

Escuela Politécnica Superior

20
21

Trabajo fin de grado

Predicción de energía eólica con métodos de ensemble



José Benjumeda Rubio

Escuela Politécnica Superior
Universidad Autónoma de Madrid
C/ Francisco Tomás y Valiente nº 11

**UNIVERSIDAD AUTÓNOMA DE MADRID
ESCUELA POLITÉCNICA SUPERIOR**



Grado en Ingeniería Informática

TRABAJO FIN DE GRADO

**Predicción de energía eólica con métodos de
ensemble**

**Autor: José Benjumbeda Rubio
Tutora: Ángela Fernández Pascual**

junio 2021

Todos los derechos reservados.

Queda prohibida, salvo excepción prevista en la Ley, cualquier forma de reproducción, distribución comunicación pública y transformación de esta obra sin contar con la autorización de los titulares de la propiedad intelectual.

La infracción de los derechos mencionados puede ser constitutiva de delito contra la propiedad intelectual (*arts. 270 y sgts. del Código Penal*).

DERECHOS RESERVADOS

© 3 de Noviembre de 2017 por UNIVERSIDAD AUTÓNOMA DE MADRID

Francisco Tomás y Valiente, nº 1

Madrid, 28049

Spain

José Benjumeda Rubio

Predicción de energía eólica con métodos de ensemble

José Benjumeda Rubio

C\ Francisco Tomás y Valiente Nº 11

IMPRESO EN ESPAÑA – PRINTED IN SPAIN

A mi familia y a mis amigos, por ser un impulso constante en todo lo que hago.

“Investigación es lo que hago cuando no sé lo que estoy haciendo”

Wernher von Braun

AGRADECIMIENTOS

En primer lugar me gustaría agradecer a Ángela Fernández Pascual que me haya guiado en la realización de este TFG, y que constantemente haya tenido palabras de ánimo para seguir trabajando.

Además, este trabajo no hubiese sido posible sin la ayuda de la Cátedra UAM-IIC de Ciencia de Datos y Aprendizaje Automático, que han permitido que tenga acceso a los datos de predicciones meteorológicas del Centro Europeo de Previsiones Meteorológicas a Plazo Medio y los datos de energía obtenida en el Parque Eólico Experimental de Sotavento, además de facilitar una cuenta en el Centro de Computación Científica de la UAM. Por esto les estoy muy agradecido.

Finalmente, en estos cinco años en la Universidad Autónoma de Madrid he conocido a personas extraordinarias que tengo la suerte de considerar amigos y amigas. Os agradezco de corazón haber hecho cada día mejor que el anterior.

RESUMEN

La inteligencia artificial es un área de las ciencias de computación en la que la inversión de trabajo y esfuerzo de investigación esta obteniendo grandes recompensas. Es un campo en el que cada vez parece haber más posibilidades, y en el que en este trabajo pretendemos avanzar para dar una solución a un problema concreto: la predicción de energía eólica en el Parque Eólico Experimental de Sotavento.

La energía eólica es una forma de energía renovable en la que España ha sido pionera, y cada vez es mayor el porcentaje de energía que proviene de esta fuente. Por esto es indispensable conseguir predicciones precisas de la energía que se va a obtener en todo momento, y en este trabajo abordamos el problema de predecirla a partir de datos de predicciones atmosféricas.

Se estudiarán varios modelos de regresión para luego construir un modelo de ensemble stacking que trate de compensar los fallos de los modelos por los que está compuesto, y se hará un análisis de los resultados obtenidos, para dar indicaciones sobre posible trabajo futuro.

PALABRAS CLAVE

Energía eólica, modelos de regresión, métodos de ensemble, stacking

ABSTRACT

Artificial intelligence is a field of computer science in which the inversion of work and investigation is granted a very decent reward. The possibilities in this field seem to be growing exponentially, and in this assignment we will try to give one more step in its development by finding a solution to a particular problem: the prediction of wind energy in the experimental wind farm of Sotavento.

Wind energy is a source of renewable energy in which Spain has been a pioneer, and the percentage of energy that comes from this source is becoming larger and larger, with ambitious goals for the years to come. For this reason, getting accurate predictions for the amount of energy that is going to be available at a given time is essential. In this work we address the problem of predicting the amount of wind energy obtained by learning its relation with the weather forecast.

We will study individual regression models with which we will then build an ensemble method, and the latter will attempt to fix some of the errors of the models it is composed of.

KEYWORDS

Wind energy, regression models, ensemble methods, stacking

ÍNDICE

1	Introducción	1
1.1	Motivación	1
1.2	Objetivos	1
1.3	Estructura del documento	2
2	Estado del arte	3
3	Modelos de regresión	5
3.1	El problema de regresión	5
3.1.1	Preprocesamiento de datos: Estandarización	7
3.1.2	Elección de hiperparámetros: validación cruzada	7
3.2	Regresión regularizada	8
3.3	Perceptrón multicapa	9
3.3.1	Estructura y alcance de las redes neuronales	9
3.3.2	Algoritmo de retropropagación	11
3.4	Máquinas de vectores soporte de regresión	13
4	Métodos de ensemble	19
4.1	¿Qué es un modelo de ensemble?	19
4.2	Método de ensemble <i>stacking</i>	21
5	Simulaciones y resultados	25
5.1	Regresión regularizada	29
5.2	Perceptrón multicapa	30
5.3	SVR	32
5.4	Stacking	35
6	Conclusiones y trabajo futuro	39
	Bibliografía	41

INTRODUCCIÓN

1.1. Motivación

El uso de la energía eólica está en auge desde hace años, y España es uno de los países pioneros en fomentar su desarrollo. Está claro que la inversión en esta fuente de energía es una apuesta ganadora.

A causa de que la sociedad está cada vez más concienciada con el cuidado del medio ambiente, y que la investigación en fuentes de energía limpias da abundantes frutos, la evolución hacia estas fuentes de energía parece ser imparable. En España hay una gran cantidad de puestos de trabajo en este sector, y a día de hoy hay instalados del orden de 30000 megavatios eólicos, con ambiciosos objetivos para los próximos años.

Sin embargo, la cantidad de energía eólica va ligada a ciertos factores sobre los que no tenemos control alguno: las condiciones atmosféricas. Dado que para cualquier empresa del mercado eólico es indispensable conocer la cantidad de megavatios de los que dispone, no es poca la investigación que se ha llevado a cabo en este campo, aunque aún queda mucho por hacer.

1.2. Objetivos

A lo largo de este trabajo pretendemos comprobar qué error de predicción podemos conseguir prediciendo la energía obtenida en el Parque Eólico de Sotavento, en Galicia, utilizando como variables independientes las predicciones meteorológicas del Centro Europeo de Previsiones Meteorológicas a Plazo Medio ¹.

Se estudiará un modelo de regresión regularizada, un perceptrón multicapa, una máquina de vectores soporte de regresión, y finalmente se utilizarán estos para construir un modelo de ensemble de regresión. Estos tres modelos los entrenaremos individualmente para ver qué error podemos conseguir con cada uno por separado, y para calcular con qué parámetros funcionan mejor, y después se

¹<https://meteolo.com/europa/ecmwf/ecmwf-europa>

incorporarán también al modelo de ensemble para ver si se obtiene alguna mejora.

1.3. Estructura del documento

Este documento comienza con el estado del arte en predicción de energía eólica con métodos de ensemble, en el Capítulo 2.

A continuación, se hace una explicación de cada modelo de regresión utilizado en el Capítulo 3. Estos son la regresión regularizada, el perceptrón multicapa y la máquina de vectores soporte de regresión.

En el Capítulo 4 se hace una introducción general a los métodos de ensemble seguida de una explicación del método de ensemble *stacking*.

En el Capítulo 5 se explican los datos sobre los que trabajamos, y se presentan las distintas pruebas realizadas con cada modelo, explicando los resultados obtenidos.

Por último, el Capítulo 6 corresponde a las conclusiones tras haber estudiado los modelos regresión regularizada, perceptrón multicapa, máquina de vectores soporte de regresión, y método de ensemble *stacking*; y tras haber realizado los experimentos. Además se incluyen algunas indicaciones sobre el trabajo futuro que, tras haber hecho un análisis de las posibles causas de los errores de los modelos, creemos que quizá conduzcan a mejorar los resultados de este trabajo.

ESTADO DEL ARTE

En este capítulo revisamos algunos trabajos que tratan sobre predicción de energía eólica o utilizan métodos de ensemble en problemas que pueden tener cierta similitud con la predicción de energía eólica.

Aprendizaje multitarea con máquinas de vectores soporte de regresión para la predicción de energía solar y eólica

El primer trabajo que citaremos es *Multitask Support Vector Regression for Solar and Wind Energy Prediction*, de Carlos Ruiz, Carlos M. Alaíz y José R. Dorronsoro [1], que aborda el problema de predicción de energía eólica y solar mediante máquinas de vectores soporte de regresión multitarea. El uso de modelos de predicción multitarea se basa en que el problema se puede resolver dividiéndolo en tareas que, a pesar de tener cada una sus distintas particularidades, están relacionadas unas con otras. De esta manera, se entrena un modelo para que resuelva todas las tareas a la vez, y la información que éste tiene que aprender para resolver cada una de ellas servirá de ayuda para resolver las demás.

En este trabajo se realizan experimentos con tres conjuntos de datos, y uno de ellos son los datos de energía eólica del Parque Eólico Experimental de Sotavento a partir de las predicciones meteorológicas del Centro Europeo de Previsiones Meteorológicas a Plazo Medio, que son precisamente los datos que se utilizan en este trabajo.

Las tasas de error que se han conseguido utilizando máquinas de vectores soporte de regresión multitarea han servido como guía para saber qué rangos de error serían aceptables. Para distintos modelos, obtienen errores absolutos medios que están entre 6,132 y 6,410, con lo que intentaremos conseguir errores también en ese rango, y, en principio, descartaremos modelos que nos den errores que no se acerquen a estas cantidades.

Otro de los procedimientos que sigue el trabajo de Carlos Ruiz, Carlos M. Alaíz y José R. Dorronsoro y que nosotros seguiremos también es la normalización de los datos. Esto consiste en redimensionar los datos para que la desviación típica sea 1 y la media 0, pero utilizando solo los datos del conjunto de entrenamiento.

Además, se lleva a cabo una validación cruzada para estimar los parámetros de una máquina de vectores soporte de regresión, y se acotan intervalos para los distintos parámetros del modelo. A lo largo de nuestro trabajo, realizaremos también una validación cruzada sobre una máquina de vectores soporte de regresión, y resultará de gran ayuda esta base para encontrar los mejores parámetros con los que calibrar el modelo.

Métodos de ensemble boosting para la predicción de energía solar y eólica: un análisis sistemático.

Otro trabajo en esta línea es *Boosting algorithms in energy research: a systematic review*, de Hristos Tyralis y Georgia A. Papacharalampous [2], en el que se utilizan modelos de ensemble *boosting* para realizar, una vez más, predicciones en energía eólica y fotovoltaica.

Los modelos de ensemble boosting se componen de varias instancias del mismo modelo variando sus hiperparámetros, y se caracterizan y diferencian de otros modelos de ensemble en que el entrenamiento es secuencial, y el entrenamiento de cada modelo influye en el de los modelos posteriores.

Este trabajo proporciona una perspectiva útil del trabajo realizado con los métodos de ensemble boosting, de los que hablaremos más adelante.

Predicción de rampas de viento utilizando redes neuronales multicapa y aprendizaje multitarea

Un último trabajo sobre predicción eólica cuyo análisis previo a nuestro trabajo ha sido interesante es *Multi-task learning for the prediction of wind power ramp events with deep neural networks* de M. Dorado-Moreno, N. Navarin, P. A. Gutiérrez, L. Prieto, A. Sperduti, S. Salcedo-Sanz, y C. Hervás-Martínez [3], que utiliza redes neuronales multitarea para predecir la ocurrencia de rampas de viento.

Las rampas de viento son grandes variaciones en la dirección o velocidad del viento en un periodo de tiempo corto. Éste es uno de los elementos que hacen la predicción de energía eólica un problema complicado. Como veremos más adelante en los datos de predicciones meteorológicas, las rampas de viento son muy comunes, y aprender a predecirlas es vital para, a partir de ahí, estimar la energía que se obtendrá.

El enfoque que se le da a la predicción de rampas de viento en este trabajo son las redes neuronales multitarea. El aprendizaje multitarea en este caso es algo más intuitivo que en el caso de las máquinas de vectores soporte que explicamos al inicio del capítulo. Básicamente, se añaden neuronas extra en la última capa de la red, cuya salida representa la solución de una tarea secundaria que se intuye relacionada con la tarea principal. Los pesos de la red se calcularán de manera que la red solucione ambas tareas, y se espera que el conocimiento necesario para resolver las tareas secundarias sea beneficioso a la hora de resolver la tarea principal.

MODELOS DE REGRESIÓN

3.1. El problema de regresión

La mayoría de esta sección ha sido obtenida a partir del Capítulo 3 de [4].

