

# Reducción de dimensiones

M. Bouza, P. Briff, N. Horro



# Métodos de proyección

Estos métodos de reducción de dimensiones se basan en aplicar transformaciones, en principio lineales, a los datos originales. De este modo esperamos capturar las direcciones de mayor importancia en los datos.

En esta materia vamos a estudiar dos métodos

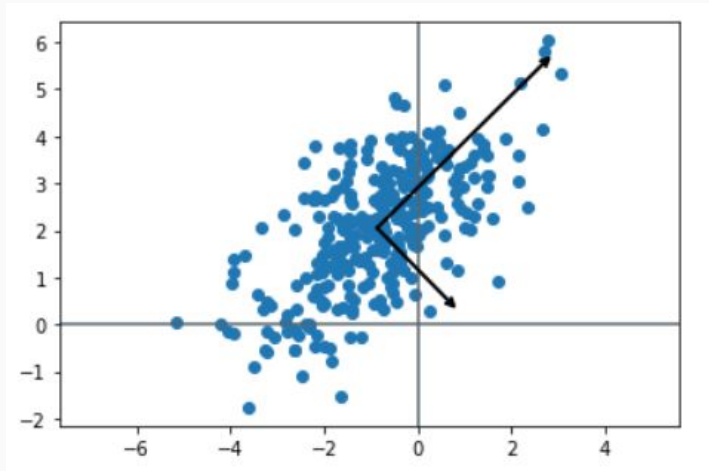
- PCA
- SVD

pero existen muchos otros como ICA, KPCA, FA, etc.

# Análisis de componentes principales (PCA)

## Motivación

PCA busca proyectar los datos en un espacio lineal (de menor dimensión), llamado *subespacio principal*, tal que la varianza en los datos proyectados sea máxima.



# Análisis de componentes principales (PCA)

Cómo hallar las direcciones de máxima varianza

Supongamos que tenemos una matriz  $\mathbf{X} \in \mathbb{R}^{n \times p}$  una matriz de  $n$  observaciones de  $p$  variables. Buscamos hallar las  $m \leq p$  direcciones que maximicen la varianza de las muestras.

Primero hallamos  $\alpha_1 \in \mathbb{R}^n$  tq  $\alpha_1^T \mathbf{X}$  sea máximo sujeto a  $\alpha_1^T \alpha_1 = 1$

Luego buscamos  $\alpha_2 \in \mathbb{R}^n$  tq  $\alpha_2^T \mathbf{X}$  sea máximo sujeto a  $\alpha_2^T \alpha_2 = 1$  y además  $\alpha_2^T \mathbf{X}$  esté descorrelacionado con  $\alpha_1^T \mathbf{X}$  i.e.  $\alpha_2 \perp \alpha_1$ .

Se prosigue de la misma forma hasta hallar los  $m$  vectores  $\alpha_1, \dots, \alpha_m$

Notar que por definición la matriz  $\alpha_m = [\alpha_1 \dots \alpha_m]$  es ortonormal, y por lo tanto define una matriz de proyección.

# Análisis de componentes principales (PCA)

## Vinculación con los autovectores

Definiendo  $\tilde{\Sigma} = (\mathbf{X} - \bar{\mathbf{X}})^T(\mathbf{X} - \bar{\mathbf{X}})$ , la matriz de covarianza muestral, los  $\alpha_i$  están asociados a los  $m$  primeros autovectores de  $\tilde{\Sigma}$ .

Al ser  $\tilde{\Sigma}$  simétrica,  $\tilde{\Sigma} = \mathbf{V}\mathbf{S}\mathbf{V}^T$ ,

donde  $\mathbf{S} = \text{diag}(\lambda_1, \dots, \lambda_p)$ ,  $\lambda_1 \geq \dots \geq \lambda_p$  son los autovalores de  $\tilde{\Sigma}$ , y  $\mathbf{V} = [\mathbf{v}_1, \dots, \mathbf{v}_p]$  con  $\mathbf{v}_i$  el autovector asociado a  $\lambda_i$ .

