

Contrastes de hipótesis. Enfoque de Neyman-Pearson

Ricardo Alberich, Juan Gabriel Gomila y Arnau Mir

Enfoque de Neyman-Pearson

Introducción

- En esta presentación vamos a introducir los contrastes de hipótesis desde una perspectiva más amplia.

Introducción

- En esta presentación vamos a introducir los **contrastes de hipótesis** desde una perspectiva más amplia.
- Esta nueva perspectiva nos permitirá introducir la **clasificación** en **machine learning** y **detección en procesamiento de señales**.

Introducción

- En esta presentación vamos a introducir los **contrastes de hipótesis** desde una perspectiva más amplia.
- Esta nueva perspectiva nos permitirá introducir la **clasificación** en **machine learning** y **detección en procesamiento de señales**.
- Este nuevo enfoque se llama **enfoque de Neyman-Pearson**.

Distribuciones de las hipótesis nula y alternativa

- En los contrastes de hipótesis paramétricos introducidos durante el curso, nos concentramos en la hipótesis nula H_0 .

Distribuciones de las hipótesis nula y alternativa

- En los contrastes de hipótesis paramétricos introducidos durante el curso, nos concentramos en la hipótesis nula H_0 .
- Tanto si usamos los z-test como los t-test, en el cálculo del p-valor, se usaba la distribución suponiendo que la hipótesis nula H_0 es cierta.

Distribuciones de las hipótesis nula y alternativa

- Para fijar ideas, suponiendo que el contraste considerado era sobre la **media** μ , y el contraste era de la forma:

$$\left. \begin{array}{l} H_0 : \mu = \mu_0, \\ H_1 : \mu \neq (<, >) \mu_0, \end{array} \right\}$$

donde hemos considerados los tres casos de **hipótesis alternativa** H_1 , suponiendo que la **desviación típica** σ de la población es conocida, suponemos que la distribución del **estadístico de contraste** $Z = \frac{\bar{X} - \mu_0}{\frac{\sigma}{\sqrt{n}}}$ es una **normal estándar** o $N(0, 1)$ suponiendo que la **hipótesis nula** H_0 es cierta o que $\mu = \mu_0$

Distribuciones de las hipótesis nula y alternativa

- La suposición anterior es equivalente a suponer que la distribución de la **media muestral \bar{X}** es **normal** de **parámetros** $\mu_{\bar{X}} = \mu_0$ y $\sigma_{\bar{X}} = \frac{\sigma}{\sqrt{n}}$: $\bar{X} = N\left(\mu_0, \frac{\sigma}{\sqrt{n}}\right)$.

Distribuciones de las hipótesis nula y alternativa

- La suposición anterior es equivalente a suponer que la distribución de la **media muestral \bar{X}** es **normal** de **parámetros $\mu_{\bar{X}} = \mu_0$ y $\sigma_{\bar{X}} = \frac{\sigma}{\sqrt{n}}$** : $\bar{X} = N\left(\mu_0, \frac{\sigma}{\sqrt{n}}\right)$.
- Recordemos que para **aceptar** o **rechazar** la **hipótesis nula H_0** , comparamos el valor crítico $z_{\alpha}(H_1 : \mu < \mu_0)$, $z_{1-\alpha}(H_1 : \mu > \mu_0)$, $z_{1-\frac{\alpha}{2}}(H_1 : \mu \neq \mu_0)$ con el valor Z del **estadístico de contraste** y dependiendo de dicha comparación aceptamos o rechazamos la **hipótesis nula H_0** , siendo α el **nivel de significación**.

Distribuciones de las hipótesis nula y alternativa

- Concretamente,

Distribuciones de las hipótesis nula y alternativa

- Concretamente,
 - Si $H_1 : \mu < \mu_0$,

Distribuciones de las hipótesis nula y alternativa

- Concretamente,
 - Si $H_1 : \mu < \mu_0$,
 - si $Z < z_\alpha$, rechazamos H_0 y en caso contrario, aceptamos H_0 ,

Distribuciones de las hipótesis nula y alternativa

- Concretamente,
 - Si $H_1 : \mu < \mu_0$,
 - si $Z < z_\alpha$, rechazamos H_0 y en caso contrario, aceptamos H_0 ,
 - Si $H_1 : \mu > \mu_0$,

Distribuciones de las hipótesis nula y alternativa

- Concretamente,
 - Si $H_1 : \mu < \mu_0$,
 - si $Z < z_\alpha$, rechazamos H_0 y en caso contrario, aceptamos H_0 ,
 - Si $H_1 : \mu > \mu_0$,
 - si $Z > z_{1-\alpha}$, rechazamos H_0 y en caso contrario, aceptamos H_0 ,

Distribuciones de las hipótesis nula y alternativa

- Concretamente,
 - Si $H_1 : \mu < \mu_0$,
 - si $Z < z_\alpha$, rechazamos H_0 y en caso contrario, aceptamos H_0 ,
 - Si $H_1 : \mu > \mu_0$,
 - si $Z > z_{1-\alpha}$, rechazamos H_0 y en caso contrario, aceptamos H_0 ,
 - Si $H_1 : \mu \neq \mu_0$,

Distribuciones de las hipótesis nula y alternativa

- Concretamente,
 - Si $H_1 : \mu < \mu_0$,
 - si $Z < z_\alpha$, rechazamos H_0 y en caso contrario, aceptamos H_0 ,
 - Si $H_1 : \mu > \mu_0$,
 - si $Z > z_{1-\alpha}$, rechazamos H_0 y en caso contrario, aceptamos H_0 ,
 - Si $H_1 : \mu \neq \mu_0$,
 - si $|Z| > z_{1-\frac{\alpha}{2}}$, rechazamos H_0 y en caso contrario, aceptamos H_0 .

Distribuciones de las hipótesis nula y alternativa

- Concretamente,
 - Si $H_1 : \mu < \mu_0$,
 - si $Z < z_\alpha$, rechazamos H_0 y en caso contrario, aceptamos H_0 ,
 - Si $H_1 : \mu > \mu_0$,
 - si $Z > z_{1-\alpha}$, rechazamos H_0 y en caso contrario, aceptamos H_0 ,
 - Si $H_1 : \mu \neq \mu_0$,
 - si $|Z| > z_{1-\frac{\alpha}{2}}$, rechazamos H_0 y en caso contrario, aceptamos H_0 .
- Un aspecto importante del **contraste de hipótesis** es la **hipótesis alternativa** H_1 , donde si suponemos que es cierta, la distribución del **estadístico de contraste** Z o \bar{X} (dependiendo de cuál usemos) sería diferente.

Distribuciones de las hipótesis nula y alternativa

- Concretamente, si la hipótesis alternativa H_1 es cierta, la distribución del estadístico de contraste \bar{X} sería

$$\bar{X} = N\left(\mu, \frac{\sigma}{\sqrt{n}}\right) \text{ o } Z = \frac{\bar{X} - \mu_0}{\frac{\sigma}{\sqrt{n}}} = N\left(\frac{\mu - \mu_0}{\frac{\sigma}{\sqrt{n}}}, 1\right).$$

Distribuciones de las hipótesis nula y alternativa

- Concretamente, si la hipótesis alternativa H_1 es cierta, la distribución del estadístico de contraste \bar{X} sería

$$\bar{X} = N\left(\mu, \frac{\sigma}{\sqrt{n}}\right) \text{ o } Z = \frac{\bar{X} - \mu_0}{\frac{\sigma}{\sqrt{n}}} = N\left(\frac{\mu - \mu_0}{\frac{\sigma}{\sqrt{n}}}, 1\right).$$

- Para usar ambas distribuciones, definimos:

$$f_0(z) = f_Z(z|H_0), \quad f_1(z) = f_Z(z|H_1),$$

las funciones de densidad del estadístico de contraste suponiendo que H_0 es cierta ($f_0(z)$) o suponiendo que H_1 es cierta ($f_1(z)$).

Distribuciones de las hipótesis nula y alternativa

- Concretamente, si la hipótesis alternativa H_1 es cierta, la distribución del estadístico de contraste \bar{X} sería

$$\bar{X} = N\left(\mu, \frac{\sigma}{\sqrt{n}}\right) \text{ o } Z = \frac{\bar{X} - \mu_0}{\frac{\sigma}{\sqrt{n}}} = N\left(\frac{\mu - \mu_0}{\frac{\sigma}{\sqrt{n}}}, 1\right).$$

- Para usar ambas distribuciones, definimos:

$$f_0(z) = f_Z(z|H_0), \quad f_1(z) = f_Z(z|H_1),$$

las funciones de densidad del estadístico de contraste suponiendo que H_0 es cierta ($f_0(z)$) o suponiendo que H_1 es cierta ($f_1(z)$).

