

# Aprendizaje Automático para la Selección de Grupos de Control en Evaluación de Impacto

por

**Benjamín Bas Peralta**

Presentado ante la **FACULTAD DE MATEMÁTICA, ASTRONOMÍA,  
FÍSICA Y COMPUTACIÓN** como parte de los requerimientos para la obtención  
del grado de Licenciado en Ciencias de la Computación de la  
**UNIVERSIDAD NACIONAL DE CÓRDOBA**

Marzo, 2025

Directores: Dr. Martín Domínguez

Mgter.David Giuliadori



Este trabajo se distribuye bajo una Licencia Creative Commons  
Atribución - No Comercial - Compartir Igual 4.0 Internacional.



**Resumen:** (...)

**Palabras Clave:** Evaluación de Impacto, Grupo de Control, Aprendizaje Automático, Redes Neuronales, Series de Tiempo.

**Abstract:** (...)

**Keywords:** Impact Assesment, Control Group, Machine Learning, Neural Networks, Time Series.



# Agradecimientos



# Índice general

<b>1. Introducción</b>	<b>9</b>
<b>2. Marco Teórico</b>	<b>11</b>
2.1. Evaluación de Impacto . . . . .	12
2.1.1. ¿Qué es una Evaluación de Impacto? . . . . .	12
2.1.2. Estimación del Tratamiento . . . . .	13
2.1.3. El Grupo de Control como Estimador del Contrafactual . . . . .	15
2.1.4. Evaluaciones Experimentales o Aleatorias . . . . .	19
2.1.5. Evaluaciones Cuasi-experimentales . . . . .	20
2.2. Inteligencia Artificial . . . . .	27
2.2.1. Aprendizaje Automático . . . . .	27
2.2.2. Aprendizaje Supervisado . . . . .	29
2.3. Redes Neuronales Artificiales . . . . .	35
2.3.1. Breve Contexto Histórico . . . . .	35
2.3.2. Red Neuronal Feedforward . . . . .	36
2.4. Redes Neuronales Convolucionales . . . . .	44
2.5. Redes Neuronales Recurrentes . . . . .	49
2.5.1. Long Short-Term Memory . . . . .	52
2.5.2. Gated Recurrent Unit . . . . .	55
2.6. Clasificación de Series de Tiempo . . . . .	55
2.6.1. Clasificación de Series de Tiempo con Aprendizaje Automático . .	55
<b>3. Presentación del problema</b>	<b>57</b>
<b>4. Marco Experimental</b>	<b>59</b>
4.1. Conjuntos de Datos . . . . .	59
4.2. Arquitecturas de Redes Neuronales . . . . .	60
4.3. Herramientas . . . . .	60
4.3.1. Hardware . . . . .	61
4.3.2. Python . . . . .	61
4.3.3. PyTorch . . . . .	61

4.3.4.	Pandas . . . . .	61
4.3.5.	Numpy . . . . .	61
4.3.6.	Jupyter . . . . .	61
4.3.7.	Optuna . . . . .	61
4.3.8.	MLflow . . . . .	61
<b>5.</b>	<b>Resultados</b>	<b>63</b>
<b>6.</b>	<b>Conclusiones y Trabajos Futuros</b>	<b>65</b>



# Capítulo 1

## Introducción



# Capítulo 2

## Marco Teórico

En este capítulo, presentamos los conceptos teóricos necesarios para entender el contexto del problema y cuál es la solución que planteamos.

Primeramente, explicamos la Evaluación de Impacto, que es el campo de aplicación sobre el que vamos a trabajar. Describimos qué es una Evaluación de Impacto, en qué consiste, cuáles son los problemas involucrados, y las distintas técnicas que se utilizan para llevarla a cabo. Al final de esta sección, presentamos el método de *Propensity Score Matching*, que es el que tomaremos como parámetro para evaluar nuestra solución propuesta.

Luego, nos abordamos al campo de la Inteligencia Artificial, enfocándonos particularmente en el campo de los algoritmos de Aprendizaje Automático. Explicamos cómo funcionan estos y cuáles son los elementos presentes en ellos haciendo especial énfasis en los algoritmos de Aprendizaje Supervisado, dentro de los cuales se enmarca nuestra propuesta.

A continuación, hablamos sobre un *modelo* particular dentro del Aprendizaje Automático que ha cobrado particular importancia en los últimos años: las Redes Neuronales Artificiales. Partimos explicando las de tipo *Feedforward* para luego introducir otras más específicas como son las Convolucionales y las Recurrentes, de las cuales haremos uso en nuestros experimentos.

Por último, y para combinar el método de solución propuesto junto con el área de aplicación, hablamos sobre las series de tiempo. Mencionamos qué son y cuáles son los parámetros involucrados en ellas, y repasamos los últimos trabajos llevados a cabo que utilizan Inteligencia Artificial para resolver el problema de clasificación de series de tiempo.

## 2.1. Evaluación de Impacto

### 2.1.1. ¿Qué es una Evaluación de Impacto?

Los programas y las políticas de desarrollo suelen estar diseñados para cambiar resultados, como aumentar los ingresos, mejorar el aprendizaje o reducir las enfermedades [4]. Saber si estos cambios se logran o no es una pregunta crucial para las políticas públicas [4], y el método para responderla es lo que se conoce como **evaluación de impacto**.

