

# 实验五：图卷积神经网络

姓名：刘威  
学号：PB18010469  
Click [here](#) to finish reading:-)

## 实验目的

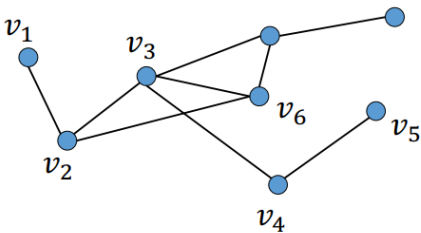
- 熟悉图卷积神经网络的基本原理
- 了解网络层数对图卷积神经网络性能的影响
- 了解不同激活函数，Add self loop, DropEdge, PairNorm等技术对图卷积神经网络性能的影响。

## 实验原理

### 图的基本概念

- 图的矩阵  $A$  表示
  - 邻接矩阵  $A_{ij} = 1$ , 如果  $v_i$  和  $v_j$  相邻
  - 度矩阵  $D = \text{diag}(d(v_1), \dots, d(v_N))$

$$d(v_i) = \sum_{v_j \in \mathcal{N}_{v_i}} A_{ij}$$



度矩阵	邻接矩阵
$\begin{pmatrix} 1 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 \\ 0 & 3 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 4 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 2 & 0 & 0 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 0 & 2 & 0 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 4 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 3 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 1 \end{pmatrix}$	$\begin{pmatrix} 0 & 1 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 \\ 1 & 0 & 1 & 0 & 0 & 1 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & 0 & 1 & 0 & 1 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 1 & 0 & 1 & 0 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 1 & 0 & 1 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & 1 & 0 & 1 & 0 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 1 & 0 & 0 & 1 & 0 & 1 \\ 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 1 & 0 \end{pmatrix}$
$D$	$A$

• 拉普拉斯矩阵的性质  $L = D - A$

• 1)  $L \mathbf{1} = D\mathbf{1} - A\mathbf{1} = \mathbf{d} - \mathbf{d} = \mathbf{0}$   $\mathbf{d} = \text{diag}(D)$

• 2)  $\mathbf{1} L = \mathbf{0}$

• 3)  $L$  是半正定的。最小特征值为0，其特征向量为 $\mathbf{1}$

证明： 对于任意的向量  $\mathbf{z} \in \mathbb{R}^n$ ，那么

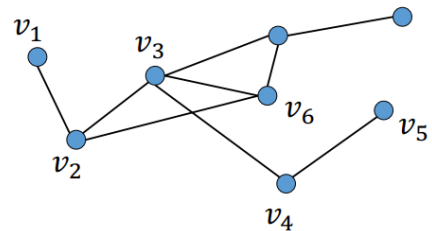
$L$  的特征值中0的个数等  
同于原图的连通块数量

$$\begin{aligned} \mathbf{z}^T L \mathbf{z} &= \sum_i d_i z_i^2 - \sum_{ij} A_{ij} z_i z_j \\ &= \frac{1}{2} \left( \sum_i d_i z_i^2 - 2 \sum_{ij} A_{ij} z_i z_j + \sum_j d_j z_j^2 \right) \\ &= \frac{1}{2} \left( \sum_i \sum_j A_{ij} z_i^2 - 2 \sum_{ij} A_{ij} z_i z_j + \sum_j \sum_i A_{ij} z_j^2 \right) \\ &= \frac{1}{2} \sum_i \sum_j A_{ij} (z_i - z_j)^2 \geq 0 \end{aligned}$$

• 归一化后的拉普拉斯矩阵

• 对称归一化:  $L^{sym} = D^{-\frac{1}{2}} L D^{-\frac{1}{2}} = I - D^{-\frac{1}{2}} A D^{-\frac{1}{2}}$

