

Estudio del grado de marginación por medio de análisis de componentes principales y k medias

Equipo 3

5/12/2020

Objetivo

Se usará análisis de componentes principales para reducir la dimensión de los 9 indicadores socioeconómicos que forman al índice de marginación, una vez se tenga la reducción de dimensiones se recreará el índice de marginación del Consejo Nacional de la Población. Además se realizarán agrupaciones por el método de k-medias con las variables originales y las obtenidas por el método de componentes principales.

Índice de marginación CONAPO

Desde 1990 el CONAPO emprendió esfuerzos sistemáticos para construir indicadores con el objetivo de analizar las desventajas sociales de la población e identificar con precisión espacios mayormente marginados, diferenciándolos según su intensidad de carencias, el resultado fue el índice de marginación.

El índice de marginación es un parámetro estadístico que contribuye a la identificación de sectores del país que carecen de oportunidades para su desarrollo y de la capacidad para encontrarlas o generarlas.

Indicadores socioeconómicos del índice de marginación

- Educación:
 - Porcentaje de población analfabeta
 - Porcentaje de población sin primaria completa
- Vivienda:
 - Porcentaje de ocupantes en viviendas sin agua entubada
 - Porcentaje de ocupantes en viviendas sin drenaje ni servicio sanitario exclusivo
 - Porcentaje de ocupantes en viviendas sin drenaje ni excusado
 - Porcentaje de ocupantes en viviendas con algún nivel de hacinamiento
 - Porcentaje de ocupantes en viviendas sin energía eléctrica
 - Porcentaje de ocupantes en viviendas con piso de tierra
- Distribución de la población:
 - Porcentaje de población en localidades con menos de 5,000 habitantes
- Ingresos:
 - Porcentaje de población ocupada con ingresos de hasta dos salarios mínimos

Análisis de componentes principales

Definición y origen de los componentes principales

Sea x un vector de p variables de donde se desea estudiar la estructura de las covarianzas o correlaciones entre las variables.

El análisis de componentes principales se enfoca en las varianzas de las variables, aunque no ignora las correlaciones ni covarianzas de estas. El primer paso es obtener una función lineal de la forma $\alpha_1'x$ de los elementos de x que explique la varianza máxima, donde α_1 es un vector de p constantes $\alpha_{11}, \alpha_{12}, \dots, \alpha_{1p}$, es decir:

$$\alpha_1'x = \alpha_{11}x_1 + \alpha_{12}x_2 + \dots + \alpha_{1p}x_p = \sum_{j=1}^p \alpha_{1j}x_j,$$

Después se debe de obtener otra función lineal $\alpha_2'x$ no correlacionada con la función $\alpha_1'x$ que también explique la máxima varianza posible. Así, sucesivamente se irán obteniendo estas funciones lineales hasta obtener la k -ésima función lineal $\alpha_k'x$ que al igual que las $k-1$ funciones lineales obtenidas anteriormente, que explique la máxima varianza posible, siendo ésta no correlacionada con $\alpha_1'x, \alpha_2'x, \dots, \alpha_{k-1}'x$. La k -ésima función corresponde al k -ésimo componente principal. Se pueden encontrar hasta p componentes principales pero se desea, en general, que la máxima varianza se encuentre en m componentes principales siendo $m \leq p$. El caso más simple es cuando se tienen dos componentes principales, pues las observaciones pueden ser visualizadas en un plano. Cuando se tienen más componentes principales, la visualización de éstos se dificulta. A lo más se pueden visualizar claramente hasta 3 dimensiones, es decir, hasta 3 componentes. Cuando hay más se podrían visualizar planos de nivel pero se perdería la interpretación.

Ya definidos los componentes principales, debemos saber como encontrarlos. Consideremos que el vector de variables aleatorias X tiene matriz de covarianzas Σ conocida. Esta matriz, cuyo (i, j) -ésimo elemento corresponde a la covarianza entre los elementos i y j de X cuando $i \neq j$, cuando $i = j$ el elemento $(i, j) = (i, i)$ corresponde a la varianza. Cuando Σ es desconocida, se reemplaza por la matriz S . Para $k = 1, 2, \dots, p$ el k -ésimo componente principal se define de la forma $z_k = \alpha_k'x$, donde α_k es el eigenvector o vector propio de Σ correspondiente al k -ésimo eigenvalor o valor propio más grande λ_k .

Se resuelve un problema de optimización para encontrar el valor de los loadings con los que se maximiza la varianza. Una forma de resolver esta optimización es mediante el cálculo de eigenvector-eigenvalue de la matriz de covarianzas.

Propiedades de los componentes principales y sus implicaciones

Sea z el vector cuyo k -ésimo elemento es z_k correspondiente al k -ésimo componente principal para $k = 1, 2, \dots, p$ entonces

$$z = A'x,$$

en donde A es la matriz ortogonal cuya k -ésima columna, α_k , es el k -ésimo vector propio de Σ . Así, los componentes principales son definidos de una transformación lineal ortonormal de X .

¿Cuántos componentes principales seleccionar?

En esta sección se presentarán las reglas para decidir con cuántos componentes principales se deberían conservar para retener la mayor varianza posible en x (o en las variables estandarizadas x^* en el caso de estudiar componentes principales con la matriz de correlación).

Porcentaje acumulado de la varianza total

El criterio más común para seleccionar el número de componentes principales es seleccionando el porcentaje acumulado de la varianza total. Normalmente se desea que los componentes principales seleccionados contribuyan entre 80% y 90%. El número requerido de componentes principales es el valor más pequeño m para el cual este porcentaje se ha excedido. Este criterio es válido para la matriz de covarianza y correlación.

Valores propios / Varianzas

Como se ha mencionado anteriormente, los valores propios miden la cantidad de varianza retenida por cada componente principal. Los valores propios son grandes para los primeros componentes principales y pequeños para los componentes subsiguientes. Esto es debido a que los primeros componentes corresponden a las direcciones con la máxima varianza en el conjunto de datos.

Los valores propios pueden ser usados para determinar el número de componentes principales:

- Un valor propio > 1 indica que el componente principal considera más varianza que la que considera la variable original estandarizada. Esto es utilizado como punto de corte para retener los componentes principales cuyos valores propios sean mayor a 1. Esto es cierto solamente cuando los datos están estandarizados.

Desafortunadamente no hay forma objetiva para decidir cuántos componentes principales son suficientes. Esto depende de cada conjunto de datos con el que se esté trabajando. En la práctica, se tiende a analizar los primeros componentes principales para encontrar patrones interesantes en los datos.

Estandarización de los datos

En el análisis de componentes principales las variables se suelen escalar (estandarizar). Esto es recomendable cuando las variables son medidas en diferentes escalas, si no se realiza la estandarización, los resultados del análisis se verán afectados. El objetivo es hacer las variables comparables. Generalmente las variables se estandarizan para que éstas cuenten con desviación estándar 1 y media cero. También se recomienda escalar los datos cuando la media y desviación estándar de las variables es muy diferente.

Cuando se escalan las variables, éstas se transforman de la siguiente manera:

$$\frac{x_i - \text{media}(x)}{\text{desv}(x)},$$

Método de Rotaciones de Jacobi para matrices simétricas

Para este proyecto no usaremos las funciones ya programadas, usaremos el método de rotaciones de Jacobi para aproximar los valores propios y los vectores propios y con estos poder calcular los componentes principales de nuestros datos.

Este método produce una secuencia de transformaciones ortogonales de la forma $J_k^T A J_k$ con el objetivo de hacer “más diagonal” a la matriz $A \in \mathbb{R}^{n \times n}$.

Si la matriz A es simétrica y J_0 es una transformación de Jacobi, entonces el esquema iterativo $A_{k+1} = (J_0 J_1 \dots J_k)^T A J_0 J_1 \dots J_k$ converge a una matriz diagonal en la que se encuentran los eigenvalores de A .

El algoritmo para matrices simétricas es:

Dados A simétrica y $tol > 0$ definimos $A_0 = A, Q_0 = I_n$, repetimos el siguiente bloque para $K = 0, 1, 2, \dots$

- 1) Elegir un par de índices $(idx1, idx2)$
- 2) Calcular las entradas $\cos(\theta), \sin(\theta)$ de la matriz de rotación J_k .
- 3) $A_{k+1} = J_k^T A_k J_k$
- 4) $Q_{k+1} = Q_k J_k$

La matriz J_k se utiliza para eliminar un par de entradas (simétricas) en la matriz A_k , esto preserva la simetría de la matriz original. En las columnas de la matriz Q_k se encuentran aproximaciones a los eigenvectores de A y en la diagonal de A_k se tienen aproximaciones a los eigenvalores de A .

El método de Jacobi es conveniente para el cálculo manual o con calculadora, pero en la práctica, en el caso de matrices de grandes dimensiones, la búsqueda del elemento de mayor valor absoluto fuera de la diagonal es muy costosa en tiempo de cálculo, tanto o más que los cálculos de la iteración en sí, por lo que es más conveniente anular los elementos fuera de la diagonal mediante ciclos sistemáticos o barridos.

En el caso de matrices de pequeña dimensión se elimina el elemento de fuera de la diagonal de mayor módulo. Para grandes dimensiones se realiza una eliminación por ciclos. Otra posibilidad es plantear el problema de diagonalizar una matriz compleja de n dimensiones como el de diagonalizar una matriz real de $2n$ dimensiones.