- En el primer caso o suponiendo que H_0 es cierta, $f_0(z)$ sería la función de densidad de una $N(0, 1)$ y en el segundo caso o suponiendo que H_1 es cierta, $f_1(z)$ sería la función de densidad de una $N\left(\frac{\mu - \mu_0}{\frac{\sigma}{\sqrt{n}}}, 1\right)$.

Distribuciones de las hipótesis nula y alternativa. Ejemplo

- Suponemos que nos planteamos el contraste de hipótesis siguiente:

$$\left. \begin{array}{l} H_0 : \mu = 2, \\ H_1 : \mu > 2, \end{array} \right\}$$

Distribuciones de las hipótesis nula y alternativa. Ejemplo

- Suponemos que nos planteamos el contraste de hipótesis siguiente:

$$\left. \begin{array}{l} H_0 : \mu = 2, \\ H_1 : \mu > 2, \end{array} \right\}$$

- En el gráfico siguiente hemos dibujado las **funciones de densidad** f_0 y f_1 . La curva azul es f_0 y la roja f_1 , donde hemos supuesto que $\mu = 2.5$ y $\sigma = 2$.

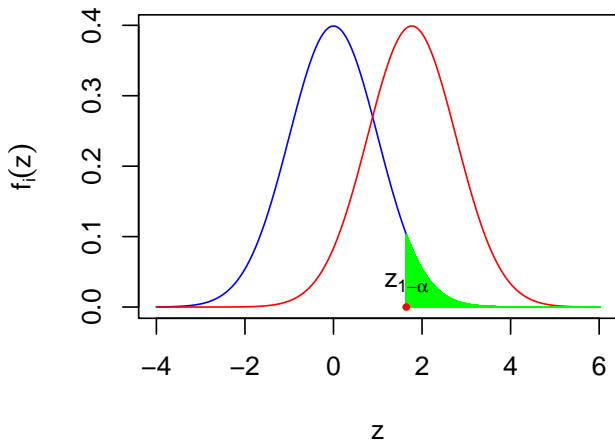
Distribuciones de las hipótesis nula y alternativa. Ejemplo

- Suponemos que nos planteamos el contraste de hipótesis siguiente:

$$\left. \begin{array}{l} H_0 : \mu = 2, \\ H_1 : \mu > 2, \end{array} \right\}$$

- En el gráfico siguiente hemos dibujado las **funciones de densidad** f_0 y f_1 . La curva azul es f_0 y la roja f_1 , donde hemos supuesto que $\mu = 2.5$ y $\sigma = 2$.
- **Rechazaremos la hipótesis nula H_0** si el valor del **estadístico de contraste Z** se encuentra en la zona verde, o $Z > z_{1-\alpha}$, donde hemos considerado un **nivel de significación $\alpha = 0.05$** , de donde $z_{0.95} = 1.645$.

Distribuciones de las hipótesis nula y alternativa. Ejemplo



Reglas de decisión

- Un **contraste de hipótesis**, se basa en una **regla de decisión** $\delta(\cdot)$ a partir de un **espacio de valores** \mathcal{Z} del **estadístico de contraste** Z .

Reglas de decisión

- Un **contraste de hipótesis**, se basa en una **regla de decisión** $\delta(\cdot)$ a partir de un **espacio de valores** \mathcal{Z} del **estadístico de contraste** Z .
- Concretamente, en un contraste de la **media** μ del tipo:

$$\left. \begin{array}{l} H_0 : \mu = \mu_0, \\ H_1 : \mu > \mu_0, \end{array} \right\}$$

como la del ejemplo anterior,

Reglas de decisión

- Un **contraste de hipótesis**, se basa en una **regla de decisión** $\delta(\cdot)$ a partir de un **espacio de valores** \mathcal{Z} del **estadístico de contraste** Z .
- Concretamente, en un contraste de la **media** μ del tipo:

$$\left. \begin{array}{l} H_0 : \mu = \mu_0, \\ H_1 : \mu > \mu_0, \end{array} \right\}$$

como la del ejemplo anterior,

- el **espacio de valores** \mathcal{Z} sería el **conjunto de números reales** \mathbb{R} ,

Reglas de decisión

- Un **contraste de hipótesis**, se basa en una **regla de decisión** $\delta(\cdot)$ a partir de un **espacio de valores** \mathcal{Z} del **estadístico de contraste** Z .
- Concretamente, en un contraste de la **media** μ del tipo:

$$\left. \begin{array}{l} H_0 : \mu = \mu_0, \\ H_1 : \mu > \mu_0, \end{array} \right\}$$

como la del ejemplo anterior,

- el **espacio de valores** \mathcal{Z} sería el **conjunto de números reales** \mathbb{R} ,
- el **estadístico de contraste** Z sería $Z = \frac{\bar{X} - \mu_0}{\frac{\sigma}{\sqrt{n}}}$ (suponemos σ conocida) y

Reglas de decisión

- Un **contraste de hipótesis**, se basa en una **regla de decisión** $\delta(\cdot)$ a partir de un **espacio de valores** \mathcal{Z} del **estadístico de contraste** Z .
- Concretamente, en un contraste de la **media** μ del tipo:

$$\left. \begin{array}{l} H_0 : \mu = \mu_0, \\ H_1 : \mu > \mu_0, \end{array} \right\}$$

como la del ejemplo anterior,

- el **espacio de valores** \mathcal{Z} sería el **conjunto de números reales** \mathbb{R} ,
- el **estadístico de contraste** Z sería $Z = \frac{\bar{X} - \mu_0}{\frac{\sigma}{\sqrt{n}}}$ (suponemos σ conocida) y
- la **regla de decisión** $\delta(z, \alpha)$ que depende del valor del **estadístico de contraste** y del **nivel de significación** α sería:

Reglas de decisión

- Un **contraste de hipótesis**, se basa en una **regla de decisión** $\delta(\cdot)$ a partir de un **espacio de valores** \mathcal{Z} del **estadístico de contraste** Z .
- Concretamente, en un contraste de la **media** μ del tipo:

$$\left. \begin{array}{l} H_0 : \mu = \mu_0, \\ H_1 : \mu > \mu_0, \end{array} \right\}$$

como la del ejemplo anterior,

- el **espacio de valores** \mathcal{Z} sería el **conjunto de números reales** \mathbb{R} ,
- el **estadístico de contraste** Z sería $Z = \frac{\bar{X} - \mu_0}{\frac{\sigma}{\sqrt{n}}}$ (suponemos σ conocida) y
- la **regla de decisión** $\delta(z, \alpha)$ que depende del valor del **estadístico de contraste** y del **nivel de significación** α sería:
 - si $Z \geq z_{1-\alpha}$, **rechazamos la hipótesis nula** H_0 ,

Reglas de decisión

- Un **contraste de hipótesis**, se basa en una **regla de decisión** $\delta(\cdot)$ a partir de un **espacio de valores** \mathcal{Z} del **estadístico de contraste** Z .
- Concretamente, en un contraste de la **media** μ del tipo:

$$\left. \begin{array}{l} H_0 : \mu = \mu_0, \\ H_1 : \mu > \mu_0, \end{array} \right\}$$

como la del ejemplo anterior,

- el **espacio de valores** \mathcal{Z} sería el **conjunto de números reales** \mathbb{R} ,
- el **estadístico de contraste** Z sería $Z = \frac{\bar{X} - \mu_0}{\frac{\sigma}{\sqrt{n}}}$ (suponemos σ conocida) y
- la **regla de decisión** $\delta(z, \alpha)$ que depende del valor del **estadístico de contraste** y del **nivel de significación** α sería:
 - si $Z \geq z_{1-\alpha}$, **rechazamos la hipótesis nula** H_0 ,
 - si $Z < z_{1-\alpha}$, **aceptamos la hipótesis nula** H_0 .

Reglas de decisión

- Escribiremos la **regla de decisión** de la forma siguiente:

$$\delta(z, \alpha) = \begin{cases} 1, & \text{si } z \in R_\alpha \text{ (rechazamos } H_0), \\ 0, & \text{si } z \notin R_\alpha \text{ (aceptamos } H_0), \end{cases}$$

donde R_α es la llamada **zona de rechazo** que valdría en el ejemplo que vamos desarrollando:

$$R_\alpha = \{z \geq z_{1-\alpha} = \phi^{-1}(1 - \alpha)\},$$

donde $\phi(z)$ representa la **función de distribución** de la $N(0, 1)$:
 $\phi(z) = P(Z \leq z)$.