• 随机游走归一化:  $L^{rw} = D^{-1} L = I - D^{-1} A$



度矩阵	邻接矩阵	拉普拉斯矩阵
$D = \begin{pmatrix} 1 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 \\ 0 & 3 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 4 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 2 & 0 & 0 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 0 & 2 & 0 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 4 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 3 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 1 \end{pmatrix}$	$A = \begin{pmatrix} 0 & 1 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 \\ 1 & 0 & 1 & 0 & 0 & 1 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & 0 & 1 & 0 & 1 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 1 & 0 & 1 & 0 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 1 & 0 & 1 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & 1 & 0 & 1 & 0 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 1 & 0 & 0 & 1 & 0 & 1 \\ 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 1 & 0 \end{pmatrix}$	$L = \begin{pmatrix} 1 & -1 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 \\ -1 & 3 & -1 & 0 & 0 & -1 & 0 & 0 \\ 0 & -1 & 4 & -1 & 0 & -1 & -1 & 0 \\ 0 & 0 & -1 & 2 & -1 & 0 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & -1 & 2 & -1 & 0 & 0 \\ 0 & -1 & -1 & 0 & -1 & 4 & -1 & 0 \\ 0 & 0 & -1 & 0 & 0 & -1 & 3 & -1 \\ 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & -1 & 1 \end{pmatrix}$
	$-$	$=$

• 归一化后的拉普拉斯矩阵  $L^{sym}$  的性质:

• 1)  $L^{sym}$  特征值的介于0到2之间

## 图傅里叶变换

- $L = U\Lambda U^\top$  为其特征值分解,  $U$  的列向量类比于傅里叶变换中的基
- 对图上信号  $z$  的图傅里叶变换:

$$\mathcal{F}(\lambda_l) = \hat{f}(\lambda_l) = \sum_{i=1}^n f(i) u_l(i) = \mathbf{u}_l^\top \mathbf{f}$$

$$\begin{pmatrix} \hat{f}(\lambda_1) \\ \hat{f}(\lambda_2) \\ \vdots \\ \hat{f}(\lambda_N) \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} u_1(1) & u_1(2) & \dots & u_1(N) \\ u_2(1) & u_2(2) & \dots & u_2(N) \\ \vdots & \vdots & \ddots & \vdots \\ u_N(1) & u_N(2) & \dots & u_N(N) \end{pmatrix} \begin{pmatrix} f(1) \\ f(2) \\ \vdots \\ f(N) \end{pmatrix} \quad \Rightarrow \quad \hat{\mathbf{f}} = U^\top \mathbf{f}$$

## 图傅里叶逆变换

- $L = U\Lambda U^\top$  为其特征值分解,  $U$  的列向量类比于傅里叶变换中的基
- 对图上信号  $z$  的图傅里叶逆变换:

$$f(i) = \sum_{l=1}^n \hat{f}(\lambda_l) u_l(i) = \mathbf{u}(i)^\top \hat{\mathbf{f}}$$

$$\begin{pmatrix} f(1) \\ f(2) \\ \vdots \\ f(N) \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} u_1(1) & u_2(1) & \dots & u_N(1) \\ u_1(2) & u_2(2) & \dots & u_N(2) \\ \vdots & \vdots & \ddots & \vdots \\ u_1(N) & u_2(N) & \dots & u_N(N) \end{pmatrix} \begin{pmatrix} \hat{f}(\lambda_1) \\ \hat{f}(\lambda_2) \\ \vdots \\ \hat{f}(\lambda_N) \end{pmatrix} \quad \Rightarrow \quad \mathbf{f} = U \hat{\mathbf{f}}$$

任一信号  $\mathbf{f}$  是不同频率的特征向量的组合

## 谱域上的图卷积

- 空域上很难定义卷积-->转到谱域



- 从图信号处理的角度考虑图卷积

- 卷积公式  $\mathbf{f} * \mathbf{g} = \mathbb{F}^{-1} \{ \mathbb{F} \{ \mathbf{f} \} \cdot \mathbb{F} \{ \mathbf{g} \} \}$

卷积定理: 函数卷积的傅里叶变换是函数傅立叶变换的乘积

- 给一个图信号  $\mathbf{x}$  和一个卷积核  $\mathbf{g}$   $\mathbf{x} * \mathbf{g} = U(U^\top \mathbf{x} \odot U^\top \mathbf{g})$

- $U^\top \mathbf{g}$  当成整体的卷积核, 用参数  $\boldsymbol{\theta}$  表示

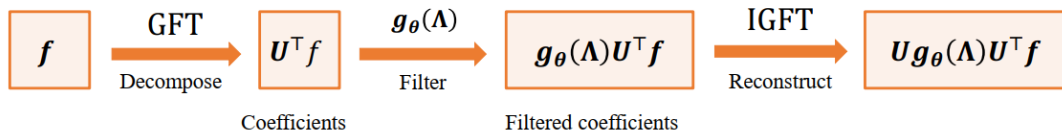
$$\mathbf{x} * \mathbf{g} = U(U^\top \mathbf{x} \odot U^\top \mathbf{g}) = U(U^\top \mathbf{x} \odot \boldsymbol{\theta}) = U \mathbf{g}_\theta U^\top \mathbf{x}$$

