

UNIVERSIDAD DE SANTIAGO DE CHILE
FACULTAD DE INGENIERÍA
DEPARTAMENTO DE INGENIERÍA INFORMÁTICA

Análisis de la convergencia del algoritmo *simulated annealing* para redes
neuronales profundas

Propuesta de tesis

Nombre: Felipe Alberto Reyes González

Programa: Magíster en Ingeniería Informática

Profesor patrocinante: Victor Parada

Cel.: 890 26 317

email: felipe.reyesg@usach.cl

21 de mayo de 2017

Tabla de contenido

1. Descripción del problema	3
1.1. El perceptrón multicapa	3
1.1.1. Arquitectura	3
1.1.2. Propagación de la entrada y el algoritmo de retropropagación	4
2. Objetivos del proyecto	8
2.1. Objetivo general	8
2.2. Objetivos específicos	8
3. Descripción de la solución	8
3.1. Estado del arte	8
3.1.1. Métodos de búsqueda global	8
3.1.2. El modelo de memoria a corto y largo plazo	9
3.1.3. Preprocesamiento de la señal	10
3.2. Características de la solución	10
3.3. Propósitos de la solución	11
3.4. Alcances o limitaciones de la solución	11
4. Metodología, herramientas y ambiente de desarrollo	11
4.1. Metodología a usar	11
4.2. Herramientas de desarrollo	12
4.3. Ambiente de desarrollo	12
5. Plan de trabajo	13
Bibliografía	14

1 Descripción del problema

El elemento básico de las redes neuronales (*Neural Networks*, NN) es el nodo, que recibe un vector de entrada para producir una salida. Cada entrada tiene asociado un vector de pesos w , que se va modificando durante el proceso de aprendizaje. Cada unidad aplica una función f sobre la suma ponderada de las entradas ponderada donde el resultado puede servir como entrada de otras unidades.

Existen dos fases importante dentro del modelo

- Fase de entrenamiento: Se usa un conjunto de datos o patrones de entrenamiento para determinar los pesos que definen el modelo de la NN. Se calculan de manera iterativa, de acuerdo con los valores de entrenamiento, con el objeto de minimizar el error cometido entre la salida obtenida por la NN y la salida deseada.
- Fase de prueba: Durante el entrenamiento, el modelo se ajusta al conjunto de entrenamiento, perdiendo la habilidad de generalizar su aprendizaje a casos nuevos, a esta situación se le llama sobreajuste. Para evitar el sobreajuste, se utiliza un segundo grupo de datos diferentes, el conjunto de validación, que permitirá controlar el proceso de aprendizaje.

Los pesos óptimos se obtienen minimizando una función. Uno de los criterios utilizados es la minimización del error cuadrático medio entre el valor de salida y el valor real esperado.

1.1 El perceptrón multicapa

Dentro de las redes neuronales, el perceptrón multicapa es una de las arquitecturas más usadas para resolver problemas. Esto es debido a que poseen la capacidad de ser un aproximador universal (Marvin Minsky, 1987). Esto no implica que sea una de las redes más potentes o con mejores resultados, el perceptrón multicapa posee una serie de limitaciones, como el proceso de aprendizaje para problemas que dependan de un gran número de variables, la dificultad para realizar un análisis teórico de la red debido a la presencia de componentes no lineales y a la alta conectividad.

1.1.1 Arquitectura

El perceptrón multicapa posee una estructura de capas compuestas por neuronas. Cada una de las capas está formada por un conjunto de neuronas y se distinguen tres tipos de capas: la capa de entrada, las capas ocultas y la capa de salida.

