



Università degli Studi di Milano Bicocca  
**Scuola di Scienze**  
**Dipartimento di Informatica, Sistemistica e Comunicazione**  
**Corso di laurea in Informatica**

# **Studio e approfondimento del coefficiente Silhouette per la valutazione interna di risultati di clustering non- supervisionato**

**Relatore:** Dott. Davide Chicco  
**Co-relatore:** Prof.ssa Francesca Gasparini

**Relazione della prova finale di:**

*Federico Salvioni*  
*Matricola 845029*

**Anno Accademico 2023-2024**

# Indice

<b>1</b>	<b>Abstract</b>	<b>1</b>
<b>2</b>	<b>Introduzione</b>	<b>2</b>
<b>3</b>	<b>Metodi e strumenti utilizzati</b>	<b>6</b>
3.1	Dataset . . . . .	6
3.2	Funzioni di distanza . . . . .	7
3.3	Silhouette . . . . .	8
3.4	Sanity check e matrice binaria . . . . .	13
3.5	Algoritmi . . . . .	13
3.5.1	Clustering partizionale: K-Means e K-Medians . . . . .	14
3.5.2	Clustering per densità: DBSCAN . . . . .	15
3.5.3	Clustering gerarchico: HDBSCAN . . . . .	16
<b>4</b>	<b>Risultati</b>	<b>17</b>
4.1	Risultati dei test . . . . .	17
4.2	Risultati delle applicazioni su EHR . . . . .	21
<b>5</b>	<b>Discussione</b>	<b>42</b>
5.1	Silhouette . . . . .	42
5.2	Pacchetti . . . . .	42
5.3	EHR . . . . .	44
<b>6</b>	<b>Conclusioni</b>	<b>56</b>

# Elenco delle figure

3.1	Scatter plot di <code>sc_dataset_good</code> . Si noti la struttura di cluster ben definita. . . . .	6
3.2	Scatter plot di <code>sc_dataset_bad</code> . Si noti l'assenza della struttura di cluster. . . . .	7
3.3	Silhouette plot per il dataset <code>iris</code> . . . . .	11
3.4	Clustering con K-Means usando $K = 2, 4, 6$ per un dataset auto generato in cui la struttura di cluster è ben visibile. . . . .	12
3.5	Applicazione dell'algoritmo K-Means ad un ipotetico dataset; i tre colori indicano i tre cluster individuati dall'algoritmo (By I, Weston.pace, CC BY-SA 3.0, <a href="https://commons.wikimedia.org">https://commons.wikimedia.org</a> )	
3.6	Ipotetica classificazione di alcuni elementi, usando $\text{MinPts} = 4$ . Gli elementi in rosso sono dei core point, perchè hanno 4 o più elementi nel loro $\epsilon$ -vicinato. Gli elementi in giallo sono invece border point, perchè hanno meno di 4 elementi nel loro $\epsilon$ -vicinato ma sono nell' $\epsilon$ -vicinato di almeno un core point. Infine, gli elementi in blu sono dei noise point, perchè oltre ad avere meno di 4 elementi nel loro $\epsilon$ -vicinato non sono nell' <i>epsilon</i> -vicinato di alcun core point (By Chire - Own work, CC BY-SA 3.0, <a href="https://commons.wikimedia.org/w/index.php?curid=17045963">https://commons.wikimedia.org/w/index.php?curid=17045963</a> ). . . . .	15
3.7	Risultato dell'applicazione dell'algoritmo DBSCAN su un ipotetico dataset. Le aree in blu e in verde rappresentano i due cluster, mentre i punti in grigio sono i noise point (By Chire - Own work, CC BY-SA 3.0, <a href="https://commons.wikimedia.org/w/index.php?curid=17085332">https://commons.wikimedia.org/w/index.php?curid=17085332</a> )	
4.1	Plot dei test sanity check usando il dataset con struttura di cluster ben visibile. . . . .	17
4.2	Plot dei test sanity check usando il dataset con struttura di cluster assente. . . . .	18
4.3	Plot del test sanity check usando <code>scikit-learn</code> attraverso <code>reticulate</code> . . . . .	19
4.4	Plot dei test matrice binaria. . . . .	20
4.5	Plot del test matrice binaria per il pacchetto <code>scikit-learn</code> (attraverso <code>reticulate</code> )	21
4.6	Risultati dell'algoritmo K-Means per il dataset <code>HeartFailure.csv</code> . . . . .	22
4.7	Risultati dell'algoritmo K-Medians per il dataset <code>HeartFailure.csv</code> . . . . .	23
4.8	Risultati dell'algoritmo DBSCAN per il dataset <code>HeartFailure.csv</code> . . . . .	24
4.9	Risultati dell'algoritmo HDBSCAN per il dataset <code>HeartFailure.csv</code> . . . . .	25
4.10	Risultati dell'algoritmo K-Means per il dataset <code>CardiacArrest.csv</code> . . . . .	26
4.11	Risultati dell'algoritmo K-Medians per il dataset <code>CardiacArrest.csv</code> . . . . .	27
4.12	Risultati dell'algoritmo DBSCAN per il dataset <code>CardiacArrest.csv</code> . . . . .	28
4.13	Risultati dell'algoritmo HDBSCAN per il dataset <code>CardiacArrest.csv</code> . . . . .	29
4.14	Risultati dell'algoritmo K-Means per il dataset <code>Neuroblastoma.csv</code> . . . . .	30
4.15	Risultati dell'algoritmo K-Medians per il dataset <code>Neuroblastoma.csv</code> . . . . .	31
4.16	Risultati dell'algoritmo DBSCAN per il dataset <code>Neuroblastoma.csv</code> . . . . .	32
4.17	Risultati dell'algoritmo HDBSCAN per il dataset <code>Neuroblastoma.csv</code> . . . . .	33
4.18	Risultati dell'algoritmo K-Means per il dataset <code>Diabetes.csv</code> . . . . .	34
4.19	Risultati dell'algoritmo K-Medians per il dataset <code>Diabetes.csv</code> . . . . .	35
4.20	Risultati dell'algoritmo DBSCAN per il dataset <code>Diabetes.csv</code> . . . . .	36
4.21	Risultati dell'algoritmo HDBSCAN per il dataset <code>Diabetes.csv</code> . . . . .	37
4.22	Risultati dell'algoritmo K-Means per il dataset <code>Sepsis.csv</code> . . . . .	38
4.23	Risultati dell'algoritmo K-Medians per il dataset <code>Sepsis.csv</code> . . . . .	39
4.24	Risultati dell'algoritmo DBSCAN per il dataset <code>Sepsis.csv</code> . . . . .	40
4.25	Risultati dell'algoritmo HDBSCAN per il dataset <code>Sepsis.csv</code> . . . . .	41
5.1	Differenze fra il test matrice binaria tra <code>cluster</code> (pacchetto R) e <code>scikit-learn</code> (pacchetto Python). . . . .	43
5.2	Riassunto dei risultati dei vari algoritmi per il dataset <code>HeartFailure.csv</code> . . . . .	45

5.3	Riassunto dei risultati dei vari algoritmi per il dataset <code>CardiacArrest.csv</code> . . .	46
5.4	Riassunto dei risultati dei vari algoritmi per il dataset <code>Neuroblastoma.csv</code> . . .	47
5.5	Riassunto dei risultati dei vari algoritmi per il dataset <code>Diabetes.csv</code> . . . . .	48
5.6	Riassunto dei risultati dei vari algoritmi per il dataset <code>Sepsis.csv</code> . . . . .	49
5.7	Risultati dell'algoritmo DBSCAN per il dataset <code>HeartFailure.csv</code> , usando un KNN-plot per stimare $\varepsilon$ . . . . .	51
5.8	Risultati dell'algoritmo DBSCAN per il dataset <code>CardiacArrest.csv</code> , usando un KNN-plot per stimare $\varepsilon$ . . . . .	52
5.9	Risultati dell'algoritmo DBSCAN per il dataset <code>Neuroblastoma.csv</code> , usando un KNN-plot per stimare $\varepsilon$ . . . . .	53
5.10	Risultati dell'algoritmo DBSCAN per il dataset <code>Diabetes.csv</code> , usando un KNN-plot per stimare $\varepsilon$ . . . . .	54
5.11	Risultati dell'algoritmo DBSCAN per il dataset <code>Sepsis.csv</code> , usando un KNN-plot per stimare $\varepsilon$ . . . . .	55

# 1. Abstract

Silhouette é una metrica spesso utilizzata per individuare la combinazione di iperparametri di un algoritmo di clustering non supervisionato che risulti nel clustering piú vicino possibile alla vera struttura di cluster dei dati in analisi. Verrá introdotta Silhouette e come calcolarla, alcune proprietà matematiche ed alcune applicazioni concrete su dataset di EHR (*Electronic Health Records*). Verranno inoltre analizzati alcuni pacchetti per il linguaggio R che implementano Silhouette per determinare quale sia il migliore, comparandone le performance sia fra di loro sia rispetto all'implementazione di `scikit-learn` (Python).

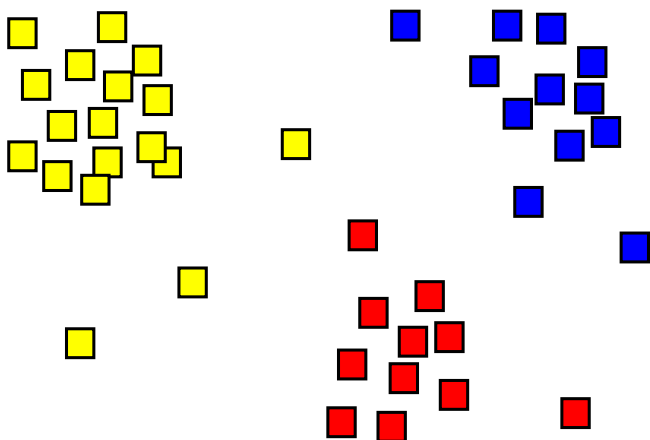
## 2. Introduzione

Con il termine **cluster analysis**, o semplicemente **clustering**, si intende "una tecnica di classificazione statistica atta a scoprire se gli individui di una popolazione ricadono all'interno di certi gruppi mediante comparazioni quantitative di loro molteplici caratteristiche" <sup>1</sup>. Informalmente, il clustering consiste nel (tentare di) suddividere un insieme di dati in gruppi, chiamati appunto **cluster**, di modo che ciascun gruppo contenga elementi simili fra di loro ma dissimili rispetto a quelli degli altri gruppi.

La definizione del concetto di "somiglianza" sta nelle mani di chi compie il clustering. In genere, l'analisi dei dati si occupa di dati numerici (altezze, lunghezze, età, ampiezze), pertanto il modo più naturale per formalizzare la somiglianza è dato da una **funzione di distanza**. Matematicamente, una qualsiasi funzione  $d : \mathbb{R} \times \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$  è considerabile una funzione di distanza se possiede (almeno) le seguenti proprietà:

- Per ogni  $x \in \mathbb{R}$ ,  $d(x, x) = 0$ ;
- Per ogni  $x, y \in \mathbb{R}$ , se  $x \neq y$  allora  $d(x, y) > 0$ ;
- Per ogni  $x, y \in \mathbb{R}$ ,  $d(x, y) = d(y, x)$  (**simmetria**);
- Per ogni  $x, y, z \in \mathbb{R}$ ,  $d(x, z) \leq d(x, y) + d(y, z)$  (**disuguaglianza triangolare**).

Un **algoritmo di clustering** non è altro che un algoritmo che abbia in input un insieme di dati e che abbia in output il risultato del clustering. Algoritmi di questo tipo fanno uso di una funzione di distanza per raggruppare gli elementi in cluster senza che sia necessario farlo manualmente.



Gli algoritmi di clustering si dividono in due macrocategorie: **algoritmi supervisionati** e **algoritmi non supervisionati**. Nei primi, viene usato un insieme di dati per generalizzarne le proprietà, cercando di predire il risultato per dati futuri, mentre nei secondi si cerca di catturare le proprietà dei dati in sé e per sé.

Una volta applicato un algoritmo di clustering su un certo insieme di dati, è ragionevole chiedersi se il risultato del clustering effettivamente rispecchi la struttura dei dati o se l'algoritmo abbia errato. Negli algoritmi di tipo supervisionato questo è semplice, perché è possibile comparare i dati ottenuti con il risultato atteso, similmente a come viene fatto in un modello di regressione.

Negli algoritmi di tipo non supervisionato questo è molto più difficile, perché non c'è differenza fra l'insieme di dati utilizzato per costruire il modello e l'insieme di dati usato per testare il modello: sono lo stesso insieme. Una possibile soluzione al problema è data da delle statistiche, il cui valore

---

<sup>1</sup><https://www.merriam-webster.com/dictionary/cluster%20analysis>

rappresenta l'accuratezza del modello. Alcuni esempi sono: **Calinski-Harabasz** [2], **Davies-Bouldin** [6] e **Dunn Index** [8].

La statistica di interesse per questa tesi è Silhouette [19]. Tale statistica, nelle parole dell'autore, si propone di rispondere alle seguenti domande:

- Il clustering è di buona qualità? In altre parole, gli elementi di uno stesso cluster sono fra di loro "vicini" ed al contempo "lontani" dagli elementi di tutti gli altri cluster?
- Quali sono gli elementi ben classificati, ovvero quelli che probabilmente si trovano nel cluster "giusto"?
- Quali sono gli elementi che è difficile stabilire con certezza in quali cluster vadano collocati, ovvero quelli che stanno "nel mezzo" fra più cluster?
- Il numero di cluster scelto è effettivamente rappresentativo del dataset o è 'artificioso'?

<i>Identifying heterogeneous subgroups of systemic autoimmune diseases by applying a joint dimension reduction and clustering approach to immunomarkers [4]</i>					
<b>Patologie</b>	<b>N. pazienti</b>	<b>Features</b>	<b>Algoritmi</b>	<b>Software</b>	<b>Metriche</b>
Lupus Eri-tematoso Sistemico, Artrite Reumatoide, Sindrome di Sjogren	11923	biomarcatori (tradotti in variabili categoriali)	Multiple Correspondence Analysis K-means (clustering e dimensionalità reduction insieme)	clustrd (R)	Silhouette
<i>Association of comorbid-socioeconomic clusters with mortality in late onset epilepsy derived through unsupervised machine learning [15]</i>					
<b>Patologie</b>	<b>N. pazienti</b>	<b>Features</b>	<b>Algoritmi</b>	<b>Software</b>	<b>Metriche</b>
Epilessia (tardiva)	11307	Fattori di rischio, comorbidità (indice di Charlson)	Agglomerative Hierarchical Clustering	scikit-learn (Python), Python 3.6.3, Stata 16.1	Silhouette, Davies-Bouldin
<i>Exploration of critical care data by using unsupervised machine learning [14]</i>					
<b>Patologie</b>	<b>N. pazienti</b>	<b>Features</b>	<b>Algoritmi</b>	<b>Software</b>	<b>Metriche</b>
	1503	Valori di test di routine di laboratorio (BUN, creatinina, glucosio, ...)	Kmeans	R 3.5.2	Total within-cluster variation, Silhouette, Gap statistic
<i>Identifying and evaluating clinical subtypes of Alzheimer's disease in care electronic health records using unsupervised machine learning [1]</i>					
<b>Patologie</b>	<b>N. pazienti</b>	<b>Features</b>	<b>Algoritmi</b>	<b>Software</b>	<b>Metriche</b>
Malattia di Alzheimer	10065	sintomi tipici, comorbidità, dati demografici	K-Means, Kernel K-means, Affinity Propagation, Latent Class Analysis		Silhouette, Coefficiente di Jaccard
<i>Utilization of Deep Learning for Subphenotype Identification in Sepsis-Associated Acute Kidney Injury [5]</i>					
<b>Patologie</b>	<b>N. pazienti</b>	<b>Features</b>	<b>Algoritmi</b>	<b>Software</b>	<b>Metriche</b>
Sepsi	4001	Segni vitali, test di laboratorio	K-Means	scikit-learn (Python), matplotlib (Python), SAS 9.4, R 3.4.3	Silhouette, Davies-Bouldin, Calinski-Harabasz

Tabella 2.1: Riassunto degli articoli scientifici che applicano Silhouette su EHR



<i>Silhouette Index as clustering evaluation tool [7]</i>				
Sintesi	Algoritmi	Dataset	Software	Metriche
É possibile utilizzare Silhouette come "stopping rule" direttamente all'interno di un algoritmo di clustering?	RPCT	Dataset artificiale, generato mediante <code>cluster.Gen</code> , FCPS Dataset artificiale costituito da tre distribuzioni uniformi	clusterSim (R)	Adjusted Rand Index
<i>Performance evaluation of the Silhouette index [22]</i>				
Sintesi	Algoritmi	Dataset	Software	Metriche
Qual'è il modo corretto per calcolare la Silhouette media?	Complete-linkage, single-linkage	Quattro dataset artificiali con una struttura di cluster ben definita, Iris, Wine		
<i>A comparison of clustering quality indices using outliers and noise [12]</i>				
Sintesi	Algoritmi	Dataset	Software	Metriche
Quali sono le prestazioni di Silhouette rispetto ad altre metriche?	K-means, model-based clustering, hierarchical clustering, algoritmo "random"	clear (struttura di cluster é ben definita), out (parte dei dati sono noise), noi (parte delle dimensioni sono noise)		Calinski-Harabasz, C-index, Davies-Bouldin, Gamma, ARI
<i>Condensed Silhouette: An Optimized Filtering Process for Cluster Selection in K-Means [17]</i>				
Sintesi	Algoritmi	Dataset	Software	Metriche
Nel caso di algoritmi di clustering partizionale, é possibile semplificare ulteriormente Silhouette?	K-Means	7 microarray gene expressions (migliaia di features), 7 dataset reali famosi (come Iris)	Scikit-Learn (Python)	
<i>CUBOS: An Internal Cluster Validity Index for Categorical Data [11]</i>				
Sintesi	Algoritmi	Dataset	Software	Metriche
É possibile estendere Silhouette per utilizzarla su valori discreti?	IDC	K-Modes	UCI	

Tabella 2.2: Riassunto degli articoli scientifici che studiano Silhouette da un punto di vista teorico

## 3. Metodi e strumenti utilizzati

### 3.1 Dataset

Per quanto riguarda l'applicare algoritmi di clustering a dataset reali, come dataset ho utilizzato delle cartelle cliniche elettroniche (EHR). Questi dataset, in formato `.csv` (*comma separated value*), sono liberamente utilizzabili. Per comodità, ho indicato tali dataset con la malattia a cui si riferiscono: Diabetes, Neuroblastoma, CardiacArrest, HeartFailure, Sepsis. Nell'intestazione dei plot è comunque possibile leggere il nome completo del rispettivo dataset.

Per quanto riguarda la valutazione delle performance delle implementazioni di Silhouette ho utilizzato due dataset da me generati, indicati con `sc_dataset_good` e `sc_dataset_bad`. Li ho costruiti utilizzando la funzione `rnorm`, che genera dei punti casuali a partire da una distribuzione normale bivariata.

`sc_dataset_good` è costituito da due distribuzioni normali fuse insieme, entrambe con una deviazione standard molto bassa, di modo che i punti siano concentrati attorno alla media. `sc_dataset_bad` è costituito da una sola distribuzione normale bivariata centrata in  $(0,0)$  e con una deviazione standard molto ampia, di modo che i punti siano molto dispersi. I loro scatter plot sono riportati in Figura 3.1 e Figura 3.2 rispettivamente.

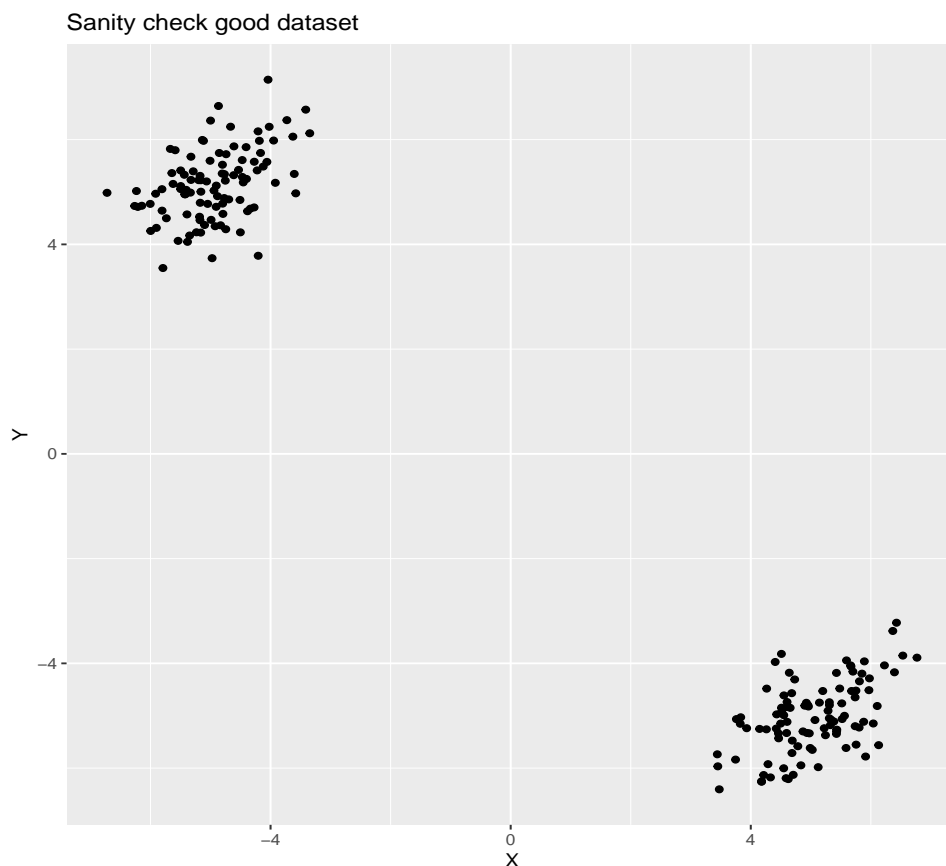


Figura 3.1: Scatter plot di `sc_dataset_good`. Si noti la struttura di cluster ben definita.

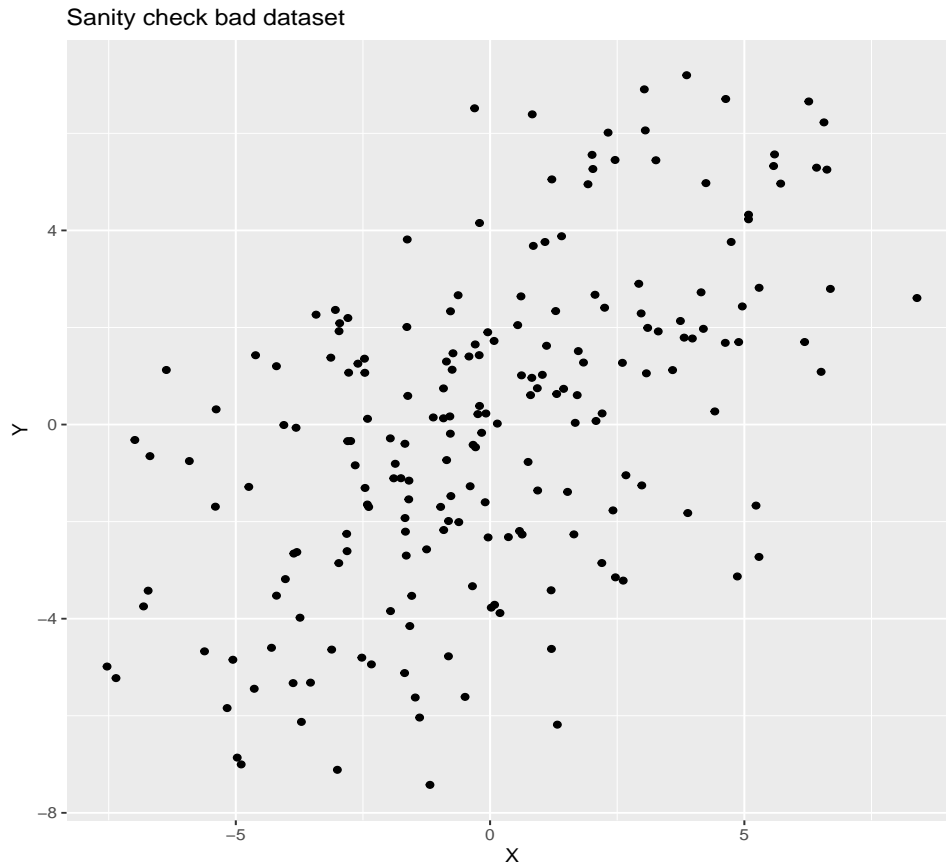


Figura 3.2: Scatter plot di `sc_dataset_bad`. Si noti l'assenza della struttura di cluster.

Infine, diversi esempi si rifanno ad un dataset molto famoso chiamato `iris` [10]. Tale dataset é costituito da 150 elementi estratti da una popolazione di fiori, ciascuno contenente cinque attributi, in ordine: lunghezza del sepal (in centimetri), larghezza del sepal, lunghezza del petalo, larghezza del petalo e specie del fiore (*Iris setosa*, *Iris virginica* oppure *Iris versicolor*). Dato che l'ultimo attributo non é numerico, viene in genere scartato. Nella Tabella 3.1 sono riportati alcuni elementi di tale dataset.

Sepal.Length	Sepal.Width	Petal.Length	Petal.Width	Species
5.1	3.5	1.4	0.2	setosa
4.9	3.0	1.4	0.2	setosa
4.7	3.2	1.3	0.2	setosa
4.6	3.1	1.5	0.2	setosa
5.0	3.6	1.4	0.2	setosa
5.4	3.9	1.7	0.4	setosa
4.6	3.4	1.4	0.3	setosa

Tabella 3.1: Primi elementi del dataset `iris`, cosí come compare nel linguaggio R.

## 3.2 Funzioni di distanza

Si supponga di avere a disposizione un dataset di dimensione  $N \times M$ , dove  $N$  indica il numero degli elementi e  $M$  é il numero di attributi. Si assuma, per semplicitá, che tutti gli attributi siano tutti dati numerici (altezze, lunghezze, capacitá, ecc...) e che ogni valore di ogni attributo sia noto.

Per ciascuna coppia di elementi  $i$  e  $j$  del dataset é possibile calcolare la loro distanza mediante una funzione di distanza. La funzione di distanza piú intuitiva è la **distanza Euclidea**, che equivale alla distanza fra due punti nel piano cartesiano  $n$ -dimensionale, definita come segue:

$$d(i, j) = \sqrt{\sum_{m=1}^M (f_{i,m} - f_{j,m})^2} = \sqrt{(f_{i,1} - f_{j,1})^2 + \dots + (f_{i,M} - f_{j,M})^2} \quad (3.1)$$

Dove  $f_{i,m}$  e  $f_{j,m}$  indicano il valore del  $m$ -esimo attributo per, rispettivamente, l' $i$ -esimo ed il  $j$ -esimo elemento del dataset.

Un'altro esempio di distanza é la **distanza di Manhattan**, calcolata come la somma fra le differenze in modulo di ciascuna coppia di attributi:

$$d(i, j) = \sum_{m=1}^M |f_{i,m} - f_{j,m}| = |f_{i,1} - f_{j,1}| + \dots + |f_{i,M} - f_{j,M}| \quad (3.2)$$

Ultimo esempio di distanza é la **distanza di Jaccard**, calcolata a partire dal numero di elementi che due insiemi  $A$  e  $B$  hanno in comune ed al numero di elementi che non hanno in comune:

$$d(A, B) = 1 - \frac{|A \cap B|}{|A \cup B|} \quad (3.3)$$

A partire da un dataset di  $N$  elementi e da una funzione di distanza è possibile costruire quella che viene chiamata **matrice delle distanze**. Tale matrice ha dimensione  $N \times N$  e, in ciascuna cella  $(i, j)$ , è presente la distanza  $d(i, j)$  fra i due elementi. La Tabella 3.2 contiene un esempio di matrice delle distanze.

0.5385165							
0.5099020	0.3000000						
0.6480741	0.3316625	0.2449490					
0.1414214	0.6082763	0.5099020	0.6480741				
0.6164414	1.0908712	1.0862780	1.1661904	0.6164414			
0.5196152	0.5099020	0.2645751	0.3316625	0.4582576	0.9949874		
0.1732051	0.4242641	0.4123106	0.5000000	0.2236068	0.7000000	0.4242641	

Tabella 3.2: Matrice delle distanze per il dataset `iris`, scartando l'ultimo attributo in quanto non numerico, usando come funzione di distanza la distanza Euclidea. Per questioni di spazio sono presenti solamente i primi 7 elementi. Si noti come la matrice sia riportata solo per metà, perché per definizione una matrice delle distanze é sempre simmetrica.

La distanza Euclidea é la funzione di distanza che viene utilizzata di default nella maggior parte delle implementazioni di default degli algoritmi di clustering. Inoltre, nella maggior parte dei casi, un algoritmo di clustering non necessita di utilizzare una funzione di distanza specifica. Pertanto, se non specificato diversamente, quando ci si riferisce ad una funzione di distanza generica si intende la distanza Euclidea.

### 3.3 Silhouette

Una volta nota la matrice delle distanze, si supponga di applicare un algoritmo di clustering (K-Means, ad esempio) per suddividere il dataset in un certo numero di cluster, sia questo  $K$ . Per ciascun cluster, è interamente noto sia il numero di suoi elementi, sia a quale cluster ciascun elemento del dataset è stato assegnato.

Per poter calcolare il coefficiente di Silhouette, è prima necessario introdurre due quantità per ciascun elemento  $i$  del dataset, indicate rispettivamente con  $a(i)$  e  $b(i)$ .

Preso un elemento  $i$  del dataset, sia  $A$  il cluster in cui l'algoritmo lo ha riposto. Ammesso che  $A$  contenga altri elementi all'infuori di  $i$ , è possibile definire  $a(i)$  come distanza media fra  $i$  e tutti gli elementi di  $A$  escluso  $i$  stesso:

$$a(i) = \frac{1}{|A| - 1} \sum_{j \in \{A - \{i\}\}} d(i, j) \quad (3.4)$$

Tale valore misura quanto un cluster è *coeso*, nel senso che se tale valore è piccolo per tutti gli elementi del cluster, questi si trovano fra loro vicini. Per tale motivo,  $a(i)$  viene anche chiamata **distanza intra-cluster**.

Dopodiché, in maniera simile, per un cluster  $C$  diverso da  $A$  è possibile definire  $D(i, C)$  come la distanza media fra  $i$  (che appartiene ad  $A$ ) e gli elementi di  $C$ :

$$D(i, C) = \frac{1}{|C|} \sum_{j \in C} d(i, j)$$

Tale valore misura quanto un cluster è *separato*, nel senso che se tale valore è grande per tutti gli elementi del cluster a cui  $i$  appartiene, il cluster nel suo complesso si trova molto distante da tutti gli altri. Per tale motivo  $D(i, C)$  viene anche chiamata **distanza inter-cluster**.

Assumendo che il numero di cluster sia più di uno, per uno stesso elemento  $i$  è possibile calcolare la distanza inter-cluster per ogni possibile cluster  $C$  distinto da  $A$ . Fra questi  $K - 1$  cluster, è di particolare interesse il cluster che ha il più piccolo valore di distanza inter-cluster per  $i$ , chiamato **neighboring cluster**. Questo perché tale cluster è quello che, se il cluster  $A$  non esistesse, sarebbe la miglior scelta per catalogare  $i$ , dato che è quello i cui elementi sono i più vicini ad  $i$ .

