert self._is_compiled, "Layer is not compiled"
```

```
ft = sigmoid(np.dot(self.weights['W_f'].T, x) + np.dot(self.weights
['U_f'], self._h_prev) + self.weights['b_f'])
       it = sigmoid(np.dot(self.weights['W i'].T, x) + np.dot(self.weights
['U_i'], self._h_prev) + self.weights['b_i'])
       ct = np.tanh(np.dot(self.weights['W c'].T, x) + np.dot(self.weights
['U c'], self h prev) + self weights['b c'])
       ot = sigmoid(np.dot(self.weights['W_o'].T, x) + np.dot(self.weights
['U_o'], self._h_prev) + self.weights['b_o'])
       self. c prev = ft * self. c prev + ct
       self. h prev = ot * np.tanh(self. c prev)
        return self._h_prev
   def __get_output_shape(self):
        return (1, self.units)
   def __get_param_count(self):
       x = self._input_shape[-1]
       h = self_units
       return (4*((x+h)*h+h))
   output_shape = property(__get_output_shape)
   param_count = property(__get_param_count)
```

## Implementasi Model Sequential

Kelas Sequential adalah kelas untuk mengelompokkan serangkaian layer secara linear ke dalam sebuah model pembelajaran. Kelas ini menyediakan metode untuk mengompilasi model, merangkum arsitekturnya, dan melakukan prediksi, meskipun metode untuk pelatihan (fit) dan evaluasi (evaluate) hanya didefinisikan tetapi belum diimplementasikan.

Metode \_\_init\_\_ adalah konstruktor yang menginisialisasi sebuah daftar kosong bernama self.layers dan menambahkan layer ke dalamnya jika ada yang disediakan saat pembuatan objek. Metode compile memastikan bahwa model memiliki layer dan layer pertama memiliki bentuk masukan yang ditentukan. Metode ini memanggil metode \_compile pada setiap layer. Jika tanda random diatur ke True, bobot layer akan diinisialisasi secara acak.

Metode summary mencetak arsitektur dan jumlah parameter dari setiap layer di model. Metode ini menghitung jumlah total parameter di model sebagai total\_params.

Metode predict menerima sebuah array NumPy sebagai masukan, memeriksa apakah bentuknya sesuai dengan bentuk masukan layer pertama, dan meneruskannya melalui semua layer di model. Variabel selfilayers adalah daftar yang memegang semua layer dalam model, dan total\_params adalah variabel untuk melacak jumlah total parameter di semua layer, yang digunakan dalam metode summary.

Metode save menerima nama file yang akan diberikan untuk menyimpan model dalam format JSON. Sebaliknya, metode load menerima nama file eksternal dalam format JSON untuk memuat informasi parameter tiap layer pada model yang disimpan pada file tersebut ke dalam objek model Sequential.

```
In [ ]: class Sequential:
            """ Sequential class.
            Sequential groups a linear stack of layers into a model
            Sequential provides training and inference features on this model.
            def __init__(self, *layers):
                self.layers = []
                for l in layers:
                    self_layers_append(l)
            def add(self, layer):
                self.layers.append(layer)
            def compile(self, random=True):
                assert len(self.layers) > 0, "No layers are available"
                assert self.layers[0]._input_shape is not None, "First layer needs a
        n input shape"
                self.layers[0]._compile(random=random)
                for i in range(len(self.layers) - 1):
                    self.layers[i+1]. compile(self.layers[i].output shape, random=ra
        ndom)
            def summary(self):
                print('Model: "sequential"')
                print("-"*70)
                print("{:<20}{:<30}{:<20}".format("Layer (type)", "Output Shape", "P</pre>
        aram #"))
                print("="*70)
                total_params = 0
                # Looping per layer
                for layer in self layers:
                    total_params+=layer.param_count
                    r.output_shape), layer.param_count))
                print("="*70)
                print(f"Total params: {total_params}")
                print(f"Trainable params: {total params}")
                print(f"Non-trainable params: 0")
            def predict(self, inp: np.ndarray):
                result = inp.copy()
                for layer in self.layers:
                    result = layer(result)
                return result
            def save(self, filename):
                data = []
                for layer in self.layers:
                  if layer.__class__._name__ == 'LSTM':
                    weights = \{\}
                    for key in layer.weights:
                      weights[key] = layer.weights[key].tolist()
                    data.append({
                        "type": "lstm",
                        "params": weights
                    })
                  elif layer.__class__._name__ == 'Dense':
                    data.append({
                        "type": "dense",
                        "params": {
                            "kernel": layer.weights.tolist(),
                            "bias": layer.bias.tolist()
                    })
```

