

# Lista 7 - Redes Neurais Artificiais

July 13, 2021

Felipe Bartelt de Assis Pessoa - 2016026841

## 1 Redes RBF

Primeiramente, definiu-se a função `h_rbf` que calcula a resposta da função radial do neurônio em questão. Essa função recebe como parâmetros: um vetor `x` que representa todos os dados de um exemplo de treino, os centros do k-médias `centers` e a matriz de covariância `cov_mat`. A função tem um tratamento para o caso de `cov_mat` ser um escalar, correspondente à variância de um vetor e não uma matriz de covariâncias, nesse caso, toma-se  $\text{cov\_mat} = \sigma^2 I$ , onde  $\sigma^2$  representa a variância e  $I$  a matriz identidade. A função retorna a resposta da função radial normalizada.

Definiu-se também a função `train_RBF` para o treino da rede neural RBF, cujos parâmetros são: os dados de treino, de entrada e saída, `x_train`, `y_train`, respectivamente; e o número de *clusters* desejados `hidden_dim`. Essa função utiliza o cálculo do k-médias fornecido pelo `sklearn.cluster` para gerar os *clusters* e utiliza a função `h_rbf` para a modelagem. Ao final a função retorna uma tupla de 4 elementos, sendo esses, em ordem: a matriz  $H$  que contém todas as respostas das funções radiais, o vetor de pesos  $w$  da camada de saída, os centros do k-médias `centers` e uma lista com todas as matrizes de covariância `cov_list`.

Por último, definiu-se a função `eval_RBF`, cuja função é avaliar a resposta do modelo gerado. Seus parâmetros são os dados de teste `x_test` e a tupla gerada por `train_RBF`, `rbf_params`. De forma análoga, a função calcula a resposta do modelo para os dados de teste e retorna a saída do modelo `y_hat`.

```
[2]: from sklearn.cluster import KMeans

def h_rbf(x, centers, cov_mat):
    m = x.shape[0]
    dist = x - centers

    if cov_mat.ndim < 2:
        cov_mat = np.eye(m) * cov_mat

    norm_factor = 1/np.sqrt((2*np.pi)**m * np.linalg.det(cov_mat))
    h = norm_factor * np.exp(-0.5 * dist @ np.linalg.pinv(cov_mat) @ dist.T)

    return h

def train_RBF(x_train, y_train, hidden_dim):
```

```

km = KMeans(hidden_dim).fit(x_train)
centers = km.cluster_centers_
cov_list = []
N = x_train.shape[0]
h = np.zeros((N, hidden_dim))

for p in range(hidden_dim):
    p_samples = (km.labels_ == p).nonzero()
    cov_mat = np.cov(x_train[p_samples], rowvar=False, ddof=0)
    cov_list.append(np.copy(cov_mat))
    center = centers[p,:]
    h[:,p] = np.array([h_rbf(x_sample, centers[p], cov_mat) for x_sample in
↪x_train])

h_aug = np.append(np.ones((N, 1)), h, axis=1)
w = np.linalg.pinv(h_aug) @ y_train

return (h, w, centers, cov_list)

def eval_RBF(x_test, rbf_params):
    w = rbf_params[1]
    hidden_dim = rbf_params[0].shape[1]
    centers = rbf_params[2]
    cov_list = rbf_params[3]
    N = x_test.shape[0]
    h = np.zeros((N, hidden_dim))

    for p in range(hidden_dim):
        cov_mat = np.copy(cov_list[p])
        center = centers[p,:]
        h[:,p] = np.array([h_rbf(x_sample, centers[p], cov_mat) for x_sample in
↪x_test])

    h = np.append(np.ones((N, 1)), h, axis=1)
    y_hat = h @ w

    return y_hat

```

Uma vez que seria necessário iterar diversas redes RBF, com diferentes números de *clusters*, modificou-se a função `make_grid`, já definida no exercício sobre ELMs

```

[307]: def make_grid(X, Y, dim_list, title):
    margin = 0.25
    mesh_size = 0.02
    x_min, x_max = X[:, 0].min() - margin, X[:, 0].max() + margin
    y_min, y_max = X[:, 1].min() - margin, X[:, 1].max() + margin
    x_range = np.linspace(x_min, x_max, 100)

```

```

y_range = np.linspace(y_min, y_max, 100)
xx, yy = np.meshgrid(x_range, y_range)
zz = np.c_[xx.ravel(), yy.ravel()]

fig = make_subplots(rows= len(dim_list)//2, cols=2, subplot_titles=
↳tuple('k='+str(i) for i in dim_list))
fig.update_layout(autosize = False, width = 800, height = 800,
↳margin=dict(l = 80, r = 80, t = 80, b = 80), title = dict(text =
↳title, x = 0.5, y = 0.95), axis_title = 'test')
fig.update_xaxes(range=[x_min, x_max])
fig.update_yaxes(range=[y_min, y_max])

for i in range(1, len(dim_list)+1):
    fig['layout']['xaxis{}'.format(i)]['title']='x1'
    fig['layout']['yaxis{}'.format(i)]['title']='x2'
    fig['layout']['yaxis{}'.format(i)]['title_standoff'] = 2
surf_list = []

for i, p in enumerate(dim_list):
    rbf = train_RBF(X, Y, p)
    y_hat = eval_RBF(zz, rbf).reshape(xx.shape)
    region = go.Contour(x= x_range, y= y_range, z= y_hat, coloraxis =
↳"coloraxis", opacity = 0.8)
    fig.add_trace(region, row = int(np.ceil((i+1)/2)), col = 2**(i%2))
    fig.add_trace(black_sample, row = int(np.ceil((i+1)/2)), col = 2**(i%2))
    fig.add_trace(red_sample, row = int(np.ceil((i+1)/2)), col = 2**(i%2))
    centers = rbf[2]
    center_plot = go.Scatter(x = centers[:,0], y= centers[:, 1],
↳mode='markers', showlegend = False,
    marker = dict(symbol = 'x', size = 9, color =
↳'#FFBC0D', opacity = 0.7))
    fig.add_trace(center_plot, row = int(np.ceil((i+1)/2)), col = 2**(i%2))
    surf_list.append((x_range, y_range, y_hat))

fig.update_layout(coloraxis = {'colorscale' : 'RdGy_r'})

return fig, surf_list