K-medias

El clustering de particiones son métodos de agrupamiento para clasificar observaciones en múltiples grupos basados en su similitud bajo una métrica específica. Esta técnica de aprendizaje de máquina cae dentro de la clasificación “no supervisada” debido a que el modelo que realizará las agrupaciones no es entrenado con ejemplos de los grupos objetivo.

K -medias es uno de los algoritmos no supervisados de clustering más popular para particionar datos en un conjunto de k grupos, es decir, k clusters. En donde k representa el número de grupos pre especificados por el analista. Éste algoritmo clasifica objetos en múltiples grupos tal que los objetos dentro del mismo grupo son lo más similares posibles (alta similitud dentro de las clases), mientras que los objetos de diferentes grupos son lo más disimilares posible (baja similitud entre clases). En k medias, cada cluster es representado por su centro (centroide) el cual corresponde a la media de los puntos asignados a ese grupo.

La idea básica detrás de k -medias consiste en definir grupos de tal forma que la variación total dentro de cada grupo (conocida como variación total entre clusters) se minimice.

El método de K -medias corresponde a un problema de optimización no-convexo. Dado suficiente tiempo, el método en cuestión tenderá a converger, a pesar de que sea solo a un mínimo local y sus resultados son altamente dependientes de la inicialización de los centroides. El algoritmo de k -medias toma un set de datos X compuesto por N puntos como input, así como un parámetro K que especifica el número de clusters a crear. La condición matemática para los N clusters C_k y los K centroides μ_k se puede expresar de la siguiente manera:

$$\text{Minimizar } \sum_{k=1} \sum_{x_n \in C_k} ||x_n - \mu_k||^2 \text{ con respecto a } C_k \text{ y } \mu_k$$

Algoritmo

El método de k -medias también es conocido como *Algoritmo de Lloyd*". Este es un método iterativo que alterna entre dos operaciones:

1. Una vez que un set de centroides μ_k está disponible, los clusters se actualizan para contener los puntos más cercanos en distancia a cada centroide.

$$C_k = \{x_n : ||x_n - \mu_k|| \leq \text{all } ||x_n - \mu_l||\}$$

2. Dado un set de clusters, los centroides son recalculados con base en la distancia media de todos los puntos que pertenecen al cluster.

$$\mu_k = \frac{1}{C_k} \sum_{x_n \in C_k} x_n$$

Este procedimiento de dos pasos continua hasta que la asignación de clusters y centroides no muestre un cambio significativo (o hasta que se alcance un número límite de iteraciones).

En términos simplificados, el algoritmo de k -medias se puede explicar de la siguiente manera:

1. Especificar el número de conglomerados (k) a crear (por el analista)
2. Selecciona k objetos del conjunto de datos como los centroides o medias iniciales. (*Nota: para este proyecto, se hizo uso del método de inicialización de centroides "k-means++" implementado en scikit-learn. Este selecciona puntos del data-set como centroides tomando en cuenta las distancias entre el universo de puntos y dichos centroides.*)
3. Asigna cada observación al centroide más cercano, basado en la distancia euclideana entre el objeto y el centroide.
4. Se actualiza el centroide de cada uno de los k grupos calculando los nuevos valores medios de todas las observaciones en el grupo. El centroide del k -ésimo grupo es un vector de tamaño p que contiene las medias de todas las variables para las observaciones que se encuentran en el k -ésimo grupo; p es el número de variables.
5. La suma de cuadrados se minimiza iterativamente. Esto es, se iteran los pasos 3 y 4 hasta que la asignación de grupos deje de cambiar o hasta que se cumpla el número máximo de iteraciones.

Ventajas y desventajas de k-medias

K -medias es un algoritmo simple y rápido. Puede trabajar eficientemente con grandes conjuntos de datos. Sin embargo, existen ciertas desventajas, incluyendo:

- Asume conocimiento previo de los datos y requiere que el analista elija el número apropiado de grupos.
- Los resultados finales son sensibles a la selección inicial aleatoria de centroides. Esto es un problema debido a que en cada iteración del algoritmo se seleccionará (con alta frecuencia) diferentes centroides iniciales aunque se esté trabajando con un sólo conjunto de datos. Esto puede dirigir a diferentes resultados de conglomerados en diferentes iteraciones.
- Es sensible con valores atípicos.
- Si se re acomodan los datos, es posible que se obtenga una solución diferente cada que se ordenen los datos.

Implementación

En primer lugar usamos la función que se desarrolló en la segunda parte de la práctica 1 para aproximar los valores propios y los vectores propios, después con estos vectores propios se calculan las componentes principales. Ya con los componentes principales creamos nuestro índice con el primer componente.

Se analizaron los indicadores socioeconómicos de los años 1990, 2000 y 2015, realizamos una reducción de dimensiones por medio de análisis de componentes principales. Para poder realizar esto se hizo uso del algoritmo de método de rotaciones de Jacobi estudiado en clase.

```
def sign(x):
    """
    Helper function for computing sign of real number x.
    """
    if x >= 0:
        return 1
    else:
        return -1

def compute_cos_sin_Jacobi_rotation(Ak, idx1, idx2):
    """
    Helper function for computing entries of Jacobi rotation.
    Args:
        Ak (numpy ndarray): Matrix of iteration k in Jacobi rotation method.
        idx1 (int): index for rows in Jacobi rotation matrix.
        idx2 (int): index for columns in Jacobi rotation matrix.
    Returns:
        c (float): value of cos of theta for Jacobi rotation matrix.
        s (float): value of sin of theta for Jacobi rotation matrix.
    """
    if np.abs(Ak[idx1, idx2]) > np.finfo(float).eps:
        tau = (Ak[idx2, idx2] - Ak[idx1, idx1]) / (2 * Ak[idx1, idx2])
        t_star = sign(tau) / (np.abs(tau) + np.sqrt(1 + tau**2))
        c = 1 / np.sqrt(1 + t_star**2)
        s = c * t_star
    else: #no rotation is performed
        c = 1
        s = 0
    return (c, s)

def compute_Jacobi_rotation(Ak, idx1, idx2):
    """
    Compute Jacobi rotation matrix.
    Args:
        Ak (numpy ndarray): Matrix of iteration k in Jacobi rotation method.
        idx1 (int): index for rows in Jacobi rotation matrix.
        idx2 (int): index for columns in Jacobi rotation matrix.
    Returns:
        J (numpy ndarray): Jacobi rotation matrix.
    """
    c, s = compute_cos_sin_Jacobi_rotation(Ak, idx1, idx2)
    m, n = Ak.shape
    J = np.eye(m)
    J[idx1, idx1] = J[idx2, idx2] = c
```

```

J[idx1, idx2] = s
J[idx2, idx1] = -s
return J

```

Para estos tres años se tuvieron que realizar entre 3 y 4 sweeps con las siguientes iteraciones utilizando la matriz de varianzas y covarianzas de las variables estandarizadas:

```

(1,2), (1,3), (1,4), (1,5), (1,6), (1,7), (1,8), (1,9),

(2,3), (2,4), (2,5), (2,6), (2,7), (2,8), (2,9)

(3,4), (3,5), (3,6), (3,7), (3,9), (3,9),

(4,5), (4,6), (4,7), (4,8), (4,9),

(5,6), (5,7), (5,8), (5,9),

(6,7), (6,8), (6,9),

(7,8), (7,9),

(8,9)

```

Una vez realizados los sweeps obtenemos la matriz A diagonalizada, en esta matriz se encuentran los valores propios de la matriz de covarianzas. Decidimos comparar los valores propios obtenidos por nuestra función con los valores propios obtenidos por la función de Python `np.linalg.eig()`. Observamos que nuestros resultados son aproximadamente iguales a los valores propios proporcionados a la función de `numpy`.

Para obtener la matriz de vectores propios utilizamos la siguiente función:

```

def compute_Jacobi_eigenvectors(A, tol, max_sweeps):
    """
    Compute Jacobi rotation matrix.
    Args:
        Ak (numpy ndarray): Matrix of iteration k in Jacobi rotation method.
        tol (float): Tolerance to stop the iteration
        max_sweeps (int): Maximum number of times the cycle is done.
    Returns:
        Q (numpy ndarray): Matrix that contain A's eigenvectors.
    """
    A_k = A.copy()
    m,n = A_k.shape
    Q = np.eye(m)
    sweeps = 0
    while (off(A_k) > tol*np.linalg.norm(A_k) and sweeps < max_sweeps + 1):
        sweeps += 1
        for i in range(A_k.shape[0]):
            j = i + 1
            for m in range(A_k.shape[0]-i-1):
                J = compute_Jacobi_rotation(A_k, i, j)
                A_k = J.T@A_k@J
                Q = Q @ J
                j += 1

    return Q

```

Lo siguiente que realizamos fue ordenar de manera descendente los valores propios, de tal forma que la matriz

de vectores propios contenga el vector propio cuyo valor propio es el más alto, y así sucesivamente. Para la creación de la matriz de PCA realizamos la multiplicación entre la matriz de vectores propios y los datos que contienen a los indicadores socioeconómicos estandarizados. Así obtenemos una matrix de 32×9 .

