

بسم الله الرحمن الرحيم

نام دانشجو: سید محمد علی رضایی

شماره دانشجویی: 400131020

استاد درس: دکتر صفابخش

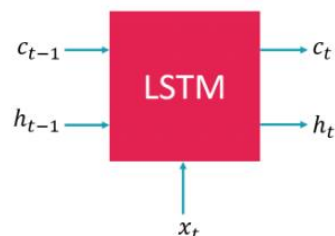
گزارش تمرین شماره ۶

کدهای گزارش در فایل زیپ موجود می باشد.

## سوال اول :

شبکه عصبی LSTM همانند شبکه RNN به صورت زنجیره‌ای پشت سر هم قرار می‌گیرد. مزیت این معماری نسبت به RNN می‌توان به استفاده از یک حافظه کوتاه مدت به مدت طولانی تری اشاره کرد. شکل زیر یک بلاک از معماری LSTM را نمایش می‌دهد که در این ساختار  $c_{t-1}$  را cell state می‌نامیم که حافظه مورد استفاده در شبکه می‌باشد.  $h_{t-1}$  خروجی از بلاک قبلی شبکه در زمان  $t-1$  می‌باشد.  $x_t$  نمونه ورودی در زمان  $t$  می‌باشد.

در گذر زمان، در cell state. اطلاعاتی ذخیره یا از آن حذف می‌شود. این حافظه بلندمدت دو خاصیت مهم دارد : ۱- می‌توانیم اطلاعات آن را پاک کنیم (فراموشی)، ۲- می‌توانیم به آن اطلاعاتی اضافه کنیم (به خاطر سپردن)



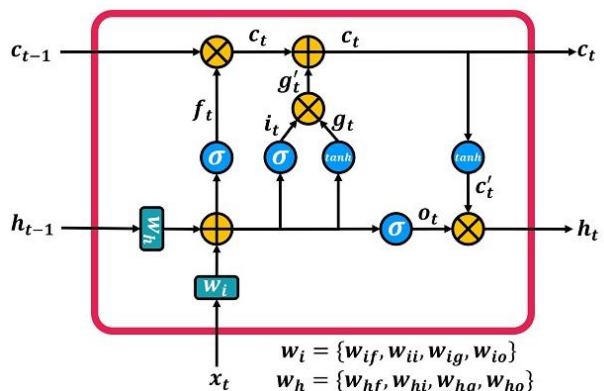
فراموشی و به خاطر سپردن در این ساختار بدین گونه انجام می‌شود که ورودی شبکه ابتدا با استفاده از یک تابع سیگموئید در رنج صفر و یک برده می‌شود و سپس به صورت متناظر با داده‌های ذخیره شده در cell state ضرب می‌شود، ورودی‌هایی که مقدار صفر بعد از اعمال تابع به خود نسبت گرفته اند منجر به حذف اطلاعات داده‌های متناظر در واحد حافظه می‌شوند و همچنین داده‌هایی که مقدار یک بعد از اعمال تابع به خود می‌گیرند منجر به حفظ داده‌های ذخیره شده در حافظه می‌گردد، این ساختار را forget gate می‌نامیم.

حال بعد از اینکه به اِزاء ورودی و خروجی بلاک قبل اطلاعات موجود در حافظه را ثبت یا حذف کردیم حال به دنبال اضافه کردن اطلاعات جدیدتر به واحد حافظه به اِزاء همین دو ورودی می‌باشیم (Input Gate).

در input gate به اِزاء دو ورودی که داشتیم ابتدا آن‌ها را به یک تابع  $\tanh$  اعمال می‌کنیم و ورودی را بین یک و منفی یک می‌بریم، سپس برای اینکه اطلاعات نا مفید را به حافظه اضافه نکنیم مجدد در یک شبکه MLP دیگر با همان دو ورودی قبلی یک تابع سیگموئید اعمال می‌کنیم و با خروجی تابع  $\tanh$  ضرب می‌کنیم و خروجی را سپس با مقدار موجود در حافظه جمع می‌کنیم به این ترتیب مقدار ذخیره شده بر روی cell state در زمان  $t$  بدست می‌آید.

Output gate : گیت خروجی تعیین می‌کند چقدر از حافظه بلندمدت باید به خروجی منتقل شود. در این فاز مشابه قبل دو ورودی  $x_t$  و  $h_{t-1}$  به یک تابع سیگموئید وارد شده و بین رنج صفر و یک می‌رود و مقدار ذخیره شده در cell state نیز با استفاده از یک تابع  $\tanh$  که مقادیر ذخیره شده در حافظه را بین یک و منفی یک می‌برد با یکدیگر ضرب انجام داده و خروجی در زمان  $t$  را می‌سازند.

شکل زیر نمایشی از یک سلول از بلاک حافظه شبکه LSTM :



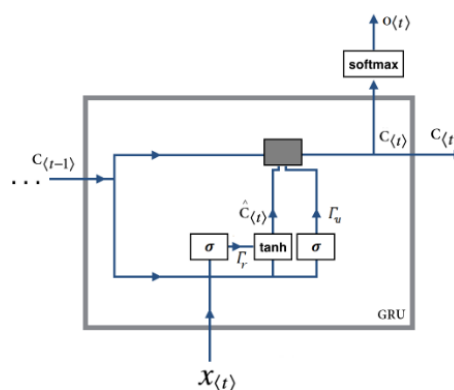
معماری GRU یا همان Gated Recurrent Unit در سال ۲۰۱۴ توسط Cho و همکاران معرفی شد این معماری به منظور برطرف سازی کاستی‌های شبکه عصبی بازگشتی نظیر مشکل محو شدگی گرادیان و همچنین کاهش سربار موجود در معماری LSTM ارائه شده است. GRU عموماً به عنوان نسخه ای تغییر یافته از LSTM در نظر گرفته می‌شود چرا که هر دو این معماری‌ها از طراحی مشابهی بهره می‌برند و در بعضی از موارد بصورت یکسان نتایج عالی بدست می‌دهند. در این معماری با استفاده از **reset gate and update gate** که هر دو، دو بردار هستند و با استفاده از آن‌ها تصمیم گرفته میشود چه اطلاعاتی به خروجی منتقل شده و چه اطلاعاتی منتقل نشود. نکته خاص در باره این دروازه ها این است که این دروازه ها را میتوان آموزش داد تا اینطور اطلاعات مربوط به گام های زمانی بسیار قبل را بدون آنکه در حین گذر زمان (طی گام های زمانی مختلف) دستخوش تغییر شوند حفظ کند.

**Update Gate :** اصطلاحاً سوپچی است که مشخص می‌کند در یک گام زمانی حالت قبلی مورد استفاده قرار گیرد یا ورودی (و یا ترکیبی از هر دو). با استفاده از این قابلیت جدید شبکه قادر است در دنباله های طولانی براحتی یک حالت از چندین گام زمانی قبل را در چند گام زمانی بعدی اثر دهد به عبارت دیگر شبکه قادر خواهد بود تا المانهایی را از گذشته دور در حافظه خود نگه داشته و از آن بهره‌برداری کند. نکته مهم درباره این گیت این است که در عمل مسیرهای میانبری ایجاد می‌کند که چندین گام زمانی را ندید گرفته و پشت سر میگذارد (از روی چندین گام زمانی می‌پزند) این میانبرها به همین صورت به خطای تولیدی اجازه می‌دهد تا بدون آنکه خیلی سریع محو شود براحتی در فاز پس انتشار منتقل گردد و اینطور معضلات مرتبط با گرادیان های محو شونده کاهش می‌یابد.

