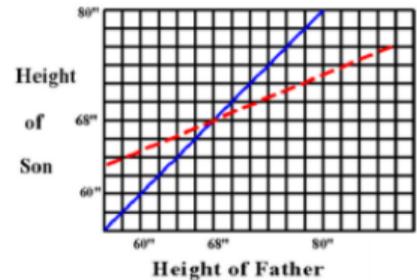
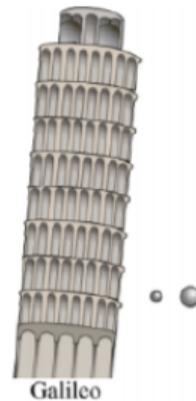


# **MODELACIÓN PREDICTIVA (CLASIFICACIÓN Y REGRESIÓN)**

ALAN REYES-FIGUEROA  
APRENDIZAJE ESTADÍSTICO

(AULA 20) 26.MARZO.2025

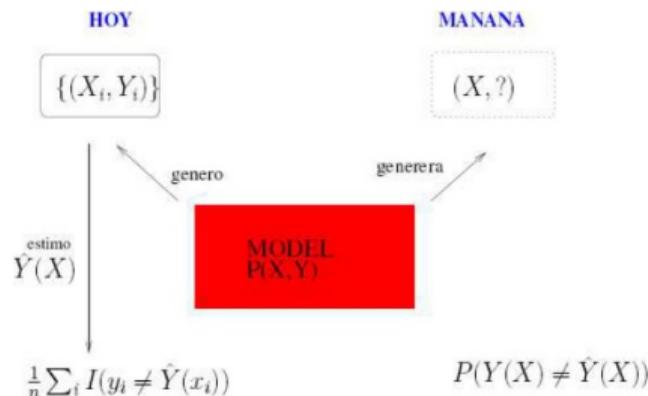
# Modelación Predictiva



Pensamiento ha cambiado con el paso del tiempo

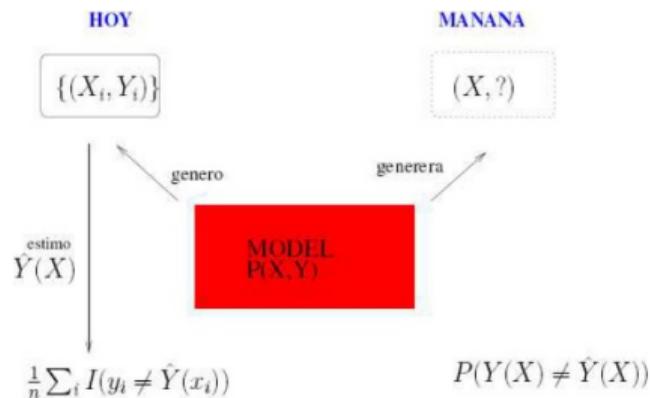
- en la antigüedad: Dioses y seres causantes del mundo
- Galileo: modelo descriptivo (separar causalidad de comportamiento)
- Hoy en día: regresión

# Modelación Predictiva



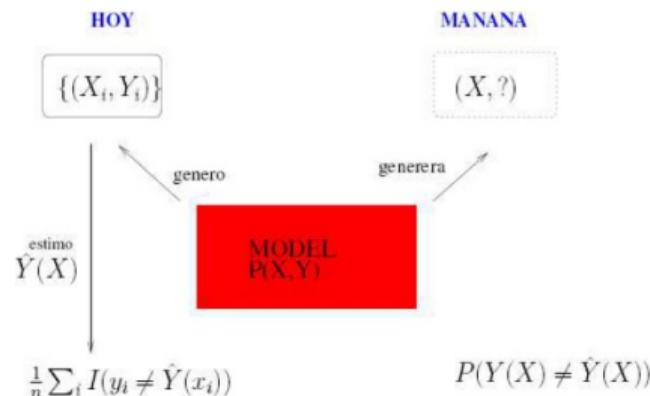
- Datos tienen dos componentes:  $(\mathbf{x}_i, y_i)$ ,  $\mathbf{x}_i$  son las variables “explicativas”,  $y_i$  variable de respuesta.
- Distinguimos dos casos:  $y_i \in \mathbb{R}$  ó  $\mathbf{y}_i \in \mathbb{R}^p \Rightarrow$  regresión,  
 $y_i \in \mathbb{N}$  ó  $y_i$  discreto  $\Rightarrow$  clasificación.
- Conectar presente con futuro: datos  $(\mathbf{x}_i, y_i)$  deben ser representativos.

# Modelación Predictiva



- Pragmático. Enfoque geométrico vs. enfoque probabilístico.
- Diferentes tipos de **error**: error empírico (error de entrenamiento), error de generalización (error de validación), error de prueba.
- Cada modelo tiene asociada una **complejidad**.

# Modelación Predictiva

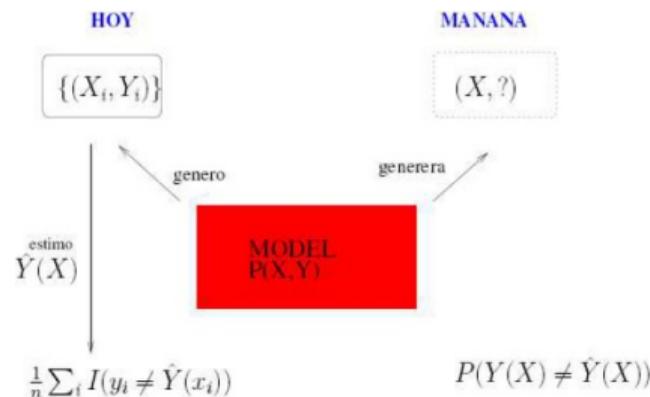


- ¿Es cierto que  $\frac{1}{n} \sum_i \mathbf{1}(y_i \neq \hat{y}_i)$  converge a  $\mathbb{P}(Y(X) \neq \hat{Y}(X))$ ?

