



郑州大学学报(工学版)

Journal of Zhengzhou University(Engineering Science)

ISSN 1671-6833,CN 41-1339/T

《郑州大学学报(工学版)》网络首发论文

题目: 基于动态融合注意力机制的电力负荷缺失数据填充模型
作者: 赵冬, 李亚瑞, 王文相, 宋伟
DOI: 10.13705/j.issn.1671-6833.2024.05.004
收稿日期: 2024-02-08
网络首发日期: 2024-05-21
引用格式: 赵冬, 李亚瑞, 王文相, 宋伟. 基于动态融合注意力机制的电力负荷缺失数据填充模型[J/OL]. 郑州大学学报(工学版).
<https://doi.org/10.13705/j.issn.1671-6833.2024.05.004>



网络首发: 在编辑部工作流程中, 稿件从录用到出版要经历录用定稿、排版定稿、整期汇编定稿等阶段。录用定稿指内容已经确定, 且通过同行评议、主编终审同意刊用的稿件。排版定稿指录用定稿按照期刊特定版式(包括网络呈现版式)排版后的稿件, 可暂不确定出版年、卷、期和页码。整期汇编定稿指出版年、卷、期、页码均已确定的印刷或数字出版的整期汇编稿件。录用定稿网络首发稿件内容必须符合《出版管理条例》和《期刊出版管理规定》的有关规定; 学术研究成果具有创新性、科学性和先进性, 符合编辑部对刊文的录用要求, 不存在学术不端行为及其他侵权行为; 稿件内容应基本符合国家有关书刊编辑、出版的技术标准, 正确使用和统一规范语言文字、符号、数字、外文字母、法定计量单位及地图标注等。为确保录用定稿网络首发的严肃性, 录用定稿一经发布, 不得修改论文题目、作者、机构名称和学术内容, 只可基于编辑规范进行少量文字的修改。

出版确认: 纸质期刊编辑部通过与《中国学术期刊(光盘版)》电子杂志社有限公司签约, 在《中国学术期刊(网络版)》出版传播平台上创办与纸质期刊内容一致的网络版, 以单篇或整期出版形式, 在印刷出版之前刊发论文的录用定稿、排版定稿、整期汇编定稿。因为《中国学术期刊(网络版)》是国家新闻出版广电总局批准的网络连续型出版物(ISSN 2096-4188, CN 11-6037/Z), 所以签约期刊的网络版上网络首发论文视为正式出版。

基于动态融合注意力机制的电力负荷缺失数据填充模型

赵冬¹, 李亚瑞², 王文相³, 宋伟⁴

(1. 中原工学院 软件学院, 河南 郑州 450007; 2. 中原工学院 计算机学院, 河南 郑州 451191; 3. 许昌许继软件技术有限公司, 河南 许昌 461000; 4. 郑州大学 计算机与人工智能学院, 河南 郑州 450001)

摘要: 为了提高电力负荷数据的缺失值填充精度, 保障后续数据分析与应用的高效进行, 提出一种基于动态融合注意力机制的填充模型 DFAIM。该模型由注意力机制模块和动态加权融合模块构成, 通过注意力机制模块的 2 种不同注意力机制挖掘特征与时间戳之间的深层关联; 通过动态加权融合模块将可学习的权重赋予注意力机制模块的 2 个输出以得到特征表示; 最后, 利用特征表示来替换缺失位置的值, 从而得到准确的填充结果。使用纽约市某地区的气象及负荷数据集及 UCI 电力负荷数据集对提出的模型进行验证, 实验结果表明: 相较于统计学、机器学习和深度学习填充模型, DFAIM 在评价指标 MAE、RMSE 和 MRE 上均具有一定优势。

关键词: 缺失值填充; 注意力机制; 电力负荷; 时序特征

中图分类号: TP183 **文献标志码:** A **doi:** 10.13705/j.issn.1671-6833.2024.05.004

大数据时代, 电力系统数据呈现出多源异构的特点, 电力负荷数据量也在不断增加。然而由于采集设备故障、极端天气等原因, 负荷数据会出现不同程度的缺失, 使得可用信息减少、数据结构关联被破坏, 给电力负荷特性分析及变化规律研究带来了极大的挑战^[1]。对缺失的负荷数据进行较高精度地填充不仅是负荷数据分析与研究的基础, 而且对提升负荷预测效果以保障电力系统能够安全稳定地运行具有重要意义。

缺失数据填充是根据观测数据对缺失数据进行估计^[2], 目前缺失值填充的方法主要分为 3 类: ①基于统计学习的填充方法; ②基于传统机器学习的方法; ③基于深度学习的方法。

基于统计学习进行填充通常采用均值填充、前值填充、众数填充、热卡填充以及冷卡填充等方法^[3], 此类方法直接对负荷数据进行拟合, 未考虑负荷数据的时序特征以及相关性, 使得填充的误差较大。基于传统机器学习的填充方法主要有基于线性回归 (linear regression) 算法、基于 K 最近邻 KNN (K-nearest neighbors) 算法以及支持向量机 SVM

(support vector machine) 等方法。Malarvizhi^[4] 将 KNN 用于缺失值填充, 其会选择距离缺失数据最近的 k 个样本来填充, 相比 k -Means 聚类方法, 填充精度有所提升, 但是该方法每填充一次就需要对所有样本进行一次遍历, 十分耗时。Smola 等^[5] 提出了一种基于 SVM 的缺失值填充方法, 其填充缺失数据的过程中采用了时间信息。随着电网环境越来越复杂, 负荷变化呈现出较强的随机性、非线性^[6] 与条件性^[7] 等特点, 传统的机器学习方法难以进行较高精度的缺失值填充。