Una evaluación de impacto mide los cambios en el bienestar de los individuos que se pueden atribuir a un proyecto, un programa o una política específicos [4]. Su sello distintivo radica en que pueden proporcionar **evidencia** robusta y creíble sobre si un programa concreto ha alcanzado o está alcanzando sus objetivos [4].

Estas evaluaciones ponen un fuerte énfasis en los resultados y buscan responder una pregunta específica de causa y efecto: ¿cuál es el impacto (o efecto causal) de un programa? Más precisamente, intentan identificar y cuantificar los cambios directamente atribuibles al tratamiento [4] sobre un conjunto de **variables de resultado** o **de interés** en un conjunto de individuos [1]. Estas variables son aquellas sobre las cuales se espera que el programa tenga un efecto en los beneficiarios [1]. Podrían ser por ejemplo la estatura y peso de los individuos, la cantidad de empleados o de ventas en una empresa, o indicadores de salud de un paciente.

Por lo tanto, el objetivo final de la evaluación de impacto consiste en establecer lo que se conoce como **efecto del tratamiento**, que es la diferencia entre la variable de resultado del individuo participante en el programa en presencia del programa, y la variable de resultado de ese individuo en ausencia del programa [1]. Sin embargo, es evidente que la respuesta a qué habría pasado con los beneficiarios si no hubieran recibido el tratamiento se refiere a una situación que no es observable. Este resultado hipotético se denomina **contrafactual** y es lo que se debe estimar en cualquier evaluación de impacto.

Algunas de las principales razones por las que se debería promover el uso de estas evaluaciones como herramientas de gestión provienen del hecho que permiten mejorar la rendición de cuentas, la inversión de recursos públicos o la efectividad de una política, obtener financiamiento, como así también probar modalidades de programas alternativos o innovaciones de diseño [4] y revelar la realidad de muchas políticas públicas para de esta forma contribuir a la fiscalización mediática [1].

Un ejemplo claro de por qué son necesarias las evaluaciones de impacto es el que describe Howard White con respecto al Programa Integrado de Nutrición en Bangladesh (PINB) [22]. Este programa identificaba, mediante mediciones en campo, a los niños desnutridos y los asignaba a un tratamiento que incluía alimentación suplementaria a los menores y educación nutricional a las madres [1]. Inicialmente, el programa fue considerado como un éxito ya que los datos de monitoreo mostraban caídas importantes en los niveles de desnutrición. El Banco Mundial decidió, con base en esta evidencia y previo a cualquier tipo de evaluación, aumentar los recursos destinados al programa. Sin embargo,

las primeras evaluaciones de impacto, realizadas por el Grupo Independiente de Evaluación del mismo Banco Mundial y por la ONG inglesa *Save the Children*, mostraron que la mejoría de los indicadores de los beneficiarios era similar o inferior a la de otros niños con características comparables que no hacían parte del programa [1]. Estos resultados reflejaron que las percepciones de los administradores del programa y de las entidades financiadoras eran erradas, y sugirieron algunos correctivos al programa [1].

Otro ejemplo que evidencia la importancia de estas evaluaciones es proporcionado por [9], donde se evaluó el efecto de un programa de preescolar comunitario en zonas rurales de Mozambique, lanzado en 2008 por la organización *Save the Children*. El programa consistió específicamente en el financiamiento de la construcción, equipamiento y entrenamiento de 67 aulas en 30 comunidades [9]. El objetivo principal era verificar si un desarrollo en la infancia temprana contribuía a preparar a los niños para la escuela y las etapas posteriores de la vida. Los resultados mostraron no solo que la inscripción a la escuela primaria se incrementó en un 24 % en las comunidades tratadas, sino también que los niños beneficiarios dedicaban un promedio de 7.2 horas adicionales por semana a actividades escolares y redujeron el tiempo destinado a trabajos en las granjas familiares y a asistir a encuentros comunitarios. Además, la participación en el programa preescolar mostró mejoras consistentes en habilidades motoras finas, cognitivas, y de resolución de problemas [9]. Todos estos resultados contribuyeron a reforzar la idea de que los programas preescolares constituyen una política prometedora para mejorar la preparación escolar de niños pobres y desfavorecidos en áreas rurales de África.

Habiéndonos enfocado en el *qué* es una evaluación de impacto, a continuación, presentamos *cómo* se lleva a cabo una, detallando los elementos presentes y los problemas que pueden surgir al hacerlo.

### 2.1.2. Estimación del Tratamiento

Como mencionamos anteriormente, el resultado deseado al llevar a cabo una evaluación de impacto es el efecto del tratamiento, y se obtiene como la diferencia entre el resultado observado y el contrafáctico. Ahora bien, marco teórico estándar para formalizar este problema se conoce como **modelo de resultados potenciales** o **modelo causal de Rubin** [18].

Formalmente, se definen dos elementos para cada individuo  $i = 1, \dots, N$ , donde  $N$  denota la población total:

- Por un lado, el indicador de tratamiento  $D$ , tal que  $D_i = 1$  implica que el individuo  $i$  participó del tratamiento, y  $D_i = 0$  en caso contrario.
- Por otro lado, para las variables de resultado se define  $Y_i(D_i) = (Y_i|D_i)$  - se lee como “el valor de  $Y_i$  dado  $D_i$ ”. De esta forma,  $Y_i(1)$  es la variable de resultado si el individuo  $i$  es tratado, e  $Y_i(0)$  es la variable de resultado si el individuo  $i$  no es tratado. Estos valores son los resultados potenciales.

