

# ***ESMA 4016 Minería de Datos***

---

Clasificación supervisada usando los vecinos  
más cercanos (KNN)

Dr. Edgar Acuna  
Departamento de Matemáticas

Universidad de Puerto Rico- Mayaguez

[academic.uprm.edu/eacuna](http://academic.uprm.edu/eacuna)

---

En el método de los  $k$  vecinos mas cercanos ("knn: k nearest neighbors") (Fix y Hodges, 1951) se estima la función de densidad que siguen los datos que se han recolectados.

Aplicado a clasificacion supervisada el metodo k-nn se usa para estimar la función de densidad condicional  $f(\mathbf{x}/C_j)$ , de las predictoras  $\mathbf{x}$  por cada clase  $C_j$ .

Es un método de clasificación noparamétrico, ya que no se hace ninguna suposición distribucional acerca de las variables predictoras.

# Estimacion de densidad univariada por knn

---

- Sea  $x_1, x_2, \dots, x_n$  una muestra con una función densidad desconocida  $f(x)$  que se desea estimar y sea  $t$  un número real. Recordar que la probabilidad de que  $x$  caiga en el intervalo  $(t-h, t+h)$ , puede ser aproximada por  $2hf(t)$ , donde  $f$  es la función de densidad y  $h$  es una constante cercana a cero.
- Por otro lado dicha probabilidad tambien puede ser estimada por  $k/n$ , donde  $k$  es el número de observaciones que caen en el intervalo  $(t-h, t+h)$ . En estimacion k-nn,  $k$  es prefijado y  $h$  se determina de acuerdo a el.
- Más formalmente, sea  $d(x,y)=|x-y|$  la distancia usual entre los puntos  $x$  e  $y$  de la linea recta.

---

Supongamos que hemos calculados todas las distancias  $d(x_i, t) = |x_i - t|$  y que estas son ordenadas de menor a mayor, tal como

$$d_1(t) \leq d_2(t) \leq \dots \leq d_n(t)$$

- Entonces el estimador de la función de densidad  $f$  en el punto  $t$  según sus  $k$  vecinos más cercanos está dado por

$$\hat{f}(t) = \frac{k}{2nd_k(t)}$$

# Ejemplo

---

Estimar usando k-nn la función de densidad correspondiente al siguiente conjunto de datos.

7.03860 6.38018 6.95461 2.25521 7.24608 6.62930 3.92734  
0.40701 5.59448 5.05751

El histograma (normalizado para que el area sea 1) de los datos se muestra en el siguiente slide.

```
hist(y,freq=F,col="green")
```

El estimador de la funcion de densidad usando un vecino mas cercano se muestra abajo