近年来, 基于深度学习的方法被广泛应用于缺失值填充领域, Cao 等^[8] 提出了基于双向循环神经网络的缺失值填充模型, 使用估计值作为循环神经网络图的变量, 能处理多个相关缺失值, 相较于机器学习模型能够提升数据填充精度, 但其本质是自回归模型, 容易因为误差累积导致填充精度降低。目前基于 Transformer^[9] 的模型多个领域被广泛使用, 其核心就是自注意力机制。Du 等^[10] 将自注意力机制应用于时间序列缺失值填充任务, 提出了 SAITS (self-attention-based imputation for time series) 模型,

收稿日期: 2024-02-08; 修订日期: 2024-04-16

基金项目: 国家重点研发计划项目 (2023YFC2206400); 国家高能物理科学数据中心开放课题 (HT-HEPS-T7-01050200-21-0008); 河南省高等学校重点科研项目 (22A520010)

作者简介: 赵冬 (1976—), 女, 河南郑州人, 中原工学院副教授, 主要从事数据挖掘与机器学习研究, E-mail: 5771@zut.edu.cn。

其使用 2 个对角掩码自注意力模块的加权组合进行缺失值填充,相较于其他填充模型提高了数据的填充精度和速度,但是该方法忽略了电力负荷的条件性,对于多维数据间相关性以及时序特征的捕获能力仍有待提升^[11]。

针对以上问题,本文提出了一种基于动态融合注意力机制的填充模型(dynamic fusion of attention mechanism imputation model, DFAIM)用于负荷缺失数据填充,相较于其他模型,所提模型填充精度更高。本文贡献点如下。

(1)以负荷缺失数据填充为应用背景,构建了动态融合注意机制的填充模型来捕获多维数据间的深层联系,达到更精确的填充效果。

(2)使用了 2 种不同的缺失值填充实验方法,对 2 种不同类型的数据集进行实验,更全面地验证了本模型的效果。

(3)考虑了影响负荷值的主要因素即气象因素,选择了开源的纽约市气象与负荷数据进行处理后作为本文实验数据集之一。

1 方法

1.1 问题定义

电力负荷数据是由多个特征组成的多变量时间序列,本文用矩阵 $\mathbf{X} \in \mathbf{R}^{T \times F}$ 表示负荷数据,如式(1)所示。

$$\mathbf{X} = [\mathbf{X}^1, \mathbf{X}^2, \dots, \mathbf{X}^{F-1}, \mathbf{X}^F] = \begin{bmatrix} X_1^1 & X_1^2 & \dots & X_1^{F-1} & X_1^F \\ X_2^1 & X_2^2 & \dots & X_2^{F-1} & X_2^F \\ \vdots & \vdots & & \vdots & \vdots \\ X_t^1 & X_t^2 & \dots & X_t^{F-1} & X_t^F \\ \vdots & \vdots & & \vdots & \vdots \\ X_{T-1}^1 & X_{T-1}^2 & \dots & X_{T-1}^{F-1} & X_{T-1}^F \\ X_T^1 & X_T^2 & \dots & X_T^{F-1} & X_T^F \end{bmatrix} \quad (1)$$

式中: T 为时间戳的数量; F 为电力负荷数据特征的维度; X^1, X^2, \dots, X^F 为所有时刻的负荷、温度、降水量等值。

为了更好地标记预处理后的电力负荷数据中缺失值所在位置,本文引入了掩码矩阵 \mathbf{M} ,其中第 t 个时间戳的第 f 个特征的掩码值 M_t^f 的计算公式为

$$M_t^f = \begin{cases} 1, & M_t^f \neq \text{空值}; \\ 0, & M_t^f = \text{空值}. \end{cases} \quad (2)$$

本文目的是通过使用 \mathbf{X} 和 \mathbf{M} 进行训练,得到一个填充模型,从而实现将原始缺失数据 \mathbf{X} 填充为完

整数据 \mathbf{X}_{imp} ,如式(3)所示。

$$\{\mathbf{X}, \mathbf{M}\} \xrightarrow{\text{填充模型}} \mathbf{X}_{\text{imp}} \quad (3)$$

1.2 2 种实验方法

对于不同类型数据集,本文在进行缺失值填充实验时,采用了以下 2 种方法。

方法 1:使用完整的数据集进行实验^[12]。将数据集以一定比例模拟自然缺失,通过掩码矩阵对模拟缺失的位置进行标记,然后使用填充模型对数据进行填充。由于该方法原始数据集是完整的,因此可以使用真值直接评价模型填充效果。

方法 2:使用存在缺失数据的数据集进行实验。由于原始数据存在缺失导致无法直接评价模型填充效果,因此需要通过比较人为缺失数据的模型填充精度高低或者比较填充前后的数据对下游预测精度的影响来进行间接评价^[13]。缺失值填充实验的 2 种方法如图 1 所示。