**Reset Gate :** در اصل همانند سوپچی عمل می‌کند که شبکه با کمک آن می‌تواند مشخص کند چه میزان از اطلاعات گذشته در گام فعلی مورد نیاز نیست (فراموش شود) و در گام فعلی از چه میزان از اطلاعات گام قبل استفاده شود مشابه گیت فراموشی در معماری lstm.

شکل زیر نمایشی از یک سلول GRU می‌باشد:

با توجه به دو معماری گفته شده از لحاظ ساختاری همانطور که مشاهده کردیم lstm دارای سه گیت در سلول حافظه خود می‌باشد (forget gate and input gate و output gate) در حالی که معماری GRU دارای دو گیت در سلول حافظه خود می‌باشد (update gate and reset gate) از لحاظ عملکرد reset gate و forget gate و همچنین input gate و update gate مشابه هم رفتار می‌کنند. در معماری lstm برای خروجی از گیت output استفاده شد در حالی که در معماری GRU صرفاً از یک لایه SoftMax استفاده شده است.



معماری GRU از لحاظ پیچیدگی و ساختار و پارامتر های قابل یادگیری نسبت به معماری LSTM ساده تر می‌باشد (با توجه به کمتر بودن گیت‌ها). با توجه به بیشتر بودن پارامترهای معماری LSTM این نتیجه گرفته می‌شود که برای آموزش نیاز به داده‌های بیشتری می‌باشد پس در هنگام مواجه شدن با دیتاست‌های بزرگ تر معماری LSTM پیشنهاد می‌گردد و همین‌طور در مقابل آن با توجه به ساختار ساده‌تر و پارامترهای کمتر معماری GRU در هنگام مواجه شدن با دیتاست‌های کوچک‌تر این ساختار نسبت به LSTM ترجیح داده می‌شود.

## سوال دوم :

برای پیاده سازی شبکه عصبی LSTM و GRU ابتدا به آماده سازی دیتاست مورد نظر می پردازیم. در این مسئله ما ۱۶ دیتاست از شاخص های مختلف بازار سرمایه داریم که باید مسئله مورد نظر خود را به صورت exogenous در نظر بگیریم و از شاخص های دیگر برای پیش بینی شاخص کل بورس استفاده کنیم.

با استفاده از بلاک کد زیر ۱۶ دیتاست موجود را ترکیب کرده و براساس تاریخ یک ساله گذشته از همه شاخص ها ان را merge کرده ایم:

```
dfs = [df1,df2,df3,df4,df5,df6,df7,df8,df9,df10,df11,df12,df13,df14,df15,df16]
df_final = ft.reduce(lambda left, right: pd.merge(left, right, on='<DTYYYYMMDD>'), dfs)

...

dataset = df_final.loc[(df_final['<DTYYYYMMDD>'] >= 20210501)]
dataset.reset_index(inplace=True)
dataset.drop(['index'], axis=1,inplace=True)
```

نمایشی از دیتاست بدست آمده :

	<DTYYYYMMDD>	<OPEN>_x	<HIGH>_x	<LOW>_x	org_close	<VOL>_x	<OPENINT>_x	<OPENINT>.1_x	<OPENINT>.2_x	<LAST>_x	...	<LAST>_x	<
0	20210501	1208560.0	1208560.0	1194303.5	1194303.5	3701769749	1.630000e+13	215895	4.778443e+10	1194303.5	...	159.0	
1	20210502	1191400.0	1191400.0	1180709.1	1180709.1	2041457656	1.060000e+13	134221	4.724093e+10	1180709.1	...	158.8	
2	20210503	1176770.0	1176770.0	1167072.7	1167072.7	1589299529	9.140000e+12	144518	4.669533e+10	1167072.7	...	158.8	
3	20210505	1167870.0	1172610.0	1172249.3	1172249.3	3573775657	1.890000e+13	260411	4.689892e+10	1172249.3	...	158.1	
4	20210508	1176190.0	1176190.0	1167498.3	1167498.3	1895501673	1.250000e+13	187024	4.670543e+10	1167498.3	...	157.4	
...	...	...	...	...	...	...	...	...	...	...	...	...	...
223	20220409	1460550.0	1460550.0	1458684.4	1458684.4	8423628503	3.770000e+13	462958	5.810100e+10	1458684.4	...	132.2	
224	20220410	1461710.0	1474240.0	1474099.6	1474099.6	11270947735	4.370000e+13	483996	5.871501e+10	1474099.6	...	130.6	
225	20220411	1475490.0	1479890.0	1479590.9	1479590.9	10070884564	3.960000e+13	504631	5.893313e+10	1479590.9	...	127.5	
226	20220412	1474000.0	1474000.0	1445970.5	1445970.5	9289109331	4.010000e+13	430607	5.759041e+10	1445970.5	...	126.8	
227	20220413	1443170.0	1454120.0	1454126.8	1454126.8	8473206930	3.540000e+13	430487	5.790589e+10	1454126.8	...	128.0	

228 rows x 145 columns

۲۲۸ تعداد نمونه های ما در یک سال اخیر و ۱۴۵ تعداد ستون ها و ویژگی های ما می باشند.

سپس با استفاده از بلاک کد زیر با توجه به توضیح تدریس یار محترم برای برچسب دهی به داده ها ، ابتدا ستون مربوطه به شاخص کل را در این دیتاست مشخص کرده و سپس نسبت اختلاف close هر روز با روز قبلش را حساب کرده اگر این اختلاف دارای عددی مثبت باشد به این معنا است که فردا بازار مثبت خواهد بود و اگر منفی باشد به ان معنا است که فردا بازار منفی خواهد بود به همین ترتیب اعداد مثبت (عدد یک) و اعداد منفی (عدد صفر) نسبت داده ام :

```
label_list = []
for i in range(len(dataset.org_close)-1) :
    m = dataset.org_close[i+1] - dataset.org_close[i]
    if m < 0:
        m = 0
        label_list.append(m)
    else:
        m = 1
        label_list.append(m)
label_list.append(1)
```

با توجه به اینکه رنج داده‌های موجود در دیتاست طیف وسیعی از اعداد را شامل می‌شود با استفاده از بلاک کد زیر و تابع minmax داده‌ها را بین اعداد صفر و یک می‌بریم:

```
min_max_scaler = MinMaxScaler()
dataset = min_max_scaler.fit_transform(dataset)
```

	0	1	2	3	4	5	6	7	8	9	...	135	136	137	138	139
0	0.000000	0.231993	0.215077	0.205353	0.205353	0.164191	0.071700	0.060317	0.206235	0.205353	...	0.498047	1.000000	1.000000	1.000000	1.000000
1	0.000101	0.196688	0.179362	0.177034	0.177034	0.035144	0.014620	0.000000	0.178154	0.177034	...	0.496094	1.000000	1.000000	1.000000	1.000000
2	0.000202	0.166588	0.148914	0.148627	0.148627	0.000000	0.000000	0.007604	0.149965	0.148627	...	0.496094	1.000000	1.000000	1.000000	1.000000
3	0.000404	0.148277	0.140256	0.159411	0.159411	0.154242	0.097737	0.093192	0.160484	0.159411	...	0.489258	1.000000	1.000000	1.000000	1.000000
4	0.000706	0.165395	0.147706	0.149514	0.149514	0.023799	0.033647	0.038995	0.150487	0.149514	...	0.482422	1.000000	1.000000	1.000000	1.000000
...	...	...	...	...	...	...	...	...	...	...	...	...	...	...	...	...
223	0.999596	0.750437	0.739531	0.756104	0.756104	0.531194	0.286000	0.242775	0.739259	0.756104	...	0.236328	0.570229	0.193463	0.198420	0.198420
224	0.999697	0.752824	0.768024	0.788217	0.788217	0.752501	0.346085	0.258312	0.770983	0.788217	...	0.220703	0.584694	0.213781	0.210711	0.210711
225	0.999798	0.781175	0.779783	0.799656	0.799656	0.659227	0.305027	0.273551	0.782252	0.799656	...	0.190430	0.573962	0.239399	0.244074	0.244074
226	0.999899	0.778109	0.767524	0.729619	0.729619	0.598464	0.310034	0.218884	0.712878	0.729619	...	0.183594	0.595427	0.234099	0.198420	0.198420
227	1.000000	0.714680	0.726149	0.746610	0.746610	0.535048	0.262968	0.218795	0.729178	0.746610	...	0.195312	0.566962	0.191696	0.194908	0.194908