Se il neighboring cluster per  $i$  è il cluster  $C'$ , la distanza inter-cluster  $D(i, C')$  viene indicata con  $b(i)$ :

$$b(i) = \min_{C \neq A} D(i, C) \quad (3.5)$$

Una volta calcolato  $a(i)$  e  $b(i)$  per l'elemento  $i$  del dataset, è possibile assegnarvi un valore di Silhouette  $s(i)$ , così calcolato:

$$s(i) = \frac{b(i) - a(i)}{\max\{a(i), b(i)\}} \quad (3.6)$$

Se l'elemento  $i$  si trova in un cluster che contiene solamente sé stesso, per convenzione il valore  $s(i)$  viene posto a 0 (è una scelta arbitraria, ma è anche quella più neutra).

È facile verificare che, per qualsiasi elemento  $i$ :

$$-1 \leq s(i) \leq 1$$

Si assuma infatti che  $b(i) \geq a(i)$ . L'espressione diventa:

$$s(i) = \frac{b(i) - a(i)}{b(i)} = \frac{b(i)}{b(i)} - \frac{a(i)}{b(i)} = 1 - \frac{a(i)}{b(i)}$$

Avendo assunto che  $b(i)$  sia maggiore di  $a(i)$ , tale frazione è una frazione propria, e pertanto il suo valore è racchiuso nell'intervallo  $[-1, 0]$ .

Si assuma invece  $a(i) > b(i)$ . L'espressione diventa:

$$s(i) = \frac{b(i) - a(i)}{a(i)} = \frac{b(i)}{a(i)} - \frac{a(i)}{a(i)} = \frac{b(i)}{a(i)} - 1$$

0	1	2
1	2	3
3	1	0.85
3	1	0.82
3	1	0.83
3	1	0.81
3	1	0.85
3	1	0.75
3	1	0.82
3	1	0.85
3	1	0.75
3	1	0.83

0	1	2
1	2	3
3	1	0.85
1	2	0.85
1	2	0.38
2	1	0.85
1	2	0.59
1	2	0.37
1	2	0.59
1	2	0.28
1	3	0.27
1	2	0.34
1	2	0.58

0	1	2
1	2	3
1	2	0.63
2	1	0.5
1	2	0.23
2	1	0.61
2	1	0.36
2	1	0.56
2	1	0.54
1	2	0.47
2	1	0.56
2	1	0.44
2	1	0.56

Tabella 3.3: Valori di  $s(i)$ , cluster e neighboring cluster per i primi 10 elementi dei tre cluster. Si noti come i valori di  $s(i)$  del primo cluster siano più alti ed il neighboring cluster sia sempre lo stesso, mentre gli altri due cluster hanno valori più variegati.

Avendo assunto che  $a(i)$  sia maggiore di  $b(i)$ , tale frazione è una frazione propria, e pertanto il suo valore è racchiuso nell'intervallo  $[0, 1]$ .

Per farsi una migliore idea del significato di  $s(i)$ , può essere utile considerare alcune situazioni estreme.

Quando  $s(i)$  è approssimativamente 1 si ha che  $b(i)$  è molto più grande di  $a(i)$ , e quindi la distanza fra  $i$  ed i membri del cluster a cui appartiene è molto più piccola della distanza fra  $i$  ed i membri degli altri cluster. Questo significa che la scelta di aver posto  $i$  in quel cluster è una buona scelta, perché persino la "seconda scelta" è di netto inferiore alla prima.

Quando  $s(i)$  è approssimativamente 0 si ha che  $b(i)$  e  $a(i)$  hanno lo stesso ordine di grandezza, e quindi la distanza fra  $i$  ed i membri del cluster a cui appartiene è comparabile a quella fra  $i$  ed i membri del suo neighboring cluster. Questo significa che la scelta di aver posto  $i$  in quel cluster è inconclusiva, nel senso che se fosse stato invece scelto il neighboring cluster si avrebbe avuto sostanzialmente lo stesso risultato.

Quando  $s(i)$  è approssimativamente  $-1$  significa che  $a(i)$  è molto più grande di  $b(i)$ , e quindi la distanza fra  $i$  ed i membri del cluster a cui appartiene è molto più grande della distanza fra  $i$  ed i membri degli altri cluster. Questo significa che la scelta di aver posto  $i$  in quel cluster è discutibile, perché vi sono cluster con cui  $i$  ha più in comune rispetto a quello in cui si trova.

I valori  $s(i)$  non sono, di per loro, particolarmente informativi. È però possibile costruire un Silhouette plot di ciascun cluster come un bar chart dove ciascuna colonna  $i$ -esima ha altezza proporzionale a  $s(i)$ , ordinato dalla colonna più alta a quella più bassa. Tale grafico può essere arricchito riportando informazioni ulteriori per ciascun elemento come, ad esempio: in quale cluster si trova, qual'è il suo neighboring cluster, il suo valore di  $s(i)$ .

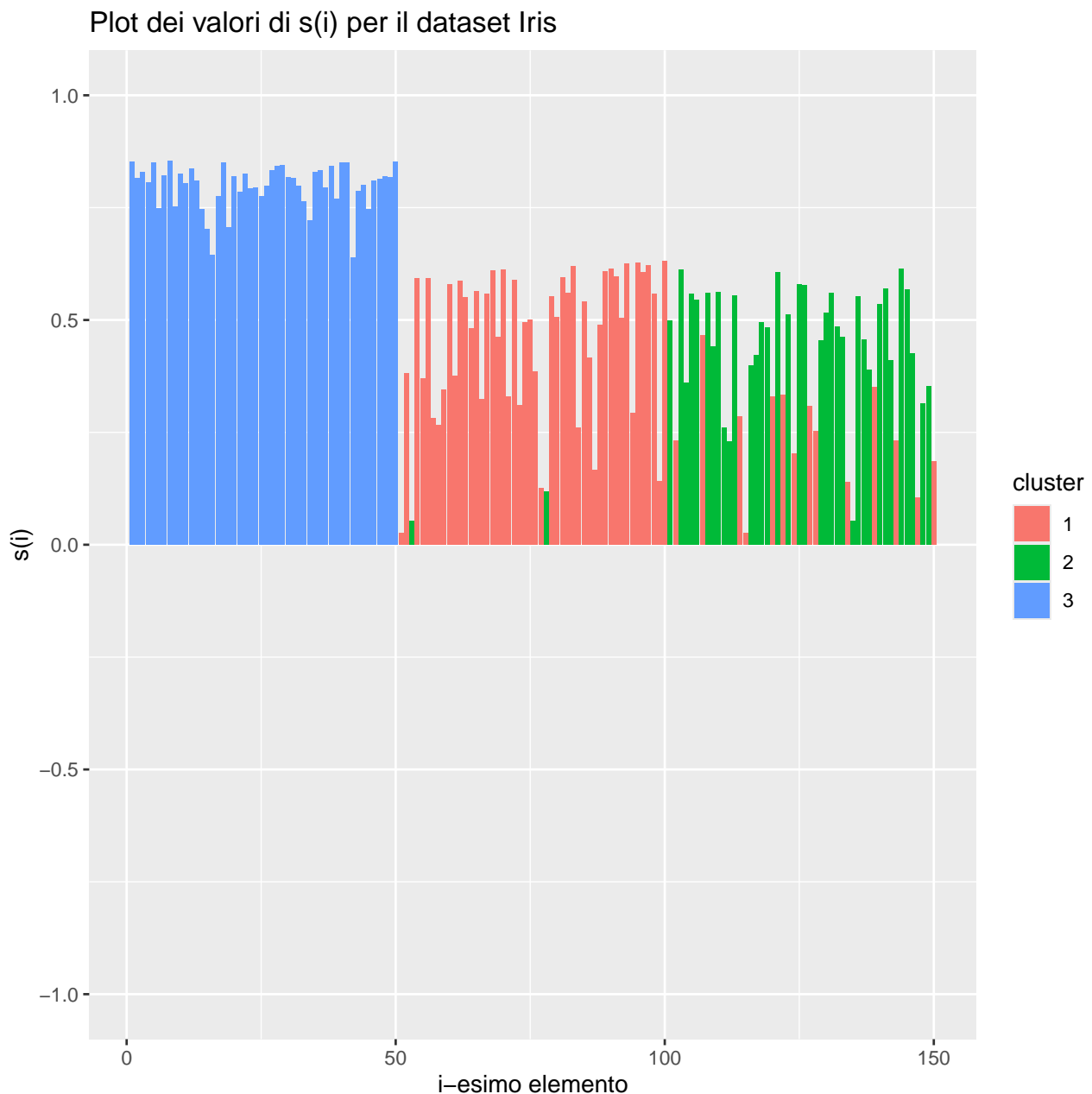


Figura 3.3: Silhouette plot per il dataset `iris`.

Il vantaggio di Silhouette è che non dipende da quale algoritmo è stato usato per effettuare il clustering. Per tale motivo, può essere usato per valutare "a posteriori" il risultato dell'algoritmo, provando a modificare il valore degli iperparametri per valutare quale combinazione di iperparametri restituisce il risultato più coerente. Questo riesce particolarmente bene negli algoritmi in cui il numero di cluster figura fra gli iperparametri, come K-Means.

Per esempio, si supponga che un dataset abbia effettivamente delle aree molto dense separate da aree ampie vuote. Operando un clustering in cui il numero di cluster è più basso del numero "naturale" di cluster, delle aree molto distanti tra loro vengono inglobate in un cluster unico nonostante vi siano considerevoli distanze nel mezzo. Silhouette può evidenziare questa situazione perché il valore di  $a(i)$  tende ad essere molto alto, essendo i membri del dataset molto distanti dai loro centroidi.

Si supponga invece di operare un clustering in cui il numero di cluster è più alto del numero "naturale" di cluster. In tale situazione, anche aree dense vengono spezzate in cluster diversi. Silhouette può evidenziare questa situazione perché il valore di  $b(i)$  tende ad essere molto basso, dato che elementi molto vicini vengono separati forzatamente.

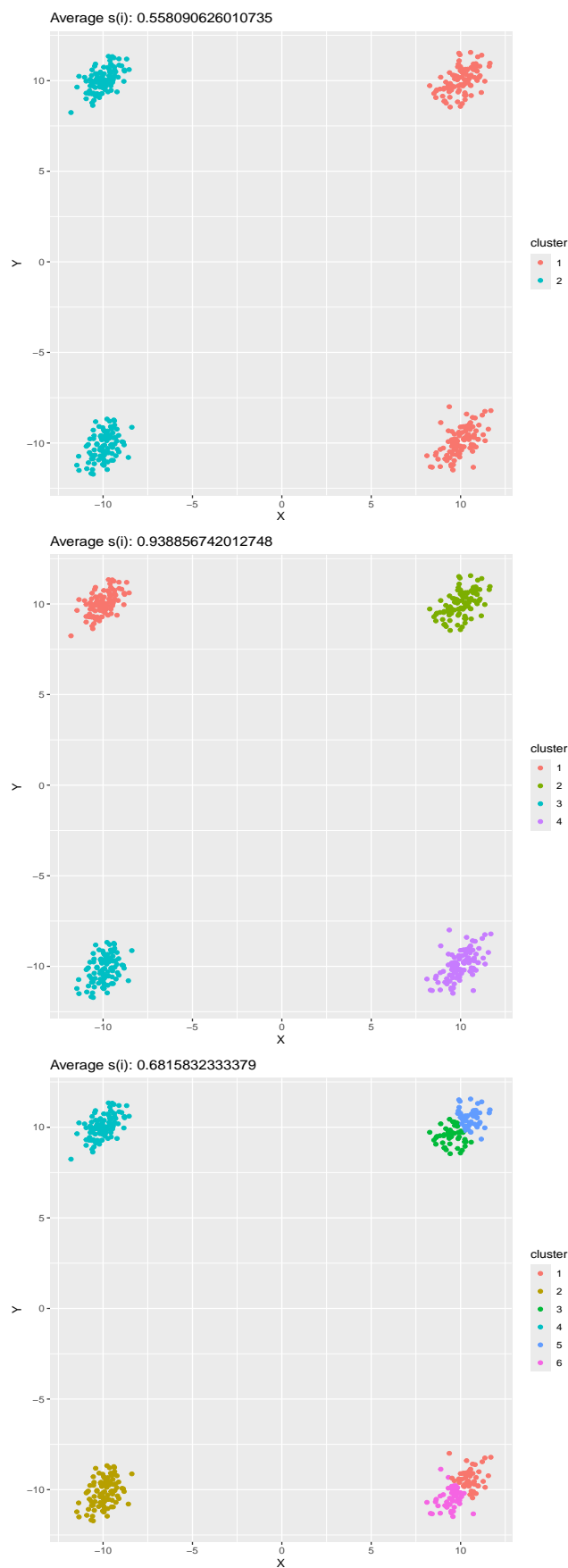


Figura 3.4: Clustering con K-Means usando  $K = 2, 4, 6$  per un dataset auto generato in cui la struttura di cluster è ben visibile.

In generale, l'operato di un algoritmo di clustering può considerarsi ottimale se il valore di  $s(i)$



tende ad essere molto alto per tutti gli elementi del dataset. A tale scopo, è possibile calcolare la Silhouette media per un certo cluster  $C$  come la media tutti gli  $s(i)$  per ciascun elemento  $i$  che appartiene a  $C$ . Se tale valore medio è alto, il cluster nel suo complesso è ben formato.

Se si ha invece interesse a sapere qual'è il numero ottimale di cluster, è possibile considerare la Silhouette media complessiva come la media di tutti gli  $s(i)$  per ogni elemento dell'intero dataset. L'idea è quella di testare diverse combinazioni di iperparametri dell'algoritmo di clustering e scegliere la combinazione che restituisce la Silhouette media complessiva più grande: tale combinazione sarà quella che restituisce il clustering che meglio interpreta il dataset.

Si noti come un valore della Silhouette media complessiva pari a 0 non significa necessariamente che il clustering non sia andato a buon fine. Può infatti anche indicare che effettivamente il dataset non ha alcuna struttura di clustering naturale, e che quindi l'algoritmo di clustering ha comunque fornito un risultato corretto, dato che effettivamente qualsiasi risultato vale l'altro.

### 3.4 Sanity check e matrice binaria

Il linguaggio R offre diverse implementazioni del calcolo della Silhouette. A differenza di altri linguaggi come Python, dove esiste un "consensus" (ufficiale o ufficioso) riguardo a quali siano i pacchetti da utilizzare per un determinato scopo, su R questo talvolta manca. Pertanto, prima di mettere Silhouette sotto analisi, è necessario scegliere un pacchetto fra quelli disponibili.

Ho cercato quante più implementazioni di Silhouette possibili utilizzando il sito <https://rdr.io> e scegliendone quante più possibili che provenissero dal repository CRAN. In particolare, sono stati scelti `cluster`, `drclust`, `tidyclust` e `Kira`. Pacchetti noti come `fpc`, che pure implementano Silhouette, li ho esclusi a priori perché non aggiornati da tempo.

Oltre a questi, come controprova ho utilizzato l'implementazione della Silhouette presente nel pacchetto `scikit-learn` per Python. Questo è stato fatto attraverso il pacchetto `reticulate`, che permette di chiamare funzioni Python all'interno di codice R.

Per comparare le performance delle diverse implementazioni di Silhouette ho eseguito due test, uno chiamato "sanity check" ed uno chiamato "matrice binaria". Il codice per la generazione dei test è liberamente disponibile. Ho organizzato il codice seguendo le linee guida riportate in [18]. Ho anche tenuto un lab notebook per tenere traccia dei risultati mano mano che venivano generati, facendo riferimento a [20]

Il test Sanity check prevede di utilizzare due dataset creati artificialmente, il primo dove la struttura di cluster è estremamente evidente ed il secondo dove la struttura di cluster è completamente assente, applicare su questi l'algoritmo di clustering K-Means e calcolare sul risultato di quest'ultimo la Silhouette media.

Il test matrice binaria inizia con una matrice di dimensione  $2n \times n$ , costituita per metà da 0 e per metà da 1. Su tale matrice viene applicato K-Means con iperparametro  $K = 2$  e si calcola la Silhouette media complessiva del risultato. Dopodiché, una qualsiasi delle righe viene sostituita con un valore scelto casualmente nell'intervallo  $(0, 1)$  e si ripete il procedimento. Tale test viene ripetuto esattamente  $2n$  volte, ogni volta con una riga diversa.

I  $2n$  valori della Silhouette media complessiva così trovati sono poi riportati in un plot; l'idea è che tali valori debbano essere alti nelle prime istanze del test quando gli 0 e gli 1 sono ben separati e piano piano perdano si riducano così come il dataset perde coesione. Ci si aspetta che i punti sul grafico approssimino una distribuzione lineare.

### 3.5 Algoritmi

Gli algoritmi di clustering sono innumerevoli, ed è impossibile testarli tutti. In questa tesi ne ho scelti quattro: **K-Means** [16] e la sua variante **K-Medians**, **DBSCAN** [9] e **HDBSCAN** [3].

### 3.5.1 Clustering partizionale: K-Means e K-Medians

**K-Means** e **K-Medians** sono esempi di algoritmi di clustering **partizionale**, ovvero che suddividono l'insieme di dati in un certo numero di cluster operando diversi "raffinamenti" spostando uno o più elementi da un cluster all'altro fino a raggiungere la precisione desiderata. L'algoritmo può essere descritto come segue:

1. Sia scelto un intero  $k$ . Tale valore sarà il numero di cluster;
2. Si scelgano  $k$  elementi qualsiasi del dataset, detti **seed**. Tali seed fungeranno da **centroidi** iniziali, ovvero da elementi che rappresentano il "baricentro" o il "punto medio" di ciascun cluster;
3. Per ciascun elemento del dataset che non è un centroide, si calcoli la distanza fra tale elemento e tutti i centroidi. L'elemento viene assegnato alla partizione il cui centroide ha la più piccola distanza da questo;
4. Per ogni cluster se ne ricalcolino i centroidi, operando la media aritmetica dei suoi valori;
5. Se è stato raggiunto un criterio di terminazione, l'algoritmo termina. Altrimenti, si riprende dal punto 3.

Si noti come l'algoritmo non specifichi un criterio di terminazione. Un criterio molto semplice consiste nel fissare un  $\varepsilon$  e valutare di quanto si discosta il nuovo valore dei centroidi (calcolato al punto 4) dal valore precedente: se questo scostamento è inferiore ad  $\varepsilon$ , l'algoritmo termina. Un criterio simile prevede di fissare un  $\varepsilon$  e di terminare l'algoritmo se il numero di elementi che vengono assegnati ad un cluster diverso alla fine della corrente iterazione è inferiore ad  $\varepsilon$ .

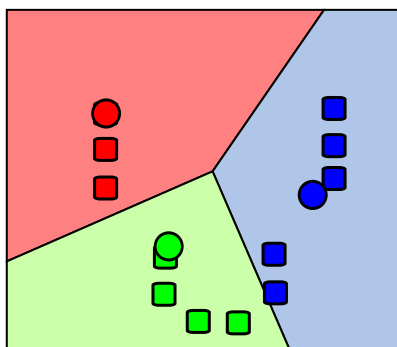


Figura 3.5: Applicazione dell'algoritmo K-Means ad un ipotetico dataset; i tre colori indicano i tre cluster individuati dall'algoritmo (By I, Weston.pace, CC BY-SA 3.0, <https://commons.wikimedia.org/w/index.php?curid=2463085>).

L'algoritmo K-Medians è una variante di K-Means che usa le mediane dei cluster come centroidi anziché le loro medie. Per tal motivo, mentre K-Means può utilizzare sostanzialmente qualsiasi funzione di distanza, K-Medians utilizza sempre la distanza di Manhattan.

Sebbene K-Means e K-Medians siano efficienti (se il numero di iterazioni è piccolo, il tempo di esecuzione è quasi-lineare) e anche estremamente semplici, tanto da comparire come subroutine in algoritmi più complessi, presentano dei problemi. Ad esempio, dato che ogni elemento ha lo stesso peso nel computo dei centroidi, anche un solo elemento che abbia valori anomali può destabilizzare completamente il risultato finale. Inoltre, il parametro  $k$  che determina il numero di cluster potrebbe non avere alcuna relazione con l'effettivo numero di cluster (se esistono) nell'insieme di dati, e quindi un valore scorretto di  $k$  porta a risultati che non rispecchiano per nulla la vera struttura di cluster. Infine, il raggruppamento di più elementi sulla base di una distanza genera dei cluster di forma ellittica, ma non tutti i dataset hanno una struttura di cluster con questa forma.

### 3.5.2 Clustering per densità: DBSCAN

**DBSCAN** è un esempio di algoritmo di clustering **per densità**, ovvero che costruisce i cluster a partire da come gli elementi di un dataset sono aggregati. In questo senso, i cluster figurano come regioni di spazio densamente popolate, di forma del tutto arbitraria, separate da spazio poco popolato.

DBSCAN prevede che vengano innanzitutto scelti due valori, un intero chiamato **MinPts** ed un numero reale positivo  $\varepsilon$ . A partire da questi, per ogni elemento  $p$  del dataset è possibile definire un insieme  $N_\varepsilon(p)$ , chiamato  **$\varepsilon$ -vicinato** ( **$\varepsilon$ -neighbourhood**). Tale insieme contiene tutti i punti  $q$  che hanno distanza da  $p$  inferiore a  $\varepsilon$ :

$$N_\varepsilon(p) = \{q | d(p, q) \leq \varepsilon\}$$

Ogni elemento  $p$  del dataset viene classificato sulla base del numero di elementi di  $N_\varepsilon(p)$ :

- Se  $N_\varepsilon(p)$  ha almeno **MinPts** elementi, si dice che  $p$  è un **core point**;
- Se  $N_\varepsilon(p)$  ha meno di **MinPts** elementi ma  $p$  si trova nell' $\varepsilon$ -vicinato di un altro elemento, allora si dice che  $p$  è un **border point**;
- Se un elemento non è né un core point né un border point, è detto **noise point**.

Si dice che un elemento  $q$  è **direttamente raggiungibile** da  $p$  se  $p$  è un core point e  $q$  si trova nell' $\varepsilon$ -vicinato di  $p$ . Se un elemento  $r$  è direttamente raggiungibile da  $q$  e  $q$  è direttamente raggiungibile da un elemento  $p$ , allora si dice che  $r$  è **indirettamente raggiungibile** da  $p$  (si noti come la raggiungibilità non sia una proprietà necessariamente simmetrica).

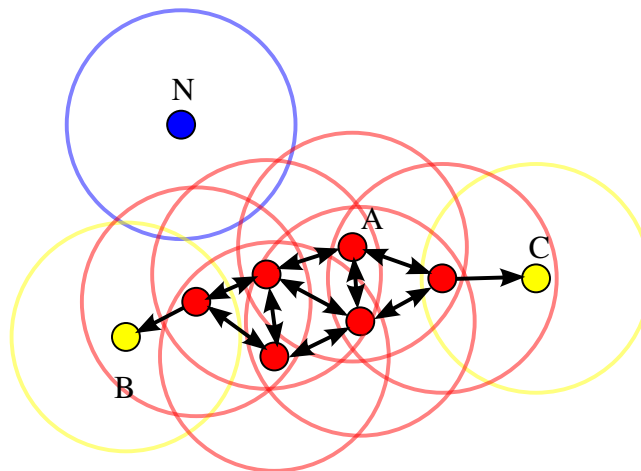


Figura 3.6: Ipotetica classificazione di alcuni elementi, usando **MinPts** = 4. Gli elementi in rosso sono dei core point, perchè hanno 4 o più elementi nel loro  $\varepsilon$ -vicinato. Gli elementi in giallo sono invece border point, perchè hanno meno di 4 elementi nel loro  $\varepsilon$ -vicinato ma sono nell' $\varepsilon$ -vicinato di almeno un core point. Infine, gli elementi in blu sono dei noise point, perchè oltre ad avere meno di 4 elementi nel loro  $\varepsilon$ -vicinato non sono nell' $\varepsilon$ -vicinato di alcun core point (By Chire - Own work, CC BY-SA 3.0, <https://commons.wikimedia.org/w/index.php?curid=17045963>).

Quando DBSCAN viene invocato viene inizializzato un cluster  $C$ , dopodiché viene costruito l' $\varepsilon$ -vicinato di ogni elemento  $p$  che non sia stato ancora ispezionato. Se tale insieme ha meno di **MinPts** elementi, allora  $p$  è certamente un noise point: questo perché è troppo isolato per poter essere un core point e, non essendo ancora stato ispezionato, non può trovarsi nell' $\varepsilon$ -vicinato di nessun altro punto.

Se invece l' $\varepsilon$ -vicinato di  $p$  ha almeno **MinPts** elementi, allora tale elemento è certamente un core point. Viene allora costruito un cluster  $C$  nel quale  $p$  viene inserito, dopodiché vengono osservati

tutti gli elementi  $q$  che si trovano nell' $\varepsilon$ -vicinato di  $p$ . Se  $q$  non é mai stato ispezionato, si osserva l' $\varepsilon$ -vicinato di  $q$  a sua volta: se questo contiene piú elementi dell' $\varepsilon$ -vicinato di  $p$ , allora  $N_\varepsilon(q)$  e  $N_\varepsilon(p)$  vengono uniti in un insieme unico, perché gli elementi dell' $\varepsilon$ -vicinato di  $q$  sono indirettamente raggiungibili a partire da  $p$ . Se  $q$  non appartiene ad alcun cluster, allora viene aggiunto al cluster in esame.

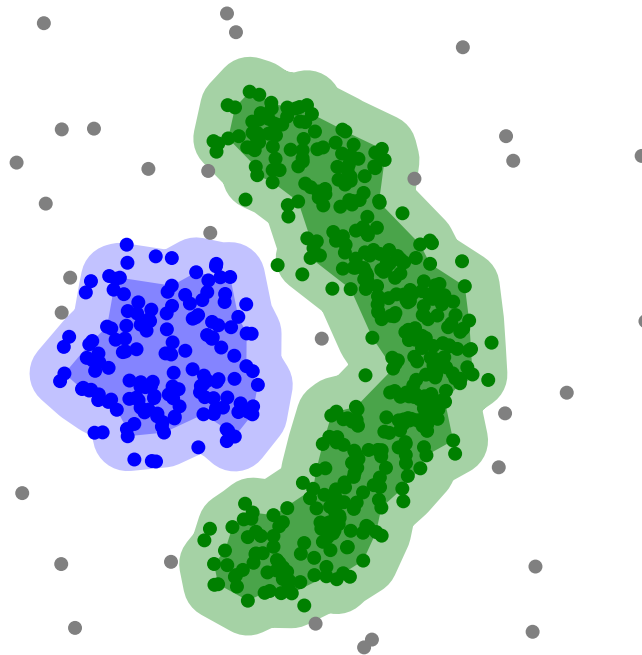


Figura 3.7: Risultato dell'applicazione dell'algoritmo DBSCAN su un ipotetico dataset. Le aree in blu e in verde rappresentano i due cluster, mentre i punti in grigio sono i noise point (By Chire - Own work, CC BY-SA 3.0, <https://commons.wikimedia.org/w/index.php?curid=17085332>)

Si osservi come la scelta di  $\varepsilon$  e MinPts influisca di molto sul risultato finale. Infatti, scegliendo un valore di  $\varepsilon$  o di MinPts troppo piccolo, quasi tutti gli elementi verranno classificati come noise point, e quindi quasi tutti scartati. D'altro canto, un valore di  $\varepsilon$  o di MinPts troppo grande potrebbe indurre un clustering dove quasi tutti i punti sono inclusi nello stesso cluster.

A differenza di K-Means e K-Medians, che costruiscono sempre cluster di forma ellissoidale, DBSCAN costruisce cluster di qualsiasi forma. Questo è sia un aspetto positivo, perchè in questo modo è possibile catturare strutture di cluster molto più variegate, sia negativo, perchè la densità di un'area non sottende necessariamente alla presenza di un cluster, e non tutte le aree dense lo sono allo stesso modo. Occorre però evidenziare come, nonostante sia leggermente inferiore a K-Means e K-Medians in termini di tempo di esecuzione ( $O(n \log(n))$ , con  $n$  numero di elementi del dataset), le sue prestazioni sono state empiricamente dimostrate come molto competitive.

### 3.5.3 Clustering gerarchico: HDBSCAN

**HDBSCAN** é un esempio di algoritmo di clustering **gerarchico**, ovvero che costruisce i cluster formando una struttura ad albero <sup>1</sup>

<sup>1</sup>In realtà, HDBSCAN é un algoritmo ibrido fra il paradigma per densità ed il paradigma gerarchico. Un esempio semplice di algoritmo di clustering "puramente" gerarchico é UPGMA [21].

## 4. Risultati

### 4.1 Risultati dei test

I risultati per il test sanity check sono riportati di seguito. Il test sanity check non é stato particolarmente conclusivo, perché tutti e cinque i pacchetti hanno fornito valori molto simili (circa 0.9 per il primo dataset e circa 0.4 per il secondo). Questo é un risultato atteso, perché il test era appositamente costruito per escludere pacchetti problematici.

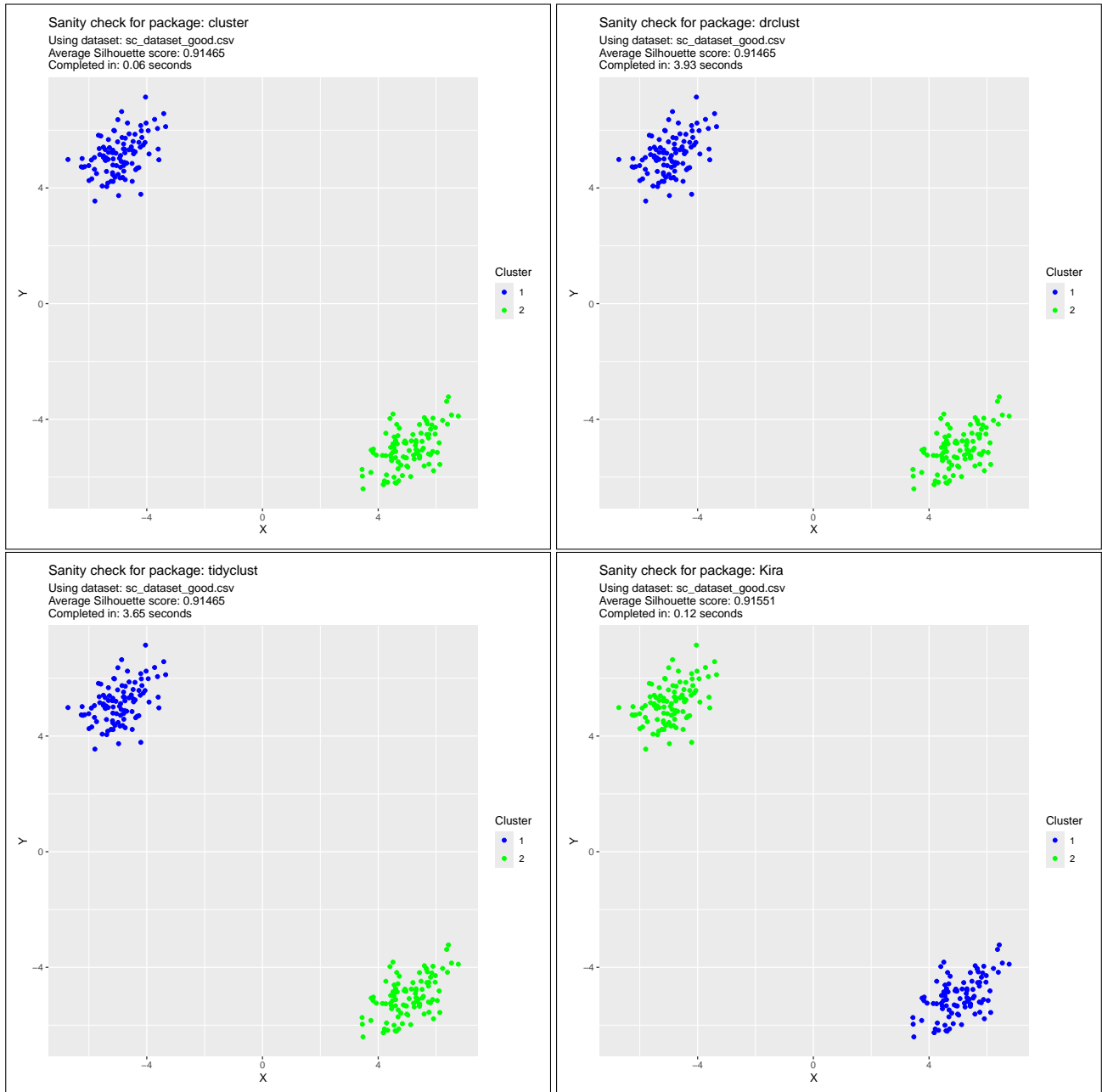


Figura 4.1: Plot dei test sanity check usando il dataset con struttura di cluster ben visibile.