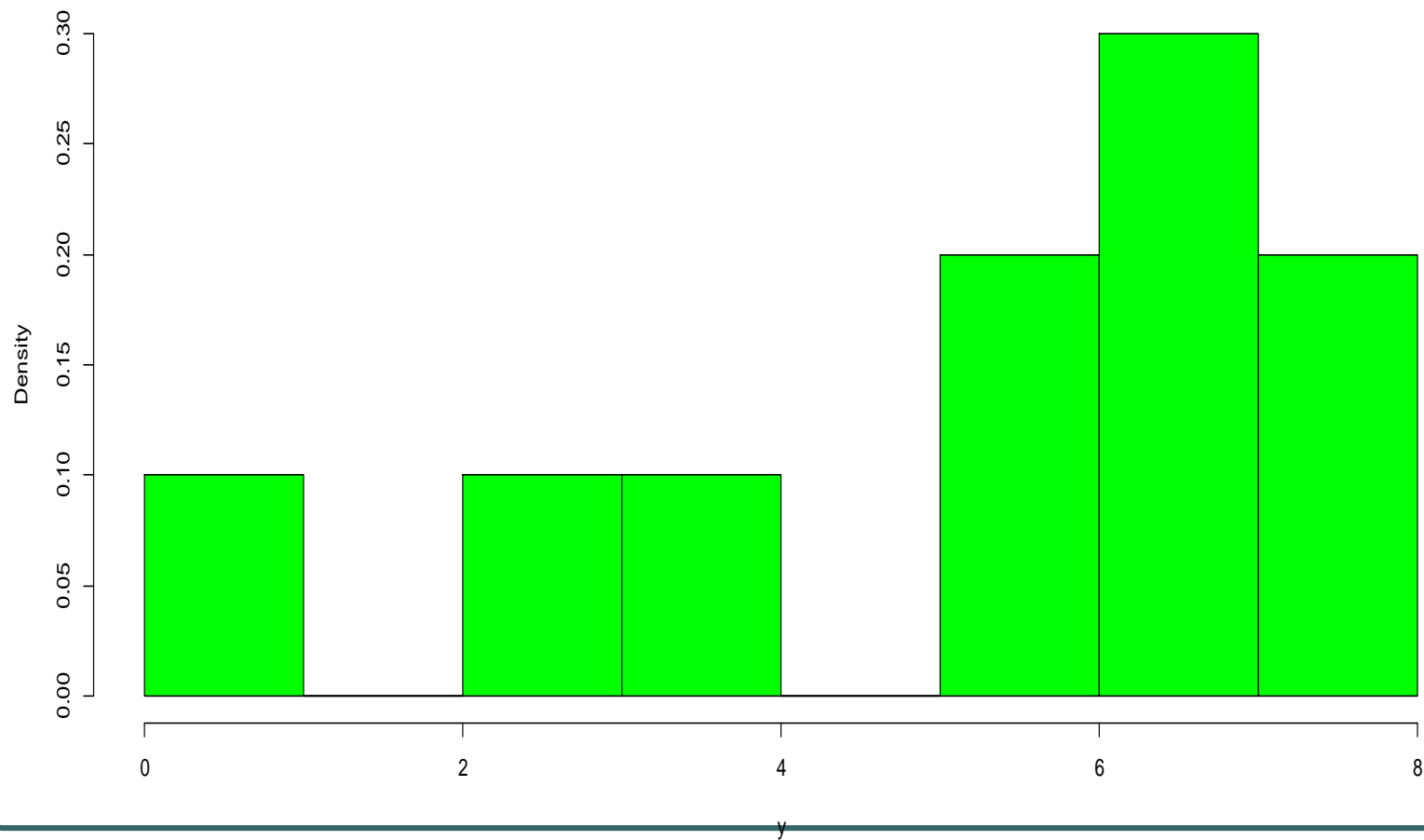
```
>y=c(7.03860,6.38018,6.95461,2.25521,7.24608,6.62930,3.92734,0.40701,5.5  
9448,5.05751)
```

```
> fdknn(y,10,1)
```

```
[1] 0.05000000 2.79624682 0.05656350 0.50938975 0.08448023 0.12811826
```

```
[7] 0.20642959 0.50845160 2.79624682 0.05000000
```

histograma de y

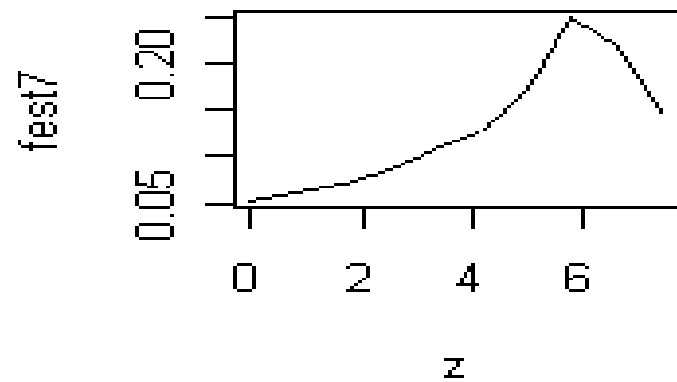
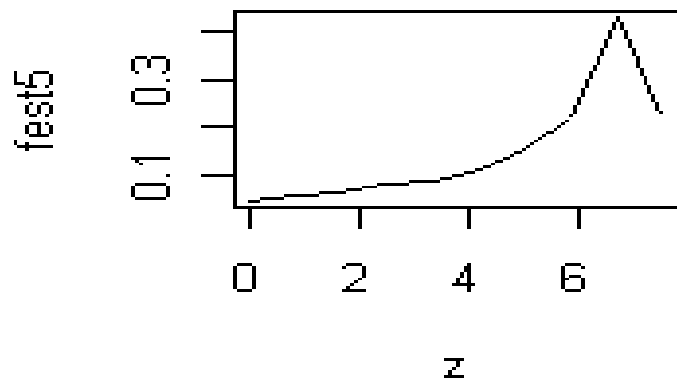
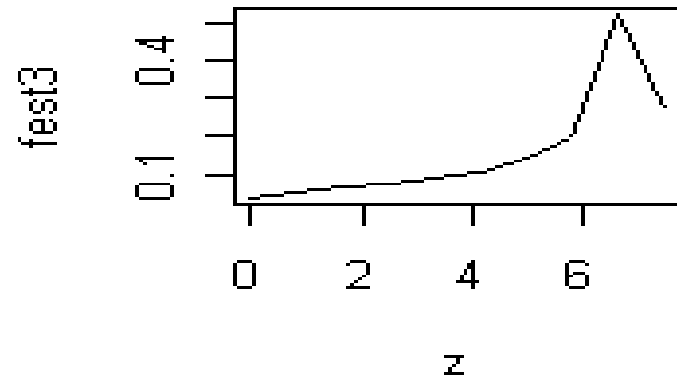
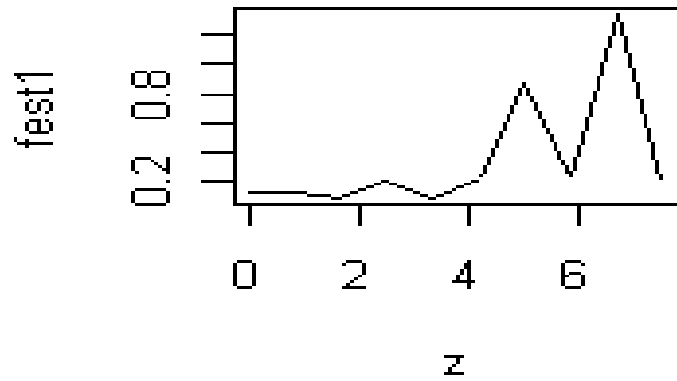