Posteriormente se analizó la varianza explicada por estas nuevas dimensiones. El porcentaje de varianza explicada se realizó de la siguiente manera en Python:

```
explained_variances = []
for i in range (len(eig)):
    explained_variances.append(eig[i]/np.sum(eig))
print(explained_variances)
```

Obtuvimos un nuevo índice de marginación con el primer componente principal, y finalmente se interpretó gráficamente el comportamiento de los primeros dos componentes principales coloreados por el grado de marginación. En la siguiente sección del reporte se mostrarán los resultados obtenidos.

Para la clasificación de estos estados se utilizarán K-medias seleccionando 5 grupos que hacen referencia a los grados de marginación **Muy bajo**, **Bajo**, **Medio**, **Alto** y **Muy alto**. Por medio de matrices de confusiones analizaremos el índice creado con la primer componente principal, se desea que estos nuevos componentes agrupen a los estados según su grado de marginación, es decir, parecido a la agrupación de k-medias obtenida por los 9 indicadores socioeconómicos .

La función realizada para este análisis de conglomerados es la siguiente:

```
def adding_cluster_feature(df_sel, df_type):
    if df_type == "orig":
        features = original_features
    elif df_type == "pca":
        features = pca_features

    else:
        print("Invalid 'df_type' parameter specified.")
        raise

    feats = [feat for feat in features if
              (features[feat]["feature"] == True) &
              (features[feat]["selected"] == True)
              ]

    print("Features fed for clustering analysis ({}):".format(len(feats)))
    i = 1
    for f in feats:
        print("{}.".format(i, f))
        i += 1

    kmeans = KMeans(n_clusters=5)
    df_sel["cluster"] = kmeans.fit_predict(df_sel.loc[:, feats])
    return df_sel
```

Entre otras funciones auxiliares que nos ayudaron a interpretar estos clusters de manera visual.

Resultados

A continuación se mostrarán los resultados obtenidos de K-medias utilizando los 9 indicadores socioeconómicos en una matriz de confusión. Posteriormente mostraremos los resultados obtenidos de componentes principales como valores propios, matriz de componentes principales y una representación visual en dos dimensiones de los componentes principales que suponemos fueron los que mejor agruparon a las 32 observaciones.

Año 1990

Clasificación original de los estados:

		0_muy_bajo	1_bajo	2_medio	3_alto	4_muy_alto
1990	0	Baja California	Aguascalientes	Nayarit	Campeche	Chiapas
	1	Distrito Federal	Baja California Sur	Quintana Roo	Durango	Guerrero
	2	Nuevo León	Coahuila de Zaragoza	Sinaloa	Guanajuato	Hidalgo
	3	-	Colima	Tlaxcala	Michoacán de Ocampo	Oaxaca
	4	-	Chihuahua	-	Querétaro	Puebla
	5	-	Jalisco	-	San Luis Potosí	Veracruz de Ignacio de la Llave
	6	-	México	-	Tabasco	-
	7	-	Morelos	-	Yucatán	-
	8	-	Sonora	-	Zacatecas	-
	9	-	Tamaulipas	-	-	-

La tabla anterior nos muestra la clasificación dada por el índice de marginación del CONAPO, tenemos 3 estados clasificados como “Muy_bajo”, 10 estados como “Bajo”, 4 como “medio”, 9 como “Alto” y 6 como “muy_alto”.

K-medias utilizando los indicadores socioeconómicos

Ya conocemos el número de grupos que tenemos, por lo que no es necesario experimentar con este. Si formamos grupos con las variables originales obtenemos lo siguiente:

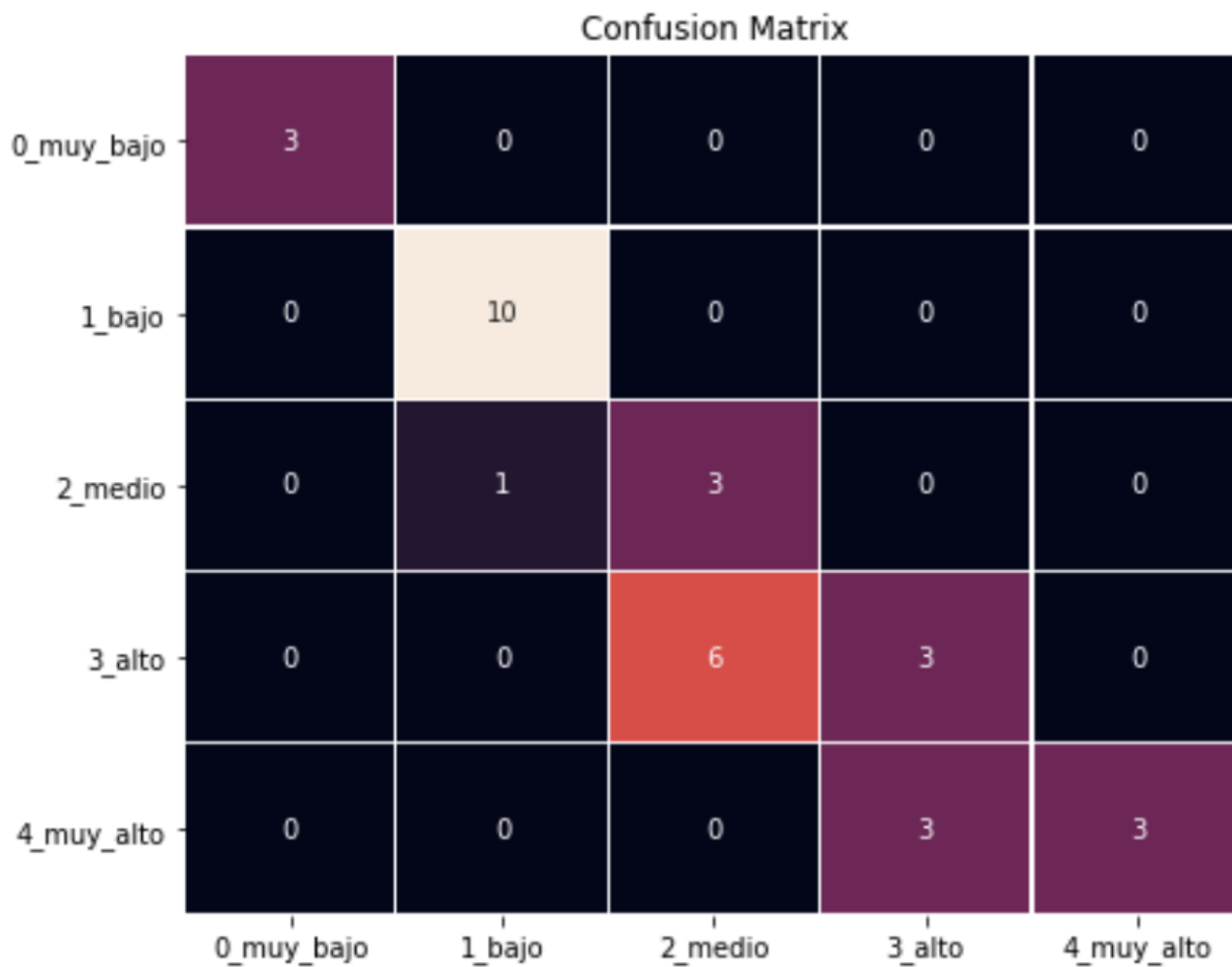
Clasificación usando features originales (9):

		0_muy_bajo	1_bajo	2_medio	3_alto	4_muy_alto
1990	0	Baja California	Aguascalientes	Campeche	Hidalgo	Chiapas
	1	Distrito Federal	Baja California Sur	Durango	Puebla	Guerrero
	2	Nuevo León	Coahuila de Zaragoza	Guanajuato	San Luis Potosí	Oaxaca
	3	-	Colima	Michoacán de Ocampo	Tabasco	-
	4	-	Chihuahua	Nayarit	Veracruz de Ignacio de la Llave	-
	5	-	Jalisco	Querétaro	Zacatecas	-
	6	-	México	Sinaloa	-	-
	7	-	Morelos	Tlaxcala	-	-
	8	-	Quintana Roo	Yucatán	-	-
	9	-	Sonora	-	-	-
	10	-	Tamaulipas	-	-	-
	-----	-----	-----	-----	-----	-----
	Correct	3	10	3	3	3
	Incorrect	0	1	6	3	0
	Missing	0	0	1	6	3

Es sencillo ver el desempeño del algoritmo con la tabla agregada, notamos que la clasificación se complica en estados que tienen clasificación de “Medio” a “Muy alto”.

Matriz de confusión

Matriz de confusión usando features originales (9):



Con la matriz de confusión es aun más sencilla observar el desempeño del modelo.

