

Úvod

Teorie

Rekurentní buňka
Dopředný neuron
Buňka 1 neuron
Buňka n neuronů
Rozvinutí buňky
Vrstvení buněk
LSTM architektura
Zapominání
Vstupní část
Výstupní část

Realizace sítě

Datové sady
Návrh struktury
Vyhodnocení
přesnosti
Výsledky predikce
Průtok Saugeen
Průtok Labe

Závěr

Přílohy

LSTM podrobněji

Rekurentní neuronové sítě pro modelování časových řad

Vypracoval: Martin Vejvar

Vedoucí: Prof. Ing. Jan Náhlík CSc.

Ústav počítačové a řídicí techniky
Vysoká škola chemicko-technologická v Praze

28.5.2018

Úvod

Úvod

Teorie

Rekurentní buňka
Dopředný neuron
Buňka 1 neuron
Buňka n neuronů
Rozvinutí buňky
Vrstvení buněk
LSTM architektura
Zapomínání
Vstupní část
Výstupní část

Realizace sítě

Datové sady
Návrh struktury
Vyhodnocení
přesnosti
Výsledky predikce
Průtok Saugeen
Průtok Lake

Závěr

Přílohy

LSTM podrobněji

- Cíle:
 - zpracování sekvenčních dat
 - porozumění problematice
 - návrh a realizace rekurentní sítě
- Využitý software:



- github.com/vejvarm/RNNs

Neuron dopředné sítě

Úvod

Teorie

- Rekurentní buňka
- Dopředný neuron**
- Buňka 1 neuron
- Buňka n neuronů
- Rozvinutí buňky
- Vrstvení buněk
- LSTM architektura
- Zapomínání
- Vstupní část
- Výstupní část

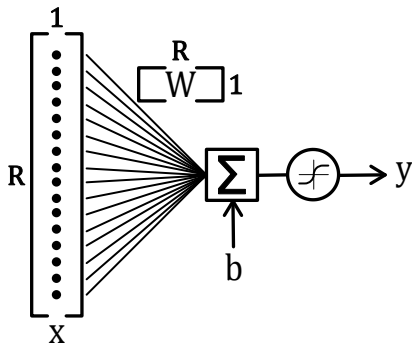
Realizace sítě

- Datové sady
- Návrh struktury
- Vyhodnocení přesnosti
- Výsledky predikce
- Průtok Saugeen
- Průtok Labe

Závěr

Přílohy

- LSTM podrobněji



- výstup neuronu

$$y = f(W \cdot x + b)$$

Buňka rekurentní sítě s 1 neuronem

Úvod

Teorie

Rekurentní buňka

Dopředný neuron

Buňka 1 neuron

Buňka n neuronů

Rozvinutí buňky

Vrstvení buněk

LSTM architektura

Zapominání

Vstupní část

Výstupní část

Realizace sítě

Datové sady

Návrh struktury

Vyhodnocení

přesnosti

Výsledky predikce

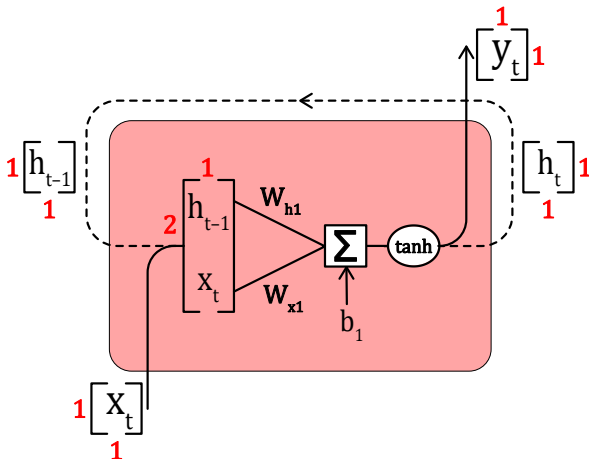
Průtok Saugeen

Průtok Labe

Závěr

Přílohy

LSTM podrobněji



$$y_t = h_t = \tanh(W_{h,1} \cdot h_{t-1} + W_{x,1} \cdot x_t + b_1)$$

Buňka rekurentní sítě s n neurony

Úvod

Teorie

- Rekurentní buňka
- Dopředný neuron
- Buňka 1 neuron
- Buňka n neuronů**
- Rozvinutí buňky
- Vrstvení buněk
- LSTM architektura
- Zapominání
- Vstupní část
- Výstupní část