Como ya hemos dicho, nos encontramos frente a un problema de regresión: queremos encontrar la relación que hay entre unas variables aleatorias independientes, que son ciertas predicciones meteorológicas; y una variable aleatoria dependiente, que es la cantidad de energía producida cada hora de cada día en el parque eólico experimental de Sotavento, en Galicia.

Las variables aleatorias independientes serán la velocidad del viento a 10 y 100 metros de altura, la presión sobre la superficie, y la temperatura a 2 metros de altura. No se profundizará más por ahora en el problema de Sotavento, sino que se detallarán los datos y las condiciones del problema al llegar a la parte de simulaciones y resultados, en la Sección 5.

En esta sección comenzaremos explicando cómo podemos obtener una solución lineal, viendo en cierta profundidad la regresión multilínea y la regresión regularizada, para, a continuación, estudiar dos modelos más complejos y no lineales: el perceptrón multicapa y la máquina de vectores soporte de regresión.

Regresión lineal simple

En un problema de regresión lineal simple queremos encontrar la expresión de una variable aleatoria, la variable de respuesta, en función de una variable independiente, de manera que la relación que hallemos entre ambas sea lineal. A la variable dependiente la llamaremos X , y a la variable independiente, Y . Además, toda la información que obtengamos sobre la relación entre estas provendrá de una muestra de datos D_n , compuesta por n observaciones:

$$D_n = \{(X_1, Y_1), (X_2, Y_2), \dots, (X_n, Y_n)\}, \quad (3.1)$$

donde (X_i, Y_i) es la observación i , X_i es el atributo de la observación i e Y_i es el *target* de la observación i .

Llamaremos \tilde{Y} a nuestra predicción del valor de Y , y la escribimos en función de X como

$$\tilde{Y} = f(X) = \beta_0 + \beta_1 X, \quad (3.2)$$

donde β_0 es el corte de la recta con el eje OY , β_1 es la pendiente de la recta y $f(X)$ es el modelo lineal. A partir de la muestra, construiremos una función cuyos valores se acerquen lo máximo posible a los valores de la variable aleatoria Y , y esta cercanía la mediremos con el error cuadrático medio.

Hallaremos los valores de β_0 y β_1 minimizando el error cuadrático medio visto como función de β_0 y β_1 , a partir de D_n :

$$J(\beta_0, \beta_1) = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n (Y_i - \tilde{Y}_i)^2 = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n (Y_i - (\beta_0 + \beta_1 X_i))^2. \quad (3.3)$$

Esta función es convexa, es decir, tiene la forma de una parábola positiva, con lo cual, sabemos que siempre tendrá mínimo. Anulando las derivadas parciales obtenemos los valores que hacen mínimo el error cuadrático:

$$\beta_0 = E[Y] - E[X] \frac{COV(X, Y)}{\sigma^2(X)}, \quad (3.4)$$

$$\beta_1 = \frac{E[XY] - E[X] E[Y]}{E[X^2] - E[X]^2} = \frac{COV(X, Y)}{\sigma^2(X)}, \quad (3.5)$$

donde $E[\cdot]$ y $\sigma^2(\cdot)$ son respectivamente esperanza y varianza de una variable aleatoria, y $COV(\cdot, \cdot)$ es la covarianza de dos variables aleatorias.

Regresión lineal múltiple

La regresión lineal múltiple o multilineal contempla el problema en el que hay que predecir el valor de una variable dependiente a partir de p variables independientes. Veremos que el modelo se construye siguiendo la misma lógica que para una sola variable, sin embargo será lo suficientemente complejo como para obtener las primeras predicciones de nuestro problema.

El enfoque que utilizaremos para explicar la regresión multilineal consiste en adaptar el modelo de regresión simple para que en lugar de tener una función de una sola variable, tengamos una función vectorial

$$\tilde{Y} = \beta_0 + \beta \mathbf{X} = \beta_0 + \sum_{i=1}^p \beta_i X_i, \quad (3.6)$$

donde X_i representa la i ésima variable, y β_i cuantifica la asociación entre esa variable y la variable

respuesta. El valor de cada parámetro β_i nos da una idea del efecto que tiene el incremento de la variable i sobre la variable final.

La manera de obtener los valores de β_i es análoga a la que utilizamos en regresión simple, pues también minimizaremos la función de error cuadrático, solo que esta vez, ésta dependerá de p variables:

$$J(\beta_0, \beta_1, \dots, \beta_p) = \sum_{i=1}^n (Y_i - \tilde{Y}_i)^2 = \sum_{i=1}^n (Y_i - \beta_0 - \sum_{i=1}^p \beta_i X_i)^2. \quad (3.7)$$

Sin embargo, para $p > 1$ las fórmulas no son tan compactas y fáciles de escribir como para $p = 1$, y, dado que las podemos obtener mediante cualquier software de estadística, no las incluiremos aquí.

Los modelos que estudiaremos de este punto en adelante tienen mayor complejidad: hay que calibrarlos con hiperparámetros, penalizan ciertas características no deseables en la función de regresión obtenida, etc. Para poder utilizarlos y sacarles mayor partido, tenemos que estudiar antes dos técnicas muy conocidas: la estandarización de los datos y la validación cruzada.

3.1.1. Preprocesamiento de datos: Estandarización

En los datos eólicos del parque de Sotavento encontramos variables con unidades de medida distintas, por ejemplo velocidad del viento en metros por segundo y presión en pascales, por lo que las magnitudes son muy diferentes unas de otras. Para que un modelo no asuma que una está más relacionada con la cantidad de energía obtenida que otra, por el simple hecho de tener valores más grandes realizamos la estandarización de los datos.

El proceso de estandarización de los datos es muy sencillo: simplemente restamos a cada variable independiente su media, y dividimos por su desviación típica. De esta manera, todas las variables tendrán media cero, y sus valores se alejarán de dicho valor una media de una unidad. Ahora todos los datos tienen magnitudes similares, pero no hemos perdido ninguna información: simplemente hemos hecho un cambio de escala.

3.1.2. Elección de hiperparámetros: validación cruzada

Como ya se ha comentado, algunos de los modelos que vamos a estudiar tienen hiperparámetros, cuyos valores determinan en gran medida en las predicciones que obtendremos. Para seleccionar qué valor deben tener los hiperparámetros de un modelo, utilizamos la validación cruzada.

Lo primero que hay que hacer es definir un conjunto finito de posibles valores para los hiperparámetros que queremos calibrar, y definir un modelo con cada posible combinación. Obtenemos entonces

una familia de modelos, y tenemos que ver cual de ellos predice mejor. Esto significa que hay que definir una métrica, una función de medida del error de predicción. En nuestros experimentos hemos utilizado el error absoluto medio, pero puede ser cualquier otra.

A continuación hay que tomar una partición del conjunto de entrenamiento en K subconjuntos. Fijando uno de estos k subconjuntos como conjunto de validación, entrenamos cada modelo sobre el resto del conjunto de entrenamiento, y calculamos el error de predicción sobre las observaciones del conjunto de validación.

Todo este proceso se repite k veces, eligiendo cada vez un subconjunto de validación distinto, de manera que hayamos hecho predicciones sobre todos los subconjuntos de la partición, y por tanto sobre todos los elementos del conjunto inicial de entrenamiento. Por último, calculamos el error absoluto medio de cada modelo para las predicciones obtenidas, y nos quedamos con el que tenga el mínimo.

Un caso particular muy conocido es la validación cruzada con una partición *leave-one-out*, donde los k subconjuntos tienen cada uno un elemento, y por tanto la partición tiene tantos subconjuntos como datos tenga el conjunto de entrenamiento. Tiene la desventaja de que el coste computacional es muy superior a una validación cruzada con 5 subconjuntos por ejemplo (contando desde luego con un conjunto de entrenamiento de tamaño muy superior a 5), pues entrenamos los modelos muchas más veces.

3.2. Regresión regularizada

Esta sección ha sido obtenida a partir de la Sección 6.2.1 de [4].

La regresión regularizada es un modelo de regresión muy similar al de regresión multilineal, en el que penalizamos los coeficientes de las variables independientes $\beta_1, \beta_2, \dots, \beta_p$, basándonos en que los valores muy grandes de estos provocarán sobreajuste, y por tanto predicciones de peor calidad. Tenemos la siguiente ecuación:

$$\tilde{J}(\beta_0, \beta_1, \dots, \beta_p) = \sum_{i=1}^n (Y_i - \beta_0 - \sum_{i=1}^p \beta_i X_i)^2 + \lambda \sum_{j=1}^p \beta_j^2 = J(\beta_0, \beta_1, \dots, \beta_p) + \lambda \sum_{j=1}^p \beta_j^2, \quad (3.8)$$

donde el hiperparámetro λ balancea la importancia relativa de minimizar el error cuadrático y de minimizar los coeficientes. Según el valor de λ , minimizaremos una función u otra, con lo que las soluciones serán distintas. Utilizaremos la validación cruzada para encontrar el valor de λ que produzca la solución de menor error. J es la función del error cuadrático para p variables que vemos en la Ecuación 3.7.

Es importante notar que la penalización no se aplica sobre β_0 , que es simplemente la media de la variable respuesta cuando todas las variables independientes tienen valor 0.

Normalmente, en problemas que tengan una relación casi lineal entre las variables independientes y la variable respuesta, la regresión multilíneal suele tener poco sesgo y varianza relativamente alta. Esto significa que un cambio pequeño en los datos puede provocar una gran diferencia en la estimación de los coeficientes. Cuanto mayor sea la cantidad de variables, p , con respecto a la cantidad de datos, n , mayor será esta diferencia. En estos casos la penalización que aplica la regresión regularizada es una gran ayuda para reducir esta varianza.

Por último, el coste computacional de la regresión regularizada es prácticamente el mismo que el de la regresión multilíneal, así que es un modelo que cumplirá las restricciones de tiempo de casi cualquier problema para el que la regresión multilíneal las cumpla.

Como veremos en los experimentos, la regresión regularizada es una solución que, en relación a su simplicidad, es capaz de conseguir resultados altamente precisos.

3.3. Perceptrón multicapa

La mayoría de esta sección ha sido obtenida a partir del Capítulo 6 de [5].

En ésta sección estudiaremos la red neuronal multicapa, también conocida como perceptrón multicapa. Éste es el primer modelo de los vistos hasta ahora que nos permite resolver problemas no lineales. Sin embargo, también pueden resolver problemas lineales. A cambio de una complejidad y un coste computacional mayores que los de la regresión regularizada, nos permiten reducir en gran medida los errores de predicción, sobretodo en problemas fuertemente no lineales.

Una red neuronal consiste en capas que son básicamente conjuntos de neuronas, y están conectadas unas con otras ponderadas con pesos. Veremos que los pesos son un factor muy determinante en el rendimiento de la red neuronal, y calcularlos es una de las principales dificultades en el uso de estos modelos.

Hay distintas maneras de entrenar una red neuronal para calcular sus pesos. La más común y la que se ha utilizado en este trabajo es la retropropagación.

Otra de las mayores dificultades a la hora de utilizar redes neuronales es ajustar su complejidad, es decir, definir su arquitectura y los valores de sus hiperparámetros. Si la red tiene demasiadas capas ocultas con muchas neuronas, el modelo tendrá sobreajuste, mientras que si no tiene suficientes, generalizará demasiado, es decir, tendrá subajuste.

3.3.1. Estructura y alcance de las redes neuronales

Las redes neuronales que vamos a estudiar tienen capa de entrada, una serie de capas ocultas y capa de salida. Normalmente la cantidad de neuronas de la capa de entrada y de la de salida

se obtiene directamente del problema, según la cantidad de atributos de cada dato y la cantidad de variables respuesta. La cantidad de neuronas de cada capa oculta es en cambio algo que tiene que decidir el diseñador.

Las neuronas se conectan por pesos. El sesgo se incluye como una neurona más que se conecta a todas las demás excepto a las de la capa de entrada, que emite un valor constante y no tiene entradas.

Las neuronas de la capa de entrada transmiten el valor de su entrada a su salida sin modificarlo, es decir, su función es la función identidad, al igual que la neurona de la capa oculta, que, como estamos en un problema de regresión, es única. Las neuronas de las capas ocultas tendrán la función ReLU:

$$f(x) = \max\{x, 0\} = \begin{cases} x & \text{si } x \geq 0 \\ 0 & \text{si } x < 0 \end{cases}. \quad (3.9)$$

Las entradas de las neuronas de la primera capa serán los atributos de cada observación, recibiendo la neurona i el valor del atributo i . La entrada de las demás neuronas será, como ya hemos dicho, una combinación lineal de las salidas de las neuronas de la capa anterior y la neurona del sesgo. La salida de la neurona de la última capa será la predicción para la observación introducida.⁹

Para una red neuronal de una sola capa oculta podemos escribir la salida en función de la entrada de manera bastante sencilla, y al añadir más capas ocultas el procedimiento es el análogo con más pasos. Llamamos x_i a la salida de las neuronas de la primera capa, y_j a las de la capa oculta k , y z a la salida de la única neurona de la capa de salida:

$$\mathbf{x} = (x_1, \dots, x_{n_1}),$$

$$\mathbf{y} = (y_1, \dots, y_{n_2}).$$

Además, net_j es la entrada de la neurona j de la capa oculta, y net es la entrada de la neurona de la capa de salida.