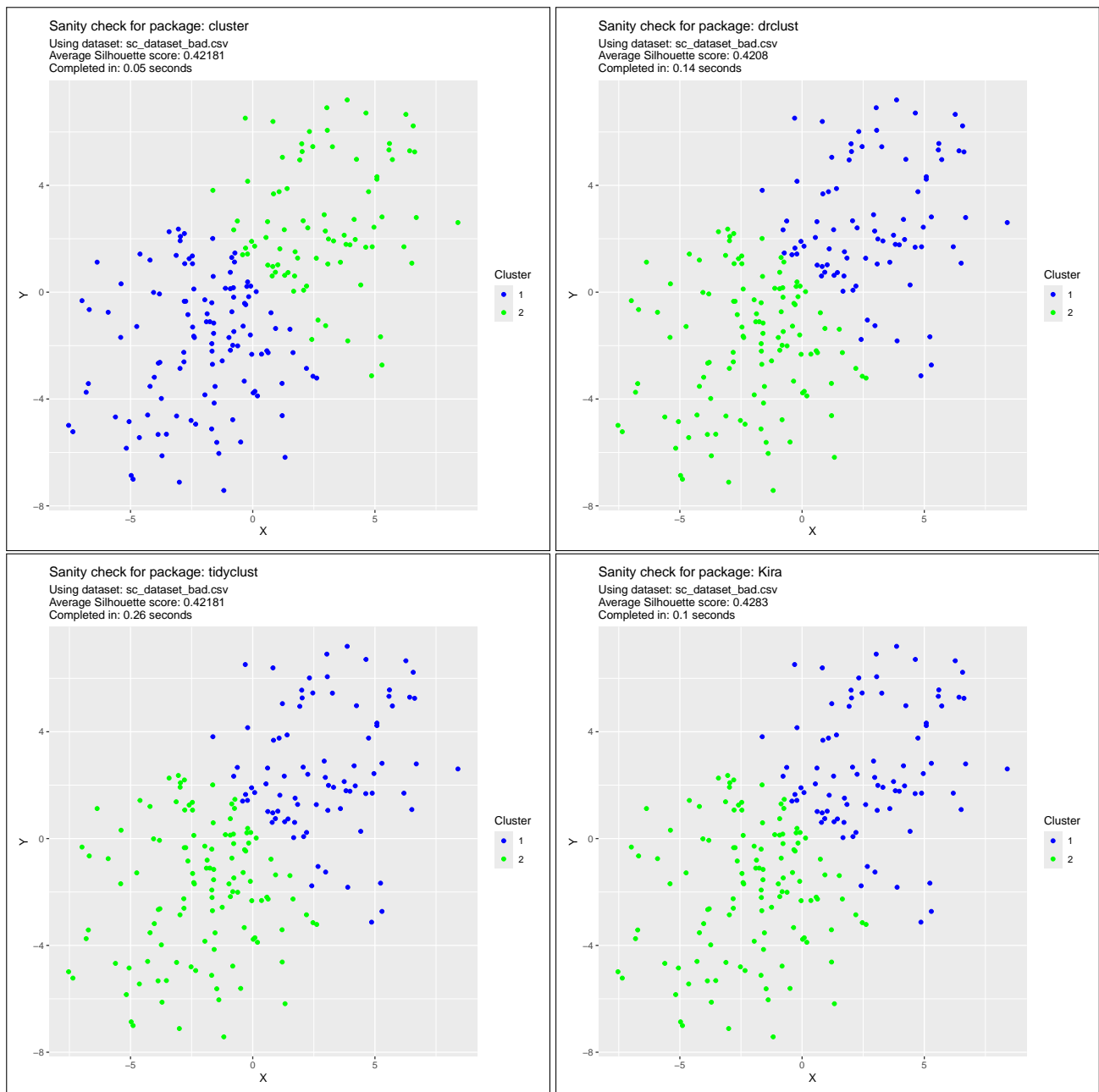


Figura 4.2: Plot dei test sanity check usando il dataset con struttura di cluster assente.

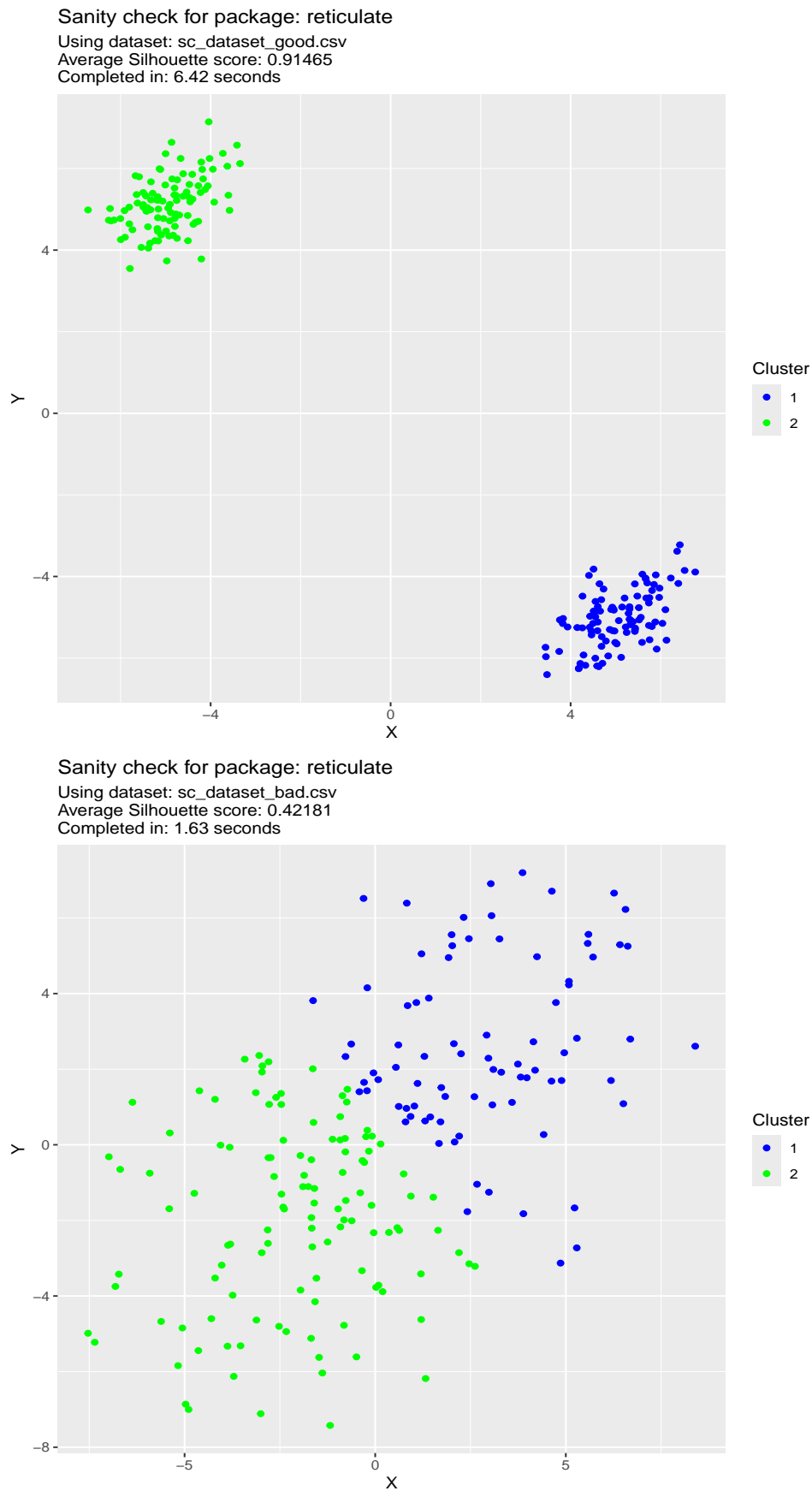


Figura 4.3: Plot del test sanity check usando `scikit-learn` attraverso `reticulate`.

I risultati per il test matrice binaria sono riportati di seguito. Il test é stato piú informativo del precedente, perché i valori restituiti avevano delle differenze evidenziali. In particolare, Kira é

stato il pacchetto con le performance peggiori, perché i valori della Silhouette media complessiva sono rimasti pressoché identici. I pacchetti `cluster`, `drclust` e `tidyclust` hanno invece avuto risultati molto simili. In particolare, `cluster` e `tidyclust` hanno avuto risultati perfettamente identici, segno che probabilmente l'uno usa l'altro come subroutine.

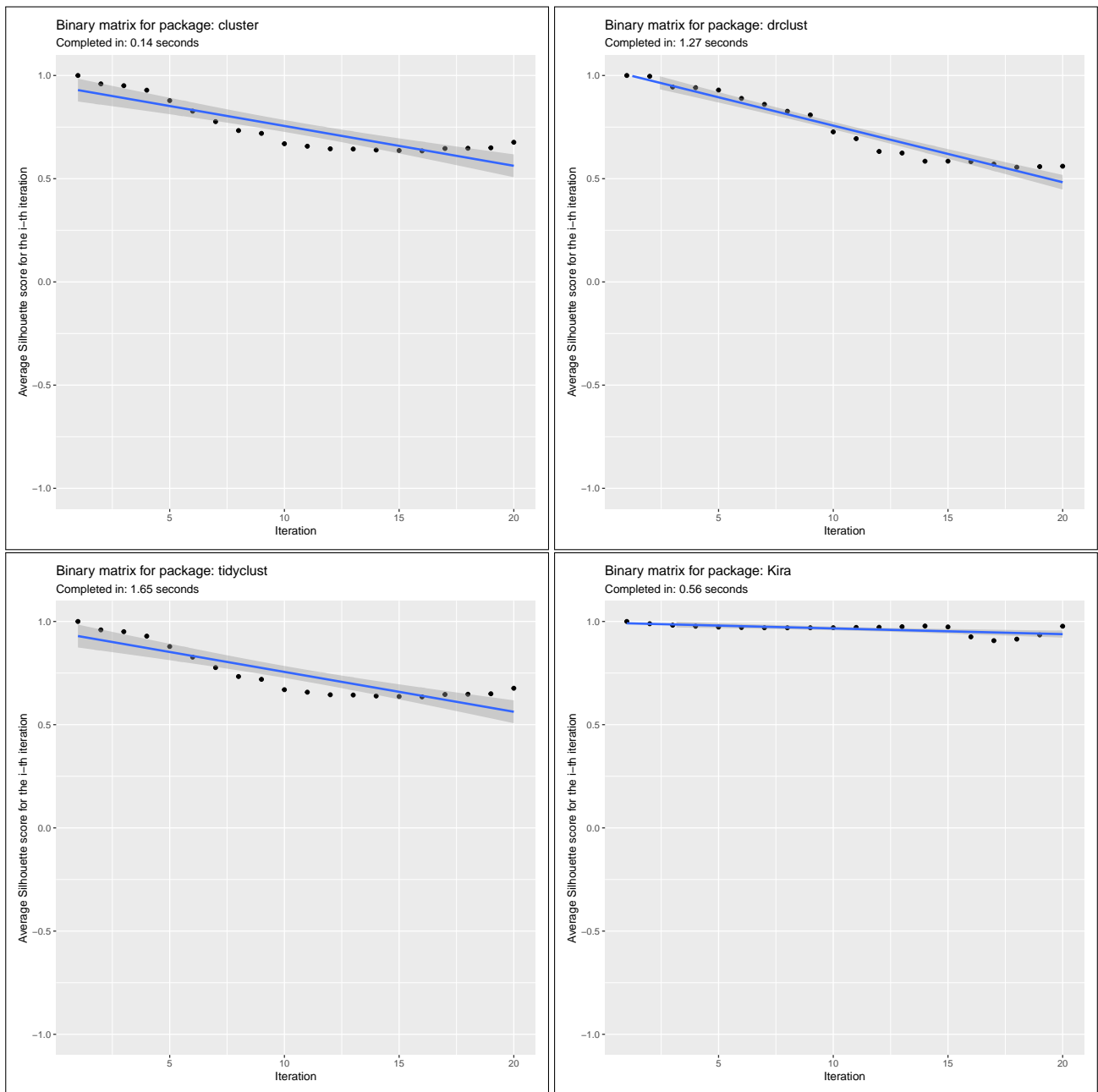


Figura 4.4: Plot dei test matrice binaria.



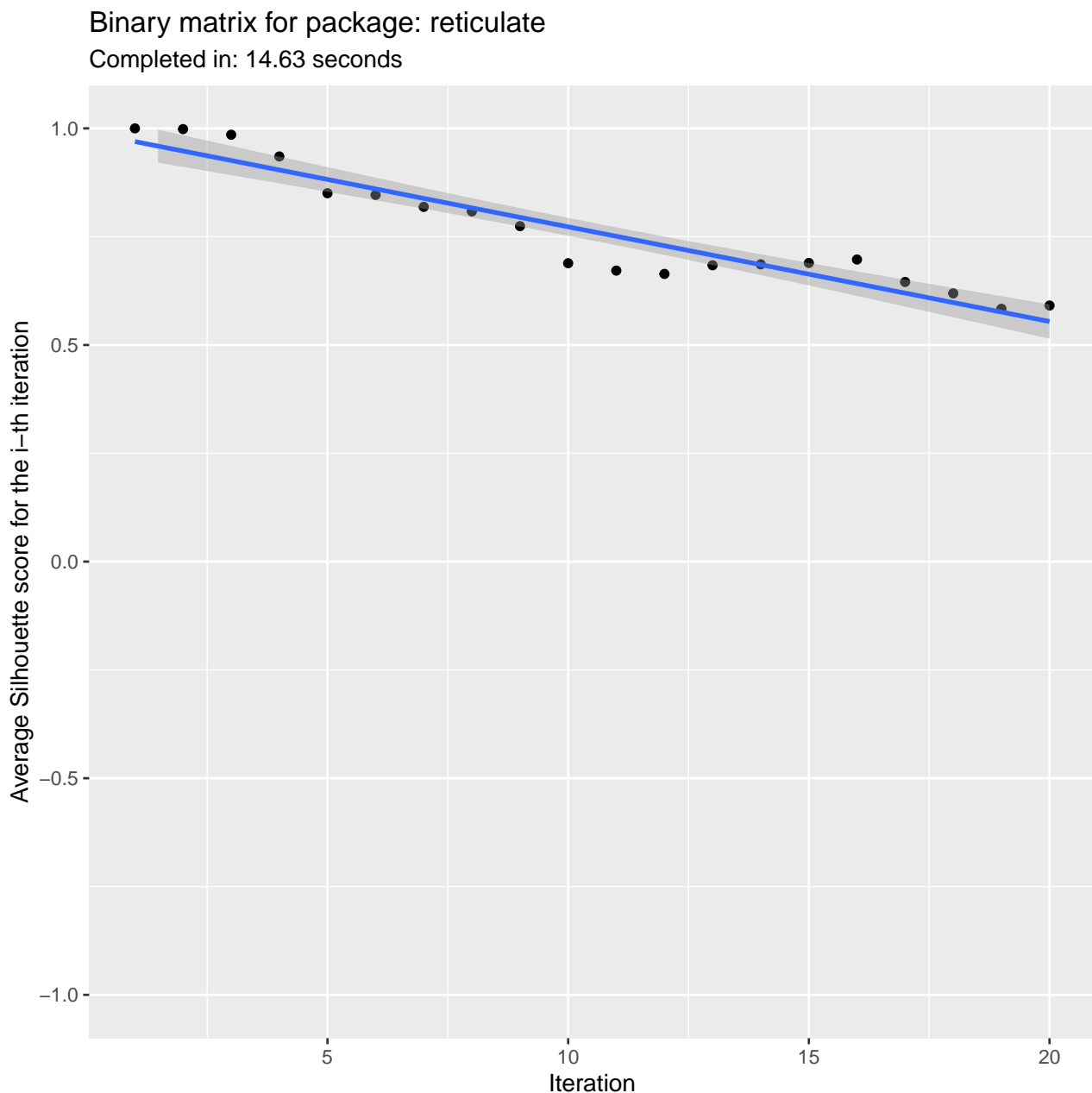


Figura 4.5: Plot del test matrice binaria per il pacchetto `scikit-learn` (attraverso `reticulate`)

## 4.2 Risultati delle applicazioni su EHR

Per K-Means, è stato testato un numero di cluster compreso fra 2 e 6, mentre per K-Medians fra 2 e 10.

Per DBSCAN e HDBSCAN, MinPts è stato scelto nel range dal numero delle dimensioni del dataset al doppio più uno delle dimensioni del dataset.

Per DBSCAN,  $\epsilon$  è stato scelto partizionando la distanza massima in parti uguali.

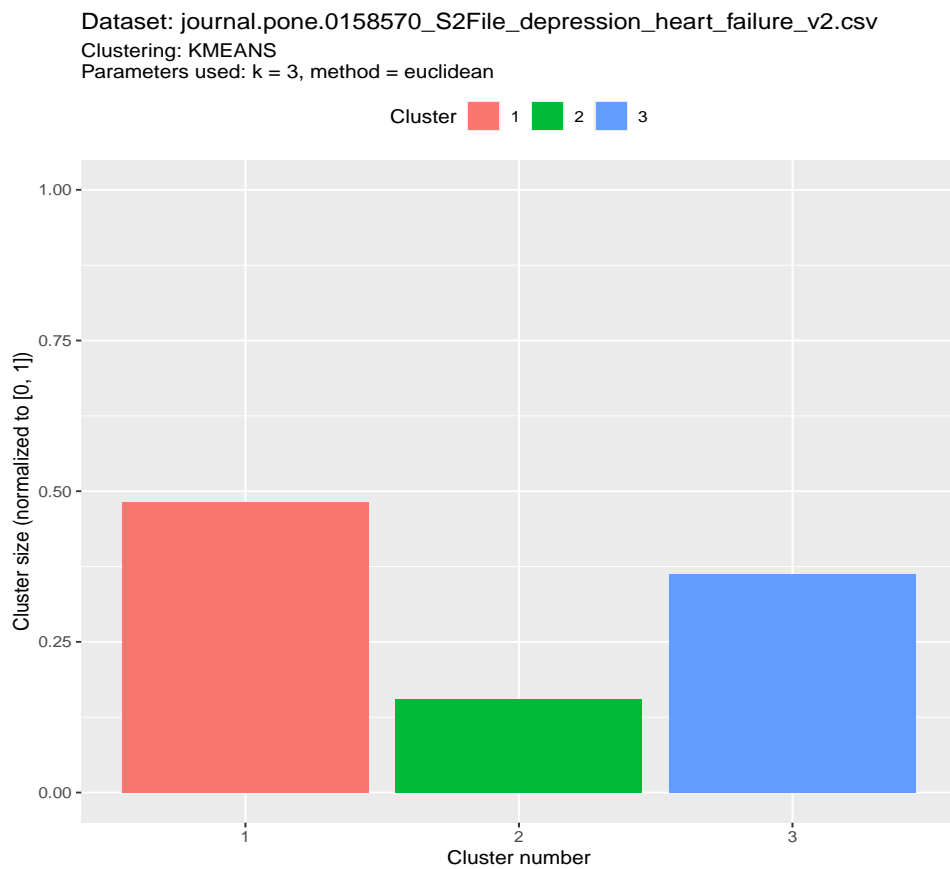
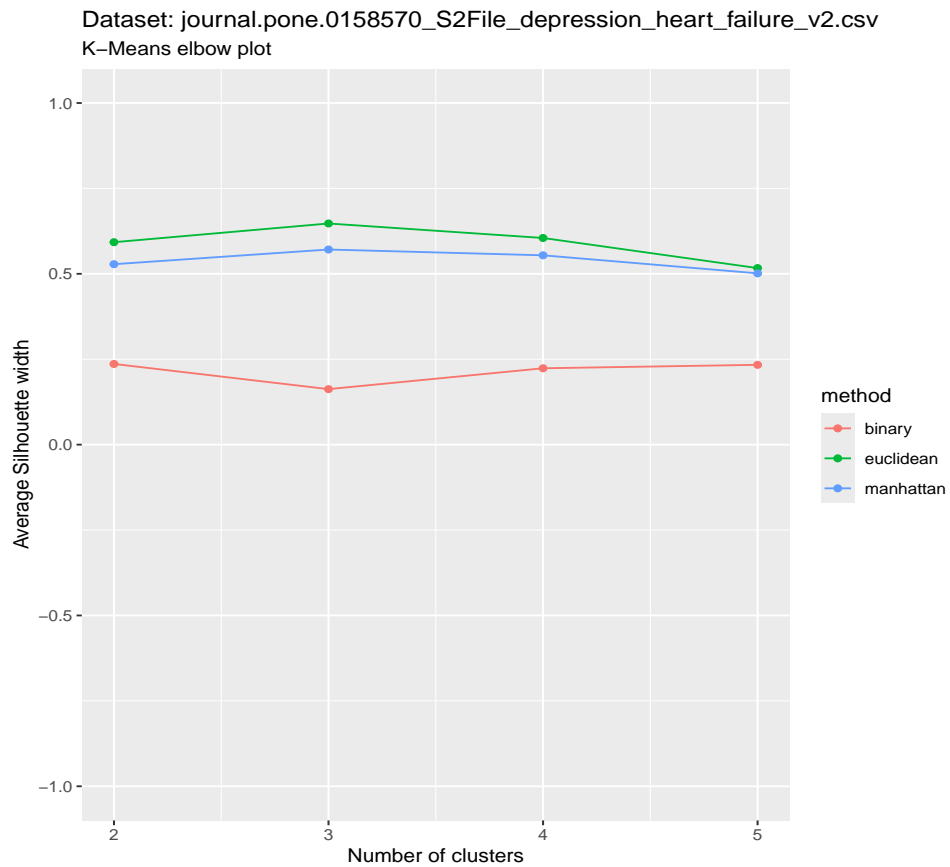
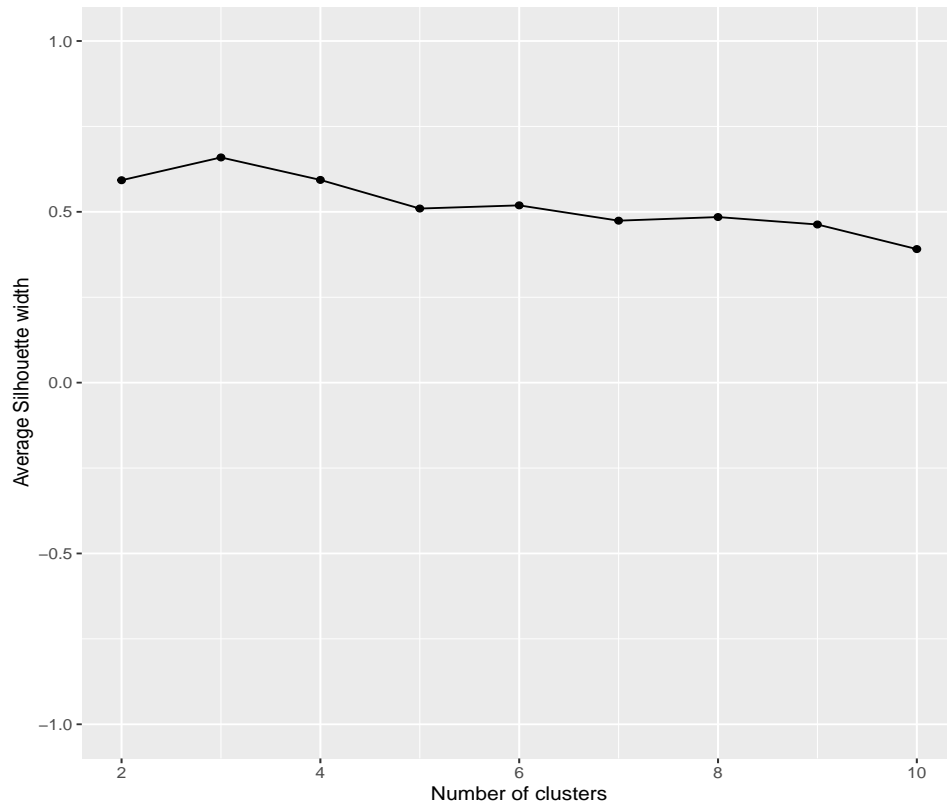


Figura 4.6: Risultati dell'algoritmo K-Means per il dataset `HeartFailure.csv`

Dataset: journal.pone.0158570\_S2File\_depression\_heart\_failure\_v2.csv  
K-Medians elbow plot



Dataset: journal.pone.0158570\_S2File\_depression\_heart\_failure\_v2.csv  
Clustering: KMEDIANS  
Parameters used: k = 3

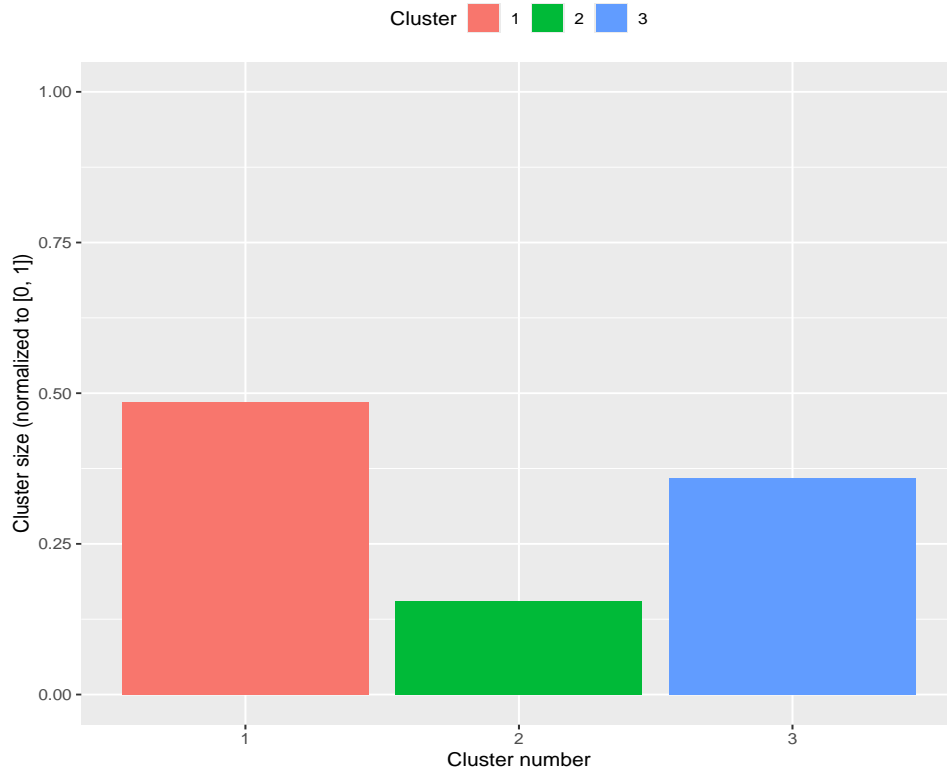
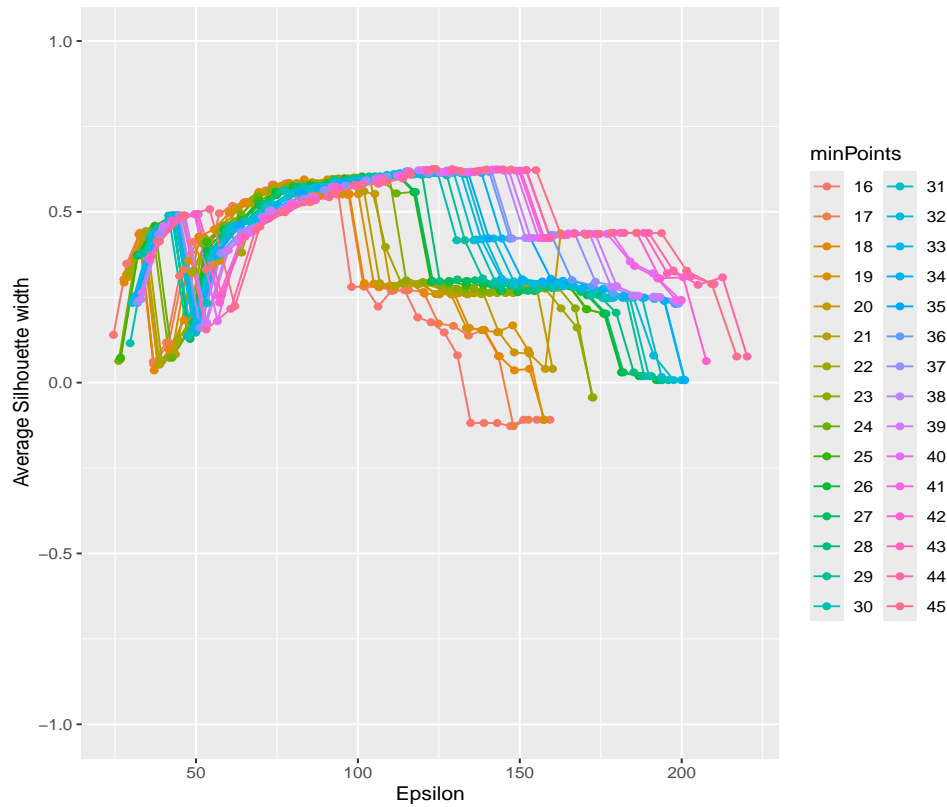


Figura 4.7: Risultati dell'algorithm K-Medians per il dataset HeartFailure.csv

Dataset: journal.pone.0158570\_S2File\_depression\_heart\_failure\_v2.csv  
DBSCAN elbow plot



Dataset: journal.pone.0158570\_S2File\_depression\_heart\_failure\_v2.csv  
Clustering: DBSCAN  
Parameters used: minPoints = 43, epsilon = 123.1177