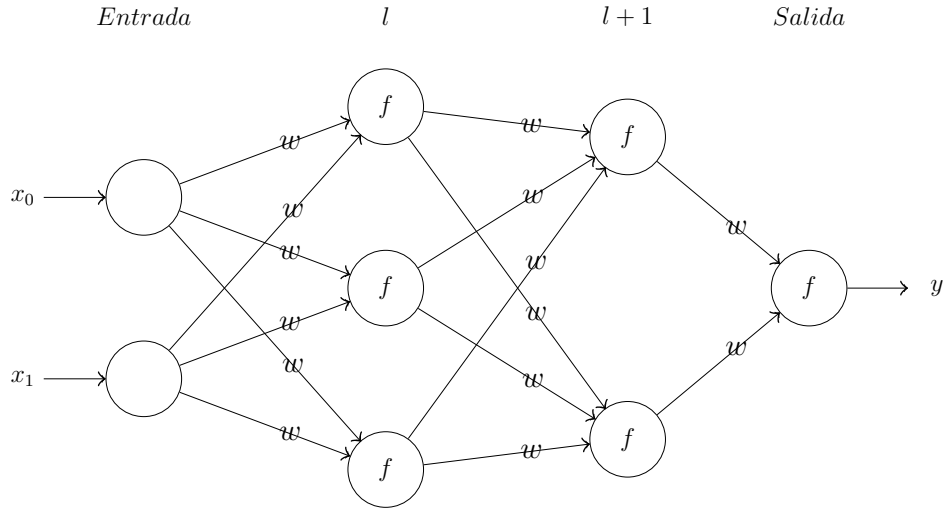


Figura 1: Perceptrón multicapa

En la figura 1 se observa que las conexiones van siempre hacia adelante. Las neuronas de la capa l se conectan con las neuronas de la capa $l + 1$. Las neuronas de la capa de entrada se encargan de recibir los patrones y propagar dichas señales a las neuronas de la capa siguiente. La última capa, la capa de salida, proporciona la respuesta de la red al patrón presentado. Las neuronas de las capas ocultas realizan el procesamiento de las señales generadas por el patrón de entrada.

1.1.2 Propagación de la entrada y el algoritmo de retropropagación

El perceptrón multicapa define una relación entre la entrada y la salida. Esta relación se obtiene propagando hacia adelante los valores de las variables de entrada, es por esto que también se les llama redes *feedforward*. Cada neurona de la red procesa la entrada recibida y produce una respuesta que se propaga, mediante las conexiones, hacia las neuronas de la capa siguiente.

Si un perceptrón multicapa con C capas y n_c neuronas en la capa c , donde $W_c = (w_{ij}^c)$ es la matriz de pesos, w_{ij}^c representará el peso de la conexión de la neurona i de la capa c hasta la neurona j de la capa siguiente. Denotaremos a_i^c a la activación de la neurona i de la capa c que se

calcula de la siguiente manera:

- **Activación de una neurona de la capa de entrada:** Las neuronas se encargan de transmitir la entrada recibida, por lo tanto

$$a_i^1 = x_i, i = 1, 2, \dots, n$$

donde $X = (x_1, x_2, \dots, x_n)$ representa el vector de entrada.

- **Activación de una neurona de la capa oculta:** Las neuronas de una capa oculta procesa la información recibida aplicando la función de activación f a la suma de los productos de la entrada por sus pesos, es decir

$$a_i^c = f \left(\sum_{j=1}^{n_{c-1}} w_{ji}^{c-1} a_j^{c-1} + \theta_i^c \right), i = 1, 2, \dots, n_c; c = 2, 3, \dots, C - 1$$

donde a_j^{c-1} es la salida de la capa anterior a c .

- **Activación de una neurona de la capa de salida:** La activación de una neurona de la capa de salida viene dada por la función de activación f aplicada a la suma de los productos de la entrada por sus pesos, es decir

$$y_i = a_i^c = f \left(\sum_{j=1}^{n_{c-1}} w_{ji}^{C-1} a_j^{C-1} + \theta_i^C \right), i = 1, \dots, n_c$$

donde $Y = (y_1, y_2, \dots, y_{n_c})$ es el vector de salida.