Ejemplo anterior

- En el ejemplo anterior, la **regla de decisión** para $\alpha = 0.05$ sería:

$$\delta(z, 0.05) = \begin{cases} 1, & \text{si } z \in R_{0.05} \text{ (rechazamos } H_0), \\ 0, & \text{si } z \notin R_{0.05} \text{ (aceptamos } H_0), \end{cases}$$

donde $R_{0.05} = \{z \geq z_{0.95} = \phi^{-1}(0.95) = 1.645\}$.

Errores tipo I y tipo II

- Recordemos que en un **contraste de hipótesis**, el **error tipo I** se definía como:

$$\text{Error tipo I} = P(\text{Rechazar } H_0 | H_0 \text{ cierta}),$$

o como la **probabilidad de rechazar la hipótesis nula suponiendo ésta cierta**.

Errores tipo I y tipo II

- Recordemos que en un **contraste de hipótesis**, el **error tipo I** se definía como:

$$\text{Error tipo I} = P(\text{Rechazar } H_0 | H_0 \text{ cierta}),$$

o como la **probabilidad de rechazar la hipótesis nula suponiendo ésta cierta.**

- De la misma manera, el **error tipo II** se definía como:

$$\text{Error tipo II} = P(\text{Aceptar } H_0 | H_0 \text{ falsa}),$$

o como la **probabilidad de aceptar la hipótesis nula suponiendo ésta falsa.**

Errores tipo I y tipo II

- Si interpretamos un **contraste de hipótesis** como un **proceso de decisión**,

Errores tipo I y tipo II

- Si interpretamos un **contraste de hipótesis** como un **proceso de decisión**,
 - aceptar la **hipótesis nula** sería tener un valor **negativo** y

Errores tipo I y tipo II

- Si interpretamos un **contraste de hipótesis** como un **proceso de decisión**,
 - aceptar la **hipótesis nula** sería tener un valor **negativo** y
 - **rechazarla** sería tener un valor **positivo**.

Errores tipo I y tipo II

- Si interpretamos un **contraste de hipótesis** como un **proceso de decisión**,
 - aceptar la **hipótesis nula** sería tener un valor **negativo** y
 - **rechazarla** sería tener un valor **positivo**.
- Entonces, podemos interpretar

Errores tipo I y tipo II

- Si interpretamos un **contraste de hipótesis** como un **proceso de decisión**,
 - aceptar la **hipótesis nula** sería tener un valor **negativo** y
 - **rechazarla** sería tener un valor **positivo**.
- Entonces, podemos interpretar
 - el **error tipo I** como un **falso positivo** ya que declaramos **positiva** una decisión que debería ser **negativa** y

Errores tipo I y tipo II

- Si interpretamos un **contraste de hipótesis** como un **proceso de decisión**,
 - aceptar la **hipótesis nula** sería tener un valor **negativo** y
 - **rechazarla** sería tener un valor **positivo**.
- Entonces, podemos interpretar
 - el **error tipo I** como un **falso positivo** ya que declaramos **positiva** una decisión que debería ser **negativa** y
 - y el **error tipo II** como un **falso negativo** ya que declaramos **positiva** una decisión que debería ser **positiva**.

Tasa de falsos positivos y falsos negativos

- En un contexto del proceso de decisión,

Tasa de falsos positivos y falsos negativos

- En un contexto del **proceso de decisión**,
 - el **error tipo I** se podría interpretar como la **tasa de falsos positivos** y

Tasa de falsos positivos y falsos negativos

- En un contexto del **proceso de decisión**,
 - el **error tipo I** se podría interpretar como la **tasa de falsos positivos** y
 - el **error tipo II** se podría interpretar como la **tasa de falsos negativos**.

Tasa de falsos positivos y falsos negativos

- En un contexto del **proceso de decisión**,
 - el **error tipo I** se podría interpretar como la **tasa de falsos positivos** y
 - el **error tipo II** se podría interpretar como la **tasa de falsos negativos**.
- Otro concepto que se introdujo en los **contrastes de hipótesis** es la **potencia de un contraste** que se definía como:

$$\begin{aligned}\text{Potencia de un contraste} &= 1 - \text{Error tipo II} \\ &= 1 - P(\text{Aceptar } H_0 | H_0 \text{ falsa}) \\ &= P(\text{rechazar } H_0 | H_0 \text{ falsa}),\end{aligned}$$

es decir, como la **probabilidad de rechazar la hipótesis nula suponiendo ésta falsa**.

Tasa de verdaderos positivos

- En un contexto del **proceso de decisión**, la **potencia del contraste** se puede interpretar como la **probabilidad de detectar un negativo**.

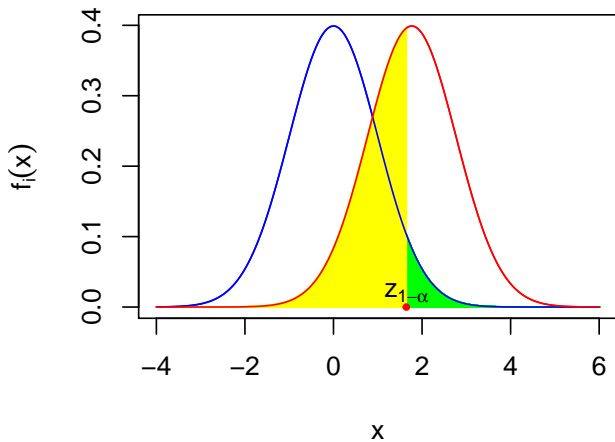
Tasa de verdaderos positivos

- En un contexto del **proceso de decisión**, la **potencia del contraste** se puede interpretar como la **probabilidad de detectar un negativo**.
- Por tanto, la **potencia de un contraste** puede interpretarse como la **tasa de verdaderos positivos** o la **probabilidad de detección**.

Tasa de verdaderos positivos

- En un contexto del **proceso de decisión**, la **potencia del contraste** se puede interpretar como la **probabilidad de detectar un negativo**.
- Por tanto, la **potencia de un contraste** puede interpretarse como la **tasa de verdaderos positivos** o la **probabilidad de detección**.
- En el gráfico siguiente mostramos en amarillo el **error tipo II** o la **tasa de falsos negativos** para el ejemplo anterior. Recordemos que en verde está el **error tipo I** o la **tasa de falsos positivos**.

Tasa de verdaderos positivos



Tasa de falsos positivos, falsos negativos y verdaderos positivos

- Matemáticamente, podemos escribir las tasas anteriores de la forma siguiente:

Tasa de falsos positivos, falsos negativos y verdaderos positivos

- Matemáticamente, podemos escribir las tasas anteriores de la forma siguiente:
 - Tasa de falsos positivos o error tipo I:

$$P_{FP} = \int_{R_\alpha} f_0(z) dz = \int_{z_{1-\alpha}}^{\infty} f_0(z) dz.$$

Tasa de falsos positivos, falsos negativos y verdaderos positivos

- Matemáticamente, podemos escribir las tasas anteriores de la forma siguiente:

- Tasa de falsos positivos o error tipo I:

$$P_{FP} = \int_{R_{\alpha}} f_0(z) dz = \int_{z_{1-\alpha}}^{\infty} f_0(z) dz.$$

- Tasa de falsos negativos o error tipo II:

$$P_{FN} = \int_{R_{\alpha}^c} f_1(z) dz = \int_{-\infty}^{z_{1-\alpha}} f_1(z) dz.$$

Tasa de falsos positivos, falsos negativos y verdaderos positivos

- Matemáticamente, podemos escribir las tasas anteriores de la forma siguiente:

- Tasa de falsos positivos o error tipo I:

$$P_{FP} = \int_{R_\alpha} f_0(z) dz = \int_{z_{1-\alpha}}^{\infty} f_0(z) dz.$$

- Tasa de falsos negativos o error tipo II:

$$P_{FN} = \int_{R_\alpha^c} f_1(z) dz = \int_{-\infty}^{z_{1-\alpha}} f_1(z) dz.$$

- Tasa de verdaderos positivos o potencia del contraste:

$$P_{VP} = \int_{R_\alpha} f_1(z) dz = \int_{z_{1-\alpha}}^{\infty} f_1(z) dz = 1 - P_{FN}.$$