Con esto, el **efecto del tratamiento** para un individuo  $i$  se puede escribir como:

$$\tau_i = Y_i(1) - Y_i(0) = (Y_i|D_i = 1) - (Y_i|D_i = 0) \quad (2.1)$$

Según esta fórmula, el impacto causal ( $\tau$ ) de un programa ( $D$ ) en una variable de resultado ( $Y$ ) para un individuo  $i$  es la diferencia entre la variable con el programa ( $Y_i(1)$ ) y la misma variable sin el programa ( $Y_i(0)$ ).

De nuevo, el problema fundamental de la evaluación de impacto es que se intenta medir una variable en un mismo momento del tiempo para la misma unidad de observación pero en dos realidades diferentes. Sin embargo, en la realidad, solo se observa uno de los dos resultados potenciales  $Y_i(1)$  o  $Y_i(0)$ , pero no ambos. Es decir, en los datos queda solamente registrado  $Y_i(1)$  si  $D_i = 1$  e  $Y_i(0)$  si  $D_i = 0$ ; no se dispone de  $Y_i(1)$  si el individuo no fue tratado ( $D_i = 0$ ), ni tampoco de  $Y_i(0)$  si el individuo fue tratado ( $D_i = 1$ ). De esta manera, el **resultado observado de  $Y_i$**  se puede expresar como:

$$Y_i = D_i Y_i(1) + (1 - D_i) Y_i(0) = \begin{cases} Y_i(1) & \text{si } D_i = 1 \\ Y_i(0) & \text{si } D_i = 0 \end{cases} \quad (2.2)$$

Si nos concentramos en las unidades tratadas, en la Ecuación 2.1, el término  $Y_i(0) = (Y_i|D_i = 0)$  representa la situación contrafactual, es decir *cuál habría sido el resultado si la unidad no hubiera participado en el programa*. Al ser imposible observar directamente el contrafactual, es necesario **estimarlos**.

La forma más directa de solucionar este problema sería hallando un “clon perfecto” para cada uno de los individuos beneficiarios del programa pero que no lo hayan recibido, lo cual resulta bastante complicado. Por lo tanto, el primer paso para lograr esta estimación consiste en **desplazarse desde el nivel individual al nivel del grupo** [4], concentrando el análisis en el **impacto** o **efecto promedio**.

En primera instancia, se puede estimar el **impacto promedio del programa sobre la población** (o *ATE*, del inglés *Average Treatment Effect*):

$$ATE = \mathbb{E}[Y_i(1) - Y_i(0)] \quad (2.3)$$

donde el operador  $\mathbb{E}$  representa la esperanza de una variable aleatoria.

El *ATE* se interpreta como el cambio promedio en la variable de resultado cuando un individuo escogido al azar pasa aleatoriamente de ser participante a ser no participante [1], es decir representa el efecto esperado del tratamiento si toda la población recibiera el tratamiento.

Sin embargo, en la mayoría de los casos, el tratamiento solo está disponible para un subconjunto de la población, ya sea por restricciones presupuestarias o criterios de elegibilidad, entre otras razones. Además, también ocurre que no todos los que fueron seleccionados para recibirlo efectivamente participan. Es por esto que suele ser más relevante estimar el efecto únicamente en quienes efectivamente recibieron el tratamiento.

Por lo tanto, se define el **impacto promedio del programa sobre los tratados** (o *ATT*, del inglés *Average Treatment Effect on the Treated*), que es en general el parámetro de mayor interés en una evaluación de impacto, y representa el efecto esperado del tratamiento en el subconjunto de individuos que fueron efectivamente tratados:

$$ATT = \mathbb{E}[Y_i(1) - Y_i(0)|D_i = 1] = \mathbb{E}[Y_i(1)|D_i = 1] - \mathbb{E}[Y_i(0)|D_i = 1] \quad (2.4)$$

Es decir, el *ATT* es la diferencia entre la media de la variable de resultado en el grupo de los participantes y la media que hubieran obtenido los participantes si el programa no hubiera existido [1]. Ahora bien, ¿cómo podemos intentar estimar esta última situación?

### 2.1.3. El Grupo de Control como Estimador del Contrafactual

En la ecuación 2.4, el término  $\mathbb{E}[Y_i(1)|D_i = 1]$  es un resultado observable mientras que  $\mathbb{E}[Y_i(0)|D_i = 1]$  es el promedio contrafactual que debemos aproximar. Para lograrlo, se construye lo que se conoce como **grupo de control** o **de comparación**, formado por individuos que no participan del programa pero que, idealmente, son estadísticamente similares [4] al **grupo de tratamiento**, compuesto por quienes sí recibieron el programa. La Figura 2.1 ilustra esta distinción. A partir de ahora, denotaremos con  $C_i$  a un individuo  $i$  que pertenezca al grupo de control.