La función f es la función de activación de la neurona. Las funciones de activación mas utilizadas son la sigmoideal y la tangente hiperbólica, descritas en las ecuaciones 1 y 2 respectivamente.

$$f_{sigm}(x) = \frac{1}{1 + \exp(-x)} \quad (1)$$

$$f_{tanh}(x) = \frac{1 - \exp(-x)}{1 + \exp(-x)} \quad (2)$$

Ambas funciones poseen como imagen intervalo de valores entre $[0, 1]$ y $[-1, 1]$ como se observa en la figura 2.

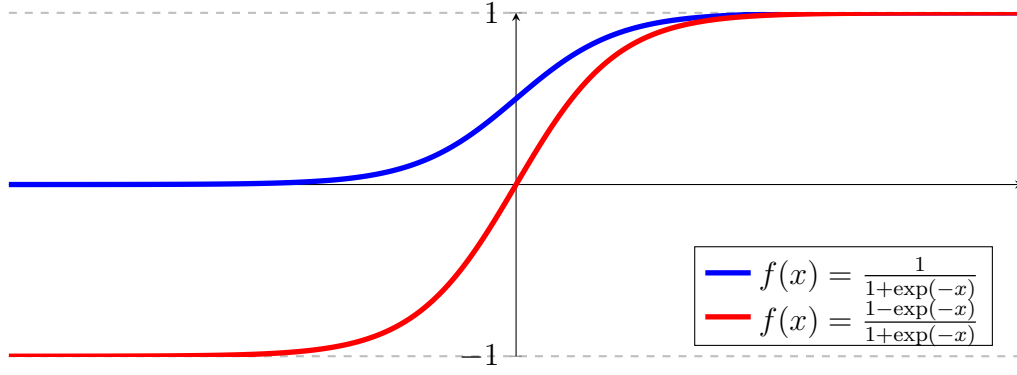


Figura 2: Funciones de activación mas utilizadas.

El perceptrón multicapa actualiza sus pesos en función de una regla de aprendizaje, de tal manera que los nuevos pesos permitan reducir el error de salida. Por tanto, para cada patrón de entrada a la red es necesario disponer de un patrón de salida deseada. El objetivo es que la salida de la red sea lo más próxima posible a la salida deseada, debido a esto es que el aprendizaje de la red se describe como un problema de minimización de la siguiente manera

$$\min_W E$$

donde W es el conjunto de parámetros de la red (pesos y umbrales) y E es una función de error que evalúa la diferencia entre las salidas de la red y las salidas deseadas. En la mayor parte de los casos, la función de error se define como:

$$E = \frac{1}{N} \sum_{i=1}^N e(i) \quad (3)$$

Donde N es el número de muestras y $e(n)$ es el error cometido por la red para el patrón i , definido de la siguiente manera

$$e(i) = \frac{1}{n_C} \sum_{j=1}^{n_C} (s_j(i) - y^j(n))^2 \quad (4)$$

Siendo $Y(i) = (y_1(i), y_2(i), \dots, y_{n_C}(i))$ y $S(i) = (s_1(i), s_2(i), \dots, s_{n_C}(i))$ los vectores de salida y salidas deseadas para el patrón i respectivamente.

De esta manera, si W^* es un mínimo de la función de error E , en dicho punto el error

será cercano a cero, y en consecuencia, la salida de la red será próxima a la salida deseada. La presencia de funciones de activación no lineales hace que la respuesta de la red sea no lineal respecto a los parámetros ajustables, por lo que el problema de minimización es un problema no lineal y se hace necesario el uso de técnicas de optimización no lineales para su resolución.

Las técnicas utilizadas suelen basarse en la actualización de los parámetros de la red mediante la determinación de una dirección de búsqueda. En el caso de las redes neuronales multicapa, la dirección de búsqueda más utilizada se basa en la dirección contraria del gradiente de la función de error E , el método de gradiente descendente.