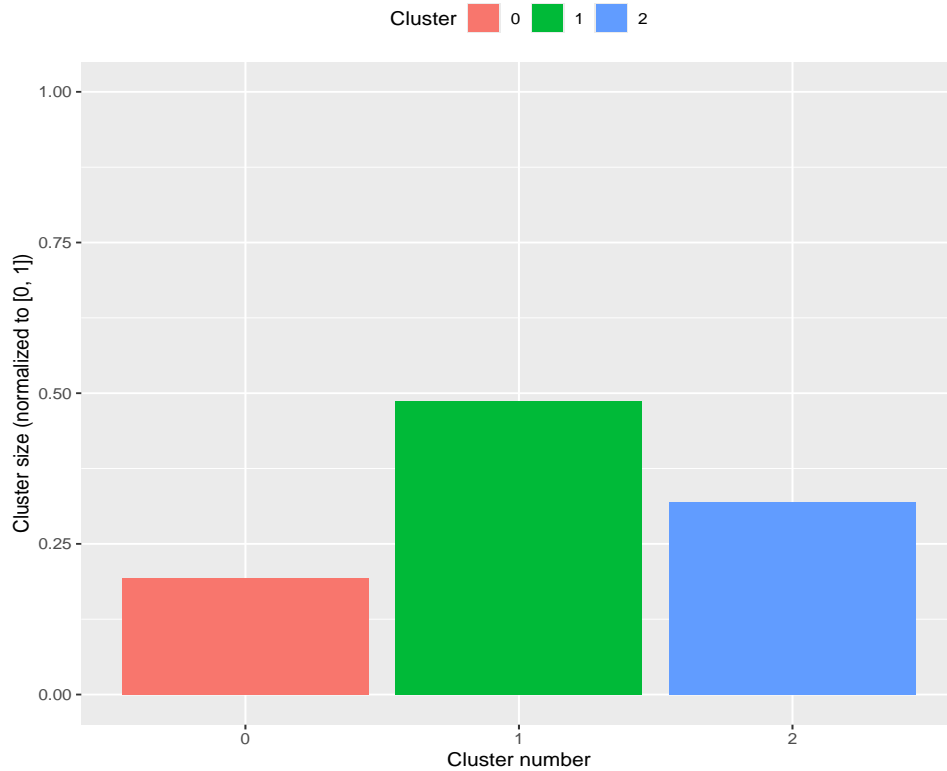


Figura 4.8: Risultati dell'algoritmo DBSCAN per il dataset HeartFailure.csv

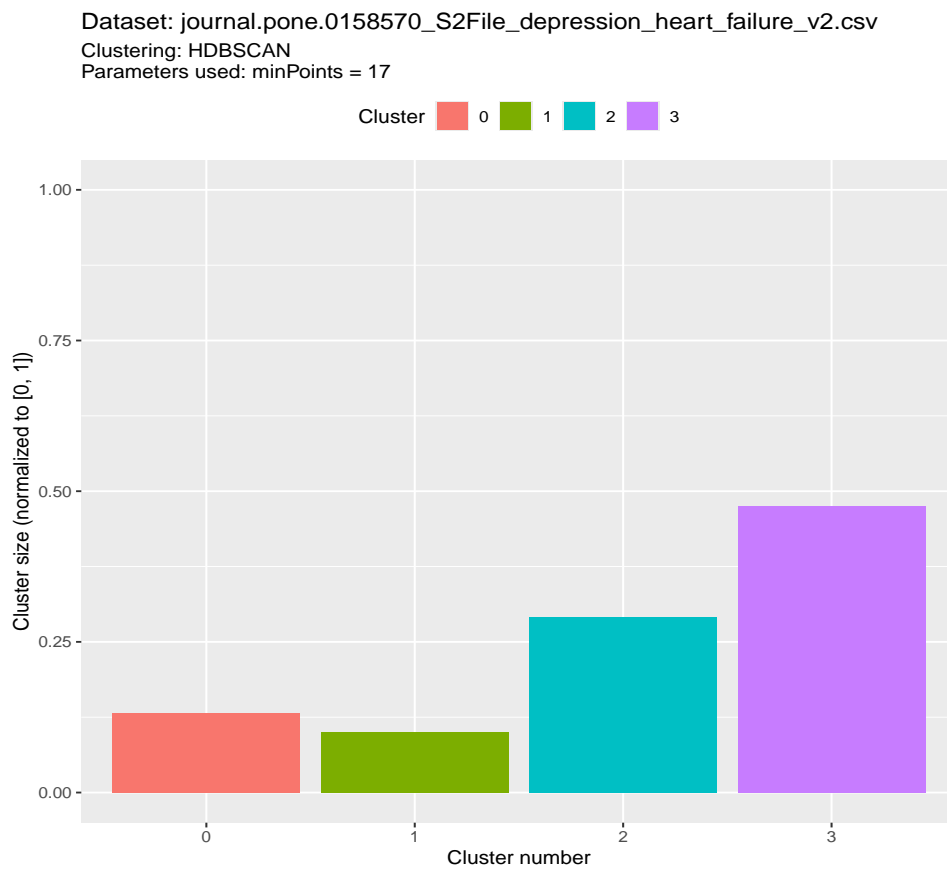
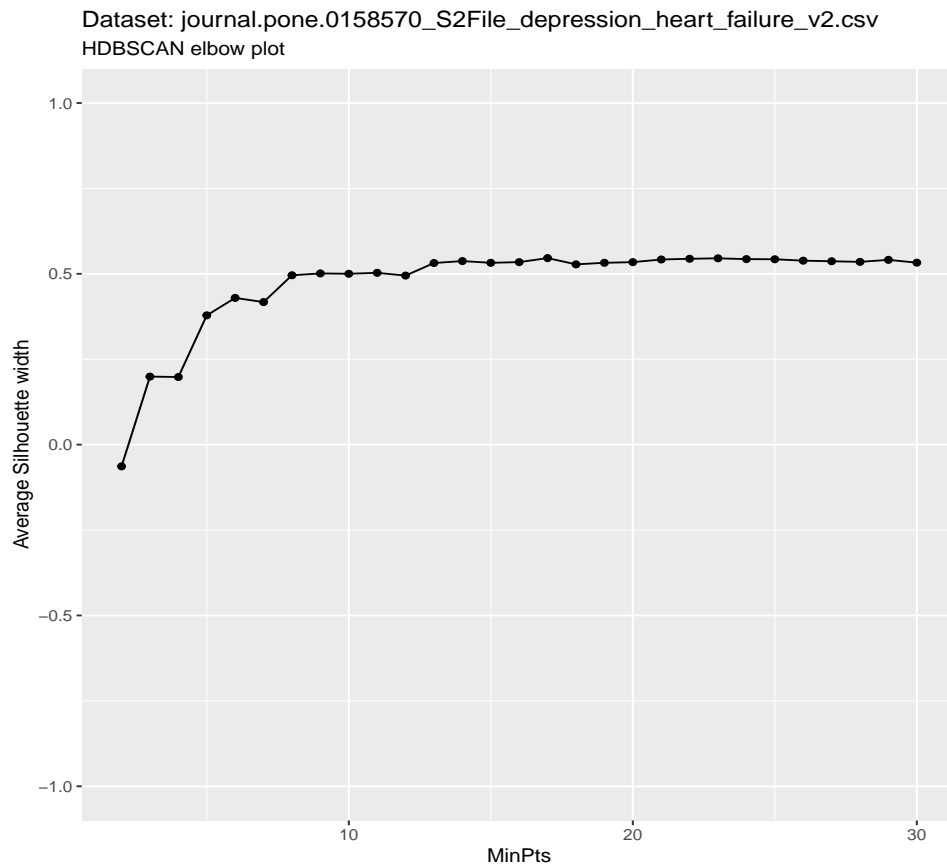
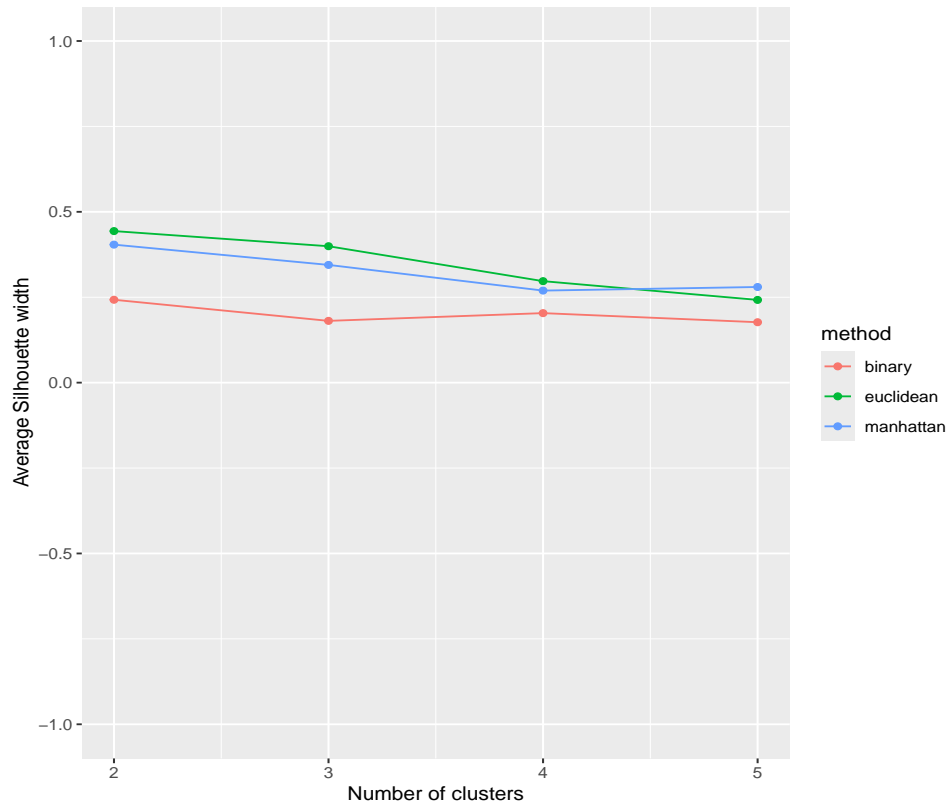


Figura 4.9: Risultati dell'algoritmo HDBSCAN per il dataset `HeartFailure.csv`

Dataset: journal.pone.0175818\_S1Dataset\_Spain\_cardiac\_arrest\_EDITED..csv  
K-Means elbow plot



Dataset: journal.pone.0175818\_S1Dataset\_Spain\_cardiac\_arrest\_EDITED..csv  
Clustering: KMEANS  
Parameters used: k = 2, method = euclidean

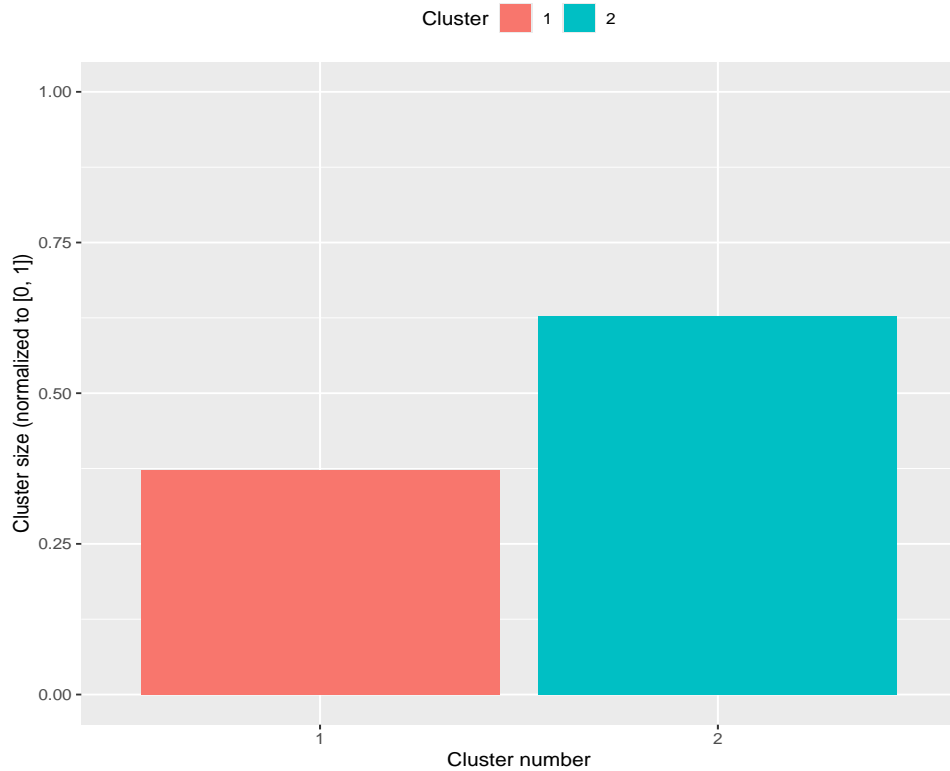
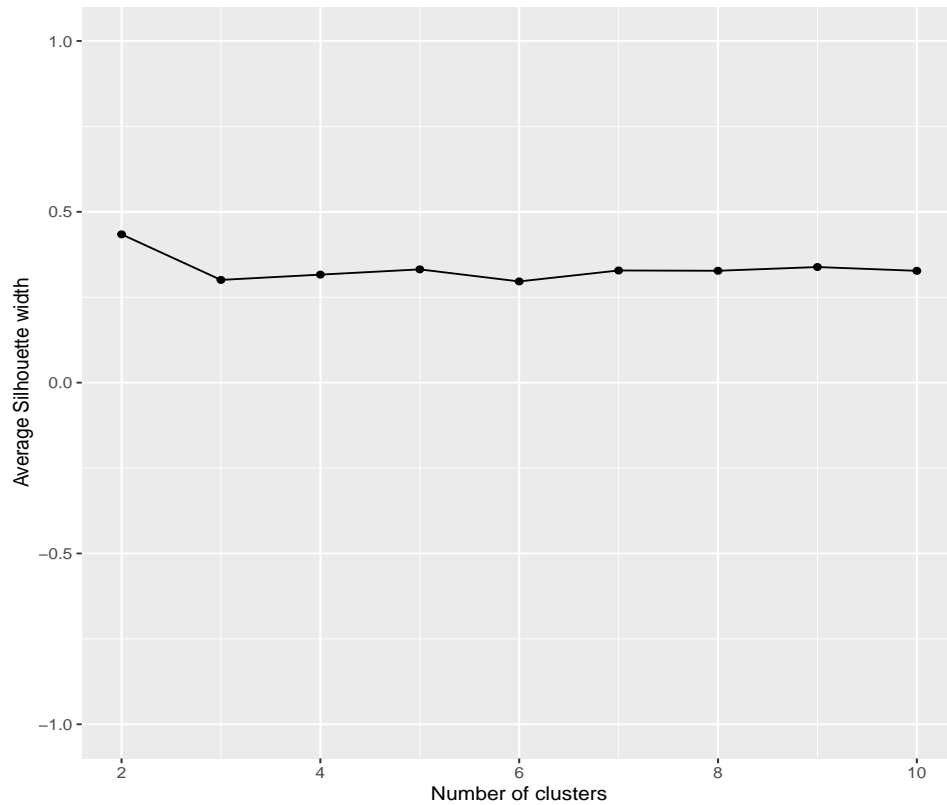


Figura 4.10: Risultati dell'algoritmo K-Means per il dataset CardiacArrest.csv

Dataset: journal.pone.0175818\_S1Dataset\_Spain\_cardiac\_arrest\_EDITED.csv  
K-Medians elbow plot



Dataset: journal.pone.0175818\_S1Dataset\_Spain\_cardiac\_arrest\_EDITED.csv  
Clustering: KMEDIANS  
Parameters used: k = 2

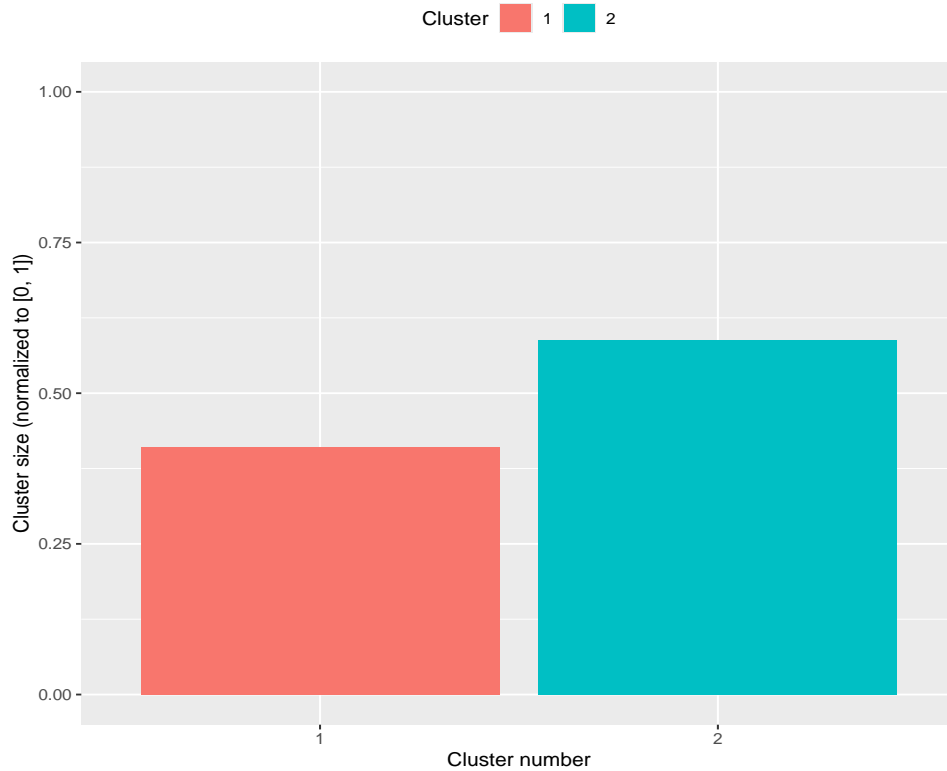
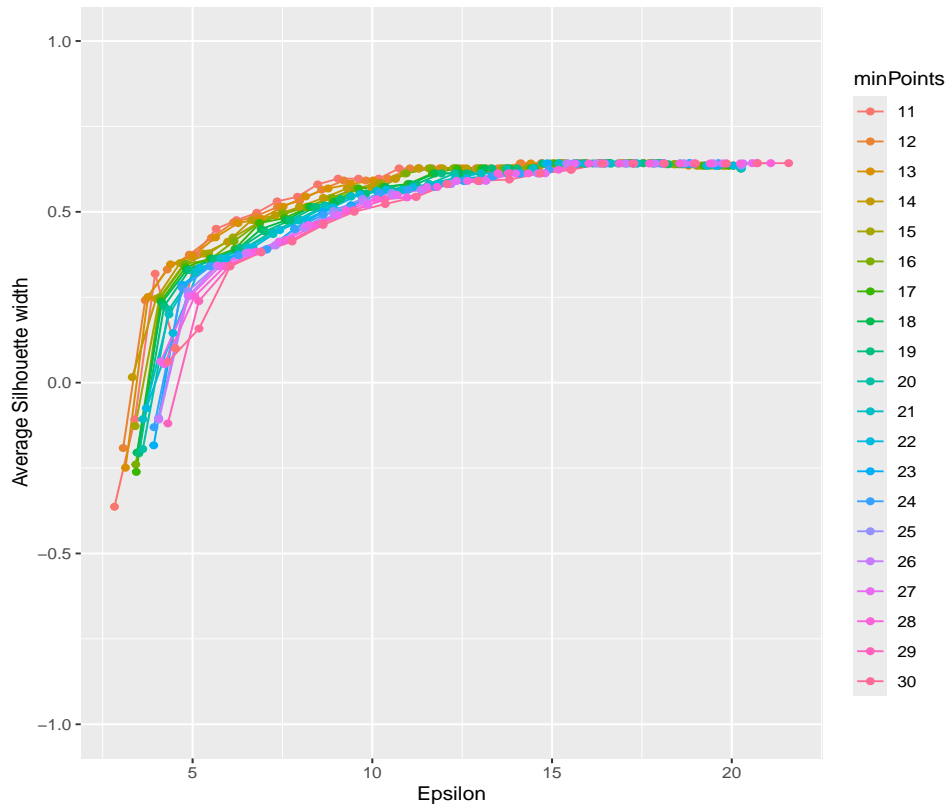


Figura 4.11: Risultati dell'algoritmo K-Medians per il dataset `CardiacArrest.csv`

Dataset: journal.pone.0175818\_S1Dataset\_Spain\_cardiac\_arrest\_EDITED.csv  
DBSCAN elbow plot



Dataset: journal.pone.0175818\_S1Dataset\_Spain\_cardiac\_arrest\_EDITED.csv  
Clustering: DBSCAN  
Parameters used: minPoints = 11, epsilon = 14.70267

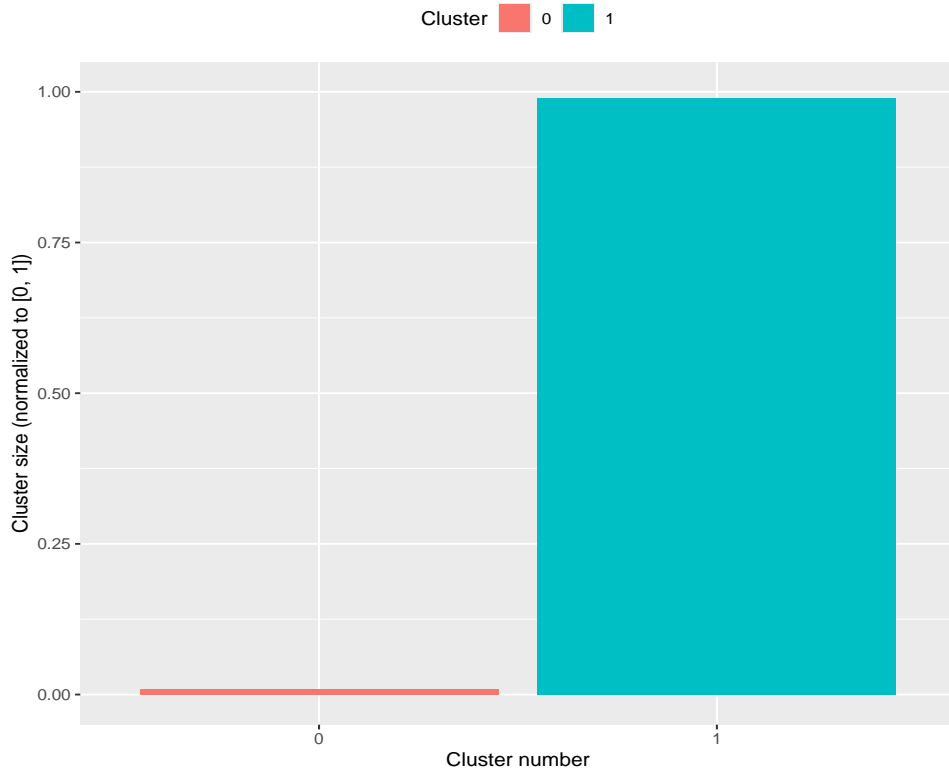
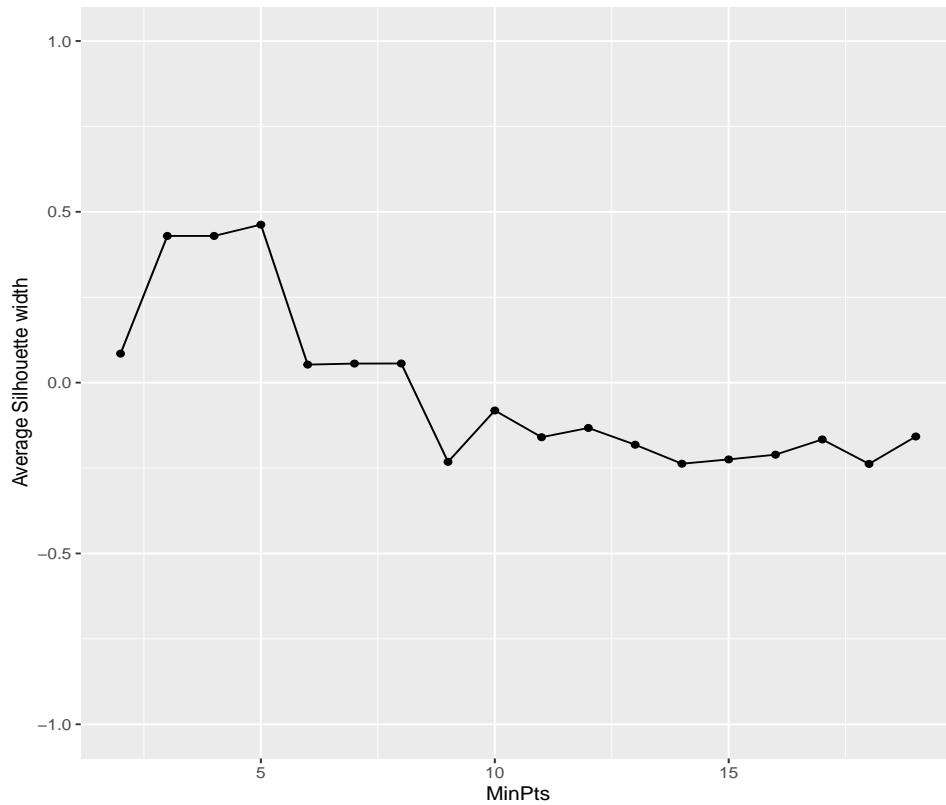


Figura 4.12: Risultati dell'algoritmo DBSCAN per il dataset CardiacArrest.csv



Dataset: journal.pone.0175818\_S1Dataset\_Spain\_cardiac\_arrest\_EDITED.csv  
HDBSCAN elbow plot



Dataset: journal.pone.0175818\_S1Dataset\_Spain\_cardiac\_arrest\_EDITED.csv  
Clustering: HDBSCAN  
Parameters used: minPoints = 5

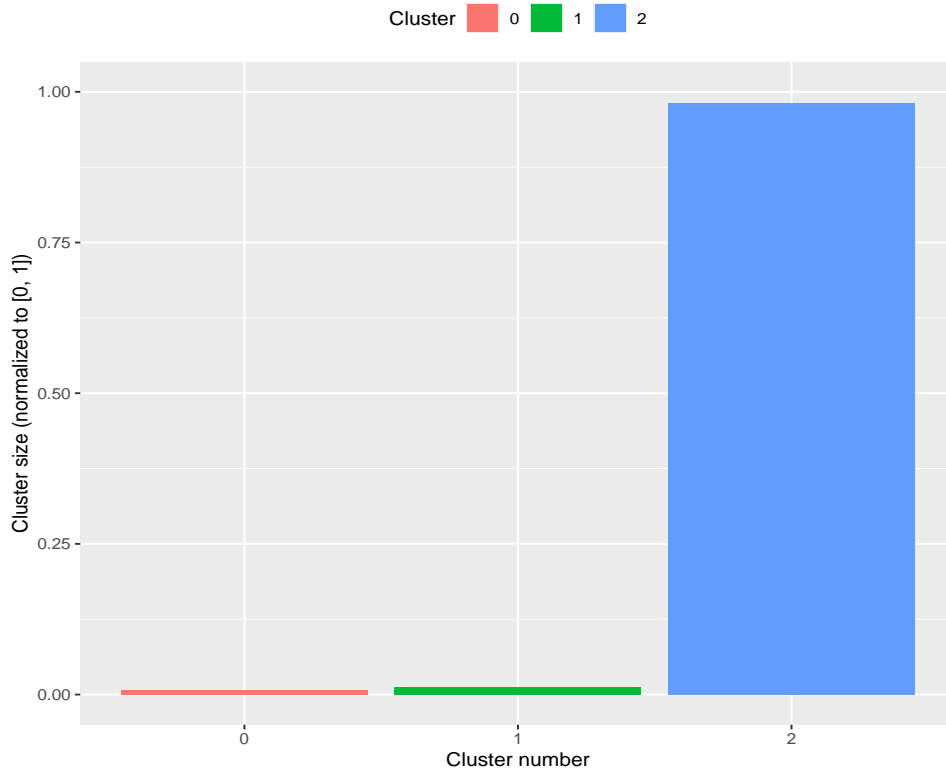


Figura 4.13: Risultati dell'algoritmo HDBSCAN per il dataset CardiacArrest.csv

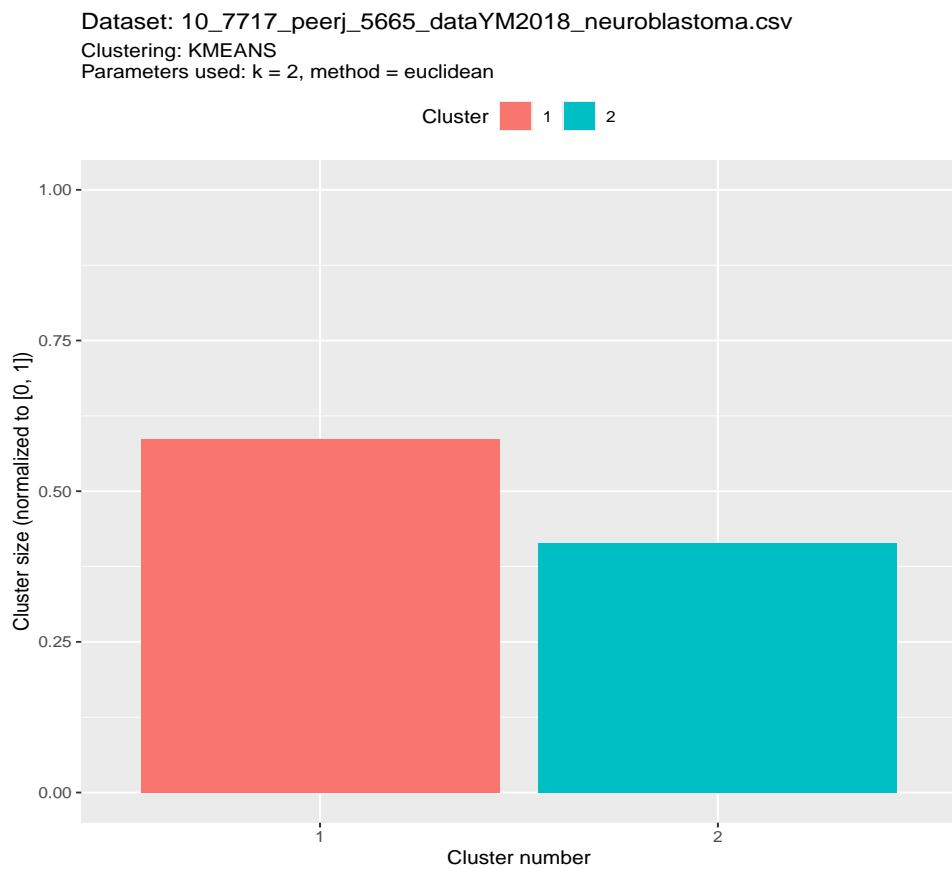
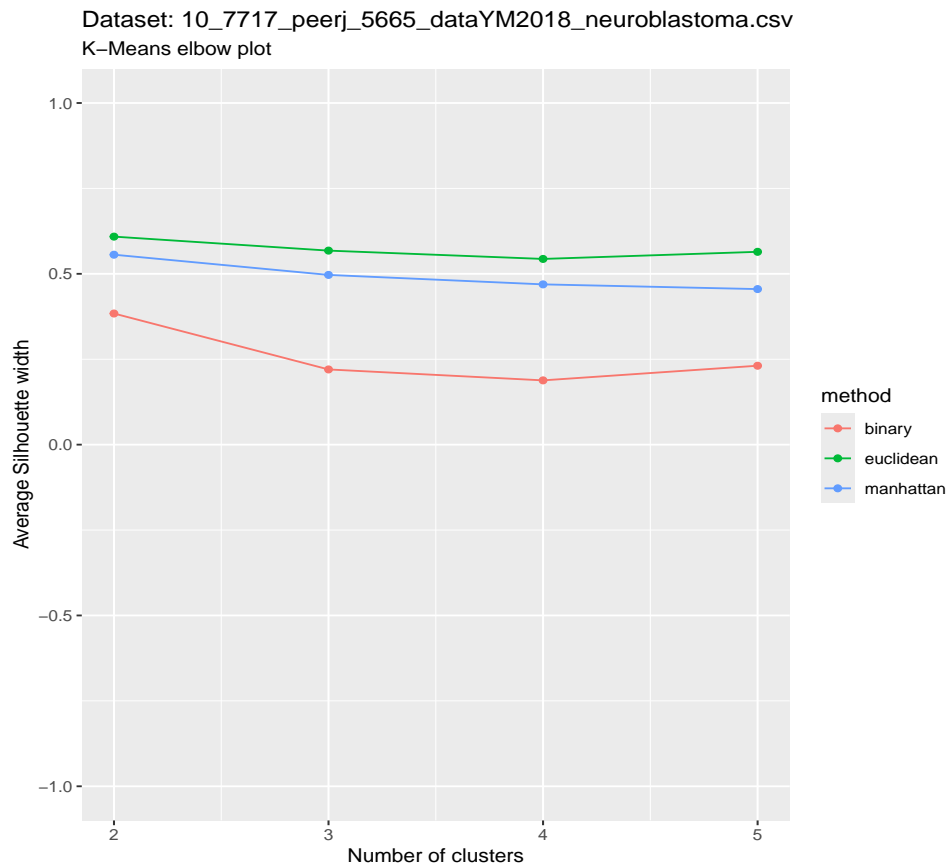