Tasa de falsos positivos, falsos negativos y verdaderos positivos

- Podemos escribir las probabilidades anteriores en función de la **regla de decisión $\delta(z, \alpha)$** de la forma siguiente:

$$P_{FP} = \int_{\mathbb{R}} \delta(z, \alpha) f_0(z) dz = \int_{z_{1-\alpha}}^{\infty} f_0(z) dz,$$

$$P_{FN} = \int_{\mathbb{R}} (1 - \delta(z, \alpha)) f_1(z) dz = \int_{-\infty}^{z_{1-\alpha}} f_1(z) dz,$$

$$P_{VP} = \int_{\mathbb{R}} \delta(z, \alpha) f_1(z) dz = \int_{z_{1-\alpha}}^{\infty} f_1(z) dz.$$

Ejemplo anterior

- En el ejemplo anterior, las tasas de falsos positivos, falsos negativos y verdaderos positivos son las siguientes:

$$P_{FP} = \int_{1.645}^{\infty} \frac{1}{\sqrt{2\pi}} e^{-\frac{z^2}{2}} dz = 1 - \phi(1.645) = 0.05,$$

$$\begin{aligned} P_{FN} &= \int_{-\infty}^{1.645} \frac{1}{\sqrt{2\pi}} e^{-\frac{\left(z - \frac{2.5-2}{\sqrt{50}}\right)^2}{2}} dz = \int_{-\infty}^{1.645} \frac{1}{\sqrt{2\pi}} e^{-\frac{(z-1.768)^2}{2}} dz \\ &= P(N(1.768, 1) \leq 1.645) = \phi(1.645 - 1.768) = \phi(-0.123) \\ &= 0.451, \end{aligned}$$

$$P_{VP} = 1 - P_{FN} = 1 - 0.451 = 0.549.$$

Decisión de Neyman-Pearson

- Una vez establecidos los conceptos necesarios, el objetivo es hallar la mejor **regla de decisión** para un **contraste de hipótesis**.

Definición

La **regla de decisión de Neyman-Pearson** se define como el siguiente problema de **optimización**:

$$\hat{\delta} = \max_{\delta \text{ tal que } P_{FP}(\delta) \leq \alpha} P_{VP}(\delta)$$

Decisión de Neyman-Pearson

- Una vez establecidos los conceptos necesarios, el objetivo es hallar la mejor **regla de decisión** para un **contraste de hipótesis**.
- Definimos la **regla de decisión de Neyman-Pearson** precisamente como la mejor **regla de decisión** donde formalmente se define como el siguiente **problema de optimización**:

Definición

La **regla de decisión de Neyman-Pearson** se define como el siguiente problema de **optimización**:

$$\hat{\delta} = \underset{\delta \text{ tal que } P_{FP}(\delta) \leq \alpha}{\text{máx}} P_{VP}(\delta)$$

Decisión de Neyman-Pearson

- Es decir, de entre todas las reglas de decisión δ tal que la tasa de falsos positivos es menor que un cierto nivel de significación α , hallar la que maximiza la tasa de verdaderos positivos o la tasa de detección.

Decisión de Neyman-Pearson

- Es decir, de entre todas las reglas de decisión δ tal que la tasa de falsos positivos es menor que un cierto nivel de significación α , hallar la que maximiza la tasa de verdaderos positivos o la tasa de detección.
- Para resolver el problema de optimización anterior, necesitamos introducir el índice de verosimilitud entre dos distribuciones de funciones de densidad $f_0(z)$ y $f_1(z)$ como:

$$L(z) = \frac{f_1(z)}{f_0(z)}.$$

Decisión de Neyman-Pearson

- El siguiente resultado resuelve el problema de **optimización**:

Decisión de Neyman-Pearson

- El siguiente resultado resuelve el problema de **optimización**:

Teorema

*La solución al problema de **optimización de la regla de decisión de Neyman-Pearson** es el siguiente:*

$$\hat{\delta}(z) = \begin{cases} 1, & \text{si } L(z) \geq \eta, \\ 0, & \text{si } L(z) < \eta, \end{cases}$$

*donde η depende del **nivel de significación** α .*

Decisión de Neyman-Pearson

- El siguiente resultado resuelve el problema de **optimización**:

Teorema

*La solución al problema de **optimización de la regla de decisión de Neyman-Pearson** es el siguiente:*

$$\hat{\delta}(z) = \begin{cases} 1, & \text{si } L(z) \geq \eta, \\ 0, & \text{si } L(z) < \eta, \end{cases}$$

*donde η depende del **nivel de significación** α .*

- El teorema anterior dice que si el objetivo es maximizar la **tasa de detección** o la **tasa de verdaderos positivos** manteniendo la **tasa de falsos positivos**, no podemos hacerlo mejor que la **regla de decisión** dada por el Teorema.

Demostración del Teorema

- La relación entre η y α es la siguiente:

$$\alpha = P_{FP}(\hat{\delta}) = \int_{\mathbb{R}} \hat{\delta}(z) f_0(z) dz = \int_{L(z) \geq \eta} f_0(z) dz$$

Demostración del Teorema

- La relación entre η y α es la siguiente:

$$\alpha = P_{FP}(\hat{\delta}) = \int_{\mathbb{R}} \hat{\delta}(z) f_0(z) dz = \int_{L(z) \geq \eta} f_0(z) dz$$

- Sea δ otra regla de decisión. Nuestro objetivo es demostrar que $P_{VP}(\hat{\delta}) \geq P_{VP}(\delta)$.

Demostración del Teorema

- La relación entre η y α es la siguiente:

$$\alpha = P_{FP}(\hat{\delta}) = \int_{\mathbb{R}} \hat{\delta}(z) f_0(z) dz = \int_{L(z) \geq \eta} f_0(z) dz$$

- Sea δ otra regla de decisión. Nuestro objetivo es demostrar que $P_{VP}(\hat{\delta}) \geq P_{VP}(\delta)$.
- Como la regla δ debe cumplir que la tasa de falsos positivos debe ser menor que α , tenemos que:

$$\begin{aligned} \alpha &\geq P_{FP}(\delta) = \int_{\mathbb{R}} \delta(z) f_0(z) dz \\ &= \int_{L(z) \geq \eta} \delta(z) f_0(z) dz + \int_{L(z) < \eta} \delta(z) f_0(z) dz. \end{aligned}$$

Demostración del Teorema (continuación)

■ Entonces:

$$\int_{L(z) \geq \eta} f_0(z) dz \geq \int_{L(z) \geq \eta} \delta(z) f_0(z) dz + \int_{L(z) < \eta} \delta(z) f_0(z) dz, \Rightarrow$$
$$\int_{L(z) \geq \eta} (1 - \delta(z)) f_0(z) dz - \int_{L(z) < \eta} \delta(z) f_0(z) dz \geq 0.$$

Demostración del Teorema (continuación)

■ Entonces:

$$\begin{aligned} \int_{L(z) \geq \eta} f_0(z) dz &\geq \int_{L(z) \geq \eta} \delta(z) f_0(z) dz + \int_{L(z) < \eta} \delta(z) f_0(z) dz, \Rightarrow \\ \int_{L(z) \geq \eta} (1 - \delta(z)) f_0(z) dz - \int_{L(z) < \eta} \delta(z) f_0(z) dz &\geq 0. \end{aligned}$$

■ A continuación, veamos que $P_{VP}(\hat{\delta}) \geq P_{VP}(\delta)$:

$$\begin{aligned} P_{VP}(\hat{\delta}) &= \int_{\mathbb{R}} \hat{\delta}(z) f_1(z) dz = \int_{L(z) \geq \eta} f_1(z) dz, \\ P_{VP}(\delta) &= \int_{\mathbb{R}} \delta(z) f_1(z) dz = \int_{L(z) \geq \eta} \delta(z) f_1(z) dz \\ &\quad + \int_{L(z) < \eta} \delta(z) f_1(z) dz, \end{aligned}$$

Demostración del Teorema (continuación)

- Restando las dos expresiones anteriores,

$$P_{VP}(\hat{\delta}) - P_{VP}(\delta) = \int_{L(z) \geq \eta} (1 - \delta(z)) f_1(z) dz - \int_{L(z) < \eta} \delta(z) f_1(z) dz$$

Demostración del Teorema (continuación)

- Restando las dos expresiones anteriores,

$$P_{VP}(\hat{\delta}) - P_{VP}(\delta) = \int_{L(z) \geq \eta} (1 - \delta(z)) f_1(z) dz - \int_{L(z) < \eta} \delta(z) f_1(z) dz$$