ESMA 4016

Edgar Acuna

6

## Estimador k-nn de la funcion de densidad para $k=1,3,5,7$



---

Notar que cuando  $k$  es pequeño la curva sigue mucho a los puntos (Sobreajuste) y que cuando  $k$  es grande sigue mucho a la tendencia(sub-ajuste). Las dos cosas son malas y uno tienen que buscar un termino intermedio, porque sino las predicciones serian malas.

Cuando hay sobreajuste hay poco sesgo pero mucha variabilidad.  
Cuando hay subajuste hay bastante sesgo pero poca variabilidad.

Cuando se estima el error por validacion cruzada se detecta si hay overfitting .



# Estimacion de densidad multivariada

---

- El estimado de la función de densidad tiene la forma

$$\hat{f}(\mathbf{x}) = \frac{k}{nv_k(\mathbf{x})}$$

- donde  $v_k(\mathbf{x})$  es el volumen de un elipsoide centrado en  $\mathbf{x}$  de radio  $r_k(\mathbf{x})$ , que a su vez es la distancia de  $\mathbf{x}$  al  $k$ -ésimo punto más cercano.

# El clasificador k-nn

---

Desde el punto de vista de clasificación supervisada el método k-nn es bien simple de aplicar (Cover y Hart, 1967)

En efecto, si las funciones de densidades condicionales  $f(\mathbf{x}/C_i)$  de la clase  $C_i$  que aparecen en la ecuación

$$P(C_i / \mathbf{x}) = \frac{f(\mathbf{x} / C_i) \pi_i}{f(\mathbf{x})}$$

son estimadas por k-nn. Entonces, para clasificar un objeto, con mediciones dadas por el vector  $\mathbf{x}$ , en la clase  $C_i$  se debe cumplir que

$$\frac{k_i \pi_i}{n_i v_k(\mathbf{x})} > \frac{k_j \pi_j}{n_j v_k(\mathbf{x})}$$

para  $j \neq i$ . Donde  $k_i$  y  $k_j$  son los  $k$  vecinos de  $\mathbf{x}$  en las clases  $C_i$  y  $C_j$  respectivamente.

---

Asumiendo priors proporcionales a los tamaños de las clases ( $n_i/n$  y  $n_j/n$  respectivamente) lo anterior es equivalente a:

$$k_i > k_j \text{ para } j \neq i$$

Luego, el procedimiento de clasificación sería así:

- 1) Hallar los  $k$  objetos que están a una distancia más cercana al objeto  $\mathbf{x}$ ,  $k$  usualmente es un número impar 1 o 3.
- 2) Si la mayoría de esos  $k$  objetos pertenecen a la clase  $C_i$  entonces el objeto  $\mathbf{x}$  es asignado a ella.