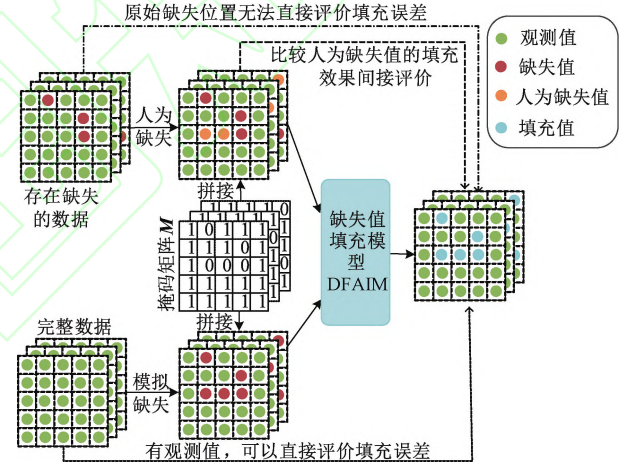


图 1 2 种缺失值填充实验方法

Figure 1 Two experimental methods for missing values imputation

2 模型设计

本文旨在通过对负荷数据以及相关数据的挖掘,实现缺失数据的准确填充。所提动态融合注意力机制的填充模型 DFAIM 如图 2 所示。

模型共包括以下 2 个模块:

(1)注意力机制模块(attention mechanism module, AMM)。该模块由自注意力机制块(self-attention mechanism block, SAB)和多维注意力机制块(multi-dim attention mechanism block, MDAB)构成。数据预处理后得到的 \mathbf{X} 和 \mathbf{M} 矩阵通过 SAB 捕获负荷数据时间步之间的潜在关联,通过 MDAB 获取到不同时间步与不同特征之间的关联,生成更加准确的特征表示 $\tilde{\mathbf{X}}_1$ 和 $\tilde{\mathbf{X}}_2$ 。

(2) 动态加权融合模块(dynamic weighted fusion module, DWFM)。该模块使用可学习的参数 γ 对 AMM 的输出 \tilde{X}_1 和 \tilde{X}_2 赋予不同权重,动态融合得到特征表示 \tilde{X}_3 ,再对 \tilde{X}_3 进行非缺失位置值替换得到最终的填充值 X_{imp} 。

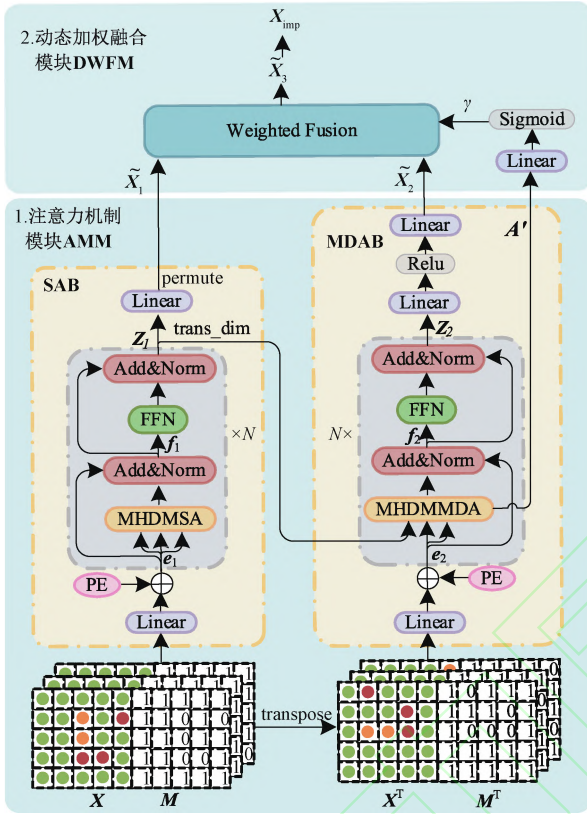


图 2 DFAIM 结构图

Figure 2 Structure diagram of DFAIM

2.1 注意力机制模块 AMM

该模块使用了 2 种不同注意力机制,分别为自注意力机制和多维注意力机制。

2.1.1 自注意力机制块 SAB

SAB 的核心是自注意力机制,将其应用于负荷缺失值填充,可以用来获取不同时间步之间的相关性^[14],该块的具体结构如下。

(1) 线性映射与位置编码层。将 X 和 M 进行拼接后经过线性层映射到 d_{model} 维度。然后进行位置编码(position embedding, PE)得到特征矩阵 e_1 。PE 和 e_1 分别由式(4)、式(5)得到。

$$\begin{cases} PE(p, 2i) = \sin(p/1000^{2i/d_{model}}); \\ PE(p, 2i+1) = \cos(p/1000^{2i/d_{model}}). \end{cases} \quad (4)$$

$$e_1 = \text{Linear}(\text{Concat}(X, M)) + PE(p, i). \quad (5)$$

式中: p 为元素位置索引, $2i$ 为偶数维度, $2i+1$ 表示奇数维度, $PE(p, 2i)$ 为位置编码向量的维度。

(2) 多头对角掩码自注意力层。首先,将矩阵

e_1 通过不同的线性变换得到 Q_i , 键矩阵 K_i 以及值矩阵 V_i , 如式(6)所示:

$$\begin{cases} Q_i = e_1 W_i^Q; \\ K_i = e_1 W_i^K; \\ V_i = e_1 W_i^V. \end{cases} \quad (6)$$

式中: W_i^Q 、 W_i^K 、 W_i^V 为模型需要学习的参数矩阵。

之后,需要在自注意力基础上添加对角掩码,保证填充时估计值只来自于其他时刻值或其他特征值,防止数据自身对其估计做出贡献^[15]。对角掩码自注意力机制(diagonal masked self-attention mechanism, DMSA)计算公式如式(7)所示。

$$\begin{cases} [DM(A)](i, j) = \begin{cases} -\infty, & i = j \\ A(i, j), & i \neq j \end{cases}; \\ DMSA(Q_i, K_i, V_i) = \text{Softmax}\left(\text{DM}\left(\frac{Q_i \cdot K_i^T}{\sqrt{d_k}}\right)\right) \cdot V_i. \end{cases} \quad (7)$$