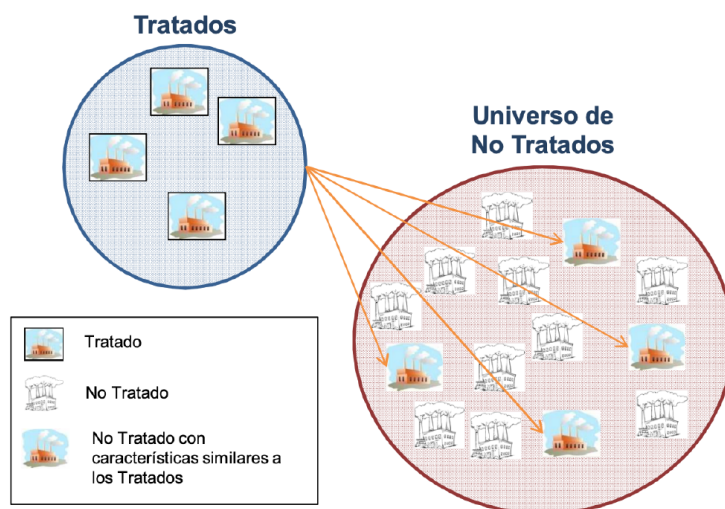


Figura 2.1: El grupo de control debería estar formado idealmente por individuos que no recibieron el tratamiento pero que en promedio poseen características similares a los tratados.

Por lo tanto, en la práctica, para obtener una buena estimación del *ATT*, el reto está en definir un *buen* grupo de control, es decir uno que sea estadísticamente idéntico al de

tratamiento, en promedio, en ausencia del programa [4]. Si se lograra que los dos grupos sean idénticos, con la única excepción que un grupo participa del programa y el otro no, entonces sería posible estar seguros que cualquier diferencia en los resultados tiene que deberse al programa [4].

Para que un grupo de comparación sea válido, debe satisfacer lo siguiente [4]:

- Las características *promedio* del grupo de tratamiento y del grupo de comparación deben ser idénticas en ausencia del programa. Cabe resaltar que no es necesario que las unidades individuales en el grupo de tratamiento tengan clones perfectos en el grupo de control.
- No debe ser afectado por el tratamiento de forma directa ni indirecta.
- El grupo de comparación debería reaccionar de la misma manera que el grupo de tratamiento si fuera objeto del programa.

Cuando el grupo de comparación no produce una estimación precisa del contrafactual, no se puede establecer el verdadero impacto del programa. A continuación, se presentan dos situaciones en las que esto ocurre.

### Comparaciones antes-después

Este tipo de comparaciones intenta establecer el impacto de un programa a partir de un seguimiento de los cambios en los resultados en los participantes del programa a lo largo del tiempo. Consideran el contrafactual como el resultado para el grupo de tratamiento antes que comience la intervención, momento también conocido como **línea de base**. Si bien una ventaja de este método es que no es necesario contar con una grupo de control, esta comparación supone que si el programa no hubiera existido, el resultado para los participantes del programa habría sido igual a su situación antes del programa, lo cual en la mayoría de los tratamientos no puede sostenerse [4].

### Comparaciones de inscritos y no inscritos: Sesgo de autoselección

Como explicamos anteriormente, el término  $\mathbb{E}[Y_i(0)|D_i = 1]$  de la Ecuación 2.4 representa el contrafactual, que no es observable. Sin embargo, lo que sí se puede medir es la variable de resultado entre los no inscritos, aquellos individuos que no participaron del programa, es decir  $\mathbb{E}[Y_i(0)|D_i = 0]$ .

Por lo tanto, podríamos tomar a todo el conjunto de los no participantes como grupo de control y solucionar el problema del contrafactual utilizando  $\mathbb{E}[Y_i(0)|D_i = 0]$  como estimador, es decir podríamos asumir lo siguiente:

$$\mathbb{E}[Y_i(0)|D_i = 1] = \mathbb{E}[Y_i(0)|D_i = 0] \quad (2.5)$$



Esto quiere decir que el valor esperado de la variable de resultado en ausencia del programa ( $\mathbb{E}[Y_i(0)]$ ) es idéntico para el grupo de tratados ( $D_i = 1$ ) y para el de no tratados ( $D_i = 0$ ). Indica que los individuos que participan en el programa no son sistemáticamente distintos de los que no lo hacen [1] o, en otras palabras, que la decisión de participar en el programa no está determinada por factores que también influyen en la variable de resultado.

De esta forma, podríamos calcular el  $ATT$  como:

$$ATT = \mathbb{E}[Y_i(1)|D_i = 1] - \mathbb{E}[Y_i(0)|D_i = 0] \quad (2.6)$$

Sin embargo, el supuesto de la Ecuación 2.5 se viola toda vez que la participación en el programa es una *elección* del individuo elegible [1]. La razón es que los participantes y los no participantes generalmente son diferentes, aún en ausencia del programa, y son justamente esas diferencias que llevan a que algunos individuos escojan participar y otros no. Por lo tanto, si en estos casos se toma como grupo de control a todos aquellos que no decidieron participar y se mide el impacto con respecto a ellos, puede ocurrir que la diferencia en los resultados se deba a características propias de los individuos que llevaron a unos a anotarse y a otros no.

El problema descrito se conoce como **sesgo de autoselección**, ya que los integrantes del grupo de control se *autoseleccionaron* para no participar del programa. Más concretamente, este sesgo se produce cuando los motivos por los que un individuo participa en un programa, usualmente no observables y difíciles de medir, están correlacionados con los resultados [4], y por ende, es muy probable que la variable de resultado del grupo de tratamiento y del grupo de control sean diferentes, *aún si el programa no existiera* [1]. Intuitivamente, si hay variables que explican tanto la participación como el resultado potencial, la comparación de medias puede estar atribuyendo al programa un efecto que en realidad se debe a las diferencias preexistentes entre el grupo de tratamiento y el grupo de control [1].

