



Machine Learning 101

Selección de características



Índice

1. **Motivación**
2. Métodos de filtrado
3. Métodos *wrapper*
4. Métodos *embedded*

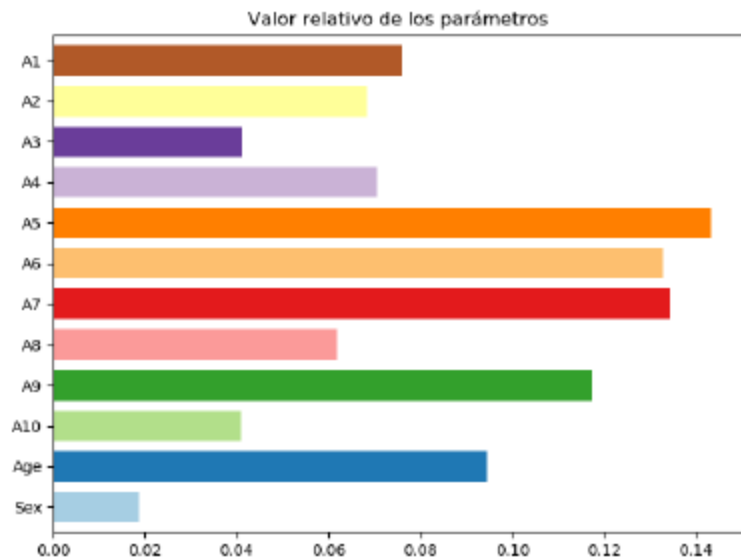


■ Motivación

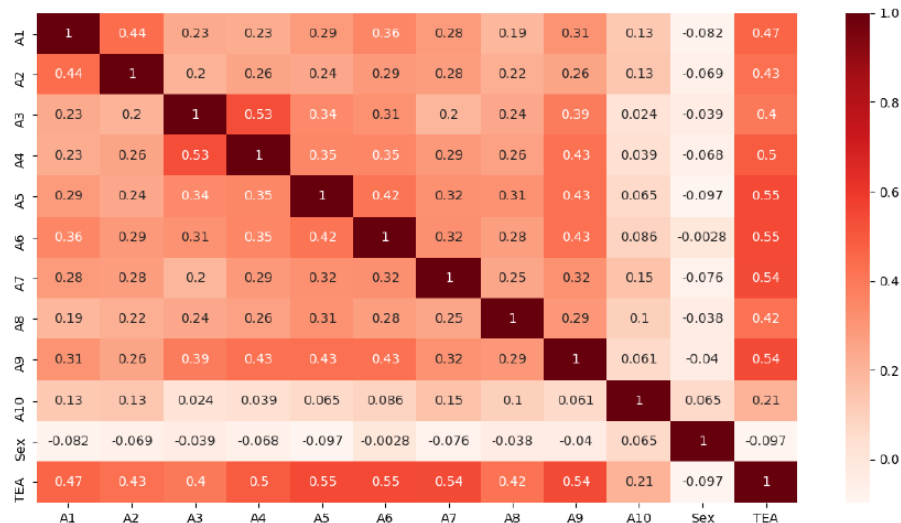
1. Interpretabilidad
 - Eliminar variables irrelevantes
 - Entender mejor los datos
2. Reducir coste computacional del entrenamiento
 - Se busca solución dispersa (“sparse”)
3. Evitar sobreajuste
 - Reducir la dimensionalidad del conjunto de entrada



Motivación selección características



Correlación



Índice

1. Motivación
2. **Métodos de filtrado**
3. Métodos *wrapper*
4. Métodos *embedded*



■ Métodos de filtrado

- Se evalúa la **relevancia** de cada característica de forma individual
- Las variables se **ordenan de acuerdo a algún índice de relevancia**, de tal forma que las variables con valor más bajo pueden ser eliminadas
- Con el conjunto de variables seleccionadas entrenamos el modelo de ML
- En scikit-learn se denomina [Univariate feature selection](#).



■ Ventajas e inconvenientes

- Ventajas
 - Sencillos y rápidos de aplicar
- Desventajas:
 - No tienen en cuenta interacciones entre variables

- For regression: `f_regression` , `mutual_info_regression`
- For classification: `chi2` , `f_classif` , `mutual_info_classif`

The methods based on F-test estimate the degree of linear dependency between two random variables. On the other hand, mutual information methods can capture any kind of statistical dependency, but being nonparametric, they require more samples for accurate estimation.



Let's code!



Índice

1. Motivación
2. Métodos de filtrado
3. **Métodos *wrapper***
4. Métodos *embedded*



■ Métodos *wrapper*

- Se utiliza un algoritmo de ML como caja negra para evaluar las prestaciones de distintos conjuntos de características
- Necesitan:
 - Un algoritmo de ML
 - Un criterio de relevancia
 - Un procedimiento de búsqueda de todos los posible subconjuntos de características (normalmente métodos heurísticos)
- Procedimientos de búsqueda
 - **Fuerza bruta**
 - Aleatorios: algoritmos genéticos
 - Estrategias greedy: selección **hacia delante** o **hacia atrás**.