228 rows x 145 columns

بعد از این مرحله با توجه به اینکه دیتاست مورد استفاده در مسائل سری زمانی به صورت پنجره‌ای (اصطلاحاً) می‌باشد پس با تابع زیر این بانک اطلاعاتی را به صورت دسته‌های ۴ تایی که دارای overlap می‌باشند در می‌آوریم:

```
def make_window_dataset(X, Y, batch=None):
    x = []
    y = []
    for i in range(batch, len(X)):
        x.append(X[i - batch : i])
        y.append(Y[i])
    return np.array(x), np.array(y)
```

شکل نهایی داده‌ها به صورت زیر می‌باشد:

```
x.shape, y.shape
((224, 4, 145), (224,))
```

که در اینجا ۲۲۴ تعداد دسته‌های ما می‌باشد که در هر دسته ۴ نمونه با ابعاد ۱۴۵ داریم و برای برچسب این ۲۲۴ دسته نمونه یک لیست حاوی ۲۲۴ عدد (صفر و یا یک) دارا می‌باشیم.

در نهایت نیز با استفاده از بلاک کد زیر داده‌ها را به مجموعه داده آموزش (۷۰ درصد) و تست (۲۰ درصد) و اعتبار سنجی (۱۰ درصد) در می‌آوریم.

```
xtrain, xtest, ytrain, ytest = train_test_split(x, y, test_size=0.2, random_state=42)
xtrain, xval, ytrain, yval = train_test_split(xtrain, ytrain, test_size=0.125, random_state=42)
```

```
xtrain.shape, ytrain.shape, xtest.shape, ytest.shape
```

```
((156, 4, 145), (156,), (45, 4, 145), (45,))
```

پیش پردازش و آماده سازی اولیه در این مرحله به پایان رسیده و به سراغ آموزش شبکه در مرحله بعد می‌رویم.

در ابتدا با استفاده از بلاک کد زیر به ساخت مدل LSTM می‌پردازیم:

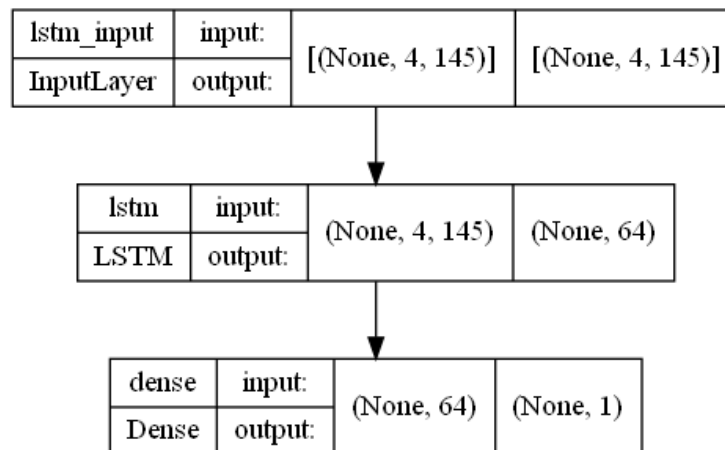
```
keras.backend.clear_session()
model = Sequential()
model.add(layers.LSTM(64, input_shape=(4,145),kernel_regularizer=keras.regularizers.l1(l1=0.001)))
model.add(layers.Dense(units=1,activation='sigmoid'))
model.compile(loss='binary_crossentropy', optimizer=keras.optimizers.Adam(learning_rate=0.001),metrics=['accuracy'])
```

در اینجا یک ساختار lstm با تعداد ۶۴ نرون در لایه مخفی و یک نرون در لایه خروجی و ورودی متناسب با اندازه batch داده‌ها و ابعاد نمونه‌ها با تابع فعال سازی sigmoid داریم برای جلوگیری از مشکل overfit شدن مدل در هنگام آموزش از رگولایزر L1 استفاده کرده‌ایم.

شکل زیر تعداد پارامترهای مسئله و نمایشی گرافیکی از نحوه ورودی و خروجی لایه‌های شبکه را نمایش می‌دهد:

Model: "sequential"

Layer (type)	Output Shape	Param #
lstm (LSTM)	(None, 64)	53760
dense (Dense)	(None, 1)	65
Total params: 53,825		
Trainable params: 53,825		
Non-trainable params: 0		



با استفاده از بلاک کد زیر شبکه را با ۲۰۰ دور بر روی مجموعه داده‌های آموزش ، آموزش می‌دهیم و از داده‌های اعتبار سنجی برای دقت validation accuracy استفاده کرده ایم و سپس ارزیابی نهایی را بر روی داده‌های آزمون انجام داده ایم :

```
model.fit(xtrain ,ytrain,validation_data=(xval,yval) , epochs=200)
model.evaluate(xtest,ytest)
```

```

57
Epoch 194/200
5/5 [=====] - 0s 22ms/step - loss: 0.6611 - accuracy: 0.6538 - val_loss: 0.6613 - val_accuracy: 0.73
91
Epoch 195/200
5/5 [=====] - 0s 27ms/step - loss: 0.6524 - accuracy: 0.7051 - val_loss: 0.7026 - val_accuracy: 0.60
87
Epoch 196/200
5/5 [=====] - 0s 19ms/step - loss: 0.6245 - accuracy: 0.7436 - val_loss: 0.6474 - val_accuracy: 0.73
91
Epoch 197/200
5/5 [=====] - 0s 15ms/step - loss: 0.6269 - accuracy: 0.7244 - val_loss: 0.7094 - val_accuracy: 0.65
22
Epoch 198/200
5/5 [=====] - 0s 18ms/step - loss: 0.6341 - accuracy: 0.6923 - val_loss: 0.6465 - val_accuracy: 0.73
91
Epoch 199/200
5/5 [=====] - 0s 18ms/step - loss: 0.6404 - accuracy: 0.7244 - val_loss: 0.6901 - val_accuracy: 0.69
57

```

همان طور که مشاهده می‌کنیم در انتهای آموزش دقت بر روی داده‌های آموزش تا ۷۲ درصد و بر روی داده‌های اعتبار سنجی تا ۶۹ درصد رسیده است. اما این دقت برای داده‌های تست به مراتب کمتر می‌باشد و در حدود ۴۸ درصد است:

```

2/2 [=====] - 0s 6ms/step - loss: 0.8237 - accuracy: 0.4889
[0.8237408399581909, 0.4888888895511627]

```

شکل زیر نمایشی از نحوه ساخت و مقادیر موجود در ماتریس درهم ریختگی برای آموزش شبکه فوق می‌باشد:

```

predictions = model.predict(xtest)
predict = []
for i in predictions:
    if i < 0.5 :
        m = 0
        predict.append(m)
    else:
        m = 1
        predict.append(m)

```

```

tn1, fp1, fn1, tp1 = confusion_matrix(ytest, predict).ravel()
tn1, fp1, fn1, tp1
(10, 14, 6, 15)

```

با توجه به نتایج بدست آمده از ماتریس درهم ریختگی مشاهده می‌شود که تعداد false positive به شدت زیاد بوده است (۱۴).