PCA

Valores propios

```
a = []
for i in range(0,9):
    a.append(pd.DataFrame(A_8_9).loc[i,i].round(4))

eig = sorted(a, reverse=True)
eig
```

[7.3004, 0.6108, 0.4312, 0.3255, 0.2333, 0.1452, 0.1176, 0.0899, 0.0365]

```
values, vectors = np.linalg.eig(var_cov)
sorted(values.round(4), reverse=True)
```

[7.3004, 0.6108, 0.4312, 0.3255, 0.2333, 0.1452, 0.1176, 0.0899, 0.0365]

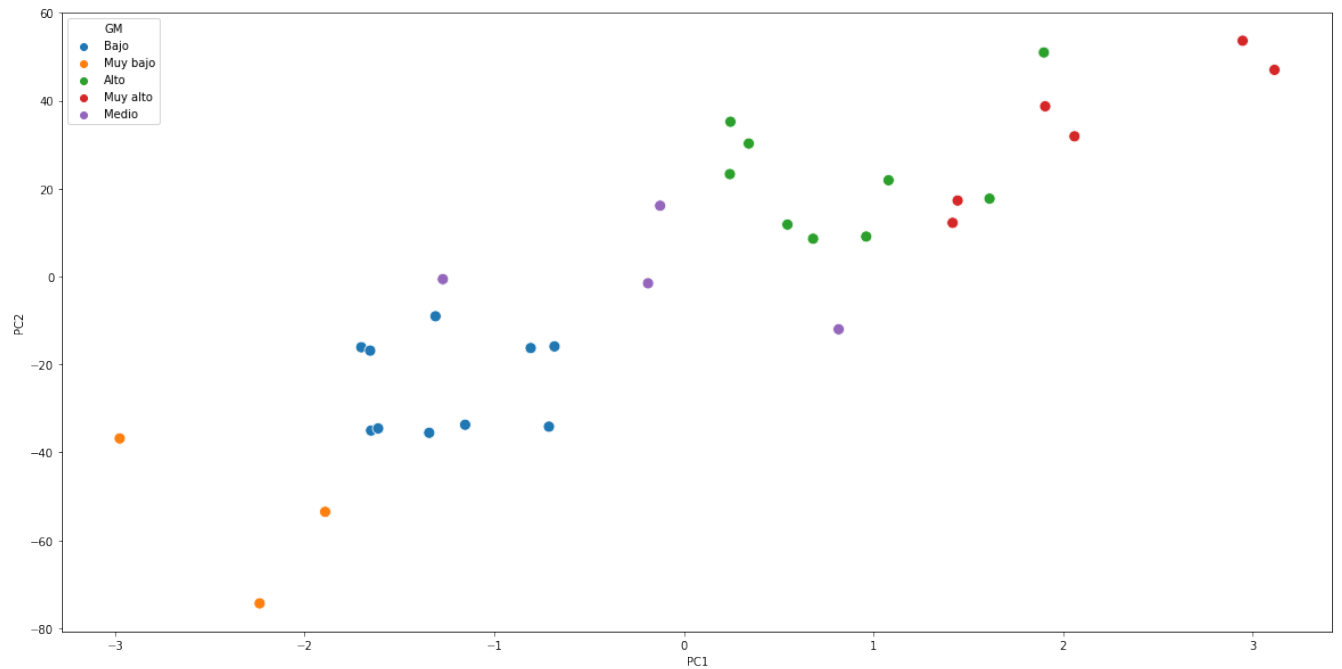
Con la imagen anterior notamos que los valores propios obtenidos con la aproximación de Jacobi son muy parecidos a los obtenidos con la función `np.linalg.eig` de numpy.

Componentes principales

##	PC1	PC2	PC3	PC4	PC5	PC6	PC7	PC8	PC9	GM
## 1	-0.808	-0.508	0.283	-0.355	-0.890	-0.295	-0.372	-1.767	-1.391	Bajo
## 2	-2.976	-1.151	-0.807	0.547	-3.213	0.177	-1.085	-1.847	0.083	Muy bajo
## 3	-1.650	-1.095	-0.438	0.102	-1.742	-0.088	-0.747	-1.336	-0.905	Bajo
## 4	0.682	0.269	-0.133	0.056	1.062	0.022	0.360	0.720	0.625	Alto
## 5	-1.343	-1.111	0.292	-0.209	-1.422	-0.478	-0.356	-1.722	-1.110	Bajo
## 6	-1.702	-0.502	-0.456	-1.206	-1.215	0.252	-1.023	-1.153	-0.268	Bajo
## 7	2.948	1.676	-0.976	0.171	3.574	0.840	2.036	4.103	1.528	Muy alto
## 8	-1.655	-0.526	-0.464	0.343	-1.890	-0.318	-0.400	-1.347	-0.679	Bajo
## 9	-2.238	-2.323	0.537	-0.287	-2.316	-0.444	-0.268	-2.720	-1.480	Muy bajo
## 10	0.546	0.370	0.562	0.331	-0.045	-0.859	-0.124	0.189	-0.861	Alto
##	IM									
## 1	-0.89									
## 2	-1.34									
## 3	-0.97									
## 4	0.48									
## 5	-1.05									
## 6	-0.76									
## 7	2.36									
## 8	-0.87									
## 9	-1.69									
## 10	0.01									

Observamos los primeros 10 valores de cada componente principal, para la construcción del índice solo fue necesario usar la primera componente principal.

Gráfica dos dimensiones



Una ventaja de las componentes principales es que nos ayudan a la visualización, podemos pasar de 9 dimensiones a 2 o 3 dimensiones y poder visualizar los datos. Podemos observar que la separación usando las primeras dos componentes es muy buena, ya que podemos apreciar los grados de marginación bien separados. Notamos cierto empalme entre los estados con grado de marginación alto y muy alto.

K-medias utilizando componentes principales

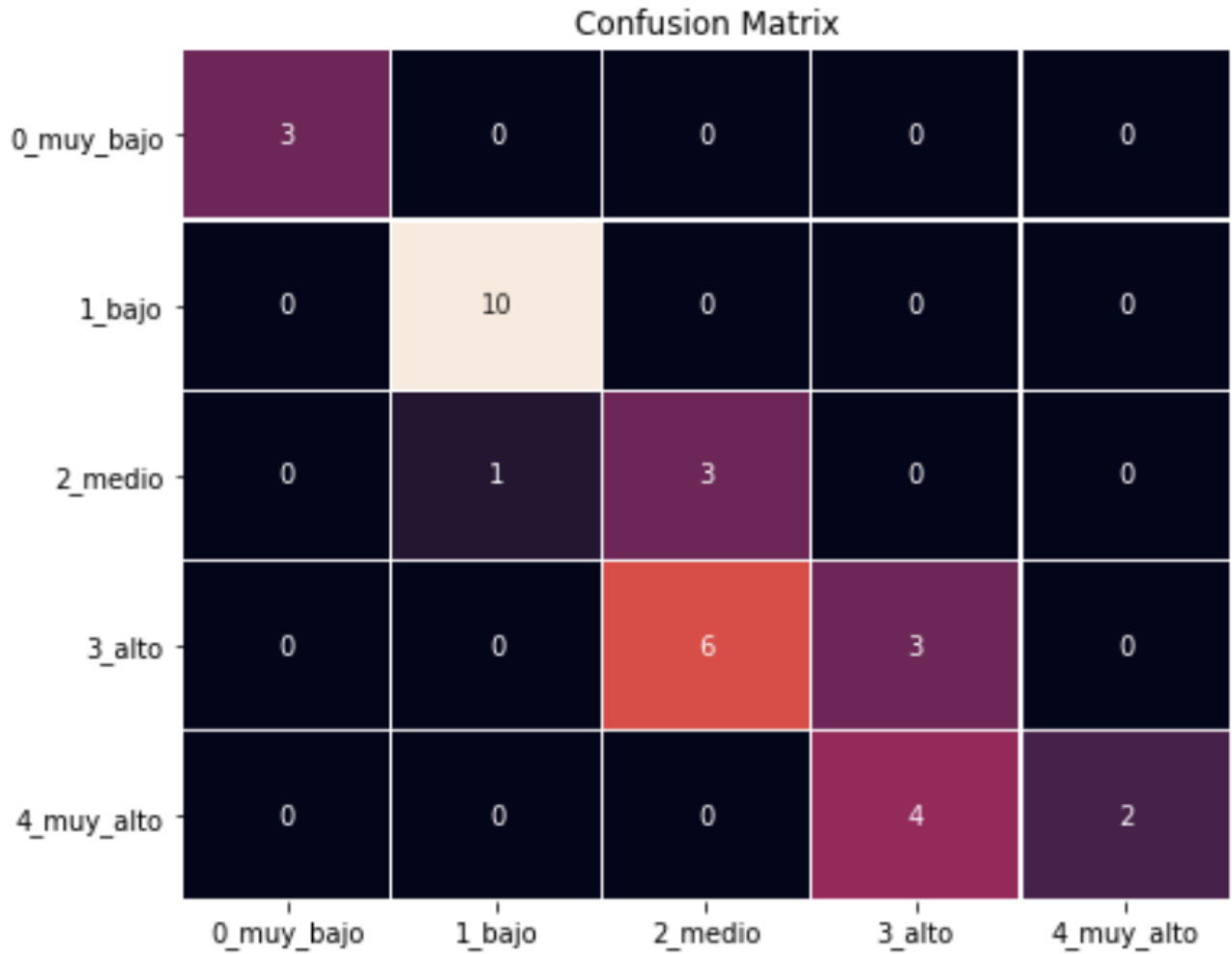
Clasificación usando componentes principales (5):

		0_muy_bajo	1_bajo	2_medio	3_alto	4_muy_alto
1990	0	Baja California	Aguascalientes	Campeche	Guerrero	Chiapas
	1	Distrito Federal	Baja California Sur	Durango	Hidalgo	Oaxaca
	2	Nuevo León	Coahuila de Zaragoza	Guanajuato	Puebla	-
	3	-	Colima	Michoacán de Ocampo	San Luis Potosí	-
	4	-	Chihuahua	Nayarit	Tabasco	-
	5	-	Jalisco	Querétaro	Veracruz de Ignacio de la Llave	-
	6	-	México	Sinaloa	Zacatecas	-
	7	-	Morelos	Tlaxcala	-	-
	8	-	Quintana Roo	Yucatán	-	-
	9	-	Sonora	-	-	-
	10	-	Tamaulipas	-	-	-
	-----	-----	-----	-----	-----	-----
	Correct	3	10	3	3	2
	Incorrect	0	1	6	4	0
	Missing	0	0	1	6	4

Usando componentes principales obtenemos resultados parecidos que con la variables originales, la clasificación sigue sin ser clara en los grupos de “Medio” a “Muy alto”.