- Ahora bien,

Demostración del Teorema (continuación)

- Restando las dos expresiones anteriores,

$$P_{VP}(\hat{\delta}) - P_{VP}(\delta) = \int_{L(z) \geq \eta} (1 - \delta(z)) f_1(z) dz - \int_{L(z) < \eta} \delta(z) f_1(z) dz$$

- Ahora bien,

- si $L(z) = \frac{f_1(z)}{f_0(z)} \geq \eta$, $f_1(z) \geq \eta f_0(z)$,

Demostración del Teorema (continuación)

- Restando las dos expresiones anteriores,

$$P_{VP}(\hat{\delta}) - P_{VP}(\delta) = \int_{L(z) \geq \eta} (1 - \delta(z)) f_1(z) dz - \int_{L(z) < \eta} \delta(z) f_1(z) dz$$

- Ahora bien,

- si $L(z) = \frac{f_1(z)}{f_0(z)} \geq \eta$, $f_1(z) \geq \eta f_0(z)$,
- si $L(z) = \frac{f_1(z)}{f_0(z)} < \eta$, $f_1(z) < \eta f_0(z)$ y por tanto,
 $-f_1(z) > -\eta f_0(z)$.

Demostración del Teorema (continuación)

■ Entonces:

$$\begin{aligned} P_{VP}(\hat{\delta}) - P_{VP}(\delta) &\geq \int_{L(z) \geq \eta} (1 - \delta(z)) \eta f_0(z) dz \\ &\quad - \int_{L(z) < \eta} \eta \delta(z) f_0(z) dz \\ &= \eta \left(\int_{L(z) \geq \eta} (1 - \delta(z)) f_0(z) dz - \int_{L(z) < \eta} \delta(z) f_0(z) dz \right) \end{aligned}$$

Demostración del Teorema (continuación)

■ Entonces:

$$\begin{aligned} P_{VP}(\hat{\delta}) - P_{VP}(\delta) &\geq \int_{L(z) \geq \eta} (1 - \delta(z)) \eta f_0(z) dz \\ &\quad - \int_{L(z) < \eta} \eta \delta(z) f_0(z) dz \\ &= \eta \left(\int_{L(z) \geq \eta} (1 - \delta(z)) f_0(z) dz - \int_{L(z) < \eta} \delta(z) f_0(z) dz \right) \end{aligned}$$

■ Anteriormente vimos que

$$\int_{L(z) \geq \eta} (1 - \delta(z)) f_0(z) dz - \int_{L(z) < \eta} \delta(z) f_0(z) dz \geq 0,$$

por tanto,

$$P_{VP}(\hat{\delta}) - P_{VP}(\delta) \geq 0,$$

tal como queríamos demostrar.

Decisión de Neyman-Pearson. Ejemplo

- Ahora ya sabemos cómo hallar reglas de decisión óptimas dado un contraste de hipótesis.

Decisión de Neyman-Pearson. Ejemplo

- Ahora ya sabemos cómo hallar reglas de decisión óptimas dado un contraste de hipótesis.
- Apliquemos el Teorema anterior al ejemplo desarrollado pero lo haremos con cualquier valor de σ .

Decisión de Neyman-Pearson. Ejemplo

- Ahora ya sabemos cómo hallar reglas de decisión óptimas dado un contraste de hipótesis.
- Apliquemos el Teorema anterior al ejemplo desarrollado pero lo haremos con cualquier valor de σ .
- En el ejemplo,

$$f_0(z) = \frac{1}{\sqrt{2\pi}} e^{-\frac{z^2}{2}}, \quad f_1(z) = \frac{1}{\sqrt{2\pi}} e^{-\frac{\left(z - \frac{\mu - 2}{\frac{\sigma}{\sqrt{n}}}\right)^2}{2}}$$

Decisión de Neyman-Pearson. Ejemplo

- Ahora ya sabemos cómo hallar reglas de decisión óptimas dado un contraste de hipótesis.
- Apliquemos el Teorema anterior al ejemplo desarrollado pero lo haremos con cualquier valor de σ .
- En el ejemplo,

$$f_0(z) = \frac{1}{\sqrt{2\pi}} e^{-\frac{z^2}{2}}, \quad f_1(z) = \frac{1}{\sqrt{2\pi}} e^{-\frac{\left(z - \frac{\mu - 2}{\frac{\sigma}{\sqrt{n}}}\right)^2}{2}}$$

- Sea $\mu_1 = \frac{\mu - 2}{\frac{\sigma}{\sqrt{n}}}$. El valor de $L(z)$ será:

$$L(z) = \frac{f_1(z)}{f_0(z)} = e^{-\frac{(z - \mu_1)^2}{2} + \frac{z^2}{2}} = e^{\frac{1}{2}(2z\mu_1 - \mu_1^2)}.$$

Decisión de Neyman-Pearson. Ejemplo

- La condición $L(z) \geq \eta$ será en nuestro caso,

$$e^{\frac{1}{2}(2z\mu_1 - \mu_1^2)} \geq \eta, \Leftrightarrow 2z\mu_1 \geq 2\ln(\eta) + \mu_1^2, \Leftrightarrow z \geq \frac{2\ln(\eta) + \mu_1^2}{2\mu_1} := \tau.$$

Decisión de Neyman-Pearson. Ejemplo

- La condición $L(z) \geq \eta$ será en nuestro caso,

$$e^{\frac{1}{2}(2z\mu_1 - \mu_1^2)} \geq \eta, \Leftrightarrow 2z\mu_1 \geq 2\ln(\eta) + \mu_1^2, \Leftrightarrow z \geq \frac{2\ln(\eta) + \mu_1^2}{2\mu_1} := \tau.$$

- Para hallar τ en función de α , hay que tener en cuenta que:

$$\alpha = P_{FP}(\hat{\delta}) = \int_{L(z) \geq \eta} f_0(z) dz = \int_{\tau}^{\infty} \frac{1}{\sqrt{2\pi}} e^{-\frac{z^2}{2}} dz = 1 - \Phi(\tau).$$

Decisión de Neyman-Pearson. Ejemplo

- La condición $L(z) \geq \eta$ será en nuestro caso,

$$e^{\frac{1}{2}(2z\mu_1 - \mu_1^2)} \geq \eta, \Leftrightarrow 2z\mu_1 \geq 2\ln(\eta) + \mu_1^2, \Leftrightarrow z \geq \frac{2\ln(\eta) + \mu_1^2}{2\mu_1} := \tau.$$

- Para hallar τ en función de α , hay que tener en cuenta que:

$$\alpha = P_{FP}(\hat{\delta}) = \int_{L(z) \geq \eta} f_0(z) dz = \int_{\tau}^{\infty} \frac{1}{\sqrt{2\pi}} e^{-\frac{z^2}{2}} dz = 1 - \phi(\tau).$$

- Entonces,

$$\phi(\tau) = 1 - \alpha, \Leftrightarrow \tau = \phi^{-1}(1 - \alpha).$$

Decisión de Neyman-Pearson. Ejemplo

- En pocas palabras la regla de decisión óptima sería

Decisión de Neyman-Pearson. Ejemplo

- En pocas palabras la **regla de decisión óptima** sería
 - si $z \geq \phi^{-1}(1 - \alpha) = z_{1-\alpha}$, rechazamos la hipótesis nula y,

Decisión de Neyman-Pearson. Ejemplo

- En pocas palabras la **regla de decisión óptima** sería
 - si $z \geq \phi^{-1}(1 - \alpha) = z_{1-\alpha}$, rechazamos la hipótesis nula y,
 - si $z < \phi^{-1}(1 - \alpha) = z_{1-\alpha}$, aceptamos la hipótesis nula.

Decisión de Neyman-Pearson. Ejemplo

- En pocas palabras la **regla de decisión óptima** sería
 - si $z \geq \phi^{-1}(1 - \alpha) = z_{1-\alpha}$, rechazamos la hipótesis nula y,
 - si $z < \phi^{-1}(1 - \alpha) = z_{1-\alpha}$, aceptamos la hipótesis nula.
- La regla anterior es la regla que aprendimos. En este nuevo enfoque, hemos demostrado cuál es la razón que sea la **regla de decisión óptima**.

Curva ROC

Introducción

- Como ya hemos comentado, realizar un **contraste de hipótesis** es similar a realizar una **clasificación en dos clases**.