حال بار دیگر شبکه را با تعداد کمتری واحد lstm (۳۲) در لایه مخفی آموزش می‌دهیم تا نتایج را بررسی کنیم :

```

model.add(layers.LSTM(32, input_shape=(4,145),kernel_regularizer=keras.regularizers.l1(l1=0.001)))

```

```
--
Epoch 95/100
5/5 [=====] - 0s 17ms/step - loss: 1.6627 - accuracy: 0.6603 - val_loss: 1.6314 - val_accuracy: 0.73
91
Epoch 96/100
5/5 [=====] - 0s 17ms/step - loss: 1.6551 - accuracy: 0.6538 - val_loss: 1.6249 - val_accuracy: 0.73
91
Epoch 97/100
5/5 [=====] - 0s 14ms/step - loss: 1.6482 - accuracy: 0.6795 - val_loss: 1.6188 - val_accuracy: 0.69
57
Epoch 98/100
5/5 [=====] - 0s 17ms/step - loss: 1.6407 - accuracy: 0.6923 - val_loss: 1.6107 - val_accuracy: 0.69
57
Epoch 99/100
5/5 [=====] - 0s 16ms/step - loss: 1.6333 - accuracy: 0.6795 - val_loss: 1.6031 - val_accuracy: 0.73
91
Epoch 100/100
5/5 [=====] - 0s 18ms/step - loss: 1.6266 - accuracy: 0.6538 - val_loss: 1.5949 - val_accuracy: 0.69
```

با تعداد واحد LSTM کمتر، مشاهده می‌کنیم صحت برای مجموعه آموزش کاهش پیدا کرده است، اما همچنان صحت برای داده‌های اعتبارسنجی تقریباً برابر حالت قبل است. در زیر نیز مقدار صحت برای داده‌های آزمون رو مشاهده می‌کنیم که برخلاف تصور نسبت به حالت قبل رشد داشته است.

```
2/2 [=====] - 0s 0s/step - loss: 1.6648 - accuracy: 0.5556
[1.6648390293121338, 0.5555555820465088]
```

این بار آزمایش را با ۱۲۸ واحد lstm اجرا می‌کنیم:

```
Epoch 195/200
5/5 [=====] - 0s 25ms/step - loss: 0.6406 - accuracy: 0.6923 - val_loss: 0.6815 - val_accuracy: 0.69
57
Epoch 196/200
5/5 [=====] - 0s 25ms/step - loss: 0.6346 - accuracy: 0.7244 - val_loss: 0.6523 - val_accuracy: 0.73
91
Epoch 197/200
5/5 [=====] - 0s 23ms/step - loss: 0.6130 - accuracy: 0.6859 - val_loss: 0.6769 - val_accuracy: 0.69
57
Epoch 198/200
5/5 [=====] - 0s 23ms/step - loss: 0.6107 - accuracy: 0.7372 - val_loss: 0.6675 - val_accuracy: 0.69
57
Epoch 199/200
5/5 [=====] - 0s 24ms/step - loss: 0.6049 - accuracy: 0.7115 - val_loss: 0.6620 - val_accuracy: 0.69
57
Epoch 200/200
5/5 [=====] - 0s 24ms/step - loss: 0.6040 - accuracy: 0.7308 - val_loss: 0.6799 - val_accuracy: 0.69
```

مقدار صحت تا ۷۳ درصد برای آموزش و ۷۰ درصد برای اعتبارسنجی رسیده است و برای داده‌های آزمون:

```
2/2 [=====] - 0s 17ms/step - loss: 0.8064 - accuracy: 0.5778
[0.8063610792160034, 0.577778029441833]
```

این بار با ۸۰ واحد lstm آزمایش را اجرا می‌کنیم:



```
Epoch 195/200
5/5 [=====] - 0s 22ms/step - loss: 0.6306 - accuracy: 0.7051 - val_loss: 0.6577 - val_accuracy: 0.69
57
Epoch 196/200
5/5 [=====] - 0s 18ms/step - loss: 0.6284 - accuracy: 0.7051 - val_loss: 0.6684 - val_accuracy: 0.69
57
Epoch 197/200
5/5 [=====] - 0s 25ms/step - loss: 0.6140 - accuracy: 0.7179 - val_loss: 0.6527 - val_accuracy: 0.73
91
Epoch 198/200
5/5 [=====] - 0s 25ms/step - loss: 0.6205 - accuracy: 0.6923 - val_loss: 0.6790 - val_accuracy: 0.65
22
Epoch 199/200
5/5 [=====] - 0s 25ms/step - loss: 0.6120 - accuracy: 0.7179 - val_loss: 0.6575 - val_accuracy: 0.69
57
Epoch 200/200
5/5 [=====] - 0s 25ms/step - loss: 0.6148 - accuracy: 0.7179 - val_loss: 0.6894 - val_accuracy: 0.65
```

در این مرحله به نظر می‌رسد کاهش تعداد واحد های lstm منجر به کاهش در مقدار صحت در آموزش و اعتبار سنجی و از مون شده است(نسبت به حالت ۱۲۸ واحد)

```
2/2 [=====] - 0s 0s/step - loss: 0.8022 - accuracy: 0.5333
[0.802226185798645, 0.5333333611488342]
```

بار دیگر آزمایش را ۱۸۰ واحد اجرا می‌کنیم :

```
Epoch 196/200
5/5 [=====] - 0s 32ms/step - loss: 0.6751 - accuracy: 0.6538 - val_loss: 0.7140 - val_accuracy: 0.65
22
Epoch 197/200
5/5 [=====] - 0s 32ms/step - loss: 0.6249 - accuracy: 0.7051 - val_loss: 0.6504 - val_accuracy: 0.69
57
Epoch 198/200
5/5 [=====] - 0s 35ms/step - loss: 0.6046 - accuracy: 0.7051 - val_loss: 0.7204 - val_accuracy: 0.65
22
Epoch 199/200
5/5 [=====] - 0s 37ms/step - loss: 0.6392 - accuracy: 0.6987 - val_loss: 0.6447 - val_accuracy: 0.69
57
Epoch 200/200
5/5 [=====] - 0s 34ms/step - loss: 0.5910 - accuracy: 0.6859 - val_loss: 0.7199 - val_accuracy: 0.65
22
2/2 [=====] - 0s 12ms/step - loss: 0.8019 - accuracy: 0.5111
[0.8019179701805115, 0.5111111402511597]
```

به نظر می‌رسد با افزایش تعداد واحد های lstm لزوماً بهبود نخواهیم داشت پس حالت = ۱۲۸ واحد lstm رو به عنوان بالاترین دقت در نظر می‌گیریم.