Escribimos z en función de \mathbf{y} como

$$z(\mathbf{y}) = f(net) = f\left(\sum_0^n w_j y_j\right). \quad (3.10)$$

donde w_j es el peso que une la neurona j de la capa oculta con la neurona de la capa de salida. Además, sabemos que la salida de cada neurona de la capa oculta es

$$y_j(\mathbf{x}) = f(net_j) = f\left(\sum_0^n w_{ji} x_i\right), \quad (3.11)$$

donde w_{ji} es el peso que une la neurona i de la capa de entrada con la neurona j de la capa oculta. Sustituyendo obtenemos la salida de la red neuronal en función de la entrada:

$$z(\mathbf{x}) = f\left(\sum_{j=1}^{n_2} w_j f\left(\sum_0^{n_1} w_{ji} x_i\right)\right). \quad (3.12)$$

¿Qué funciones puede representar una red neuronal?

Gracias al teorema de Kolmogorov sabemos que cualquier función continua puede expresarse en una red neuronal de 3 capas, si ponemos $2n + 1$ neuronas ocultas, y poniendo una función en cada neurona que puede no ser la misma. En la última capa habría una única neurona que sumaría las salidas de todas las neuronas ocultas.

Otra prueba del alcance de las redes neuronales es el teorema de Fourier, que dice que cualquier función continua puede aproximarse arbitrariamente cerca por una suma de funciones armónicas, posiblemente infinita.

Esto sería una red neuronal de una capa oculta con la función identidad en las neuronas de la capa de entrada, una cantidad posiblemente muy grande de neuronas en la capa oculta, con dichas funciones armónicas, y una sola neurona en la capa de salida, con una función que sume las salidas de las funciones de la capa oculta.

Ninguno de los teoremas anteriores nos da ninguna pista sobre la cantidad de neuronas ocultas ni sobre los pesos correctos. Además, aunque existiese, una prueba constructiva nos sería de poca ayuda, ya que normalmente no sabremos cómo es la función buscada. Sin embargo, estos resultados nos ayudan a pensar que el esfuerzo en esta búsqueda es razonable.

3.3.2. Algoritmo de retropropagación

El entrenamiento de una red neuronal consiste en introducir observaciones (de las que conocemos el target) en la capa de entrada y según cuánto se alejen las predicciones que produzca la red de los targets, ajustar los pesos, buscando que se parezcan lo máximo posible.

Sin embargo, aunque podríamos modificar a ojo los pesos de la capa oculta a la capa de salida para que la predicción se pareciese más al valor poblacional, no sabemos cómo modificar los pesos de la capa de entrada a la oculta, ya que no sabemos que salidas deberíamos estar obteniendo por las neuronas de esta capa. Éste es el problema de asignación de crédito (*credit assignment problem*). El algoritmo de retropropagación, que vamos a estudiar a continuación, es una de las soluciones.

Aprendizaje de la red

Lo primero que tenemos que hacer para que nuestro método haga buenas predicciones, es cuantificar cómo de buena es una predicción. Queremos medir la distancia entre cada predicción y el resultado poblacional, y para esto utilizamos el error cuadrático. Si fijamos el valor de entrada, el error cuadrático se puede ver como una función de todos los pesos de la red. La llamamos $J(\mathbf{w})$ (multiplicamos por $\frac{1}{2}$ para derivar más cómodamente):

$$J(\mathbf{w}) = \frac{1}{2}(t - z)^2, \quad (3.13)$$

siendo t el valor poblacional (target) y z el valor que ha predicho la red. \mathbf{w} es el vector de todos los pesos de la red (weight). Buscamos el mínimo de esta función, es decir, la combinación de pesos que hay que seleccionar en la red para que las predicciones estén lo más cerca posible de los valores poblacionales.

El algoritmo de retropropagación consiste en intentar llegar a un mínimo local de $J(\mathbf{w})$ haciendo pequeñas modificaciones de \mathbf{w} en la dirección contraria a la del vector gradiente en ese punto, que es aquella en la que más rápido decrece $J(\mathbf{w})$.

Las modificaciones serán proporcionales al error cuadrático, pues suponemos que si éste es cercano a cero, ya estamos muy cerca del mínimo (que como mucho, será 0). Representamos el incremento de \mathbf{w} como

$$\Delta \mathbf{w} = -\eta \frac{\partial J}{\partial \mathbf{w}} \quad (3.14)$$

o, componente a componente:

$$\Delta w_{mn} = -\eta \frac{\partial J}{\partial w_{mn}}, \quad (3.15)$$

donde η indica el tamaño del incremento.

Para una red neuronal de una capa oculta, podemos obtener en pocos cálculos la expresión del incremento de los pesos. Los de la capa oculta a la capa de salida son:

$$\Delta w_j = \eta(t - z) f'(net) y_j, \quad (3.16)$$

donde j es el índice la neurona de la capa oculta de la que sale el peso

De manera análoga, obtenemos la expresión del incremento de los pesos de la capa de entrada a

la capa oculta:

$$\Delta w_{ji} = \eta(t - z) f'(net) w_j f'(net_j) x_i, \quad (3.17)$$

donde j es el índice de la neurona de la capa oculta a la que llega el peso, e i el de la neurona de la capa de entrada de la que sale el peso.

Para una red neuronal con más capas ocultas, los cálculos son idénticos, pero cuantas más capas de neuronas haya entre el peso y el target, más derivadas incluirá su fórmula.

Aunque es interesante tener una idea general de cómo se va incrementando cada peso, la implementación del método de retropropagación está disponible en diversos softwares y no es objeto de este TFG.

3.4. Máquinas de vectores soporte de regresión

La mayoría de esta sección ha sido obtenida de [6] y del Capítulo 19 de [7].

Las máquinas de vectores soporte de regresión, a las que nos referiremos por sus siglas en inglés, *SVR*, son otra solución al problema de regresión, que consiste en una función $f(x)$ que, en las observaciones del conjunto de aprendizaje, tenga un error menor que un ε definido, y que al mismo tiempo sea lo más cercana posible a una función constante.

Si imaginamos la función poblacional, que es la que tratamos de aproximar con $f(x)$, e imaginamos también un tubo alrededor de su gráfica, de manera que los puntos de este tubo estén a una distancia ε de los puntos de la función, entonces nuestra función $f(x)$ estará dentro de este tubo. Ésta es la primera de las condiciones que hemos pedido, es decir, que en las observaciones del conjunto de aprendizaje, el error sea menor que ε . La otra condición hace referencia a que la función sea lo más parecida posible a una recta horizontal.

Explicaremos primero el método que siguen las máquinas de vectores soporte para resolver un problema lineal, y luego introduciremos las modificaciones necesarias para resolver problemas no lineales.

Si f es lineal podemos escribirla como

$$f(x) = \langle w, x \rangle + b \quad : \quad w \in \mathcal{X}, b \in \mathcal{R}. \quad (3.18)$$

En este caso, que f sea cercana a una función constante lo entendemos como que $\|w\|$ sea cercano a 0. Encontrar entonces la f sería resolver el siguiente problema de optimización:

$$\min \frac{1}{2} \|w\|^2 \quad : \quad \begin{cases} y_i - \langle w, x_i \rangle - b \leq \varepsilon \\ \langle w, x_i \rangle + b - y_i \leq \varepsilon \end{cases}, \quad (3.19)$$

donde, de todas las funciones que cumplen las restricciones impuestas, nos quedamos con aquella cuyo vector de coeficientes, w , tenga menor norma. Como la función que buscamos es la solución a un problema de optimización convexa, sabemos que siempre habrá solución.

En ocasiones queremos permitir cierta cantidad de error, es decir, queremos permitir que nuestra función no esté contenida enteramente en el tubo ϵ . En este caso, tenemos que modificar el problema e incluir las llamadas *slack variables*, ξ_i, ξ_i^* :

$$\min \quad \frac{1}{2} \|w\|^2 + C \sum_{i=1}^N (\xi_i + \xi_i^*) \quad : \quad \begin{cases} y_i - \langle w, x_i \rangle - b \leq \epsilon + \xi_i \\ \langle w, x_i \rangle + b - y_i \leq \epsilon + \xi_i^* \end{cases} \quad (3.20)$$

La constante C , que es un hiperparámetro que tendremos que ajustar, balancea la importancia de que f sea cercana a una función constante y la cantidad hasta la que toleramos desviaciones mayores que ϵ . El valor que demos a C define en gran medida las predicciones que obtendrá nuestro modelo, por lo que es imprescindible que su valor sea adecuado. Para encontrarlo utilizaremos la validación cruzada, como definimos al principio del capítulo. Se explica más detalladamente al llegar a los experimentos, en la Sección 5.3.

Otro detalle importante es que sólo las desviaciones mayores que ϵ tienen coste. El segundo término de la ecuación no diferencia entre funciones que estén contenidas en el tubo ϵ , sino que únicamente tiene en cuenta la parte de la función que sale del tubo. El primer término, en cambio, será el que nos haga elegir una función u otra de entre las que tienen el mismo error: elegiremos aquella con menores coeficientes, es decir, aquella para la que la norma del vector de coeficientes, w , sea menor.

Para simplificar la resolución de la Ecuación 3.20, se suele modificar su formulación a la denominada expresión dual. Sobre la expresión dual de un problema de optimización únicamente veremos que es una función que construimos a partir del problema que ya hemos definido, que se llama problema primal. A grandes rasgos, buscamos un máximo en lugar de un mínimo, modificando las restricciones e introduciendo el conjunto dual de variables, que son los multiplicadores de Lagrange $\alpha_i^{(*)}$ y $\eta_i^{(*)}$:

$$\begin{aligned} L := & \frac{1}{2} \|w\|^2 + C \sum_{i=1}^n (\xi_i + \xi_i^*) - \sum_{i=1}^n (\eta_i \xi_i + \eta_i \xi_i^*) - \\ & - \sum_{i=1}^n \alpha_i (\epsilon + \xi_i - y_i + \langle w, x_i \rangle + b) - \\ & - \sum_{i=1}^n \alpha_i^* (\epsilon + \xi_i^* + y_i - \langle w, x_i \rangle - b). \end{aligned} \quad (3.21)$$

Ahora, derivando respecto de las variables primarias w, b y $\xi_i^{(*)}$, anulando y sustituyendo, obtenemos el problema de optimización dual

$$\text{máx} \begin{cases} -\frac{1}{2} \sum_{i,j=1}^n (\alpha_i - \alpha_i^*)(\alpha_j - \alpha_j^*) \langle \mathbf{x}_i, \mathbf{x}_j \rangle \\ -\varepsilon \sum_{i=1}^n (\alpha_i + \alpha_i^*) + \sum_{i=1}^n y_i (\alpha_i - \alpha_i^*) \end{cases} : \sum_{i=1}^n (\alpha_i - \alpha_i^*) = 0 \quad \text{y} \quad \alpha_i, \alpha_i^* \in [0, C]$$

Y finalmente, con algunos cálculos más en las ecuaciones de las derivadas, podemos expresar \mathbf{w} en función de los \mathbf{x}_i por un coeficiente:

$$\mathbf{w} = \sum_{i=1}^n (\alpha_i - \alpha_i^*) \mathbf{x}_i, \quad (3.22)$$

y por tanto

$$f(\mathbf{x}) = \sum_{i=1}^n (\alpha_i - \alpha_i^*) \langle \mathbf{x}_i, \mathbf{x} \rangle + b. \quad (3.23)$$

Vemos que \mathbf{w} puede expresarse como una combinación lineal de las observaciones de nuestra muestra de datos. Además, el algoritmo consiste esencialmente en hacer productos escalares entre observaciones, y mientras conozcamos los resultados de estos, no es necesario conocer el valor de las observaciones individualmente. Este detalle es importante y más adelante lo utilizaremos para poder resolver problemas no lineales.

Ahora nos falta calcular b . En este punto introducimos las condiciones de Karush-Kuhn-Tucker, a partir de las cuales acotaremos b y concluiremos algunas observaciones más que revelan por qué las SVRs son tan potentes. Las condiciones de Karush-Kuhn-Tucker dicen que el vector de pesos \mathbf{w} que sea solución de nuestro problema también será solución de las siguientes ecuaciones:

$$\alpha_i (\varepsilon + \xi_i - y_i + \langle \mathbf{w}, \mathbf{x}_i \rangle + b) = 0, \quad (3.24)$$

$$\alpha_i^* (\varepsilon + \xi_i^* + y_i - \langle \mathbf{w}, \mathbf{x}_i \rangle - b) = 0, \quad (3.25)$$

$$(C - \alpha_i) \xi_i = 0 \quad (3.26)$$

y

$$(C - \alpha_i^*) \xi_i^* = 0. \quad (3.27)$$

A partir de estas condiciones vemos que las observaciones que se salgan del tubo ε son las

únicas para las que $\alpha_i - \alpha_i^*$ es no nulo, por lo tanto, en la expresión de w , las únicas observaciones que no vamos a multiplicar por un coeficiente igual a cero son las que se salgan del tubo. Obviamente no nos hace falta conocer las observaciones que se vayan a multiplicar por cero, con lo que w solo depende las observaciones que salgan del tubo ϵ . A estas observaciones las llamamos vectores soporte, y nos permiten no tener en cuenta el conjunto completo de datos cada vez que queramos realizar una predicción, lo cual supone que podamos aplicar las SVRs en problemas con un conjunto de datos de gran tamaño.

