

# TAnoGAN: Time Series Anomaly Detection with Generative Adversarial Networks

## TAnoGAN: Time Series Anomaly Detection with Generative Adversarial Networks

Md Abul Bashar School of Computer Science Centre for Data Science Queensland University of Technology Brisbane, Queensland 4000, Australia Email: m1.bashar@qut.edu.au Richi Nayak
School of Computer Science
Centre for Data Science
Queensland University of Technology
Brisbane, Queensland 4000, Australia
Email: r.nayak@qut.edu.au

Abstract—Anomaly detection in time series data is a significant problem faced in many application areas such as manufacturing, medical imaging and cyber-security. Recently, Generative Adversarial Networks (GAN) have gained attention for generation and anomaly detection in image domain. In this paper, we propose a novel GAN-based unsupervised method called TAnoGan for detecting anomalies in time series when a small number of data points are available. We evaluate TAnoGan with 46 real-world time series datasets that cover a variety of domains. Extensive experimental results show that TAnoGan performs better than traditional and neural network models.

time series data [10]. Recently a GAN framework coupled with the mapping of data to latent space has been explored for anomaly detection [3], [2]. While GAN has been extensively investigated in image domain for generation and anomaly detection, only a few works (e.g. [10], [2]) have explored the potential of GAN in time series domain.

In this paper, we propose a novel method, Time series Anomaly detection with GAN (TAnoGan)<sup>1</sup>, for unsupervised anomaly detection in time series data when a small number of

1 / 논문 리뷰

### **Abstract**

Abstract—Anomaly detection in time series data is a significant problem faced in many application areas such as manufacturing, medical imaging and cyber-security. Recently, Generative Adversarial Networks (GAN) have gained attention for generation and anomaly detection in image domain. In this paper, we propose a novel GAN-based unsupervised method called TAnoGan for detecting anomalies in time series when a small number of data points are available. We evaluate TAnoGan with 46 real-world time series datasets that cover a variety of domains. Extensive experimental results show that TAnoGan performs better than traditional and neural network models.

- 1. 시계열 데이터에서의 이상탐지는 제조, 의료영상, 사이버 보안 등 여러 분야에서 직면하는 문제이다.
- 2. 최근 GAN(Generative Adversarial Networks) 은 이미지 분야에서 생성 및 이상탐지와 관련해 주 목을 받고 있다.
- 3. 본 논문에서는 적은 수의 데이터를 가진 시계열에 서의 이상탐지에 대해 TAnoGAN이라고 불리는 GAN기반의 비지도 학습 모델을 제시한다.
- 4. 46개의 다양한 도메인 데이터를 이용해 TAnoGAN을 평가하였으며, 여러 실험에서 TAnoGAN이 지곤의 신경망 모델들보다 성능이 우수하다는 것을 보여준다.

# 2 / 코드 리뷰, 모델구성

※ <a href="https://github.com/mdabashar/TAnoGAN">https://github.com/mdabashar/TAnoGAN</a> source코드를 따라 단계별 Pytorch 코드 리뷰와 모델 구성을 파악하였습니다.

### 1. NabDataset

- 스트리밍 실시간 애플리케이션에서 이상 탐지를 위한 알고리즘을 평가하기 위한 새로운 벤치마트
- 50개 이상의 라벨이 붙은 실제 및 인공 시계열 데이터 파일과 실시간 애플리케이션을 위해 설계된 새로운 scoring mechanism으로 구성
- NabDataset 중 realKnownCause 분류에 속하는 ambient\_temperature\_system\_failure.csv을 사용
- realKnownCause는 이상 원인에 대해 알고 있는 데이터, no hand labeling
- ambient\_temperature\_system\_failure은 사무실 환경의 주변 온도를 나타냄
- 7207개의 행으로 구성
- Counter( {0.0: 6363, 1.0: 844})로 구성돼 844개의 이상치가 존재

#### <ambient\_temperature\_system\_failure>

timestamp	value
2013-07-04 0:00	69.88084
2013-07-04 1:00	71.22023
2013-07-04 2:00	70.8778
2013-07-04 3:00	68.9594
2013-07-04 4:00	69.28355
2013-07-04 5:00	70.06097
2013-07-04 6:00	69.27976
2013-07-04 7:00	69.36961
2013-07-04 8:00	69.16671
2013-07-04 9:00	68.98608
2013-07-04 10:00	69.96506
2013-07-04 11:00	70.55619
2013-07-04 12:00	70.30751
2013-07-04 13:00	70.24625
2014-05-28 15:00	72.58409