式中: $DM(A)$ 为对角掩码函数; A 为 Q_i 与 K_i^T 经过点积运算与缩放后得到的矩阵; i 和 j 分别为矩阵 A 的行索引和列索引; $DMSA(Q_i, K_i, V_i)$ 为对角掩码自注意力函数。

最后,使用多个注意力头以使模型能获得更为丰富的特征信息,将得到的多个注意力头所有输出进行融合得到 f_1 ,计算方法如式(8)所示。

$$\begin{cases} h_{1_i} = DMSA(Q_i, K_i, V_i); \\ f_1 = \text{MHDMSA}(e_1) = \text{concat}(h_{1_1}, h_{1_2}, \dots, h_{1_n}) \cdot W^*. \end{cases} \quad (8)$$

式中: $i \subseteq (1, n)$, n 为多头机制的头数; W^* 为可学习的参数矩阵; $\text{MHDMSA}(e_1)$ 为多头对角掩码自注意力函数。

(3) 前馈网络 FFN 层。该前馈网络由 2 个线性层和一个 Relu 激活函数构成。 f_1 通过 N 次的 FFN 得到特征表示 Z_1 , 如式(9)所示:

$$Z_1 = \{\text{FFN}(f_1) = \text{Linear}(\text{Relu}(\text{Linear}(f_1)))\}^N. \quad (9)$$

(4) 输出层。对经过线性层的 Z_1 进行第二、三维互换,得到特征表示 \tilde{X}_1 作为 SAB 的输出,如式(10)所示:

$$\tilde{X}_1 = \text{permute}(\text{Linear}(Z_1)). \quad (10)$$

2.1.2 多维注意力机制块 MDAB

MDAB 的核心是多维注意力机制,将其应用于负荷缺失值填充,可以用来获取不同特征与不同时间戳之间的联系,该块的具体结构如下。

(1) 线性映射与位置编码层。首先,将 X^T 和

M^T 进行拼接,之后通过线性映射并添加位置编码至维度得到特征矩阵 e_2 ,如式(11)所示:

$$e_2 = \text{Linear}(\text{concat}(X^T, M^T)) + \text{PE}(p, i). \quad (11)$$

(2)多头对角掩码多维注意力层。不同于自注意力机制的3个矩阵均由一个矩阵变换而来,多维注意力机制的查询矩阵 Q_f 和键矩阵 K_f 由 e_2 变换得到,值矩阵 V'_f 是由特征表示 Z_1 通过维度变化而来,3个矩阵计算方法如式(12)所示:

$$\begin{cases} V'_f = \text{trans_dim}(Z_1); \\ Q_f = e_2 W_f^Q; \\ K_f = e_2 W_f^K. \end{cases} \quad (12)$$

式中: W_f^Q 和 W_f^K 为模型需要学习的参数矩阵。

接下来,矩阵通过对角掩码多维注意力机制(diagonal masked multi-dim attention mechanism, DMMDA)层以学习特征与时间戳维度的深层关联,如式(13)所示:

$$\text{DMMDA}(Q_f, K_f, V'_f) = \text{Softmax}\left(\text{DM}\left(\frac{Q_f \cdot K_f^T}{\sqrt{d_k}}\right)\right) \cdot V'_f. \quad (13)$$

Q_f 和 K_f^T 进行了缩放点积运算,可以获取到特征维度的数据相关性, V'_f 包含了时间戳维度之间的潜在关联,所以 DMMDA 能够学习到特征维度与时间戳维度之间的潜在联系。

最后,通过多头机制获取到不同表示空间的多维潜在联系,将多头输出进行融合得到 f_2 ,如式(14)所示:

$$\begin{cases} h_{2_i} = \text{DMMDA}(Q_{f_i}, K_{f_i}, V'_{f_i}) = A'_i \cdot V'_{f_i}; \\ f_2 = \text{MHDMMDA}(e_2, Z_1); \\ = \text{concat}(h_{2_1}, h_{2_2}, \dots, h_{2_n}) \cdot W^m. \end{cases} \quad (14)$$

式中: $i \subseteq (1, n)$, n 为多头机制的头数; A'_i 为可学习的参数矩阵; $\text{MHDMMDA}(e_2, Z_1)$ 为多头对角掩码多维注意力函数。

(3)前馈网络 FFN 层。将 Z_2 通过 N 次由2个线性层和1个 Sigmoid 激活函数构成的 FFN 层,得到特征表示 Z_2 ,计算方式如式(15)所示:

$$Z_2 = \{\text{FFN}(f_2)\}^N. \quad (15)$$

(4)输出层。 Z_2 经过线性层、Relu 激活函数和

线性层得到 MDAB 的输出 \tilde{X}_2 ,计算方式如式(16)所示:

$$\tilde{X}_2 = \text{Linear}(\text{Relu}(\text{Linear}(Z_2)))。 \quad (16)$$

2.2 动态加权融合模块 DWFM

为提高模型的泛化能力,使模型能够根据负荷数据缺失率的变化动态调整权重,在对注意力机制模块得到的2个特征表示进行融合时,使用动态加权的方式。

首先将通过 MDAB 得到的可学习矩阵 A' 与矩阵 M^T 进行拼接,然后通过线性层进行降维,接下来通过 Sigmoid 函数得到动态权重 γ 。最后,将 γ 作为 \tilde{X}_2 的权重,将 $(1 - \gamma)$ 作为 \tilde{X}_1 的权重,加权融合得到 \tilde{X}_3 , γ 与 \tilde{X}_3 计算方式分别如式(17)、式(18)所示:

$$\gamma = \text{Sigmoid}(\text{Linear}(\text{concat}(A', M^T))) ; \quad (17)$$

$$\tilde{X}_3 = \gamma \cdot \tilde{X}_2 + (1 - \gamma) \cdot \tilde{X}_1. \quad (18)$$