Por otro lado, a partir de estas cuatro condiciones vemos que podemos acotar b en el siguiente intervalo:

$$\begin{aligned} \max\{-\epsilon + y_i - \langle w, x_i \rangle \mid \alpha_i < C \text{ o } \alpha_i^* > 0\} &\leq \\ &\leq b \leq \\ \min\{-\epsilon + y_i - \langle w, x_i \rangle \mid \alpha_i > 0 \text{ o } \alpha_i^* < C\}, & \end{aligned}$$

y en el caso de que algún $\alpha^{(*)}$ pertenezca al intervalo $(0, C)$, las desigualdades pasan a ser igualdades, con lo que tenemos el valor exacto de b .

Ya conocemos un procedimiento para encontrar $f(x)$ en un caso lineal, y hemos visto además que solo depende de los vectores soporte. A continuación, vamos a ver como adaptar $f(x)$ para resolver problemas no lineales.

Kernel trick

Como se ha hecho notar anteriormente, para escribir $f(x)$ no es necesario conocer el valor de las observaciones individualmente, sino que solo nos interesaba conocer el producto escalar de unas observaciones con otras. Esto nos va a permitir aplicar una transformación no lineal a los datos para convertirlos en unos que sí se puedan aproximar con una función lineal.

Supongamos que queremos aplicar una transformación no lineal ϕ a nuestros datos. Dado que solo necesitamos conocer $\langle x_i, x_j \rangle$, tras aplicar la transformación solo necesitamos saber $\langle \phi(x_i), \phi(x_j) \rangle$, y para ello podemos utilizar las llamadas funciones kernel, que representamos mediante la letra K y que cumplen $K(x_i, x_j) = \langle \phi(x_i), \phi(x_j) \rangle$, para determinada ϕ . De esta manera podemos calcular los productos escalares sin conocer la imagen por ϕ , y solo tenemos que calcular $K(x_i, x_j)$.

Hay distintos ejemplos de funciones Kernel, pero la más común y por tanto la que se ha utilizado en este trabajo es la función kernel de base radial, o, según sus siglas en inglés, kernel *rbf*. Tiene la siguiente expresión:

$$K(x_i, x_j) = \exp\left(-\frac{\|x_i - x_j\|^2}{2\sigma^2}\right), \quad (3.28)$$

Los valores que toman sus distintos parámetros se hallarán utilizando validación cruzada, como se explica en la parte de simulaciones y resultados, en la Sección 5.3, que es la del modelo SVR.

MÉTODOS DE ENSEMBLE

4.1. ¿Qué es un modelo de ensemble?

Los métodos de ensemble de regresión son un tipo de modelo de regresión compuesto de varios modelos individuales, que se entrenan para resolver el mismo problema y son combinados para obtener mejores resultados. En este sentido, con el término modelo individual nos referimos a un modelo que no está compuesto por otros, como sí que lo están los modelos de ensemble. Los modelos Ridge, perceptrón multicapa y SVR, detallados en el capítulo anterior, son modelos individuales.

Los modelos de ensemble dan una solución más elaborada que la de otros métodos al problema de elegir con qué modelos de regresión individuales haremos predicciones, de entre una familia de N modelos $\{G_j\}_{j=1}^N$, con $N \geq 1$. Tradicionalmente, cuando utilizamos métodos individuales, elegimos mediante validación cruzada cuál de todos los modelos obtiene las mejores predicciones, y utilizamos ese descartando todos los demás.

Los modelos de ensemble, en cambio, involucran a la familia completa de modelos de regresión individuales, $\{G_j\}_{j=1}^N$, buscando un modelo más potente a expensas de un coste computacional algo mayor. La idea subyacente es que los fallos de cada modelo se compensen con los demás, ya que la porción de datos donde un modelo comete mayor error no tiene por qué ser la misma que para otro modelo.

Para encontrar una solución a un problema de regresión hacemos un balance de la complejidad del modelo: deberá tener suficientes grados de libertad como para ser capaz de reproducir la complejidad de las relaciones entre las distintas variables, pero no demasiados o será capaz de replicar con demasiada precisión los resultados de los datos con los que se entrene, resultando esto en sobreajuste. Este balance es uno de los aspectos que buscamos mejorar al componer varios modelos en un modelo de ensemble.

Cuando un modelo sobreajusta, normalmente tiene una varianza muy alta, pues si los datos son muy similares a los del conjunto de entrenamiento, el modelo obtendrá buenas predicciones, pero en cuanto estos sean algo diferentes, el modelo no sabrá generalizar lo suficiente como para obtener

buenos resultados. Por lo tanto, queremos reducir la varianza de los modelos que sobreajusten.

En cambio, cuando un modelo generaliza demasiado, tiene menor varianza, y los resultados suelen ser más parecidos al variar el conjunto de datos, pero al precio de que las predicciones tengan un mayor sesgo. En estos casos, por lo tanto, querríamos reducir el sesgo.

Utilizando los métodos de ensemble podemos construir un método con menor sesgo o menor varianza que obtenga mejores resultados. Tendremos por lo tanto que utilizar el modelo de ensemble que coincida con nuestras necesidades, pues unos están más orientados a reducir la varianza de los modelos que los componen y otros a reducir el sesgo.

El primer paso para trabajar con métodos de ensemble es seleccionar los modelos base que vamos a utilizar. La mayoría de los métodos, como bagging o boosting, utilizan un único modelo variando sus hiperparámetros y/o el conjunto de aprendizaje. Entonces decimos que el método de ensemble es homogéneo. En los modelos de ensemble stacking, en cambio, se utilizan distintos modelos individuales. Entonces decimos que el modelo de ensemble es heterogéneo. Esto supone muchas más posibilidades, y por lo tanto pueden obtenerse mayores beneficios, pero hay también una dificultad implícita: no todos los modelos funcionarán bien juntos, y encontrar la combinación adecuada puede resultar complicado. A continuación pasamos a una explicación general de cada uno de estos métodos de ensemble.

Bagging

Para definir bagging, antes es necesario definir bootstrapping, que es un método de remuestreo en el que generamos muestras de tamaño k a partir de un conjunto de datos de tamaño n , haciendo extracciones aleatorias con reemplazo. Este método tiene la ventaja de que, bajo las hipótesis de representatividad e independencia, podemos considerar que las extracciones se hacen directamente de la distribución subyacente.

La hipótesis de representatividad consiste en asumir que n es lo suficientemente grande como para reflejar la complejidad de la distribución subyacente.

La hipótesis de independencia consiste en asumir que n es lo suficientemente grande en comparación con k como para poder asumir que las muestras no tendrán correlación. Podremos considerar las observaciones casi independientes idénticamente distribuidas.

Bagging es un método de ensemble que consiste en entrenar varios modelos individuales independientes y promediar sus predicciones para obtener un modelo con menos varianza. Al entrenarse los modelos individuales de manera independiente, tenemos la posibilidad de entrenarlos en paralelo, lo que puede suponer una reducción muy significativa del tiempo de ejecución.

El procedimiento consiste en extraer una muestra bootstrap para cada modelo, que será su conjunto de aprendizaje. La predicción del modelo bagging se obtiene haciendo un promedio entre las

predicciones de los modelos individuales.

Hacer un promedio de las predicciones de los modelos individuales no cambia la respuesta esperada, pero reduce la varianza, de la misma manera que hacer la media de variables aleatorias i.i.d. preserva el valor esperado pero reduce la varianza.

Random forests es el ejemplo más conocido de modelo de ensemble bagging, donde se combinan árboles de decisión.

Boosting

Boosting es un método de ensemble que consiste en entrenar varios modelos individuales secuencialmente, influyendo el entrenamiento de un modelo en el de los modelos posteriores. Conseguimos un modelo con menor sesgo, aunque en ocasiones el coste temporal es muy elevado.

Para que el coste temporal sea razonable, se suelen utilizar modelos individuales poco precisos que se entrenen rápidamente. Cada modelo se entrena dando más prioridad a las observaciones que han sido mal clasificadas previamente.

La predicción del modelo de ensemble bagging será una suma ponderada de las predicciones de los modelos individuales. Normalmente buscar una ponderación que dé buenos resultados no es inmediato.

Adaptative boosting y *gradient boosting* son dos maneras distintas de construir un modelo de ensemble boosting, que se diferencian en la manera de encontrar los coeficientes de la suma ponderada.

Stacking

Dado que emplearemos este modelo en los experimentos, no haremos una explicación tan general como la de bagging y boosting, sino que le dedicaremos más tiempo en la Sección 4.2.

4.2. Método de ensemble *stacking*

La mayoría de esta sección ha sido obtenida a partir de [8].

En esta sección vamos a definir una técnica utilizada para construir métodos de ensemble conocida como *stacking* o *stacked generalization*. A modo de adelanto para facilitar la comprensión de este método de ensemble, hacemos la siguiente comparación entre un modelo individual y un modelo stacking: mientras que al utilizar un modelo individual entrenamos un único modelo sobre un único conjunto de datos, en un modelo de ensemble stacking hay varias capas de modelos y los modelos de cada capa se entrenan con las predicciones de los modelos de la capa anterior. En este último caso, consideramos que las predicciones de cada capa forman un nuevo conjunto de datos, en un nuevo espacio, por

lo que ahora hay varios conjuntos y espacios.

En este trabajo construimos y explicamos un modelo de ensemble stacking de dos capas, en el que la segunda capa, por tratarse de un modelo stacking de regresión, tendrá un único modelo.

Llamaremos espacio de nivel 0 al espacio donde viven los elementos de D_n , y espacio de nivel 1 a donde viven las transformaciones, que enseguida definiremos, de los datos del nivel 0. Los modelos de la primera capa serán un subconjunto de k modelos de la familia de N modelos de regresión individuales, que llamaremos los modelos de nivel 0 y denotaremos como $\{G_i\}_{i=1}^k$. El modelo de la segunda capa, es decir, el modelo de nivel 1, será un solo modelo, que puede estar incluido en los modelos de nivel 0 o no, y que denotaremos por \tilde{G} . Los modelos de nivel 0 se llaman así porque predicen sobre datos del nivel 0, y ocurre igual con el nivel 1.

El enfoque de esta explicación se basa en considerar que el modelo con el que queremos realizar predicciones es el modelo de nivel 1, en lugar de todo el modelo de ensemble. La parte restante de este último, que son los modelos de nivel 0, se utiliza únicamente para llevar datos del conjunto de nivel 0 al conjunto de nivel 1, donde se entrena, y por tanto predice, el modelo de nivel 1.

Lo primero que explicaremos es cómo se hace la transformación que genera, a partir del conjunto de entrenamiento de nivel 0, D_{train} , el conjunto de entrenamiento del nivel 1, que llamamos \tilde{D}_{train} . Sobre este último entrenaremos el modelo de nivel 1. Tomando un elemento genérico de \tilde{D}_{train} , digamos $(\tilde{\mathbf{X}}_i, \tilde{Y}_i)$, con $\tilde{\mathbf{X}}_i = (\tilde{X}_{i1}, \tilde{X}_{i2}, \dots, \tilde{X}_{ik})$, vamos a ver cómo obtenerlo a partir de la observación i de D_{train} , es decir, (\mathbf{X}_i, Y_i) .

El atributo j de $\tilde{\mathbf{X}}_i$, es decir, \tilde{X}_{ij} , es la predicción del modelo j de la familia de modelos de nivel 0 del target de \mathbf{X}_i , al entrenarse sobre todo el resto de D_{train} , es decir, $D_{train} \setminus \{(\mathbf{X}_i, Y_i)\}$. Por lo tanto, para obtener todos los atributos de $\tilde{\mathbf{X}}_i$ aplicamos los k modelos de nivel 0 sobre una observación de D_{train} , y la observación obtenida tendrá k atributos.

El target de la observación $(\tilde{\mathbf{X}}_i, \tilde{Y}_i)$, es decir, \tilde{Y}_i , es simplemente Y_i . En algunas variaciones del método stacking también se hace una transformación de Y_i para obtener \tilde{Y}_i , pero en este trabajo, Y_i e \tilde{Y}_i son iguales, o lo que es lo mismo, se utiliza la identidad como transformación.

Dado que con una observación de D_{train} obtenemos otra de \tilde{D}_{train} , ambos conjuntos tendrán la misma cantidad de elementos.