```
with open(filename, "w") as file:
    json.dump(data, file)

def load(self, filename):
    self.layers = []
    with open(filename, "r") as file:
        models = json.load(file)
    for model in models:
        if model['type'] == 'lstm':
        self.add(
            LSTM.from_file(model['params'])
        )
    elif model['type'] == 'dense':
        self.add(
            Dense.from_file(model['params'])
        )
```

### Contoh Hasil Prediksi Menggunakan Model LSTM yang Dibuat

### **Mengambil File Dataset dan Trained Model**

```
In []: # 1. Authenticate and create the PyDrive client.
        auth.authenticate_user()
        gauth = GoogleAuth()
        gauth.credentials = GoogleCredentials.get_application_default()
        drive = GoogleDrive(gauth)
        # choose a local (colab) directory to store the data.
        local_download_path = os.path.expanduser('')
        try:
          os.makedirs(local_download_path)
        except: pass
        # 2. Auto-iterate using the query syntax
             https://developers.google.com/drive/v2/web/search-parameters
        file_list = drive.ListFile(
            {'q': "'1TG6YYGc1a252MNsyvMJPlloZ6CEf5BHX' in parents"}).GetList()
        for f in file_list:
          # 3. Create & download by id.
          print('title: %s, id: %s' % (f['title'], f['id']))
          fname = os.path.join(local_download_path, f['title'])
          print('downloading to {}'.format(fname))
          f_ = drive.CreateFile({'id': f['id']})
          f_.GetContentFile(fname)
```

title: Train\_stock\_market.csv, id: 161zosFN434JGf0D4ssvzH00h2P2iv5Rl downloading to Train\_stock\_market.csv title: Test\_stock\_market.csv, id: 1YhhX5wilhflUfDbqBI3rpcY0s0nZqeSU downloading to Test\_stock\_market.csv title: model\_4\_parameters.json, id: 1kA6u0fx536TqyfVSb1AaT5q9l9TE6ZPf downloading to model\_4\_parameters.json

#### **Load Dataset**

```
In [ ]: train_data = pd.read_csv('Train_stock_market.csv')
        test data = pd.read csv('Test stock market.csv')
In [ ]: | train_data.info()
        <class 'pandas.core.frame.DataFrame'>
        RangeIndex: 9645 entries, 0 to 9644
        Data columns (total 7 columns):
             Column
                            Non-Null Count Dtype
         0
                            9645 non-null
                                            object
             Date
         1
             Low
                            9645 non-null
                                            float64
         2
                            9645 non-null
                                            float64
             0pen
         3
             Volume
                            9645 non-null int64
         4
                            9645 non-null float64
             Hiah
         5
             Close
                            9645 non-null float64
             Adjusted Close 9645 non-null float64
         6
        dtypes: float64(5), int64(1), object(1)
        memory usage: 527.6+ KB
In [ ]: | test_data.info()
        <class 'pandas.core.frame.DataFrame'>
        RangeIndex: 39 entries, 0 to 38
        Data columns (total 7 columns):
                       Non-Null Count Dtype
             Column
                      39 non-null
         0
             Date
                                        object
                       39 non-null
                                        float64
         1
             0pen
         2
             High
                       39 non-null
                                        float64
         3
             Low
                       39 non-null
                                        float64
         4
             Close
                       39 non-null
                                        float64
         5
             Adj Close 39 non-null
                                        float64
         6
             Volume
                       39 non-null
                                        int64
        dtypes: float64(5), int64(1), object(1)
        memory usage: 2.3+ KB
```

### Inisialisasi Jaringan LSTM