Matriz de confusión

Clasificación usando componentes principales (5):



Al igual que en las variables originales los grupos que se forman con una clasificación de “Muy bajo” y “Bajo” están mejor definidos que los grupos de de las clasificaciones restantes.

Año 2000

Clasificación original de los estados:

		0_muy_bajo	1_bajo	2_medio	3_alto	4_muy_alto
2000	0	Baja California	Aguascalientes	Durango	Campeche	Chiapas
	1	Coahuila de Zaragoza	Baja California Sur	Morelos	Guanajuato	Guerrero
	2	Distrito Federal	Colima	Querétaro	Michoacán de Ocampo	Hidalgo
	3	Nuevo León	Chihuahua	Quintana Roo	Nayarit	Oaxaca
	4	-	Jalisco	Sinaloa	Puebla	Veracruz de Ignacio de la Llave
	5	-	México	Tlaxcala	San Luis Potosí	-
	6	-	Sonora	-	Tabasco	-
	7	-	Tamaulipas	-	Yucatán	-
	8	-	-	-	Zacatecas	-

Notamos que para el año 2000, el estado de Durango pasó de tener un gardo de marginación “Alto” a un grado “Medio”, mientras que Puebla pasó de tener un grado de marginación “Muy alto” a “Alto” y finalmente el estado de Coahuila pasó de tener un gardo de marginación “Bajo” a “Muy bajo”.

K-medias utilizando los indicadores socioeconómicos

Clasificación usando features originales (9):

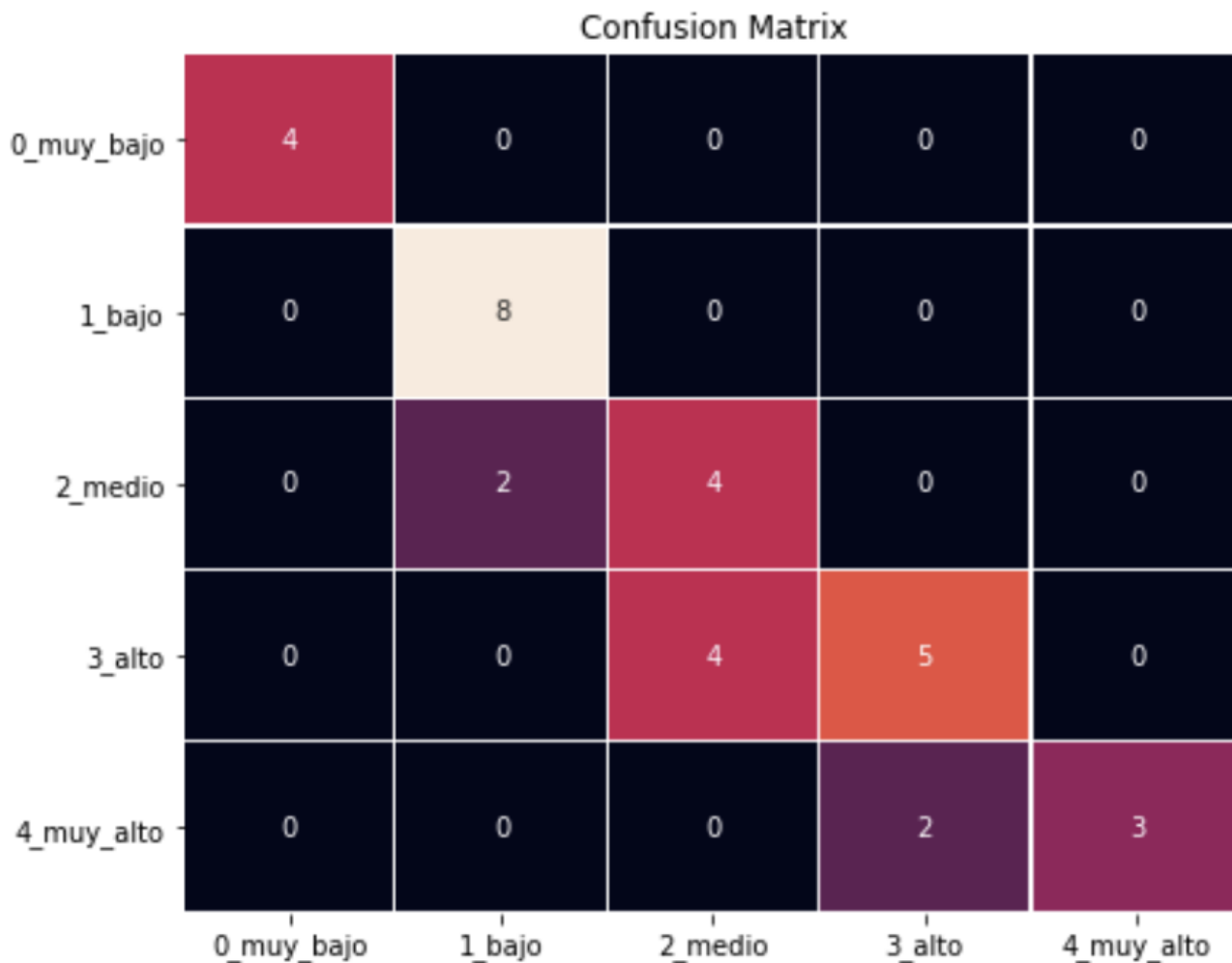
		0_muy_bajo	1_bajo	2_medio	3_alto	4_muy_alto
2000	0	Baja California	Aguascalientes	Durango	Campeche	Chiapas
	1	Coahuila de Zaragoza	Baja California Sur	Guanajuato	Hidalgo	Guerrero
	2	Distrito Federal	Colima	Michoacán de Ocampo	Puebla	Oaxaca
	3	Nuevo León	Chihuahua	Nayarit	San Luis Potosí	-
	4	-	Jalisco	Querétaro	Tabasco	-
	5	-	México	Sinaloa	Veracruz de Ignacio de la Llave	-
	6	-	Morelos	Tlaxcala	Zacatecas	-
	7	-	Quintana Roo	Yucatán	-	-
	8	-	Sonora	-	-	-
	9	-	Tamaulipas	-	-	-
	-----	-----	-----	-----	-----	-----
	Correct	4	8	4	5	3
	Incorrect	0	2	4	2	0
	Missing	0	0	2	4	2

Observamos que las tasas de error de agrupación más grandes corresponden a los grados “Medio” y “Alto”

seguido del grado “Muy alto”. Por otro lado el algoritmo de K-medias agrupó de manera exacta a los 4 estados de la República con los grados de marginación mas bajos.

Matriz de confusión

Matriz de confusión usando features originales (9):



Esta matriz de confusión es una manera visual de interpretar el agrupamiento de los estados, la interpretación es la misma a la explicada en la tabla anterior.

PCA

Valores propios

```
eg_val = compute_Jacobi_iterative(var_cov, 4, 10**(-8))
```

```
a = []  
for i in range(0,9):  
    a.append(pd.DataFrame(eg_val).loc[i,i].round(4))
```

```
eig = sorted(a, reverse=True)  
eig
```

```
[7.3544, 0.6511, 0.4141, 0.2976, 0.2154, 0.1358, 0.1162, 0.069, 0.0367]
```

```
values, vectors = np.linalg.eig(var_cov)  
sorted(values.round(4), reverse=True)
```

```
[7.3544, 0.6511, 0.4141, 0.2976, 0.2154, 0.1358, 0.1162, 0.069, 0.0367]
```