Los modelos de nivel 0 se entrenarán de dos maneras distintas: la primera de ellas es la que acabamos de ver para obtener los atributos de las observaciones de \tilde{D}_{train} , donde para predecir sobre la observación (\mathbf{X}_i, Y_i) , se entrenan sobre $D_{train} \setminus \{(\mathbf{X}_i, Y_i)\}$. La segunda manera corresponde a cuando predecimos sobre una observación que no pertenece al conjunto de entrenamiento, por ejemplo sobre una observación del conjunto de test. Aunque la veremos un poco más adelante, adelantamos que la única diferencia es que los modelos se entrenarán sobre todo D_{train} .

En la figura 4.1 vemos el esquema de la transformación de una observación de D_{train} , en el espacio de nivel 0, a una de \tilde{D}_{train} , en el espacio de nivel 1. Los k modelos de nivel 0 se entrenan, como hemos visto, con $D_{train} \setminus (\mathbf{X}_i, Y_i)$ para obtener $(\tilde{\mathbf{X}}_i, \tilde{Y}_i)$ a partir de (\mathbf{X}_i, Y_i) .

Hasta aquí se ha definido \tilde{D}_{train} . Falta por definir, una vez entrenado el modelo de nivel 1, cómo utilizarlo para realizar predicciones de observaciones que esta vez pueden pertenecer a D_{train} o no.

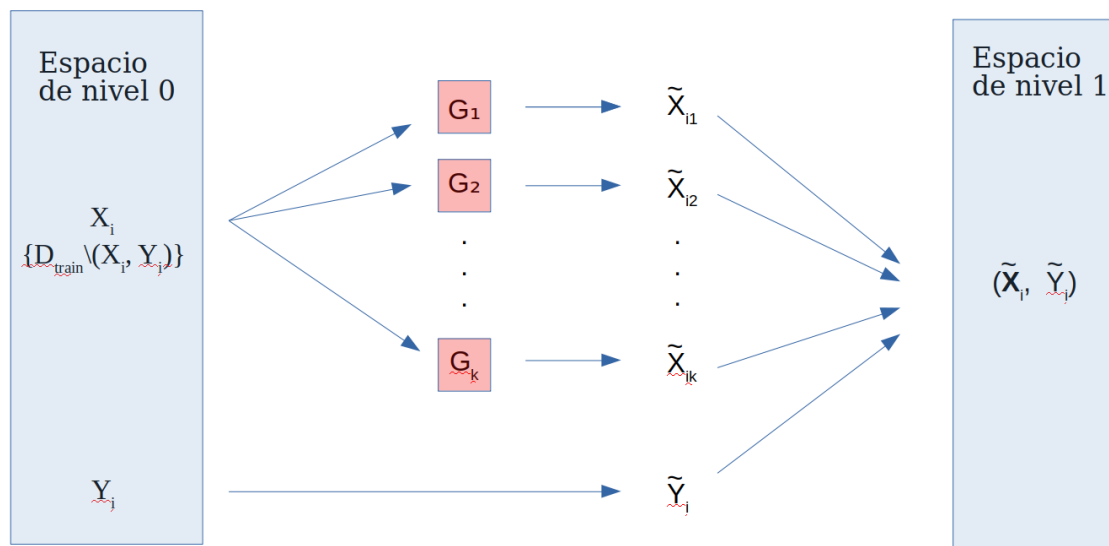


Figura 4.1: Este esquema representa cómo se obtiene una observación del espacio de nivel 1 a partir de una observación del espacio de nivel 0 utilizando los k modelos de nivel 0.

Sea \mathbf{X} una observación en el espacio de nivel 0 y $\tilde{\mathbf{X}} = (\tilde{X}_1, \tilde{X}_2, \dots, \tilde{X}_k)$ su transformación al espacio de nivel 1. Entonces el atributo i de la observación de nivel 1 es la predicción del target de la observación \mathbf{X} mediante el modelo i del subconjunto de modelos de nivel 0, cuando se entrena con el conjunto completo de datos, D_n .

Una vez obtenido $\tilde{\mathbf{X}}$, la predicción que hagamos mediante el modelo de nivel 1 será la predicción que buscamos, es decir, la predicción del modelo de ensemble para la observación \mathbf{X} . En cambio, en los modelos stacking en que \tilde{Y} se obtiene modificando Y , a la predicción que obtengamos de $\tilde{\mathbf{X}}$ mediante el modelo de nivel 1 hay que aplicarle la inversa de dicha transformación.

En la figura 4.2 vemos el proceso de predicción del target de una observación \mathbf{X} . Esta vez los k modelos de nivel 0 se entrenan sobre todo D_{train} .

Este es el proceso completo, que puede iterarse para obtener p niveles, con $p \geq 1$. Sin embargo, cuantos más niveles tenga el modelo de ensemble, mayor será el coste computacional. A día de hoy no hay reglas generales que indiquen qué generalizadores utilizar para cada nivel, ni con qué proceso obtener los k números a partir del conjunto de aprendizaje del nivel i que formen las componentes de entrada del nivel $i + 1$, etc. La manera de proceder habitualmente es aplicar conocimiento específico del problema para seleccionar estos hiperparámetros.

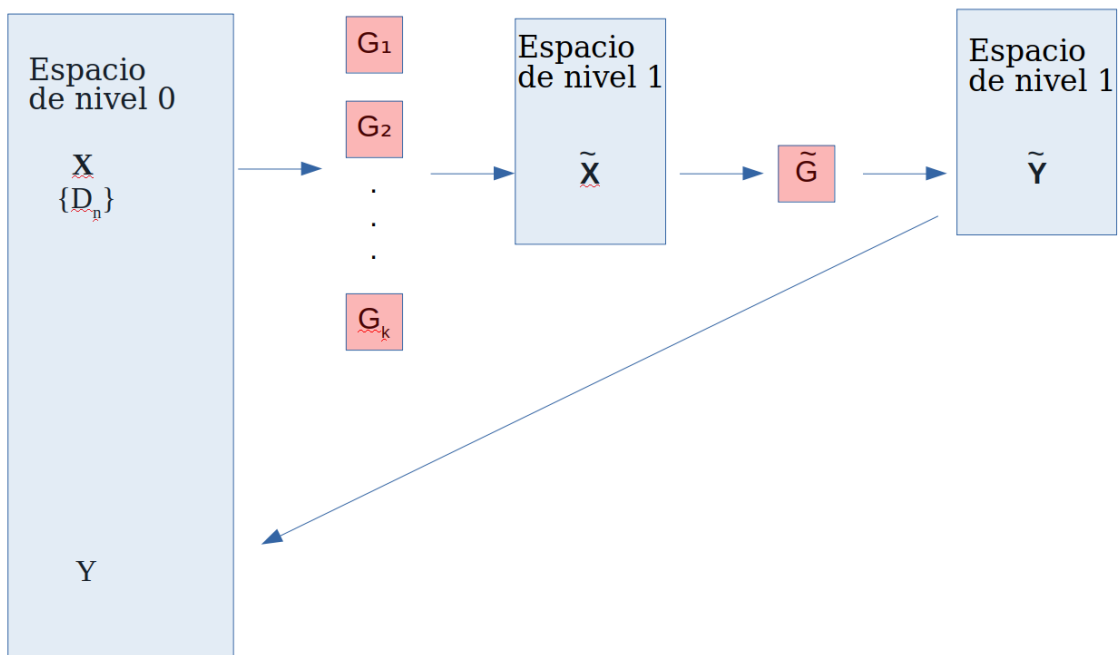


Figura 4.2: Este esquema representa el proceso de predicción una vez entrenado el modelo de ensemble.

SIMULACIONES Y RESULTADOS

En este capítulo explicamos cómo hemos utilizado cada uno de los modelos vistos hasta ahora para predecir la cantidad de energía eólica obtenida en el Parque Eólico Experimental de Sotavento.

Datos utilizados

La información sobre los datos ha sido obtenida de [1].

Para realizar este trabajo contábamos con una cuenta en el Centro de Computación Científica de la Universidad Autónoma de Madrid, a partir de la cual teníamos acceso a 6 ficheros de datos en los que se encontraban las predicciones atmosféricas del Centro Europeo de Previsiones Meteorológicas a Plazo Medio y las medidas de la energía obtenida en el Parque Eólico de Sotavento de cada hora de cada día de los años 2016, 2017 y 2018.

Los datos de las predicciones atmosféricas consisten en una serie de medidas de la dirección del viento, la velocidad, presión y temperatura, que enseguida concretaremos; tomadas en distintos puntos de Galicia. Estos puntos constituyen una rejilla que está aproximadamente centrada en el parque de Sotavento, y que tiene 435 puntos.

A partir de la intuición de que la cantidad de energía que iba a obtener el parque de Sotavento dependía sobretodo de las condiciones meteorológicas en sus alrededores más próximos, y que no era necesario por lo tanto tener en cuenta estas previsiones en un territorio tan amplio como del que disponíamos en principio, optamos por recortar los datos. Esto nos ha permitido reducir el coste computacional del entrenamiento de los modelos. Nos quedaremos únicamente con los puntos que rodean al parque de Sotavento, que está situado en las coordenadas $(43.354377^{\circ}, -7.881213^{\circ})$.

La coordenada más cercana, dado que la resolución de la rejilla es de $0,125^{\circ}$, es $(43.375^{\circ} -7.875^{\circ})$, y los puntos que estudiaremos, por tanto, son $(43.5, -8.)$, $(43.5, -7.875)$, $(43.5, -7.75)$, $(43.375, -8.)$, $(43.375, -7.875)$, $(43.375, -7.75)$, $(43.25, -8.)$, $(43.25, -7.875)$, $(43.25, -7.75)$.

Las medidas de las que disponemos son:

- 1.– Componente u de la dirección del viento medida a 10 metros de altura en m/s.
- 2.– Componente v de la dirección del viento medida a 10 metros de altura en m/s.

- 3.– Módulo de la velocidad del viento medida a 10 metros de altura en m/s.
- 4.– Componente u de la dirección del viento medida a 100 metros de altura en m/s.
- 5.– Componente v de la dirección del viento medida a 100 metros de altura en m/s.
- 6.– Módulo de la velocidad del viento medida a 100 metros de altura en m/s.
- 7.– Presión en la superficie en pascales.
- 8.– Temperatura medida a 2 metros de altura en kelvin.

En total tenemos 8 medidas tomadas en cada uno de los 9 puntos de la rejilla, es decir, 72 variables. Como la energía obtenida en el parque de Sotavento se mide cada hora, y tenemos los datos de tres años (2016 fue bisiesto), en total tenemos $24 \times 365 \times 3 + 24 = 26304$ observaciones.

En la figura 5.1 vemos un diagrama de caja de la energía obtenida en los años 2016, 2017 y 2018, es decir, del target de nuestro conjunto de datos. Vemos que el bigote inferior es muy corto: esto se debe a que hay una alta cantidad de periodos en los que la producción de energía fue nula, debido a que los molinos no estaban funcionando, y a los periodos de tiempo en los que no hubo viento. Desconocemos el motivo por el que los molinos no estuvieron funcionando, pero, a la vista de los resultados, parece lógico asumir que no depende de las condiciones atmosféricas, sino que quizá se deba a algún fallo mecánico o a mantenimiento en general. Por lo tanto, los periodos de producción nula, a efectos prácticos, aleatorios, son una desventaja que tenemos que asumir desde el principio.

Continuando con el diagrama de cajas 5.1, vemos que la mediana es muy baja, debido en gran parte al peso de las veces que los molinos no han estado funcionando y a las veces que no ha habido viento.

Por último, vemos una gran densidad de valores atípicos elevados. En general la idea que podemos ir sacando en claro de este diagrama es que los datos son bastante cambiantes.

Las gráficas 5.2 y 5.3 son dos ejemplos de días en los que hay producción nula de energía. En el gráfico del día 1 de diciembre de 2018 encontramos un ascenso de 8000 vatios en un periodo de unas 10 horas, mientras que en el segundo gráfico, vemos un ascenso de 5000 vatios en apenas 3 horas. Esto corrobora la gran variabilidad de los datos, muy relacionada con el carácter cambiante del viento.

Lectura de los datos

Para leer los datos, que están en formato csv (valores separados por comas), hemos utilizado la librería pandas, que nos permite trabajar con objetos *dataframe*. Los dataframe tienen una funcionalidad que hemos encontrado muy completa y que ha facilitado enormemente el análisis de los datos y resultados.

Con la función *read_csv* de pandas, pasando como parámetro el nombre del archivo, creamos un dataframe con tantas columnas como datos. A partir de aquí es fácil realizar un filtrado en el que mantengamos únicamente los atributos cuyas coordenadas pertenezcan al intervalo que hemos recortado.