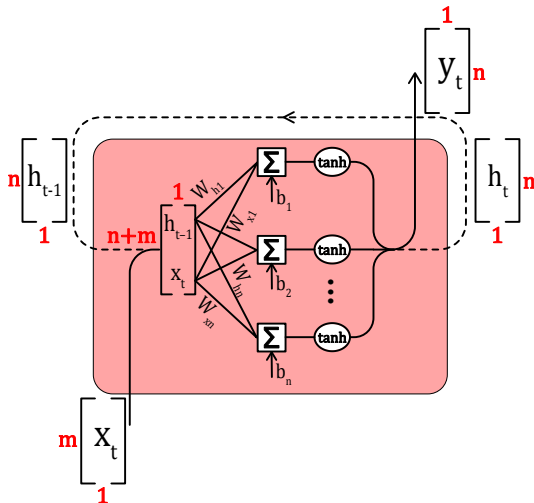
Realizace sítě

- Datové sady
- Návrh struktury
- Vyhodnocení přesnosti
- Výsledky predikce
- Průtok Saugeen
- Průtok Labe

Závěr

Přílohy

- LSTM podrobněji



$$y_{t,i} = h_{t,i} = \tanh(W_{h,i} \cdot h_{t-1} + W_{x,i} \cdot x_t + b_i) \quad i = (1, 2, \dots, n)$$

Buňka rekurentní sítě s n neurony

Úvod

Teorie

- Rekurentní buňka
- Dopředný neuron
- Buňka 1 neuron
- Buňka n neuronů**
- Rozvinutí buňky
- Vrstvení buněk
- LSTM architektura
- Zapomínání
- Vstupní část
- Výstupní část

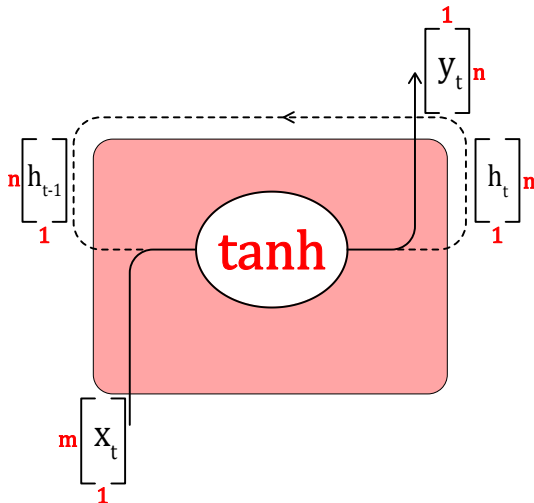
Realizace sítě

- Datové sady
- Návrh struktury
- Vyhodnocení přesnosti
- Výsledky predikce
- Průtok Saugeen
- Průtok Labe

Závěr

Přílohy

- LSTM podrobněji



$$y_{t,i} = h_{t,i} = \tanh(W_{h,i} \cdot h_{t-1} + W_{x,i} \cdot x_t + b_i) \quad i = (1, 2, \dots, n)$$

Rozvinutí buňky od počátku sekvence

Úvod

Teorie

- Rekurentní buňka
- Dopředný neuron
- Buňka 1 neuron
- Buňka n neuronů
- Rozvinutí buňky**
- Vrstvení buněk
- LSTM architektura
- Zapominání
- Vstupní část
- Výstupní část

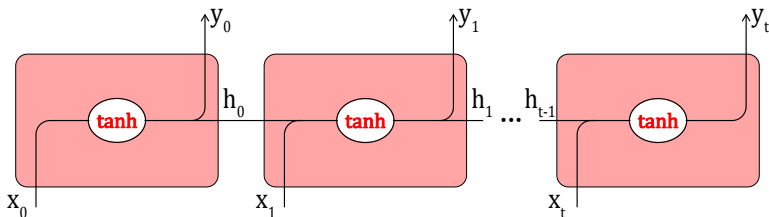
Realizace sítě

- Datové sady
- Návrh struktury
- Vyhodnocení přesnosti
- Výsledky predikce
- Průtok Saugeen
- Průtok Labe

Závěr

Přílohy

- LSTM podrobněji



$$\begin{aligned}y_t &= f(x_t, h_{t-1}) \\h_{t-1} &= f(x_{t-1}, h_{t-2}) \\&\vdots \\h_1 &= f(x_1, h_0) \\h_0 &= f(x_0)\end{aligned}$$