Si bien el aprendizaje de la red busca minimizar el error total de la red, el procedimiento está basado en métodos del gradiente estocástico, que son una sucesión de minimizaciones del error $e(i)$ por cada patrón, en lugar de minimizar el error total E de la red. Aplicando el método del gradiente estocástico, cada parámetro w se modifica para cada patrón de entrada n según la siguiente regla de aprendizaje

$$w(i) = w(n - 1) - \alpha \frac{\partial e(i)}{\partial w} \quad (5)$$

donde $e(i)$ es el error para el patrón de entrada i dado por la ecuación 4, y α es la tasa de aprendizaje, éste último determina el desplazamiento en la superficie del error.

Como las neuronas están ordenadas por capas y en distintos niveles, es posible aplicar el método del gradiente de forma eficiente, resultando en el *algoritmo de retropropagación* (Rumelhart, Hinton, y Williams, 1986) o *regla delta generalizada*. El término retropropagación es utilizado debido a la forma de implementar el método del gradiente en las redes multicapa, pues el error cometido en la salida de la red es propagado hacia atrás, transformándolo en un error para cada una de las neuronas ocultas de la red.

El algoritmo de retropropagación es el método de entrenamiento más utilizado en redes con conexión hacia adelante. Es un método de aprendizaje supervisado, en el que se distinguen claramente dos fases:

1. Se aplica un patrón de entrada, el cual se propaga por las distintas capas que componen la red hasta producir la salida de la misma. Esta salida se compara con la salida deseada y se calcula el error cometido por cada neurona de salida.

2. Estos errores se transmiten desde la capa de salida, hacia todas neuronas de las capas anteriores (Fritsch, 1996). Cada neurona recibe un error que es proporcional a su contribución sobre el error total de la red. Basándose en el error recibido, se ajustan los errores de los pesos sinápticos de cada neurona.

2 Objetivos del proyecto

2.1 Objetivo general

Evaluar el desempeño del algoritmo *simulated annealing* y su efecto sobre entrenamiento de redes neuronales profundas.

2.2 Objetivos específicos

Los objetivos establecidos para el presente trabajo son descritos a continuación

1. Definir las reglas de aprendizaje a implementar.
2. Construir los conjuntos de datos de entrada y salida a analizar.
3. Establecer los parámetros de las redes neuronales para la experimentación.
4. Entrenar las redes con los distintos conjuntos de datos.
5. Establecer las conclusiones del trabajo.

3 Descripción de la solución

3.1 Estado del arte

Muchos de los métodos utilizados (Elman, 1990; Schmidhuber, 1992; Pearlmutter, 1989, 1995) sufren del desvanecimiento del gradiente. Para solventar el problema hay diversos métodos que lo evitan.

3.1.1 Métodos de búsqueda global

Los métodos de búsqueda global no utilizan el gradiente. Métodos como *simulated annealing* (SA), *multi-grid random search* (Bengio, Simard, y Frasconi, 1994) y *random weight*

guessing (Schmidhuber y Hochreiter, 1996) han sido investigados. Se ha encontrado que los métodos de búsquedas globales funcionan bien en problemas que involucren dependencias a largo plazo y que además utilizan redes que contienen pocos parámetros y no precisan de alta precisión en sus calculos.

El método SA es un algoritmo de búsqueda meta-heurística para problemas de optimización global. La técnica está basada en el proceso de calentamiento de un metal, vidrio o cristal hasta su punto de fusión, para luego enfriarlo hasta obtener una estructura cristalina. El algoritmo 1 describe el procedimiento de la siguiente manera: dada una solución inicial se genera un conjunto de soluciones que son una perturbación de la solución actual, al evaluar cada perturbación se actualizará la solución actual en caso de que la perturbación sea mejor que la solución actual, y en caso contrario, existirá una probabilidad de que la solución actual sea actualizada de igual manera.