Introducción

- Como ya hemos comentado, realizar un **contraste de hipótesis** es similar a realizar una **clasificación en dos clases**.
- **Rechazar la hipótesis nula** sería equivalente a **clasificar** como **positivo** y **aceptar la hipótesis nula**, como **negativo**.

Introducción

- Como ya hemos comentado, realizar un **contraste de hipótesis** es similar a realizar una **clasificación en dos clases**.
- **Rechazar la hipótesis nula** sería equivalente a **clasificar** como **positivo** y **aceptar la hipótesis nula**, como **negativo**.
- Entonces, cualquier **métrica de evaluación** para **contrastes de hipótesis** tiene su equivalencia en **clasificación** y viceversa.

Introducción

- Como ya hemos comentado, realizar un **contraste de hipótesis** es similar a realizar una **clasificación en dos clases**.
- **Rechazar la hipótesis nula** sería equivalente a **clasificar** como **positivo** y **aceptar la hipótesis nula**, como **negativo**.
- Entonces, cualquier **métrica de evaluación** para **contrastes de hipótesis** tiene su equivalencia en **clasificación** y viceversa.
- Vamos a introducir la curva *Receiving Operating Characteristic* o curva ROC. Dicha curva es una de las **métricas** más usadas en tareas de **clasificación, detección y segmentación** en **machine learning**.

Introducción

- Vamos a relacionar el enfoque de Neyman Pearson para contrastes de hipótesis y las curvas ROC.

Introducción

- Vamos a relacionar el **enfoque de Neyman Pearson** para **contrastes de hipótesis** y las **curvas ROC**.
- Recordemos que el **criterio de Neyman-Pearson** es la **regla de decisión óptima $\hat{\delta}$** que resuelve el problema de **optimización** siguiente:

$$\hat{\delta} = \max_{\delta \text{ tal que } P_{FP}(\delta) \leq \alpha} P_{VP}(\delta)$$

Introducción

- Vamos a relacionar el **enfoque de Neyman Pearson** para **contrastes de hipótesis** y las **curvas ROC**.
- Recordemos que el **criterio de Neyman-Pearson** es la **regla de decisión óptima $\hat{\delta}$** que resuelve el problema de **optimización** siguiente:

$$\hat{\delta} = \max_{\delta \text{ tal que } P_{FP}(\delta) \leq \alpha} P_{VP}(\delta)$$

- La **regla de decisión óptima $\hat{\delta}$** cambia si cambiamos el **nivel de significación α** . Por tanto, podemos escribir $\hat{\delta}(\alpha)$.

- Entonces, dados un conjunto de niveles de significación $\alpha_1, \dots, \alpha_N$, podemos calcular las reglas de decisión óptimas $\hat{\delta}_1, \dots, \hat{\delta}_N$ correspondientes a dichos niveles de significación.

Curva ROC

- Entonces, dados un conjunto de niveles de significación $\alpha_1, \dots, \alpha_N$, podemos calcular las reglas de decisión óptimas $\hat{\delta}_1, \dots, \hat{\delta}_N$ correspondientes a dichos niveles de significación.
- Además, para cada regla de decisión óptima $\hat{\delta}_i$, podemos calcular la tasa de falsos positivos $P_{FP}(\hat{\delta}_i)$ y la tasa de verdaderos positivos $P_{VP}(\hat{\delta}_i)$, $i = 1, \dots, N$.

Curva ROC

- Entonces, dados un conjunto de niveles de significación $\alpha_1, \dots, \alpha_N$, podemos calcular las reglas de decisión óptimas $\hat{\delta}_1, \dots, \hat{\delta}_N$ correspondientes a dichos niveles de significación.
- Además, para cada regla de decisión óptima $\hat{\delta}_i$, podemos calcular la tasa de falsos positivos $P_{FP}(\hat{\delta}_i)$ y la tasa de verdaderos positivos $P_{VP}(\hat{\delta}_i)$, $i = 1, \dots, N$.
- El gráfico de las tasas de verdaderos positivos $P_{VP}(\hat{\delta}_i)$ (eje Y) como función de las tasas de falsos positivos $P_{FP}(\hat{\delta}_i)$ (eje X), $i = 1, \dots, N$ se denomina curva ROC para el contraste de hipótesis considerado.

Curva ROC. Ejemplo

- Para el ejemplo considerado, dado un valor de $\alpha \in [0, 1]$, la **tasa de falsos positivos** $P_{FP}(\hat{\delta})$ y la **tasa de verdaderos positivos** $P_{VP}(\hat{\delta})$ para dicho valor de α serán:

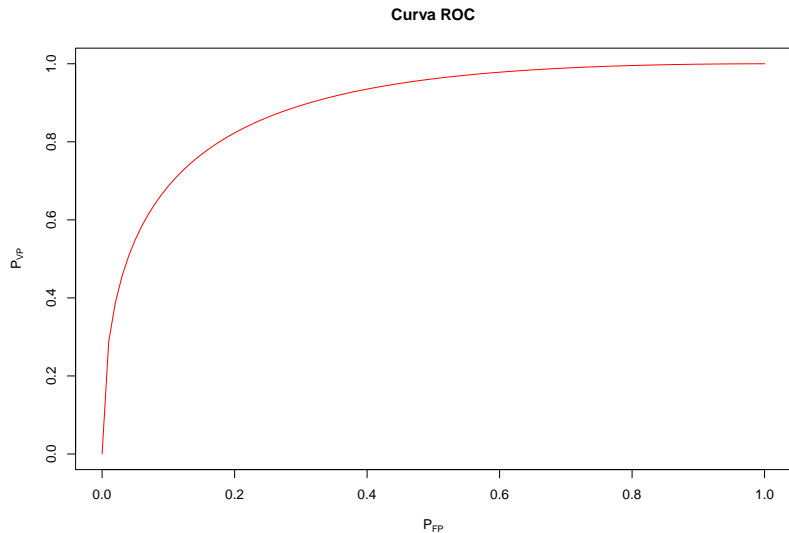
$$P_{FP} = \int_{\phi^{-1}(1-\alpha)}^{\infty} \frac{1}{\sqrt{2\pi}} e^{-\frac{z^2}{2}} dz = 1 - \phi(\phi^{-1}(1-\alpha)) = \alpha,$$

$$\begin{aligned} P_{FN} &= \int_{-\infty}^{\phi^{-1}(1-\alpha)} \frac{1}{\sqrt{2\pi}} e^{-\frac{\left(z - \frac{2.5-2}{\sqrt{50}}\right)^2}{2}} dz \\ &= \int_{-\infty}^{\phi^{-1}(1-\alpha)} \frac{1}{\sqrt{2\pi}} e^{-\frac{(z-1.768)^2}{2}} dz \\ &= P(N(1.768, 1) \leq \phi^{-1}(1-\alpha)) = \phi(\phi^{-1}(1-\alpha) - 1.768), \\ P_{VP} &= 1 - P_{FN} = 1 - \phi(\phi^{-1}(1-\alpha) - 1.768). \end{aligned}$$

Curva ROC. Ejemplo

- El gráfico siguiente muestra la **curva ROC** para el ejemplo considerado.

Curva ROC. Ejemplo



Interpretación de la curva ROC

- El valor $(0, 0)$ siempre está en la **curva ROC**. Significa que se tiene una tasa nula de **falsos positivos** y **verdaderos positivos**. En este caso, siempre aceptamos la **hipótesis nula** pero tampoco se **detecta nada** ya que nunca aceptamos la **hipótesis alternativa H_1** . Estaríamos en un caso sin **ningún tipo de interés** desde el punto de vista de realizar un **contraste de hipótesis** o de realizar una **clasificación en dos clases**.

Interpretación de la curva ROC

- El valor (0, 0) siempre está en la **curva ROC**. Significa que se tiene una tasa nula de **falsos positivos** y **verdaderos positivos**. En este caso, siempre aceptamos la **hipótesis nula** pero tampoco se **detecta nada** ya que nunca aceptamos la **hipótesis alternativa H_1** . Estaríamos en un caso sin **ningún tipo de interés** desde el punto de vista de realizar un **contraste de hipótesis** o de realizar una **clasificación en dos clases**.
- El valor (1, 1) también pertenece siempre a la **curva ROC**. Significa que se tiene un 100 % de **falsos positivos** y un 100 % de **verdaderos positivos**. En este caso, siempre rechazamos la **hipótesis nula**, por tanto, tenemos un 100 % de detección pero al mismo tiempo tenemos una tasa del 100 % de **falsos positivos** o un **error tipo I** máximo.