Fuerza bruta

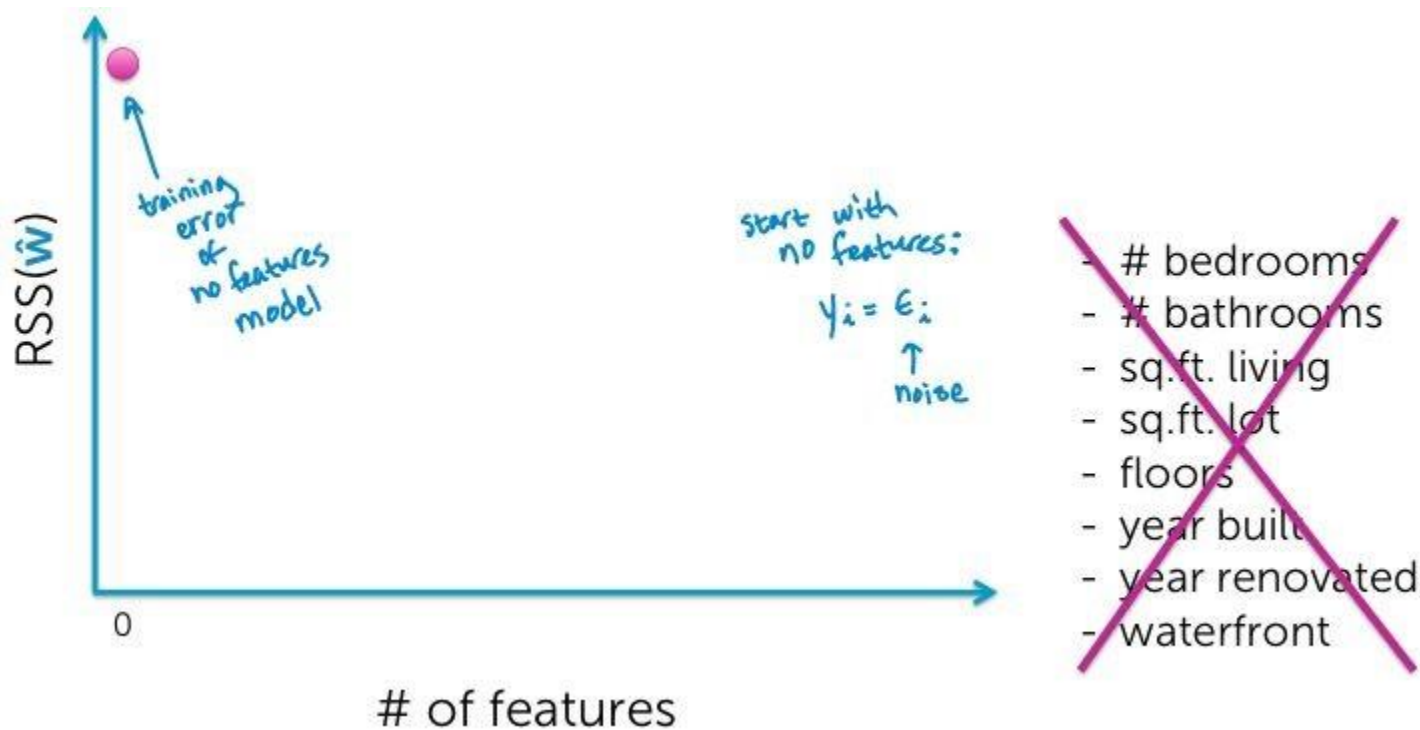


Lot size	Dishwasher
Single Family	Garbage disposal
Year built	Microwave
Last sold price	Range / Oven
Last sale price/sqft	Refrigerator
Finished sqft	Washer
Unfinished sqft	Dryer
Finished basement sqft	Laundry location
# floors	Heating type
Flooring types	Jetted Tub
Parking type	Deck
Parking amount	Fenced Yard
Cooling	Lawn
Heating	Garden
Exterior materials	Sprinkler System
Roof type	⋮
Structure style	



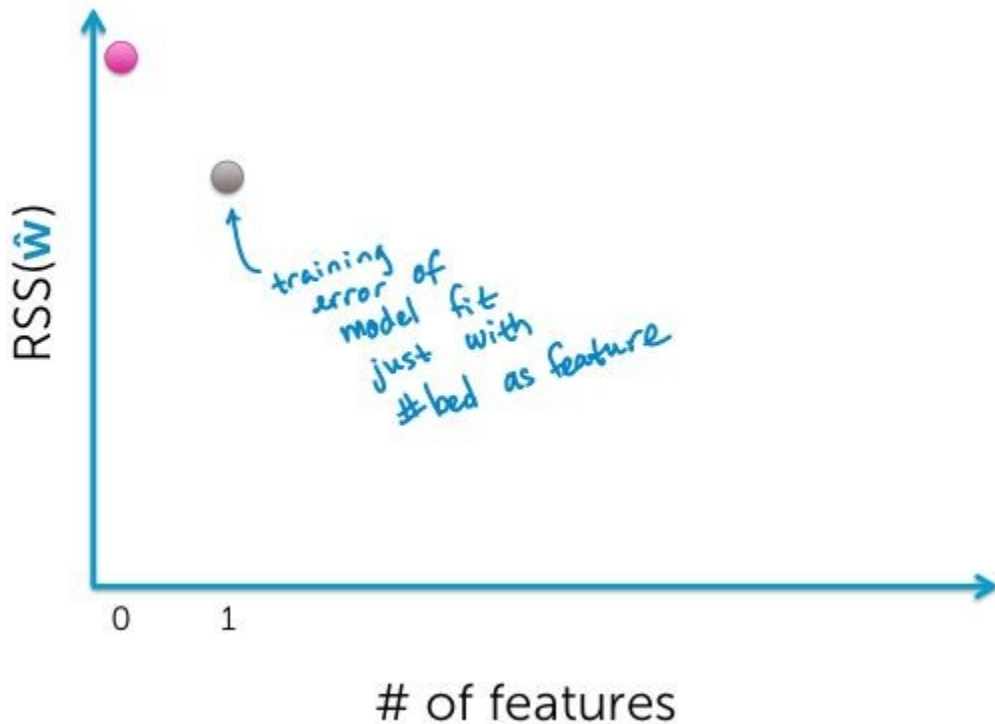
Fuente: [Machine learning course. Emily Fox and Carlos Guestrin](#)

Fuerza bruta



Fuente: [Machine learning course. Emily Fox and Carlos Guestrin](#)

Fuerza bruta

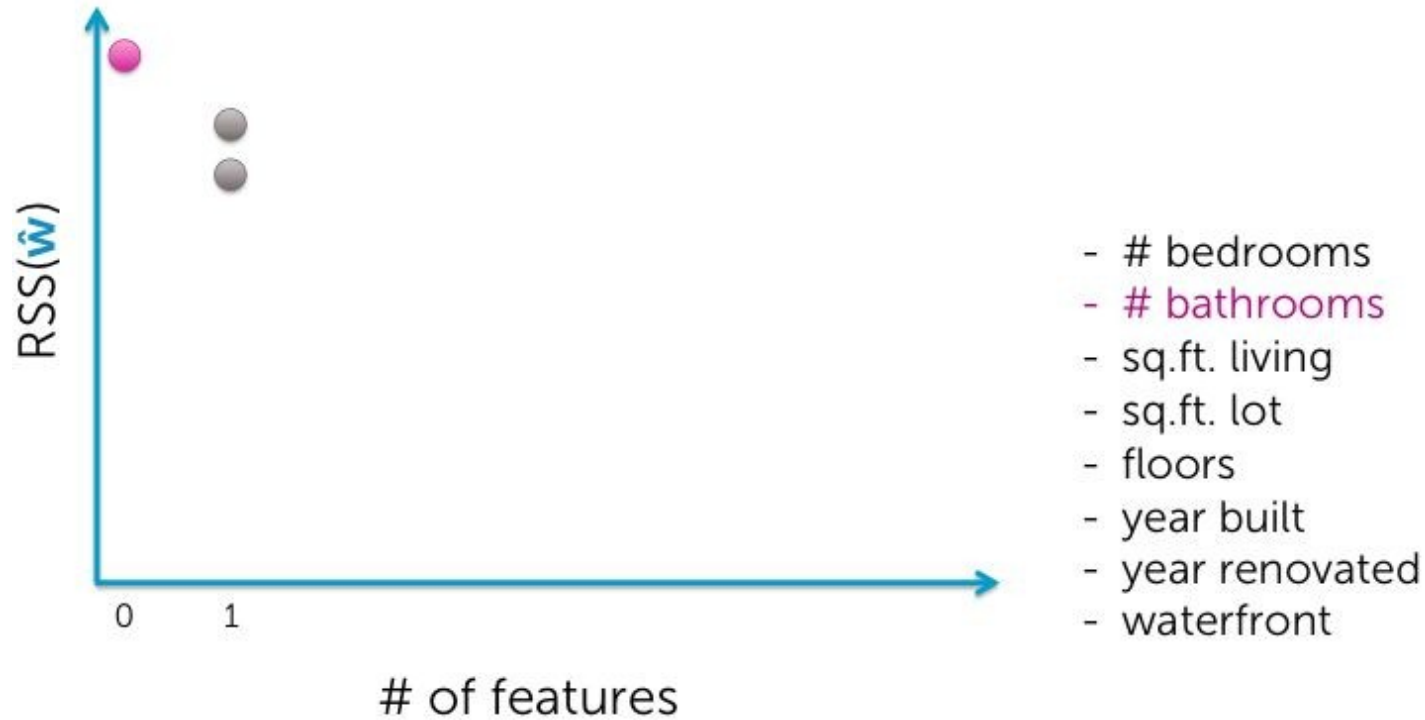


- # bedrooms
- # bathrooms
- sq.ft. living
- sq.ft. lot
- floors
- year built
- year renovated
- waterfront