Un buen ejemplo de esta situación lo presenta [1], en el que se plantea un programa de nutrición infantil. Podría ocurrir por ejemplo que las madres de familias participantes del programa sean más proactivas respecto al desarrollo de sus hijos, por lo cual se preocuparon en lograr la participación en el programa. El problema de autoselección en este caso radica en que la motivación de las madres (que no se observa y es difícil de medir) afecta no solo la probabilidad de participar en el programa, sino también el estado nutricional de los niños ya que estas podrían vigilar mejor la dieta de sus hijos. De esta forma, la diferencia observada en el estado nutricional de los niños de los dos grupos podría deberse parcialmente a la diferencia en el nivel de compromiso de las madres, y no exclusivamente a que un grupo participa en el programa y el otro no.

Podemos plantear este problema más formalmente. Notemos que podemos reescribir la fórmula del  $ATT$  (2.4) de la siguiente manera:

$$ATT + \mathbb{E}[Y_i(0)|D_i = 1] = \mathbb{E}[Y_i(1)|D_i = 1] \quad (2.7)$$

Si ahora restamos  $\mathbb{E}[Y_i(0)|D_i = 0]$  a ambos lados, obtenemos:

$$ATT + (\mathbb{E}[Y_i(0)|D_i = 1] - \mathbb{E}[Y_i(0)|D_i = 0]) = \mathbb{E}[Y_i(1)|D_i = 1] - \mathbb{E}[Y_i(0)|D_i = 0] \quad (2.8)$$

De esta forma, es claro que si los individuos del grupo de tratamiento y el grupo de control son diferentes, aún en ausencia del tratamiento ( $\mathbb{E}[Y_i(0)|D_i = 1] - \mathbb{E}[Y_i(0)|D_i = 0] \neq 0$ ), entonces la diferencia entre la media del grupo de tratamiento y la media del grupo de control (el lado derecho de la igualdad) será igual al  $ATT$  más la diferencia preexistente entre los grupos [1]. Es decir, esta comparación de medias será una combinación del efecto directo del tratamiento, capturado en el  $ATT$ , y las diferencias preexistentes, y sin información adicional, no es posible distinguir qué parte se debe a qué [1].

Dicho esto, el gran desafío de la evaluación de impacto es determinar las condiciones o supuestos bajo los cuales  $\mathbb{E}[Y_i(0)|D_i = 0]$  se puede utilizar como una estimación válida del contrafactual  $\mathbb{E}[Y_i(0)|D_i = 1]$  [1], y por lo tanto utilizarse para poder aproximar el valor del  $ATT$ . Asegurarse de que el impacto estimado esté libre de sesgo de autoselección es uno de los principales objetivos de cualquier evaluación de impacto, y plantea importantes dificultades [4].

Es importante en este punto identificar claramente las comparaciones que hemos mencionado hasta el momento, los cuales se encuentran en la Tabla 2.1.

<b>Lo que se desea medir:</b> el $ATT$ .	$\mathbb{E}[Y_i(1) - Y_i(0) D_i = 1]$
<b>Lo que se observa:</b> el promedio de la diferencia entre los resultados de los tratados y el grupo de control.	$\mathbb{E}[Y_i(1) - C_i(0)]$
<b>El sesgo de autoselección:</b> las diferencias preexistentes que pueden existir entre el grupo de tratamiento y el de control.	$\mathbb{E}[C_i(0) - Y_i(0)]$

Tabla 2.1: Distinción entre las diferentes comparaciones presentes en una evaluación de impacto.

Teniendo en cuenta las fórmulas expuestas la Tabla 2.1, podemos enunciar de otra forma lo que dijimos anteriormente: la calidad de una evaluación de impacto dependerá de los supuestos necesarios para asegurar que no hay sesgo de selección, es decir que  $\mathbb{E}[C_i(0) - Y_i(0)] = 0$ .

Las reglas de un programa para seleccionar a los participantes beneficiarios, también llamadas **reglas de asignación**, constituyen el parámetro clave para determinar el método de evaluación de impacto a utilizar para dicho tratamiento. A continuación, presentamos las distintas reglas y los métodos de evaluación que se utilizan en la práctica al trabajar con cada una de ellas.

### 2.1.4. Evaluaciones Experimentales o Aleatorias

Este tipo de evaluaciones se utiliza cuando los beneficiarios del programa en cuestión son seleccionados de manera completamente aleatoria<sup>1</sup>. Este tipo de tratamientos también son llamados ensayos controlados aleatorios. La asignación aleatoria se considera la regla de oro de la evaluación de impacto ya que no solo proporciona a los administradores del programa una regla imparcial y transparente para asignar recursos escasos entre poblaciones igualmente merecedoras de ellos, sino que también representa el método más sólido para evaluar el impacto de un programa [4].

La asignación aleatoria trae dos consecuencias importantes: por un lado, las unidades ya no pueden *elegir* si participar o no, lo cual **elimina el sesgo de autoselección**, y por el otro, todas tienen la misma probabilidad de ser seleccionadas para el programa. De esta forma, el resultado potencial de cada individuo es independiente de sus condiciones previas, ya que la asignación al tratamiento no está determinada por sus características, sino por el azar.