Algoritmo 1: Simulated annealing

Entrada: Temperatura T , constante de Boltzmann k , factor de reducción c

```

1  Seleccionar el mejor vector solución  $x_0$  a optimizar
2  Mientras El criterio no se cumpla hacer
3      Mientras Existan soluciones en el conjunto hacer
4          Seleccionar una solución  $x_0 + \Delta x$ 
5          si  $f(x_0 + \Delta x) < f(x_0)$  entonces
6               $f_{new} = f(x_0 + \Delta x)$ ;  $x_0 = x_0 + \Delta x$ 
7          en otro caso
8               $\Delta f = f(x_0 + \Delta x) - f(x_0)$ 
9              si  $rand(0, 1) > \exp(-\Delta f / kT)$  entonces
10                  $f_{new} = f(x_0 + \Delta x)$ ;  $x_0 = x_0 + \Delta x$ 
11             en otro caso
12                  $f_{new} = f(x_0)$ 
13             fin
14         fin
15          $f = f_{new}$ ;  $T = cT$ 
16     fin
17 fin

```

3.1.2 El modelo de memoria a corto y largo plazo

Hochreiter y Schmidhuber (1997) introdujeron el modelo de memoria a corto y largo plazo (*Long short-term memory*, LSTM) como solución al problema del devanecimiento del gra-

diente. La red LSTM se basa en el bloque de memoria, que se compone de una o más celdas de memoria, una compuerta de entrada y una compuerta de salida. Las entradas son unidades multiplicativas con activación continua y son compartidas por todas las celdas de un mismo bloque de memoria. Cada celda contiene una unidad lineal con una conexión recurrente local llamada carrusel de error constante (CEC), se conocerá como estado de la celda a la activación del CEC.

Cada celda recibe una entrada ponderada por los pesos correspondientes a la capa anterior. La compuerta de entrada se encarga de permitir o impedir el acceso de estos valores al CEC del interior de la celda. La compuerta de salida realiza una acción similar sobre la salida de la celda, tolerando o reprimiendo la difusión del estado del CEC al resto de la red.

Los bloques de memoria configuran una red LSTM, donde no se indican los sesgos de las distintas neuronas del modelo. La existencia de las conexiones con pesos $W^{y,u}$ determina la naturaleza de la red. Así, si se permite la existencia de esta conexión, la red LSTM se puede considerar como una máquina neuronal de estados de MEaly, si no se permite, la red LSTM puede considerarse como una máquina neuronal de estados de Moore. El estado de la red LSTM está formado por las activaciones de las compuertas, el CEC y las celdas de los bloques de memoria.

3.1.3 Preprocesamiento de la señal

Squartini, Hussain, y Piazza (2003) propone pre-procesar la señal de entrada a través de una descomposición wavelet, buscando separar la información a corto plazo de la información a largo plazo, y entrenando diferentes NN. Los resultados son combinados para alcanzar el objetivo final. Este enfoque simplifica el proceso de aprendizaje de la NN, evitando cambios relevantes en la arquitectura de la red y las técnicas de aprendizaje.

3.2 Características de la solución

La solución propone un análisis práctico de la convergencia de las redes neuronales profundas mediante la aplicación de la regla de aprendizaje basada en el algoritmo *simulated annealing*. El análisis se realizará sobre conjuntos de datos de diferente índole, utilizados en otras investigaciones. Se comparará su desempeño frente a otras reglas de aprendizaje definidas en la literatura.

3.3 Propósitos de la solución

El propósito del presente trabajo es analizar la convergencia de las redes neuronales profundas, determinando el comportamiento de diferentes reglas de aprendizaje.

3.4 Alcances o limitaciones de la solución

Los alcances y limitaciones descritos para el trabajo son los siguientes

- El estudio se plantea desde una perspectiva práctica, precisando conjuntos de datos acotados.
- Los datos que se utilizarán son utilizados por Morse y Stanley (2016) en su publicación.
- Se estudiarán las reglas de aprendizaje definidas por el gradiente estocástico y *simulated annealing*.
- Las redes neuronales utilizarán la misma configuración para todos los experimentos salvo por la regla de aprendizaje.