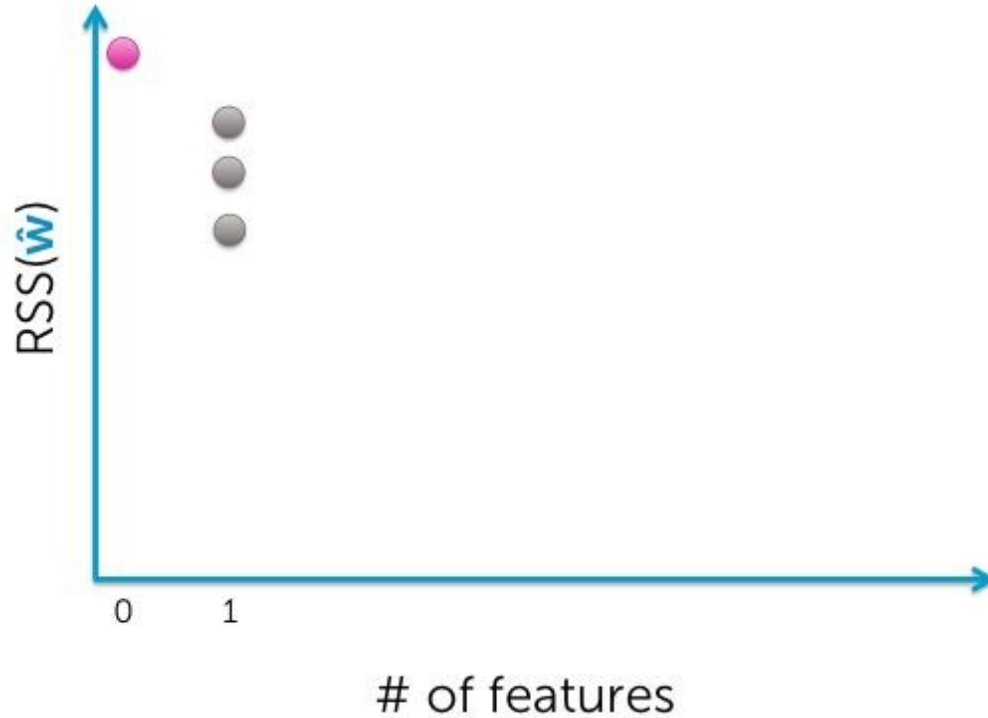
Fuente: [Machine learning course. Emily Fox and Carlos Guestrin](#)

Fuerza bruta



Fuente: [Machine learning course. Emily Fox and Carlos Guestrin](#)

Fuerza bruta

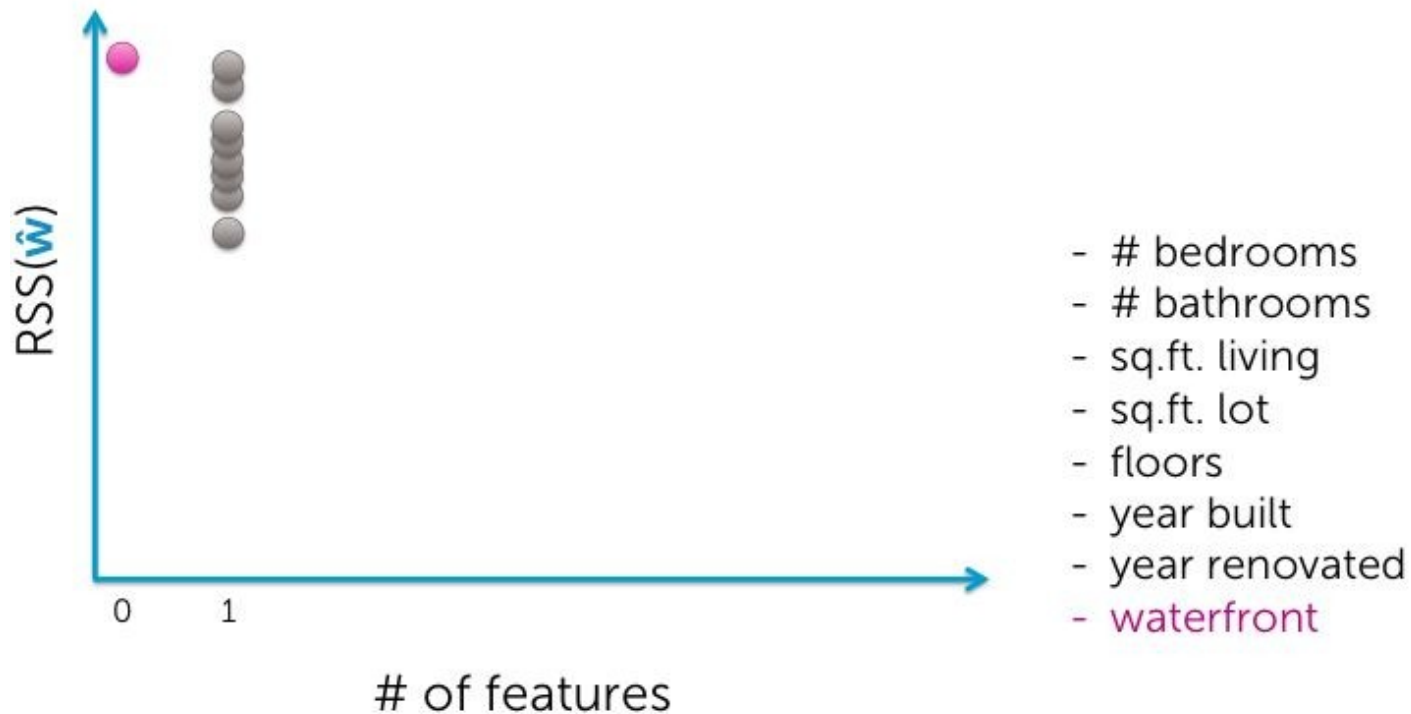


- # bedrooms
- # bathrooms
- sq.ft. living
- sq.ft. lot
- floors
- year built
- year renovated
- waterfront



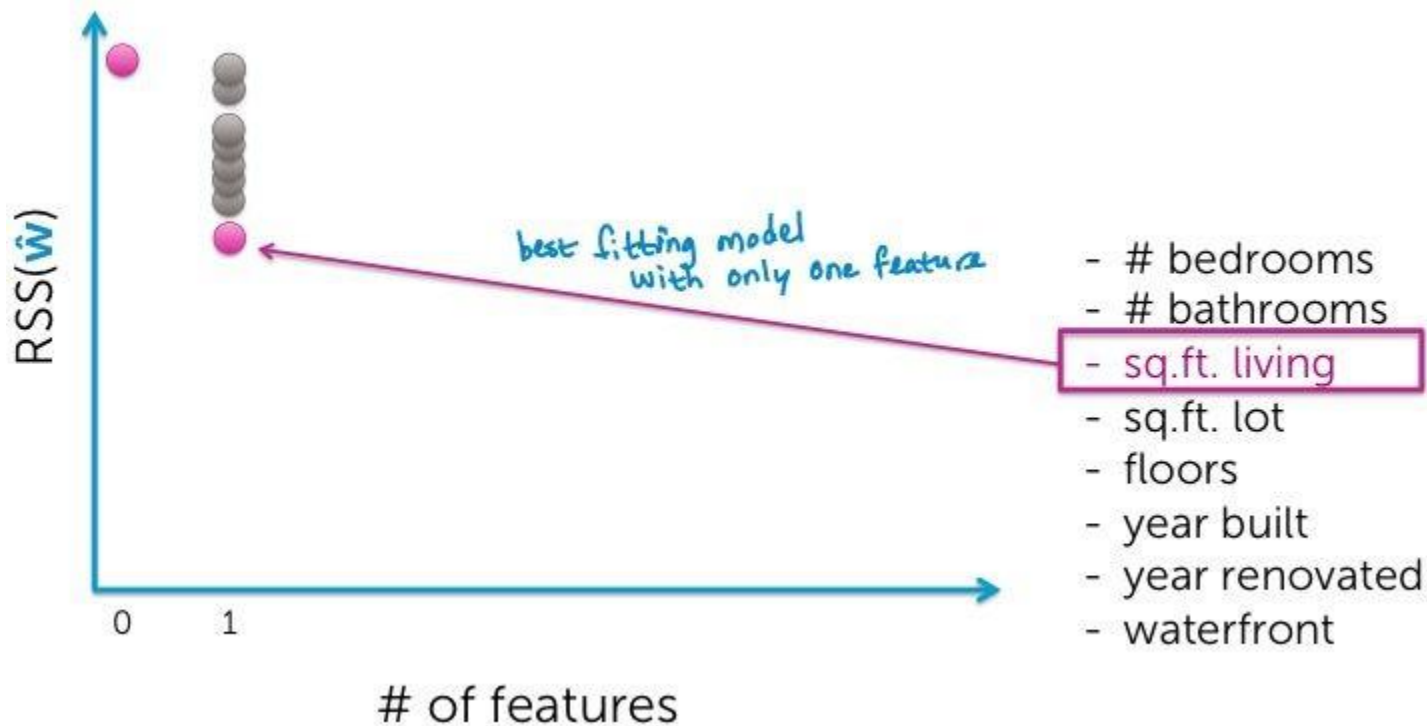
Fuente: [Machine learning course. Emily Fox and Carlos Guestrin](#)