Como explicamos anteriormente, el grupo de comparación ideal sería lo más similar posible al grupo de tratamiento en todos los sentidos, excepto con respecto a su participación en el programa que se evalúa. Ahora bien, el proceso de asignación aleatoria producirá dos grupos que tienen una alta probabilidad de ser estadísticamente idénticos en todas sus características (observables y no observables), siempre que el número de unidades sea suficientemente grande [4]. Esto es así ya que en general, si esto ocurre, este mecanismo asegura que cualquier rasgo de la población se transfiere a ambos grupos. Sin embargo, en la práctica, este supuesto debería comprobarse empíricamente con los datos de línea de base de ambos grupos.

Dicho esto, lo que ocurre en estos casos es que todos aquellos individuos que no resultaron ser beneficiarios del programa conforman un grupo de control que resulta ser naturalmente un excelente estimador del contrafactual  $\mathbb{E}[Y_i(0)|D_i = 1]$ . Es decir, mediante este tipo de asignación, se asegura que se cumple el supuesto de la Ecuación 2.5.

Una vez que se haya asignado el tratamiento de manera aleatoria, gracias a la eliminación del sesgo de autoselección y el consecuente cumplimiento de 2.5, es bastante sencillo estimar el impacto del programa. Después de que el programa ha funcionado durante un tiempo, tendrán que medirse los resultados de las unidades de tratamiento y de comparación. El impacto del programa es sencillamente la diferencia entre el resultado promedio para el grupo de tratamiento y el resultado promedio para el grupo de comparación, es decir:

$$ATT = \mathbb{E}[Y_i(1)|D_i = 1] - \mathbb{E}[Y_i(0)|D_i = 0]$$

---

<sup>1</sup>Cabe aclarar que la asignación aleatoria se produce dentro de la población de unidades elegibles, que está compuesta por aquellos individuos para los cuales interesa conocer el impacto del programa [4]. Por ejemplo, si se está implementando un programa de formación para los maestros de escuela primaria en zonas rurales, los maestros de escuela primaria de zonas urbanas o los profesores de secundaria no formarían parte del conjunto de unidades elegibles [4].

La asignación aleatoria puede utilizarse como regla de asignación de un programa en dos escenarios específicos: cuando la población elegible es mayor que el número de plazas disponibles del programa, o cuando sea necesario ampliar un programa de manera progresiva hasta que cubra a toda la población elegible [4]. Además, la asignación aleatoria podría hacerse a nivel individual (por ejemplo, a nivel de hogares), o a nivel de conglomerado (por ejemplo, comunidades) [1].

Resulta claro que las evaluaciones experimentales tienen varias ventajas: por diseño, al quitarles la posibilidad de elección a los individuos sobre si participar o no en el programa, resuelven el problema del sesgo de selección, y además los resultados obtenidos son transparentes, intuitivos y no es necesario utilizar herramientas econométricas sofisticadas para alcanzarlos [1]. Esto hace que contribuyan a la transparencia de las políticas públicas y a la rendición de cuentas [1].

Sin embargo, este tipo de experimentos sufre varias limitaciones que hace que no sea tan común en la práctica. Por un lado, pueden ser costosos y de difícil implementación [1]. Esto se debe a que en general, el ensayo aleatorio se hace específicamente para evaluar una intervención, por lo que es necesario destinar recursos para la prueba piloto, la recolección de información, los seguimientos, y a veces incluso la implementación del programa [1]. Otro problema que tienen, y probablemente el más importante, es que por pertenecer al grupo de control, se *excluye* a un segmento de la población, igualmente vulnerable y elegible, de los beneficios de la intervención [1]. Además, dada la imposibilidad de negar los beneficios a un grupo de control por largos períodos, con frecuencia es imposible estimar los impactos de largo plazo [1].

### 2.1.5. Evaluaciones Cuasi-experimentales

Cuando la asignación aleatoria de los participantes no es factible o plantea problemas éticos, se emplean las llamadas evaluaciones o técnicas cuasi-experimentales, que son aquellas que buscan estimar el impacto causal, pero a diferencia de las experimentales, no se basan en la asignación aleatoria de la intervención [4]. En estos casos, el programa que se intenta evaluar no tiene una regla de asignación clara que explique por qué ciertos individuos se inscribieron en el programa y otros no lo hicieron, por lo que se convierte en una incógnita adicional en la evaluación, acerca de la cual se deben formular supuestos [4]. Para ello, estos métodos intentan *simular* la aleatorización de un diseño experimental controlando las diferencias entre los individuos tratados y no tratados bajo diferentes hipótesis.

Si bien los métodos cuasi-experimentales suelen ser más adecuados en algunos contextos operativos, su desventaja es que requieren más condiciones para garantizar que el grupo de comparación provea una estimación válida del contrafactual, como veremos a continuación al profundizar en algunos de ellos.

### Diferencias en Diferencias

El modelo de diferencias-en-diferencias (DD) es una manera de controlar la estimación del impacto por las diferencias preexistentes entre el grupo de tratamiento y el de control, que estará formado por todos aquellos individuos elegibles que no recibieron el tratamiento. Es decir, el DD no propone una forma de construir un grupo de control adecuado sino una manera de aproximar el impacto que tenga en cuenta las diferencias entre participantes y no participantes. A grandes rasgos, combina las comparaciones antes-después con las comparaciones de inscritos y no inscritos, ambas discutidas anteriormente.