最终的填充数据 X_{imp} 由 \tilde{X}_3 提供缺失位置的, X^T 提供原本的观测值,如式(19)所示:

$$X_{\text{imp}} = \text{permute}(M^T \cdot \tilde{X}_3 + (1 - M^T) \cdot X^T). \quad (19)$$

式中: $\text{permute}()$ 表示第二、三维互换操作,其目的是使 X_{imp} 的维度与输入 X 保持一致; \circ 为哈达玛积运算。

3 实验设置及结果分析

3.1 实验环境

本实验采用的编程语言为 python,版本为 3.8.0,在 Windows10 操作系统上搭建了基于 Pytorch 框架的编程环境,框架版本为 1.10.0,开发环境为 PyCharm11.0.15+10-b2 043.56 amd64,实验所用的处理器为英特尔 i5-12400F 2.50 GHz,显卡为英伟达 RTX3060,内存为 16 GB。

3.2 数据集与预处理

为了验证 DFAIM 对电力负荷缺失值填充精度的提升效果,使用了开源的 UCI 电力负荷数据集^[16],本文还考虑了气象因素,构建了纽约气象及负荷数据集作为实验数据集,并对2个数据集进行了预处理操作,具体操作如表1所示。

表1 数据集预处理

Table 1 Datasets preprocessing

数据集	是否完整	填充实验方法	总缺失率/%	引入缺失方式	特征缩放方式	特征维度	训练集	验证集	测试集	样本构建方法	窗口大小	样本总量	数据集样本划分
UCI 电力负荷数据集	是	方法1	0	模拟缺失	归一化	370	28个月	10个月	10个月	滑动	100	1 400	817/292/291
纽约气象及负荷数据集	否	方法2	22.78	人为缺失		11	32个月	11个月	10个月	窗口法	24	1 602	875/291/235

3.2.1 纽约气象及负荷数据集及预处理

使用开源的纽约市 2016 年 1 月 1 日至 2020 年 5 月 31 日共计 53 个月的负荷数据和气象数据,通过进行相关性分析以及显著性检验,最终选择了与其关联程度较大的 10 种气象数据。负荷与气象数据均以 1 h 为采样间隔,使用外连接的方式进行 2 种数据拼接,将得到的 38 472 条数据作为纽约气象负荷数据集。该数据集中含有缺失数据的记录为 8 764 条,每一属性的数据均存在不同程度缺失,最高缺失达 16.27%。为了消除不同量纲之间的影响,先对原数据进行 Min-Max 归一化处理,将其控制在 $[0,1]$ 内,归一化公式如式 (20) 所示:

$$\bar{X}_t^f = \frac{X_t^f - X^{f_{\min}}}{X^{f_{\max}} - X^{f_{\min}}}. \quad (20)$$

式中: $t \in (1, T)$; $f \in (1, F)$; $X^{f_{\max}}$ 和 $X^{f_{\min}}$ 分别表示同一特征维度下样本的最大值与最小值。

3.2.2 UCI 电力负荷数据集及预处理

该数据集包含从 370 个客户端收集的 2011 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日共计 48 个月的负荷数据。采样间隔为 15 min,并且没有缺失数据。

3.3 评价指标

本文使用平均绝对误差 MAE、均方根误差 RMSE、平均相对误差 MRE 这 3 个评价指标来评估不同模型对于电力负荷缺失数据的填充效果,计算方法如式 (21)~(23) 所示:

$$MAE = \frac{\sum_{t=1}^T \sum_{f=1}^F |(X - X_{\text{imp}}) \circ M_t^f|}{\sum_{t=1}^T \sum_{f=1}^F M_t^f}; \quad (21)$$

$$RMSE = \sqrt{\frac{\sum_{t=1}^T \sum_{f=1}^F ((X - X_{\text{imp}}) \circ M_t^f)^2}{\sum_{t=1}^T \sum_{f=1}^F M_t^f}}; \quad (22)$$

$$MAE = \frac{\sum_{t=1}^T \sum_{f=1}^F |(X - X_{\text{imp}}) \circ M_t^f|}{\sum_{t=1}^T \sum_{f=1}^F X \circ M_t^f}. \quad (23)$$

式中: \circ 为哈达玛积运算。

3.4 参数设置

本文在进行超参数的选择时使用了微软自动超参调优工具 NNI^[17] (neural network intelligence),其可通过定义的超参搜索空间和超参调优算法运行,并报告评价指标,从而更好地选择最佳超参组合。本文对 DFAIM 模型进行实验时使用随机搜索 (random search) 作为超参调优算法,该算法相比网格搜

索更加高效^[18],同时也能够保证模型的准确性。实验设置每个模型的 trial 为 200,即进行 200 次自动超参搜索,为了兼顾时间效率与模型的可解释性,除学习率 lr 外超参数范围均设定为离散值。对于纽约气象负荷数据集以及 UCI 电力负荷数据集,设置的超参搜索范围以及最终确定的模型超参数如表 2 所示。表 2 中, N 表示 2 个模块编码器的层数; d_{model} 表示特征矩阵的 e_1 和 e_2 维度; n 表示注意力头数; d 表示 V 的维度; d_{inner} 表示中间线性层的维度; $dropout$ 表示随机失活率; lr 表示模型参数的学习率,采用随机采样的方式进行学习率的选择。