Figura 4.14: Risultati dell'algoritmo K-Means per il dataset Neuroblastoma.csv

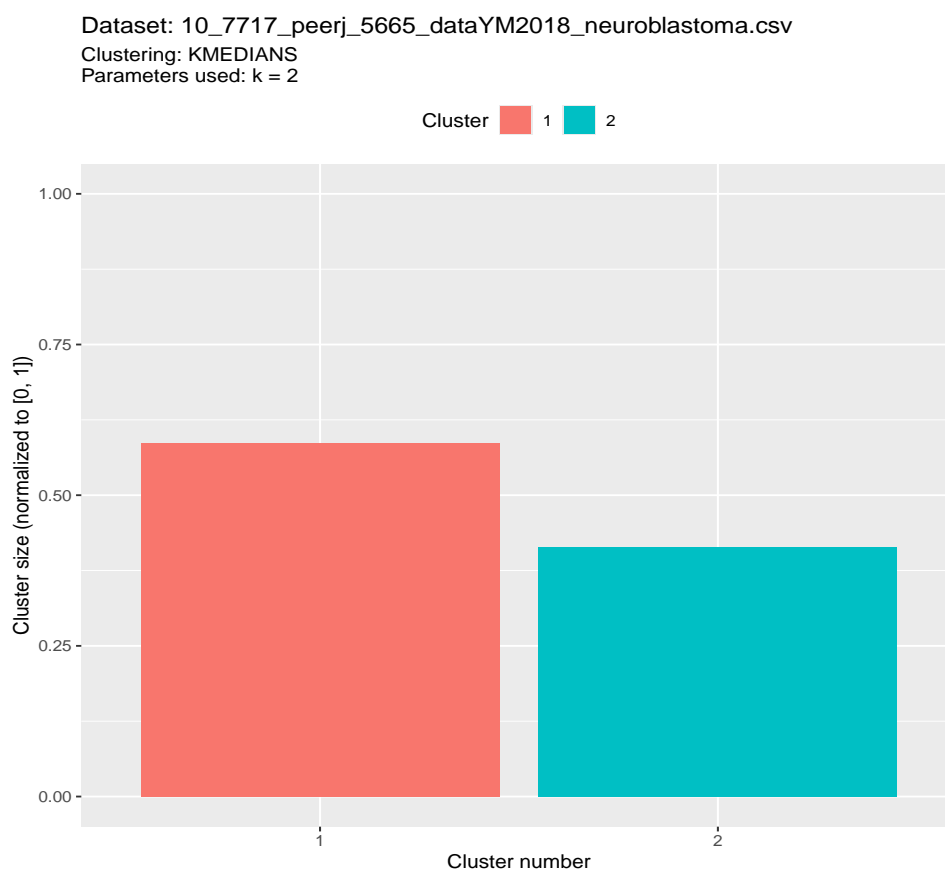
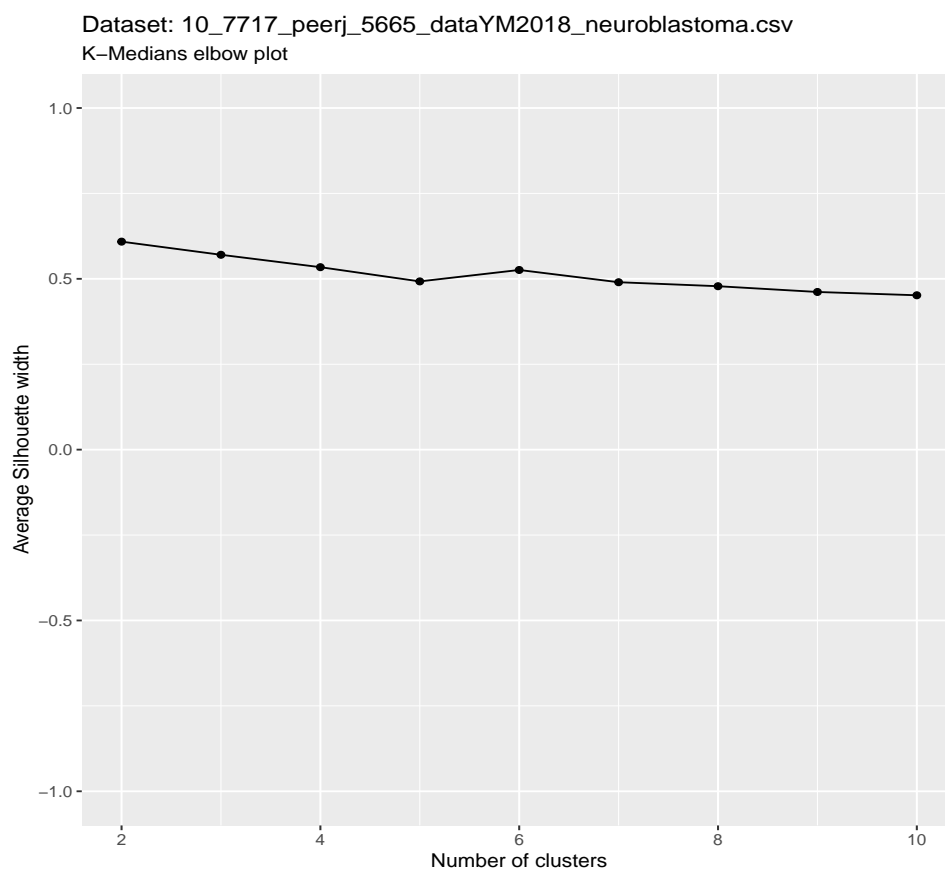


Figura 4.15: Risultati dell'algoritmo K-Medians per il dataset `Neuroblastoma.csv`

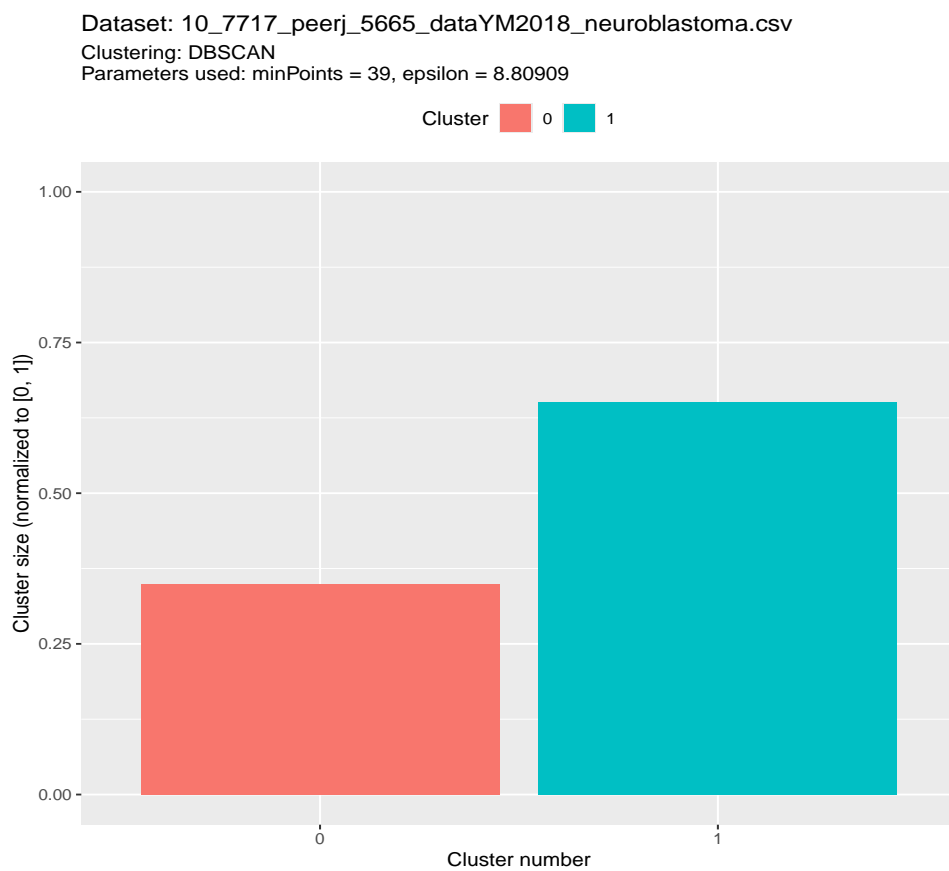
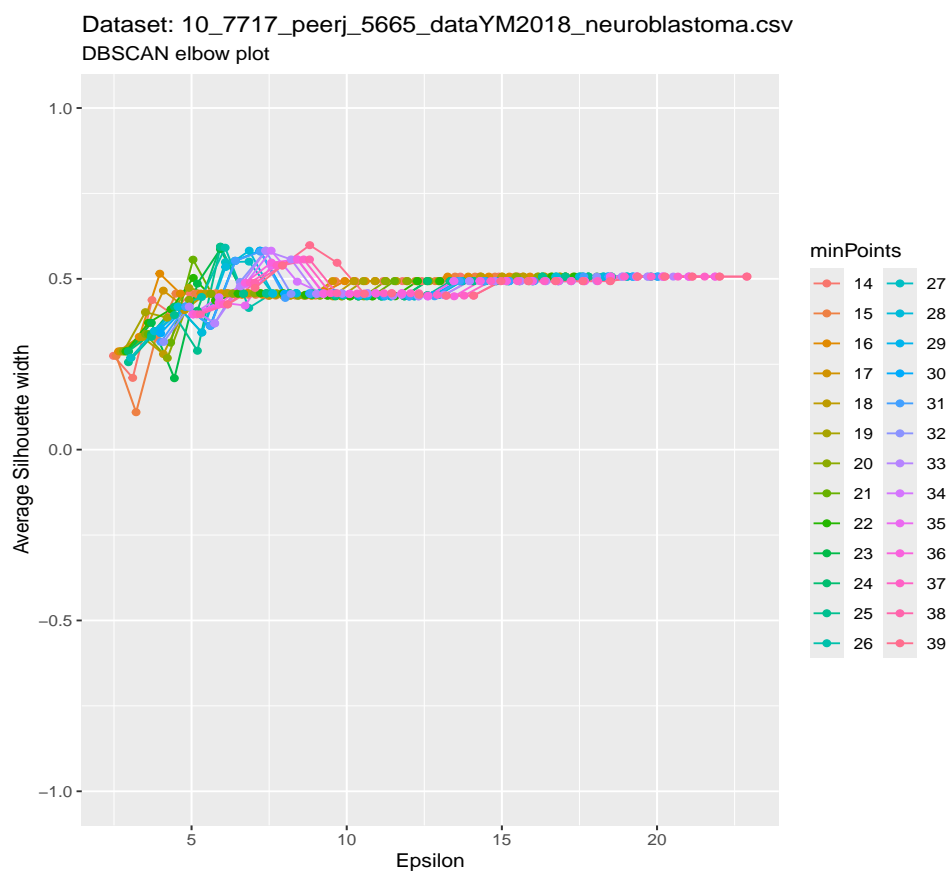
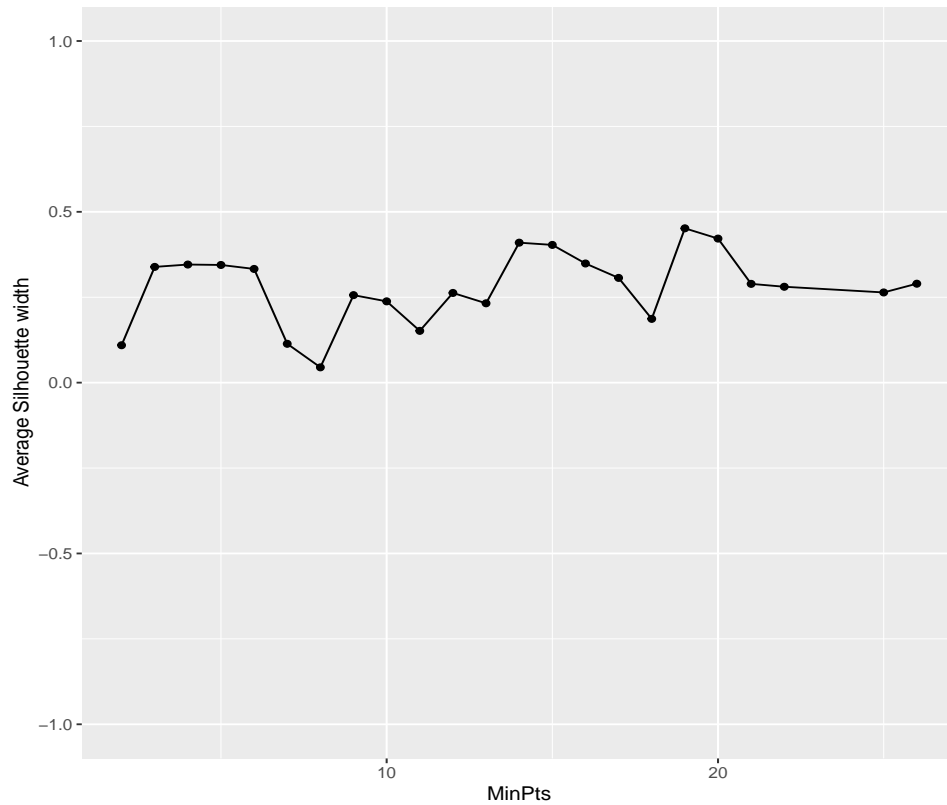


Figura 4.16: Risultati dell'algoritmo DBSCAN per il dataset `Neuroblastoma.csv`

Dataset: 10\_7717\_peerj\_5665\_dataYM2018\_neuroblastoma.csv  
HDBSCAN elbow plot



Dataset: 10\_7717\_peerj\_5665\_dataYM2018\_neuroblastoma.csv  
Clustering: HDBSCAN  
Parameters used: minPoints = 19

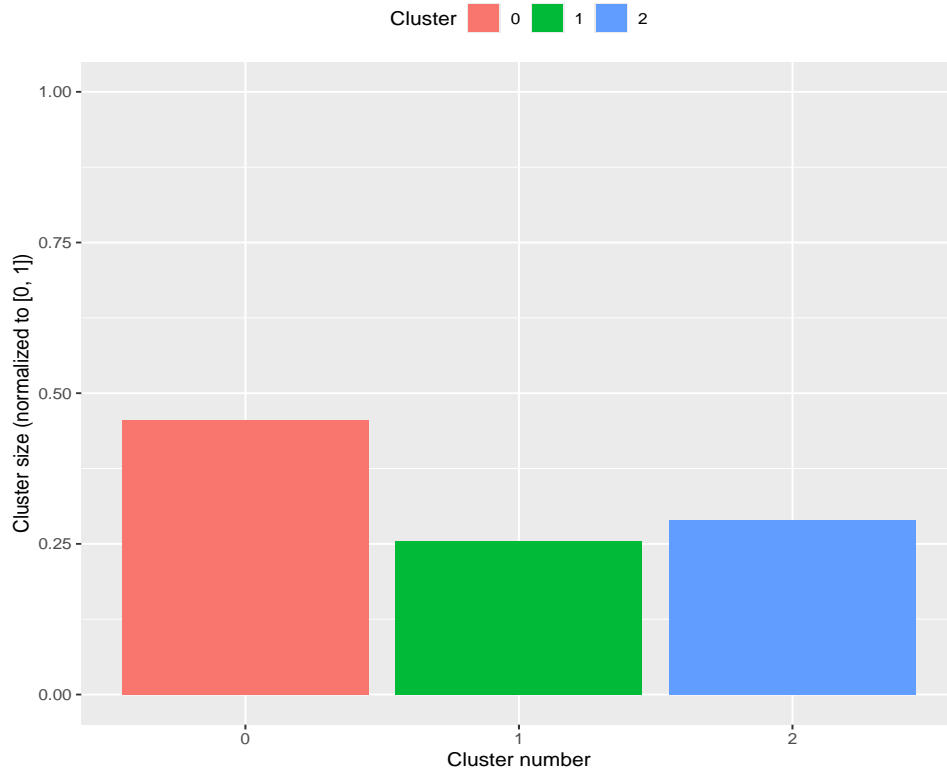
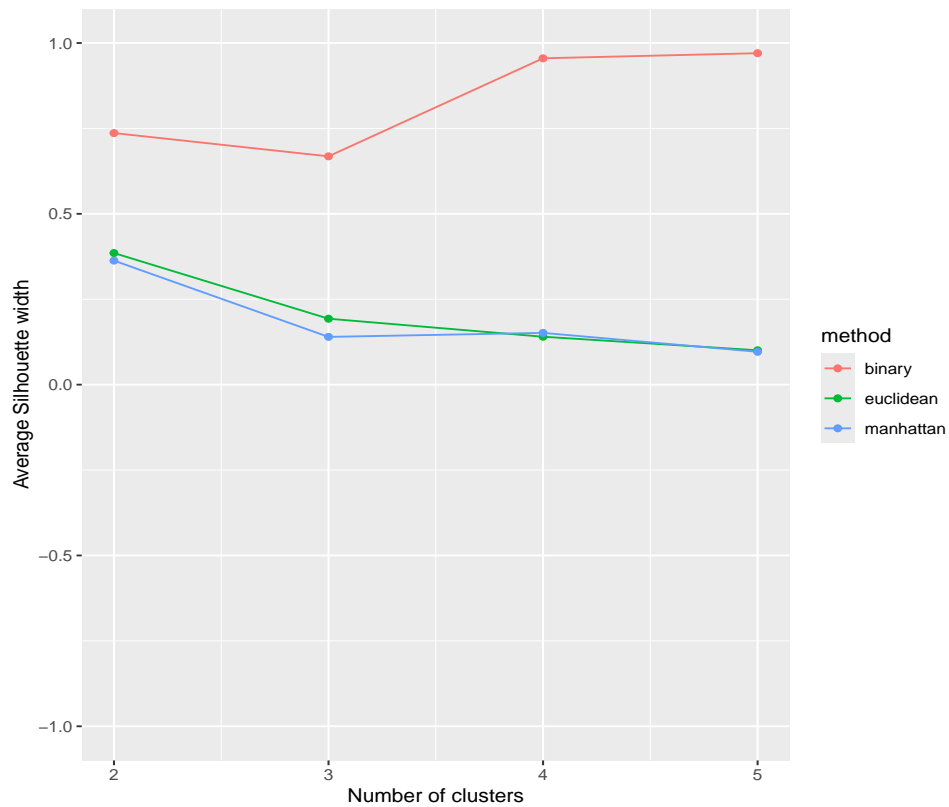


Figura 4.17: Risultati dell'algoritmo HDBSCAN per il dataset Neuroblastoma.csv

Dataset: journal.pone.0216416\_Takashi2019\_diabetes\_type1\_dataset\_preproce:  
K-Means elbow plot



Dataset: journal.pone.0216416\_Takashi2019\_diabetes\_type1\_dataset\_preproce:  
Clustering: KMEANS  
Parameters used: k = 5, method = binary

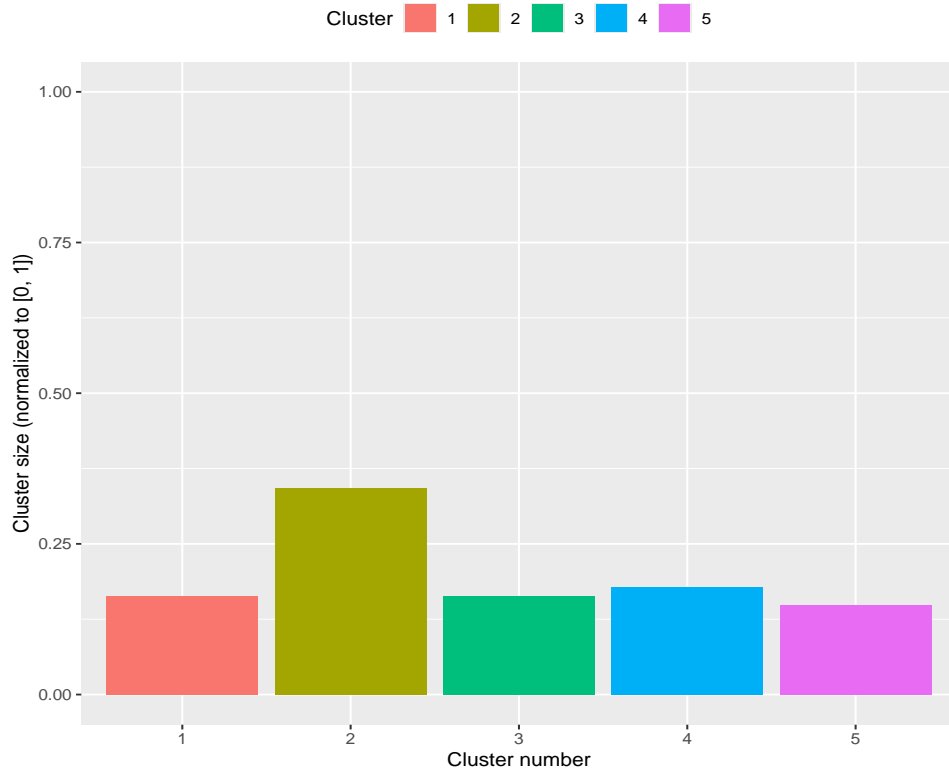
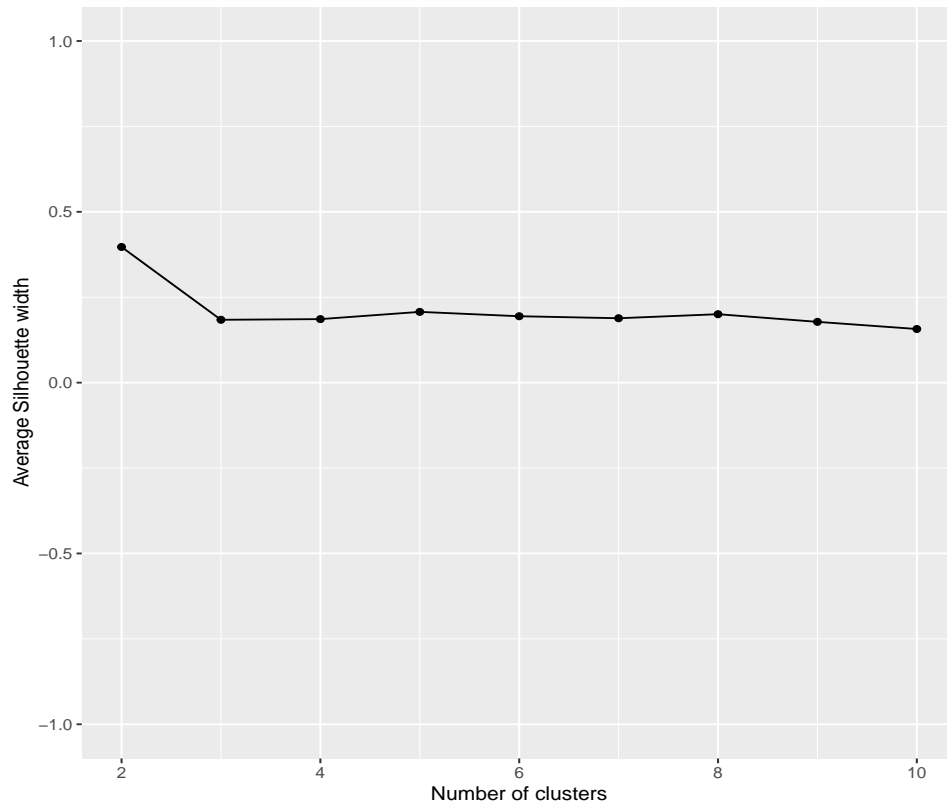


Figura 4.18: Risultati dell'algoritmo K-Means per il dataset `Diabetes.csv`

Dataset: journal.pone.0216416\_Takashi2019\_diabetes\_type1\_dataset\_preproce:  
K-Medians elbow plot



Dataset: journal.pone.0216416\_Takashi2019\_diabetes\_type1\_dataset\_preproce:  
Clustering: KMEDIANS  
Parameters used: k = 2

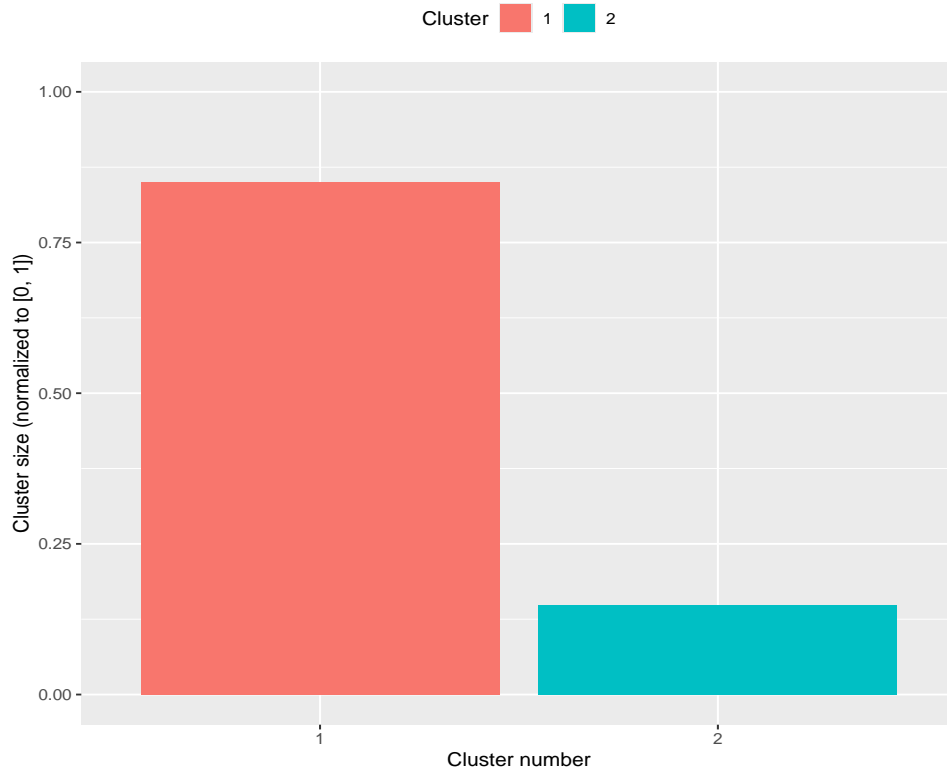
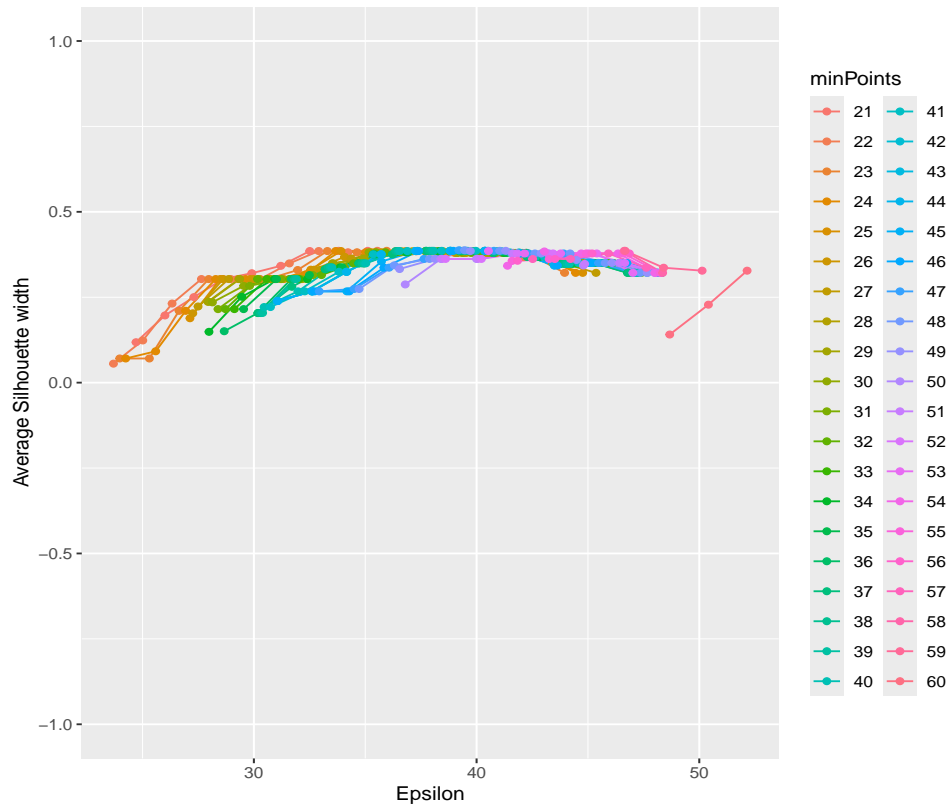


Figura 4.19: Risultati dell'algoritmo K-Medians per il dataset `Diabetes.csv`

Dataset: journal.pone.0216416\_Takashi2019\_diabetes\_type1\_dataset\_preproce:  
DBSCAN elbow plot



Dataset: journal.pone.0216416\_Takashi2019\_diabetes\_type1\_dataset\_preproce:  
Clustering: DBSCAN  
Parameters used: minPoints = 47, epsilon = 39.20665