Dada una variable de resultado  $Y$ , este modelo establece el impacto como el cambio esperado en  $Y$  entre el período posterior y el período anterior a la implementación del tratamiento en el grupo de tratamiento, menos la diferencia esperada en  $Y$  en el grupo de control en el mismo período [1]. Es decir, **compara los cambios en los resultados a lo largo del tiempo** entre unidades participantes y no participantes.

Si denotamos con  $Y^{(1)}$  al valor de la variable  $Y$  en la línea de base, es decir justo antes de la implementación del programa, y con  $Y^{(2)}$  al valor de la misma variable en una período posterior a la implementación (también llamado período de seguimiento), entonces el impacto del programa por el método de DD estaría dado por:

$$ATT_{DD} = (\mathbb{E}[Y^{(2)}|D=1] - \mathbb{E}[Y^{(1)}|D=1]) - (\mathbb{E}[Y^{(2)}|D=0] - \mathbb{E}[Y^{(1)}|D=0]) \quad (2.9)$$

Es importante señalar que el contrafactual que se estima en este caso es el cambio en los resultados del grupo de tratamiento, y su estimación se logra midiendo el cambio en los resultados del grupo de comparación [4]. En lugar de contrastar los resultados entre los grupos de tratamiento y comparación después de la intervención, la técnica de DD estudia las *tendencias* entre los grupos de tratamiento y comparación [4].

Como explicamos con anterioridad, el principal problema de las comparaciones antes-después en el grupo de tratamiento es que se asume que lo único que hizo cambiar la variable de resultado fue el programa, cuando en realidad puede haber sido por factores externos. El DD busca solucionar este problema basándose en la idea que la diferencia en los resultados antes-después para el grupo de tratamiento controla por factores que son constantes a lo largo del tiempo en ese grupo, y la manera de capturar los factores variables en el tiempo es medir el cambio antes-después en los resultados de un grupo que no se inscribió en el programa pero que estuvo expuesto al mismo conjunto de condiciones ambientales. De esta forma, si se “limpia” la primera diferencia de otros factores variables en el tiempo que influyen en el resultado de interés sustrayendo la segunda diferencia, se habrá eliminado una fuente de sesgo [4].

Por otro lado, en las comparaciones de inscritos y no inscritos, el gran inconveniente era el sesgo de autoselección. Para entender mejor la solución que el DD propone a esto,

resulta conveniente reescribir el estimador como:

$$ATT_{DD} = (\mathbb{E}[Y^{(2)}|D=1] - \mathbb{E}[Y^{(2)}|D=0]) - (\mathbb{E}[Y^{(1)}|D=1] - \mathbb{E}[Y^{(1)}|D=0]) \quad (2.10)$$

De la Ecuación 2.10 se puede ver que lo que plantea es restarle al cambio visto en la variable entre tratados y no tratados luego de la implementación del programa ( $Y^{(2)}$ ), las diferencias que ya pueda haber habido entre ellos en la línea de base ( $Y^{(1)}$ ). Es decir, desde este punto de vista, se utiliza a  $\mathbb{E}[Y^{(1)}|D=1] - \mathbb{E}[Y^{(1)}|D=0]$  como un estimador de las diferencias preexistentes entre el grupo de tratamiento y el grupo de control.

Ahora bien, volviendo a la Ecuación 2.9, el supuesto que permite utilizar la diferencia en el grupo de no inscritos para controlar los factores externos que afectan a los inscritos es que, en ausencia del programa, dichos factores habrían impactado a los tratados de la misma manera que a los no tratados. En otras palabras, se asume que, sin la intervención, los resultados en el grupo tratado habrían evolucionado en paralelo con los del grupo de control, aumentando o disminuyendo en la misma proporción. Esto se conoce como **supuesto de tendencias paralelas**, y es sobre el que hay que basarse al trabajar con este método ya que claramente no es posible observar qué habría ocurrido con el grupo tratado en ausencia del programa.

### Propensity Score Matching

Otro enfoque para lograr una buena aproximación del contrafactual consiste en construir un grupo de comparación artificial, a partir del conjunto de individuos que no recibieron el tratamiento. En esto se basa el método conocido como **pareamiento** o **emparejamiento**, que utiliza técnicas estadísticas y grandes bases de datos para construir el mejor grupo de comparación posible sobre la base de características observables [4]. La principal utilidad de este método es que puede aplicarse en el contexto de casi todas las reglas de asignación de un programa, siempre que se cuente con un grupo que no haya participado en el mismo [4].

El supuesto que utilizan estas técnicas para basarse en características observables al construir el grupo de control es que tanto la participación en el programa como los resultados potenciales están únicamente determinados por estas. O, en otras palabras que no están determinados por variables no observables (o no medidas).

De esta forma, se asume que al condicionar los resultados potenciales de tratados y no tratados en determinadas características observables (pertinentes en el programa bajo estudio), el sesgo de autoselección es igual a cero. Formalmente, si denotamos con  $X$  a los rasgos observables que se están teniendo en cuenta, este supuesto se escribe de la siguiente forma:

$$\mathbb{E}[Y_i(0)|D_i=1, X] = \mathbb{E}[Y_i(0)|D_i=0, X], \quad (2.11)$$

y se lo conoce como **supuesto de Independencia Condicional (IC)**.