En caso de empate se clasifica al azar.

K-nn es un clasificador Lazy, porque no se construye un modelo para hacer la predicción.

- 
- Hay dos problemas en el método k-nn, la elección de la distancia o métrica y la elección de k.
  - La métrica más elemental que se puede elegir es la euclídeana  $d(\mathbf{x}, \mathbf{y}) = (\mathbf{x} - \mathbf{y})'(\mathbf{x} - \mathbf{y})$ . Esta métrica sin embargo, puede causar problemas si las variables predictoras han sido medidas en unidades muy distintas entre sí. Algunos prefieren rescalar los datos antes de aplicar el método. Otra distancia bien usada es la distancia Manhattan definida por  $d(\mathbf{x}, \mathbf{y}) = |\mathbf{x} - \mathbf{y}|$ . Predictoras discretas pueden ser continuizadas.
  - Enas y Choi (1996) usando simulación hicieron un estudio para determinar el k óptimo cuando solo hay dos clases presentes y determinaron que si los tamaños muestrales de las dos clases son comparables entonces  $k = n^{3/8}$  si habia poca diferencia entre las matrices de covarianzas de los grupos y  $k = n^{2/8}$  si habia bastante diferencia entre las matrices de covarianzas.

# La distancia Gower (I)

---

- La distancia Gower (Gower, 1971) entre las instancias d-dimensionales  $x_i$  y  $x_j$  esta definida por

$$dist.Gow(x_i, x_j) = \frac{\sum_{k=1}^d w_{ijk} d_{ijk}}{\sum_{k=1}^d w_{ijk}}$$

- Si la k-esima variable es nominal entonces  $d_{ijk}=0$  si  $x_{ik}=x_{jk}$  y 1 en caso contrario . Los  $w_{ijk}=1$
- Si la k-esima variable es logica o binaria asimetrica entonces  $d_{ijk}=0$  si  $x_{ik}=x_{jk} = \text{TRUE}$ , y 1 en caso contrario . Los  $w_{ijk}$  seran 1 en todos los casos excepto cuando  $x_{ik}=x_{jk} = \text{FALSE}$  en cuyo caso valen 0.
- Si la k-esima variable es continua u ordinal entonces  $d_{ijk}=|x_{ik}-x_{jk}|/\text{rango}(x_k)$ . Los  $w_{ijk}=1$ . Tambien si  $x_{ik}$  o  $x_{jk}$  o ambos estan "missing" entonces  $w_{ijk}$  vale 0.

# La Distancia Gower

---

La funcion `gower.dist` del paquete `StatMatch` de R calcula la distancia gower

`Gower.dist(ejearbol)`

Otra manera de lidiar con variables nominales es usar variables binarias para representarlas (scikit-learn). Asi si una variable nominal asume  $k$  valores distintos se pueden usar  $k-1$  variables binarias para representarlas.

Wilson y Martinz (1997 y 2000) tambien han propuesto tres otras medidas: HVDM, IVDM, WVDM

Wojna (2005), modifiko la distancia WVDM y la llamo DWVDM

- 
- El sesgo del error de clasificación aumenta a medida que  $k$  aumenta, en tanto que la varianza disminuye (subajuste).
  - La tasa de error tiende a aumentar cuando se elige un mayor numero de vecinos.
  - Se ha demostrado (Cover y Hart, 1967) que la tasa de error del clasificador  $k$ -nn es a lo más dos veces la tasa de error óptimo (error del clasificador Bayesiano donde las posteriores son conocidas).