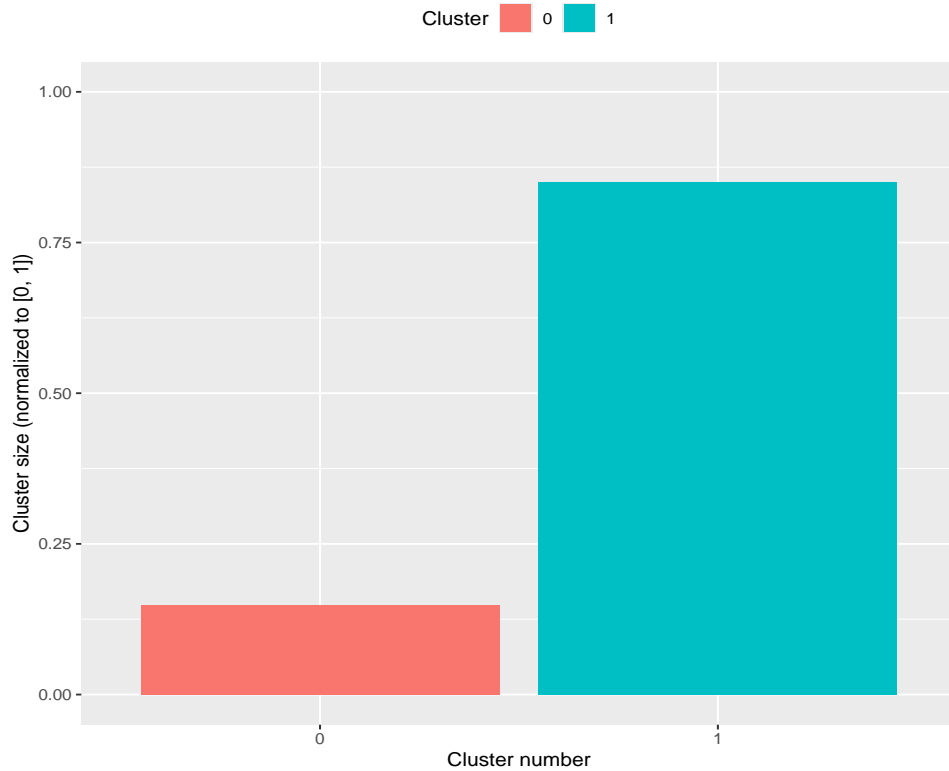
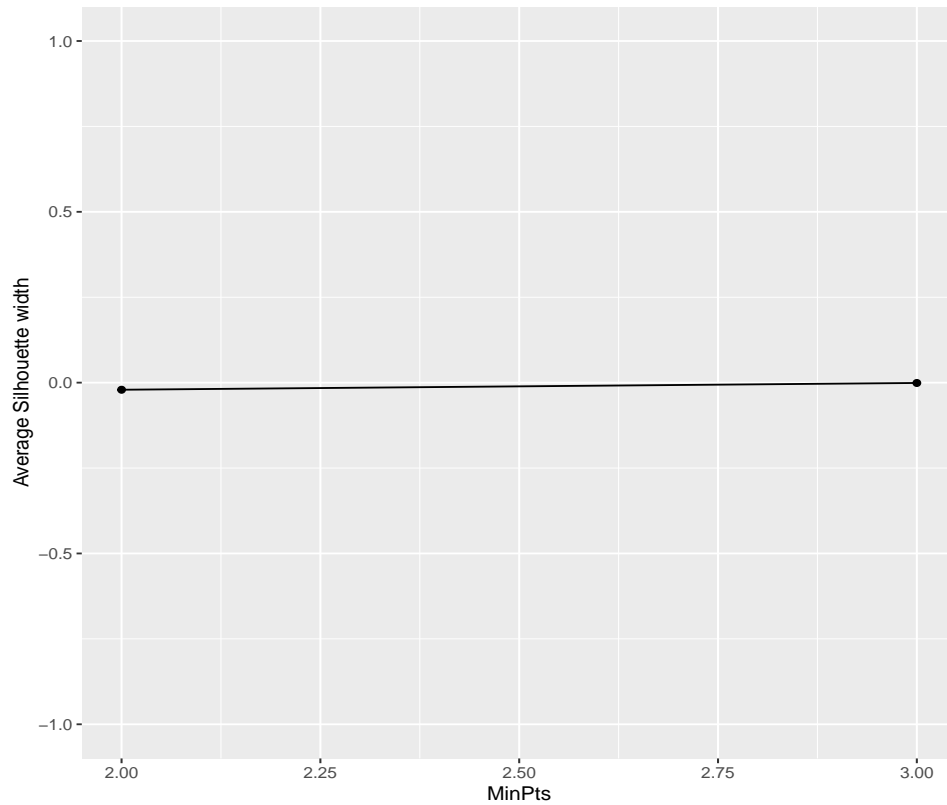


Figura 4.20: Risultati dell'algoritmo DBSCAN per il dataset `Diabetes.csv`



Dataset: journal.pone.0216416\_Takashi2019\_diabetes\_type1\_dataset\_preproce:  
HDBSCAN elbow plot



Dataset: journal.pone.0216416\_Takashi2019\_diabetes\_type1\_dataset\_preproce:  
Clustering: HDBSCAN  
Parameters used: minPoints = 3

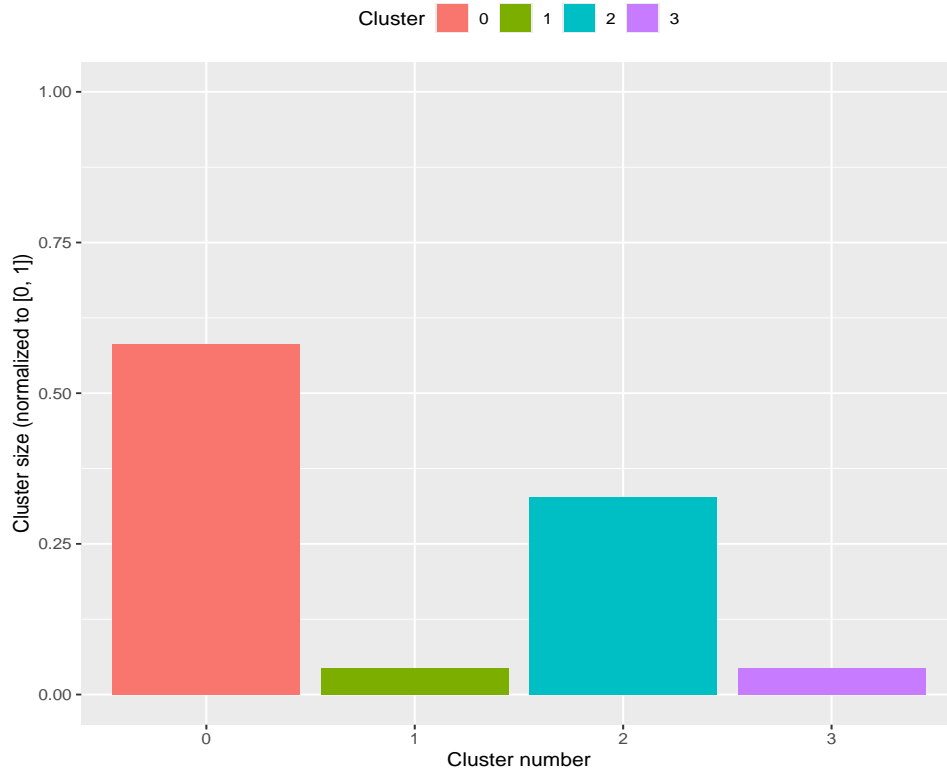


Figura 4.21: Risultati dell'algoritmo HDBSCAN per il dataset `Diabetes.csv`

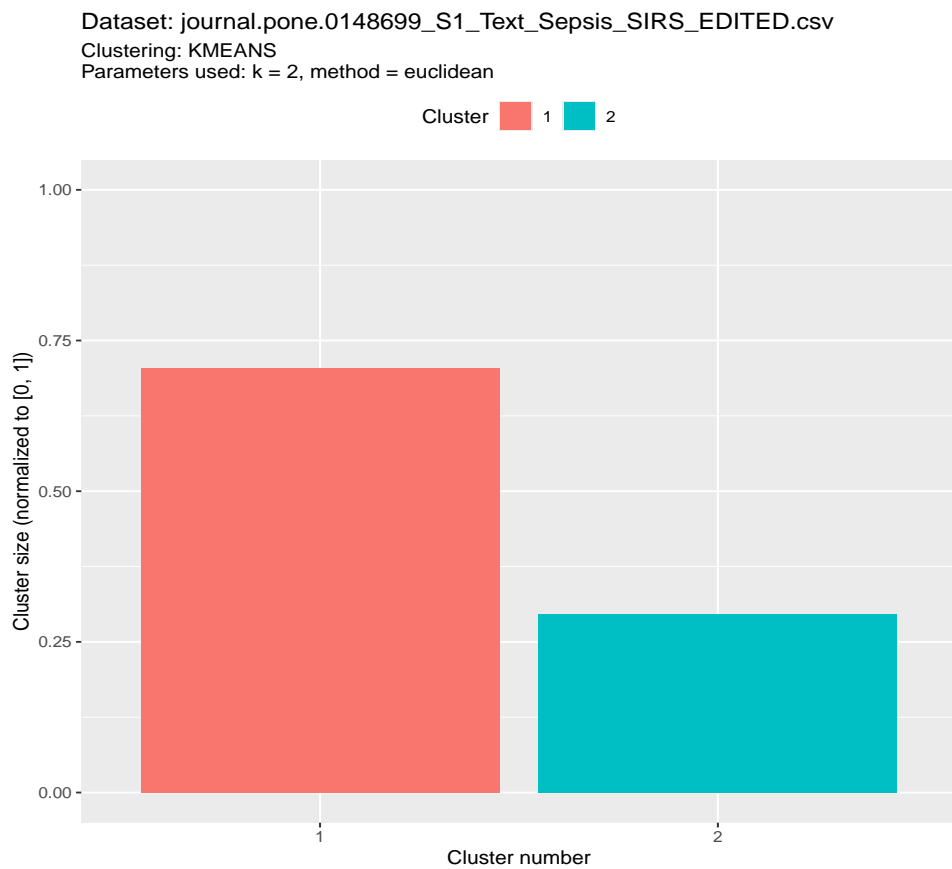
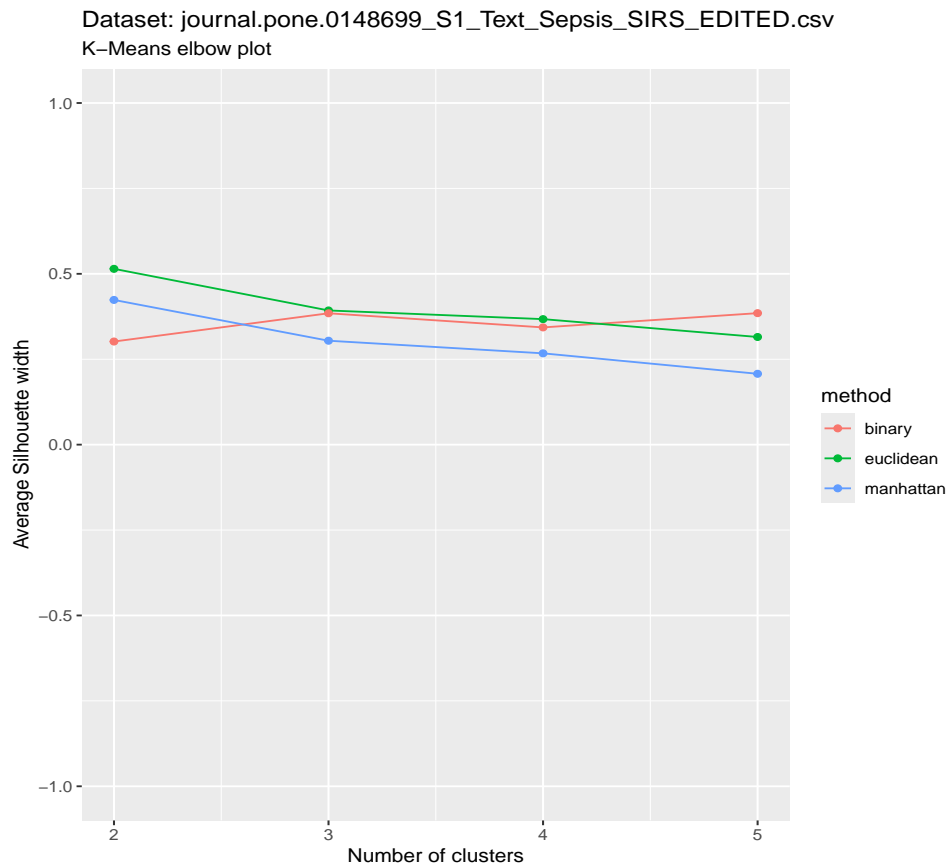
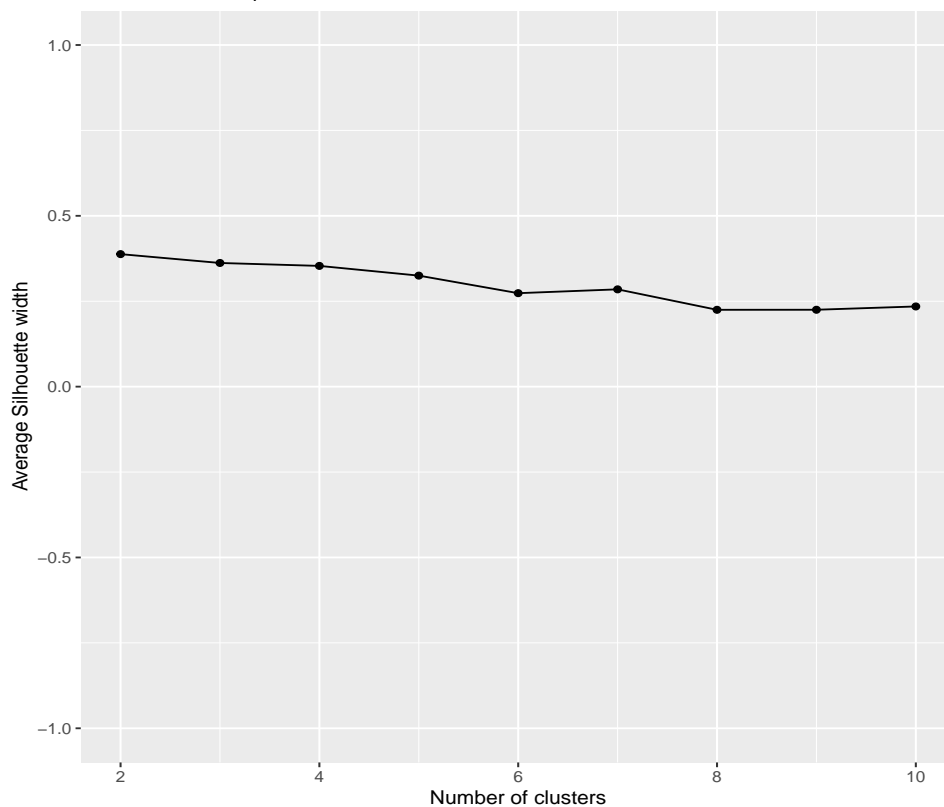


Figura 4.22: Risultati dell'algoritmo K-Means per il dataset `Sepsis.csv`

Dataset: journal.pone.0148699\_S1\_Text\_Sepsis\_SIRS\_EDITED.csv  
K-Medians elbow plot



Dataset: journal.pone.0148699\_S1\_Text\_Sepsis\_SIRS\_EDITED.csv  
Clustering: KMEDIANS  
Parameters used: k = 2

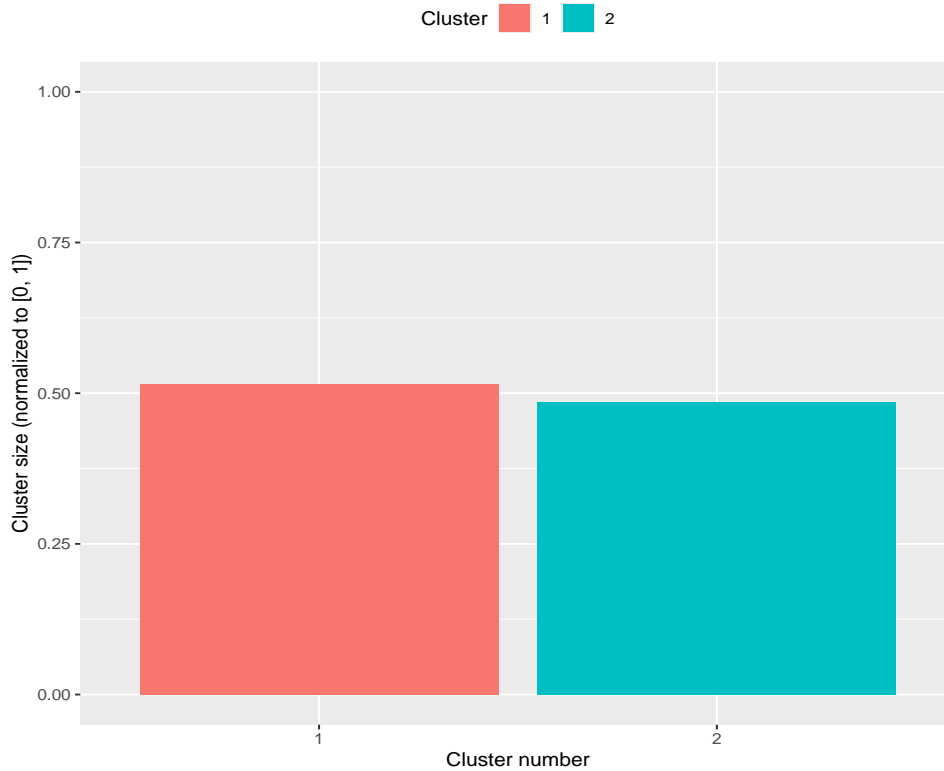
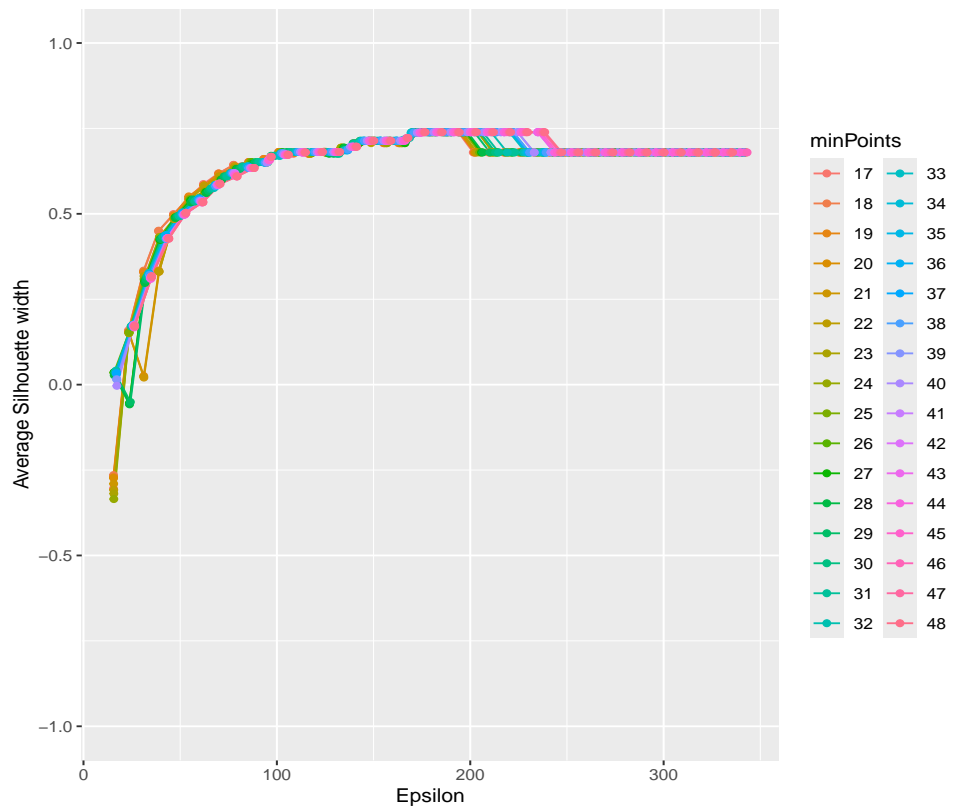


Figura 4.23: Risultati dell'algorithm K-Medians per il dataset Sepsis.csv

Dataset: journal.pone.0148699\_S1\_Text\_Sepsis\_SIRS\_EDITED.csv  
DBSCAN elbow plot



Dataset: journal.pone.0148699\_S1\_Text\_Sepsis\_SIRS\_EDITED.csv  
Clustering: DBSCAN  
Parameters used: minPoints = 17, epsilon = 170.55707

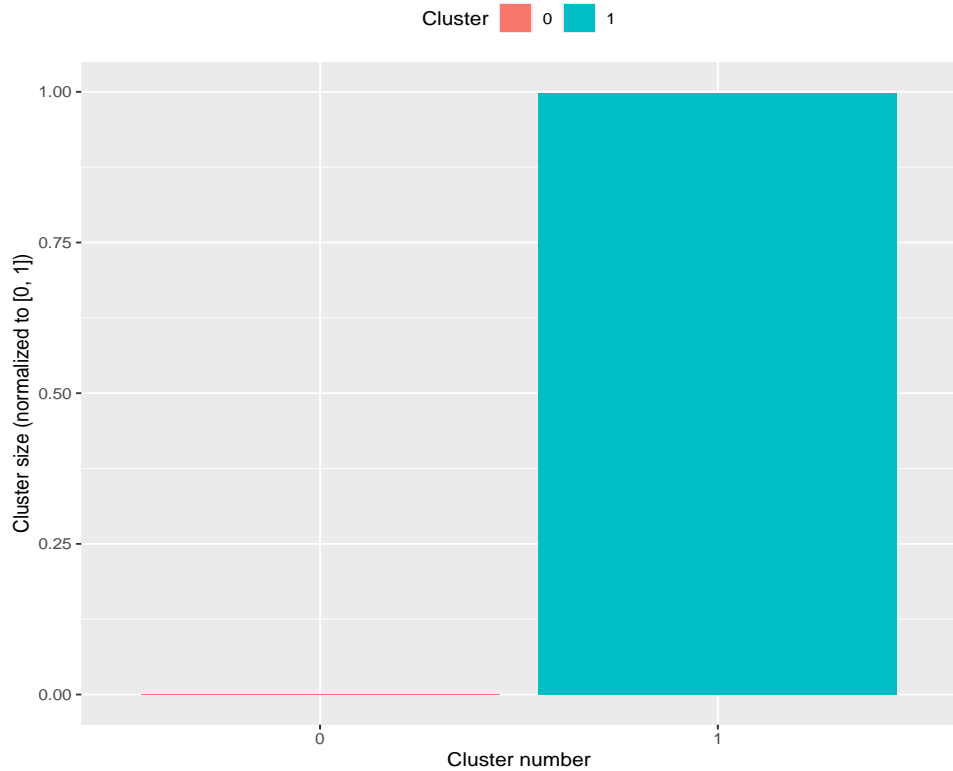
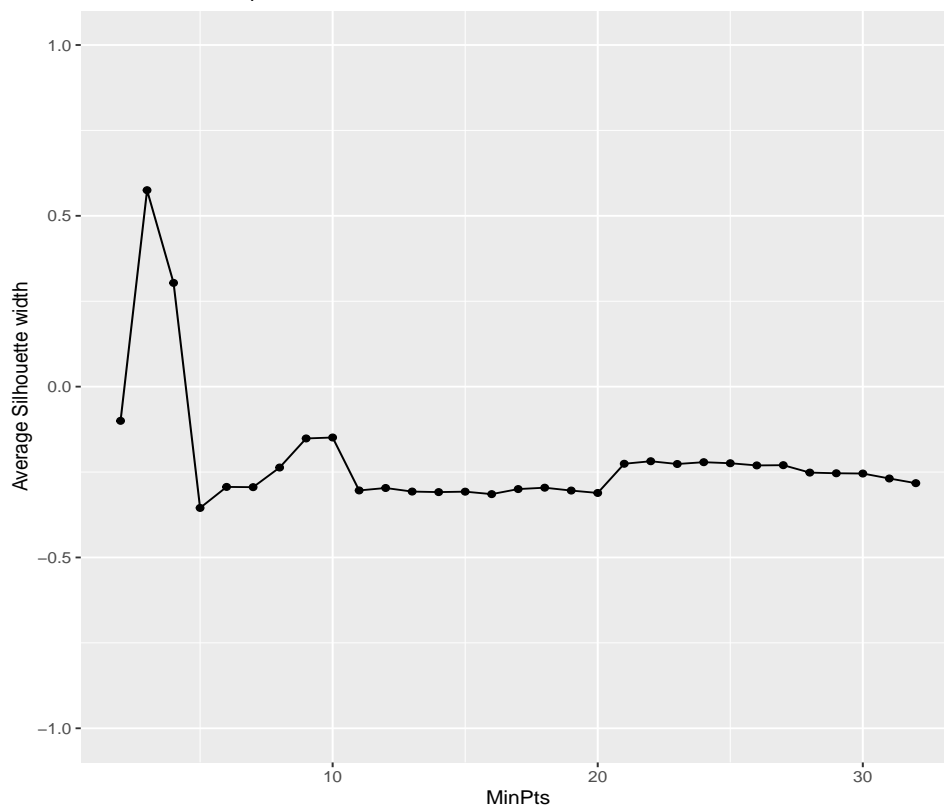


Figura 4.24: Risultati dell’algoritmo DBSCAN per il dataset Sepsis.csv

Dataset: journal.pone.0148699\_S1\_Text\_Sepsis\_SIRS\_EDITED.csv  
HDBSCAN elbow plot



Dataset: journal.pone.0148699\_S1\_Text\_Sepsis\_SIRS\_EDITED.csv  
Clustering: HDBSCAN  
Parameters used: minPoints = 3

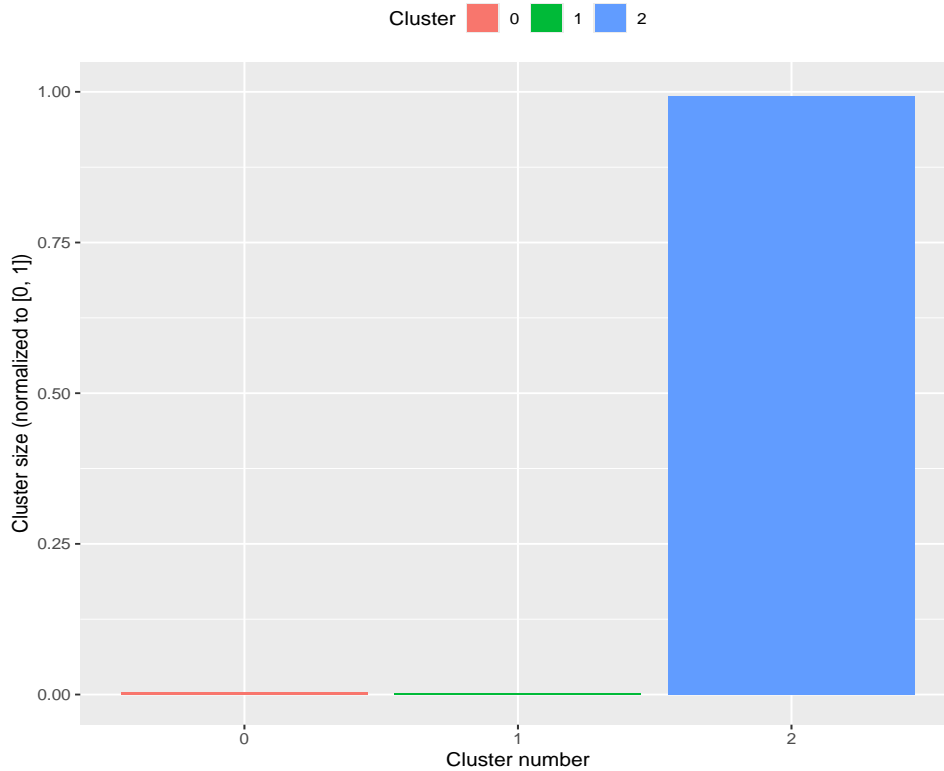


Figura 4.25: Risultati dell'algorithm HDBSCAN per il dataset `Sepsis.csv`

## 5. Discussione

### 5.1 Silhouette

A partire dall'idea di base di Silhouette, è possibile costruirne infinite varianti. Gli autori citano:

- Per determinare il miglior numero di cluster non è strettamente necessario utilizzare la Silhouette media complessiva. Sarebbe infatti possibile anche combinare gli  $s(i)$  in modo diverso;
- La Silhouette media complessiva può essere essa stessa usata come funzione obiettivo da massimizzare direttamente all'interno di un algoritmo di clustering, anziché effettuare una valutazione a posteriori;
- Se l'algoritmo di clustering si basa sulla costruzione di centroidi o sulla elezione di rappresentanti, si potrebbe usare la distanza da tali centroidi o rappresentanti come grado di dissomiglianza anziché calcolare  $a(i)$  o  $D(i, C)$  per ogni  $i$ -esimo elemento, semplificando il procedimento. Naturalmente, questo approccio renderebbe Silhouette dipendente dal tipo di algoritmo usato.

Tutte e tre le varianti sono toccate da articoli citati.

### 5.2 Pacchetti

Alla luce dei due test considerati, il pacchetto `Kira` è stato immediatamente escluso, perché i risultati forniti dal test della matrice binaria non sono affatto incoraggianti. Dato che i pacchetti `cluster` e `tidyclust` hanno fornito un risultato identico, fra i due è stato preferito `cluster`, perché fra i due era quello con il tempo di esecuzione più basso. Il pacchetto `scikit-learn` attraverso `reticulate` non è stato preso in considerazione, perché era stato incluso semplicemente come metro di paragone.

Fra `cluster` e `drclust` ho preferito scegliere `cluster`. Questo sia perché il tempo di esecuzione è inferiore, sia perché il pacchetto `cluster` si trova spesso già incluso nelle installazioni di R (garanzia di affidabilità) sia perché è l'unico pacchetto il cui input non dipende dall'algoritmo usato. Infatti, `cluster` ha in input il risultato di un qualsiasi algoritmo di clustering ed una matrice delle distanze, mentre gli altri pacchetti richiedono in input espressamente il risultato dell'applicazione di una loro implementazione di un algoritmo.

In Figura 5.1 è presentata la differenza fra `cluster` e `scikit-learn` sul test matrice binaria. Come è possibile notare, la differenza fra i due è contenuta.

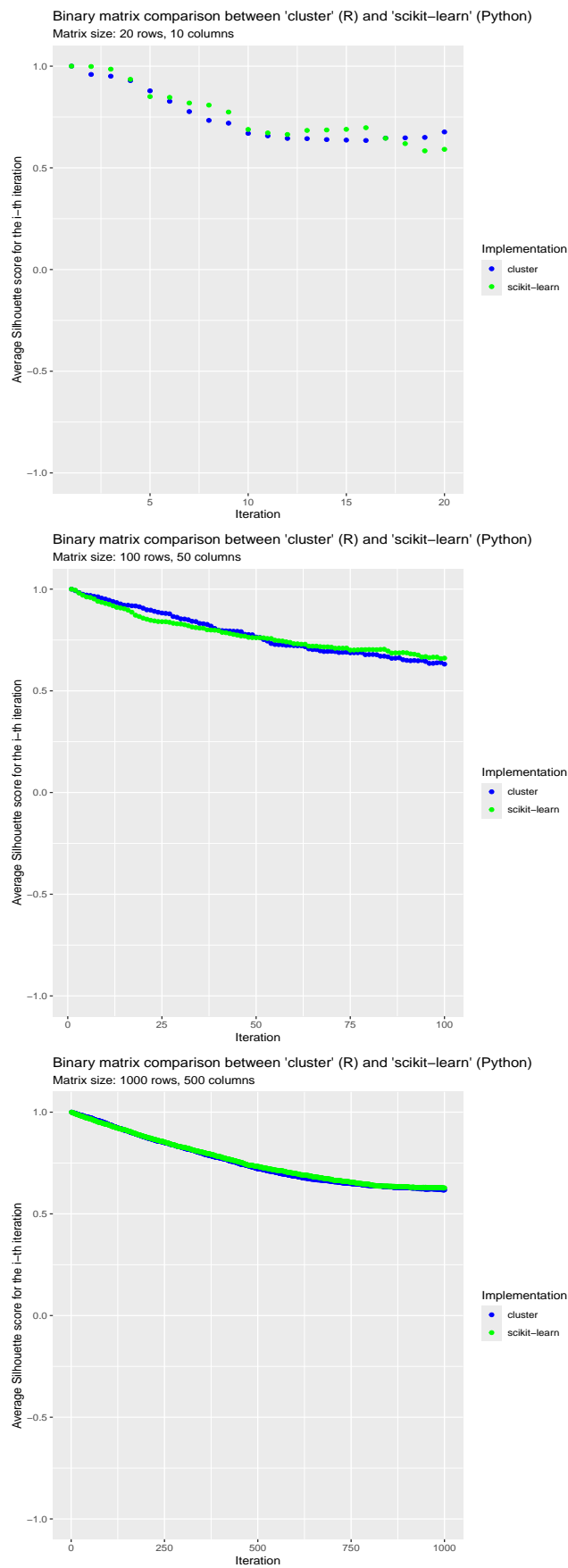


Figura 5.1: Differenze fra il test matrice binaria tra `cluster` (pacchetto R) e `scikit-learn` (pacchetto Python).