### 1. NabDataset

Real data	realAWSCloudwatch		AmazonCloudwatch 서비스에서 수집한 CPU사용 등 AWS 서버 측정						
	realAdExchange		온라인 광고 클릭률: 클릭당 비용(CPC) 및 1,000개당 비용(CPM)						
	realKnownCause	ambient_temperature_system_failure.csv	사무실 환경의 주변 온도						
		cpu_utilization_asg_misconfiguration.csv	AWS(Amazon Web Services)에서 CPU 사용량 모니터링						
		ec2_request_latency_system_failure.csv	Amazon의 East Coast 데이터 센터에 있는 서버의 CPU 사용량 데이터						
		machine_temperature_system_failure.csv	대형 산업용 기계의 내부 구성 요소의 온도 센서 데이터						
		nyc_taxi.csv	NYC 마라톤, 추수감사절, 크리스마스, 설날 및 눈폭풍 동안 5가지 이상 현상이 발생하는 NYC 택시 승객의 수						
		rogue_agent_key_hold.csv	Timing the key holds for several users of a computer						
		rogue_agent_key_updown.csv	Timing the key strokes for several users of a computer						
	realTraffic		미네소타 트윈 시티 메트로 지역의 실시간 교통 데이터, 특정 센서의 승객, 속도 및 이동 시간이 포함						
	realTweets		구글과 IBM과 같은 대형 상장 기업들의 트위터 언급 모음, 매 5분마다 지정된 눈금 기호에 대한 언급 수						
Artificial data	artificialNoAnomaly		이상 현상 없이 인위적으로 생성된 데이터						
	artificialWithAnomaly		다양한 유형의 변칙으로 인위적으로 생성된 데이터						

pytorch의 Dataset을 상속받아 데이터를 구성

#### **Class NabDataset(Dataset):**

```
def read_data(self, data_file=None, label_file=None, key=None, BASE=''):
    with open(BASE+label_file) as FI:
        j_label = json.load(FI)
    ano_spans = j_label[key]
    self.ano_span_count = len(ano_spans)
    df_x = pd.read_csv(BASE+data_file)
    df_x, df_y = self.assign_ano(ano_spans, df_x)
return df_x, df_y
```

- ① NabDataset의 50가지 데이터 Label 정보는 labels/combined\_windows.json에 집합형태로 저장되어 있다. Appendix에 파일형태 첨부
- ② Ex)"realKnownCause/ambient\_temperature\_system\_failure .csv": [["2013-12-15 07:00:00.000000", "2013-12-30 09:00:00.000000"], ["2014-03-29 15:00:00.000000", "2014-04-20 22:00:00.000000"]]
- ③ Ano\_spans는 사용하는 데이터를 Key로 입력받아 그 데이터의 Label정보를 불러온 객체이다.

pytorch의 Dataset을 상속받아 데이터를 구성

#### **Class NabDataset(Dataset):**

```
# create sequences
def unroll(self, data, labels):
    un_data = []
    un_labels = []
    seq_len = int(self.window_length)
    stride = int(self.stride)

idx = 0
    while(idx < len(data) - seq_len):
        un_data.append(data.iloc[idx:idx+seq_len].values)
        un_labels.append(labels.iloc[idx:idx+seq_len].values)
        idx += stride
    return np.array(un_data), np.array(un_labels)</pre>
```

- ① Unroll함수는 sequence 형태로 변환해주는 함수이다.
- ② 현재 window\_length는 60, stride는 1로 설정
- ③ data.iloc[idx:idx+seq\_len].values을 통해 seq\_len(60)만큼의 길이를 가지는 value값이 하나의 sequence가 된다.
- ④ Un\_label또한 60개의 값이 하나의 sequence에 대한 label로 담겨지는데 이는 나중에 전체 합이 0보다 크면 1의 label을 갖도록 변환된다.
- self.y = torch.from\_numpy(np.array([1 if sum(y\_i) > 0 else 0 for y\_i in y])).float()

```
## Dataset은 반드시 __len__ 함수를 만들어줘야함(데이터 길이)
## The __len__ function returns the number of samples in our dataset.

def __len__(self):
    return self.data_len
```

- ① Pytorch Dataset을 상속받은 부분, self.data\_len = x.shape[0] 다음을 통해 데이터 길이를 반환
- ## torch 모듈은 \_\_getitem\_\_ 을 호출하여 학습할 데이터를 불러옴.
  ## The \_\_getitem\_\_ function loads and returns a sample from the dataset at the given index idx

  def \_\_getitem\_\_(self, idx):
   return self.x[idx], self.y[idx]
- ② Item(index)에 해당하는 데이터(2번 에서 만든 input\_size의 tensor데이 터)를 실제로 반환

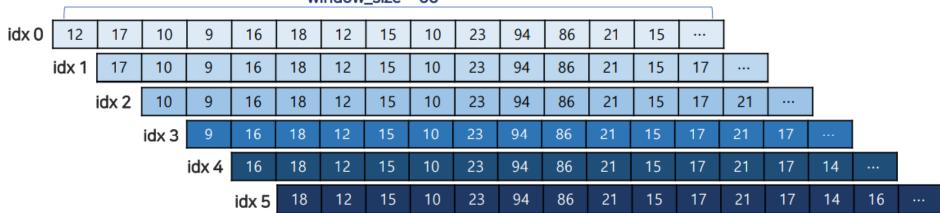
#### Dataset\_Example:

#### [Original Sequence]

Time stamp	1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13	14	15	16	17	18	19	20	
Value	12	17	10	9	16	18	12	15	10	23	94	86	21	15	17	21	17	14	16	12	

- Window size = 60
- Sliding = training  $\Rightarrow$  1, test = > 60

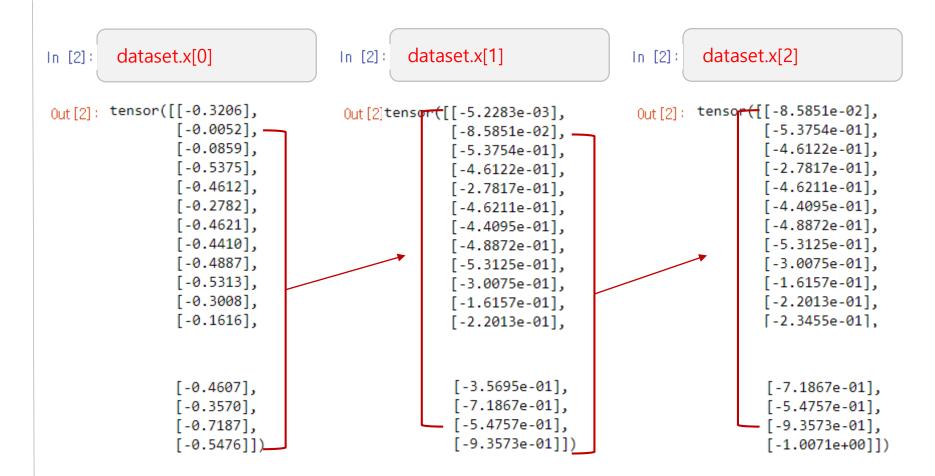
#### window\_size = 60



#### Dataset\_Example :

timestamp	value
2013-07-04 0:00	69.88084
2013-07-04 1:00	71.22023
2013-07-04 2:00	70.8778
2013-07-04 3:00	68.9594
2013-07-04 4:00	69.28355
2013-07-04 5:00	70.06097
2013-07-04 6:00	69.27976
2013-07-04 7:00	69.36961
2013-07-04 11:00	70.55619
2014-05-28 15:00	72.58409

- window\_length를 60으로 입력받아 60개의 row에 대해 정규화된 값들이 반환
- window의 개념으로 X[1]의 첫번째 값은 X[0]의 두번째가 됨을 볼 수 있다.



#### TORCH.UTILS.DATA

#### **Class DataLoder:**

In [2]:

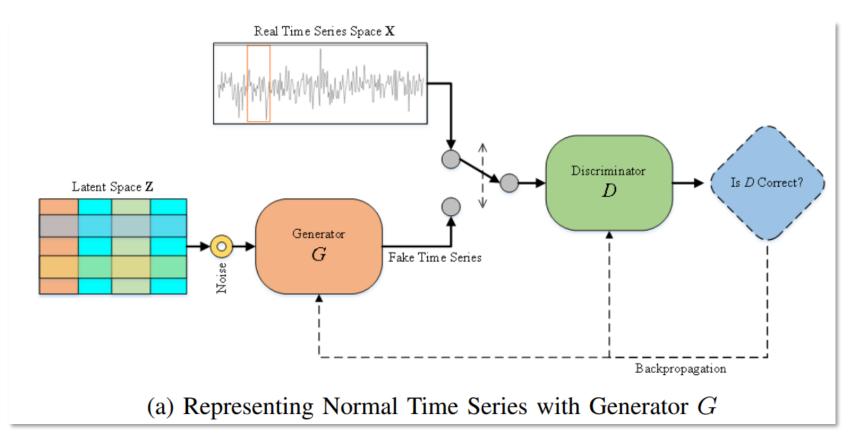
DataLoader(dataset, batch\_size=1, shuffle=False, sampler=None, batch\_sampler=None, num\_workers=0, collate\_fn=None, pin\_memory=False, drop\_last=False, timeout=0, worker\_init\_fn=None, \*, prefetch\_factor=2, persistent\_workers=False)

class ArgsTrn:
 workers=4
 batch\_size=32
 epochs=20
 lr=0.0002

opt\_trn=ArgsTrn()