Se concluye que  $\alpha_m = \mathbf{v}_m$  donde  $\mathbf{V}_m = [\mathbf{v}_1, \dots, \mathbf{v}_m]$

Los datos transformados resultan  $\hat{\mathbf{X}} = \mathbf{X}\mathbf{V}_m$

# Análisis de componentes principales (PCA)

## Criterios de selección de orden

Una pregunta importante es cómo elijo la cantidad  $m$  de features a retener.

Existen dos enfoques comúnmente usados:

- Busco explicar el  $k\%$  de la varianza de los datos:  $m$  es tal que  $\frac{\sum_{i=1}^m \sigma_i}{\sum_{i=1}^p \sigma_i} 100 > k$
- Método del codo ('elbow'). Grafico los  $\lambda_i$  y tomo  $m$  en el punto de inflexión de la curva.

# Análisis de componentes principales (PCA)

## Comentarios finales

- **Ventajas:**

- Obtengo features descorrelacionados
- No "tiro" información de ninguna variable
- Explicable en términos de la matriz de correlación
- No supervisado (sirve para mayor cantidad de problemas)

- **Desventajas:**

- Si el dataset es muy grande puede ser muy costoso de computar
- Pierdo explicabilidad de los features (ahora son una c.l. de las mediciones)

- **Observaciones:**

- Las direcciones de los componentes principales se pueden ver afectadas por las unidades de medida, por ejemplo un feature es la altura en metros de una persona y otra el peso en gramos). Una práctica común estandarizar las variables para que tengan media 0 y varianza 1 antes de aplicar PCA.

# Descomposición en valores singulares (SVD)

La SVD es muy popular para reducir dimensiones para datos *sparse*.

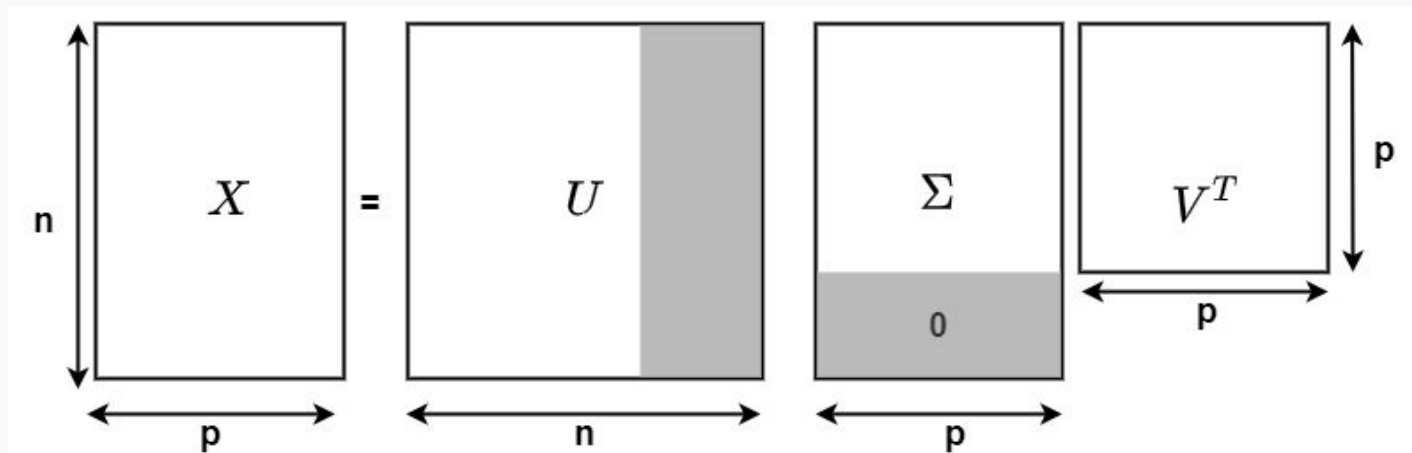
Sea  $\mathbf{X} \in \mathbb{R}^{n \times p}$  una matriz de  $n$  observaciones de  $p$  variables. Luego,  $\mathbf{X}$  se puede descomponer como

$$\mathbf{X} = \mathbf{U}\mathbf{\Sigma}\mathbf{V}^T,$$

donde  $\mathbf{U} \in \mathbb{R}^{n \times n}$ ,  $\mathbf{V} \in \mathbb{R}^{p \times p}$  y  $\mathbf{\Sigma} \in \mathbb{R}^{n \times p}$  es una matriz "diagonal"