Interpretación de la curva ROC

- Para cualquier valor de α diferente de 0 y 1, no podemos tener una **tasa de verdaderos positivos** más alta que la que nos da la **curva ROC** para la **tasa de falsos positivos** fijada.

Interpretación de la curva ROC

- Para cualquier valor de α diferente de 0 y 1, no podemos tener una **tasa de verdaderos positivos** más alta que la que nos da la **curva ROC** para la **tasa de falsos positivos** fijada.
- La **curva ROC** dice cómo cambia la **regla de decisión** a medida que cambiamos el **umbral**. Dicho **umbral** es un concepto usado tanto en **contraste de hipótesis** como en **clasificación**.

Interpretación de la curva ROC

- Para cualquier valor de α diferente de 0 y 1, no podemos tener una **tasa de verdaderos positivos** más alta que la que nos da la **curva ROC** para la **tasa de falsos positivos** fijada.
- La **curva ROC** dice cómo cambia la **regla de decisión** a medida que cambiamos el **umbral**. Dicho **umbral** es un concepto usado tanto en **contraste de hipótesis** como en **clasificación**.
- En **contraste de hipótesis**, el **umbral** sería el **nivel de significación α** . En **clasificación**, el **umbral** sería un valor para decidir si un valor de la muestra se clasifica como **clase 1** o **clase 0**.

Interpretación de la curva ROC

- La **curva ROC ideal** sería aquella en la cual la **tasa de falsos positivos** siempre es nula, $P_{FP} = 0$ y la **tasa de verdaderos positivos** siempre vale 1 o su valor máximo, $P_{VP} = 1$. En el gráfico, la curva correspondería a los lados del cuadrado que van de $(0,0)$ a $(0,1)$ y de $(0,1)$ a $(1,1)$. Sin embargo, esta situación es teórica y nunca se da en la práctica.

Decisión ciega

- Imaginemos que para realizar un **contraste de hipótesis** determinado, consideramos la **regla de decisión** que consiste en **rechazar la hipótesis nula H_0** con probabilidad α y **aceptarla** con probabilidad $1 - \alpha$. Es decir:

$$\delta(z) = \begin{cases} 1, & \text{con probabilidad } \alpha, \\ 0, & \text{con probabilidad } 1 - \alpha. \end{cases}$$

Llamamos a dicha regla de decisión, **decisión ciega** ya que no depende del valor del **estadístico de contraste**.

Decisión ciega

- En este caso, fijado un valor del nivel de significación α , la tasa de falsos positivos y la tasa de verdaderos positivos serán

$$P_{FP} = P(\text{rechazar } H_0 | H_0 \text{ cierta}) = \alpha,$$

$$P_{VP} = P(\text{rechazar } H_0 | H_0 \text{ cierta}) = \alpha.$$

Es decir el punto de la curva ROC de la decisión ciega sería (α, α) .

Decisión ciega

- En este caso, fijado un valor del nivel de significación α , la tasa de falsos positivos y la tasa de verdaderos positivos serán

$$P_{FP} = P(\text{rechazar } H_0 | H_0 \text{ cierta}) = \alpha,$$

$$P_{VP} = P(\text{rechazar } H_0 | H_0 \text{ cierta}) = \alpha.$$

Es decir el punto de la curva ROC de la decisión ciega sería (α, α) .

- Por tanto, la curva ROC correspondiente a la decisión ciega sería la diagonal del cuadrado $[0, 1] \times [0, 1]$.

Decisión ciega

- En este caso, fijado un valor del nivel de significación α , la tasa de falsos positivos y la tasa de verdaderos positivos serán

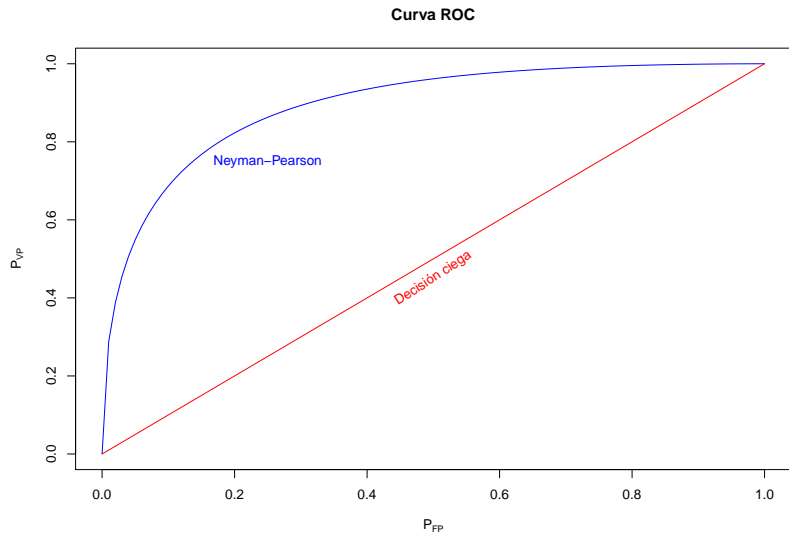
$$P_{FP} = P(\text{rechazar } H_0 | H_0 \text{ cierta}) = \alpha,$$

$$P_{VP} = P(\text{rechazar } H_0 | H_0 \text{ cierta}) = \alpha.$$

Es decir el punto de la curva ROC de la decisión ciega sería (α, α) .

- Por tanto, la curva ROC correspondiente a la decisión ciega sería la diagonal del cuadrado $[0, 1] \times [0, 1]$.
- Entonces, cuanto más lejos esté la curva ROC de nuestra regla de decisión de la diagonal del cuadrado $[0, 1] \times [0, 1]$, más lejos estará de la decisión ciega y más óptima será.

Decisión ciega



Evaluación de la regla de decisión a través de la curva ROC

- Para evaluar una **regla de decisión** dada su **curva ROC** se calcula el **AUC** (*area under the curve*) o el **área bajo la curva** ya que cuánto mayor es dicha área, más cerca está la curva ROC de la **curva ROC ideal**.

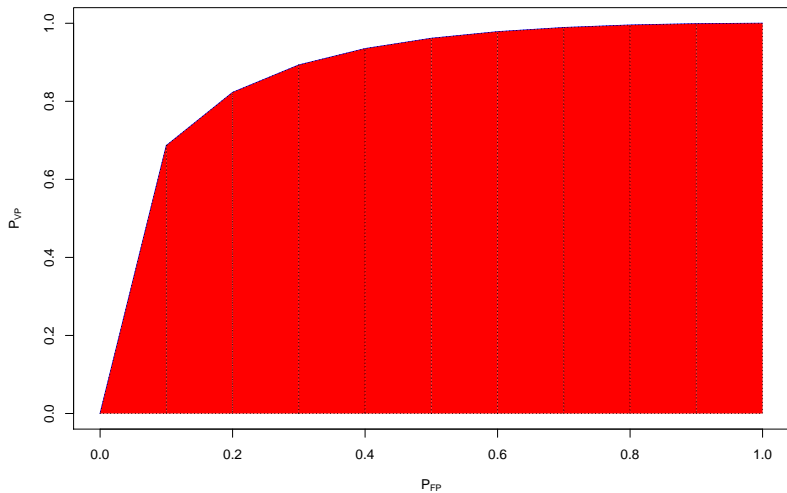
Evaluación de la regla de decisión a través de la curva ROC

- Para evaluar una **regla de decisión** dada su **curva ROC** se calcula el **AUC** (*area under the curve*) o el **área bajo la curva** ya que cuánto mayor es dicha área, más cerca está la curva ROC de la **curva ROC ideal**.
- En general, para dibujar la curva ROC se dispone de un **conjunto discreto** de valores del tipo $(P_{FP,i}, P_{VP,i})$, $i = 1, \dots, N$. Entonces una aproximación del **área bajo la curva AUC** se puede calcular de la forma siguiente:

$$\text{AUC} \approx \frac{1}{2} \sum_{i=1}^{N-1} (P_{VP,i+1} + P_{VP,i}) \cdot (P_{FP,i+1} - P_{FP,i}).$$

AUC

Curva ROC



Ejemplo anterior

- En el ejemplo anterior, considerando $N = 11$ puntos, con

$$P_{FP,i} = 0, 0.1, 0.2, 0.3, 0.4, 0.5, 0.6, 0.7, 0.8, 0.9, 1,$$

$$P_{VP,i} = 0, 0.6866, 0.8228, 0.8931, 0.935, 0.9615, 0.9784, \\ 0.9891, 0.9955, 0.9989, 1.$$