## Ejemplo: Datos de notas

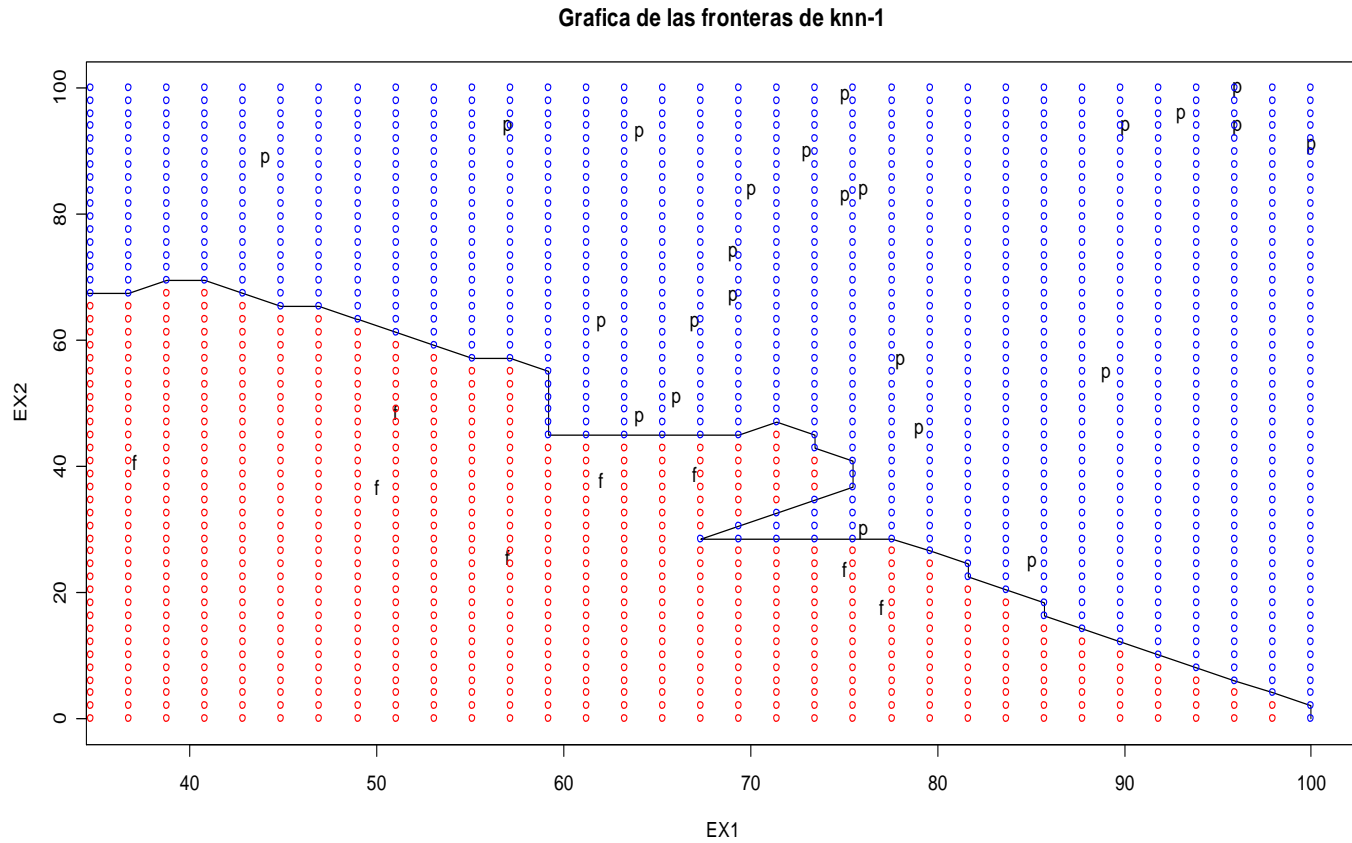
```

eye1dis=read.table("http://math.uprm.edu/~edgar/eje1disc.dat",header=T)
> knn(eye1dis[,1:2],eye1dis[,1:2],eye1dis[,4],k=1)
[1] p p p p p p p p p p p p p p p p p p p p p p p f f f f f f f
Levels: f p
># error de clasificacion con k=1 vecinos
> exak1=knn(eye1dis[,1:2],eye1dis[,1:2],eye1dis[,4],k=1)
> mean(exak1!=eye1dis[,4])
[1] 0
> knn(eye1dis[,1:2],eye1dis[,1:2],eye1dis[,4],k=5)
[1] p p p p p p p p p p p p p p p f p p p p f p p p f f p f f f f
Levels: f p
># error de clasificacion con k=5 vecinos
>exak5=knn(eye1dis[,1:2],eye1dis[,1:2],eye1dis[,4],k=5)
> mean(exak5!=eye1dis[,4])
[1] 0.09375