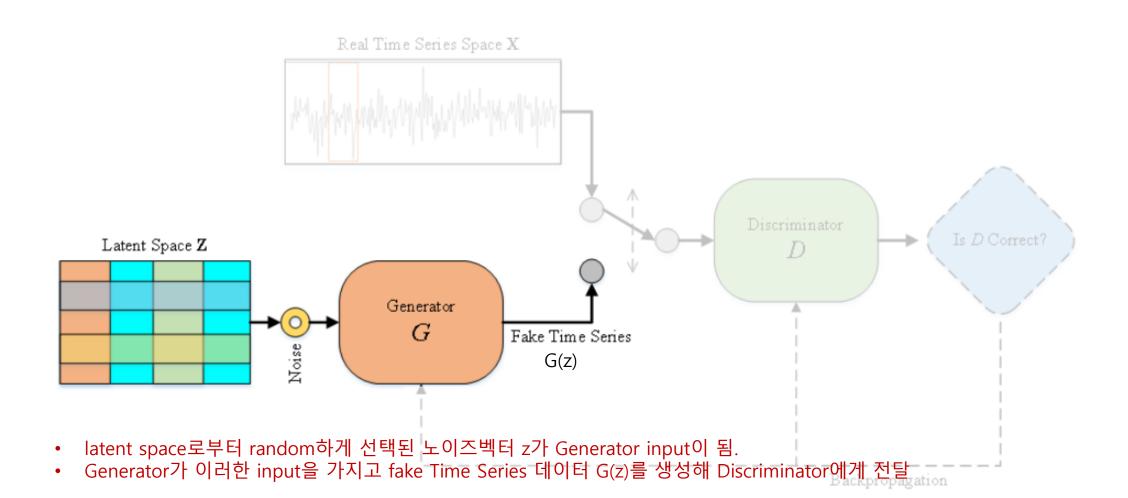
In [2]:

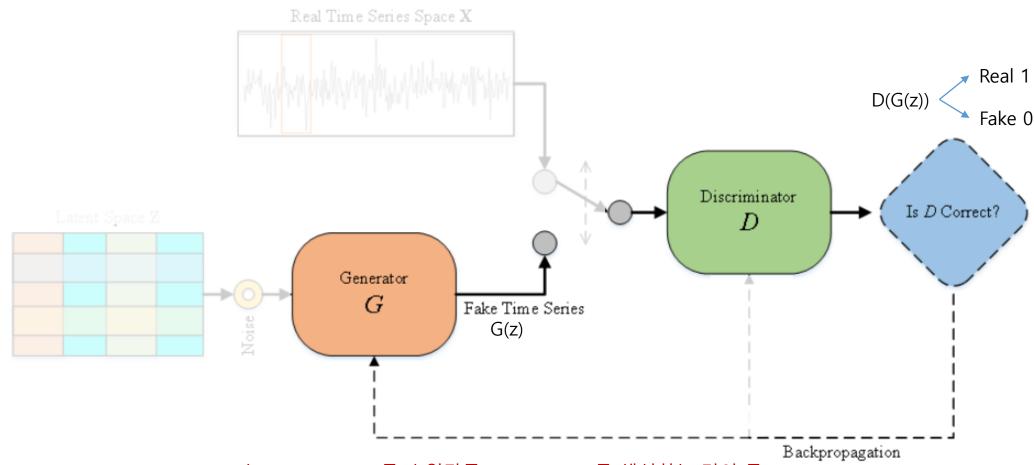
- torch.utils.data를 이용해 Data Loader 형태로 변환
- Dataloader class는 batch기반의 딥러닝모델 학습을 위해서 mini batch를 만들어주는 역할
- 앞서 만들었던 dataset을 input으로 넣어주면 여러 옵션(데이터 묶기, 섞기, 알아서 병렬처리)을 통해 batch 생성
- batch\_size=opt\_trn.batch\_size
- "batch\_size" 를 32로 두어 앞서 보았던 3개의 window를 가지는 tensor 32개가 하나의 집단이 되어 학습이 이루어진다.



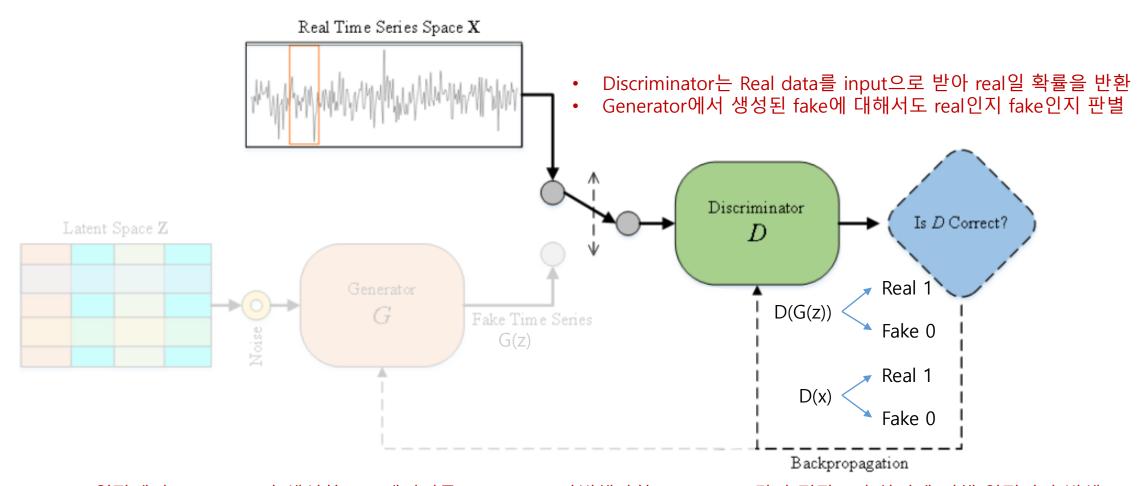
#### Training

- fake 데이터를 생성하는 generator G와 생성된 fake데이터를 real데이터와 판별을 하는 Discriminator를 adversarial 하게 학습
- Generator와 Discriminator모두
   Input과 Output이 Time series의
   Sequence형태이므로 LSTM을 사용