```

## 1.1 2D-Normals

O primeiro banco de dados utilizado foi o 2D-Normals, apresentado a seguir:

```

[252]: import numpy as np
import plotly.graph_objects as go
from plotly.subplots import make_subplots
from sklearn import datasets

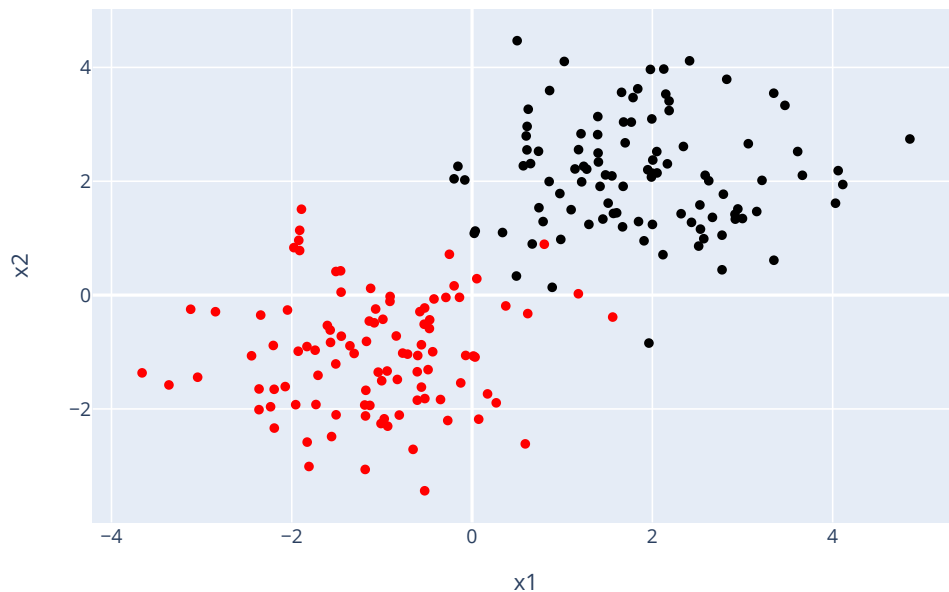
```

```

X, Y = datasets.make_blobs(200, centers = [[2,2],[-1,-1]])

red_sample = go.Scatter(x=X[Y==1,0], y=X[Y==1,1], mode = 'markers',
    ↪marker_color = 'red', showlegend = False)
black_sample = go.Scatter(x=X[Y==0,0], y=X[Y==0,1], mode = 'markers',
    ↪marker_color = 'black', showlegend = False)
fig = go.Figure(red_sample)
fig.update_layout(xaxis={'title':'x1'}, yaxis={'title':'x2'})
fig.add_trace(black_sample)
fig.show(renderer = 'svg')

```



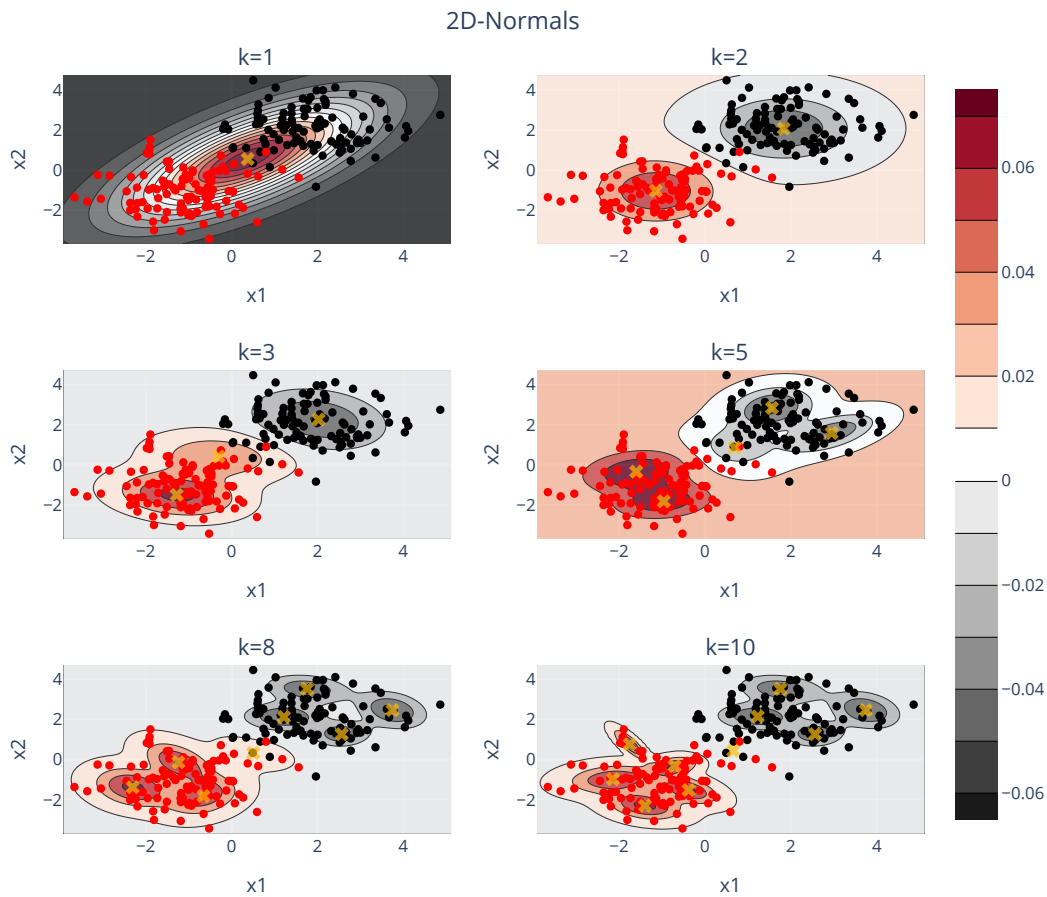
Modificou-se as classes nulas, bolinhas pretas, para classes  $-1$ , uma vez que foi percebido que essa alteração evitava erros quanto à matrizes singulares, durante o funcionamento do algoritmo.