```
In []: # Inisialisasi object Sequential
model = Sequential()

In []: # Load pre-trained model
model.load("model_4_parameters.json")

In []: # Compile model
model.compile(random=False)
```

```
In [ ]: # Melihat trainable parameters dari summary model
model.summary()
```

#### Model: "sequential"

\_\_\_\_\_

Layer (type)	Output Shape	Param #
LSTM	(1, 64)	17920
Dense	(1, 5)	325

Total params: 18245 Trainable params: 18245 Non-trainable params: 0

seq\_y = data[seq\_end]
sequences.append(seq\_x)
targets.append(seq\_y)

return np.array(sequences), np.array(targets)

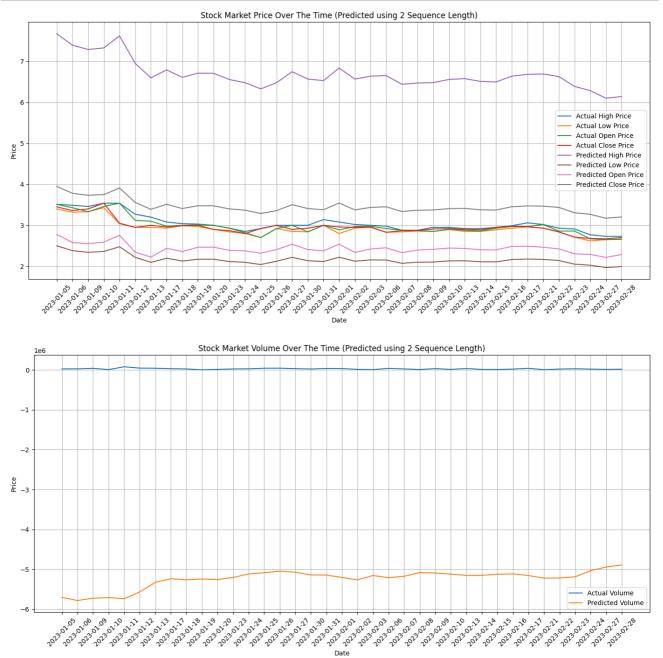
### Prediksi Beberapa Data Uji

```
In []: # Pemilihan fitur yang ingin diprediksi: High, Low, Volume, Open, Close
    train_data_features = train_data[['High','Low','Volume','Open', 'Close']]
    test_data_features = test_data[['High','Low','Volume','Open', 'Close']]

In []: # Normalisasi data
    scaler = MinMaxScaler()
    scaled_train = scaler.fit_transform(train_data_features)
    scaled_test = scaler.transform(test_data_features)

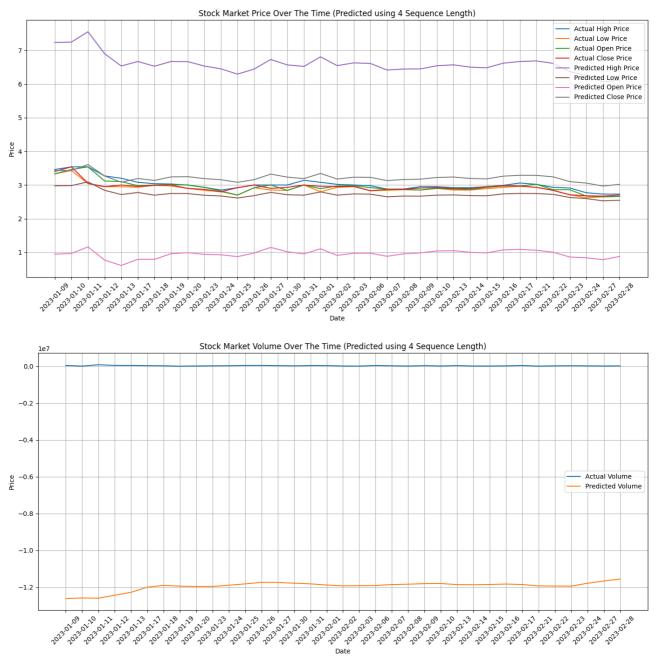
In []: def create_sequences(data, seq_length):
    sequences = []
    targets = []
    data_len = len(data)
    for i in range(data_len - seq_length):
        seq_end = i + seq_length
        seq_x = data[i:seq_end]
```