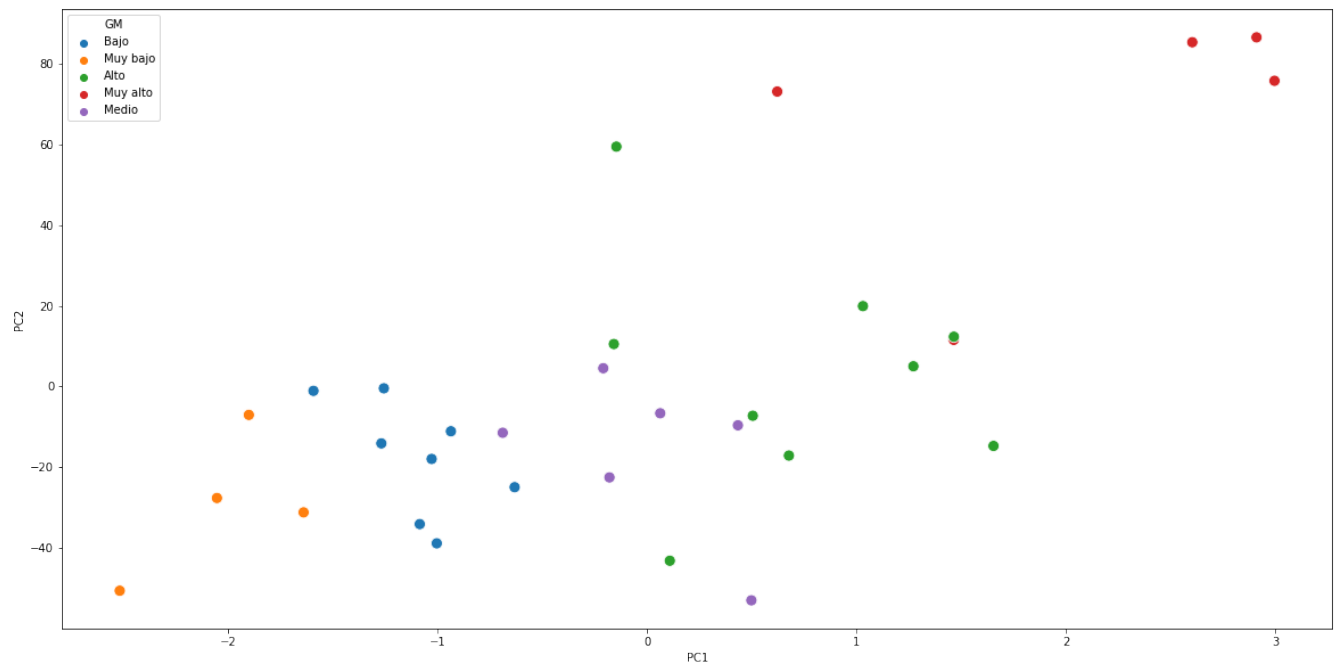
Observamos que solamente contamos con un valor propio mayor a uno, si nuestro criterio de selección de componentes a trabajar es por medio de eigen valores se seleccionaria solamente la primera componente principal.

Componentes principales

##	PC1	PC2	PC3	PC4	PC5	PC6	PC7	PC8	PC9	IM	GM
## 1	-1.005	-1.215	-0.573	-1.164	1.058	1.187	0.100	0.477	-0.250	-0.97	Bajo
## 2	-1.902	-0.219	-1.491	-1.856	1.265	1.133	-0.264	0.834	-0.780	-1.27	Muy bajo
## 3	-1.257	-0.014	-0.264	-1.327	0.959	0.964	-0.188	0.472	-0.361	-0.80	Bajo
## 4	-0.159	0.329	0.780	1.326	-1.197	-0.423	-0.609	0.280	0.615	0.70	Alto
## 5	-1.641	-0.975	-0.959	-1.702	0.941	1.209	0.214	0.714	-0.601	-1.20	Muy bajo
## 6	-0.633	-0.780	-0.478	-0.550	0.324	1.104	0.657	0.712	-0.428	-0.69	Bajo

En esta tabla mostramos las primeras cargas de los componentes principales, estos pesos se obtuvieron al realizar el producto de matrices entre la matriz de eigenvectores traspuesta y la matriz con las variables originales escaladas teniendo asi una matriz de 32x9.

Gráfica dos dimensiones



Tras un análisis visual de las dos primeras componentes, observamos que los estados con grado de marginación “Muy bajo” y “Bajo” se encuentran bien agrupados, sin embargo notamos que el resto de los grupos no estan tan bien definidos.

K-medias utilizando componentes principales

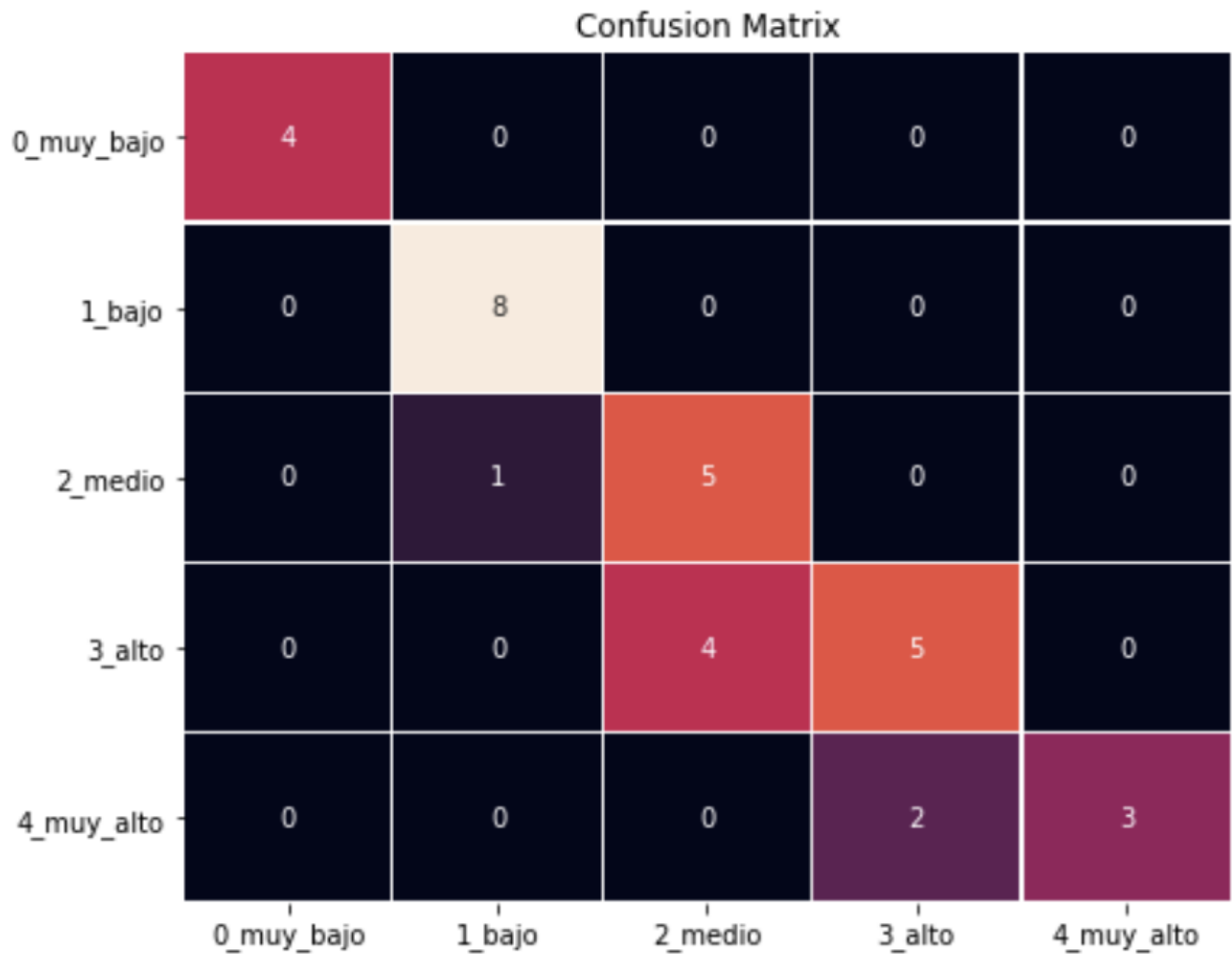
Clasificación usando componentes principales (5):

		0_muy_bajo	1_bajo	2_medio	3_alto	4_muy_alto
2000	0	Baja California	Aguascalientes	Durango	Campeche	Chiapas
	1	Coahuila de Zaragoza	Baja California Sur	Guanajuato	Hidalgo	Guerrero
	2	Distrito Federal	Colima	Morelos	Michoacán de Ocampo	Oaxaca
	3	Nuevo León	Chihuahua	Nayarit	Puebla	-
	4	-	Jalisco	Querétaro	San Luis Potosí	-
	5	-	México	Sinaloa	Tabasco	-
	6	-	Quintana Roo	Tlaxcala	Veracruz de Ignacio de la Llave	-
	7	-	Sonora	Yucatán	-	-
	8	-	Tamaulipas	Zacatecas	-	-
	-----	-----	-----	-----	-----	-----
Correct		4	8	5	5	3
Incorrect		0	1	4	2	0
Missing		0	0	1	4	2

Volvemos a utilizar el algoritmo de k-medias para comparar si las clasificaciones de los estados por su grado de marginación presentan tasas de error menores a las tasas obtenidas anteriormente. Notamos que el grupo “Alto” fue el que presentó un error de agrupación más alto que el resto de los grupos, seguido del grupo con grado de marginación “Medio”. Nuevamente, los estados con grado de marginación “Muy bajo” fueron perfectamente agrupados.

Matriz de confusión

Clasificación usando componentes principales (5):



Finalmente, interpretamos de manera visual el agrupamiento de los estados utilizando componentes principales y k-medias.