4 Metodología, herramientas y ambiente de desarrollo

A continuación se especifica la metodología, herramientas y ambientes de desarrollo que se utilizarán para llevar a cabo el proyecto.

4.1 Metodología a usar

Considerando el aspecto investigativo del trabajo, se considera la utilización del método científico. Entre las actividades que componen la metodología, Sampieri (2006) describe los siguientes pasos para desarrollar una investigación:

- Formulación de la hipótesis: Los modelos lineales y no lineales que aprenden el comportamiento de la autorregulación del flujo sanguíneo cerebral se comportan distinto cuando se utilizan diferentes bandas de frecuencias.
- Marco teórico: Una revisión de la literatura donde se aborda el problema planteado, para situarse en el contexto actual de los problemas. Se describirán los modelos que permiten establecer relaciones entre las componentes de la autorregulación cerebral dinámica.

- Diseño de la solución: Se deberá diseñar el experimento para generar los modelos y preparar las señales para su evaluación. Diseñar y ejecutar el experimento provocando ruido en las señales utilizadas.
- Análisis y verificación de los resultados: Los resultados se analizarán considerando métodos estadísticos con un valor $p < 0,05$ que será considerado como diferencia significativa.
- Presentación de los resultados: Se presentarán tablas que describan los resultados obtenidos y que se consideren pertinentes.
- Conclusiones obtenidas en el desarrollo de la investigación.

4.2 Herramientas de desarrollo

Para el desarrollo y ejecución de los experimentos se utilizará un equipo con las siguientes características

Sistema Operativo	Solus 2017.04.18.0 64-bit
Procesador	Intel® Core™i5-2450M CPU @ 2.50GHz x 4
RAM	7.7Gb
Gráficos	Intel® Sandybridge Mobile
Almacenamiento	935,6 GB

El software que se utilizará es:

- Software: Entorno para computación y gráficos estadísticos R.
- Herramienta ofimática: \LaTeX .

4.3 Ambiente de desarrollo

El desarrollo de la investigación se realizará en el Departamento de Ingeniería Informática de la Universidad de Santiago de Chile, el cual cuenta con una biblioteca y un laboratorio de computación con acceso a internet, para la recopilación de información y para el desarrollo del experimento. Además, se utilizará el hogar del autor, donde se ubica el equipo de desarrollo a utilizar.

5 Plan de trabajo

La planificación del trabajo de investigación, se indica en una carta Gantt que se puede apreciar en la Tabla 1, donde se fija como fecha de inicio el día 12 de marzo de 2016 con fecha de término el día 30 de Junio de 2016. En un regimen de trabajo que considera periodos de 5 horas diarias de trabajo promedio, los 7 días de la semana, lo que equivale a un total de 640 horas de trabajo.

