

Построение метода динамического выравнивания многомерных временных рядов, устойчивого к локальным колебаниям сигнала.*

*И. О. Автор*¹, *И. О. Соавтор*², *И. О. Фамилия*^{1,2}
author@site.ru; co-author@site.ru; co-author@site.ru

¹Организация, адрес; ²Организация, адрес

Данная работа посвящена построению эффективного алгоритма динамического выравнивания многомерных временных рядов. Для решения данной задачи предлагается использовать функцию расстояния DTW между двумя многомерными временными рядами, согласно которому выравниваются две оси времени, при этом внутри функционала DTW выбирается расстояние между i -м и j -м измерениями такое, что оно устойчиво к локальным “сдвигам” сигнала. В качестве решения будет рассмотрено более продвинутое, основанное на DTW между парой измерений. Для проверки корректности используются как и реальные данные, например измерения активность мозга обезьян, так и искусственно сгенерированные, например движение сигнала в пространстве по часовой и против часовой стрелки.

Ключевые слова: *многомерные временные ряды; DTW; динамическое выравнивание.*

1 Введение

В данной работе исследуется проблема динамического выравнивания многомерных временных рядов, устойчивого к локальным колебаниям сигнала. Временной ряд - собранный в разные моменты времени статистический материал о значении каких-либо параметров (в простейшем случае одного исследуемого процесса). В данном случае рассматривается многомерный случай.

Необходимость сравнивать 2 временных ряда на схожесть возникает из практических задач таких как классификация геномных сигналов [1]

При этом необходимо учитывать, что в таких задачах как ... возникает необходимо учитывать, что близость временных рядов не ограничивается сдвигами по времени, а также присутствует расположением сигналов.

Для сравнения определения расстояния между временными рядами будет использовать известный алгоритм DTW..., однако возникает проблема определения расстояния между сигналами в этом алгоритме.

Базовое решение задачи с помощью метрики L2 расстояния между рядами не всегда оказывается эффективным. Таким примером являются 2 временных ряда, полученные при близком расположении датчиков с сигналами, которые могут зафиксировать один и тот же пик. Полученный пик окажет большое влияние на значение метрики L2.

Напротив, использование известного алгоритма DTW, но уже в многомерном случае позволит обойти проблему малого расстояния между датчиками, как более частный метод для решения конкретного типа задач.

Итак, в данной работе рассматриваются 2 варианта расстояния между сигналами L2 и DTW, выравнивание по временной оси будет сглаживать DTW.

Полученные алгоритмы тестировались на реальных данных и искусственно сгенерированных. Полученные результаты показали преимущество использования попарного DTW алгоритма.

*Работа выполнена при финансовой поддержке РФФИ, проекты № №00-00-00000 и 00-00-00001.

2 Постановка задачи.

Рассматривается алгоритм решения задачи динамического выравнивания многомерных рядов.

Задача классификации временных рядов имеет вид.

Пусть X - множество временных рядов, Y - множество меток классов.

$$\forall x \in X x \in \mathbb{R}^K$$

При $|Y| = 2$ рассматривается задача бинарной классификации, при $|Y| \geq 2$ - многоклассовой классификации.

Предполагается существование зависимости $f : X \rightarrow Y$

Задача заключается в поиске оптимального алгоритма из семейства $A = \{a_\alpha\}$, предсказывающего класс из множества Y .

Пусть $X^n = \{X_1, X_2 \dots X_n\}$ - обучающая выборка из временных рядов, $Y^n = \{Y_1, Y_2 \dots Y_n\}$ - метки классов.

В качестве алгоритмов классификации будем использовать метрические алгоритмы классификации. Поэтому введём функцию расстояния между 2 временными рядами с помощью алгоритма DTW.

$$D(i, j) = d(i, j) + \min(D(i-1, j), D(i, j-1), D(i-1, j-1))$$

$d(i, j)$ - расстояние между парой сигналов. Определяется 2 разными способами.

1) L2 - метрика.

$$d(i, j) = \sum_{k=1}^K (X(i, k) - X(j, k))^2$$

2) DTW - расстояние.

$$d(i, j, k, t) = (X(i, k) - X(j, t))^2 + \min(d(i, j, k-1, t), d(i, j, k, t-1), d(i, j, k-1, t-1))$$

$$d(i, j) := d(i, j, K, K)$$

В качестве функционала ошибки будем рассматривать ассигасу $= \frac{TP+TN}{TP+TN+FP+FN}$

Будут рассматриваться искусственно сгенерированные данные, которые жестко будут разделены по положению пика на 2 класса.

Те ряды, которые имеют небольшое расстояние до пика, будут принадлежать одному классу.

3 Базовый эксперимент

Суть эксперимента заключается в сравнении различных метрик для сравнения многомерных временных рядов, а именно: DTW и L2.

Эксперимент проводится в 2 этапа.

1. Искусственно сгенерированные данные, на которых можно увидеть достоинства и недостатки работы алгоритмов и предложить из улучшение.

2. Реальные данные, на которых можно протестировать полученные алгоритмы и измерить качество.

Генерация многомерных временных рядов из 1 шага проводится с помощью функций с отчётливым пиком:

$$\sin(x)$$

$$x^2$$

плотность нормального распределения

В дальнейшем следует сдвиг по временной шкале семества этих функций и некоторый небольшой сдвиг максимума по шкале пространства.

$$f(x) \rightarrow f(x + a)$$

Также будем масштабировать значения

$$f(x) \rightarrow f(ax)$$

Суть 2 этапа заключается в проверке полученных на 1 шаге алгоритмов на реальных данных и измерением точности.

В итоге будет выбран лучший алгоритм.

Литература

- [1] Stan Salvador and Philip Chan. Toward accurate dynamic time warping in linear time and space. *Intell. Data Anal*, 11(5):561–580, 2007.
- [2] Gineke ten Holt, Marcel Reinders, and Emile Hendriks. Multi-dimensional dynamic time warping for gesture recognition. *Annual Conference of the Advanced School for Computing and Imaging*, 01 2007.
- [3] Jörg P. Bachmann and Johann-Christoph Freytag. High dimensional time series generators. *CoRR*, abs/1804.06352, 2018.
- [4] Nurjahan Begum, Liudmila Ulanova, Hoang Anh Dau, Jun Wang, and Eamonn J. Keogh. A general framework for density based time series clustering exploiting a novel admissible pruning strategy. *CoRR*, abs/1612.00637, 2016.
- [5] P. Sanguansat. Multiple multidimensional sequence alignment using generalized dynamic time warping. *WSEAS Transactions on Mathematics*, 11:684–694, 08 2012.
- [6] Eamonn J. Keogh and Michael J. Pazzani. Derivative dynamic time warping. In *SIAM International Conference on Data Mining*, 2001.
- [7] Parinya Sanguansat. Multiple multidimensional sequence alignment using generalized dynamic time warping. 2012.
- [8] Babula Petr Kizek Rene Provaznik Ivo Skutkova Helena, Vitek Martin.

Поступила в редакцию