- Generator는 Discriminator를 속일만큼 realistic data를 생성하는 것이 목표
- G가 생성한 데이터에 대해서는 Discriminator는 real 1을 반환해야 함
- 즉 D(G(z))가 1이냐 0이냐에 따라 이 차이를 역전파하여 G를 학습

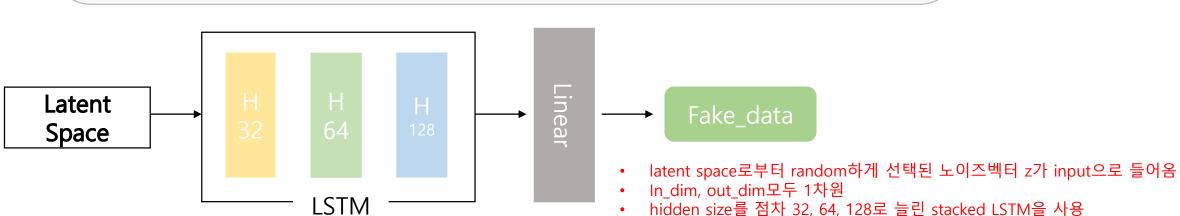


- Discriminator입장에서 Generator가 생성한 fake데이터를 fake 0으로 판별해야하므로 D(G(z))값과 정답 0의 차이에 의해 역전파가 발생
- Real 데이터에 대해서도 Discriminator는 real 1로 판단해야 하기 때문에 D(x)값과 정답 1의 차이에 의해 역전파가 발생

#### **Class LSTMGenerator(nn.Module):**

```
In [2]:
    def __init__(self, in_dim, out_dim, device=None):
        super().__init__()
        self.out_dim = out_dim
        self.device = device

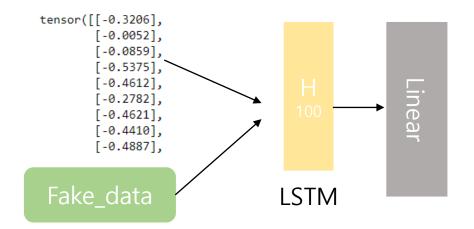
        self.lstm0 = nn.LSTM(in_dim, hidden_size=32, num_layers=1, batch_first=True)
        self.lstm1 = nn.LSTM(input_size=32, hidden_size=64, num_layers=1, batch_first=True)
        self.lstm2 = nn.LSTM(input_size=64, hidden_size=128, num_layers=1, batch_first=True)
        self.linear = nn.Sequential(nn.Linear(in_features=128, out_features=out_dim), nn.Tanh())
```



#### **Class LSTMDiscriminator(nn.Module):**

```
def __init__(self, in_dim, device=None):
    super().__init__()
    self.device = device

self.lstm = nn.LSTM(input_size=in_dim, hidden_size=100, num_layers=1, batch_first=True)
    self.linear = nn.Sequential(nn.Linear(100, 1), nn.Sigmoid())
```



- 고은 discriminator를 사용하면 충분히 학습시킬만한 데이터가 존재하지 않기 때문에 과적합이 쉽게 발생
- 간단하고 얕은 구조로 싱글LSTM layer를 가지고 hidden unit은 100개인 discriminator를 설계, In dim 출력 모두 1차원

#### **Algorithm 1:** Algorithm for TAnoGan

```
Input: A list of small sequences X.
Output: A list of anomaly scores A.
Function adversarialTrain(X):
for number_of_epochs do
Sample m noise vectors {z<sub>1</sub>,...z<sub>m</sub>} from the noise prior p<sub>g</sub>(z).
Generate m fake-data vectors {G(z<sub>1</sub>),...,G(z<sub>m</sub>)} from the m noise vectors.
Sample m real-data vectors {x<sub>1</sub>,...,x<sub>m</sub>} from the data generating distribution p<sub>data</sub>(x).
Train D on the fake-data vectors and real-data vectors.
Sample another m noise vectors {z<sub>1</sub>,...z<sub>m</sub>} to from the noise prior p<sub>g</sub>(z).
Train G on the second set of noise vectors.
return G, D
```

#### Summary

#### Epoch수만큼

- Noise vector z를 m개 sampling
- M개의 noise vecto로부터 fake data인 {G(z1.. G(크)}을 생성
- M개의 real data를 sampling
- Fake data와 real data를 이용해 Discriminator학습
- Latent space에서 또다른 m개의 noise vector sampling
- 두번째 noise vector를 이용해 Generator학습