用  $\mathbf{g}_\theta$  表示对角线为  $\boldsymbol{\theta}$  的矩阵

- 回顾:

$$\text{GFT: } \hat{f} = U^\top f \quad \text{IGFT: } f = U \hat{f}$$

- 滤波信号: 空域信号 → 谱域信号 → 滤波 → 空域信号



## 最简单的谱域图卷积网络

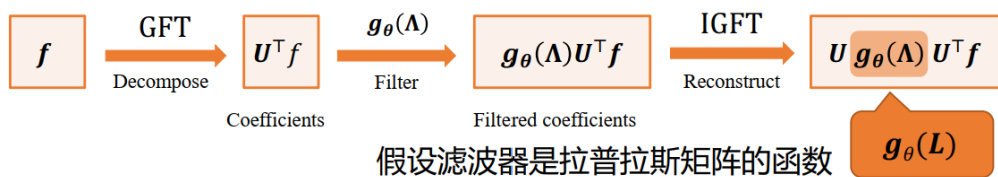
- Spectral Graph CNN
  - 无参数化:  $g_\theta$  与  $L$  的特征向量无关

$$x * g = U g_\theta U^\top x = U \begin{pmatrix} \theta_1 & & \\ & \theta_2 & \\ & & \ddots \\ & & & \theta_n \end{pmatrix} U^\top x$$

- 缺点
  - 参数多, 总共有  $n$  个参数,  $n$  为节点数
  - 需要对拉普拉斯矩阵进行特征分解,  $O(n^3)$  时间复杂度
  - 不能局部化: 每个节点上信号依赖于其他全部节点信号, 而不只是邻居

## 多项式卷积核 (ChebyNet)

- 局部化:  $L$  对图信号  $f$  的操作  $L f$  相当于在图上传播一步 常用归一化的  $L$ , 比如  $L_{sym}$



- 多项式卷积核:

$$g_\theta(\Lambda) = \sum_{k=0}^K \theta_k \Lambda^k$$

$$\hat{g}(\Lambda) = \begin{bmatrix} \sum_{k=0}^K \theta_k \lambda_1^k & & \\ & \sum_{k=0}^K \theta_k \lambda_2^k & \\ & & \ddots \\ & & & \sum_{k=0}^K \theta_k \lambda_N^k \end{bmatrix}$$

$$U \hat{g}(\Lambda) U^\top f = U \sum_{k=0}^K \theta_k \Lambda^k U^\top f$$

$$L^k = U \Lambda^k U^\top = \sum_{k=0}^K \theta_k L^k f$$

**局部性:** 实际上在图上传播了  $K$  步, 因此一个节点只影响它周围距离为  $K$  以内的邻居

**效率高:** 不需要进行特征值分解

**参数少:** 只有  $K+1$  个参数

- 切比雪夫多项式，通过如下递归定义
  - $T_0(x) = 1; T_1(x) = x$
  - $T_k(x) = 2xT_{k-1}(x) - T_{k-2}(x)$
- 由于其定义域为 $[-1,1]$ ，因此 $\hat{g}(\Lambda)$ 通过如下方式定义

$$\hat{g}(\Lambda) = \sum_{k=0}^K \theta_k T_k(\tilde{\Lambda}) \quad \text{其中 } \tilde{\Lambda} = \frac{2\Lambda}{\lambda_{\max}} - I$$

- 在归一化之后，任然可以不用计算特征值分解

- 有结论  $U\hat{g}(\Lambda)U^T f = \sum_{k=0}^K \theta_k T_k(\tilde{L}) f$ , 其中  $\tilde{L} = \frac{2L}{\lambda_{\max}} - I$

归一化图拉普拉斯矩阵 $L^{sym}$   
最大特征值约为2,  $\lambda_{\max} \approx 2$

$$L^{sym} = D^{-\frac{1}{2}} L D^{-\frac{1}{2}} = I - D^{-\frac{1}{2}} A D^{-\frac{1}{2}}$$

$$\Rightarrow \tilde{L} = \frac{2L^{sym}}{\lambda_{\max}} - I = L^{sym} - I = -D^{-\frac{1}{2}} A D^{-\frac{1}{2}}$$