Ejemplo anterior

- En el ejemplo anterior, considerando $N = 11$ puntos, con

$$P_{FP,i} = 0, 0.1, 0.2, 0.3, 0.4, 0.5, 0.6, 0.7, 0.8, 0.9, 1,$$

$$P_{VP,i} = 0, 0.6866, 0.8228, 0.8931, 0.935, 0.9615, 0.9784, \\ 0.9891, 0.9955, 0.9989, 1.$$

- La aproximación del **área AUC** sería:

$$\begin{aligned} \text{AUC} &\approx \frac{1}{2} \sum_{i=1}^{10} (P_{VP,i+1} + P_{VP,i}) \cdot (P_{FP,i+1} - P_{FP,i}) \\ &= \frac{1}{2} ((0.6866 + 0) \cdot (0.1 - 0) + \dots + (1 + 0.9989) \cdot (1 - 0.9)) \\ &= 0.8761. \end{aligned}$$

Ejemplo anterior

- Como el valor máximo del **área AUC** es 1 que correspondería a la **curva ROC ideal** y el valor mínimo vale 0.5 que correspondería a la **decisión ciega**, la **regla de decisión** es bastante buena.

La curva *Precision-Recall*

- Una alternativa a la **curva ROC** para medir el rendimiento de la **regla de decisión** es la **curva Precision-Recall** o **curva PR**. Se define de la forma siguiente:

Definición

Se define la **precisión** de una **regla de decisión** como:

$$\text{precisión} = \frac{P_{VP}}{P_{VP} + P_{FP}},$$

y el **recall** como:

$$\text{recall} = \frac{P_{VP}}{P_{VP} + P_{FN}} = P_{VP}.$$

La curva *Precision-Recall*

- Es decir, la **precisión** sería el número de **verdaderos positivos** entre todos los **verdaderos positivos y falsos positivos** o el **total de positivos detectados**.

La curva *Precision-Recall*

- Es decir, la **precisión** sería el número de **verdaderos positivos** entre todos los **verdaderos positivos y falsos positivos** o el **total de positivos detectados**.
- Una **precisión alta** significa que entre todos los **positivos detectados**, la mayoría son **verdaderos positivos**. Es decir, lo que la **regla de decisión** afirma que son positivos, en realidad lo son o la **regla** es muy fiable. En este caso, si **rechazamos la hipótesis nula**, probablemente tomemos una buena decisión.

La curva *Precision-Recall*

- Es decir, la **precisión** sería el número de **verdaderos positivos** entre todos los **verdaderos positivos y falsos positivos** o el **total de positivos detectados**.
- Una **precisión alta** significa que entre todos los **positivos detectados**, la mayoría son **verdaderos positivos**. Es decir, lo que la **regla de decisión** afirma que son positivos, en realidad lo son o la **regla** es muy fiable. En este caso, si **rechazamos la hipótesis nula**, probablemente tomemos una buena decisión.
- Una **precisión baja** significa que entre todos los **positivos detectados**, la mayoría en realidad no lo son. Una **precisión baja** puede ocurrir cuando uno está demasiado **ansioso** para **rechazar H_1** . En este caso, si **rechazamos la hipótesis nula**, probablemente no sea una buena decisión.

La curva *Precision-Recall*

- El **recall** sería simplemente la **tasa de verdaderos positivos**.

La curva *Precision-Recall*

- El **recall** sería simplemente la **tasa de verdaderos positivos**.
- La diferencia fundamental entre la **precisión** y el **recall** es el **denominador**. En el caso, de la **precisión**, dividimos entre todos los **positivos detectados**; en cambio, en el caso del **recall**, dividimos entre todos los **positivos verdaderos**.

La curva *Precision-Recall*

- El **recall** sería simplemente la **tasa de verdaderos positivos**.
- La diferencia fundamental entre la **precisión** y el **recall** es el **denominador**. En el caso, de la **precisión**, dividimos entre todos los **positivos detectados**; en cambio, en el caso del **recall**, dividimos entre todos los **positivos verdaderos**.
- Un **recall alto** significa que la **regla de decisión** es muy fiable en **detectar positivos** o **rechazar la hipótesis nula H_0** . Esto ocurre cuando elegimos un valor α muy bajo. Sin embargo, en este caso, tendríamos una **precisión baja**.

La curva *Precision-Recall*

- El **recall** sería simplemente la **tasa de verdaderos positivos**.
- La diferencia fundamental entre la **precisión** y el **recall** es el **denominador**. En el caso, de la **precisión**, dividimos entre todos los **positivos detectados**; en cambio, en el caso del **recall**, dividimos entre todos los **positivos verdaderos**.
- Un **recall alto** significa que la **regla de decisión** es muy fiable en **detectar positivos** o **rechazar la hipótesis nula H_0** . Esto ocurre cuando elegimos un valor α muy bajo. Sin embargo, en este caso, tendríamos una **precisión baja**.
- Un **recall bajo** significa que **aceptamos la hipótesis nula** demasiadas veces y por tanto, casi nunca detectamos un **positivo**. Sin embargo, tener un **recall bajo** significa tener una **precisión alta** ya que casi nunca **rechazamos la hipótesis nula** a no ser que tengamos **evidencia clara**.

La curva *Precision-Recall*

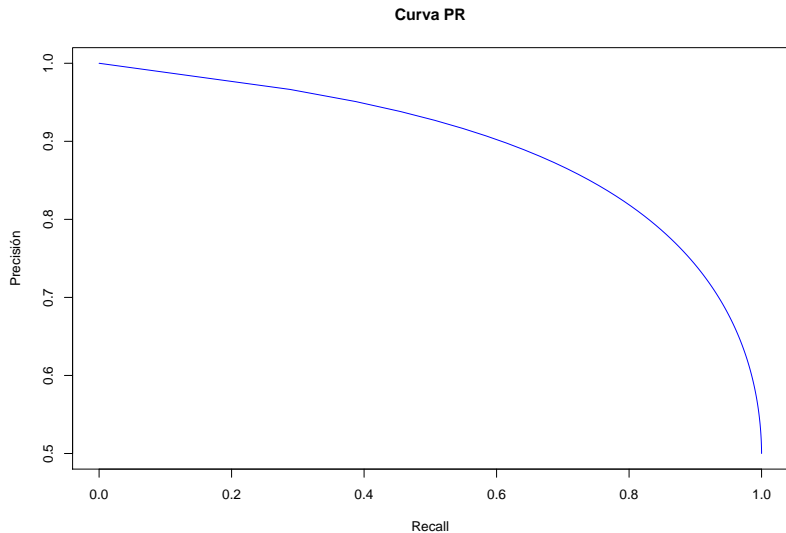
- La **curva PR** consiste en realizar un gráfico de la **precisión** (eje Y) en función del **recall** o **tasa de verdaderos positivos** (eje X).

La curva *Precision-Recall*

- La **curva PR** consiste en realizar un gráfico de la **precisión** (eje Y) en función del **recall** o **tasa de verdaderos positivos** (eje X).
- La relación entre la **precisión** y el **recall** y la **tasa de falsos positivos** y la **tasa de verdaderos positivos** es la siguiente:

$$P_{FP} = \frac{\text{recall}(1 - \text{precisión})}{\text{precisión}}, \quad P_{VP} = \text{recall}.$$

Ejemplo anterior



Curva ROC ideal y decisión ciega

- La curva **PR** para la curva **ROC ideal** correspondería a los lados que van de los puntos $(0, 1)$ al $(1, 1)$ y del $(1, 1)$ al $(1, 0)$ ya que en este caso, la **precisión** valdría 1 y el **recall** también.

Curva ROC ideal y decisión ciega

- La curva **PR** para la curva **ROC ideal** correspondería a los lados que van de los puntos $(0, 1)$ al $(1, 1)$ y del $(1, 1)$ al $(1, 0)$ ya que en este caso, la **precisión** valdría 1 y el **recall** también.
- En el caso de la **decisión ciega**, la precisión sería:

$$\text{precisión} = \frac{P_{VP}}{P_{VP} + P_{FP}} = \frac{\alpha}{\alpha + \alpha} = \frac{1}{2},$$

y el **recall** valdría:

$$\text{recall} = P_{VP} = \alpha.$$

Por tanto, la curva **PR** correspondería a la recta horizontal $y = \frac{1}{2}$.

Curva ROC ideal y decisión ciega