Fuerza bruta



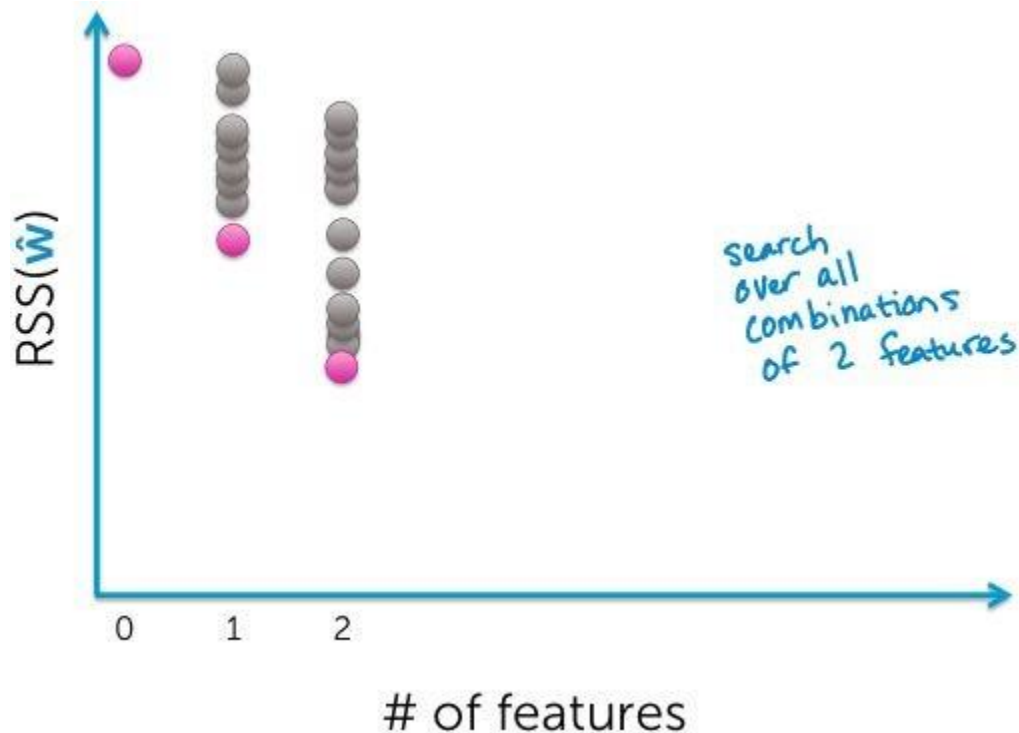
Fuente: [Machine learning course. Emily Fox and Carlos Guestrin](#)

Fuerza bruta



Fuente: [Machine learning course. Emily Fox and Carlos Guestrin](#)

Fuerza bruta

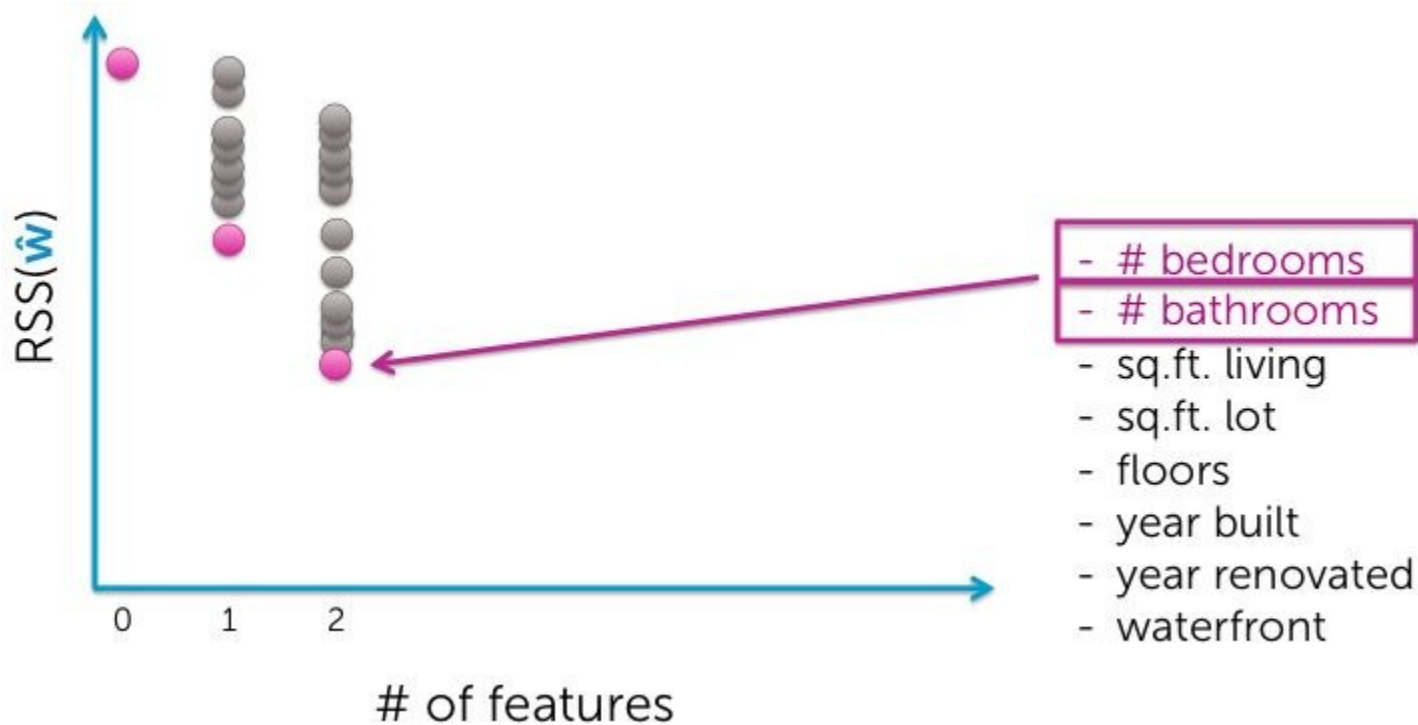


- # bedrooms
- # bathrooms
- sq.ft. living
- sq.ft. lot
- floors
- year built
- year renovated
- waterfront