Año 2015

Clasificación original de los estados:

		0_muy_bajo	1_bajo	2_medio	3_alto	4_muy_alto
2015	0	Baja California	Aguascalientes	Durango	Campeche	Chiapas
	1	Coahuila de Zaragoza	Baja California Sur	Guanajuato	Hidalgo	Guerrero
	2	Distrito Federal	Colima	Morelos	Michoacán de Ocampo	Oaxaca
	3	Nuevo León	Chihuahua	Nayarit	Puebla	-
	4	-	Jalisco	Quintana Roo	San Luis Potosí	-
	5	-	México	Sinaloa	Veracruz de Ignacio de la Llave	-
	6	-	Querétaro	Tabasco	Yucatán	-
	7	-	Sonora	Tlaxcala	-	-
	8	-	Tamaulipas	Zacatecas	-	-

De este año notamos que la mayoría de los estados cuentan con grados de marginación “Medio” y “Alto”. Los estados de Chiapas, Guerrero y Oaxaca han formado parte del grupo cuyos grados de marginación son los más altos durante estos años de estudio. Del mismo modo, los estados con grado de marginación “Muy bajo” han sido los mismos durante todos estos años.

K-medias utilizando los indicadores socioeconómicos

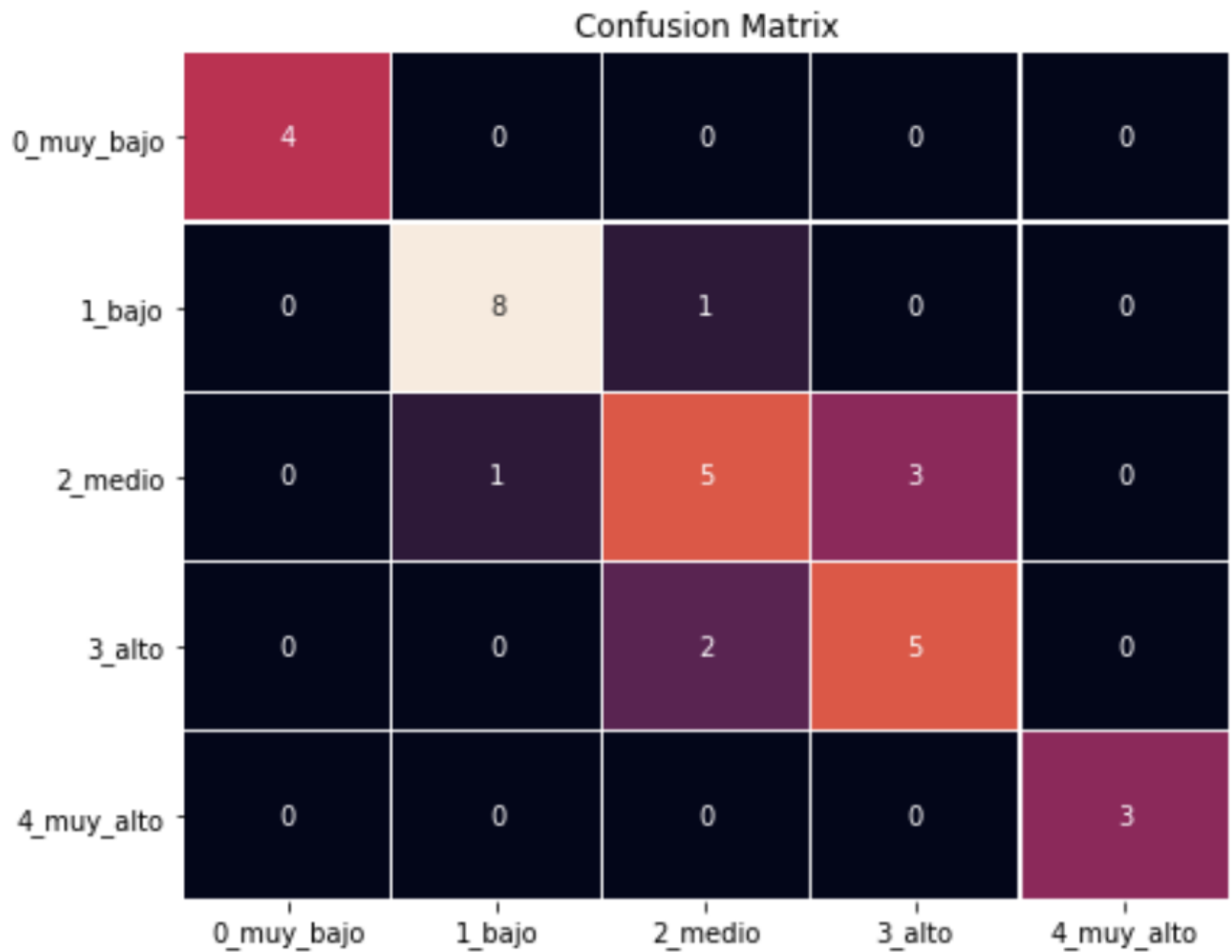
Clasificación usando features originales (9):

		0_muy_bajo	1_bajo	2_medio	3_alto	4_muy_alto
2015	0	Baja California	Aguascalientes	Campeche	Hidalgo	Chiapas
	1	Coahuila de Zaragoza	Baja California Sur	Durango	Michoacán de Ocampo	Guerrero
	2	Distrito Federal	Colima	Guanajuato	Puebla	Oaxaca
	3	Nuevo León	Chihuahua	Morelos	San Luis Potosí	-
	4	-	Jalisco	Nayarit	Tabasco	-
	5	-	México	Querétaro	Tlaxcala	-
	6	-	Quintana Roo	Sinaloa	Veracruz de Ignacio de la Llave	-
	7	-	Sonora	Yucatán	Zacatecas	-
	8	-	Tamaulipas	-	-	-
	-----	-----	-----	-----	-----	-----
	Correct	4	8	5	5	3
	Incorrect	0	1	3	3	0
	Missing	0	1	4	2	0

Notamos ahora que la agrupación de estados con un grado de marginación “Medio” fue el grupo que más errores presentó en esta agrupación seguido del grado de marginación “Alto”. Ahora, los grupos de grados de marginación “Muy bajo” y “Muy alto” fueron clasificados de manera correcta según los datos del CONAPO. A continuación podemos ver lo descrito de forma visual.

Matriz de confusión

Matriz de confusión usando features originales (9):



PCA

Valores propios

```
eg_val = compute_Jacobi_iterative(var_cov, 4, 10**(-8))
```

```
a = []  
for i in range(0,9):  
    a.append(pd.DataFrame(eg_val).loc[i,i].round(4))
```

```
eig = sorted(a, reverse=True)  
eig
```

```
[6.6282, 0.7565, 0.6488, 0.4816, 0.3139, 0.1978, 0.1531, 0.0797, 0.0307]
```

```
values, vectors = np.linalg.eig(var_cov)  
sorted(values.round(4), reverse=True)
```

```
[6.6282, 0.7565, 0.6488, 0.4816, 0.3139, 0.1978, 0.1531, 0.0797, 0.0307]
```

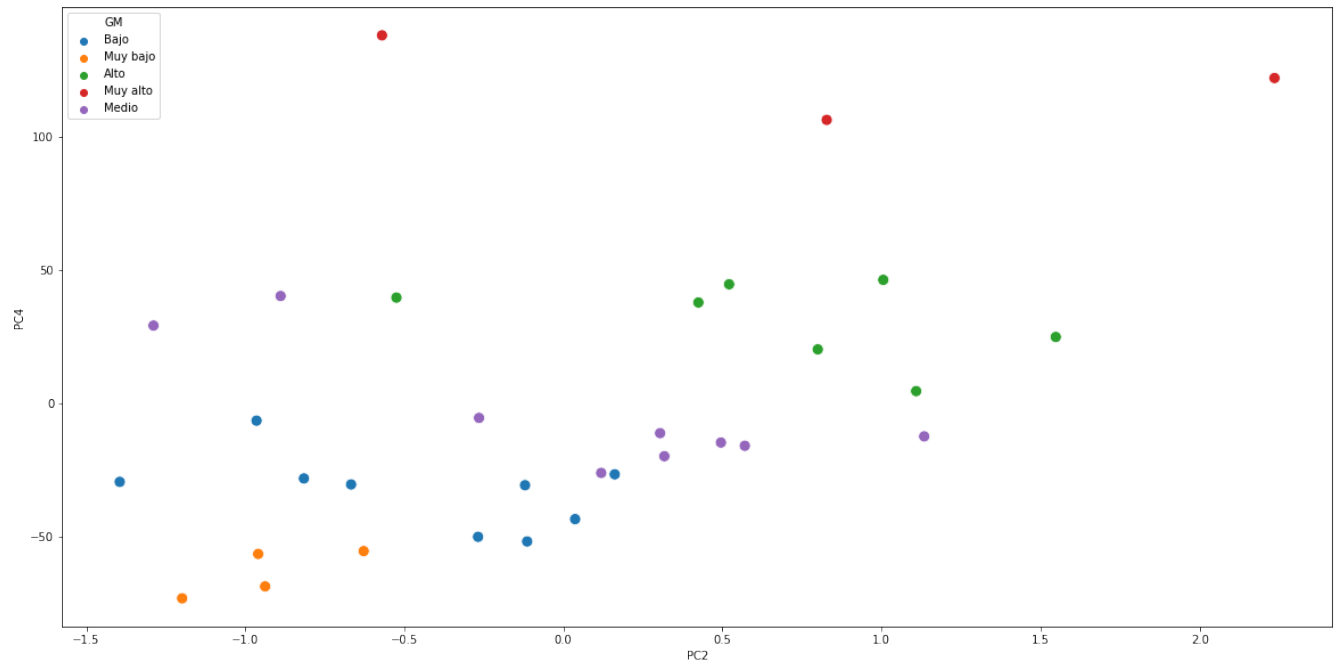
Al igual que los años anteriormente estudiados contamos que un eigenvalor mayor a uno, esto también significa que este primer componente principal contiene la mayor proporción de varianza explicada.