حال در مرحله بعد به سراغ شبکه با استفاده از واحد GRU می‌رویم:

با بلاک کد زیر مدل شبکه مورد نظر خود را می‌سازیم:

GRU mdoel

```
keras.backend.clear_session()
gru_model = Sequential()
gru_model.add(layers.GRU(64, input_shape=(4,145),kernel_regularizer=keras.regularizers.l1(l1=0.001)))
gru_model.add(layers.Dense(units=1,activation='sigmoid'))
gru_model.compile(loss='binary_crossentropy', optimizer=keras.optimizers.Adam(learning_rate=0.0001),metrics=['accuracy'])
```

در شرایط مشابه قبل این آزمایش را برای تعداد واحد های ۳۲ و ۶۴ و ۸۰ و ۱۲۸ و ۱۸۰ انجام می‌دهیم :

: Units = 32

```
Epoch 196/200
5/5 [=====] - 0s 17ms/step - loss: 1.0388 - accuracy: 0.6667 - val_loss: 1.0154 - val_accuracy: 0.69
57
Epoch 197/200
5/5 [=====] - 0s 24ms/step - loss: 1.0363 - accuracy: 0.6667 - val_loss: 1.0132 - val_accuracy: 0.69
57
Epoch 198/200
5/5 [=====] - 0s 22ms/step - loss: 1.0343 - accuracy: 0.6603 - val_loss: 1.0109 - val_accuracy: 0.69
57
Epoch 199/200
5/5 [=====] - 0s 22ms/step - loss: 1.0317 - accuracy: 0.6731 - val_loss: 1.0093 - val_accuracy: 0.69
57
Epoch 200/200
5/5 [=====] - 0s 21ms/step - loss: 1.0296 - accuracy: 0.6731 - val_loss: 1.0065 - val_accuracy: 0.69
57
2/2 [=====] - 0s 5ms/step - loss: 1.0651 - accuracy: 0.6000
[1.065058946609497, 0.6000000238418579]
```

مقدار دقت بر روی داده‌های تست به ۶۰ درصد رسیده است که با تعداد واحد gru کمتر نسبت به lstm توانسته ایم دقت بالاتری را نسبت به تمام آزمایش های قبلی بدست بیاوریم.

: Units = 64

```
Epoch 196/200
5/5 [=====] - 0s 18ms/step - loss: 1.1332 - accuracy: 0.6923 - val_loss: 1.1094 - val_accuracy: 0.73
91
Epoch 197/200
5/5 [=====] - 0s 16ms/step - loss: 1.1301 - accuracy: 0.6859 - val_loss: 1.1043 - val_accuracy: 0.73
91
Epoch 198/200
5/5 [=====] - 0s 18ms/step - loss: 1.1276 - accuracy: 0.6987 - val_loss: 1.1042 - val_accuracy: 0.73
91
Epoch 199/200
5/5 [=====] - 0s 14ms/step - loss: 1.1261 - accuracy: 0.6859 - val_loss: 1.0968 - val_accuracy: 0.73
91
Epoch 200/200
5/5 [=====] - 0s 14ms/step - loss: 1.1210 - accuracy: 0.6923 - val_loss: 1.0971 - val_accuracy: 0.73
91
2/2 [=====] - 0s 7ms/step - loss: 1.1682 - accuracy: 0.5556
[1.1682217121124268, 0.5555555820465088]
```

با توجه به اینکه مقدار صحت برای داده‌های ازمون نسبت به آزمایش قبل کمتر بوده است اما مقدار صحت برای داده‌های اعتبار سنجی اندکی بهبود داشته است .

: Units = 80

```
Epoch 196/200
5/5 [=====] - 0s 19ms/step - loss: 1.1472 - accuracy: 0.6987 - val_loss: 1.1151 - val_accuracy: 0.73
91
Epoch 197/200
5/5 [=====] - 0s 19ms/step - loss: 1.1436 - accuracy: 0.6795 - val_loss: 1.1095 - val_accuracy: 0.73
91
Epoch 198/200
5/5 [=====] - 0s 18ms/step - loss: 1.1383 - accuracy: 0.6795 - val_loss: 1.1070 - val_accuracy: 0.73
91
Epoch 199/200
5/5 [=====] - 0s 19ms/step - loss: 1.1349 - accuracy: 0.6923 - val_loss: 1.1054 - val_accuracy: 0.73
91
Epoch 200/200
5/5 [=====] - 0s 21ms/step - loss: 1.1314 - accuracy: 0.7051 - val_loss: 1.1042 - val_accuracy: 0.73
91
2/2 [=====] - 0s 6ms/step - loss: 1.1776 - accuracy: 0.5333
[1.1775588989257812, 0.5333333611488342]
```

: Units = 128

```
Epoch 196/200
5/5 [=====] - 0s 26ms/step - loss: 1.0907 - accuracy: 0.6795 - val_loss: 1.0602 - val_accuracy: 0.78
26
Epoch 197/200
5/5 [=====] - 0s 27ms/step - loss: 1.0863 - accuracy: 0.6795 - val_loss: 1.0636 - val_accuracy: 0.73
91
Epoch 198/200
5/5 [=====] - 0s 25ms/step - loss: 1.0827 - accuracy: 0.6987 - val_loss: 1.0608 - val_accuracy: 0.73
91
Epoch 199/200
5/5 [=====] - 0s 26ms/step - loss: 1.0820 - accuracy: 0.6859 - val_loss: 1.0504 - val_accuracy: 0.78
26
Epoch 200/200
5/5 [=====] - 0s 26ms/step - loss: 1.0767 - accuracy: 0.6538 - val_loss: 1.0470 - val_accuracy: 0.78
26
2/2 [=====] - 0s 7ms/step - loss: 1.1404 - accuracy: 0.5556

[1.140446424484253, 0.5555555820465088]
```

: Units = 180

```
Epoch 196/200
5/5 [=====] - 0s 28ms/step - loss: 1.0777 - accuracy: 0.6923 - val_loss: 1.0535 - val_accuracy: 0.78
26
Epoch 197/200
5/5 [=====] - 0s 27ms/step - loss: 1.0759 - accuracy: 0.6923 - val_loss: 1.0518 - val_accuracy: 0.78
26
Epoch 198/200
5/5 [=====] - 0s 27ms/step - loss: 1.0717 - accuracy: 0.6859 - val_loss: 1.0474 - val_accuracy: 0.78
26
Epoch 199/200
5/5 [=====] - 0s 27ms/step - loss: 1.0716 - accuracy: 0.6731 - val_loss: 1.0473 - val_accuracy: 0.78
26
Epoch 200/200
5/5 [=====] - 0s 27ms/step - loss: 1.0695 - accuracy: 0.7051 - val_loss: 1.0460 - val_accuracy: 0.78
26
2/2 [=====] - 0s 9ms/step - loss: 1.1502 - accuracy: 0.4889

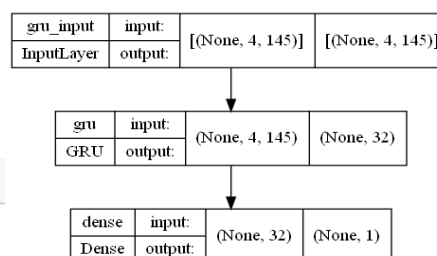
[1.15022873878479, 0.4888888895511627]
```

مشاهده می‌کنیم در طی این آزمایشات بهترین مقدار در صحت مربوط به  $units=32$  می‌باشد و با افزایش تعداد واحد GRU در بین محدوده ۵۵ درصد نوسان داشتیم و مشابه حالت  $lstm$  با افزایش به ۱۸۰ واحد مقدار صحت به زیر ۵۰ درصد کاهش پیدا کرد.