Vertikální vrstvení buněk sítě

Úvod

Teorie

- Rekurentní buňka
- Dopředný neuron
- Buňka 1 neuron
- Buňka n neuronů
- Rozvinutí buňky
- Vrstvení buněk**
- LSTM architektura
- Zapominání
- Vstupní část
- Výstupní část

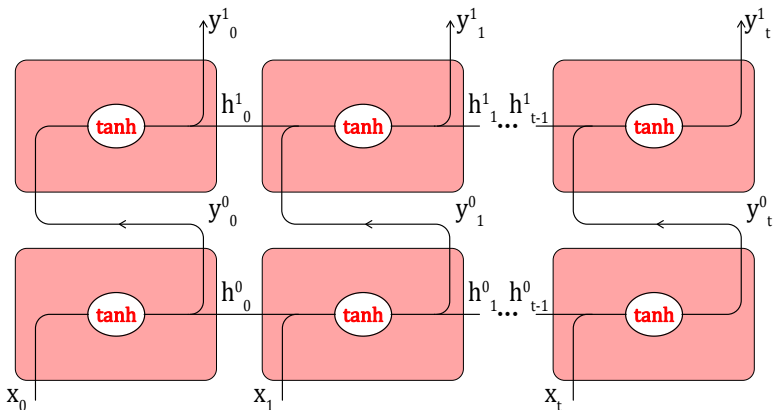
Realizace sítě

- Datové sady
- Návrh struktury
- Vyhodnocení přesnosti
- Výsledky predikce
- Průtok Saugeen
- Průtok Labe

Závěr

Přílohy

- LSTM podrobněji



$$y_t^1 = f(y_t^0, h_{t-1}^1)$$

$$y_t^0 = f(x_t, h_{t-1}^0)$$

LSTM architektura buňky

Úvod

Teorie

- Rekurentní buňka
- Dopředný neuron
- Buňka 1 neuron
- Buňka n neuronů
- Rozvinutí buňky
- Vrstvení buněk
- LSTM architektura**
- Zapomínání
- Vstupní část
- Výstupní část

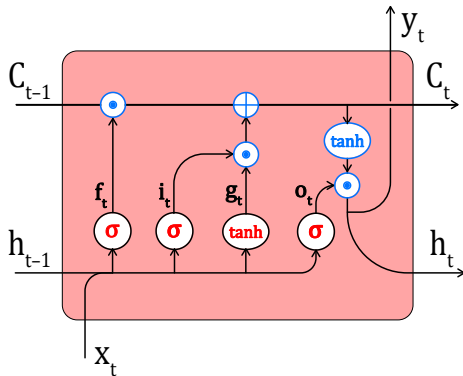
Realizace sítě

- Datové sady
- Návrh struktury
- Vyhodnocení přesnosti
- Výsledky predikce
- Průtok Saugeen
- Průtok Labe

Závěr

Přílohy

- LSTM podrobněji



Brána zapomínání

Úvod

Teorie

- Rekurentní buňka
- Dopředný neuron
- Buňka 1 neuron
- Buňka n neuronů
- Rozvinutí buňky
- Vrstvení buněk
- LSTM architektura
- Zapomínání**
- Vstupní část
- Výstupní část

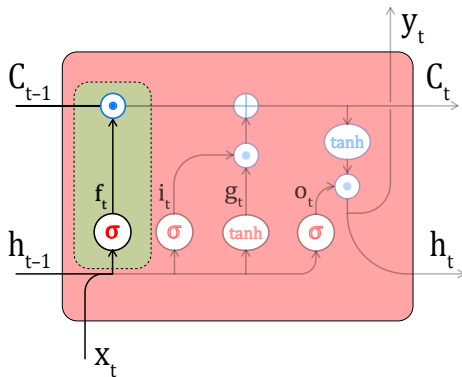
Realizace sítě

- Datové sady
- Návrh struktury
- Vyhodnocení přesnosti
- Výsledky predikce
- Průtok Saugeen
- Průtok Labe

Závěr

Přílohy

LSTM podrobněji



Vstupní část

Úvod

Teorie

- Rekurentní buňka
- Dopředný neuron
- Buňka 1 neuron
- Buňka n neuronů
- Rozvinutí buňky
- Vrstvení buněk
- LSTM architektura
- Zapominání
- Vstupní část**
- Výstupní část