- 假设我们只取1阶切比雪夫多项式，且 $\lambda_{\max} \approx 2$
- 此时节点只能被它周围的1阶邻接点所影响，但只需要叠加K层这样的图卷积层，就可以把节点的影响力扩展到K阶邻居节点

$$y = \sum_{k=0}^1 \theta_k T_k(\tilde{L}) x \approx \theta_0 T_0(\tilde{L}) x + \theta_1 T_1(\tilde{L}) x$$

$$\approx \theta_0 x - \theta_1 D^{-\frac{1}{2}} A D^{-\frac{1}{2}} x$$

$$\text{取 } \theta' = \theta_0 = -\theta_1 \approx \theta' \left( I + D^{-\frac{1}{2}} A D^{-\frac{1}{2}} \right) x$$

根据类似方法，可证明可得  $I + D^{-\frac{1}{2}} A D^{-\frac{1}{2}}$  的特征值在 $[0,2]$ 之间，叠加多层图卷积层会多次迭代这个操作，可能造成数值不稳定和梯度爆炸的问题

$$I + D^{-\frac{1}{2}} A D^{-\frac{1}{2}} \xrightarrow{\text{做归一化}} \tilde{D}^{-\frac{1}{2}} \tilde{A} \tilde{D}^{-\frac{1}{2}} \Rightarrow y = \tilde{D}^{-\frac{1}{2}} \tilde{A} \tilde{D}^{-\frac{1}{2}} X \Theta$$

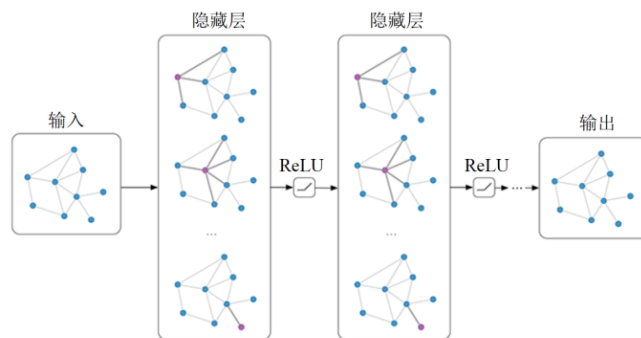
$$\tilde{A} = A + I \quad \text{特征值在}[0,1]$$

$$\tilde{D} = D + I \quad X \in R^{n \times d}: \text{节点属性矩阵}$$

## 从ChebyNet到GCN

- 叠加多层GCN得到最终的模型(常取两层)

$$\hat{Y} = f(X, A) = \text{Softmax} \left( \hat{A} \text{ReLU}(\hat{A} X W^0) W^1 \right)$$



其中

$$\hat{A} = \tilde{D}^{-\frac{1}{2}} \tilde{A} \tilde{D}^{-\frac{1}{2}}$$

$$\tilde{A} = A + I_n$$

$$\tilde{D}_{ii} = \sum_j \tilde{A}_{ij}$$

## 实验内容

- 给定三个图数据，实现GCN算法用于节点分类和链路预测，分析自环、层数、DropEdge、PairNorm、激活函数等因素的分类性能和链路预测性能的影响
- 请助教准备Cora、Citeseer、PPI的数据

## 实验结果

- 本实验使用 PyTorch 进行，并主要使用了 pytorch\_geometric 库。
- 本实验再 Cora 和 Citeseer 两个数据集上进行了节点分类，并比较了自环，层数，DropEdge，PairNorm，激活函数对其分类性能的影响。

## 源码结构及说明

### 数据处理部分

数据集概览：

Dataset	Nodes	Edges	Classes	Features
Citeseer	3327	4732	6	3703
Cora	2708	5429	7	1433

数据处理方法：

按照 pytorch\_geometric 的数据输入格式，将顶点关联的 features 组织成一个二维矩阵  $x$ ：shape=(Nodes, Features)，将图结构，即顶点的连接关系用 coo 格式组织成一个二维矩阵 edge\_index：shape=(2, Edges) (邻接矩阵的稀疏表示)。将标签处理为一维向量  $y$ ：shape=(Nodes,) 其取值范围为 range(Classes)。