```

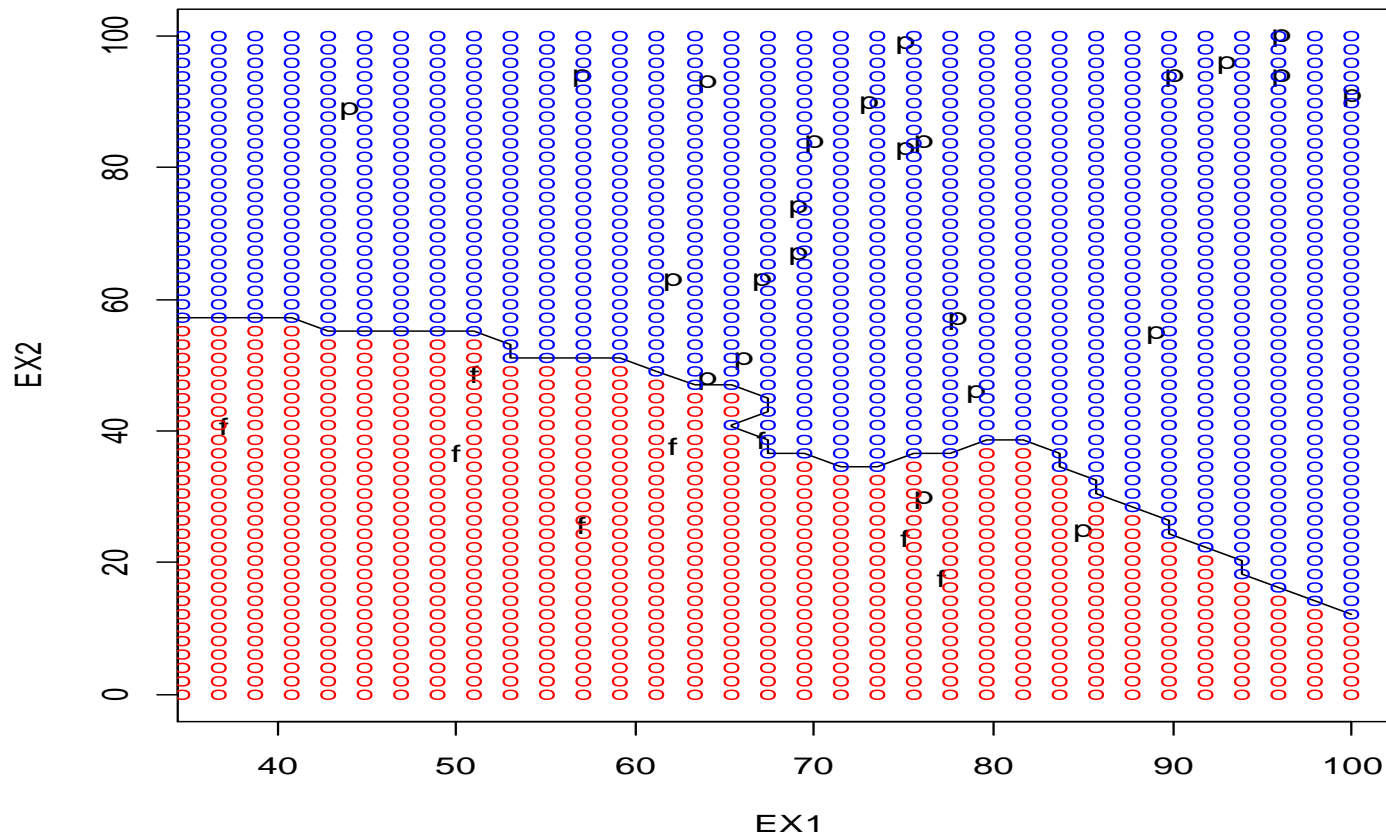


# Ejemplo: Frontera de decision



# Ejemplo: Frontera de decision

Grafica de las fronteras de knn-7



# Ejemplo de knn: Bupa

---

```
> knn(bupa[,1:6],bupa[,1:6],bupa[,7],k=3)
[1] 2 2 2 2 2 2 1 1 1 1 2 2 2 1 1 2 1 1 2 1 1 1 1 1 2 1 1 1 2 1 1 1 2 1 2 1
[38] 2 2 2 2 2 1 2 1 2 2 2 1 2 1 1 2 2 2 2 2 1 2 1 2 2 2 2 1 1 2 2 2 2 2 1 1 1
[75] 1 1 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 1 1 1 1 1 1 1 1 2 2 2 2 2 2 2 1 1 1 1 1 1 1 1 1
[112] 2 2 2 2 2 2 2 1 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 1 1 2 2 2 2 2 2 2 1 2 1 1 2 1 2 2
[149] 1 1 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 1 2 2 1 1 2 1 1 2 1 2 2 1 2 2 1 1 2 2
[186] 2 1 2 2 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 2 1 1 1 1 1 1 2 2 1 1 1 1 2 1 2 2 2 2 2
[223] 1 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 1 1 1 1 2 2 2 1 2 2 1 2 1 1
[260] 2 1 2 1 2 2 2 2 2 1 2 2 1 2 1 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 1 1 2 1 2 2 2 2 2
[297] 2 1 1 2 1 2 2 2 2 2 2 1 2 2 2 1 2 1 1 1 1 1 2 2 2 2 2 2 1 1 1 1 2 2 2 1 2
[334] 2 1 2 2 2 1 2 2 1 1 1 2
Levels: 1 2
Error de mala clasificacion por resustitucion
> mean(knn(bupa[,1:6],bupa[,1:6],bupa[,7],k=3)!=bupa[,7])
[1] 0.1971014
```

# Ejemplo (cont)

---

```
> bupak1=knn(bupa[,-7],bupa[,-7],as.factor(bupa[,7]),k=1)
```

```
> table(bupak1,bupa[,7])
```

```
bupak1  1  2  
  1   145  0  
  2     0 200
```

```
error=0%
```

```
> bupak3=knn(bupa[,-7],bupa[,-7],as.factor(bupa[,7]),k=3)
```

```
> table(bupak3,bupa[,7])
```

```
  bupak3  1  2  
    1     106 29  
    2      39 171
```

```
error=19.71%
```

```
> bupak5=knn(bupa[,-7],bupa[,-7],as.factor(bupa[,7]),k=5)
```

```
> table(bupak5,bupa[,7])
```

```
bupak5  1  2  
  1   94 23  
  2   51 177