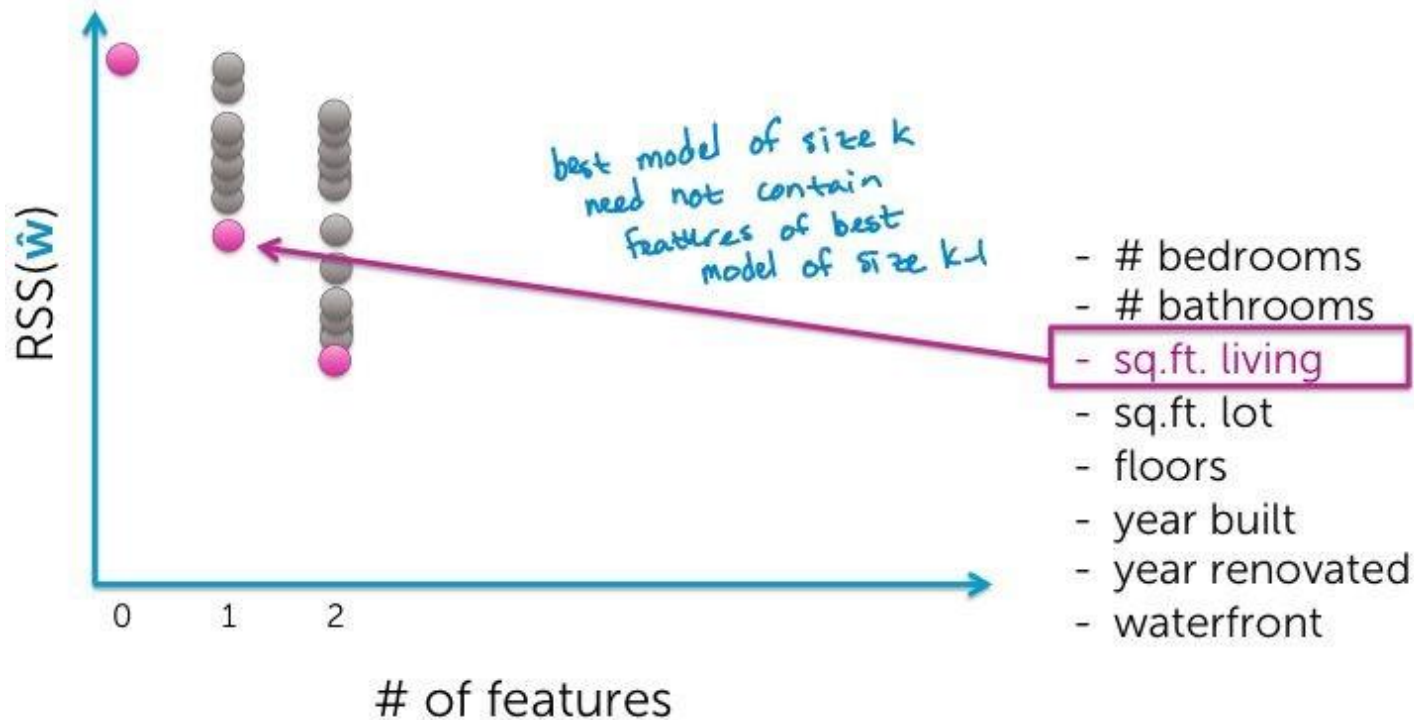
Fuente: [Machine learning course. Emily Fox and Carlos Guestrin](#)

Fuerza bruta



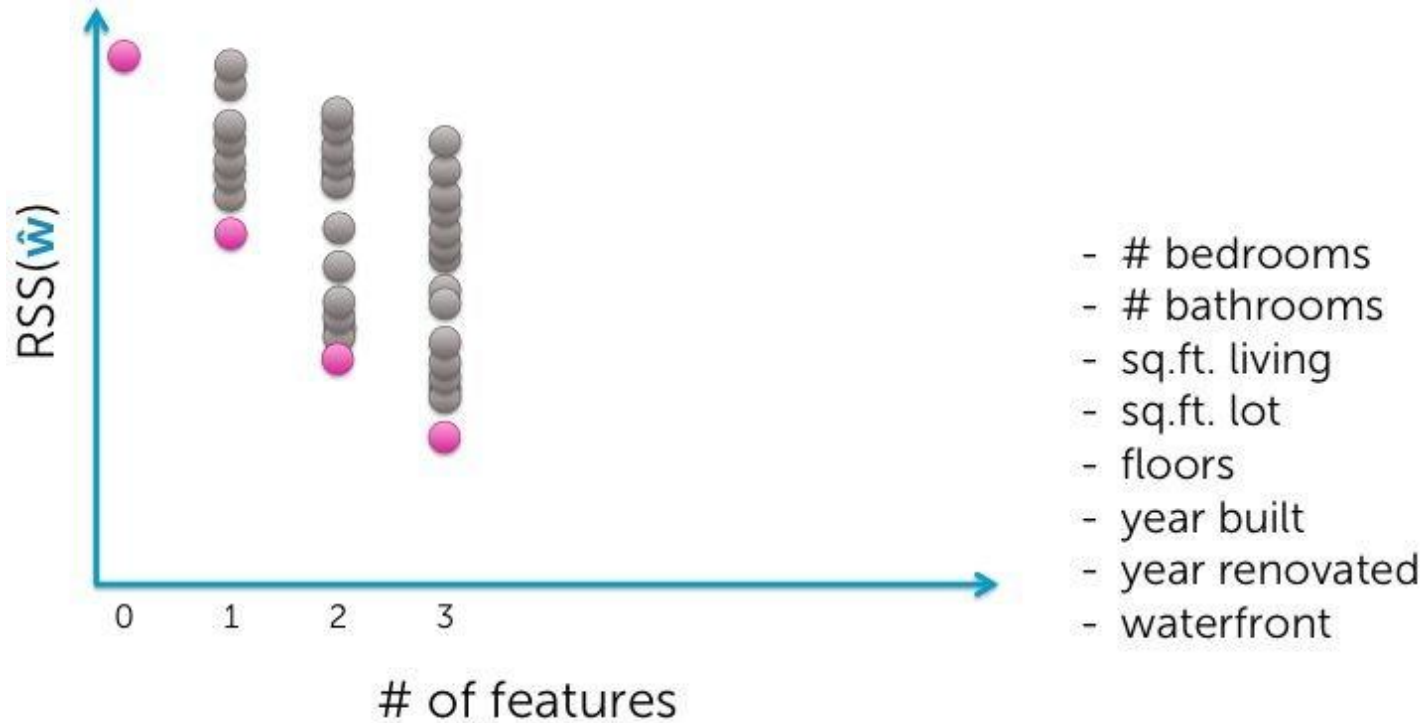
Fuente: [Machine learning course. Emily Fox and Carlos Guestrin](#)