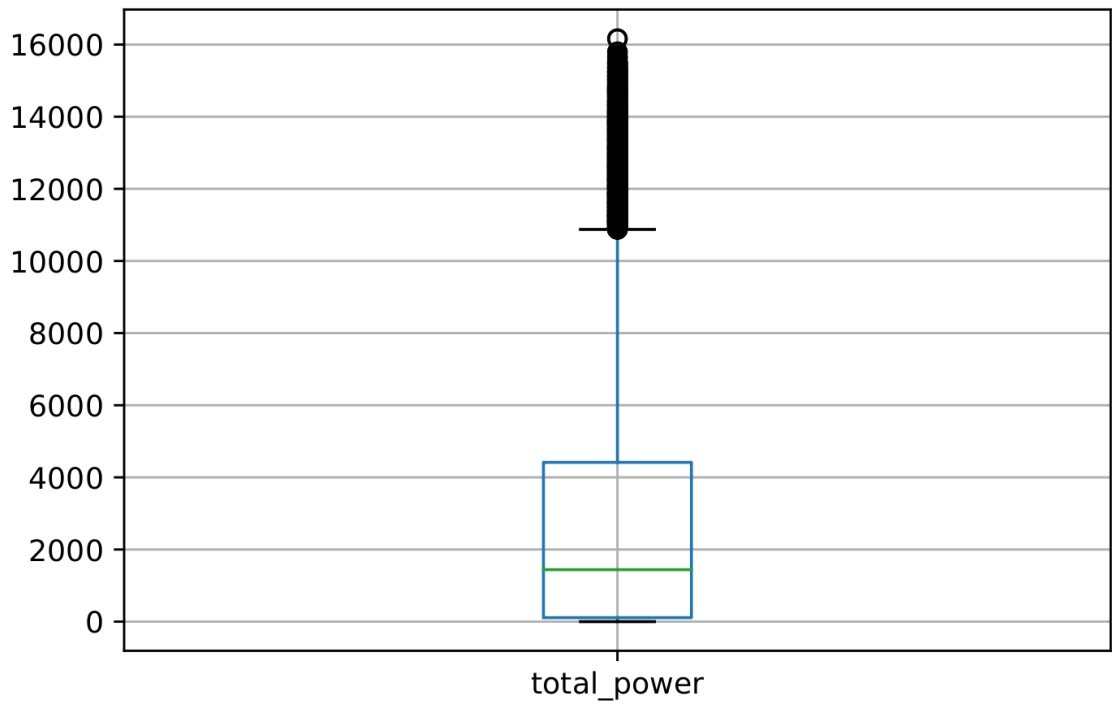


Figura 5.1: Boxplot de los valores de energía obtenida en los años 2016, 2017 y 2018.

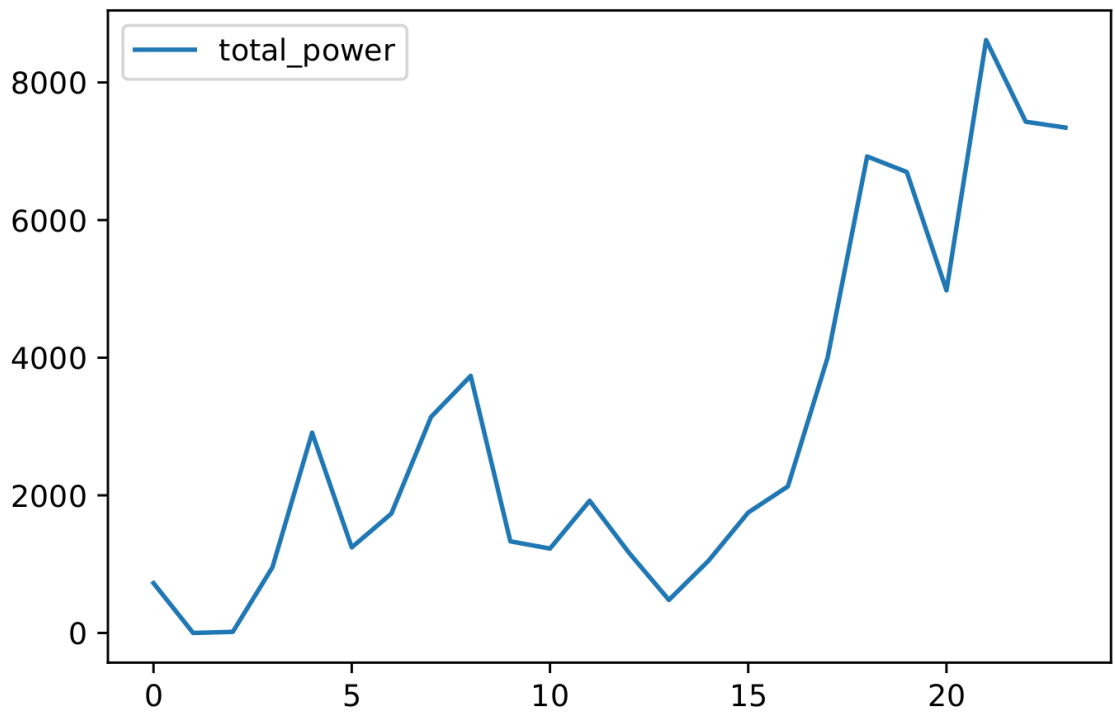


Figura 5.2: Gráfica de los valores de energía obtenida el 1 de diciembre de 2018.

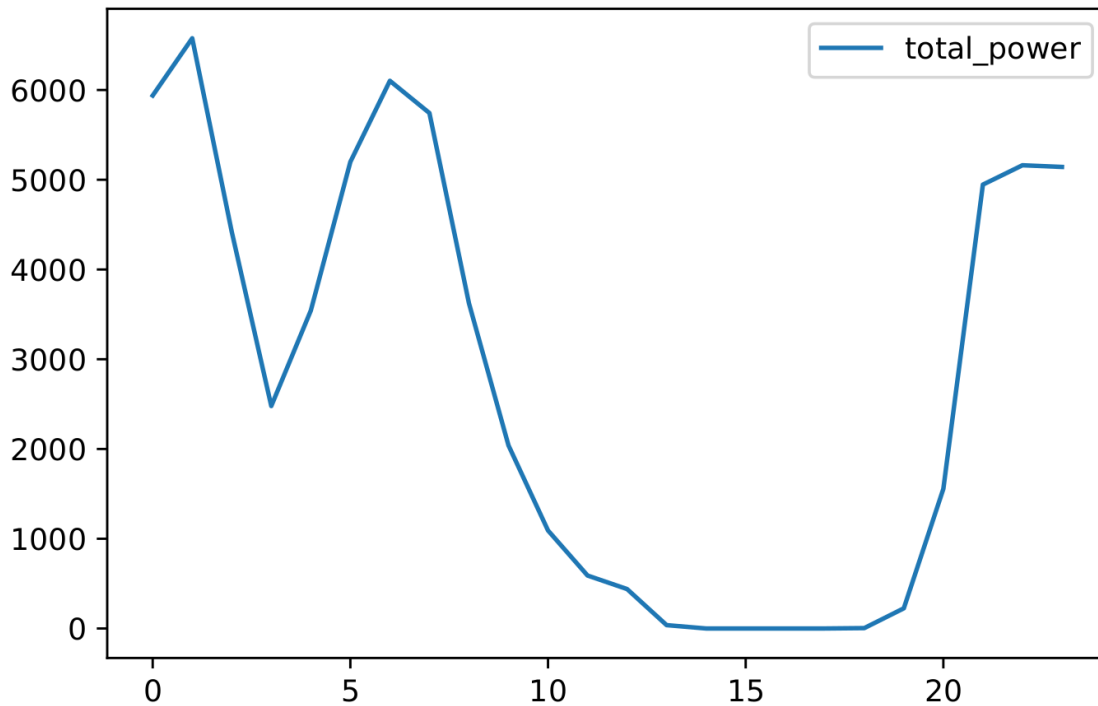


Figura 5.3: Gráfica de los valores de energía obtenida el 30 de diciembre de 2018.

Llegados a este punto tenemos los datos que vamos a utilizar, y hay que separarlos en un subconjunto que utilizaremos como datos de entrenamiento y otro subconjunto que utilizaremos como datos de test.

Conjunto de entrenamiento y conjunto de test

Un modelo como el que estamos construyendo siempre se entrena con datos anteriores a aquellos sobre los que predice, ya que solo conoceremos la cantidad exacta de energía que se obtiene cada día al haber pasado ese día.

Intuimos que este puede ser un detalle importante, y la manera de incorporar esta información a nuestro modelo es utilizar como conjunto de entrenamiento los años 2016 y 2017, y utilizar como conjunto de test los datos del año 2018.

Separamos entonces en los siguientes subconjuntos:

- X_train: predicciones meteorológicas de 2016 y 2017.
- Y_train: energía obtenida en 2016 y 2017.
- X_test: predicciones meteorológicas de 2018.
- Y_test: energía obtenida en 2018.

5.1. Regresión regularizada

Para el modelo de regresión regularizada hemos utilizado la función *Ridge* del módulo *linear_model* de la librería *scikit learn* (sklearn). Respecto a los parámetros, hemos utilizado como *solver* el mínimo error cuadrático medio, es decir, "lsqr"(del inglés *lowest squares*), ya que es lo que corresponde al modelo que hemos estudiado. Además, suele ser más rápido que las alternativas. Los demás parámetros se han dejado con los valores por defecto, a excepción del parámetro α .

El parámetro α corresponde al peso de la regularización, es decir, al parámetro λ en nuestra explicación del modelo en la Sección 3.2. Para seleccionar su valor hemos utilizado la validación cruzada, mediante la función *GridSearchCV* del módulo *model_selection* de la librería sklearn. El rango de valores sobre el que la hemos realizado es

$$\alpha := \{10^k : 0 \leq k \leq 6\}. \quad (5.1)$$

Al escoger el rango de valores hay que intentar coger un rango no excesivamente amplio, especialmente si el modelo tarda en entrenarse (aunque por ahora, este no es el caso), pero lo suficientemente grande para observar en qué parte del rango están los parámetros que mejor funcionan. Si, por ejemplo, escogemos un rango desde 10 hasta 10000, y el modelo va obteniendo mejores resultados a medida que el valor del parámetro aumenta, y además el mejor resultado se obtiene en el valor 10000, es decir, en el borde del intervalo, es obvio que hay una tendencia a obtener mejores resultados al aumentar el parámetro. En esta situación tenemos que aumentar el intervalo, o al menos moverlo, para incluir valores que hay a la derecha del máximo, pues es muy probable que el modelo siga mejorando. Nos detenemos cuando haya signos claros de que el modelo deja de mejorar.

En nuestro caso, el modelo obtiene resultados muy similares desde el 10^0 hasta el 10^3 , y luego comienzan a mejorar rápidamente en 10^4 y 10^5 , para luego obtener el peor resultado de todos en 10^6 . Si hubiésemos utilizado un rango de parámetros hasta 10^4 , el mejor resultado hubiese estado en el borde del intervalo, hubiésemos renunciado a obtener mejores resultados con 10^5 , e incluso si el intervalo llegase solo hasta 10^5 , no tendríamos la certeza de que estamos en el mejor valor, ya que no habríamos comprobado que a partir de ese valor los resultados son peores.

α	10^0	10^1	10^2	10^3	10^4	10^5	10^6
ranking	6	5	4	3	2	1	7
pts. test	-2801,20	-2801,20	-2801,18	-2800,95	-2798,76	-2781,95	-2822,19

Tabla 5.1: Resultados de la validación cruzada para el modelo Ridge sobre el parámetro α .

Además, hemos utilizado como scoring la estrategia *neg_mean_absolute_error*. Esto significa que el ranking y las puntuaciones de los modelos corresponden al error absoluto medio que tiene el método

Ridge con cada uno de los parámetros del rango que hemos proporcionado. En la tabla 5.1, la tercera fila corresponde a la puntuación media de cada modelo, midiendo el error absoluto en negativo. La razón por la que medimos en negativo es porque la función `GridSearchCV` siempre maximiza, y como nosotros queremos seleccionar el parámetro para el que el modelo tenga error mínimo, escribimos los errores en negativo (los errores siempre serán una cantidad mayor o igual que cero) y escogemos el mayor.

Un detalle importante es que la validación cruzada se realiza siempre sobre el conjunto de entrenamiento. Esto es para que luego al predecir sobre el conjunto de test los resultados se parezcan a lo que podemos esperar al predecir sobre datos no conocidos. Si incluyésemos el conjunto de test en la validación cruzada, luego no podríamos utilizarlo para evaluar el comportamiento del modelo con datos nuevos.

En la tabla 5.1 vemos que el parámetro que menor error absoluto tiene sobre el conjunto de entrenamiento es $\alpha = 10^5$. Entrenamos entonces un modelo Ridge con ese parámetro α , y lo entrenamos con el conjunto de entrenamiento mediante la función `fit`, a la que se le pasan como parámetros las observaciones del conjunto de entrenamiento y sus targets. A continuación, predecimos con él los targets de las observaciones del conjunto de test, y ya podemos medir los errores frente a los targets que tenemos en el conjunto de test.

El error absoluto medio que se ha obtenido prediciendo sobre el conjunto de test, es decir, sobre las predicciones atmosféricas de 2018, es de 0,0866, es decir, 8,66 %. Este porcentaje lo medimos respecto a la potencia máxima que puede obtener el parque en una hora, que son 17560 vatios. El error medio en valor absoluto es entonces entorno a los 1500 vatios.