# Descomposición en valores singulares (SVD)



Finalmente, los datos transformados resultan  $\hat{\mathbf{X}} = \mathbf{X}\mathbf{V}_k$ ,

donde  $\mathbf{V}_k = [\mathbf{v}_1, \dots, \mathbf{v}_k]$

# Descomposición en valores singulares (SVD)

¿Qué representan las matrices  $\mathbf{U}$  y  $\mathbf{V}$ ?

- $\mathbf{U}$  se corresponde con los autovectores de  $\mathbf{X}\mathbf{X}^T$  ( correlación empírica entre muestras)
- $\mathbf{V}$  está asociada a los autovectores de  $\mathbf{X}^T\mathbf{X}$  (correlación empírica de los features)
- $\Sigma$  es la raíz cuadrada de lo autovalores de ambas matrices.

# Descomposición en valores singulares (SVD)

¿Qué representan las matrices **U** y **V**? Ejemplo

Puntuación de  
distintos usuarios a 5  
películas<sup>[1]</sup>

	Matrix	Alien	Star Wars	Casablanca	Titanic
Joe	1	1	1	0	0
Jim	3	3	3	0	0
John	4	4	4	0	0
Jack	5	5	5	0	0
Jill	0	0	0	4	4
Jenny	0	0	0	5	5
Jane	0	0	0	2	2

SVD

$$\begin{matrix} & \begin{matrix} \text{person} \\ \text{as} \end{matrix} & \begin{matrix} \text{temas} \\ \text{temas} \end{matrix} & & & & \begin{matrix} \text{películas} \\ \text{películas} \end{matrix} & \begin{matrix} \text{temas} \\ \text{temas} \end{matrix} \\ \begin{bmatrix} 1 & 1 & 1 & 0 & 0 \\ 3 & 3 & 3 & 0 & 0 \\ 4 & 4 & 4 & 0 & 0 \\ 5 & 5 & 5 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 4 & 4 \\ 0 & 0 & 0 & 5 & 5 \\ 0 & 0 & 0 & 2 & 2 \end{bmatrix} & \begin{bmatrix} 0.14 & 0 \\ 0.42 & 0 \\ 0.56 & 0 \\ 0.7 & 0 \\ 0 & 0.6 \\ 0 & 0.75 \\ 0 & 0.3 \end{bmatrix} & \begin{bmatrix} 12.4 & 0 \\ 0 & 9.5 \end{bmatrix} & \begin{bmatrix} 0.58 & 0.58 & 0.58 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 0.71 & 0.71 \end{bmatrix} \\ \mathbf{X} & \mathbf{U} & \mathbf{\Sigma} & \mathbf{V}^T \end{matrix}$$

[1] <http://infolab.stanford.edu/~ullman/mmds/ch11.pdf>

# Descomposición en valores singulares (SVD)

## Comentarios finales

- Realizar la descomposición SVD sobre los datos centrados es equivalente a hacer PCA
- SVD funciona sobre datos sparse, sin necesidad de "redensificarlos" que puede ocupar mucha memoria
- Según el problema, las matrices  $U$  y  $V$  de la SVD pueden dar información útil acerca de las correlaciones entre las muestras y variables.

# Bibliografía

- "Mining of Massive Datasets", Leskovec J, Rajaraman A., Ullman J.D., Stanford University. Capítulo 11.  
<http://infolab.stanford.edu/~ullman/mmds/ch11.pdf>
- <https://towardsdatascience.com/a-one-stop-shop-for-principal-component-analysis-5582fb7e0a9c>
- "Pattern Recognition and Machine Learning", Bishop, Christopher M. New York, Springer, 2006