表 2 DFAIM 在两个数据集上的超参数

数据集名	参数名	超参数设定范围	取值
纽约气象 负荷数据集	N	$[1, 2, 3, 4, 5, 6, 7, 8]$	8
	d_{model}	$[16, 32, 64, 128, 256, 512]$	128
	n	$[2, 4, 8, 16]$	8
	d	$[16, 32, 64, 128, 256, 512]$	16
	d_{inner}	$[32, 64, 128, 256, 512, 1024]$	128
	dropout	$[0, 0.1, 0.2, 0.3, 0.4, 0.5]$	0.1
UCI 电力 负荷数据集	lr	loguniform $[0.0001, 0.01]$	0.001 9
	N	$[1, 2, 3, 4, 5, 6, 7, 8]$	1
	d_{model}	$[32, 64, 128, 256, 512, 1024]$	1 024
	n	$[2, 4, 8, 16]$	2
	d	$[16, 32, 64, 128, 256, 512]$	512
	d_{inner}	$[32, 64, 128, 256, 512, 1024]$	64
	dropout	$[0, 0.1, 0.2, 0.3, 0.4, 0.5]$	0.1
	lr	loguniform $[0.0001, 0.01]$	0.000 3

3.5 对比实验

本文在模型选择上使用了 8 种基线模型,不仅考虑了传统简单的均值填充法 Mean 和前值填充法 Previous,还考虑了机器学习模型如线性回归模型与多层感知机模型,以及像 MRNN、BRITS 这样基于双向循环神经网络的深度神经网络,还对比了基于自注意力机制的 Transformer 模型和 SAITS 模型。下面是关于对比模型的介绍。

Mean: 均值填充法,使用缺失数据所在属性其余观测数据的平均值进行填充。

Previous: 前值填充法,使用缺失数据前一时间戳的值进行填充。

LR: 线性回归模型,作为一种基础回归算法,使用线(面)等模型对于现有相对线性的数据进行较小损失的拟合。

MLP: 多层感知机,在本实验中隐藏层的维度设置为 1 024。

MRNN: 基于循环神经网络的填充模型^[19],本实验中隐藏层的维度设置为 1 024,学习率设置

为 0.001。

BRITS:基于双向 RNN 来进行缺失值估算,将缺失值作为双向 RNN 图的变量参与到反向传播过程中,本实验隐藏层维度设置为 1 024,学习率设置为 0.001。

Transformer:本文将缺失值填充视为掩码预测任务,因此在实验时只使用了 Transformer 的编码器

部分,未使用解码器部分。

SAITS:基于自注意力机制进行缺失值填充的模型,相比于基于 RNN 的自回归模型,提高了填充精度,当前在时间序列填充任务上取得 SOTA 结果。

在 10%缺失率的情况下,本文所提 DFAIM 与其他模型的对比实验结果如表 3 所示。

表 3 对比实验结果

模型	纽约气象及负荷数据集			UCI 电力负荷数据集		
	MAE	RMSE	MRE	MAE	RMSE	MRE
Mean	0.816 1	0.940 5	0.894 9	5.591 2	6.010 7	3.727 3
Previous	0.402 6	0.589 4	0.494 7	2.830 9	3.092 9	1.518 0
LR	0.276 0	0.400 9	0.180 8	2.159 6	2.648 4	1.359 7
MLP	0.106 5	0.178 1	0.165 1	1.890 5	2.325 8	1.128 9
MRNN	0.059 3	0.082 4	0.095 3	1.177 3	1.812 2	0.630 6
BRITS	0.015 8	0.040 0	0.032 1	0.925 6	1.396 2	0.494 9
Transformers	0.020 2	0.043 4	0.041 0	0.813 7	1.224 0	0.435 8
SAITS	0.018 9	0.042 1	0.037 9	0.737 5	1.106 1	0.394 2
DFAIM (本文)	0.014 5	0.035 7	0.029 5	0.130 2	0.231 1	0.069 7

通过对表 3 数据进行对比分析,可以看出:

(1)本文所提 DFAIM 同其他模型相比,MAE、RMSE、MRE 值均有降低,取得了最佳填充效果。在其他填充方法中:传统统计方法 Mean 和 Previous 的填充效果最差,原因是其仅利用了缺失数据同维度的数据进行填充;简单机器学习模型 LR 和 MLP 表现较差,是由于其只能大致拟合数据整体变化;深度学习模型 MRNN、BRITS、Transformer 和 SAITS 表现较好,能够较为准确地拟合数据的细节变化,但是捕获数据间深层联系的效果欠佳。

(2)本文所提 DFAIM 在 UCI 电力负荷数据集上的填充精度提升十分明显,原因应该在于该数据集特征数量更多,不同维度数据之间的关联性更强,

DFAIM 模型的多维注意力机制块很好地捕获了多维数据之间的关联性。

3.6 不同缺失率实验

为了进一步验证模型的填充效果,本文还在纽约气象负荷数据集上进行了不同缺失率实验。通过在测试集引入 20%~90%缺失比例的自然缺失值,来验证不同缺失率下本模型的有效性,实验结果如图 3 所示。