```

```
error=21.44%
```

## Ejemplo (cont.)

---

```
> mean(knn.cv(bupa[,1:6],bupa[,7],k=5)!=bupa[,7])  
[1] 0.3391304  
> mean(knn.cv(bupa[,1:6],bupa[,7],k=7)!=bupa[,7])  
[1] 0.3130435  
> mean(knn.cv(bupa[,1:6],bupa[,7],k=9)!=bupa[,7])  
[1] 0.3043478  
> mean(knn.cv(bupa[,1:6],bupa[,7],k=11)!=bupa[,7])  
[1] 0.3188406  
> crossval(bupa,method="knn",kvec=7,rep=10)  
[1] 0.3133333  
> crossval(bupa,method="knn",kvec=9,rep=10)  
[1] 0.3084058  
> crossval(bupa,method="knn",kvec=11,rep=10)  
[1] 0.3226087
```

# Ejemplo de knn: diabetes

---

```
> diabk3=knn(diabetes[,-9],diabetes[,-9],as.factor(diabetes[,9]),k=3)
> table(diabk3,diabetes[,9])
```

```
diabk1  1  2
      1 459 67
      2  41 201
```

error=14.06%

```
> diabk5=knn(diabetes[,-9],diabetes[,-9],as.factor(diabetes[,9]),k=5)
> table(diabk5,diabetes[,9])
```

```
diabk1  1  2
      1 442 93
      2  58 175
```

error=19.66

# Reduciendo el tiempo de corrida de k-nn

---

- Complejidad  $O(ndk)$ , donde  $n$  es el numero de instancias,  $d$  el numero de atributos predictores y  $k$  el numero de vecinos.
- Uso de kd-trees(1975)(scikit-learn). Baja la complejidad a  $(kd\log(n))$ . Se deteriora cuando la dimensionalidad aumenta ( $d > 30$ ). (Paquete RANN)
- Uso de Local Sensitivity Hashing (LSH) (2005). que es un algoritmo aleatorio que encuentra los vecinos mas cercanos con alta probabilidad.

## Otro clasificador noparametrico

---

- Estimacion de densidad por kernel. Pero su mayor desventaja es que es pesado computacionalmente. El mas usado es el kernel gaussiano.
- Los metodos noparametricos por lo general afrontan el problema de la maldicion de la dimensionalidad. El numero de datos debe crecer casi exponencialmente al numero de la dimension para que la estimacion sea buena.