Obtenemos además un valor para el estadístico R^2 de 46,8 %. Esto quiere decir que la varianza de las predicciones atmosféricas explican un 46,8 % de la varianza de la energía obtenida.

Obtenemos la distribución de error que vemos en la gráfica 5.4. La información que se muestra es la diferencia *valor real - valor predicción*. Podemos observar que la mediana está por debajo de cero, y que hay valores atípicos negativos de cerca de 17560 vatios (corresponden al -1). Estos son debidos probablemente a los periodos de tiempo de producción nula, que el modelo no ha conseguido aprender. Sin embargo, la caja que corresponde al rango intercuartílico es muy achatada, lo que nos indica que hay una gran cantidad de datos para los que se obtiene un error de $\pm 5\%$. Dada la simplicidad del modelo y la complejidad de los datos, consideramos que estos son buenos resultados.

5.2. Perceptrón multicapa

Para el perceptrón multicapa hemos utilizado la función `MLPRegressor` del módulo `neural_network` de `sklearn`. Las funciones de activación de las neuronas de las capas ocultas son funciones ReLU, y la

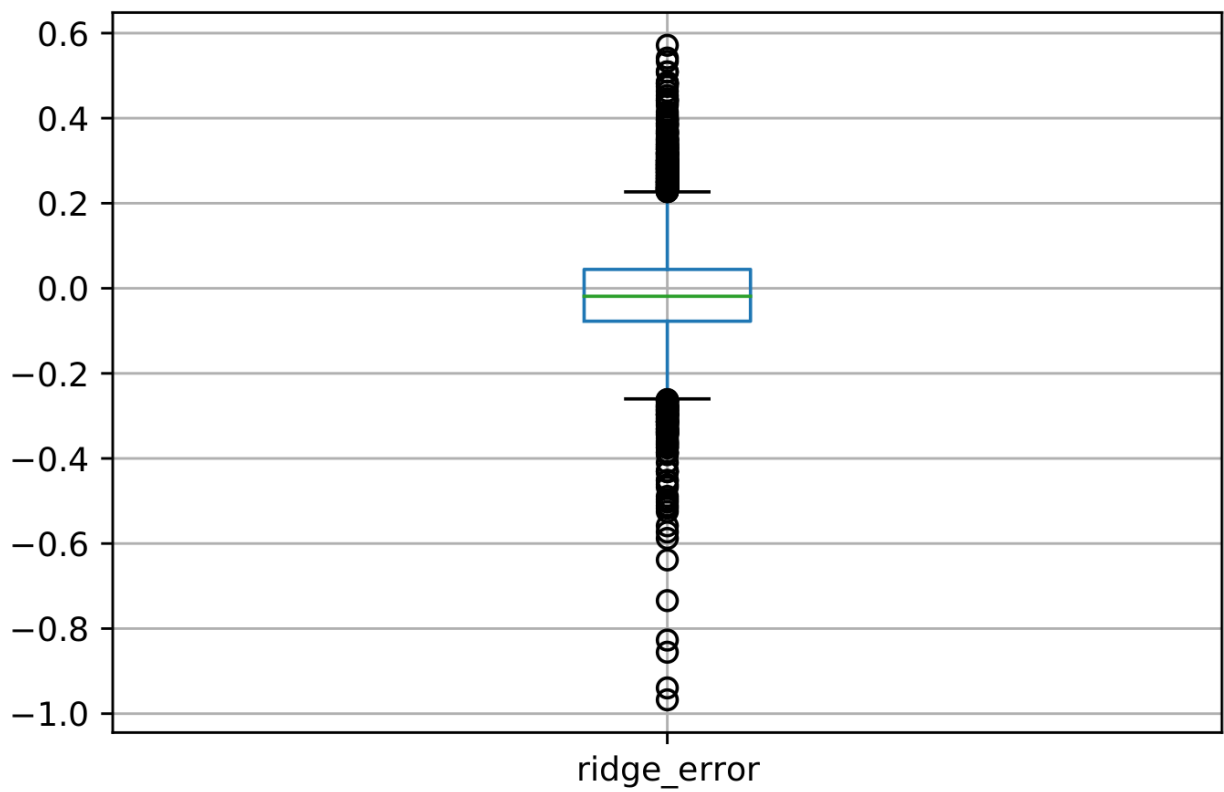


Figura 5.4: Boxplot de los errores medidos como valores reales menos valores predichos del modelo Ridge.

inicialización de pesos es aleatoria. Inicialmente pretendíamos utilizar una red neuronal de una capa oculta, pero tras numerosas pruebas, la mejor arquitectura ha sido utilizar tres capas ocultas de cien neuronas cada una. Para el parámetro de regularización α , una vez más, realizamos una validación cruzada, con el rango de valores

$$\alpha := \{10^k : 1 \leq k \leq 6\}. \quad (5.2)$$

En la figura 5.2 vemos los resultados de la validación cruzada. El rango es lógico, pues es lo suficientemente grande como para permitir variedad de resultados, y tenemos evidencia para considerar que el valor 10^4 es un mínimo local, ya que si damos al parámetro α un valor mayor o menor, los resultados empeoran según nos alejamos.

α	10^1	10^2	10^3	10^4	10^5	10^6
ranking	5	4	3	1	2	6
pts. test	-1048,44	-1044,96	-1044,92	-1033,40	-1043,27	-1049,27

Tabla 5.2: Resultados de la validación cruzada para el perceptrón multicapa sobre el parámetro α .

Para este modelo hemos obtenido un error absoluto medio de 6,5 %, es decir, hemos mejorado considerablemente las predicciones que obteníamos con el modelo Ridge, con el que fallábamos en un 8,66 %. Este 6,5 % equivale a unos 1150 vatios, frente a los 1500 del modelo Ridge.

El estadístico R^2 en este caso tiene un valor de 71,31 %, que, frente al 46,8 % del modelo Ridge, supone una mejora de caso el 25 %.

En la figura 5.5 vemos el diagrama de caja con los errores de predicción del perceptrón multicapa sobre las predicciones meteorológicas de 2018. Podemos apreciar que el rango intercuartílico vuelve a ser muy pequeño, y que la mediana parece ser también muy cercana a cero. Los valores atípicos vuelven a ser más extremos cuando el valor predicho supera al valor real, debido a los periodos de producción nula. Podemos apreciar también una disminución de la longitud de los bigotes: buena señal ya que indica más cantidad de errores cercanos a cero.

5.3. SVR

Para el modelo de la máquina de vectores soporte de regresión, SVR, hemos utilizado la función SVR del módulo *svm* de la librería *sklearn*. Como función de kernel hemos utilizado una función de base radial. Hemos utilizado la validación cruzada para los parámetros *epsilon*, *C* y *gamma*.

El parámetro *C* hace referencia a la regularización. Cuanto menor sea su valor, más impacto tendrá la regularización. El parámetro *gamma* corresponde a la inversa del parámetro σ de la función de base

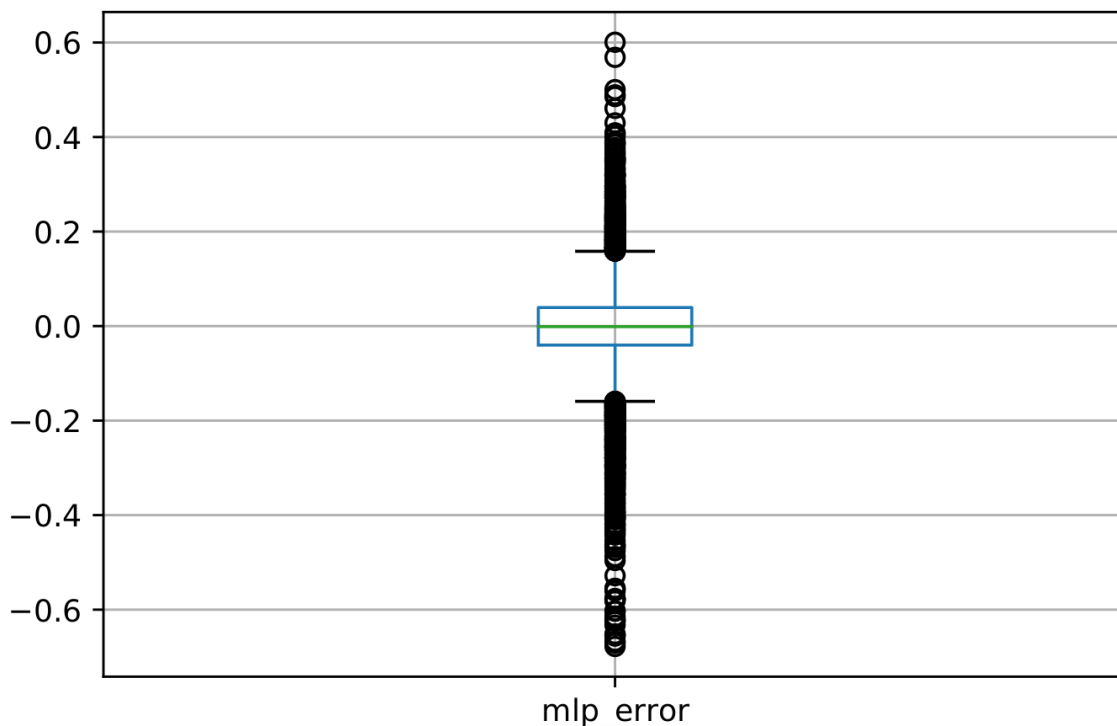


Figura 5.5: Errores del perceptrón multicapa medidos como valores predcidos menos valores reales.

radial que utilizamos como kernel, según está escrita en la ecuación 3.28. Por último, el parámetro ϵ hace referencia al tamaño del tubo ϵ que describimos al explicar las SVRs, en la Sección 3.4.

Para la validación cruzada hemos configurado GridSearchCV según se hace en el artículo [1]. Los intervalos que se proponen en dicho artículo son los siguientes:

$$C := \{10^k : -1 \leq k \leq 6\}, \quad (5.3)$$

$$\epsilon := \left\{ \frac{\tilde{\sigma}}{2^k} : 1 \leq k \leq 6 \right\}, \quad (5.4)$$

$$\gamma := \left\{ \frac{4^k}{d} : -2 \leq k \leq 3 \right\}, \quad (5.5)$$

donde $\tilde{\sigma}$ es la desviación típica de la energía obtenida en el conjunto de entrenamiento, es decir, de 2016 y 2017; y d es la cantidad de variables que tiene el problema. $\tilde{\sigma}$ se puede obtener mediante la función `std()` del objeto DataFrame, y la cantidad de variables o dimensión del problema, con la función `shape()` del objeto dataframe.

Los valores que hemos obtenido son

$$C = 10^4 = 10000 , \quad (5.6)$$

$$\varepsilon = \frac{\sigma}{2^{-6}} = 53,46 , \quad (5.7)$$

$$\gamma = \frac{4^{-1}}{d} = 0,0035 . \quad (5.8)$$

Con este modelo hemos obtenido un error absoluto medio del 6,36 %, que se traduce en alrededor de 1115 vatios, y un estadístico R^2 del 72,7 %. No hemos obtenido una mejora significativa respecto a los resultados del perceptrón, por lo que consideramos que la SVR y el perceptrón empatan, es decir, predicen con el mismo error.

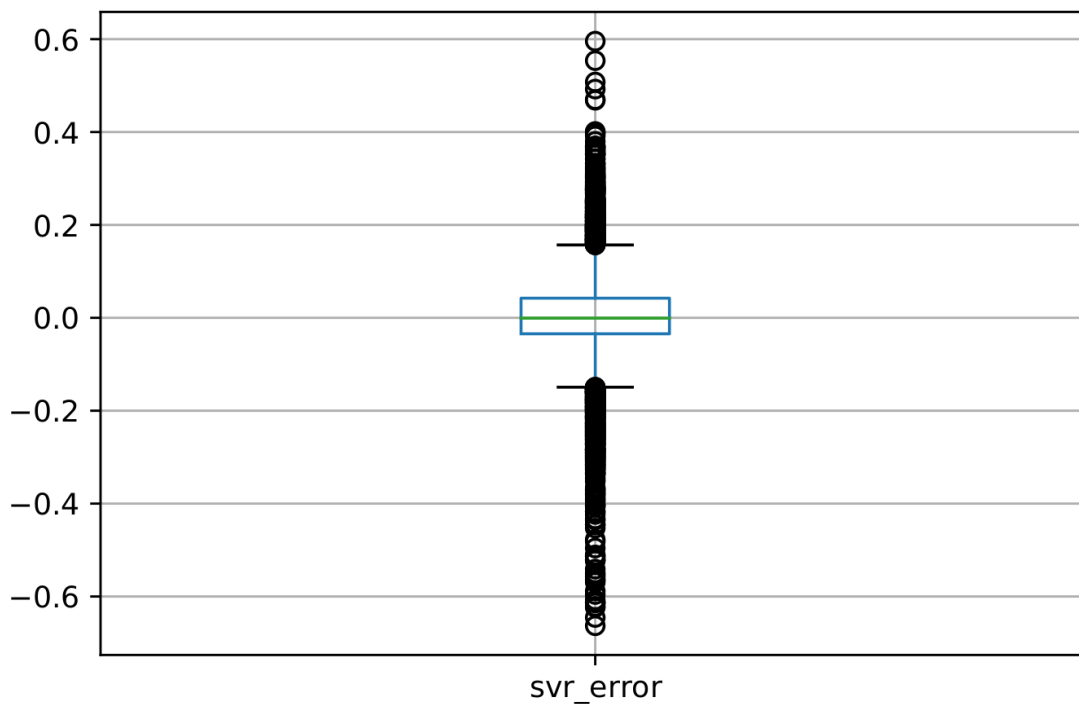


Figura 5.6: Errores del modelo SVR medidos como valores predcidos menos valores reales del perceptrón multicapa.