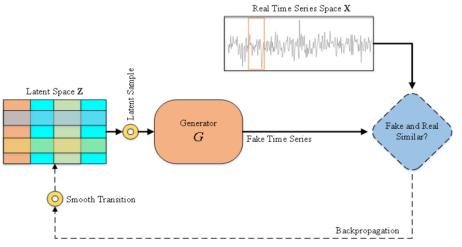
#### Algorithm 1: Algorithm for TAnoGan

```
Input: A list of small sequences X.
   Output: A list of anomaly scores A.
 1 Function adversarialTrain(X):
          for number_of_epochs do
                Sample m noise vectors \{\mathbf{z}_1, \dots \mathbf{z}_m\} from the noise prior p_g(\mathbf{z}).
                Generate m fake-data vectors \{G(\mathbf{z}_1), \ldots, G(\mathbf{z}_m)\} from the m
                  noise vectors.
                Sample m real-data vectors \{\mathbf{x}_1,\ldots,\mathbf{x}_m\} from the data generating
 5
                  distribution p_{data}(\mathbf{x}).
                Train D on the fake-data vectors and real-data vectors.
                Sample another m noise vectors \{\mathbf{z}_1, \dots \mathbf{z}_m\} to from the noise prior
                 p_a(\mathbf{z}).
                Train G on the second set of noise vectors.
          return G, D
11 Function anomalyScore (X, G, D):
          for i in 1 to m do
12
                Sample a noise vector \mathbf{z}^i from the noise prior p_q(\mathbf{z}^i).
13
                for \lambda in 1 to \Lambda do
14
                       Generate a fake-data vector G(\mathbf{z}^i) from the noise vector \mathbf{z}^i.
15
                      Calculate \mathcal{L}(G(\mathbf{z}^i)) for \mathbf{x}^i utilising G and D, and update \mathbf{z}^i
16
                        using gradient descent.
                A(\mathbf{x}^i) = \mathcal{L}(G(\mathbf{z}^i))
17
          return A
18
19
   Function Main (X):
          G, D = adversarialTrain(X)
          A = anomalyScore(\mathbf{X}, G, D)
```

#### Summary

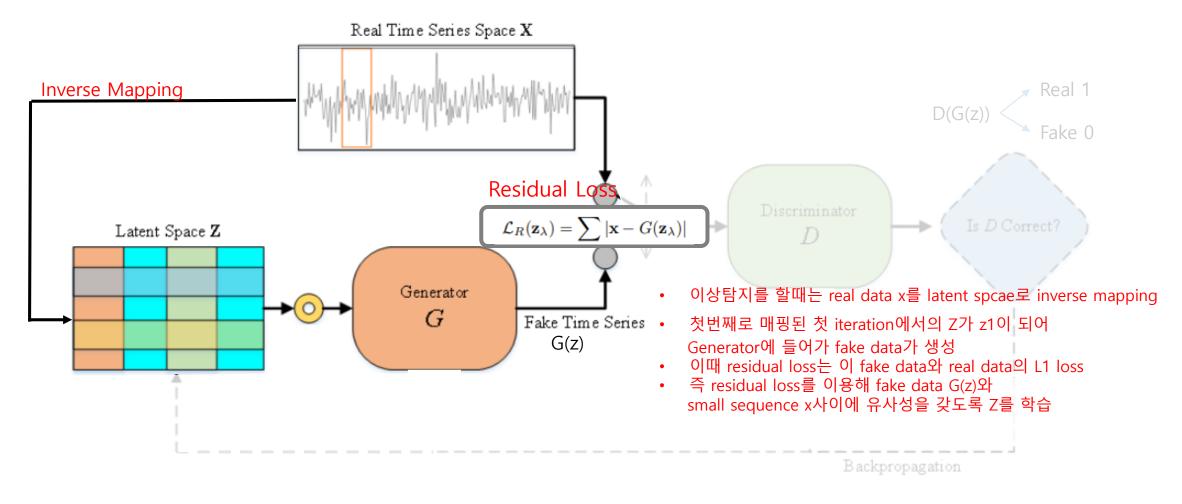
Discriminator와 Generator의 학습이 끝나면 새로운 데이터에 대해 anomaly score를 계산

- Latent space로부터 noise vecto를 sampling
- 이 Noise vector로부터 Generator는 fake data를 생성
- G와 D를 이용해 실제 데이터 x에 대한 Loss(G(z))를 계산
- 즉 fake data로 부터 얻은 loss를 경사하강법을 이용해 z를 업데이트