通过 mask 将顶点划分为 train, val, test。其中 train\_mask 覆盖每个类别分别20个顶点，val\_mask 覆盖除 train\_mask 外的随机500个顶点，test\_mask 覆盖除前两者外的随机1000个顶点。图结构难以拆解成三个部分，因此图是一整个输入到网络中的，也即所有的顶点都会参与计算。train\_mask 的作用是，在计算损失时，将其他顶点mask掉，只计算训练顶点的损失。同样地，通过 val\_mask, test\_mask 我们可以分别计算 val 和 test 顶点的分类准确率。

## 模型部分

网络用 `n_layers` 层 GCN 堆叠而成，在每层 GCN 后都紧跟一层可选的 PairNorm 层；除了最后一层外，每层的 PairNorm 后还有有激活函数和 dropout，激活函数可以选择 `relu`, `tanh`, `sigmoid`，dropout 可以调节 drop 的概率 `p`。

其中 GCN 直接使用 `pytorch_geometric` 库中的 `GCNConv` 层，它可以通过参数 `add_self_loop` 设置是否添加自环。在输入 GCN 之前，还可以通过设置 `drop_edge` 的 drop 比例去掉部分 `edge_index`。

完整的模型定义如下：

```
import torch
import torch.nn.functional as F
from torch_geometric.nn import GCNConv, PairNorm
from torch_geometric.utils import dropout_adj

activations = {
    'relu': torch.relu,
    'sigmoid': torch.sigmoid,
    'tanh': torch.tanh,
}

class GCN(torch.nn.Module):
    def __init__(self, in_channels: int, hidden_channels: int, num_classes: int,
                 n_layers: int, act: str = 'relu', add_self_loops: bool = True,
                 pair_norm: bool = True, dropout: float = .0, drop_edge: float =
                 .0):
        super(GCN, self).__init__()
        self.dropout = dropout
        self.drop_edge = drop_edge
        self.pair_norm = pair_norm
        self.act = activations[act] if isinstance(act, str) else act

        self.conv_list = torch.nn.ModuleList()
        for i in range(n_layers):
            in_c, out_c = hidden_channels, hidden_channels
            if i == 0:
                in_c = in_channels
            elif i == n_layers - 1:
                out_c = num_classes
            self.conv_list.append(GCNConv(in_c, out_c,
                                          add_self_loops=add_self_loops))

        def forward(self, x, edge_index):
            edge_index, _ = dropout_adj(edge_index, p=self.drop_edge)

            for i, conv in enumerate(self.conv_list):
                x = conv(x, edge_index)
                if self.pair_norm:
                    x = PairNorm()(x)
                if i < len(self.conv_list) - 1:
                    x = self.act(x)
                    x = F.dropout(x, p=self.dropout, training=self.training)

            return x
```

## 结果及分析

### 参数设置

本实验的可选参数及其默认值为

```
default_cfg = {
    'data_root': './GNN/', # 数据根目录
    'data_name': 'cora', # citeseer or cora
    'num_train_per_class': 20, # 训练集包含的每个类别的顶点数目
    'num_val': 500, # 验证集顶点数目
    'num_test': 1000, # 测试集顶点数目
    'seed': 114514,
    'device': 'cuda:0',
    'epochs': 1000,
    'patience': 5, # 早停的等待轮数
    'lr': 5e-3,
    'weight_decay': 5e-4,
    'hidden_dim': 32,
    'n_layers': 2,
    'activations': 'relu',
    'dropout': 0.5,
    'drop_edge': 0.,
    'add_self_loop': True,
    'pair_norm': False,
    'test_only': False
}
```

其中本实验进行调节的参数及调节的范围为

```
cfg_grid = {
    'data_name': ['citeseer', 'cora'],
    'add_self_loop': [True, False],
    'n_layers': [1, 2, 3, 5, 10],
    'drop_edge': [0, .1, .2, .3, .5],
    'pair_norm': [True, False],
    'activations': ['relu', 'tanh', 'sigmoid']
}
```

共有600种可能的参数组合。在每种参数组合下，分别训练模型，并通过验证集 `val_loss` 进行早停，以 `val_loss` 最低时的模型权重对测试集进行测试，以其分类准确率 `test_acc` 作为最终评价指标。

### 结果对比分析

所有的组合下的 `test_acc` 结果可以在附件 [result.csv](#) 中查看，下面仅列举出部分结果。

两个数据集上的最好结果及对应参数

data_name	add_self_loop	n_layers	drop_edge	pair_norm	activations	test_acc
'cora'	True	2	0.	False	'relu'	0.797
'citeseer'	True	2	0.	False	'relu'	0.685