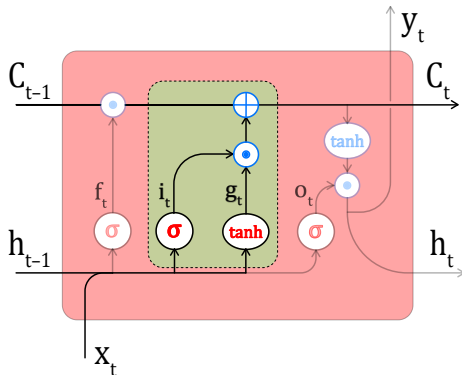
Realizace sítě

- Datové sady
- Návrh struktury
- Vyhodnocení přesnosti
- Výsledky predikce
- Průtok Saugeen
- Průtok Labe

Závěr

Přílohy

- LSTM podrobněji



Výstupní část

Úvod

Teorie

- Rekurentní buňka
- Dopředný neuron
- Buňka 1 neuron
- Buňka n neuronů
- Rozvinutí buňky
- Vrstvení buněk
- LSTM architektura
- Zapominání
- Vstupní část
- Výstupní část

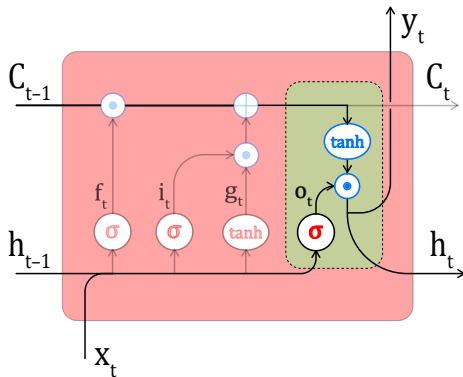
Realizace sítě

- Datové sady
- Návrh struktury
- Vyhodnocení přesnosti
- Výsledky predikce
- Průtok Saugeen
- Průtok Labe

Závěr

Přílohy

- LSTM podrobněji



LSTM podrobněji

Predikce časových řad

Úvod

Teorie

Rekurentní buňka
Dopředný neuron
Buňka 1 neuron
Buňka n neuronů
Rozvinutí buňky
Vrstvení buněk
LSTM architektura
Zapomínání
Vstupní část
Výstupní část

Realizace sítě

Datové sady

Návrh struktury
Vyhodnocení přesnosti
Výsledky predikce
Průtok Saugeen
Průtok Labe

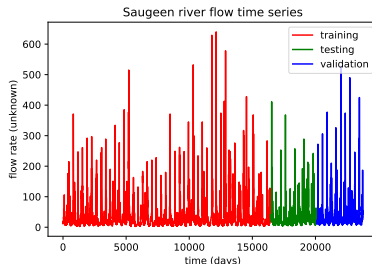
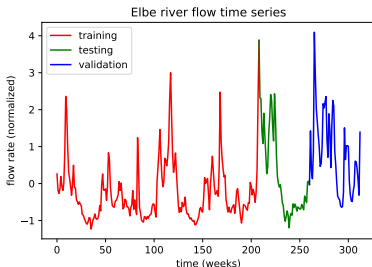
Závěr

Přílohy

LSTM podrobněji

- cíl

- jednokroková predikce
- týdenní průtoky Labe (313 vzorků)
- denní průtoky Saugeen (23741 vzorků)



Sít v čase t

Úvod

Teorie

- Rekurentní buňka
- Dopředný neuron
- Buňka 1 neuron
- Buňka n neuronů
- Rozvinutí buňky
- Vrstvení buněk
- LSTM architektura
- Zapomínání
- Vstupní část
- Výstupní část

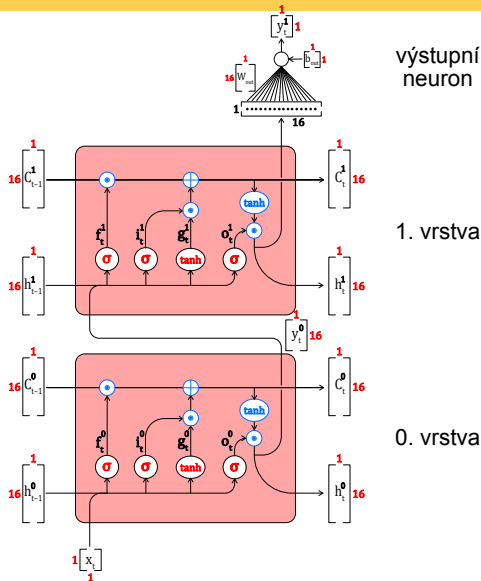
Realizace sítě

- Datové sady
- Návrh struktury
- Vyhodnocení přesnosti
- Výsledky predikce
- Průtok Saugeen
- Průtok Labe