```
In [ ]: def predict_by_sequence(model, data, scaler, scaled_data_arr, seq_length):
           sequences, targets = create sequences(scaled data arr, seq length)
           predictions = []
           for seq in sequences:
             pred = model.predict(seq)
             predictions.append(pred)
          error = mean squared error(targets, predictions)
           pred length = len(predictions)
           predictions = scaler.inverse_transform(predictions)
           predictions = predictions.T
          data = data[['Date', 'High', 'Low', 'Volume', 'Open', 'Close']]
          data = data.tail(pred_length)
          data['Pred High'] = predictions[0]
          data['Pred Low'] = predictions[1]
          data['Pred Volume'] = predictions[2]
          data['Pred Open'] = predictions[3]
          data['Pred Close'] = predictions[4]
           plt.figure(figsize=(14, 7))
           plt.plot(data['Date'], data['High'], label='Actual High Price')
           plt.plot(data['Date'], data['Low'], label='Actual Low Price')
          plt.plot(data['Date'], data['Open'], label='Actual Open Price')
plt.plot(data['Date'], data['Close'], label='Actual Close Price')
           plt.plot(data['Date'], data['Pred High'], label='Predicted High Price')
          plt.plot(data['Date'], data['Pred Low'], label='Predicted Low Price')
           plt.plot(data['Date'], data['Pred Open'], label='Predicted Open Price')
           plt.plot(data['Date'], data['Pred Close'], label='Predicted Close Price')
           plt.title(f'Stock Market Price Over The Time (Predicted using {seq_length})
        Sequence Length)')
           plt.xlabel('Date')
           plt.ylabel('Price')
          plt.legend()
           plt.grid(True)
           plt.xticks(data['Date'][::1]) # Show every date for clarity
          plt.xticks(rotation=45)
          plt.tight_layout()
           plt.show()
          plt.figure(figsize=(14, 7))
           plt.plot(data['Date'], data['Volume'], label='Actual Volume')
           plt.plot(data['Date'], data['Pred Volume'], label='Predicted Volume')
          plt.title(f'Stock Market Volume Over The Time (Predicted using {seg lengt
        h} Sequence Length)')
           plt.xlabel('Date')
           plt.ylabel('Price')
           plt.legend()
           plt.grid(True)
           plt.xticks(data['Date'][::1]) # Show every date for clarity
           plt.xticks(rotation=45)
          plt.tight_layout()
           plt.show()
           print(f"RMSE: {error} ")
```



RMSE: 0.0065556796913000025

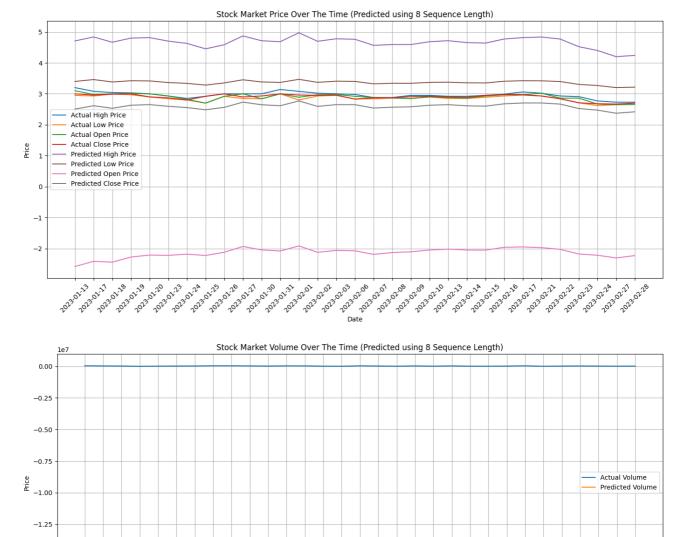
Eksperimen Prediksi Data Uji dengan Panjang Sekuens 4



RMSE: 0.010154455720784841

Eksperimen Prediksi Data Uji dengan Panjang Sekuens 8





201301.08 202302.09 2023-02:20

202302.03 202302.06 2013-02-01 te

Date

202302:24

202302.15 202302:16

202302.22 202302:72 202302:23 2023-02-24

2023-02-27

2023-02-27

202302:23

RMSE: 0.02190130718208759

202301.18 202301.19 202301.20 202301:23

-1.50

-1.75

#### **Save Model**