**Note:** 下面的对比均以 `citeseer` 数据集为例, 即 `data_name='citeseer'`

是否添加自环的对比



Selected Comparision:

data_name	add_self_loop	n_layers	drop_edge	pair_norm	activations	test_acc
citeseer	True	3	0.0	False	relu	0.645
citeseer	False	3	0.0	False	relu	0.628
citeseer	True	2	0.0	False	relu	0.685
citeseer	False	2	0.0	False	relu	0.667

分析：添加自环效果好，在某些参数下提升非常显著。

### 不同层数的对比

Selected Comparision:

data_name	add_self_loop	n_layers	drop_edge	pair_norm	activations	test_acc
citeseer	True	1	0.0	False	relu	0.68
citeseer	True	2	0.0	False	relu	0.685
citeseer	True	3	0.0	False	relu	0.645
citeseer	True	5	0.0	False	relu	0.522
citeseer	True	10	0.0	False	relu	0.176

分析：两层效果最好，层数多难以优化。

### drop edge的对比

data_name	add_self_loop	n_layers	drop_edge	pair_norm	activations	test_acc
citeseer	True	5	0.0	False	relu	0.522
citeseer	True	5	0.1	False	relu	0.351
citeseer	True	5	0.2	False	relu	0.182
citeseer	True	5	0.3	False	relu	0.201
citeseer	True	5	0.5	False	relu	0.188
citeseer	True	3	0.0	False	relu	0.645
citeseer	True	3	0.1	False	relu	0.671
citeseer	True	3	0.2	False	relu	0.655
citeseer	True	3	0.3	False	relu	0.663
citeseer	True	3	0.5	False	relu	0.609

分析：层数少时drop edge 有点效果，层数深时效果不好。

### 是否使用PairNorm的对比

data_name	add_self_loop	n_layers	drop_edge	pair_norm	activations	test_acc
citeseer	True	1	0.0	False	relu	0.68
citeseer	True	1	0.0	True	relu	0.443
citeseer	True	2	0.0	False	relu	0.685
citeseer	True	2	0.0	True	relu	0.526
citeseer	True	3	0.0	False	relu	0.645
citeseer	True	3	0.0	True	relu	0.568
citeseer	True	5	0.0	False	relu	0.522
citeseer	True	5	0.0	True	relu	0.545
citeseer	True	10	0.0	False	relu	0.176
citeseer	True	10	0.0	True	relu	0.3

分析：层数少时加 PairNorm 效果变差，层数多时 PairNorm 有效果。

### 不同激活函数的对比

data_name	add_self_loop	n_layers	drop_edge	pair_norm	activations	test_acc
citeseer	True	2	0.0	False	relu	0.685
citeseer	True	2	0.0	False	tanh	0.683
citeseer	True	2	0.0	False	sigmoid	0.207
citeseer	True	3	0.0	False	relu	0.645
citeseer	True	3	0.0	False	tanh	0.667
citeseer	True	3	0.0	False	sigmoid	0.207
citeseer	True	5	0.0	False	relu	0.522
citeseer	True	5	0.0	False	tanh	0.588
citeseer	True	5	0.0	False	sigmoid	0.207
citeseer	True	10	0.0	False	relu	0.176
citeseer	True	10	0.0	False	tanh	0.472
citeseer	True	10	0.0	False	sigmoid	0.195

分析：2层和3层时  $\text{relu} \sim \text{tanh} \gg \text{sigmoid}$ ，3层和5层  $\text{tanh} > \text{relu} \gg \text{sigmoid}$ ，10层  $\text{tanh} \gg \text{sigmoid} \sim \text{relu}$ 。

## 实验总结

本次实验的最大收获在于了解的图神经网络的原理，以及学会了使用 `torch_geometric` 库。

原GCN论文里面 citeseer 和 cora 数据集的最好结果 (%) 分别为 70.3 和 81.5，我这里略差，分别是 68.5 和 79.7。其实网络结构是一样的，也是两层，用 `relu` 作为激活函数。我对比了一下才发现原因：它那个数据集划分是某种特定的划分。虽然划分比例相同，但在它那个划分下结果就是好不少，主要差别就在于这里。(你们这些做学术的人都在调些什么啊，dataset split is all you need?)

(完)