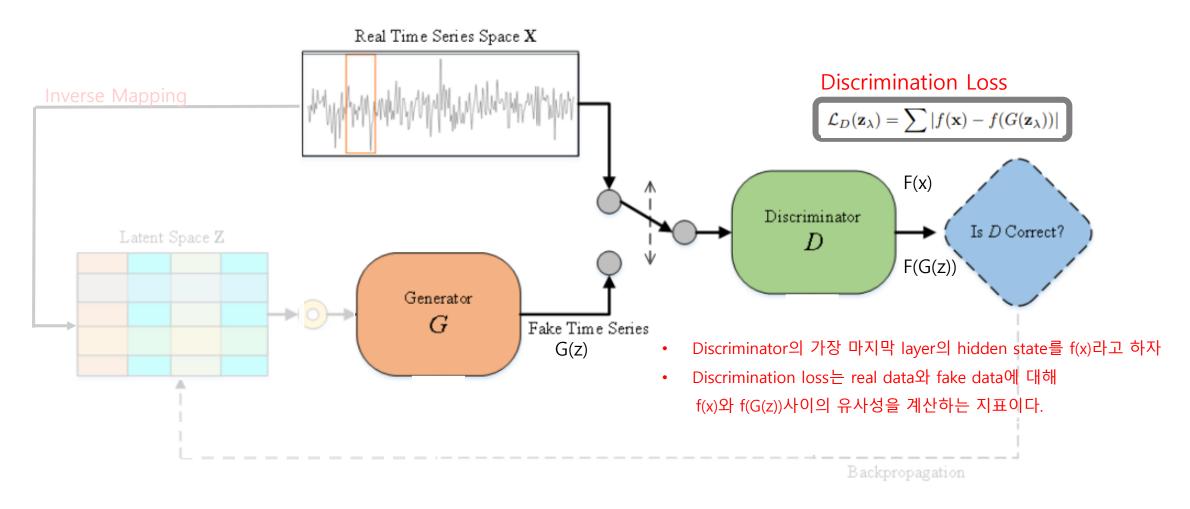


(b) Mapping Real-Data to the Latent Space

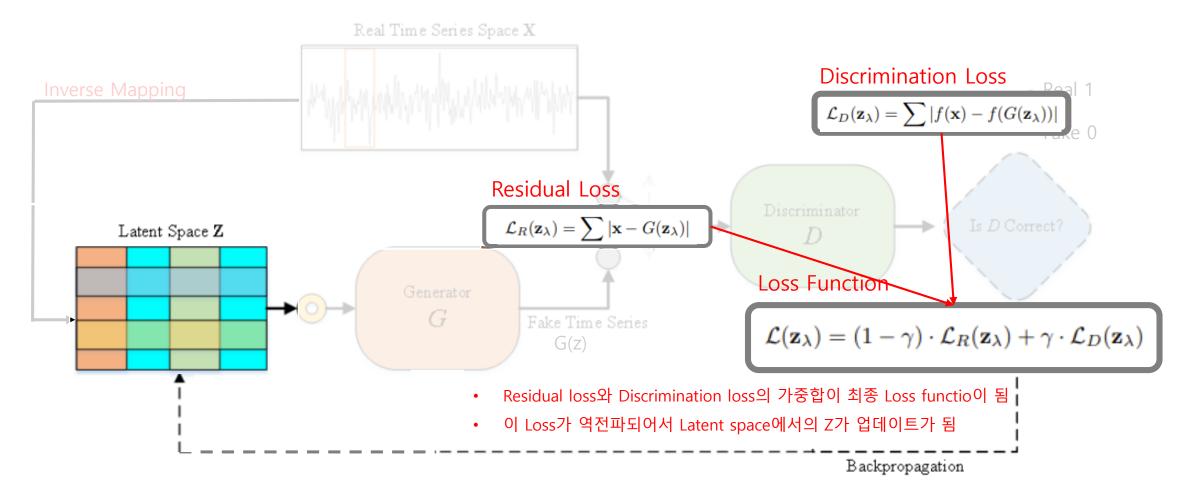
#### 비정상 점수 계산: 1. Inverse mapping to latent space and Residual Loss



#### 비정상 점수 계산: 2. Discrimination Loss



#### 비정상 점수 계산: 3. Loss Function and Backpropagation



#### Code: Inverse mapping to latent space and reconstruction of data

loss list: 테스트셋에 대해서 모든 행마다 50번의 iteration(업데이트)을 통해 latent space상에서의 z를 확정하고 해당데이터의 loss를 저장

```
loss list = []
In [2]:
                                                                                      [tensor(465.1875, grad fn=<AddBackward0>),
                                                                                       tensor(560.8277, grad_fn=<AddBackward0>),
          for i, (x,y) in enumerate(test dataloader):
                                                                                       tensor(508.7813, grad_fn=<AddBackward0>),
              print(i, y)
              z = Variable(init.normal(torch.zeros(opt test.batch size,
                                                                             ① 처음에는 랜덤하게 noise vector z를 생성
                                         test_dataset.window_length,
                                         test dataset.n feature), mean=0, std=0.1),
                                         requires grad=True)
              \#Z = X
                                                                             ② Loss를 통해 업데이트할 대상은 z이다.
              z_optimizer = torch.optim.Adam([z],lr=1e-2)
              loss = None
                                                                             ③ 각 iteration에서의 z를 generato에 넣어서 fake데이터를
              for j in range(50): # set your interation range
                                                                                생성
                  gen fake, = generator(z)
                                                                             ④ Anomaly_score 함수를 이용해 fake data와 real data x의
                  loss = Anomaly score(Variable(x), gen fake)
                                                                                loss를 반환
                  loss.backward()
                                                                             ⑤ Loss를 역전파하여 z를 업데이터
                  z optimizer.step()
                                                                             ⑥ 마지막 iteration을 돌았을 때 나오는 latent space상에서의
              loss list.append(loss)
                                                                                데이터 포인트 z를 확정하고 해당 데이터의 loss를 저장
              print('~~~~~loss={}, v={} ~~~~~~'.format(loss, v))
```