Assim, plota-se a resposta obtida para os números de clusters:  $[1, 2, 3, 5, 8, 10]$ . Os centros obtidos pelo k-médias são mostrados como X's amarelos

```

[253]: Y[Y==0] = -1
dim_list = [1, 2, 3, 5, 8, 10]
fig2, surf_list = make_grid(X, Y, dim_list, '2D-Normals')
fig2.show(renderer = 'svg', width = 800, height = 700)

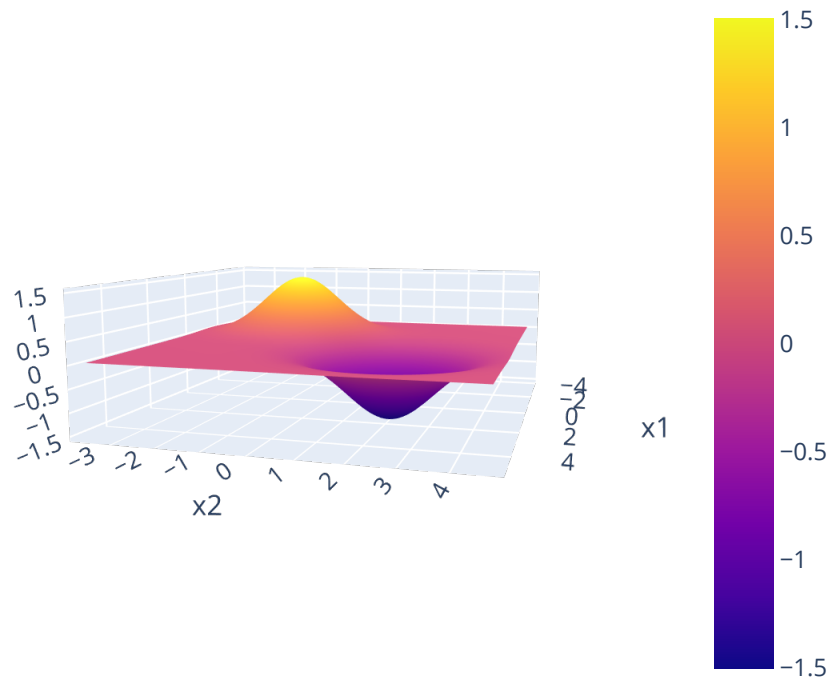
```



Observando o comportamento anterior, tomou-se como aproximações boas as redes com 2 e 3 *clusters*. As redes com 5, 8 e 10 aparentam superdimensionadas e a com 1 aparenta subdimensionada.

A fim de se visualizar a superfície formada pela rede RBF, tomou-se como base a rede com  $k = 2$ , que apresenta a seguinte superfície de resposta:

```
[254]: fig = go.Figure(go.Surface(x = surf_list[1][0], y = surf_list[1][1], z =
    ↪surf_list[1][2]))
fig.update_layout(autosize=False, scene_camera_eye=dict(x=3, y=0.88, z=0.44),
    ↪width=500, height=500, margin=dict(l=65, r=50, b=65, t=90))
fig.update_scenes(xaxis_title = {'text': 'x1'}, yaxis_title = {'text': 'x2'},
    ↪zaxis_title = {'text': 'y'})
fig.show(renderer = 'svg')
```

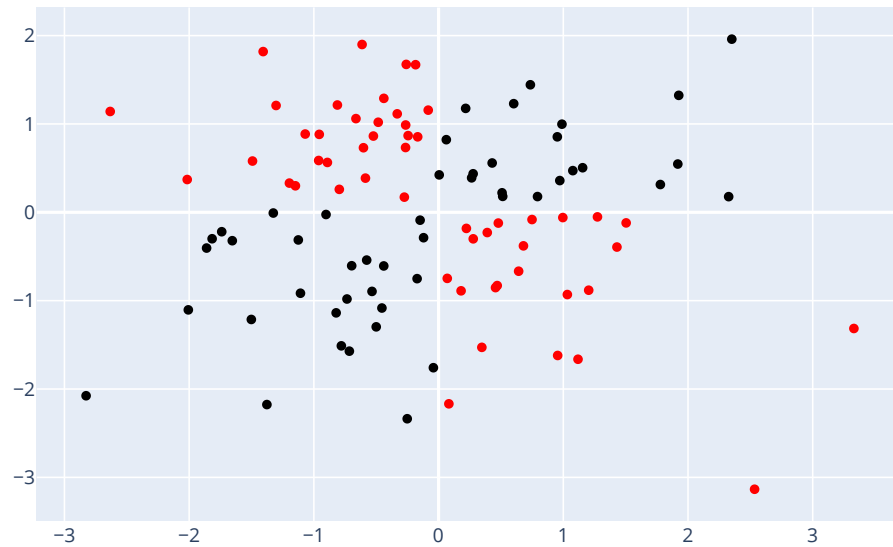


## 1.2 XOR

O segundo banco de dados utilizado foi o XOR:

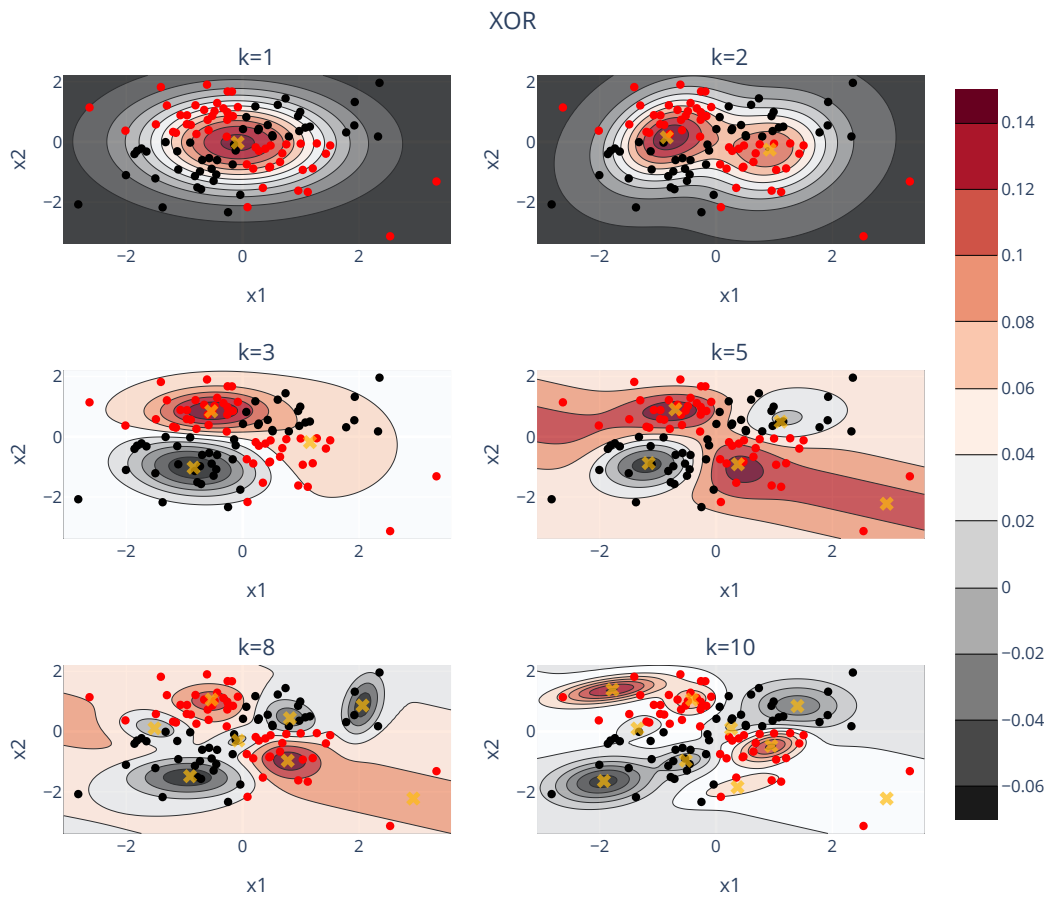
```
[446]: X = np.random.default_rng().standard_normal((100, 2))
Y = np.logical_xor(X[:, 0] > 0, X[:, 1] > 0).astype(int)

red_sample = go.Scatter(x=X[Y==1, 0], y=X[Y==1,1], mode = 'markers',
    ↪marker_color = 'red', showlegend = False)
black_sample = go.Scatter(x=X[Y==0,0], y=X[Y==0,1], mode = 'markers',
    ↪marker_color = 'black', showlegend = False)
fig = go.Figure(red_sample)
fig.add_trace(black_sample)
fig.show(renderer = 'svg')
```



Novamente, modificou-se as classes nulas para classes  $-1$ , correspondentes às bolinhas pretas e plotou-se as respostas para os números de clusters:  $[1, 2, 3, 5, 8, 10]$ . Novamente, os centros são identificados por X's amarelos:

```
[447]: Y[Y==0] = -1
dim_list = [1, 2, 3, 5, 8, 10]
fig2, surf_list = make_grid(X, Y, dim_list, 'XOR')
fig2.show(renderer = 'svg', width = 800, height = 700)
```

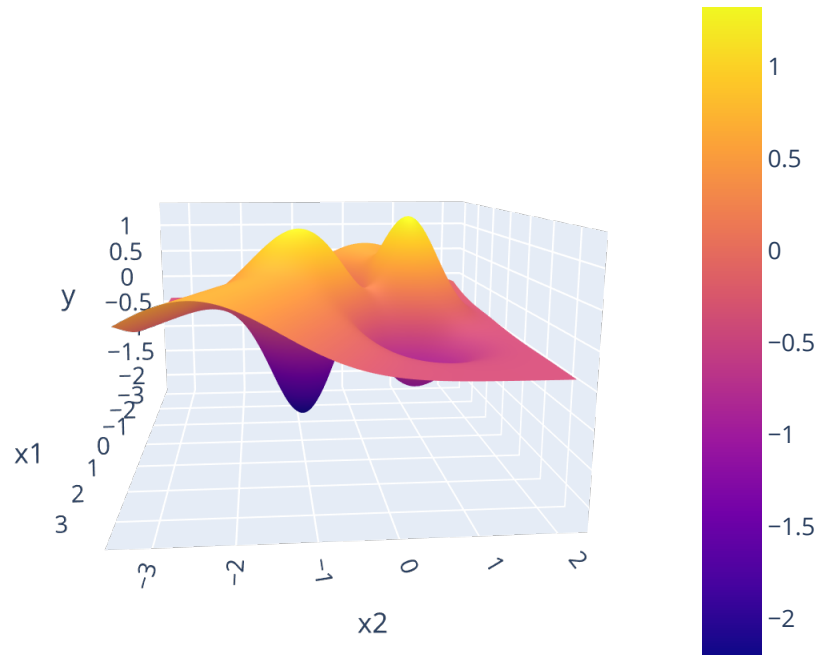


Observando o comportamento anterior, tomou-se como aproximações boas as redes com 5 *clusters*. As redes com 1, 2 e 3 aparentam subdimensionadas, enquanto as com 8 e 10 aparentam superdimensionadas.

A fim de se visualizar a superfície formada pela rede RBF, tomou-se como base a rede com  $k = 5$ , que apresenta a seguinte superfície de resposta:

```
[452]: fig = go.Figure(go.Surface(x = surf_list[3][0], y = surf_list[3][1], z = surf_list[3][2]))
fig.update_layout(autosize=False, scene_camera_eye=dict(x=2.4, y=-0.2, z=0.5),
width=500, height=500, margin=dict(l=65, r=50, b=65, t=90))
fig.update_scenes(xaxis_title = {'text': 'x1'}, yaxis_title = {'text': 'x2'},
zaxis_title = {'text': 'y'})
fig.show(renderer = 'svg')
```