La ley (débil) de grandes números dice que

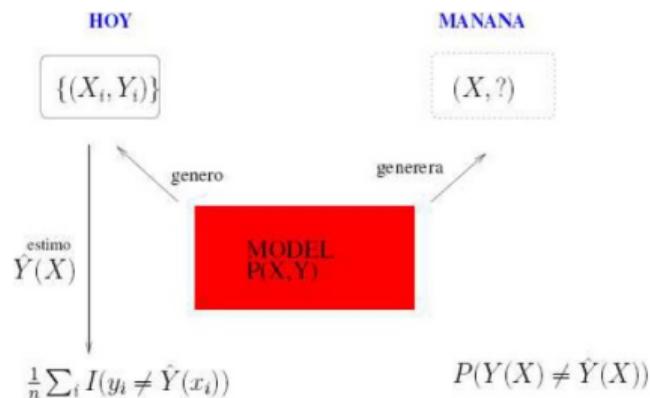
$$\lim_{n \rightarrow \infty} \frac{1}{n} \sum_i Z_i = \mathbb{E}(Z_i) = \mathbb{P}(Z_i = 1).$$

# Modelación Predictiva



- Veremos que en general, no.
- Otro problema con esta función de costo empírica es que no es continua, menos diferenciable.
- Si usas tu método de derivación favorito, no funciona.  
Pregunta: ¿cómo optimizar?

# Modelación Predictiva



- Aprendizaje automático: imitar el aprendizaje humano.
- Históricamente: aprender o estimar con pocos datos.
- Varios tipos de aprendizaje: supervised, *unsupervised*, *semi-supervised*, *self-learning*, *reinforced learning*, ...

# Modelación Predictiva

Tratamos de responder la pregunta

$$\frac{1}{n} \sum_i \underbrace{\mathbf{1}(y_i \neq \hat{y}(\mathbf{x}_i))}_{Z_i} \xrightarrow{n \rightarrow \infty} \mathbb{P}(Y(X) \neq \hat{Y}(X))?$$

Mencionamos que en el caso de variables aleatorias Bernoulli  $Z_i \sim \text{Ber}(p)$ , la ley de grandes números establece que

$$\frac{1}{n} \sum_i Z_i \xrightarrow{n \rightarrow \infty} \mathbb{E}(Z) = \mathbb{P}(Z = 1).$$

¿Vale en este caso?

No.

La ley de grandes número requiere independencia de las  $Z_i$ .

# Modelación Predictiva

En este caso, tenemos

$$\frac{1}{n} \sum_i \mathbf{1}(y_i \neq \hat{y}(\mathbf{x}_i)) \xrightarrow{n \rightarrow \infty} \mathbb{P}(Y(X) \neq \hat{Y}(X)),$$

donde la función  $\hat{y}$  depende de todos los datos  $(\mathbf{x}_i, y_i)$  (de modo que no hay independencia de las  $Z_i$ ). No aplica la ley de grandes números.

Solución ad hoc:

Separamos el conjunto  $(\mathbf{x}_i, y_i)$  en dos:

- Conjunto de entrenamiento: lo usamos para construir la función  $\hat{y}$ .
- Conjunto de validación: calculamos el error empírico  $\frac{1}{n} \sum_i \mathbf{1}(y_i = \hat{y}(\mathbf{x}_i))$ . Ahora sí hay independencia, y este error empírico de validación converge al error de generalización  $\mathbb{P}(Y = \hat{Y})$ .

# Modelación Predictiva

Discutimos el concepto de **complejidad** de un modelo. Este se refiere al número de parámetros involucrados en el modelo.

- en regresión: está claro, relacionado al número de variables
- en clasificación: no es tan evidente.

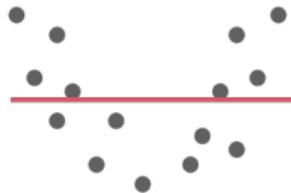
El concepto es importante por varias razones:

- Esto es lo que directamente va a afectar a los errores (empírico y de generalización).
- Nos va a permitir comparar diferentes modelos (en términos de simplicidad, no de exactitud).

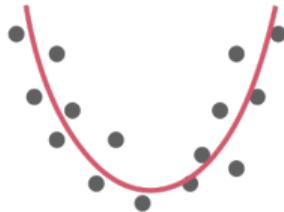
Veremos que existen diferentes métricas que miden la complejidad, y nos va a permitir una segunda opinión a la hora de elegir entre diferentes modelos con similar desempeño.

# Modelación Predictiva

*Regression*



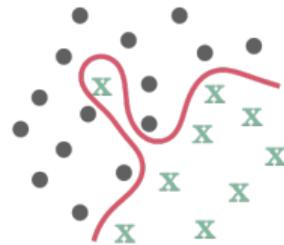
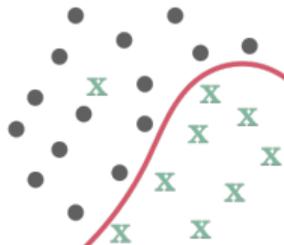
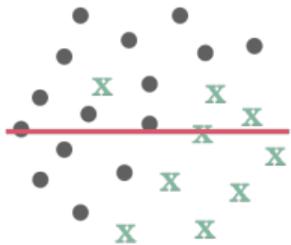
Underfitting



Desired



**Overfitting**



*Classification*