بهترین مقدار برای واحد GRU برابر با  $units=32$  می‌باشد که پارامترهای قابل یادگیری و ساختار شبکه و ماتریس درهم ریختگی به صورت زیر می‌باشد:

Layer (type)	Output Shape	Param #
gru (GRU)	(None, 32)	17184
dense (Dense)	(None, 1)	33

-----  
Total params: 17,217  
Trainable params: 17,217  
Non-trainable params: 0



tn2, fp2, fn2, tp2

(8, 16, 3, 18)

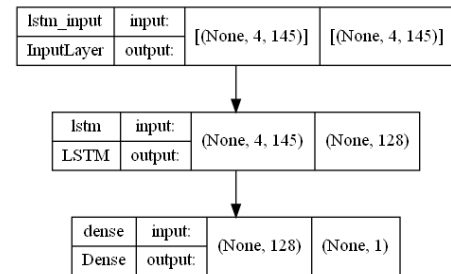
بهترین حالت برای LSTM نیز برابر است با units = 128 :

tn1, fp1, fn1, tp1  
(10, 14, 7, 14)

Layer (type)	Output Shape	Param #
lstm (LSTM)	(None, 128)	140288
dense (Dense)	(None, 1)	129

-----  
Total params: 140,417  
Trainable params: 140,417  
Non-trainable params: 0

با توجه با ساختار هر دو مدل و دقت های بدست آمده تعداد پارامترهای قابل یادگیری برای ساختار GRU در حدود ۱۷ هزار و برای ساختار LSTM در حدود ۱۴۰ هزار می باشد پس GRU با ساختاری کوچک تر توانسته است پیش بینی بهتری را ارائه دهد و با توجه به نکته ای که در سوال یک به ان اشاره کردیم GRU در حال حاضر با یک دیتا ست کوچک در ارتباط بوده است و دقت بهتری را نیز از خود نشان داده است. در حالی که lstm با دیتاست های بزرگ تر به دقت های بهتری خواهد رسید. همچنین با مراجعه به ماتریس درهم ریختگی مشاهده می کنیم مجموع tp+tn در مدل gru نسبت به lstm بیشتر بوده است.



سوال ۳ :

با توجه به ساختار قبل در این قسمت به پشته کردن واحد های بازگشتی می پردازیم

LSTM :

```

keras.backend.clear_session()
inp = keras.Input(shape=(4,145),name='input_layer')
Lstm_hidden1 = keras.layers.LSTM(128, name='lstm_layer1',return_sequences=True)
Lstm_hidden2 = keras.layers.LSTM(64,name='lstm_layer2')
output_layer = keras.layers.Dense(1,name = 'output_layer')

lstm_hidden1_output = Lstm_hidden1(inp)
lstm_hidden2_output = Lstm_hidden2(lstm_hidden1_output)
output_value = output_layer(lstm_hidden2_output)

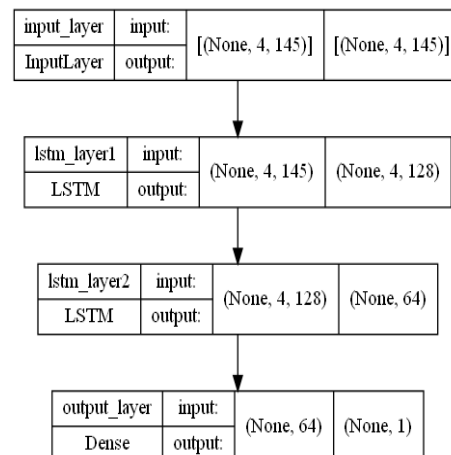
Deep_lstm_model = keras.Model(inputs= inp , outputs =output_value)
Deep_lstm_model.compile(loss='binary_crossentropy', optimizer=keras.optimizers.Adam(learning_rate=0.0001),metrics=['accuracy'])

```

عمق واحد بازگشتی را یک مرحله افزایش داده ایم ساختار این شبکه و پارامترهای ان به صورت زیر می باشد :

Layer (type)	Output Shape	Param #
input_layer (InputLayer)	[(None, 4, 145)]	0
lstm_layer1 (LSTM)	(None, 4, 128)	140288
lstm_layer2 (LSTM)	(None, 64)	49408
output_layer (Dense)	(None, 1)	65

-----  
Total params: 189,761  
Trainable params: 189,761  
Non-trainable params: 0

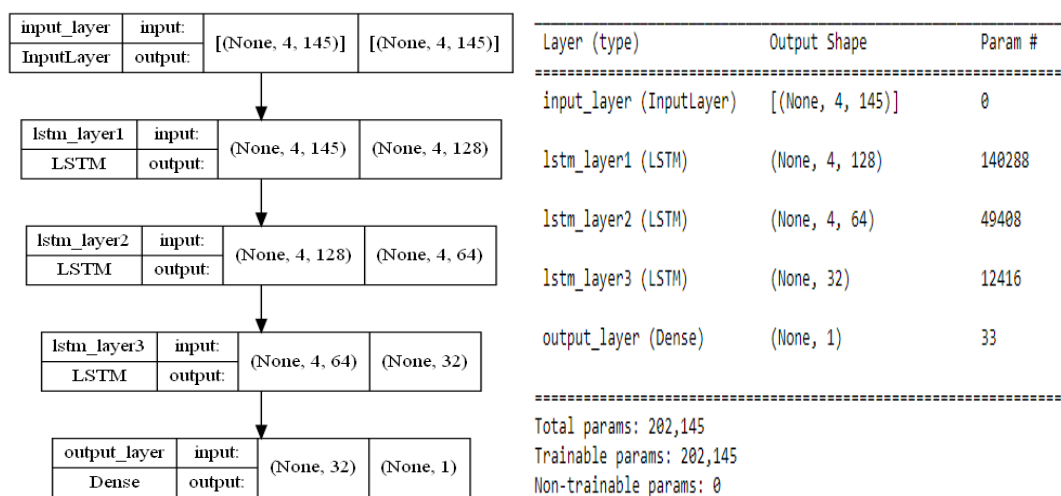


سپس شبکه را با ساختار فوق با ۱۰۰ دور آموزش اجرا می‌کنیم :

```
Epoch 96/100
5/5 [=====] - 0s 30ms/step - loss: 0.5878 - accuracy: 0.6923 - val_loss: 0.5817 - val_accuracy: 0.65
22
Epoch 97/100
5/5 [=====] - 0s 36ms/step - loss: 0.5865 - accuracy: 0.6795 - val_loss: 0.5746 - val_accuracy: 0.73
91
Epoch 98/100
5/5 [=====] - 0s 31ms/step - loss: 0.5832 - accuracy: 0.7179 - val_loss: 0.5877 - val_accuracy: 0.65
22
Epoch 99/100
5/5 [=====] - 0s 31ms/step - loss: 0.5828 - accuracy: 0.7115 - val_loss: 0.5807 - val_accuracy: 0.65
22
Epoch 100/100
5/5 [=====] - 0s 31ms/step - loss: 0.5938 - accuracy: 0.6603 - val_loss: 0.5739 - val_accuracy: 0.73
91
2/2 [=====] - 0s 23ms/step - loss: 0.7285 - accuracy: 0.5111
[0.7285200357437134, 0.5111111402511597]
```

دقت بر روی داده‌های آموزش تا ۶۶ درصد و اعتبار سنجی تا ۷۳ درصد رسیده است در حالی که بر روی داده‌های تست به حدود ۵۱ درصد می‌باشد.