Závěr

Přílohy

- LSTM podrobněji



Síť rozvinutá do minulosti

Úvod

Teorie

- Rekurentní buňka
- Dopředný neuron
- Buňka 1 neuron
- Buňka n neuronů
- Rozvinutí buňky
- Vrstvení buněk
- LSTM architektura
- Zapominání
- Vstupní část
- Výstupní část

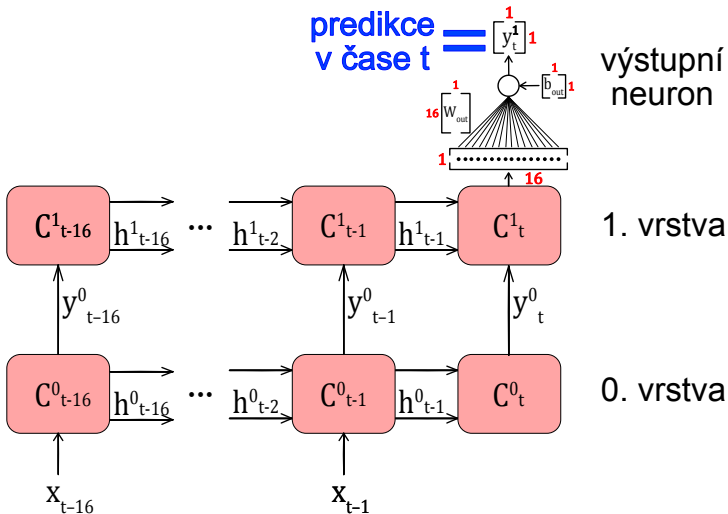
Realizace sítě

- Datové sady
- Návrh struktury
- Vyhodnocení přesnosti
- Výsledky predikce
- Průtok Saugeen
- Průtok Labe

Závěr

Přílohy

- LSTM podrobněji



Vyhodnocení přesnosti

Úvod

Teorie

- Rekurentní buňka
- Dopředný neuron
- Buňka 1 neuron
- Buňka n neuronů
- Rozvinutí buňky
- Vrstvení buněk
- LSTM architektura
- Zapominání
- Vstupní část
- Výstupní část

Realizace sítě

- Datové sady
- Návrh struktury
- Vyhodnocení přesnosti
- Výsledky predikce
- Průtok Saugeen
- Průtok Labe

Závěr

Přílohy

- LSTM podrobněji

- relativní chyba predikce:

$$MAPE = \frac{1}{N} \sum_{i=1}^N \left| \frac{y_i - t_i}{y_i} \right|$$

- symetrická relativní chyba predikce:

$$SMAPE = \frac{2}{N} \sum_{i=1}^N \frac{|y_i - t_i|}{|y_i| + |t_i|}$$

- y_i ... predikované hodnoty
- t_i ... skutečné hodnoty

Jednokroková predikce průtoku Saugeen

Úvod

Teorie

Rekurentní buňka
Dopředný neuron
Buňka 1 neuron
Buňka n neuronů
Rozvinutí buňky
Vrstvení buněk
LSTM architektura
Zapominání
Vstupní část
Výstupní část

Realizace sítě

Datové sady
Návrh struktury
Vyhodnocení přesnosti
Výsledky predikce
Průtok Saugeen
Průtok Labe

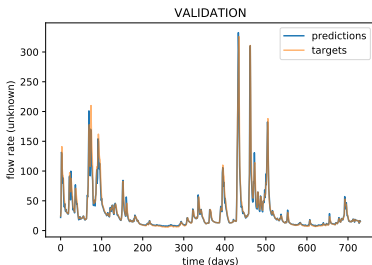
Závěr

Přílohy

LSTM podrobněji

● základní:

- paměť: 16
- rozvinutí: 16
- dávka: 4

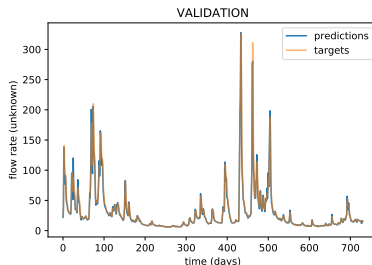


● SMAPE = 9,08 %

● učení: 23 min 43 s

● nejlepší:

- paměť: 16
- rozvinutí: 16
- dávka: 16



● SMAPE = 7,85 %

● učení: 4 min 42 s

Jednokroková predikce průtoku Labe

Úvod

Teorie

Rekurentní buňka
Dopředný neuron
Buňka 1 neuron
Buňka n neuronů
Rozvinutí buňky
Vrstvení buněk
LSTM architektura
Zapomínání
Vstupní část
Výstupní část

Realizace sítě

Datové sady
Návrh struktury
Vyhodnocení přesnosti
Výsledky predikce
Průtok Saugeen
Průtok Labe

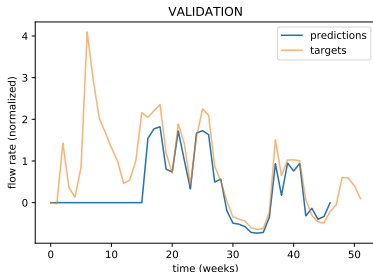
Závěr

Přilohy

LSTM podrobněji

● základní:

- paměť: 16
- rozvinutí: 16
- dávka: 4

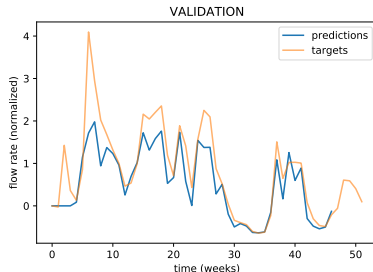


● SMAPE = 64,9 %

● učení: 36 s

● nejlepší:

- paměť: 4
- rozvinutí: 4
- dávka: 2



● SMAPE = 62,3 %

● učení: 58 s

Závěr

Úvod

Teorie

Rekurentní buňka
Dopředný neuron
Buňka 1 neuron
Buňka n neuronů
Rozvinutí buňky
Vrstvení buněk
LSTM architektura
Zapominání
Vstupní část
Výstupní část

Realizace sítě

Datové sady
Návrh struktury
Vyhodnocení
přesnosti
Výsledky predikce
Průtok Saugeen
Průtok Labe

Závěr

Přílohy

LSTM podrobněji

- co bylo provedeno
 - rekurentní síť s LSTM архитектурou
 - otestována na predikci průtoků Labe a Saugeen
- dosažené výsledky
 - Saugeen: 7,85 % (paměť 16, rozvinutí 16, dávka 16)
 - Labe: 64,9 % (paměť 4, rozvinutí 4, dávka 2)
- co bude dál
 - víceukroková predikce
 - dropout
 - grid search
 - naučení na jedné sadě a testování na druhé
 - jiná data

Brány

Úvod

Teorie

- Rekurentní buňka
- Dopředný neuron
- Buňka 1 neuron
- Buňka n neuronů
- Rozvinutí buňky
- Vrstvení buněk
- LSTM architektura
- Zapomínání
- Vstupní část
- Výstupní část

Realizace sítě

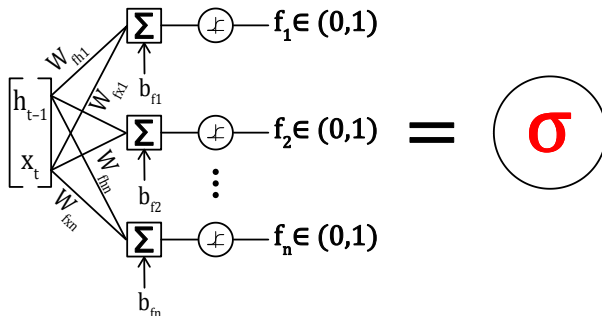
- Datové sady
- Návrh struktury
- Vyhodnocení přesnosti
- Výsledky predikce
- Průtok Saugeen
- Průtok Labe