Fuerza bruta



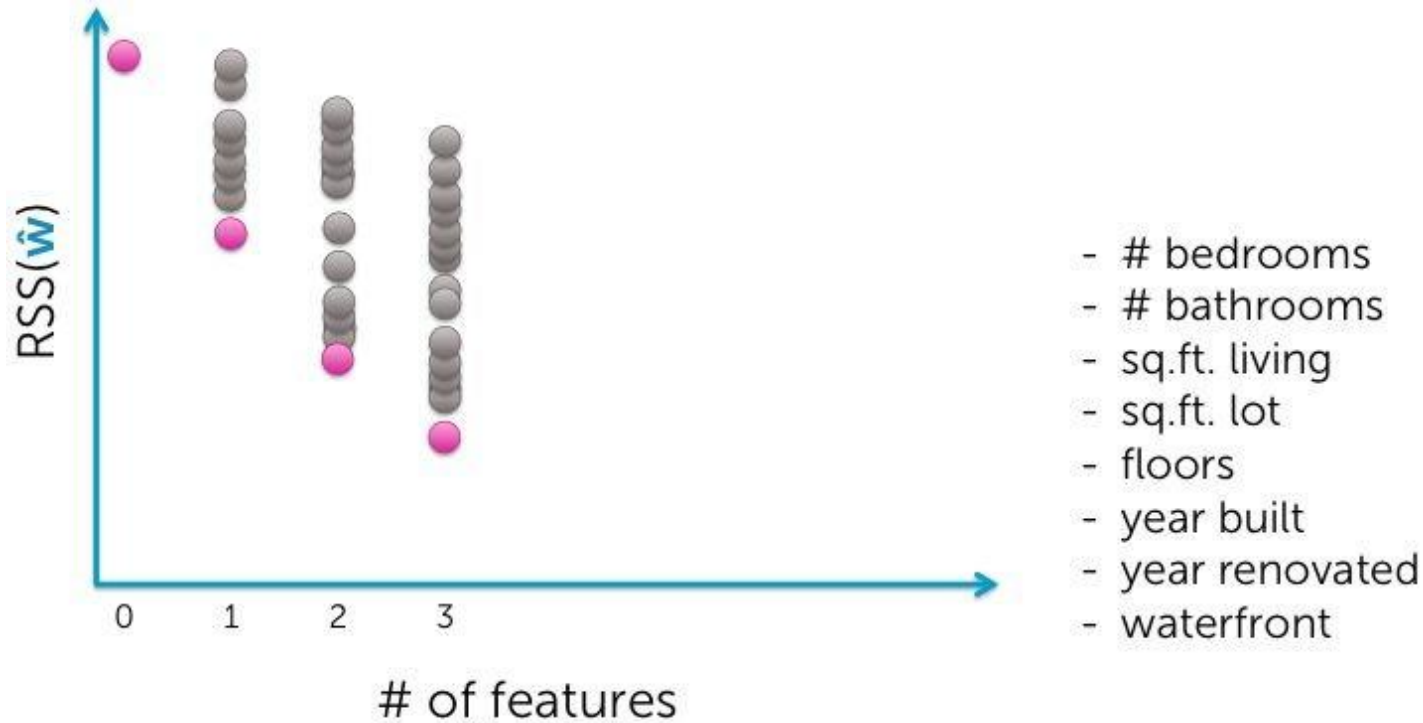
Fuente: [Machine learning course. Emily Fox and Carlos Guestrin](#)

Fuerza bruta



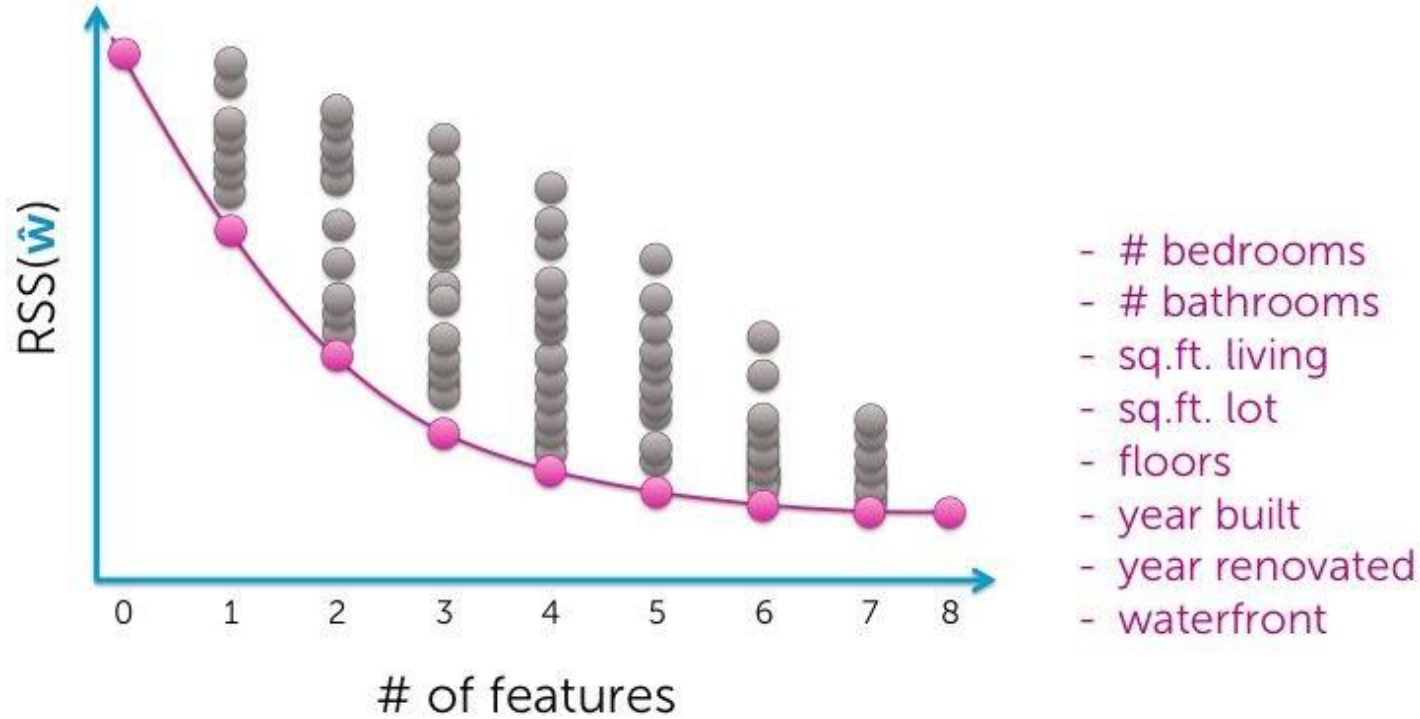
Fuente: [Machine learning course. Emily Fox and Carlos Guestrin](#)

Fuerza bruta



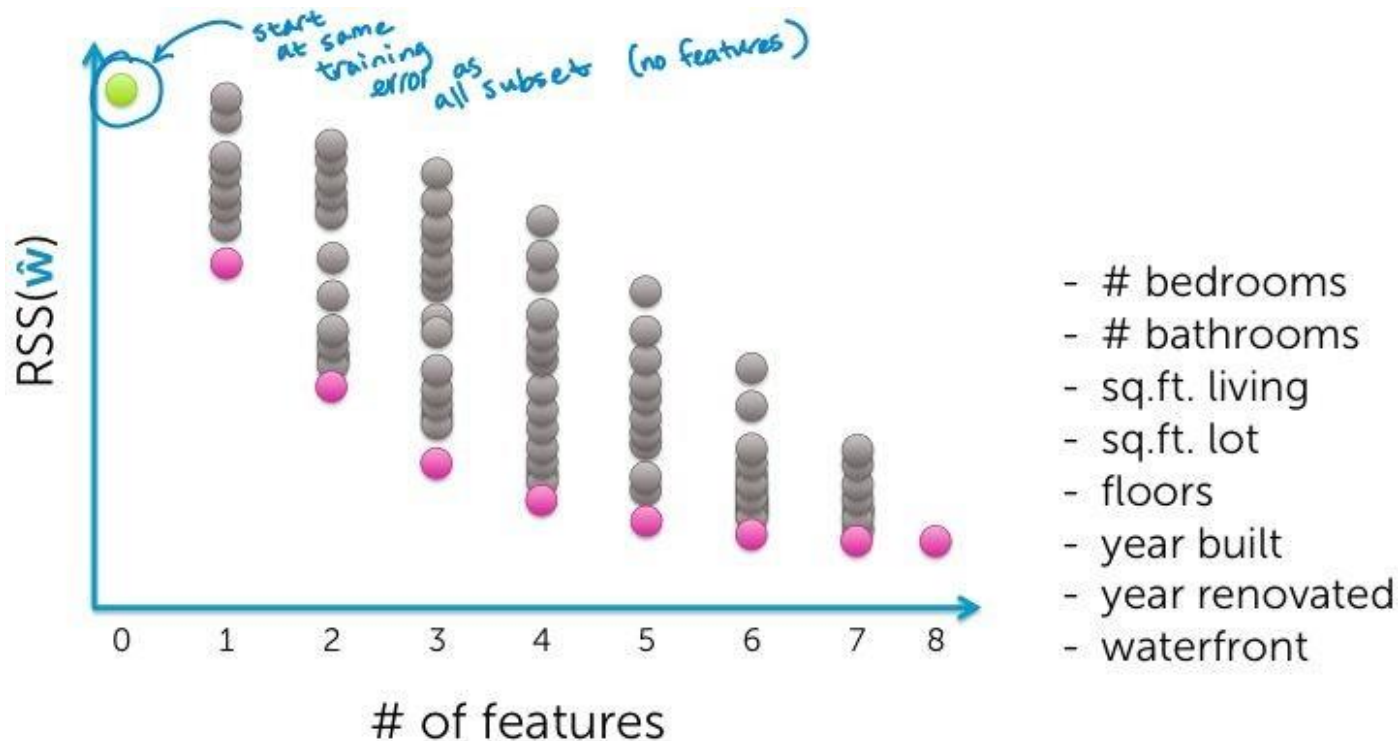
Fuente: [Machine learning course. Emily Fox and Carlos Guestrin](#)