حال دوباره عمق شبکه را یک واحد دیگر زیادت‌ر کرده ایم :

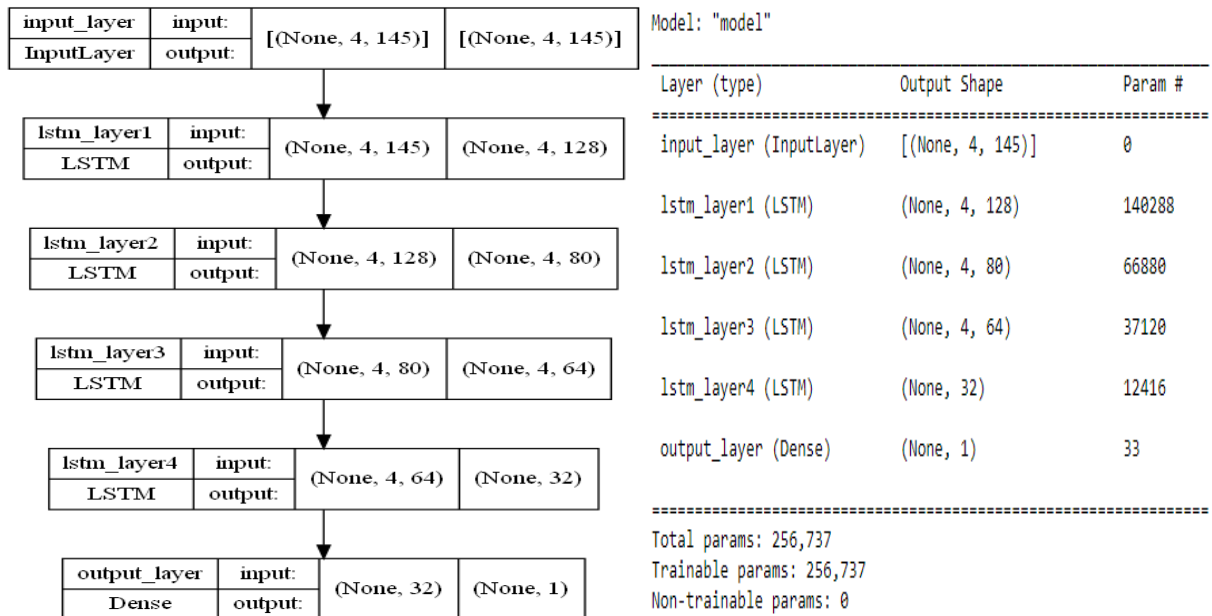


سپس شبکه را با ۲۰۰ دور آموزش می‌دهیم :

```
22
Epoch 196/200
5/5 [=====] - 0s 40ms/step - loss: 0.6212 - accuracy: 0.6667 - val_loss: 0.6392 - val_accuracy: 0.65
22
Epoch 197/200
5/5 [=====] - 0s 42ms/step - loss: 0.6169 - accuracy: 0.6859 - val_loss: 0.6419 - val_accuracy: 0.60
87
Epoch 198/200
5/5 [=====] - 0s 40ms/step - loss: 0.6183 - accuracy: 0.7051 - val_loss: 0.6412 - val_accuracy: 0.60
87
Epoch 199/200
5/5 [=====] - 0s 40ms/step - loss: 0.6161 - accuracy: 0.6987 - val_loss: 0.6393 - val_accuracy: 0.65
22
Epoch 200/200
5/5 [=====] - 0s 39ms/step - loss: 0.6201 - accuracy: 0.6731 - val_loss: 0.6419 - val_accuracy: 0.69
57
2/2 [=====] - 0s 12ms/step - loss: 0.7179 - accuracy: 0.5333
[0.7178578972816467, 0.5333333611488342]
```

شاهد افزایش دو درصدی بر روی داده‌های آزمون شده ایم .

عمق شبکه را یک واحد دیگر افزایش می‌دهیم :



```

22
Epoch 196/200
5/5 [=====] - 0s 60ms/step - loss: 0.6543 - accuracy: 0.6603 - val_loss: 0.6350 - val_accuracy: 0.69
57
Epoch 197/200
5/5 [=====] - 0s 53ms/step - loss: 0.6543 - accuracy: 0.6603 - val_loss: 0.6341 - val_accuracy: 0.65
22
Epoch 198/200
5/5 [=====] - 0s 56ms/step - loss: 0.6552 - accuracy: 0.6603 - val_loss: 0.6357 - val_accuracy: 0.65
22
Epoch 199/200
5/5 [=====] - 0s 63ms/step - loss: 0.6535 - accuracy: 0.6603 - val_loss: 0.6338 - val_accuracy: 0.65
22
Epoch 200/200
5/5 [=====] - 0s 52ms/step - loss: 0.6547 - accuracy: 0.6731 - val_loss: 0.6343 - val_accuracy: 0.69
57
2/2 [=====] - 0s 14ms/step - loss: 0.7120 - accuracy: 0.5778
[0.7120218276977539, 0.577778029441833]

```

مشاهده کردیم با افزایش عمق شاهد افزایش دقت بر روی داده‌های آزمون بودیم.

حال این عمیق تر کردن لایه ها را بر روی معماری GRU اجرا می‌کنیم :

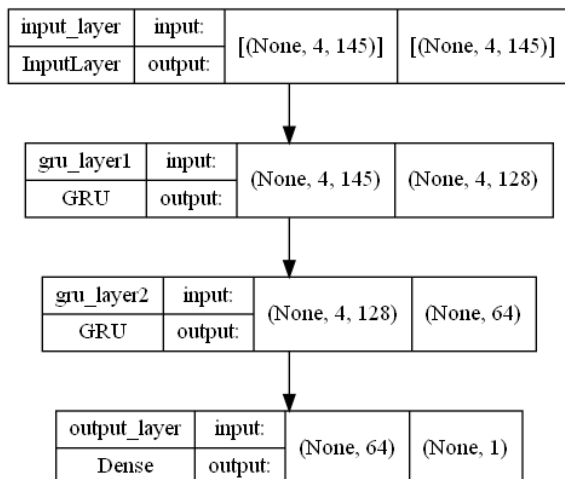
```

keras.backend.clear_session()
inp_gru = keras.Input(shape=(4,145),name='input_layer')
gru_hidden1 = keras.layers.GRU(128, name='gru_layer1',return_sequences=True)
gru_hidden2 = keras.layers.GRU(64,name='gru_layer2')
output_layer_gru = keras.layers.Dense(1,name = 'output_layer')

gru_hidden1_output = gru_hidden1(inp)
gru_hidden2_output = gru_hidden2(gru_hidden1_output)
output_value_gru = output_layer_gru(gru_hidden2_output)

Deep_gru_model = keras.Model(inputs= inp , outputs =output_value_gru)
Deep_gru_model.compile(loss='binary_crossentropy', optimizer=keras.optimizers.Adam(learning_rate=0.0001),metrics=['accuracy'])

```



Model: "model"

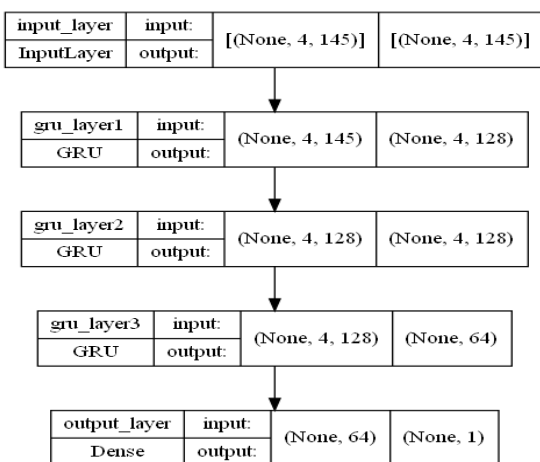
Layer (type)	Output Shape	Param #
=====		
input_layer (InputLayer)	[(None, 4, 145)]	0
gru_layer1 (GRU)	(None, 4, 128)	105600
gru_layer2 (GRU)	(None, 64)	37248
output_layer (Dense)	(None, 1)	65
=====		
Total params: 142,913		
Trainable params: 142,913		
Non-trainable params: 0		