Závěr

Přílohy

- LSTM podrobněji

- vnitřní struktura brány zapomínání



Brána zapomínání

Úvod

Teorie

Rekurentní buňka

Dopředný neuron

Buňka 1 neuron

Buňka n neuronů

Rozvinutí buňky

Vrstvení buněk

LSTM architektura

Zapomínání

Vstupní část

Výstupní část

Realizace sítě

Datové sady

Návrh struktury

Vyhodnocení

přesnosti

Výsledky predikce

Průtok Saugeen

Průtok Labe

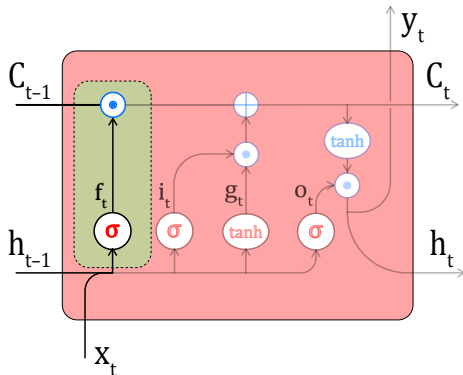
Závěr

Přílohy

LSTM podrobněji

- zapomínání části vnitřního stavu

$$f_t = \sigma(W_f \cdot [h_{t-1}, x_t] + b_f)$$



Vstupní část

Úvod

Teorie

Rekurentní buňka
Dopředný neuron
Buňka 1 neuron
Buňka n neuronů
Rozvinutí buňky
Vrstvení buněk
LSTM architektura
Zapomínání
Vstupní část
Výstupní část

Realizace sítě

Datové sady
Návrh struktury
Vyhodnocení
přesnosti
Výsledky predikce
Průtok Saugeen
Průtok Labe

Závěr

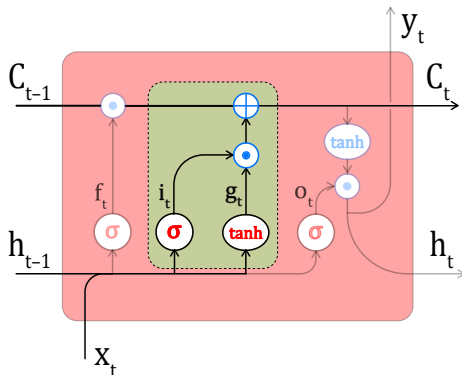
Přílohy

LSTM podrobněji

- ukládání nových hodnot do vnitřního stavu

$$i_t = \sigma(W_i \cdot [h_{t-1}, x_t] + b_i)$$

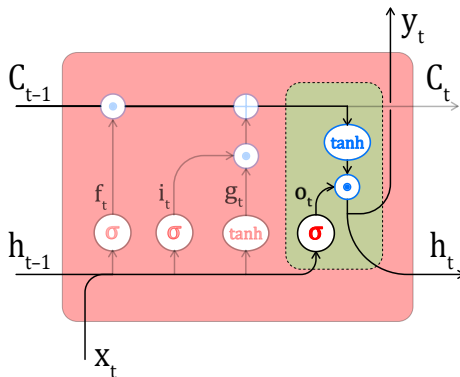
$$g_t = \tanh(W_g \cdot [h_{t-1}, x_t] + b_g)$$



Výstupní část

- průchod vnitřního stavu tanh funkcí na výstup:

$$o_t = \sigma(W_o \cdot [h_{t-1}, x_t] + b_o)$$



Aktualizace výstupů

Úvod

Teorie

Rekurentní buňka
Dopředný neuron
Buňka 1 neuron
Buňka n neuronů
Rozvinutí buňky
Vrstvení buněk
LSTM architektura
Zapominání
Vstupní část
Výstupní část

Realizace sítě

Datové sady
Návrh struktury
Vyhodnocení
přesnosti
Výsledky predikce
Průtok Saugeen
Průtok Labe

Závěr

Přílohy

LSTM podrobněji

● výstupy vrstev

$$f_t = \sigma(W_f \cdot [h_{t-1}, x_t] + b_f)$$

$$i_t = \sigma(W_i \cdot [h_{t-1}, x_t] + b_i)$$

$$g_t = \tanh(W_g \cdot [h_{t-1}, x_t] + b_g)$$

$$o_t = \sigma(W_o \cdot [h_{t-1}, x_t] + b_o)$$

● výstupy buňky

$$C_t = f_t \odot C_{t-1} + i_t \odot g_t$$

$$y_t = o_t \odot \tanh(C_t)$$

$$h_t = o_t \odot \tanh(C_t)$$

Zpět