Tabla 1: Carta Gantt

TAREA	FECHA INICIO	FECHA TÉRMINO	DURACIÓN (DÍAS)
PROYECTO DE TESIS	07-03-16	24-06-16	—
Inicio	07-03-16	08-03-16	2
Reunión con el profesor	07-03-16	07-03-16	1
Inscripción del tema	08-03-16	08-03-16	1
Estado del arte	09-03-16	29-03-16	21
Revisión bibliográfica	09-03-16	18-03-16	10
Reunión con el profesor	19-03-16	19-03-16	1
Marco teórico	20-03-16	29-03-16	10
Desarrollo de la solución	30-03-16	24-04-16	26
Análisis	30-03-16	02-04-16	4
Diseño	03-04-16	06-04-16	4
Implementación	07-04-16	16-04-16	10
Pruebas	17-04-16	19-04-16	3
Correcciones	20-04-16	22-04-16	3
Reunión con el profesor	23-04-16	23-04-16	1
Redacción del análisis, diseño e implementación	24-04-16	24-04-16	1
Experimentos	25-04-16	25-05-16	31
Calibración de parámetros	25-04-16	29-04-16	5
Experimentación	30-04-16	14-05-16	15
Reunión con el profesor	15-05-16	15-05-16	1
Redacción de la experimentación	16-05-16	25-05-16	10
Análisis de resultados	26-05-16	08-06-16	14
Análisis detallado	26-05-16	29-05-16	4
Interpretación de los resultados	30-05-16	02-06-16	4
Reunión con el profesor	03-06-16	03-06-16	1
Redación de los resultados	04-06-16	08-06-16	5
Documento final	09-06-16	24-06-16	16
Redacción de la conclusión	09-06-16	10-06-16	2
Revisión del documento	11-06-16	17-06-16	7
Presentación al profesor	18-06-16	18-06-16	1
Correcciones	19-06-16	22-06-16	4
Versión final	23-06-16	23-06-16	1
Entrega del documento	24-06-16	24-06-16	1

Bibliografía

- Bengio, Y., Simard, P., y Frasconi, P. (1994, Mar). Learning long-term dependencies with gradient descent is difficult. *IEEE Transactions on Neural Networks*, 5(2), 157-166. doi: 10.1109/72.279181
- Elman, J. L. (1990). Finding structure in time. *Cognitive Science*, 14(2), 179 - 211. Descargado de <http://www.sciencedirect.com/science/article/pii/036402139090002E> doi: [https://doi.org/10.1016/0364-0213\(90\)90002-E](https://doi.org/10.1016/0364-0213(90)90002-E)
- Fritsch, J. (1996). *Modular neural networks for speech recognition* (Masters Thesis). KIT.
- Hochreiter, S., y Schmidhuber, J. (1997, noviembre). Long short-term memory. *Neural Comput.*, 9(8), 1735–1780. Descargado de <http://dx.doi.org/10.1162/neco.1997.9.8.1735> doi: 10.1162/neco.1997.9.8.1735
- Marvin Minsky, S. A. P. (1987). *Perceptrons: An introduction to computational geometry* (Expanded ed.). The MIT Press.
- Morse, G., y Stanley, K. O. (2016). Simple evolutionary optimization can rival stochastic gradient descent in neural networks. En *Proceedings of the genetic and evolutionary computation conference 2016* (pp. 477–484). New York, NY, USA: ACM. Descargado de <http://doi.acm.org/10.1145/2908812.2908916> doi: 10.1145/2908812.2908916
- Pearlmutter, B. A. (1989, June). Learning state space trajectories in recurrent neural networks. *Neural Computation*, 1(2), 263-269. doi: 10.1162/neco.1989.1.2.263
- Pearlmutter, B. A. (1995, Sep). Gradient calculations for dynamic recurrent neural networks: a survey. *IEEE Transactions on Neural Networks*, 6(5), 1212-1228. doi: 10.1109/72.410363
- Rumelhart, D. E., Hinton, G. E., y Williams, R. J. (1986). Learning representations by back-propagating errors. *Nature*, 323, 533–536.
- Sampieri, R. (2006). *Metodología de la investigación*. México: McGraw Hill.
- Schmidhuber, J. (1992). A fixed size storage $O(n^3)$ time complexity learning algorithm for fully recurrent continually running networks. *Neural Computation*, 4, 243-248.
- Schmidhuber, J., y Hochreiter, S. (1996). *Guessing can outperform many long time lag algorithms* (Inf. Téc.).
- Squartini, S., Hussain, A., y Piazza, F. (2003, May). Preprocessing based solution for the vanishing gradient problem in recurrent neural networks. En *Circuits and systems, 2003. iscas '03*.

proceedings of the 2003 international symposium on (Vol. 5, p. V-713-V-716 vol.5). doi:
10.1109/ISCAS.2003.1206412