سپس مدل ساخته شده را با ۲۰۰ دور آموزش می‌دهیم :

```
Epoch 196/200
5/5 [=====] - 0s 33ms/step - loss: 0.5619 - accuracy: 0.6923 - val_loss: 0.5886 - val_accuracy: 0.69
57
Epoch 197/200
5/5 [=====] - 0s 33ms/step - loss: 0.5640 - accuracy: 0.7051 - val_loss: 0.5758 - val_accuracy: 0.73
91
Epoch 198/200
5/5 [=====] - 0s 34ms/step - loss: 0.5600 - accuracy: 0.6923 - val_loss: 0.5891 - val_accuracy: 0.69
57
Epoch 199/200
5/5 [=====] - 0s 33ms/step - loss: 0.5578 - accuracy: 0.7115 - val_loss: 0.5818 - val_accuracy: 0.69
57
Epoch 200/200
5/5 [=====] - 0s 32ms/step - loss: 0.5606 - accuracy: 0.7115 - val_loss: 0.5811 - val_accuracy: 0.73
91
2/2 [=====] - 0s 11ms/step - loss: 0.7068 - accuracy: 0.4667
[0.706840455532074, 0.466666666865348816]
```

در دقت بر روی داده‌های آموزش و اعتبار سنجی نسبت به حالت مشابه *lstm* بهبود داشته ایم در حالی که پارامترهای قابل یادگیری به مراتب کمتری وجود دارد.

حال عمق شبکه را یک واحد عمیق تر مشابه حالت قبل می‌کنیم :



Model: "model"

Layer (type)	Output Shape	Param #
=====		
input_layer (InputLayer)	[(None, 4, 145)]	0
gru_layer1 (GRU)	(None, 4, 128)	105600
gru_layer2 (GRU)	(None, 4, 64)	37248
gru_layer3 (GRU)	(None, 32)	9408
output_layer (Dense)	(None, 1)	33
=====		
Total params: 152,289		
Trainable params: 152,289		
Non-trainable params: 0		

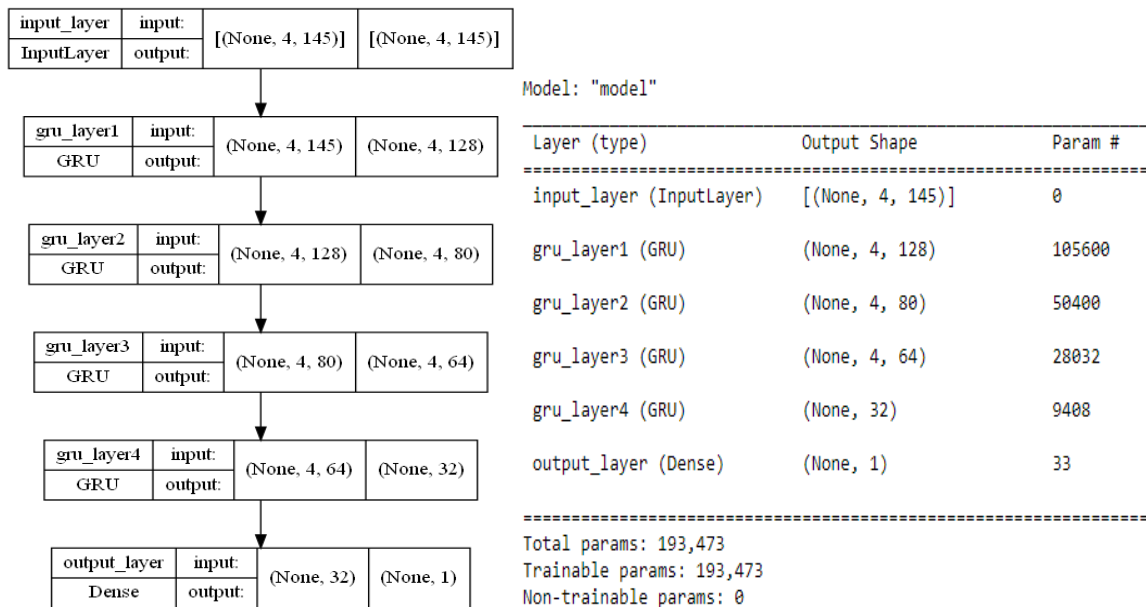
```

Epoch 196/200
5/5 [=====] - 0s 48ms/step - loss: 0.5841 - accuracy: 0.6923 - val_loss: 0.5795 - val_accuracy: 0.73
91
Epoch 197/200
5/5 [=====] - 0s 56ms/step - loss: 0.5828 - accuracy: 0.6923 - val_loss: 0.5817 - val_accuracy: 0.73
91
Epoch 198/200
5/5 [=====] - 0s 58ms/step - loss: 0.5837 - accuracy: 0.7051 - val_loss: 0.5949 - val_accuracy: 0.69
57
Epoch 199/200
5/5 [=====] - 0s 56ms/step - loss: 0.5787 - accuracy: 0.7179 - val_loss: 0.5763 - val_accuracy: 0.73
91
Epoch 200/200
5/5 [=====] - 0s 43ms/step - loss: 0.5874 - accuracy: 0.6987 - val_loss: 0.5751 - val_accuracy: 0.73
91
2/2 [=====] - 0s 22ms/step - loss: 0.7115 - accuracy: 0.5111
[0.711453914642334, 0.5111111402511597]

```

شاهد افزایش در مقدار صحت برای داده‌های آزمون بوده ایم که در حدود ۵۱ درصد می‌باشد.

عمق شبکه را مجدد یک واحد دیگر افزایش می‌دهیم:



```

Epoch 196/200
5/5 [=====] - 0s 55ms/step - loss: 0.5353 - accuracy: 0.7179 - val_loss: 0.5846 - val_accuracy: 0.69
57
Epoch 197/200
5/5 [=====] - 0s 59ms/step - loss: 0.5304 - accuracy: 0.7308 - val_loss: 0.5375 - val_accuracy: 0.78
26
Epoch 198/200
5/5 [=====] - 0s 68ms/step - loss: 0.5359 - accuracy: 0.7051 - val_loss: 0.6024 - val_accuracy: 0.69
57
Epoch 199/200
5/5 [=====] - 0s 59ms/step - loss: 0.5574 - accuracy: 0.7372 - val_loss: 0.5376 - val_accuracy: 0.78
26
Epoch 200/200
5/5 [=====] - 0s 62ms/step - loss: 0.5421 - accuracy: 0.7051 - val_loss: 0.5673 - val_accuracy: 0.69
57
2/2 [=====] - 0s 15ms/step - loss: 1.3181 - accuracy: 0.5111
[1.3181369304656982, 0.5111111402511597]

```

مقدار صحت بر روی داده‌های آموزش تا ۷۰ درصد و بر روی داده‌های اعتبارسنجی تا ۶۹ درصد رسیده است .



به نظر می‌رسد که با افزایش عمق، شبکه عملکرد بهتری را از خود نشان می‌دهد اما متناسب با این افزایش عمق پارامترهای قابل یادگیری مسئله نیز افزایش پیدا می‌کنند و آموزش سخت تر خواهد شد برای پیدا کردن تعداد عمق بهینه برای شبکه مذکور با سعی و خطا می‌توان این ساختار را پیدا کرد.

برای پاسخ به این پرسش که کدام یک از این ساختارها را می‌توان عمیق تر کرد می‌توان به این مسئله اشاره کرد که gru نیاز به حافظه کمتری دارد و سریع تر نسبت به lstm می‌باشد پس با افزایش عمق این شبکه بار محاسباتی و پارامترهای قابل یادگیری به مراتب کمتر خواهد بود بدین ترتیب gru را می‌توان عمیق تر مورد استفاده قرار داد در صورت نیاز.