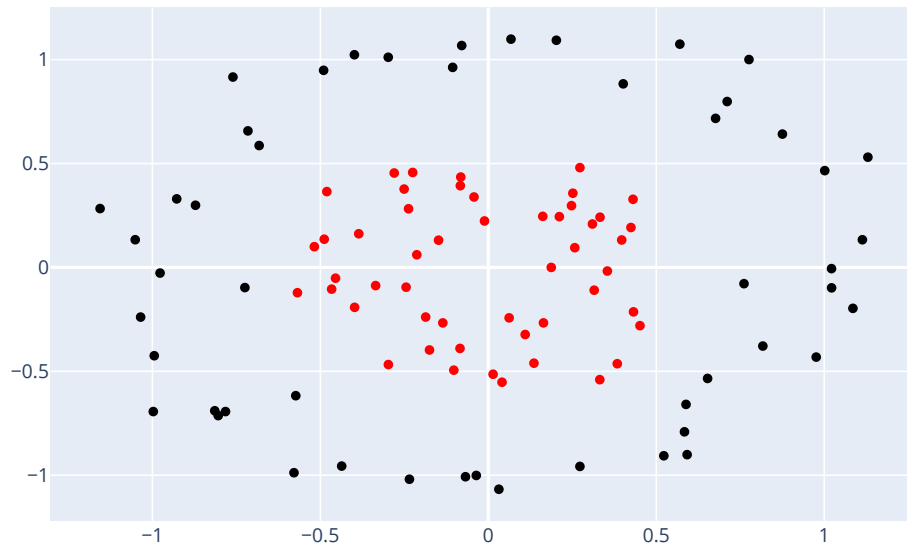




### 1.3 Circles

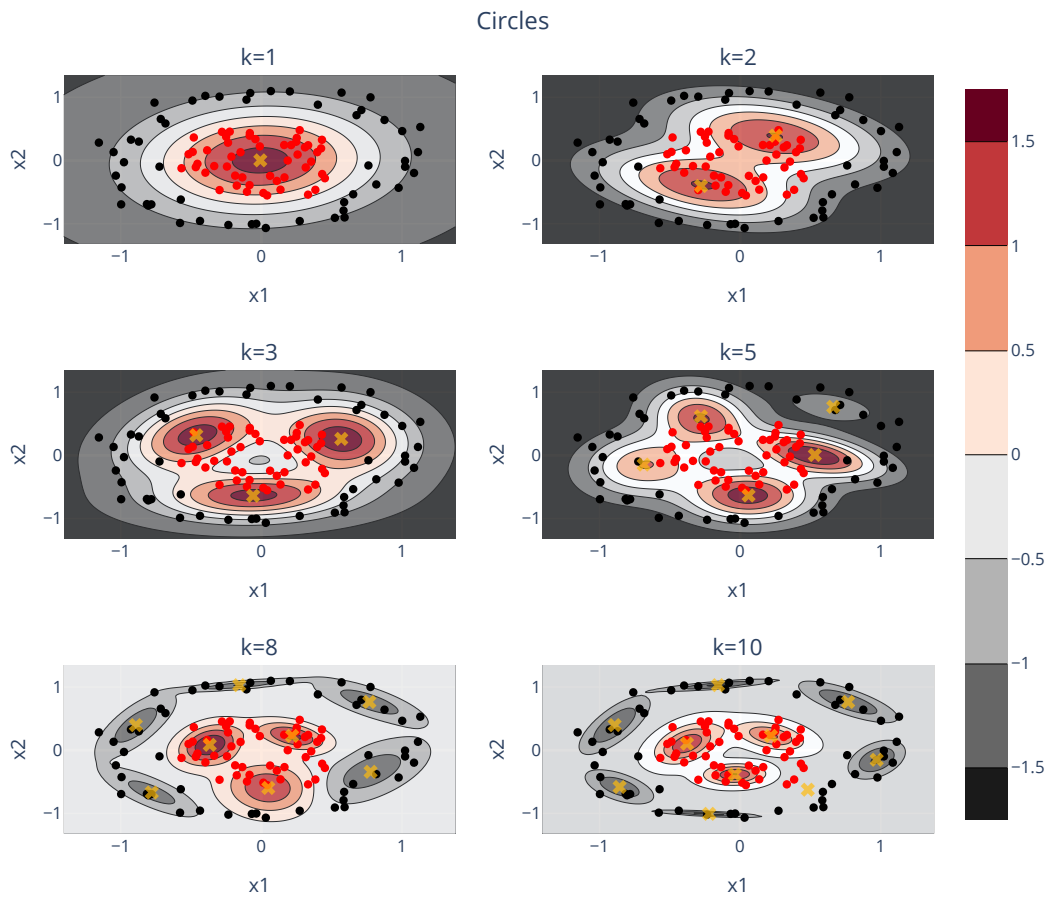
Em seguida, tomou-se a base de dados Circles:

```
[453]: X, Y = datasets.make_circles(noise = 0.12, factor = 0.4)
Y[Y==0] = -1
red_sample = go.Scatter(x=X[Y==1,0], y=X[Y==1,1], mode = 'markers',
    ↪marker_color = 'red', showlegend = False)
black_sample = go.Scatter(x=X[Y==-1,0], y=X[Y==-1,1], mode = 'markers',
    ↪marker_color = 'black', showlegend = False)
fig2 = go.Figure(red_sample)
fig2.add_trace(black_sample)
fig2.show(renderer = 'svg')
```



Novamente, obteve-se as repostas para [1, 2, 3, 5, 8, 10] *clusters*:

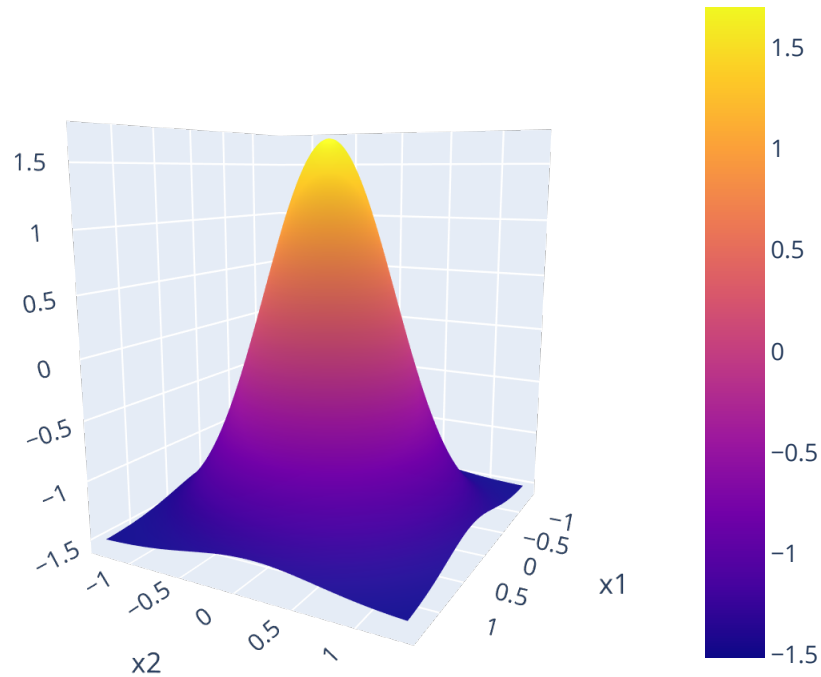
```
[454]: dim_list = [1, 2, 3, 5, 8, 10]
fig2, surf_list = make_grid(X, Y, dim_list, 'Circles')
fig2.show(renderer = 'svg', width = 800, height = 700)
```