从图 3 可以看出,随着缺失比例的上升,不同模型的 MAE、RMSE、MRE 值大致呈上升趋势,这表明随着数据缺失比例的上升,填充准确性呈下降趋势,与实际情况一致。DFAIM 在不同的缺失率下,都表现出更高的填充精度,实现了最佳效果。

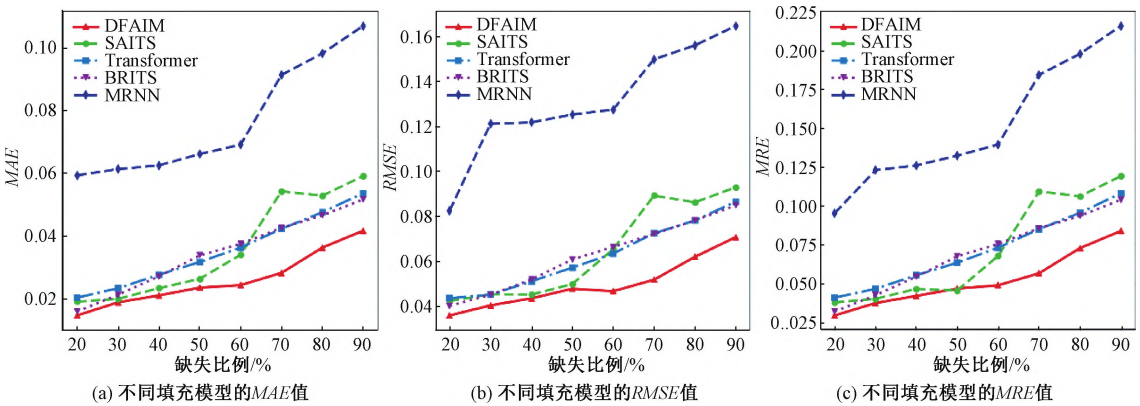


图 3 不同缺失率下模型的填充效果

Figure 3 Imputation results of models with different missing rates

3.7 消融实验

本文使用 2 个不同的注意力块以深入挖掘数据之间的潜在联系,使用了动态加权融合的方式以根据数据的不同缺失率来自适应地调整权重,因此消融实验重点要探究两个注意力机制块组合的有效性以及动态加权融合方式的有效性。本文在纽约气象及负荷数据集上进行了消融实验,描述如下。

Only SAB:仅使用自注意力机制块的特征表示。
Only MDAB:仅使用多维注意力机制块的特征表示。

AMM+EWFM:使用 SAB 与 MDAB2 个模块最终的特征表示,然后使用等权重融合模块(equal weight fusion module, EWFM)。

实验结果如表 4 所示。

表 4 消融实验结果

Table 4 Results of ablation experiment			
实验	MAE	RMSE	MRE
Only SAB	0.029 5	0.054 7	0.060 1
Only MDAB	0.020 2	0.046 1	0.0410
AMM+EWFM	0.019 2	0.041 6	0.039 2
DFAIM	0.014 5	0.035 7	0.029 5

通过对实验结果的对比分析,可以发现:
(1)Only SAB 的填充误差明显高于其他 3 个,说明仅使用自注意力机制能捕获浅层的数据关联,但无法捕获更深层的关联。
(2)AMM+EWFM 的填充误差低于 Only SAB 和 Only MDAB 的结果,说明增加多维注意力机制块能够捕获缺失值与其他时刻值或其他特征值之间更深层的关联,证明了两种注意力机制组合模块 AMM 挖掘数据潜在联系的能力。

(3)DFAIM 误差比 AMM+EWFM 进一步降低,说明动态加权融合的方式能够根据数据的缺失率学习到更优的权重,证明了动态加权融合模块 DWFM 对于填充精度提升的有效性。

4 结论

针对现有的负荷缺失值填充模型较难深入挖掘数据之间的潜在联系,导致总体填补精确度不高的问题,本文设计了动态融合注意力机制的填充模型,通过 SAB 与 MDAB 的组合来构建模型,能兼顾时间维度与特征维度之间的关联模式,从而更好地挖掘缺失数据特征间联系;通过动态加权的方式融合两个特征表示,能根据不同的缺失率自适应地调节权重,从而得到更高的填充精度。通过在两种数据集上与多个填充模型的对比,证明了 DFAIM 模型能够

进一步提升填充精度。并通过消融实验,证明了本文所提注意力机制模块及动态加权融合方式的有效性。通过不同缺失比例的实验,表明了 DFAIM 模型在不同缺失比例下均能取得较好结果,能够更好适应现实的不同数据缺失场景。

参考文献:

[1] 朱俊丞,杨之乐,郭媛君,等. 深度学习在电力负荷预测中的应用综述[J]. 郑州大学学报(工学版), 2019, 40(5): 13-22.
ZHU J C, YANG Z L, GUO Y J, et al. Deep learning applications in power system load forecasting: a survey [J]. Journal of Zhengzhou University (Engineering Science), 2019, 40(5): 13-22.
[2] SUO Q L, ZHONG W D, XUN G X, et al. GLIMA: global and local time series imputation with multi-directional attention learning [C] // 2020 IEEE International Conference on Big Data (Big Data). Piscataway: IEEE, 2020: 798-807.
[3] LIN W C, TSAI C F. Missing value imputation: a review and analysis of the literature (2006—2017) [J]. Artificial Intelligence Review, 2020, 53(2): 1487-1509.
[4] MALARVIZHI M R. K-NN classifier performs better than K-means clustering in missing value imputation [J]. IOSR Journal of Computer Engineering, 2012, 6(5): 12-15.
[5] SMOLA A J, VISHWANATHAN S V N, HOFMANN T. Kernel methods for missing variables[J]. Society for Artificial Intelligence and Statistics, 2005: 325-332.
[6] 徐岩, 张晓, 周兴华, 等. 基于 Prophet-LightGBM 的台区短期负荷预测方法[J/OL]. 华北电力大学学报(自然科学版), 2022: 1-7. (2022-12-06). <https://kns.cnki.net/kcms/detail/13.1212.TM.20221206.1229.003.html>.
XU Y, ZHANG X, ZHOU X H, et al. The short-term load forecasting method of transformer based on prophet-LightGBM [J/OL]. Journal of North China Electric Power University (Natural Science Edition), 2022: 1-7. (2022-12-06). <https://kns.cnki.net/kcms/detail/13.1212.TM.20221206.1229.003.html>.
[7] 张颖超, 成金杰, 邓华, 等. 基于相似日和特征提取的短期风电功率预测[J]. 郑州大学学报(工学版), 2020, 41(5): 44-49.
ZHANG Y C, CHENG J J, DENG H, et al. Short-term wind power prediction based on similar day and feature extraction[J]. Journal of Zhengzhou University (Engineering Science), 2020, 41(5): 44-49.
[8] CAO W, WANG D, LI J, et al. BRITS: bidirectional recurrent imputation for time series [C] // Proceedings of the

- 32nd International Conference on Neural Information Processing Systems. NewYork: ACM, 2018; 6776–6786.
- [9] VASWANI A, SHAZEER N, PARMAR N, et al. Attention is all you need[C]//Proceedings of the 31st International Conference on Neural Information Processing Systems. NewYork: ACM, 2017; 6000–6010.
- [10] DU W J, CÔTÉ D, LIU Y. SAITS: self-attention-based imputation for time series[J]. Expert Systems with Applications, 2023, 219: 119619.
- [11] 周远翔, 林孟龙, 陈健宁, 等. 基于自注意力生成对抗网络的电力设备在线监测缺失数据填补[J]. 高电压技术, 2023, 49(5): 1795–1809.
- ZHOU Y X, LIN M L, CHEN J N, et al. Missing data imputation for online monitoring of power equipment based on self-attention generative adversarial networks [J]. High Voltage Engineering, 2023, 49(5): 1795–1809.
- [12] JÄGER S, ALLHORN A, BIEBMAN F. A benchmark for data imputation methods[J]. Frontiers in Big Data, 2021, 4: 693674.
- [13] AHN H, SUN K, PIO KIM K. Comparison of missing data imputation methods in time series forecasting[J]. Computers, Materials & Continua, 2022, 70 (1): 767–779.
- [14] 马思远, 焦佳辉, 任晟岐, 等. 基于注意力机制的城市多元空气质量数据缺失值填充[J]. 计算机工程与科学, 2023, 45(8): 1354–1364.
- MA S Y, JIAO J H, REN S Q, et al. Missing value filling for multi-variable urban air quality data based on attention mechanism [J]. Computer Engineering & Science, 2023, 45(8): 1354–1364.
- [15] HAN K, WANG Y H, CHEN H T, et al. A survey on vision transformer[J]. IEEE Transactions on Pattern Analysis and Machine Intelligence, 2023, 45 (1): 87–110.
- [16] Trindade A. Electricity load diagrams 2011—2014 data set[EB/OL]. [2024-01-05]. https://archive.ics.uci.edu/ml/datasets/Electricity_Load_Diagrams20112014.
- [17] Microsoft. Neural network intelligence[EB/OL]. (2017-06-01) [2024-01-05]. <https://github.com/microsoft/nni>.
- [18] BERGSTRA J, BENGIO Y. Random search for hyper-parameter optimization [J]. Journal of Machine Learning Research, 2012, 13: 281–305.
- [19] YOON J, ZAME W R, VAN DER SCHAAR M. Estimating missing data in temporal data streams using multi-directional recurrent neural networks[J]. IEEE Transactions on Biomedical Engineering, 2019, 66 (5): 1477–1490.

Dynamic Fusion of Attention Mechanism Imputation Model for Missing Data of Power Load

ZHAO Dong¹, LI Yaru², WANG Wenxiang³, SONG Wei⁴

(1. School of Software, Zhongyuan University of Technology, Zhengzhou 450007, China; 2. School of Computer, Zhongyuan University of Technology, Zhengzhou 451191, China; 3. Xuchang Xuji Software Technology Co., Ltd., Xuchang 461000; 4. School of Computer and Artificial Intelligence, Zhengzhou University, Zhengzhou 450001, China)

Abstract: In order to improve the missing value imputation accuracy of power load data and guarantee the efficiency of subsequent data analysis and application, a imputation model based on Dynamic Fusion of Attention mechanism DFAIM (Dynamic Fusion of Attention mechanism Imputation Model) is proposed. The model consists of an attention mechanism module and a dynamic weighted fusion module, where the deep correlation between features and timestamps is mined through the two different attention mechanisms of the attention mechanism module, and feature representations are obtained by assigning learnable weights to the two outputs of the attention mechanism module through the dynamic weighted fusion module, and then replacing the values of the missing locations with the obtained feature representations to finally obtain the imputed values. The proposed model is validated using the meteorological and load dataset and the UCI electric load dataset for an area in New York City, and the experimental results show that DFAIM has certain advantages in evaluating metrics such as MAE, RMSE, and MRE compared to statistics, machine learning, and deep learning models imputation models.

Keywords: Missing data imputation; Attention mechanism; Power load; Time series features