## 5.3 EHR

Come é possibile notare nei plot mostrati in precedenza, l'algoritmo scelto influenza notevolmente il numero di cluster che vengono individuati, pure se in ogni caso si tratta di iperparametri massimizzati usando Silhouette. Questo é in accordo con gli articoli citati. Di seguito sono riportate le performance degli algoritmi di clustering.



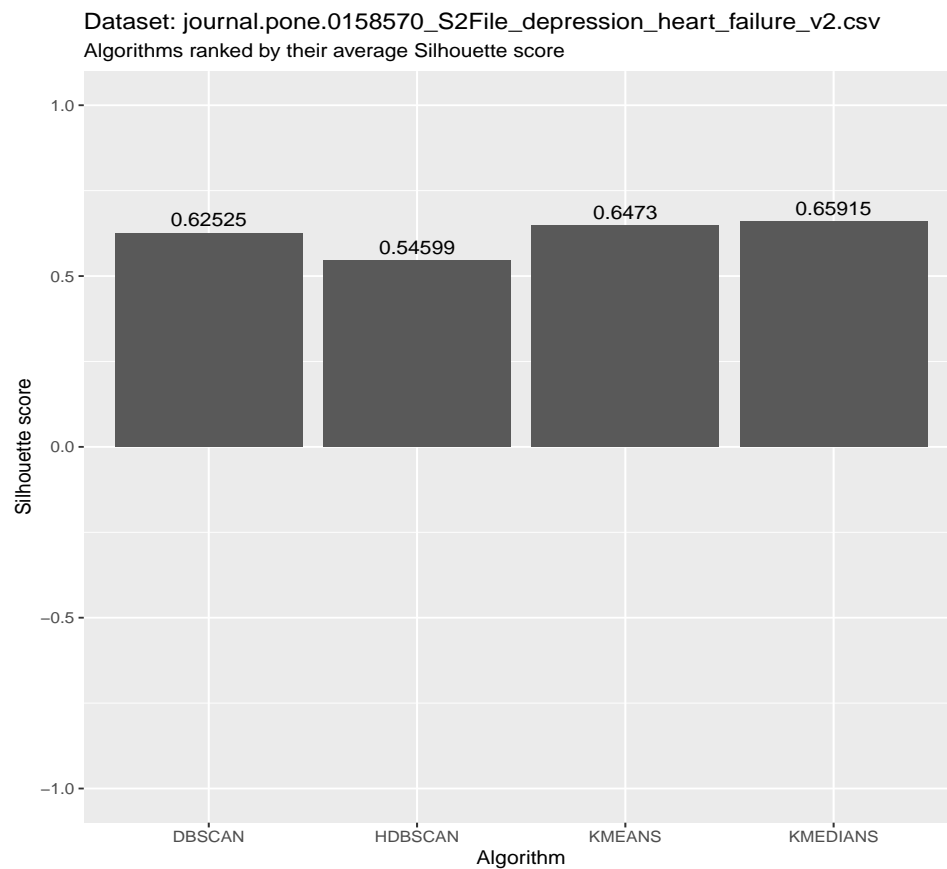
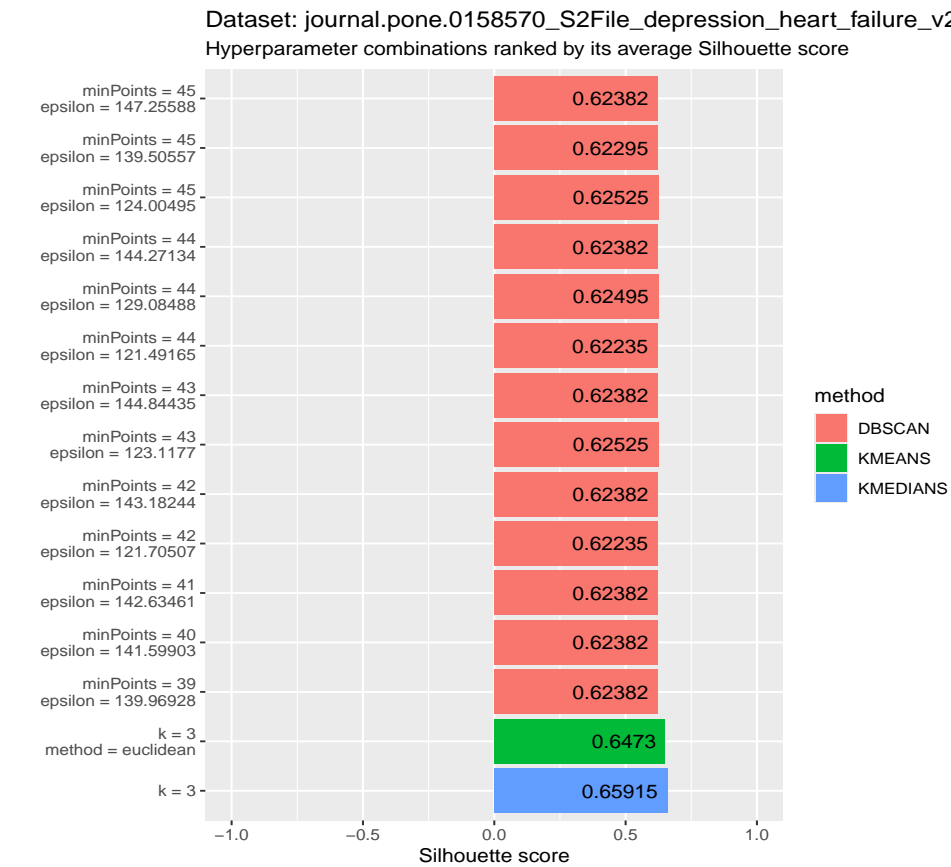


Figura 5.2: Riassunto dei risultati dei vari algoritmi per il dataset `HeartFailure.csv`

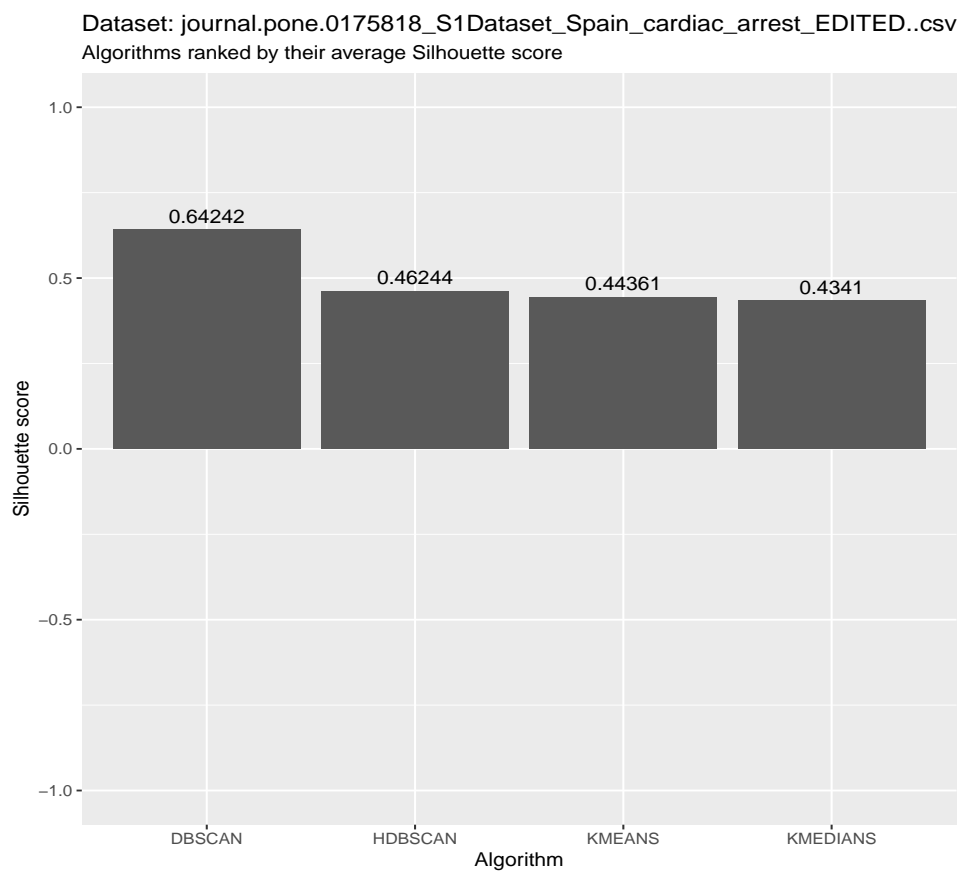
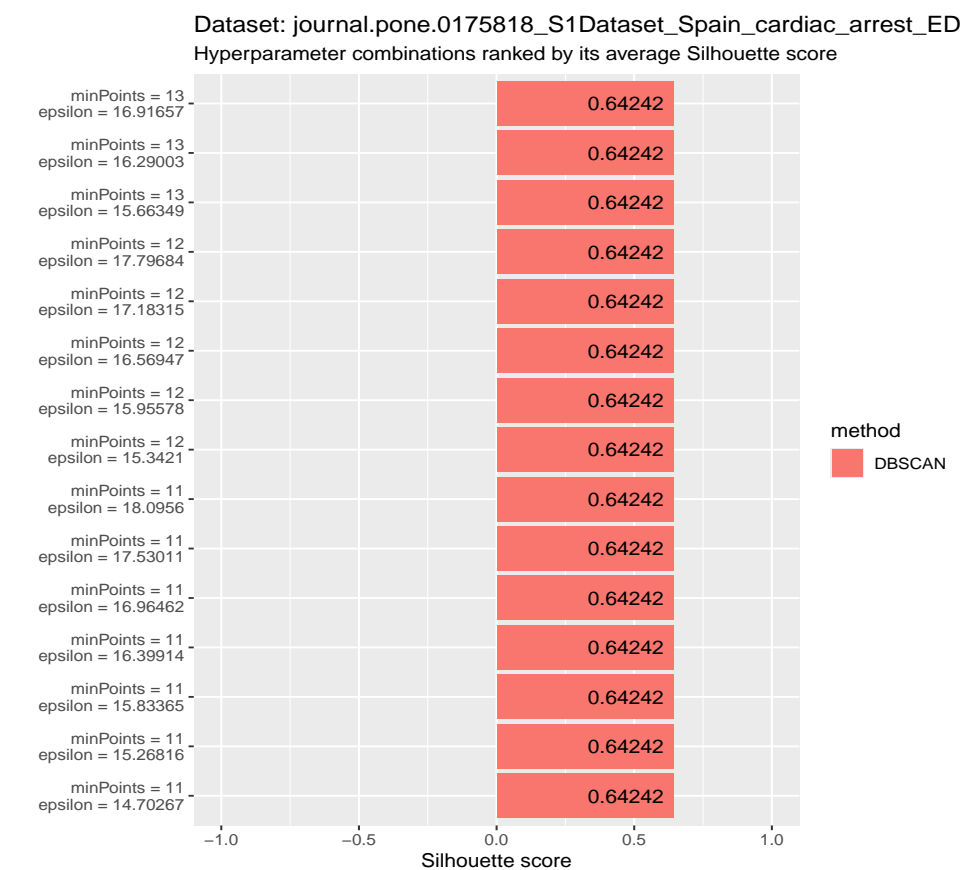


Figura 5.3: Riassunto dei risultati dei vari algoritmi per il dataset CardiacArrest.csv

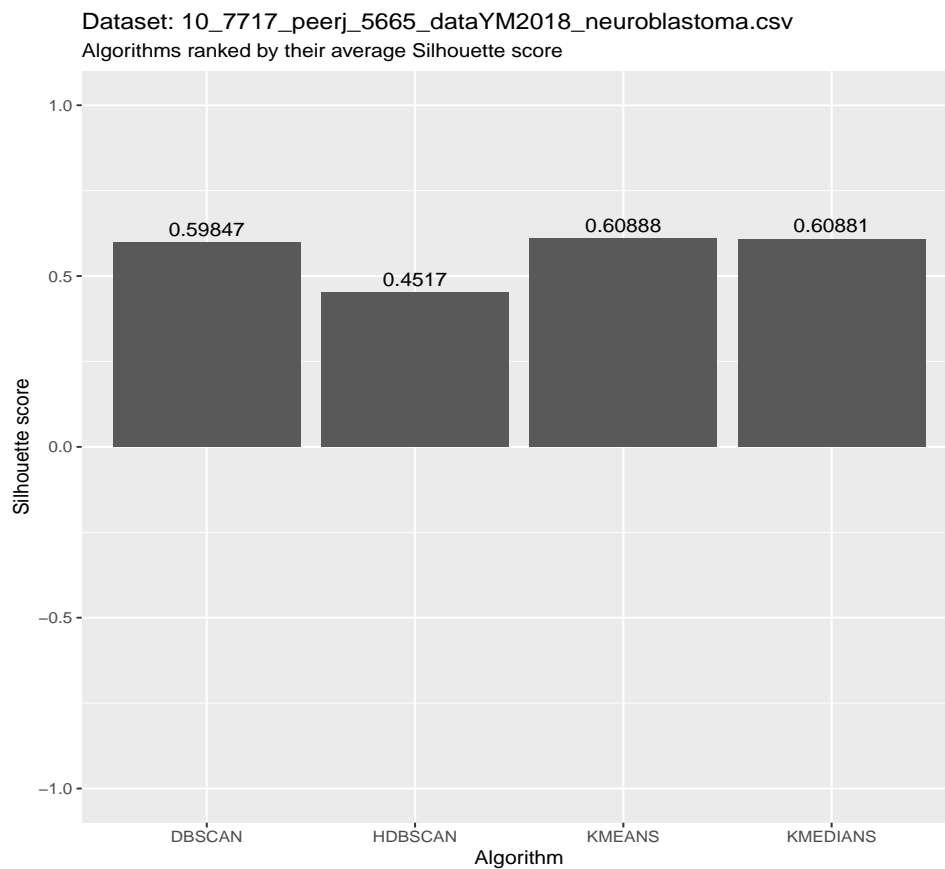
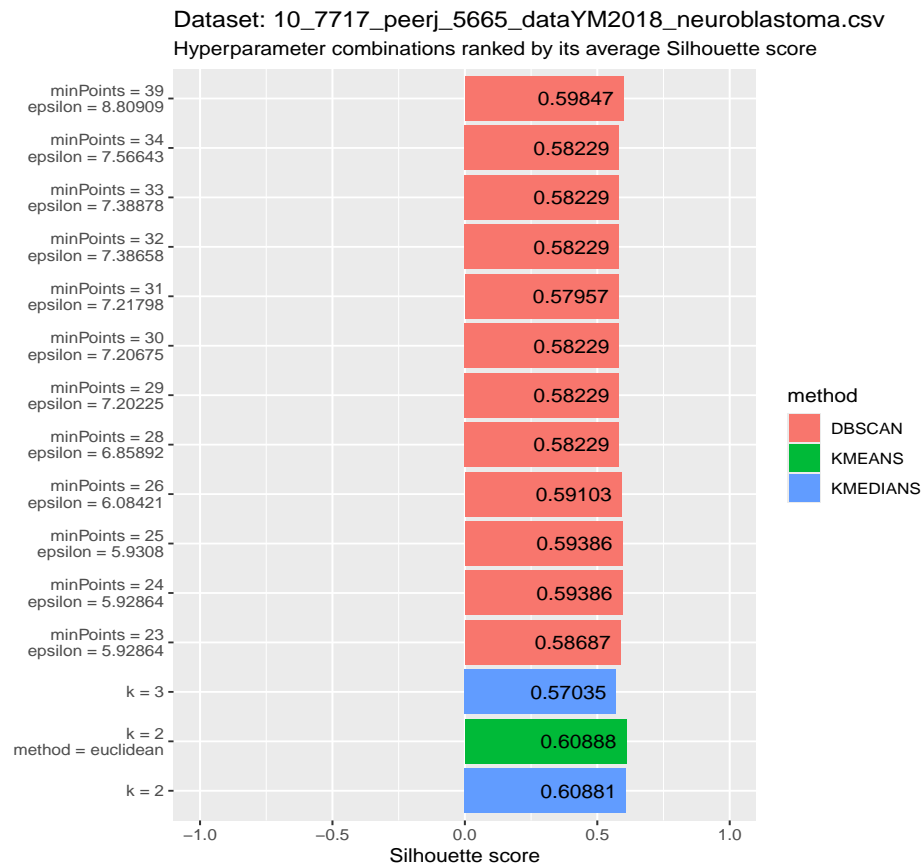


Figura 5.4: Riassunto dei risultati dei vari algoritmi per il dataset `Neuroblastoma.csv`

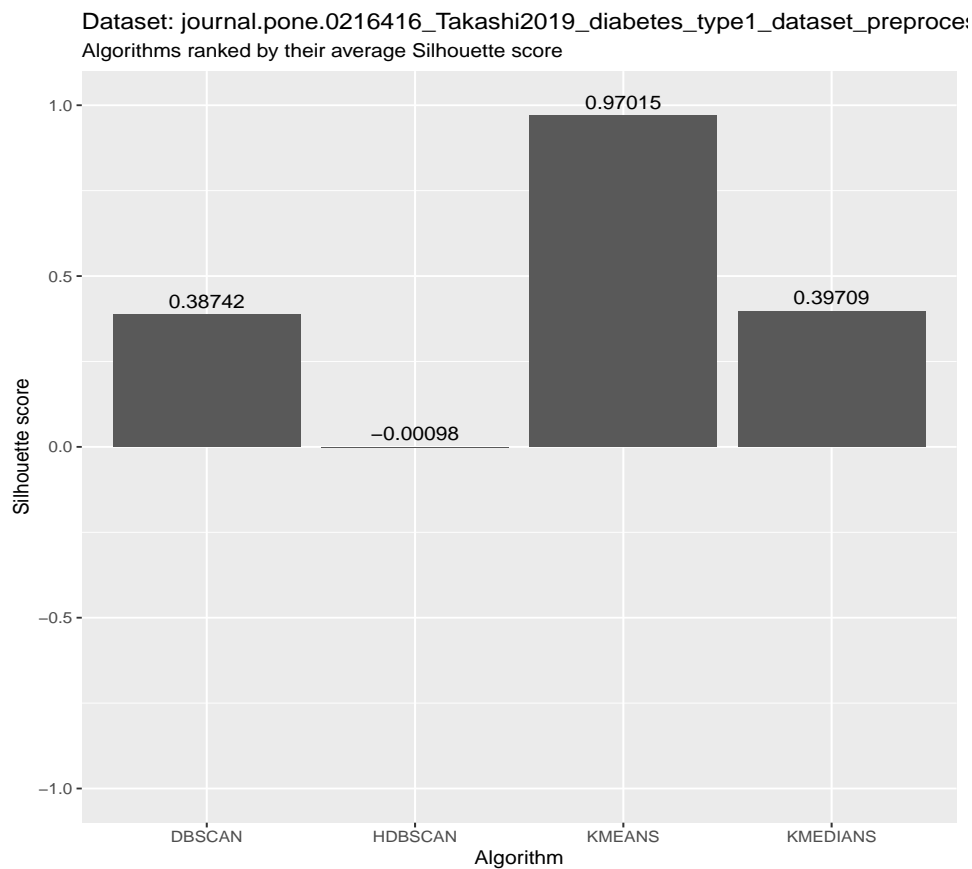
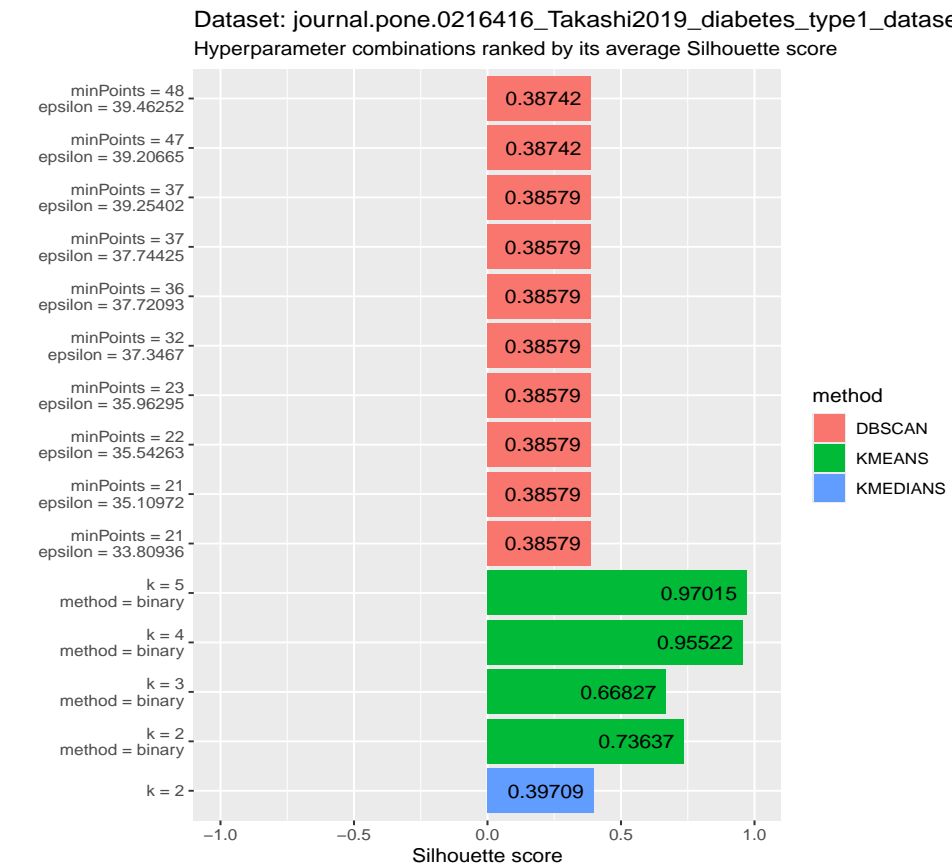


Figura 5.5: Riassunto dei risultati dei vari algoritmi per il dataset `Diabetes.csv`

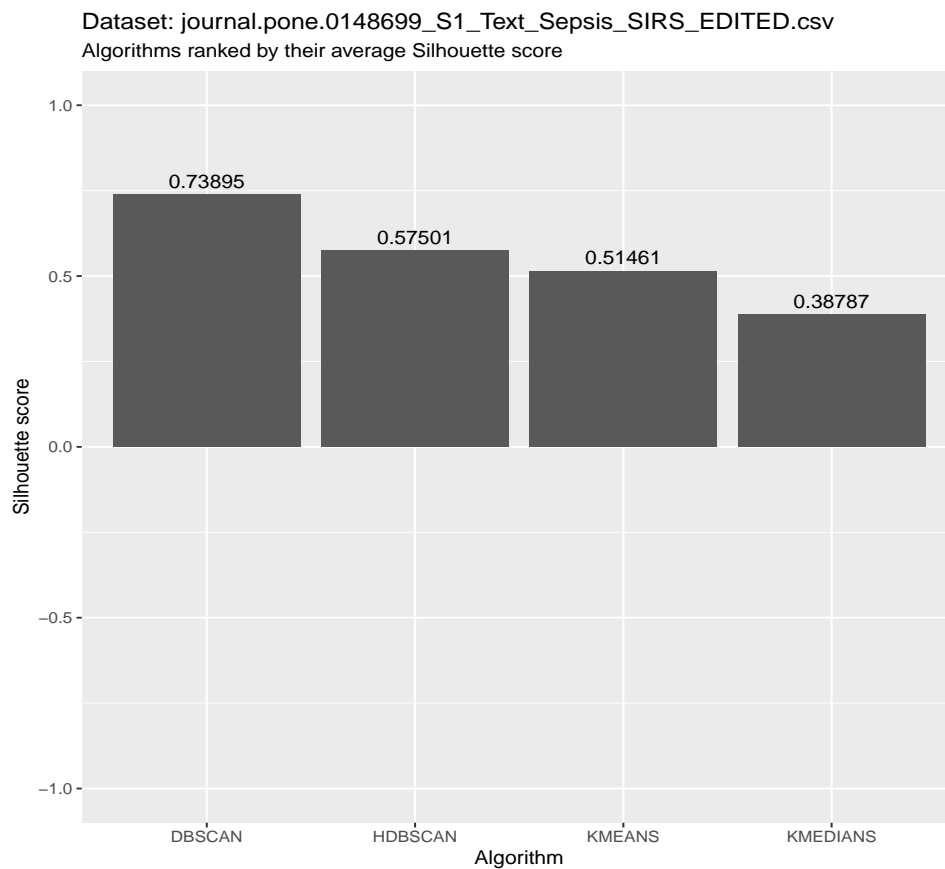
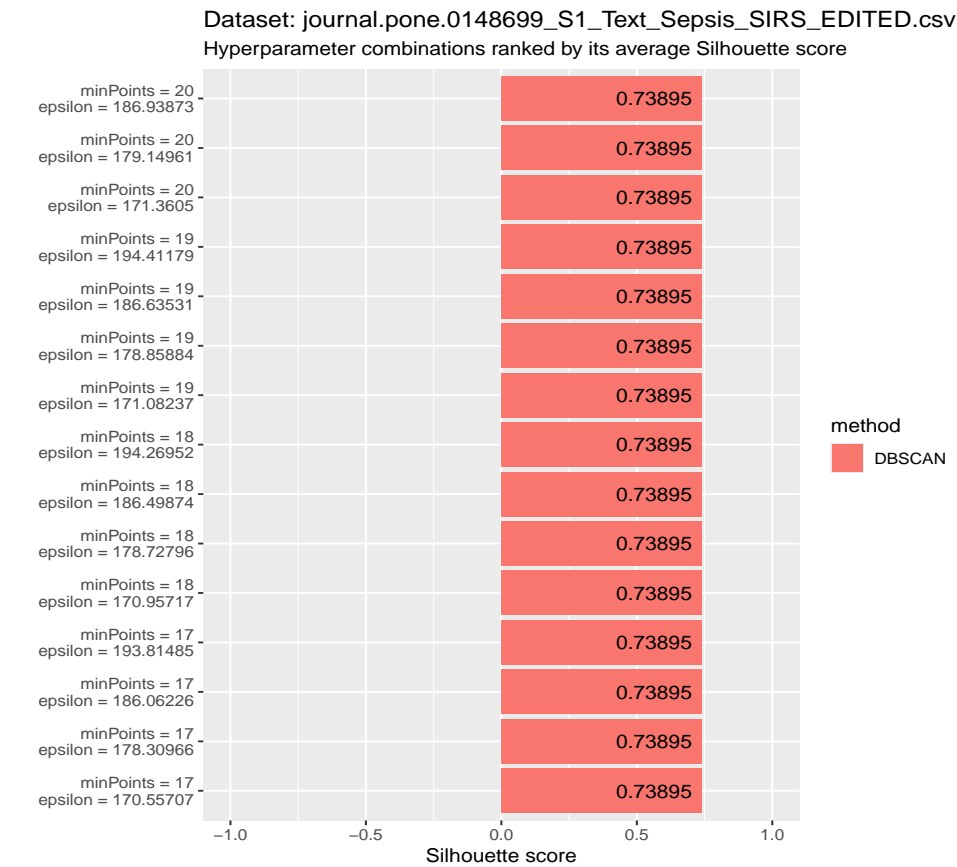


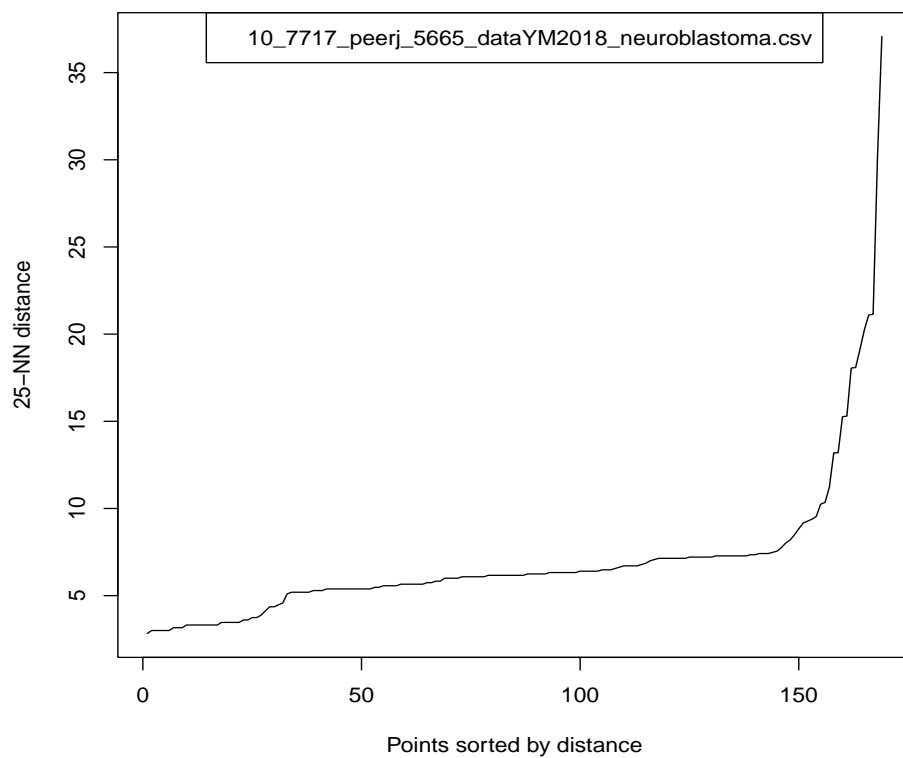
Figura 5.6: Riassunto dei risultati dei vari algoritmi per il dataset `Sepsis.csv`

DBSCAN figura spesso come algoritmo dalle alte performance. Per tale motivo mi sono chiesto se fosse possibile testare le prestazioni di Silhouette su DBSCAN comparandolo con un metodo di

ottimizzazione degli iperparametri alternativo, e vedere se i due risultati sono simili.

Fissato  $\text{MinPts}$  come il doppio piú uno delle dimensioni del dataset, il valore di  $\epsilon$  può essere stimato costruendo un **KNN plot**: fissato  $k = \text{MinPts} - 1$ , lungo l'asse delle ascisse si riportano gli elementi ordinati in ordine crescente per distanza dal loro  $k$ -esimo vicino, mentre sull'asse delle ordinate la distanza stessa. In genere, una curva costruita sulla base di questi dati ha inizialmente un andamento stabile per poi avere una crescita rapida: il valore di  $\epsilon$  è scelto il punto della curva in cui si ha tale variazione di pendenza.

Come è possibile apprezzare nelle figure successive, i valori di  $\epsilon$  così restituiti inducono un clustering che è molto simile a quello fornito utilizzando Silhouette. Questo indica che Silhouette è effettivamente in grado di restituire una combinazione ottimale di iperparametri.