Observando o comportamento anterior, tomou-se como aproximações boas as redes com 1 e 2 *clusters*. As redes com 3, 5, 8 e 10 aparentam estar superdimensionadas.

A fim de se visualizar a superfície formada pela rede RBF, tomou-se como base a rede com  $k = 1$ , que apresenta a seguinte superfície de resposta:

```
[455]: fig = go.Figure(go.Surface(x = surf_list[0][0], y = surf_list[0][1], z =
    ↪surf_list[0][2]))
fig.update_layout(autosize=False, scene_camera_eye=dict(x=2, y=1.08, z=0.44),
    ↪width=500, height=500, margin=dict(l=65, r=50, b=65, t=90))
fig.update_scenes(xaxis_title = {'text': 'x1'}, yaxis_title = {'text': 'x2'},
    ↪zaxis_title = {'text': 'y'})
fig.show(renderer = 'svg')
```



## 1.4 Spirals

Por último, utilizou-se os dados Spirals:

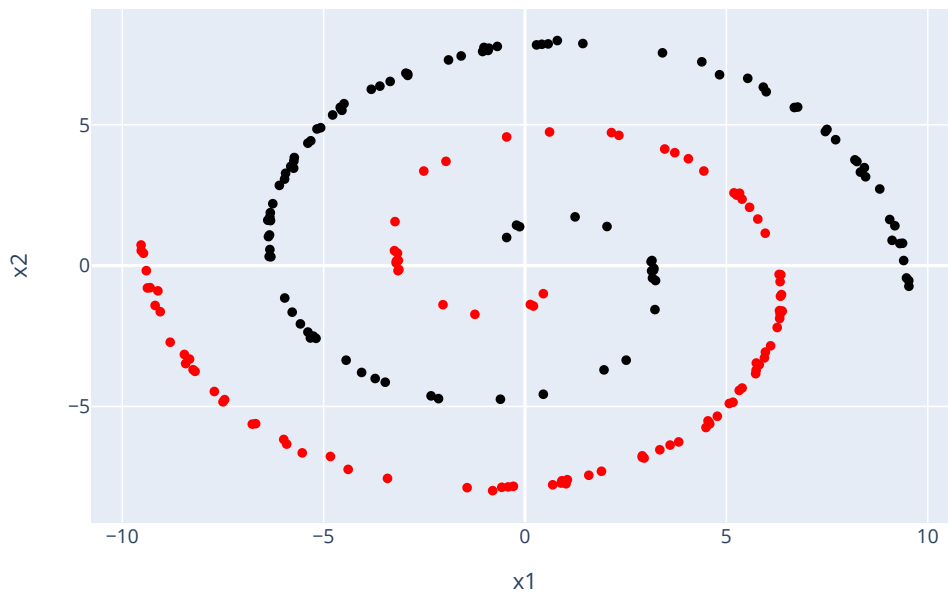
```
[270]: def twospirals(n_points, noise=0.5, factor = 1):
    # Returns the two spirals dataset.
    n = np.sqrt(np.random.rand(n_points,1)) * 780 * factor * (2*np.pi)/360
    d1x = -np.cos(n)*n + np.random.default_rng().standard_normal((n_points,1))
    ↪* noise
    d1y = np.sin(n)*n + np.random.default_rng().standard_normal((n_points,1))
    ↪noise
    return (np.vstack((np.hstack((d1x,d1y)),np.hstack((-d1x,-d1y)))),
            np.hstack((np.zeros(n_points),np.ones(n_points))))

X, Y = twospirals(100, 0.05, 0.7)
```

```

red_sample = go.Scatter(x=X[Y==1,0], y=X[Y==1,1], mode = 'markers',
    ↪marker_color = 'red', showlegend=False)
black_sample = go.Scatter(x=X[Y==0,0], y=X[Y==0,1], mode = 'markers',
    ↪marker_color = 'black', showlegend=False)
fig = go.Figure(red_sample)
fig.update_layout(xaxis={'title':'x1'}, yaxis={'title':'x2'})
fig.add_trace(black_sample)
fig.show(renderer = 'svg')

```



Tomou-se um procedimento análogo, porém, para essa base de dados a resposta da rede com apenas 1 *cluster* obteve valores muito pequenos, o que tornou a escala de cores péssima. Dessa forma, não se plotou a resposta para esse valor, que foi substituído por um número maior de *clusters*. Sendo assim, as respostas para  $k = [2, 3, 5, 8, 10, 15]$  são:

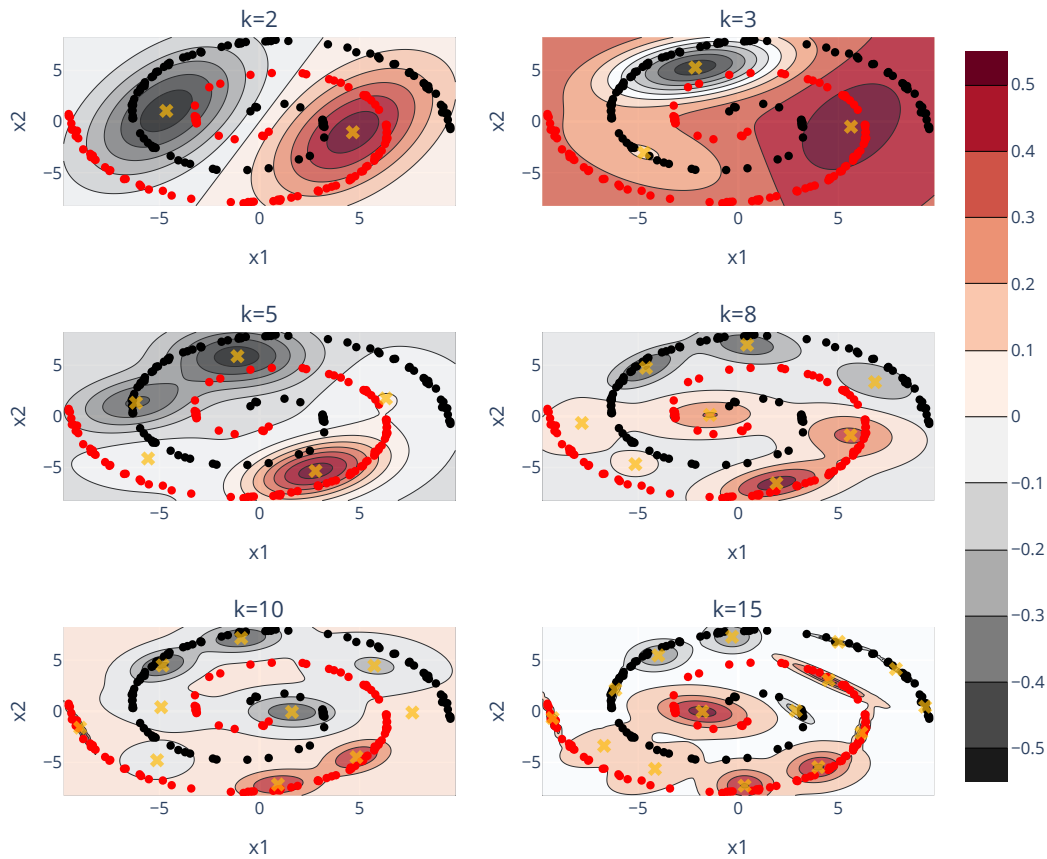
```

[308]: Y[Y==0] = -1

dim_list = [2, 3, 5, 8, 10, 15]
fig2, surf_list = make_grid(X, Y, dim_list, 'Spirals')
fig2.show(renderer = 'svg', width = 800, height = 700)

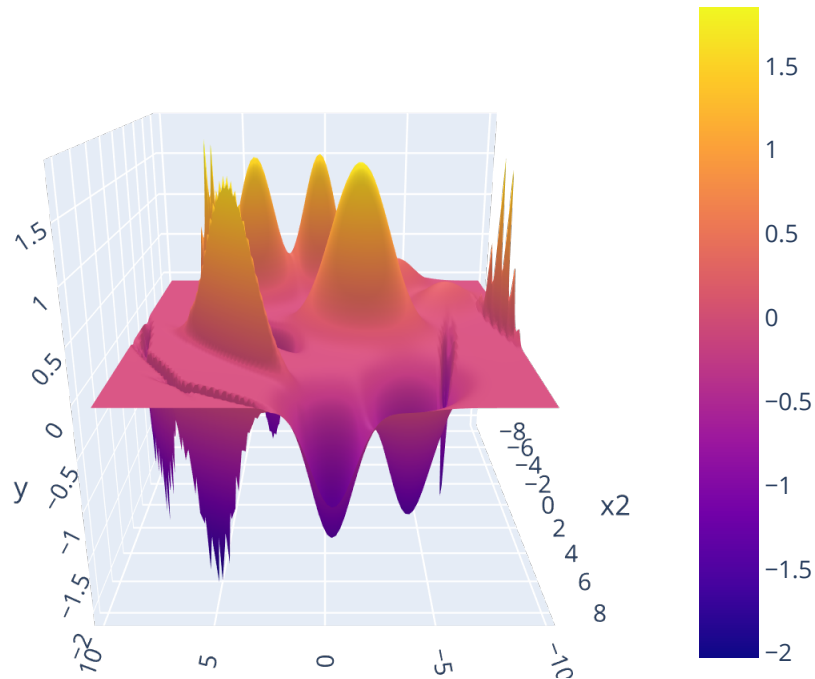
```

Spirals



Para essa base, é fácil notar que o desempenho é muito ruim para  $k < 10$ , porém, mesmo para  $k = 10, 15$  a resposta obtida não é excelente, havendo diversas amostras classificadas incorretamente. Dessa forma, tomou-se como superfície de interesse a gerada por  $k = 15$ , uma vez que é a resposta que mais aparenta “tentar” seguir um caminho espiral:

```
[321]: fig = go.Figure(go.Surface(x = surf_list[5][0], y = surf_list[5][1], z =
    ↳surf_list[5][2]))
fig.update_layout(autosize=False, scene_camera_eye=dict(x=0, y=2, z=0.7),
    ↳width=500, height=500, margin=dict(l=65, r=50, b=65, t=90))
fig.update_scenes(xaxis_title={'text':'x1'}, yaxis_title = {'text':'x2'},
    ↳zaxis_title = {'text':'y'})
fig.show(renderer = 'svg')
```