#### Code: Anomaly\_Score 함수

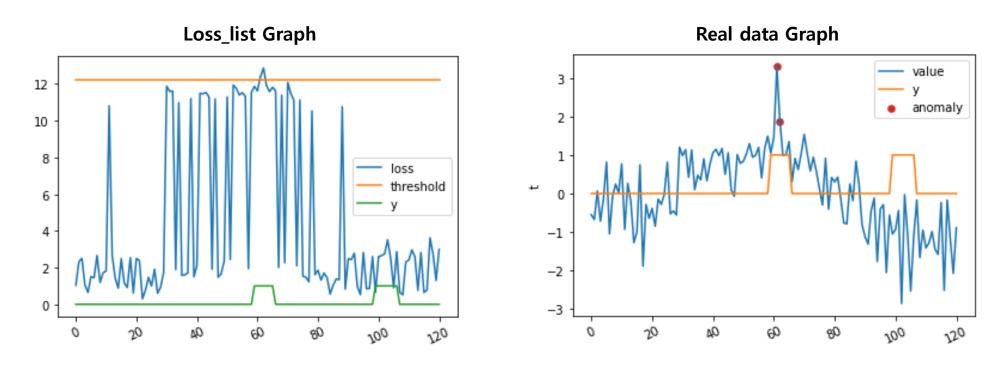
predict값과 real값의 loss를 담은 loss\_list의 평균과 표준편차를 통해 이상치 점수를 산출

```
# Lambda = 0.1 according to paper
In [2]:
        # x is new data, G z is closely regenerated data
        def Anomaly_score(x, G_z, Lambda=0.1):

 Residual Loss

            residual_loss = torch.sum(torch.abs(x-G_z)) # Residual Loss
                                                                                ② Real x와 generato가 생성한 fake data인 G z의 L1 loss
            output, x feature = discriminator(x.to(device))
            output, G_z_feature = discriminator(G_z.to(device))
                                                                                ③ Discrimination Loss
            # Discrimination Loss
                                                                                ④ Real data와 fake data에 대해 Discriminator의 가장 마지
            discrimination_loss = torch.sum(torch.abs(x_feature-G_z_feature))
                                                                                   막 layer를 통과시킨 f(x)와 f(G(z))의 L1 loss
            total_loss = (1-Lambda)*residual_loss.to(device) + Lambda*discrimination_loss
            return total_loss
                                                                                ⑤ Lambda는 residual loss와 discrimination loss의 trade off
                                                                                   를 조정하는 가중치로 논문에서는 0.1로 설정하였다.
```

### 5. Visualize Result



- 앞서 구한 Loss\_list를 시각화하고 threshold를 12.5로 두어 loss가 12.5이상인 경우 이상치로 탐지
   오른쪽 그래프는 실제 test data의 values를 시각화한 것으로 loss를 통해 탐지한 이상치가 실제 이상치(주황색 그래프)와 얼마나 맞는지를 비교
- 2구간의 이상치 중 한 구간의 이상치를 탐지한 것으로 보여짐

3/ Appendix

### **Labels Data**

pytorch의 Dataset을 상속받아 데이터를 구성

#### **Class NabDataset(Dataset):**

```
def read_data(self, data_file=None, label_file=None, key=None, BASE=''):
    with open(BASE+label_file) as FI:
        j_label = json.load(FI)
        ano_spans = j_label[key]
    self.ano_span_count = len(ano_spans)
    df_x = pd.read_csv(BASE+data_file)
    df_x, df_y = self.assign_ano(ano_spans, df_x)

return df_x, df_y
```

- ① 다음은 j\_label의 실제모습을 보여주고 있다.
- ② NabDataset의 50가지 데이터 Label 정보는 labels/ combined\_windows.json에 집합형태로 저장되어 있다.
- ③ 위의 사전처럼 각각의 csv파일에 대해 이상치에 해당하는 날짜의 정보가 리스 트에 담겨져 있다.
- ④ []처럼 빈칸으로 표시된것은 이상치가 없음을 의미하고 ["2014-04-10", "2014-04-12"] 와 같이 표시된것은 4-10일부터 4/12사이에 해당하는 데이터 모두 이상 치임을 나타낸다.