Fuerza bruta



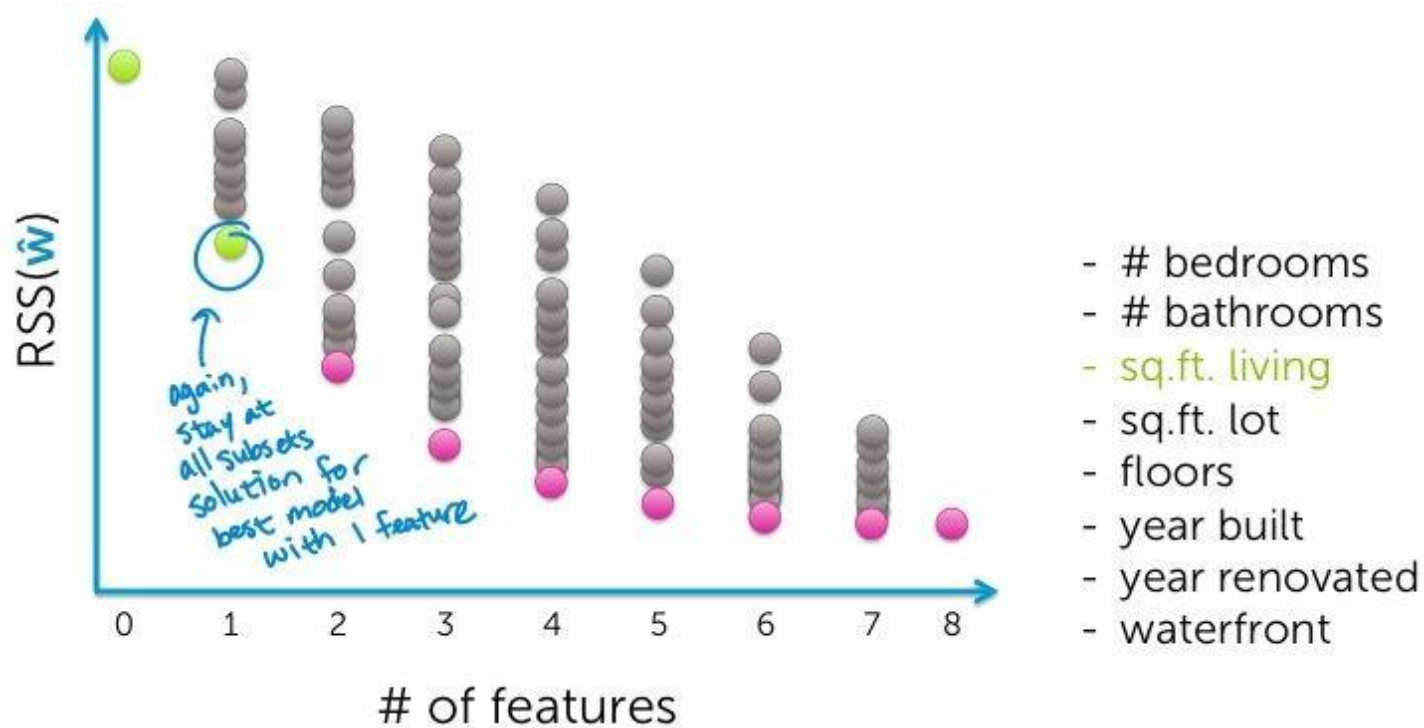
Fuente: [Machine learning course. Emily Fox and Carlos Guestrin](#)

Selección hacia delante



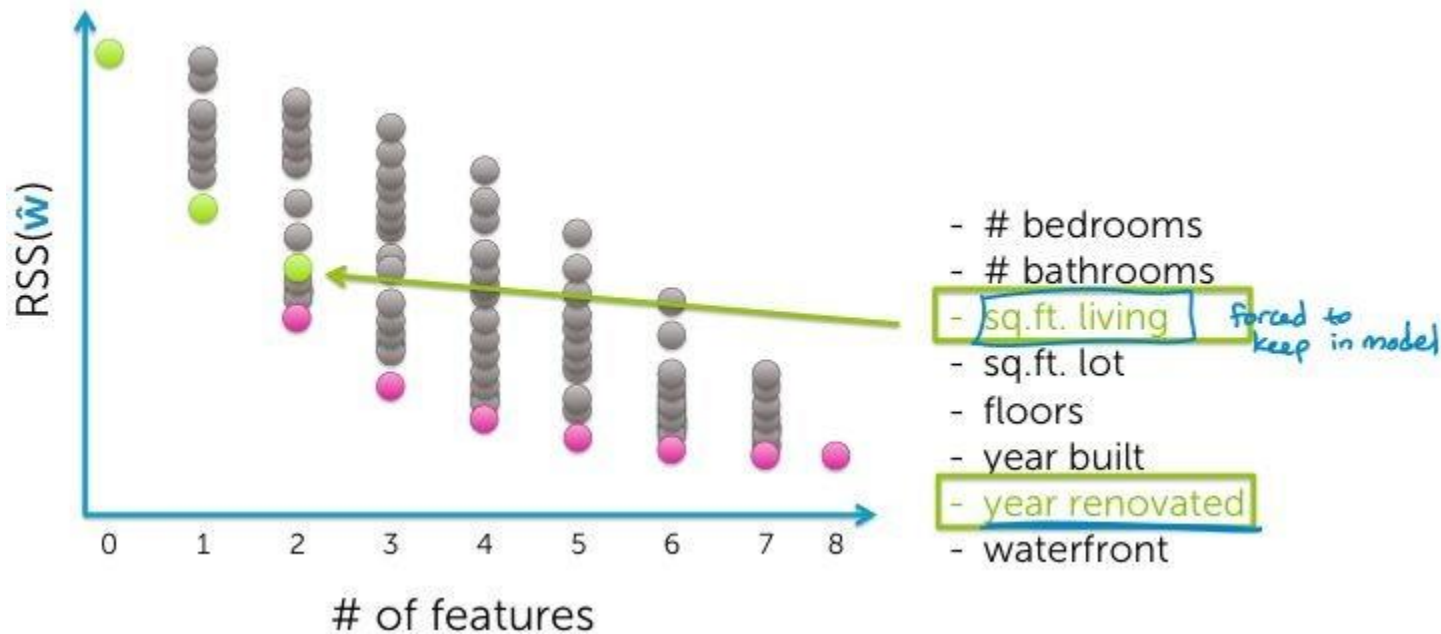
Fuente: [Machine learning course. Emily Fox and Carlos Guestrin](#)