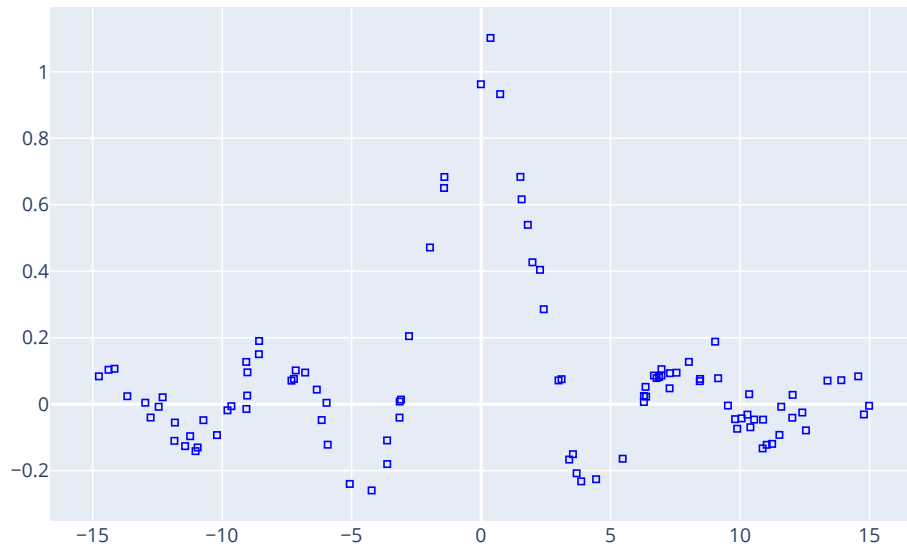


### 1.5 Aproximação da função $\text{sinc}$

Buscou-se aproximar uma função  $\text{sinc}(x)$ , por meio de um conjunto de dados randômicos e acrescidos de ruído gaussiano. Gerou-se as 100 amostras de treino apresentadas a seguir:

```
[1]: import numpy as np
import plotly.graph_objects as go
x = np.random.default_rng().uniform(-15, 15, 100)
noise = np.random.default_rng().normal(0, 0.05, 100)
y = np.sin(x)/x + noise
sort_idx = np.argsort(x)

train_data = go.Scatter(x = x, y = y, mode = 'markers', marker_color = 'blue',
    ↪marker_size = 4, marker_symbol = 'square-open', name='amostras')
fig = go.Figure(train_data)
fig.show(renderer = 'svg')
```



Por meio dos dados gerados, gerou-se, primeiramente, um modelo RBF para 5 neurônios intermediários com base nos dados gerados. A aproximação obtida pelo modelo foi testada para um novo conjunto, gerado da mesma forma, porém com 50 amostras.

A resposta obtida pelo modelo,  $\hat{y}$ , as amostras de treino e a resposta esperada  $\text{sinc}(x)$  são mostradas a seguir:

```
[12]: x = x.reshape((-1,1))
      y = y.reshape((-1,1))

      rbf = train_RBF(x,y,5)
      x_test = np.random.default_rng().uniform(-15, 15, 50).reshape((-1,1))
      y_test = np.sin(x_test)/x_test
      y_hat = eval_RBF(x_test, rbf)
      sort_idx = np.argsort(x_test, axis=0)

      x_p = x_test.flatten()[sort_idx.flatten()]
      y_t = y_test.flatten()[sort_idx.flatten()]
      y_p = y_hat.flatten()[sort_idx.flatten()]

      fig = go.Figure(go.Scatter(x=x_p, y=y_p, mode= 'lines', marker_color = 'red',
      ↪name = 'ŷ'))
```



```
fig.update_layout(xaxis_title = 'x', yaxis_title = 'y', title= {'text':'k = 5', 'x':0.5})
fig.add_trace(train_data)
fig.add_trace(go.Scatter(x = x_p, y=y_t, mode='lines', name='sinc(x)'))
fig.show()
```

O erro quadrático médio (MSE) obtido por essa aproximação foi igual a

```
[13]: print('MSE = ', float((y_hat - y_test).T @ (y_hat - y_test)/y_hat.shape[0]))

MSE = 0.05475804028606894
```

Em seguida, treinou-se, para os mesmos dados gerados, uma rede RBF com 10 neurônios na camada intermediária. Essa rede foi testada da mesma forma, com outros 50 dados de teste.

A resposta obtida pelo modelo,  $\hat{y}$ , as amostras de treino e a resposta esperada  $\text{sinc}(x)$  são mostradas a seguir:

```
[14]: rbf = train_RBF(x,y,10)
x_test = np.random.default_rng().uniform(-15, 15, 50).reshape((-1,1))
y_test = np.sin(x_test)/x_test
y_hat = eval_RBF(x_test, rbf)
sort_idx = np.argsort(x_test, axis=0)

x_p = x_test.flatten()[sort_idx.flatten()]
y_t = y_test.flatten()[sort_idx.flatten()]
y_p = y_hat.flatten()[sort_idx.flatten()]

fig = go.Figure(go.Scatter(x=x_p, y=y_p, mode= 'lines', marker_color = 'red',
    name = 'ŷ'))
fig.update_layout(xaxis_title = 'x', yaxis_title = 'y', title= {'text':'k = 10', 'x':0.5})
fig.add_trace(train_data)
fig.add_trace(go.Scatter(x = x_p, y=y_t, mode='lines', name='sinc(x)'))
fig.show()
```

Para 10 neurônios, obteve-se o seguinte MSE:

```
[15]: print('MSE = ', float((y_hat - y_test).T @ (y_hat - y_test)/y_hat.shape[0]))

MSE = 0.08658041366328482
```

Por último, testou-se o comportamento da rede RBF para 20 neurônios. A rede foi testada de maneira análoga à anterior e o gráfico obtido foi:

```
[16]: rbf = train_RBF(x,y,20)
x_test = np.random.default_rng().uniform(-15, 15, 50).reshape((-1,1))
y_test = np.sin(x_test)/x_test
y_hat = eval_RBF(x_test, rbf)
sort_idx = np.argsort(x_test, axis=0)
```

```

x_p = x_test.flatten()[sort_idx.flatten()]
y_t = y_test.flatten()[sort_idx.flatten()]
y_p = y_hat.flatten()[sort_idx.flatten()]

fig = go.Figure(go.Scatter(x=x_p, y=y_p, mode= 'lines', marker_color = 'red',
↪name = 'ŷ'))
fig.update_layout(xaxis_title = 'x', yaxis_title = 'y', title= {'text':'k =
↪20', 'x':0.5})
fig.add_trace(train_data)
fig.add_trace(go.Scatter(x = x_p, y=y_t, mode='lines', name='sinc(x)'))
fig.show()

```

Para esse número de *clusters*, obteve-se:

```
[17]: print('MSE = ', float((y_hat - y_test).T @ (y_hat - y_test)/y_hat.shape[0]))
```

```
MSE = 0.017162910291136285
```

Dessa forma, obteve-se como melhor aproximação, dentre as testadas, a rede RBF com 5 *clusters*, tendo como base o erro quadrático médio. Porém, não é possível afirmar que esse número de *clusters* forneça a melhor aproximação, uma vez que seria necessário um estudo de validação cruzada para que se pudesse afirmar com propriedade o melhor número de neurônios.

```
[9]: print(pio.renderers.default)
```

```
vscode
```

```
[ ]:
```