Componentes principales

##	PC1	PC2	PC3	PC4	PC5	PC6	PC7	PC8	PC9	GM	IM
## 1	0.270	-0.114	-0.261	-1.613	0.324	-0.846	-1.391	0.568	0.290	Bajo	-0.89
## 2	-0.335	-0.960	-1.055	-1.758	0.792	-0.626	-1.423	-0.091	0.652	Muy bajo	-1.10
## 3	-0.653	-1.395	-1.212	-0.916	0.827	-0.286	-0.266	-0.324	0.042	Bajo	-0.60
## 4	-0.778	0.424	0.528	1.182	-0.020	0.123	0.655	-0.498	0.481	Alto	0.46
## 5	-0.259	-0.628	-0.688	-1.726	0.811	-0.667	-1.554	0.304	0.802	Muy bajo	-1.10
## 6	-0.287	0.037	-0.729	-1.351	0.138	0.004	-1.317	0.092	0.426	Bajo	-0.73

Observamos los pesos de nuestras nuevas dimensiones, si, si nos quedamos únicamente con el primer componente principal, estos pesos serían nuestros nuevos índices de marginación para los estados.

Gráfica dos dimensiones



Durante el estudio de este año se observó que los componentes que “mejor agrupaban” nuestras observaciones eran el segundo y el cuarto, sin embargo notamos el mismo problema que en los años pasados, están bien definidos los grupos, suponemos que para este año tendremos los errores de clasificación más altos

Para este año notamos que la “mejor” agrupación en dos dimensiones la pudimos analizar con el segundo y el cuarto componente principal.

K-medias utilizando componentes principales

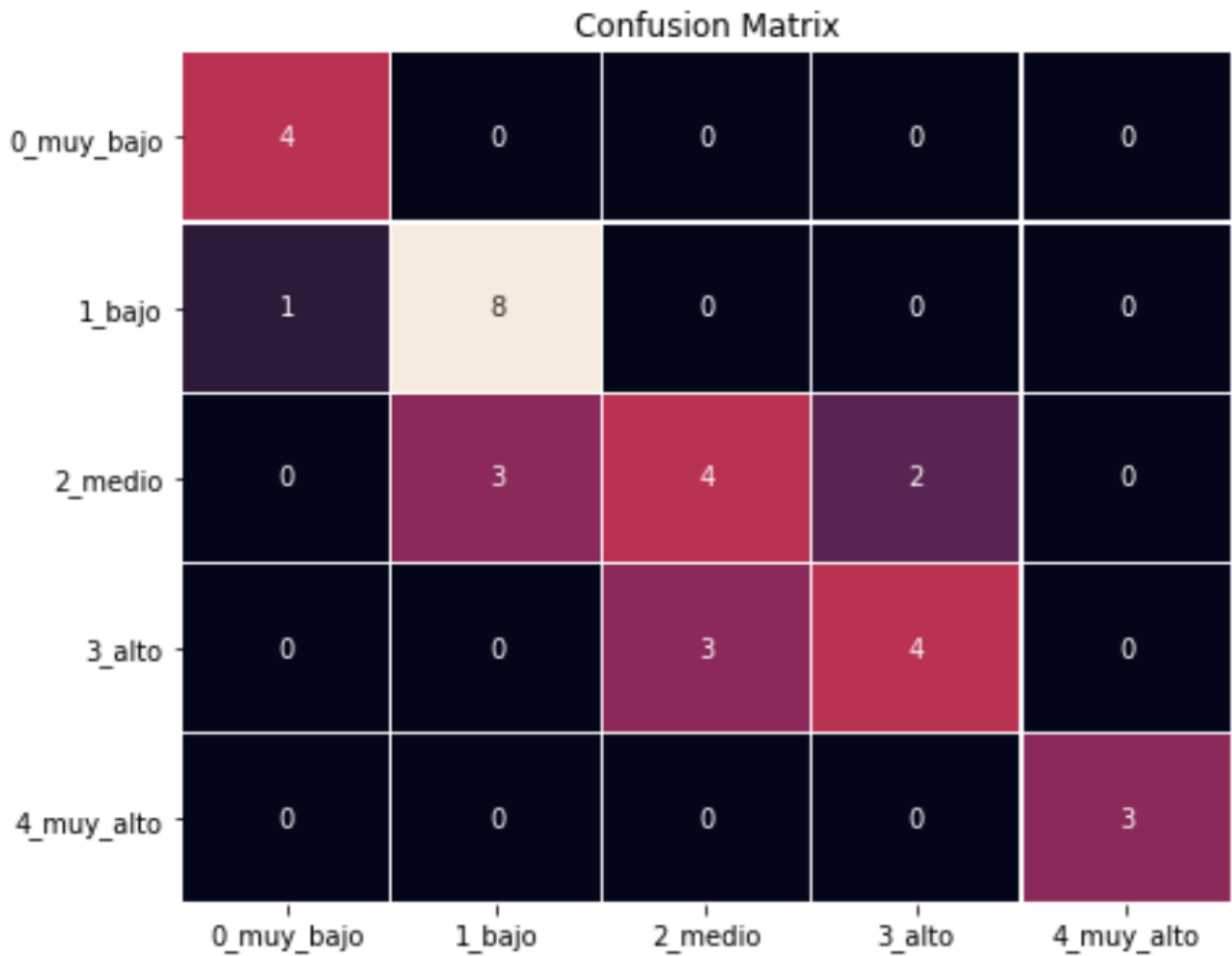
Clasificación usando componentes principales (5):

		0_muy_bajo	1_bajo	2_medio	3_alto	4_muy_alto
2015	0	Baja California	Aguascalientes	Guanajuato	Campeche	Chiapas
	1	Baja California Sur	Colima	Hidalgo	Durango	Guerrero
	2	Coahuila de Zaragoza	Chihuahua	Michoacán de Ocampo	Nayarit	Oaxaca
	3	Distrito Federal	Jalisco	Puebla	San Luis Potosí	-
	4	Nuevo León	México	Tabasco	Veracruz de Ignacio de la Llave	-
	5	-	Morelos	Tlaxcala	Yucatán	-
	6	-	Querétaro	Zacatecas	-	-
	7	-	Quintana Roo	-	-	-
	8	-	Sinaloa	-	-	-
	9	-	Sonora	-	-	-
	10	-	Tamaulipas	-	-	-
	-----	-----	-----	-----	-----	-----
	Correct	4	8	4	4	3
	Incorrect	1	3	3	2	0
	Missing	0	1	5	3	0

En efecto, los grupos “Bajo”, “Medio” y “Alto” presentan errores de agrupación, siendo el grupo asignado al grado de marginación “medio” el grupo con más error de agrupación.

Matriz de confusión

Clasificación usando componentes principales (5):



Conclusiones

Notamos que para los tres años que decidimos estudiar los valores propios de la matriz de covarianza de cada año no presentaban cambios drásticos. Los primeros dos componentes principales explicaban aproximadamente el 80% de varianza.

Como se muestra en la sección de resultados, los estados que presentan tasas de error más altas son los clasificados con un grado de marginación medio y alto.

Mientras que los estados con grado de marginación bajo y muy bajo fueron los estados mejor agrupados según el método de k-means, lo anterior tiene sentido pues esto también ocurrió con las variables originales.

Si hubiésemos decidido trabajar solo con los componentes principales cuyos valores propios mayores a uno utilizaríamos este componente principal como nuestro nuevo Índice de marginación, sin embargo, tras este análisis de agrupación por el método de k-medias no notamos una agrupación mejor que la que obtuvimos al realizar este mismo algoritmo con los indicadores socioeconómicos, salvo en casos particulares .

Referencias

- Kassambara, Alboukadel (2017) Practical Guide To Principal Component Methods in R: PCA, M (CA), FAMD, MFA, HCPC, factoextra. Volumen 2. STHDA.
 - I.T. Jolliffe (2002) Principal Component Analysis. Second Edition. Volumen 2. Springer.
 - CONAPO (2010) Índice de marginación por Entidad Federativa. Consejo Nacional de Población México, DF.
 - Scikit-learn developers (2007-2020), 2.3. Clustering, <https://scikit-learn.org/stable/modules/clustering.html#k-means>.
 - Anjua Nagpal (2017), Clustering — Unsupervised Learning, Towards data science, <https://towardsdatascience.com/clustering-unsupervised-learning-788b215b074b>.
 - Huu Le, Anders Eriksson, Thanh-Toan Do, Michael Milford (2018), A Binary Optimization Approach for Constrained K-Means Clustering, Cornell University, <https://arxiv.org/abs/1810.10134v2>.
- The Data Science Lab (2013), Clustering With K-Means in Python, <https://datasciencelab.wordpress.com/2013/12/12/clustering-with-k-means-in-python/>.
- David Arthur and Sergei Vassilvitskii (2016), Stanford University, <http://ilpubs.stanford.edu:8090/778/1/2006-13.pdf>.
 - Notas del curso