En la figura 5.6 vemos un diagrama de caja de los errores del modelo SVR prediciendo sobre las predicciones eólicas de 2018. El gráfico es, a simple vista, idéntico al del perceptrón multicapa, lo que nos hace pensar que no solo obtienen una media de error muy parecida, sino que también cometen los mismos errores. A continuación profundizaremos sobre esta idea, y compararemos las predicciones

de unos modelos y otros en distintos escenarios, como parte del análisis del modelo de ensemble.

5.4. Stacking

Para el modelo stacking hemos utilizado la función *stackingRegressor* del módulo *ensemble* de la librería *sklearn*. Los modelos que utilizaremos como modelos de regresión de nivel 0 son los vistos hasta ahora: el modelo Ridge, el perceptrón multicapa y la SVR. Para cada uno de estos utilizaremos los parámetros que ya calculamos haciendo la validación cruzada de cada uno, y como modelo de regresión de nivel 1 utilizamos una regresión lineal.

Para el modelo de regresión de nivel 1, hemos probado un modelo Ridge, un perceptrón multicapa y una regresión lineal, pero obteniendo siempre los mismos resultados. Por lo tanto, al ser el modelo lineal el más simple y rápido, es el que hemos empleado para mostrar los resultados en esta memoria. El error absoluto medio que ha obtenido es 6,52 %, y el estadístico R^2 es 70,97 %. En la tabla 5.3 podemos comparar los resultados de todos los modelos.

Modelos	Ridge	MLP	SVR	Stacking
MAE	8,66 %	6,5 %	6,35 %	6,52 %
R^2	46,8 %	71,31 %	72,7 %	70,97 %

Tabla 5.3: Resultados de la validación cruzada para el modelo Ridge sobre el parámetro α .

Dadas las diferencias tan poco significativas que obtenemos entre los errores del perceptrón multicapa (MLP), la SVR y el modelo stacking, concluimos que los tres modelos empatan. Esto indica que, sobre estos datos, el perceptrón multicapa y la SVR son modelos equivalentes, y por lo tanto el modelo stacking no es capaz de compensar los errores de uno con mejores predicciones del otro modelo.

Estudiando la distribución del error absoluto de cada modelo individual, vemos que el día de mayor error de los tres modelos es el mismo: el 4 de abril de 2018. Este es un día con una producción relativamente alta (alrededor de un 70 % de la producción máxima) que súbitamente se interrumpe y hay varias horas de producción nula, para luego volver a producir a una tasa bastante cercana a la inicial.

En la gráfica 5.7 vemos la energía obtenida ese día y la que predice cada modelo. Podemos observar claramente que ninguno de los cuatro modelos es capaz de predecir la producción nula. Vemos también que la gráfica del modelo stacking está siempre muy cerca de las gráficas del perceptrón y de la SVR.

En la figura 5.8 vemos los errores de todos los modelos en valor absoluto el día 4 de abril de 2018.

¿Por qué no se ha utilizado el menor error del modelo Ridge en el periodo de producción nula para disminuir el error del modelo stacking?

Por lo que vemos en la gráfica, y teniendo en mente que el error absoluto medio del modelo Ridge es mucho mayor que el de los demás modelos, intuimos que el modelo Ridge, aunque obtiene un error ligeramente menor en el periodo de producción nula, obtiene peores predicciones en general. De esta manera, el modelo stacking obtiene menor error si apenas da peso al modelo Ridge y se basa únicamente en la SVR y en el perceptrón. Dar mayor peso al modelo Ridge obtendría un error ligeramente menor en la sección de producción nula, pero globalmente el modelo empeoraría.

Aún se podría pensar que el mejor modelo sería aquel que diese más peso al modelo Ridge únicamente en el periodo de producción nula. Sin embargo, vemos que ninguno de los modelos es capaz de anticipar cuándo va a haber un periodo de producción nula, por lo tanto un modelo semejante queda más allá de nuestras posibilidades.

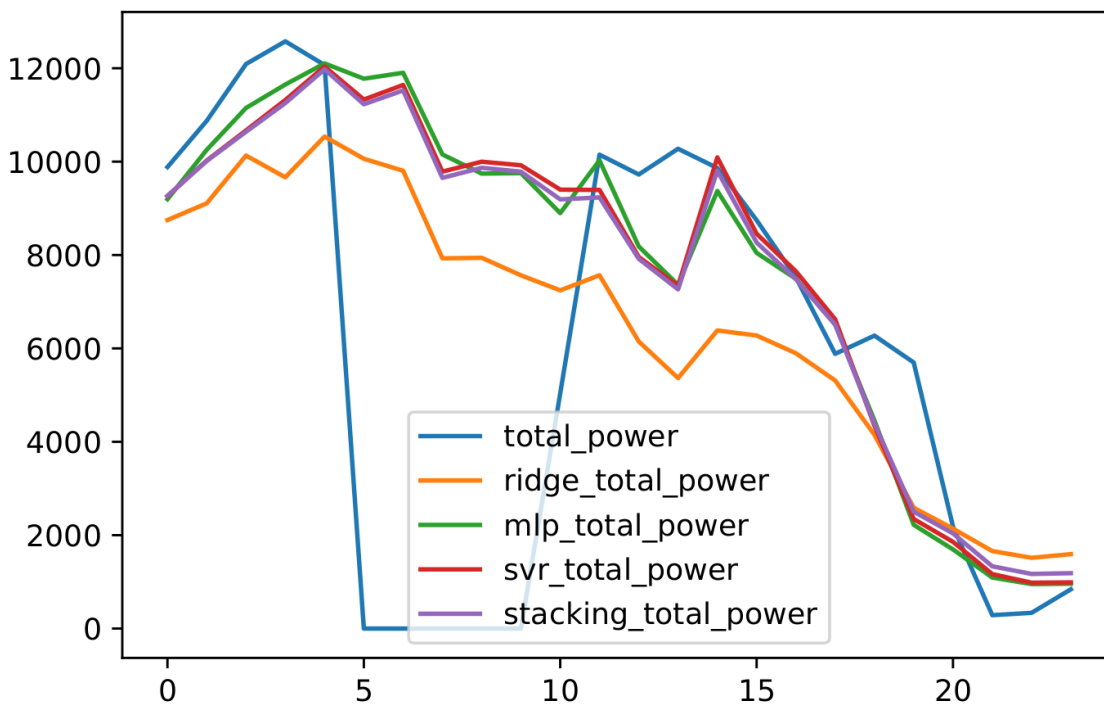


Figura 5.7: Predicción de energía de cada modelo el día 4 de abril de 2018 y producción real.

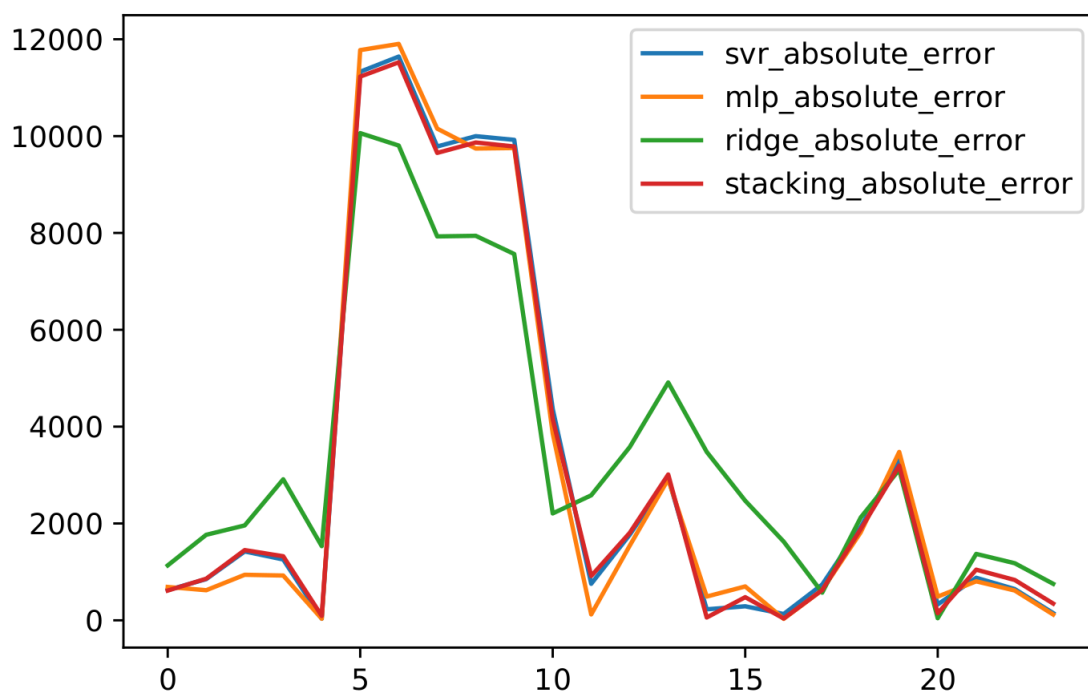


Figura 5.8: Errores de predicción de todos los modelos en valor absoluto para el día 4 de abril de 2018.

CONCLUSIONES Y TRABAJO FUTURO

Nos encontramos ante unos datos en los que es muy difícil mejorar un error de entorno al 6,5 % entrenando sobre 2016 y 2017 y prediciendo sobre 2018. Gran parte de este error parece deberse a periodos de producción nula que nuestros modelos no han sido capaces de predecir. A partir de estos resultados, una de las conclusiones que podríamos obtener sería que los periodos de predicción nula no dependiesen de las predicciones meteorológicas, sino que tuviesen una causa ajena, haciendo que para nosotros resultase un fenómeno aleatorio.

Respecto al comportamiento general del modelo stacking, a la vista de los resultados, parece que el modelo se basa principalmente en las predicciones del perceptrón multicapa y la SVR, dando menor peso al modelo Ridge. Consideramos que el error del modelo stacking es el mismo que obteníamos para el perceptrón y para la SVR.

Al ser tan similares la SVR y el perceptrón, no se puede distinguir una diferencia clara entre el comportamiento del stacking y de estos dos modelos. Hay un empate entre la SVR y el perceptrón, por lo que no se pueden compensar los errores de uno con mejores predicciones del otro, ya que estas son esencialmente las mismas.

Sería interesante, como trabajo futuro, construir un modelo stacking compuesto de modelos de naturaleza muy diferente, como por ejemplo, una SVR y un árbol de regresión, buscando así pueda haber una disparidad más significativa entre las predicciones de ambos, y pueda darse así una compensación de los errores.

También sería de gran utilidad aumentar el espacio de datos para incluir alguna variable a partir de la cual puedan predecirse algunas de las secciones de producción nula de energía. Quizá esto no sea posible, pues desconocemos el motivo de estos periodos de inactividad de los molinos eólicos. Sin embargo, incorporar periodos de mantenimiento planificado, por ejemplo, podría tener un impacto positivo quizá bastante significativo.

BIBLIOGRAFÍA

- [1] C. M. A. y J. R. D. Carlos Ruiz, "Multitask support vector regression for solar and wind energy prediction," *Energies*, p. 8, 2020. Leer.
- [2] G. Tyrallis, Hristos y A. Papacharalampous, "Boosting algorithms in energy research: A systematic review," p. 8, 2020. Descargar.
- [3] N. N. G. P. A. P. L. S. A. S.-S. S. y H.-M. C. Dorado-Moreno, M., "Multi-task learning for the prediction of wind power ramp events with deep neural networks," p. 8, 2020. Descargar.
- [4] T. H. y R. T. Daniela Witten, Gareth James, *An introduction to statistical learning with applications in R*. Springer Texts in Statistics, eighth ed., 2017.
- [5] R. O. D. y D. G. S. Peter E. Hart, *Pattern classification*. John Wiley Sons Inc, second ed., 2000.
- [6] A. J. S. y Bernhard Schölkopf, "A tutorial on support vector regression *," *Statistics and computing*, p. 8, Received 2002 and accepted 2003. Descargar.
- [7] B. E. y Trevor Hastie, *Computer Age Statistical Inference*. Cambridge University Press, first ed., 2016.
- [8] D. H. Wolpert, "Stacked generalization," *ResearchGate*, p. 8, 1992. Leer o descargar.

UAM

UNIVERSIDAD AUTONOMA

DE MADRID