Dataset: 10\_7717\_peerj\_5665\_dataYM2018\_neuroblastoma.csv  
 DBSCAN clustering with visual inspection  
 Parameters used: minPoints = 25, epsilon = 7.5

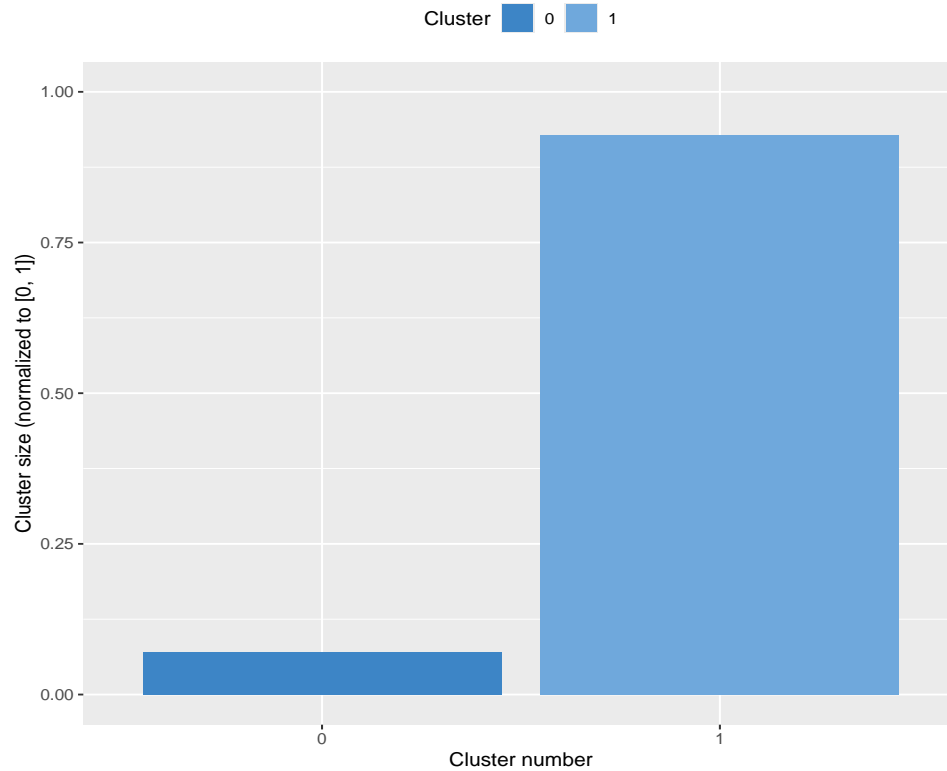
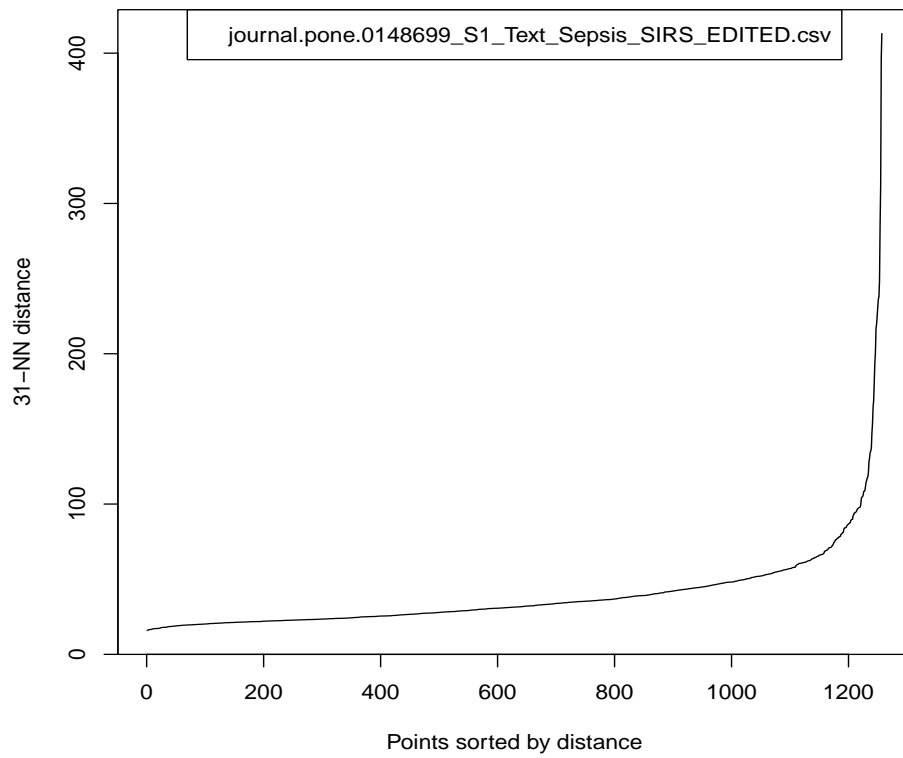


Figura 5.7: Risultati dell'algoritmo DBSCAN per il dataset `HeartFailure.csv`, usando un KNN-plot per stimare  $\epsilon$



Dataset: journal.pone.0148699\_S1\_Text\_Sepsis\_SIRS\_EDITED.csv  
 DBSCAN clustering with visual inspection  
 Parameters used: minPoints = 31, epsilon = 100

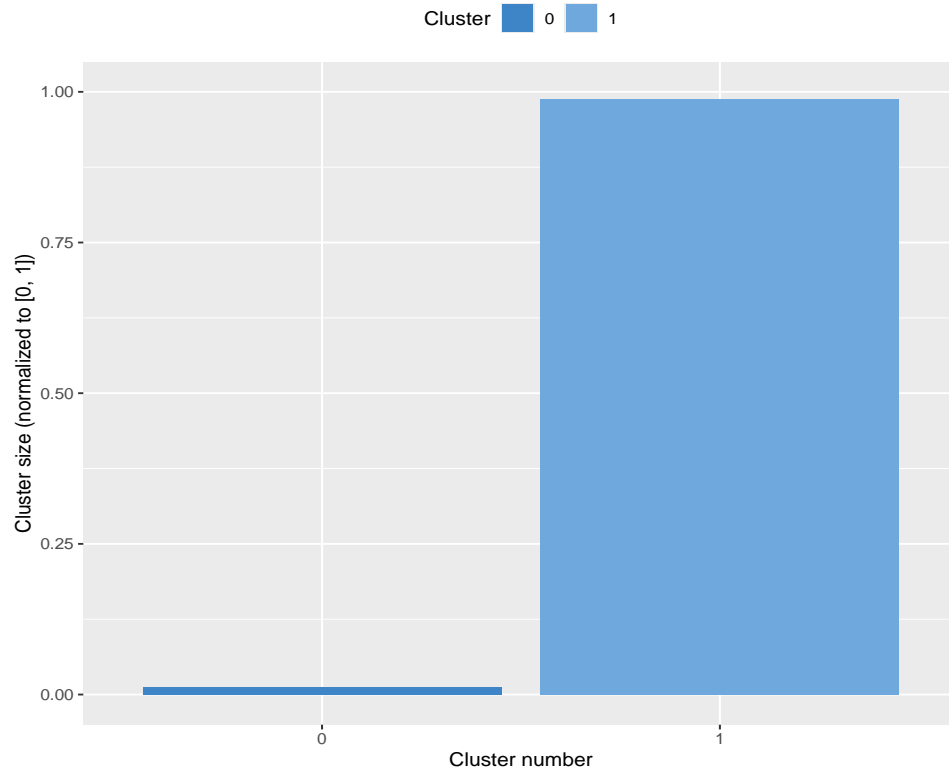
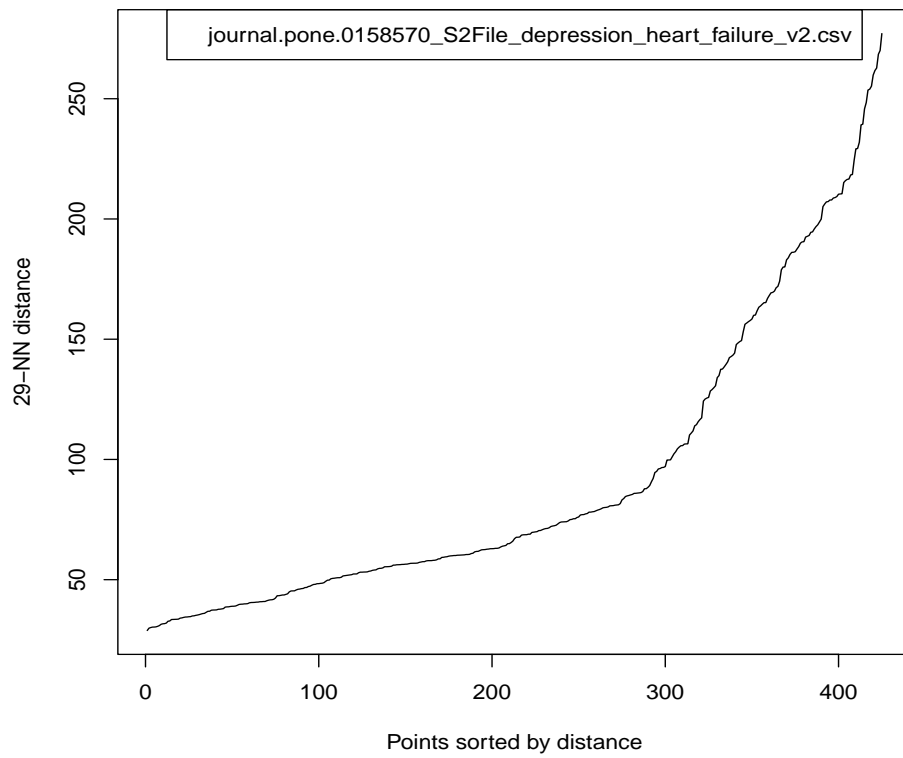


Figura 5.8: Risultati dell'algoritmo DBSCAN per il dataset `CardiacArrest.csv`, usando un KNN-plot per stimare  $\epsilon$





Dataset: journal.pone.0158570\_S2File\_depression\_heart\_failure\_v2.csv  
 DBSCAN clustering with visual inspection  
 Parameters used: minPoints = 29, epsilon = 75

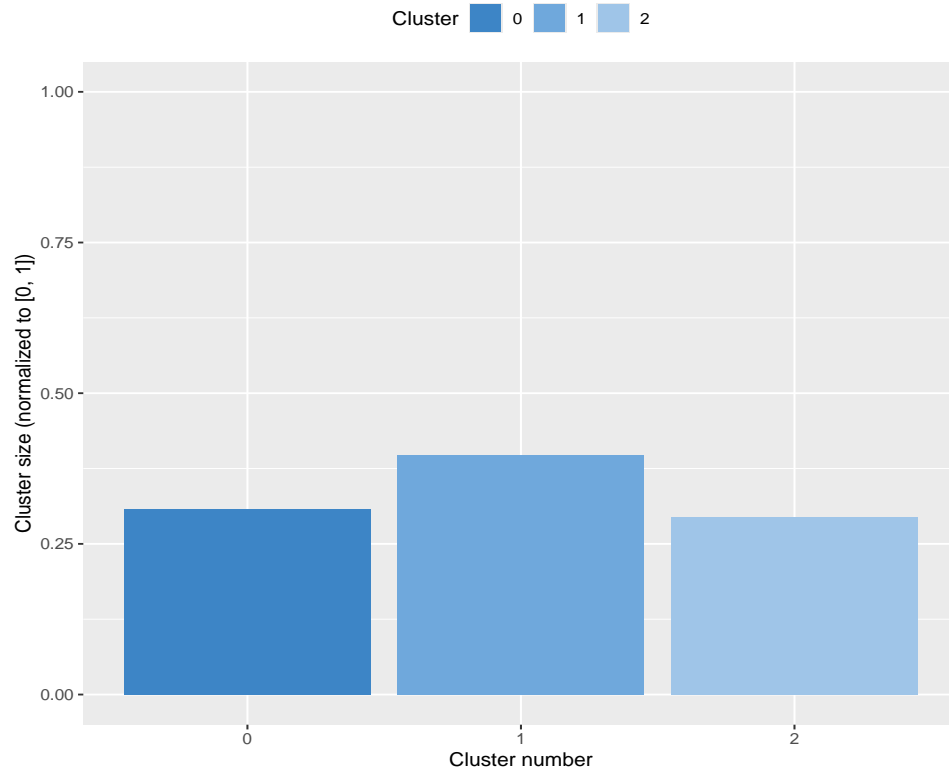
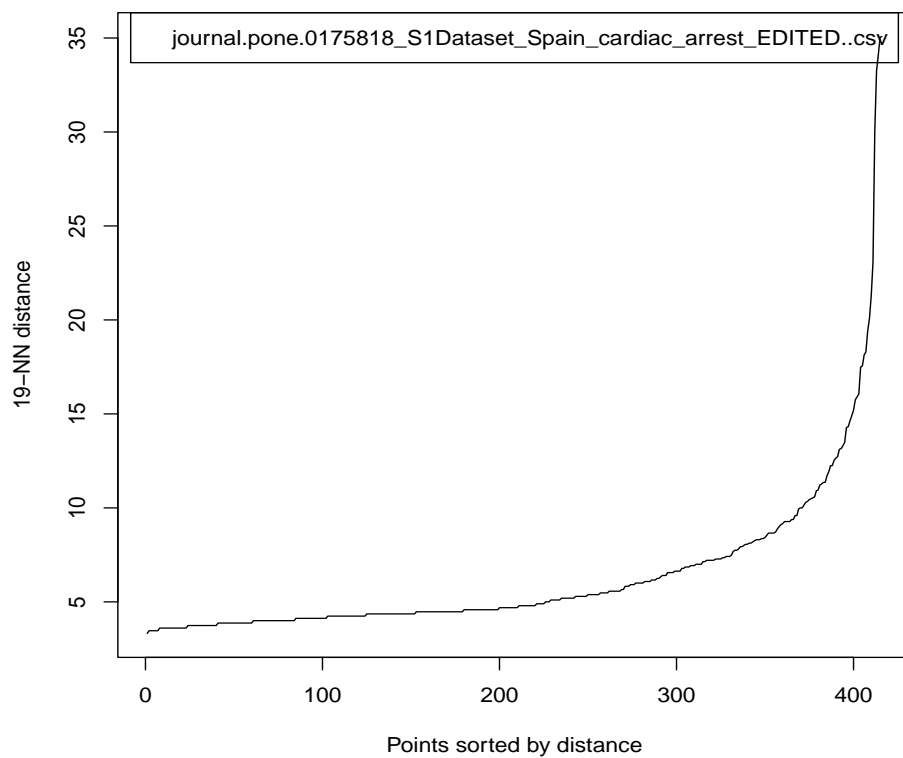


Figura 5.9: Risultati dell'algoritmo DBSCAN per il dataset Neuroblastoma.csv, usando un KNN-plot per stimare  $\epsilon$



Dataset: journal.pone.0175818\_S1Dataset\_Spain\_cardiac\_arrest\_EDITED.csv  
 DBSCAN clustering with visual inspection  
 Parameters used: minPoints = 19, epsilon = 15

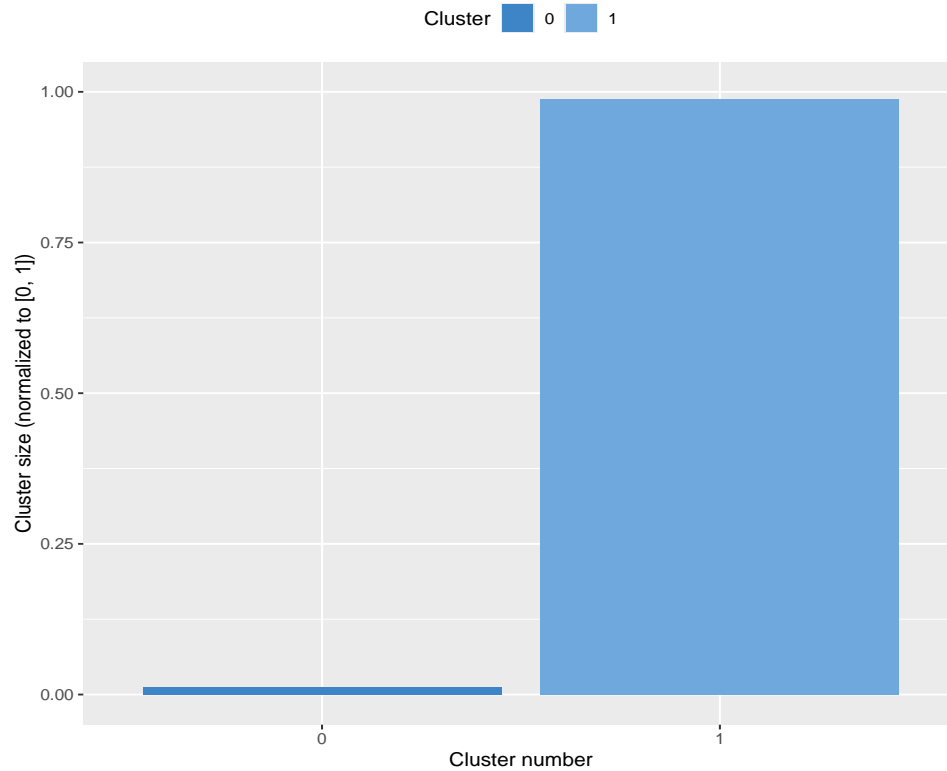
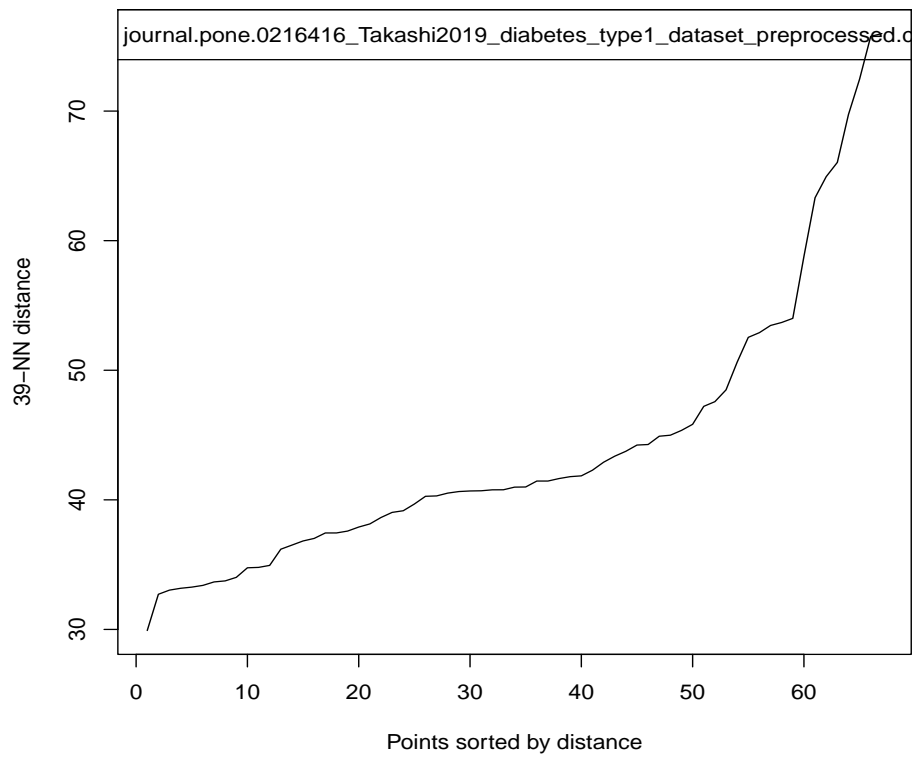


Figura 5.10: Risultati dell'algoritmo DBSCAN per il dataset `Diabetes.csv`, usando un KNN-plot per stimare  $\epsilon$



Dataset: journal.pone.0216416\_Takashi2019\_diabetes\_type1\_dataset\_preproce:  
 DBSCAN clustering with visual inspection  
 Parameters used: minPoints = 39, epsilon = 50

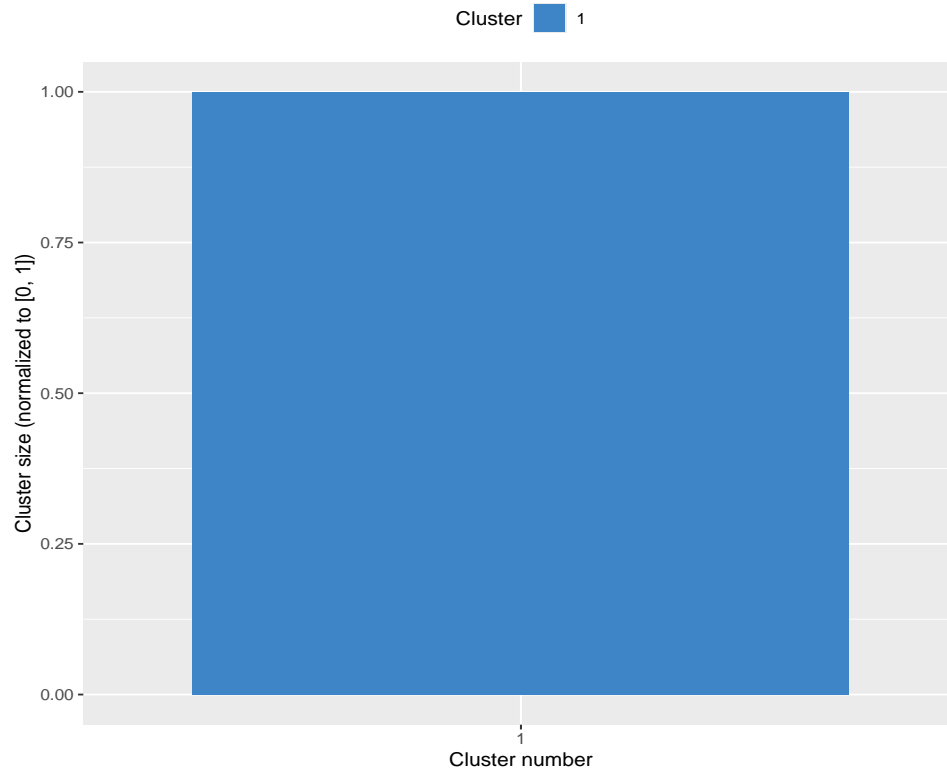


Figura 5.11: Risultati dell'algoritmo DBSCAN per il dataset `Sepsis.csv`, usando un KNN-plot per stimare  $\epsilon$

## 6. Conclusioni

I test sono stati condotti usando esclusivamente EHR come dataset. Naturalmente, sarebbe possibile estendere i test a dataset di diversa natura, che possano contenere informazioni che le EHR non riportano.

Gli algoritmi di clustering sono stati applicati su dataset dove parte degli elementi avevano uno o più attributi di valore ignoto. Non essendo possibile operare il clustering con dati dei quali non è noto il valore, l'approccio che ho utilizzato è consistito semplicemente nell'eliminare dal dataset ogni elemento che avesse almeno un dato mancante. Si potrebbe ripetere gli esperimenti adottando un approccio più conservativo, ad esempio sostituendo tali dati con valori di default ed osservare se si presentano differenze.

Un'alternativa simile è quella di utilizzare tecniche in grado di predire i valori mancanti sulla base di quelli noti, ad esempio calcolando la media di tutti i valori noti per un certo attributo ed utilizzarla al posto dei valori mancanti.

Sarebbe inoltre interessante ripetere gli esperimenti operando **dimensionality reduction**, come ad esempio **principal component analysis** [13], ovvero delle tecniche in grado di accorpare o di scartare del tutto gli attributi che non hanno particolare rilevanza nel risultato finale del clustering. Questo permetterebbe, ammesso di riuscire a ridurre il numero delle dimensioni fino a due o a tre, di poter visualizzare il risultato del clustering in uno scatter plot.

# Bibliografia

- [1] Nonie Alexander et al. «Identifying and Evaluating Clinical Subtypes of Alzheimer's Disease in Care Electronic Health Records Using Unsupervised Machine Learning». In: *BMC Medical Informatics and Decision Making* 21.1 (2021), p. 343. ISSN: 1472-6947. DOI: 10.1186/s12911-021-01693-6. URL: <https://doi.org/10.1186/s12911-021-01693-6>.
- [2] T. Caliński e J Harabasz. «A dendrite method for cluster analysis». In: *Communications in Statistics* 3.1 (1974), pp. 1–27. DOI: 10.1080/03610927408827101. eprint: <https://www.tandfonline.com/doi/pdf/10.1080/03610927408827101>. URL: <https://www.tandfonline.com/doi/abs/10.1080/03610927408827101>.
- [3] Ricardo J. G. B. Campello, Davoud Moulavi e Joerg Sander. «Density-Based Clustering Based on Hierarchical Density Estimates». In: *Advances in Knowledge Discovery and Data Mining*. A cura di Jian Pei et al. Berlin, Heidelberg: Springer Berlin Heidelberg, 2013, pp. 160–172. ISBN: 978-3-642-37456-2.
- [4] Chia-Wei Chang et al. «Identifying Heterogeneous Subgroups of Systemic Autoimmune Diseases by Applying a Joint Dimension Reduction and Clustering Approach to Immunomarkers». In: *BioData Mining* 17.1 (2024), p. 36. ISSN: 1756-0381. DOI: 10.1186/s13040-024-00389-7. URL: <https://doi.org/10.1186/s13040-024-00389-7>.
- [5] Kumardeep Chaudhary et al. «Utilization of Deep Learning for Subphenotype Identification in Sepsis-Associated Acute Kidney Injury». In: *Clinical Journal of the American Society of Nephrology* 15.11 (2020). ISSN: 1555-9041. URL: [https://journals.lww.com/cjasn/fulltext/2020/11000/utilization\\_of\\_deep\\_learning\\_for\\_subphenotype.6.aspx](https://journals.lww.com/cjasn/fulltext/2020/11000/utilization_of_deep_learning_for_subphenotype.6.aspx).
- [6] David L. Davies e Donald W. Bouldin. «A Cluster Separation Measure». In: *IEEE Transactions on Pattern Analysis and Machine Intelligence* PAMI-1.2 (1979), pp. 224–227. DOI: 10.1109/TPAMI.1979.4766909.
- [7] Andrzej Dudek. «Silhouette Index as Clustering Evaluation Tool». In: *Classification and Data Analysis*. A cura di Krzysztof Jajuga, Jacek Batóg e Marek Walesiak. Cham: Springer International Publishing, 2020, pp. 19–33. ISBN: 978-3-030-52348-0.
- [8] J. C. Dunn†. «Well-Separated Clusters and Optimal Fuzzy Partitions». In: *Journal of Cybernetics* 4.1 (1974), pp. 95–104. DOI: 10.1080/01969727408546059. eprint: <https://doi.org/10.1080/01969727408546059>. URL: <https://doi.org/10.1080/01969727408546059>.
- [9] Martin Ester et al. «A density-based algorithm for discovering clusters in large spatial databases with noise». In: *Proceedings of the Second International Conference on Knowledge Discovery and Data Mining*. KDD'96. Portland, Oregon: AAAI Press, 1996, pp. 226–231.
- [10] R. A. FISHER. «THE USE OF MULTIPLE MEASUREMENTS IN TAXONOMIC PROBLEMS». In: *Annals of Eugenics* 7.2 (1936), pp. 179–188. DOI: <https://doi.org/10.1111/j.1469-1809.1936.tb02137.x>. eprint: <https://onlinelibrary.wiley.com/doi/pdf/10.1111/j.1469-1809.1936.tb02137.x>. URL: <https://onlinelibrary.wiley.com/doi/abs/10.1111/j.1469-1809.1936.tb02137.x>.

- [11] Xiaonan Gao e WU Sen. «CUBOS: An Internal Cluster Validity Index for Categorical Data». In: *Tehnicki vjesnik - Technical Gazette* (2019). URL: <https://api.semanticscholar.org/CorpusID:198189126>.
- [12] L. Guerra et al. «A comparison of clustering quality indices using outliers and noise». In: *Intelligent Data Analysis* 16.4 (2012), pp. 703–715. DOI: 10.3233/IDA-2012-0545. eprint: <https://doi.org/10.3233/IDA-2012-0545>. URL: <https://doi.org/10.3233/IDA-2012-0545>.
- [13] Harold Hotelling. «Analysis of a complex of statistical variables into principal components.» In: *Journal of Educational Psychology* 24 (1933), pp. 498–520. URL: <https://api.semanticscholar.org/CorpusID:144828484>.
- [14] Sookyung Hyun et al. «Exploration of critical care data by using unsupervised machine learning». In: *Computer Methods and Programs in Biomedicine* 194 (2020), p. 105507. ISSN: 0169-2607. DOI: <https://doi.org/10.1016/j.cmpb.2020.105507>. URL: <https://www.sciencedirect.com/science/article/pii/S0169260719310624>.
- [15] Colin B. Josephson et al. «Association of Comorbid-Socioeconomic Clusters with Mortality in Late Onset Epilepsy Derived Through Unsupervised Machine Learning». In: *Seizure - European Journal of Epilepsy* 111 (), pp. 58–67. ISSN: 1059-1311. DOI: 10.1016/j.seizure.2023.07.016. URL: <https://doi.org/10.1016/j.seizure.2023.07.016>.
- [16] S. Lloyd. «Least squares quantization in PCM». In: *IEEE Transactions on Information Theory* 28.2 (1982), pp. 129–137. DOI: 10.1109/TIT.1982.1056489.
- [17] Alireza Naghizadeh e Dimitris N. Metaxas. «Condensed Silhouette: An Optimized Filtering Process for Cluster Selection in K-Means». In: *Procedia Computer Science* 176 (2020). Knowledge-Based and Intelligent Information and Engineering Systems: Proceedings of the 24th International Conference KES2020, pp. 205–214. ISSN: 1877-0509. DOI: <https://doi.org/10.1016/j.procs.2020.08.022>. URL: <https://www.sciencedirect.com/science/article/pii/S1877050920318469>.
- [18] William Stafford Noble. «A Quick Guide to Organizing Computational Biology Projects». In: *PLOS Computational Biology* 5.7 (lug. 2009), pp. 1–5. DOI: 10.1371/journal.pcbi.1000424. URL: <https://doi.org/10.1371/journal.pcbi.1000424>.
- [19] Peter J. Rousseeuw. «Silhouettes: A graphical aid to the interpretation and validation of cluster analysis». In: *Journal of Computational and Applied Mathematics* 20 (1987), pp. 53–65. ISSN: 0377-0427. DOI: [https://doi.org/10.1016/0377-0427\(87\)90125-7](https://doi.org/10.1016/0377-0427(87)90125-7). URL: <https://www.sciencedirect.com/science/article/pii/0377042787901257>.
- [20] Santiago Schnell. «Ten Simple Rules for a Computational Biologist's Laboratory Notebook». In: *PLOS Computational Biology* 11.9 (set. 2015), pp. 1–5. DOI: 10.1371/journal.pcbi.1004385. URL: <https://doi.org/10.1371/journal.pcbi.1004385>.
- [21] Robert R. Sokal e Charles Duncan Michener. «A statistical method for evaluating systematic relationships». In: *University of Kansas science bulletin* 38 (1958), pp. 1409–1438. URL: <https://api.semanticscholar.org/CorpusID:61950873>.
- [22] Artur Starczewski e Adam Krzyżak. «Performance Evaluation of the Silhouette Index». In: *Artificial Intelligence and Soft Computing*. A cura di Leszek Rutkowski et al. Cham: Springer International Publishing, 2015, pp. 49–58. ISBN: 978-3-319-19369-4.