```
In [ ]: # Save the model
        model = Sequential()
        model.load("model_4_parameters.json")
        model.save("model_4_parameters_new.json")
```

20230121

202301:30 202301:32 20230202 202302.02

20230126

202301.25

20230124

```
In [ ]: | # Try to load the saved model, and compare the summary
       model2 = Sequential()
       model2.load("model 4 parameters new.json")
       model.summary(), print(), model2.summary()
       Model: "sequential"
       Layer (type)
                         Output Shape
                                                    Param #
       _____
       LSTM
                         (1, 64)
                                                    17920
                         (1, 5)
       Dense
                                                    325
       Total params: 18245
       Trainable params: 18245
       Non-trainable params: 0
       Model: "sequential"
       Layer (type)
                         Output Shape
                                                    Param #
       ______
                         (1, 64)
       LSTM
                                                    17920
                         (1, 5)
       Dense
                                                    325
       Total params: 18245
       Trainable params: 18245
       Non-trainable params: 0
Out[]: (None, None, None)
In []: # Making sure, the json is same
       with open("model_4_parameters.json", "r") as f:
         a = json.load(f)
       with open("model_4_parameters_new.json", "r") as f:
         b = json.load(f)
       str(a) == str(b)
Out[]: True
```

**Pembagian Tugas** 

Rifqi Naufal Abdjul (13520062) mengerjakan implementasi LSTM, perhitungan summary model, dan save model.

Fachry Dennis Heraldi (13520139) mengerjakan implementasi prediksi model, penggunaan model, dan load model.

### Kesimpulan Hasil Eksperimen

Dalam rangka menjalankan serangkaian eksperimen, kami telah melakukan prediksi terhadap kolom 'High', 'Low', 'Volume', 'Open', dan 'Close' dalam data uji dengan variasi panjang sekuens: 2, 4, dan 8. Untuk memulai eksperimen ini, bobot pada model awalnya diinisialisasi dengan memuat file 'model\_4\_parameters.json'.

Pendekatan eksperimental yang kami terapkan adalah dengan mengambil x data pertama, di mana x adalah panjang sekuens yang ditentukan. Data-data awal ini digunakan untuk memprediksi data berikutnya, yaitu data ke-x+1. Dalam dataset uji kami yang terdiri dari 39 baris data, ini berarti untuk panjang sekuens 2, kami memprediksi 37 data, untuk panjang sekuens 4, kami memprediksi 35 data, dan untuk panjang sekuens 8, kami memprediksi 31 data.

Penting untuk dicatat bahwa perbedaan dalam panjang sekuens pada setiap eksperimen memengaruhi nilai h (hidden state) dan c (cell state) yang dihasilkan setelah proses forward pass melalui x data pertama, yang pada gilirannya digunakan untuk memprediksi data ke-x+1.

Namun, perlu diperhatikan dari hasil eksperimen yang kami peroleh, model belum mampu memprediksi data dengan akurasi yang memuaskan. Hal ini dapat dijelaskan oleh keterbatasan model kami dalam memahami dan mengekstraksi pola dari data latih, karena model kami tidak memiliki mekanisme backpropagation. Sebagai gantinya, hasil prediksi kami bergantung pada bobot yang dimuat dari file eksternal, yang mungkin belum mencerminkan informasi yang cukup untuk prediksi yang akurat. Dalam perkembangan selanjutnya, perbaikan dan pengembangan model mungkin diperlukan untuk meningkatkan performa prediksi kami.