■ Selección hacia delante



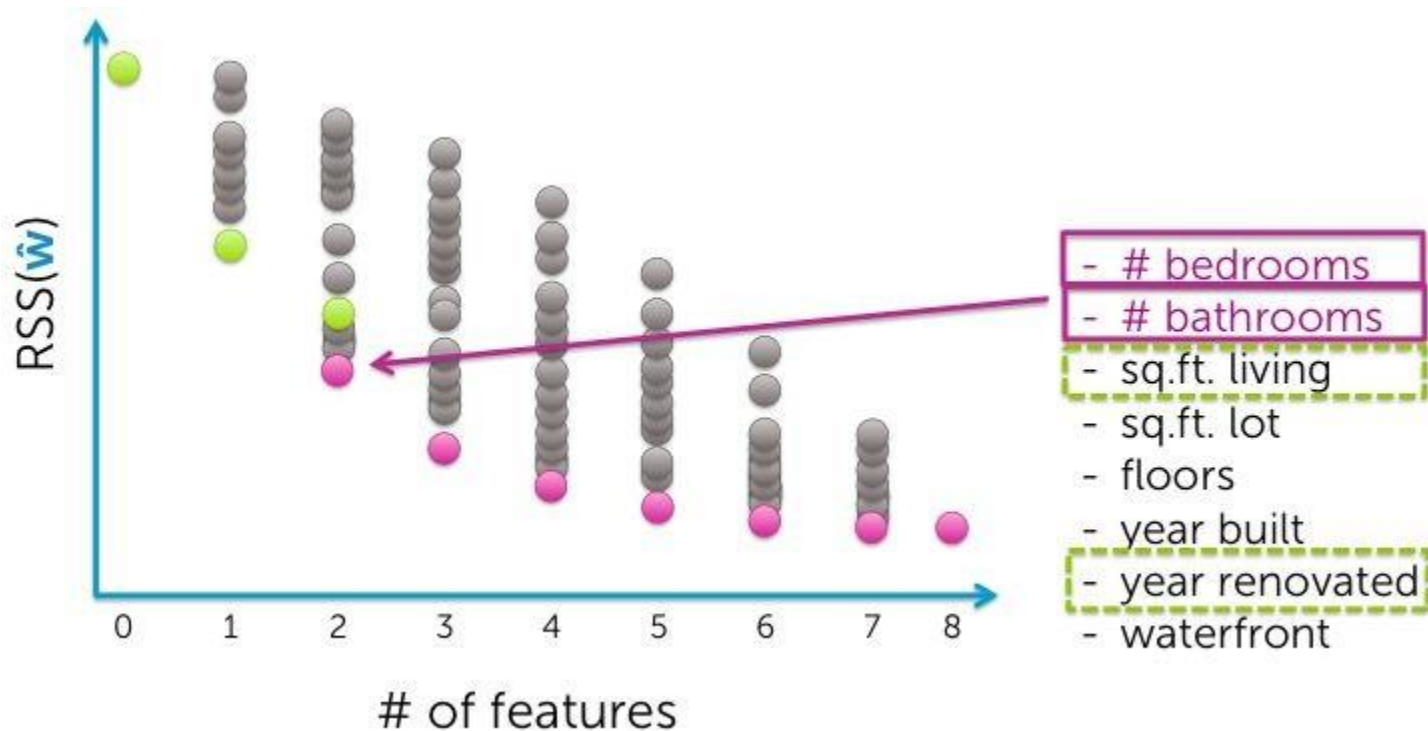
Fuente: [Machine learning course. Emily Fox and Carlos Guestrin](#)

Selección hacia delante



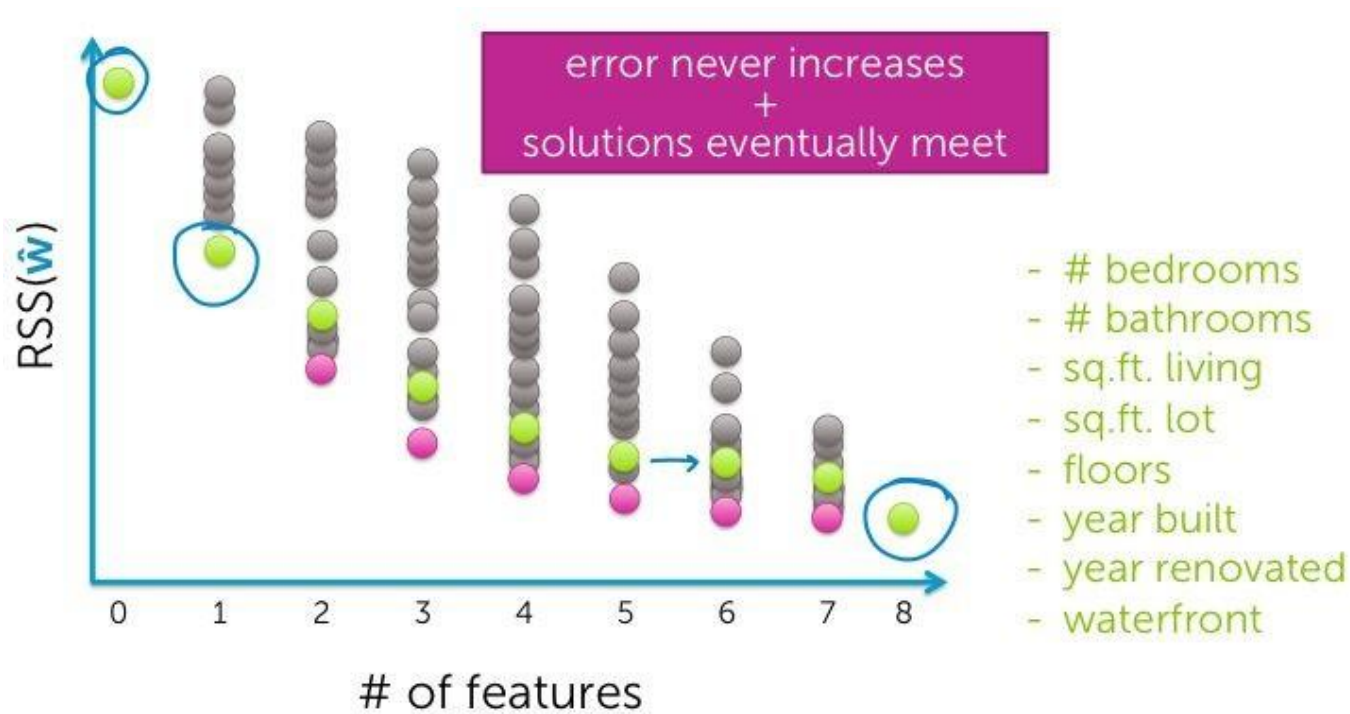
Fuente: [Machine learning course. Emily Fox and Carlos Guestrin](#)

■ Selección hacia delante



Fuente: [Machine learning course. Emily Fox and Carlos Guestrin](#)

■ Selección hacia delante



Fuente: [Machine learning course. Emily Fox and Carlos Guestrin](#)

■ Métodos *wrapper*

- Complejidad
 - Fuerza bruta: $O(2^D)$
 - Si $D = 20 \Rightarrow 2^{20} \approx 1\text{e}6$ posibilidades
 - Complejidad selección hacia delante: $O(D^2)$
- OK: algoritmo de ML como caja negra, solución universal y sencilla.
- KO: para cada subconjunto se tiene que crear un nuevo modelo (entrenamiento/validación)
 - k-fold CV (hay que hacerlo bien!!)



Índice

1. Motivación
2. Métodos de filtrado
3. Métodos *wrapper*
4. **Métodos *embedded***



■ Métodos *embedded*

1. Incorporan la selección de características como parte del proceso de entrenamiento:
 - Algoritmos que permiten seleccionar características
1. Se pueden utilizar junto con técnicas hacia delante/atrás (métodos anidados): eficientes.
1. Ejemplos
 - Lasso



■ Lo que puedes hacer ahora ...

- Técnicas de filtrado: filtrar (eliminar) las características poco relevantes en función de distintos criterios
- Técnicas wrapper: utilizar estrategias greedy para selección de características
- Técnicas embedded: utilizar las particularidades de un algoritmo para seleccionar las características relevantes



■ Referencias

- An Introduction to Statistical Learning. Capítulos 3, 6.



Let's code!