Con esto en mente, la versión más directa de esta metodología consiste en encontrar un

“clon” para cada individuo tratado en el grupo de no tratados y contrastar las variables de resultado de ambos [1]. Un clon en este caso quiere decir, una vez fijadas las características que el investigador cree que explican la decisión de inscribirse en el programa, un individuo (o grupo de individuos) con exactamente las mismas características observables  $X$ .

Sin embargo, como mencionamos anteriormente, en la práctica esto resulta difícil. Si la lista de características observables relevantes es muy grande, o si cada característica adopta muchos valores, puede resultar computacionalmente complejo identificar una pareja para cada una de las unidades del grupo de tratamiento. Esta situación es conocida como *el problema de la dimensionalidad*.

Esta situación puede solucionarse utilizando un método denominado **Pareamiento por Puntajes de Propensión** (*Propensity Score Matching*, PSM), presentado por primera vez en 1983 en [16]. Consiste en emparejar individuos ya no con base en  $X$ , sino en su probabilidad estimada de participación en el programa, dadas sus características observables, es decir en:

$$P(X) = P(D = 1|X)$$

donde  $P$  denota el operador de probabilidad de un evento. Este valor es conocido como **probabilidad de participación o puntaje de propensión**.

De esta forma, el clon adecuado para cada individuo del grupo de tratamiento será aquel del grupo de no tratados con una probabilidad de participación en el programa suficientemente cercana [1]. La ventaja de emparejar a partir de  $P(X)$ , a diferencia de  $X$ , es que  $P(X)$  es un número, mientras que  $X$  puede tener una dimensión muy grande [1]. Cabe aclarar que para calcular este puntaje, solo deberían utilizarse las características en la línea de base, ya que post-tratamiento, estas pueden haberse visto afectadas por el propio programa [4].

Ahora bien, puede surgir la siguiente pregunta: ¿es posible encontrar (al menos) una pareja para todos los individuos tratados? Y la respuesta es no, y para aquellos individuos no será posible estimar el impacto del programa. Lo que puede ocurrir en la práctica es que para algunas unidades inscritas, no haya unidades en el conjunto de no inscritos que tengan puntajes de propensión similares. En términos técnicos, puede que se produzca una falta de **rango o soporte común**.

La condición de soporte común (SC) establece que individuos con el mismo vector de variables  $X$  tienen probabilidad positiva de ser tanto participantes como no participantes del programa [1]. Esto es, fijado un vector de variables  $\hat{X}$ :

$$0 < P(D = 1|\hat{X}) < 1$$

Si esta condición no se cumple, sería posible encontrar una combinación particular de características que predice perfectamente la participación en el programa, y por tanto, no existiría un individuo que fuera un buen control (o viceversa) [1].

El SC implica que solo se utilizarán en la estimación aquellos individuos tratados para los cuales se pueda encontrar uno no tratado con un puntaje de propensión similar.

Por ejemplo, si existen individuos del grupo de tratamiento con una probabilidad de participación muy alta, pero ningún individuo no participante exhibe un puntaje tan alto, entonces estos individuos tratados se descartarán a la hora de hacer el emparejamiento.

Asumiendo que se cumplen las condiciones de IC y SC, el estimador del *ATT* por PSM estaría dado por:

$$ATT_{PSM} = \mathbb{E}_{P(X)|D=1} \{ \mathbb{E}[Y(1)|D=1, P(X)] - \mathbb{E}[Y(0)|D=0, P(X)] \} \quad (2.12)$$

donde  $\mathbb{E}_{P(X)|D=1}$  es el valor esperado con respecto a la probabilidad de participación  $P(X)$ , condicional en ser participante del programa [1]. Es decir, un promedio ponderado de las diferencias entre llaves, donde los ponderadores son funciones de la probabilidad de participación en el programa [1].

Los pasos a seguir a la hora de aplicar la técnica de PSM se pueden resumir en los siguientes puntos:

1. Identificar las unidades que se inscribieron en el programa y las que no lo hicieron.
2. Definir el conjunto de variables observables  $X$  que se utilizarán para calcular el puntaje de propensión  $P(X)$ .
3. Calcular el puntaje de propensión  $P(X)$  para cada individuo, tratados y no tratados.
4. Restringir la muestra al soporte común con respecto a la distribución del puntaje de propensión.
5. Seleccionar un algoritmo de emparejamiento para emparejar a cada individuo tratado con un individuo o grupo de individuos no tratados que tenga una probabilidad de participación similar.
6. Se calcula el impacto del programa como el promedio apropiadamente ponderado de la diferencia entre la variable de resultado de los tratados y sus parejas no tratadas (Ecuación 2.12).

A continuación, se explican brevemente algunos de estos pasos.

En cuanto a la elección de variables (paso **2**) que se incluirán para calcular el puntaje de propensión, si bien es importante poder parear utilizando un gran número de características, lo es más aún hacerlo sobre la base de aquellas que **determinan la inscripción** [4]. En términos estadísticos, estas características reciben el nombre de **covariables**, **variables independientes** o **variables explicativas**, y son justamente aquellas que posiblemente predicen el resultado bajo estudio.

Cuanto más se comprenda acerca de los criterios utilizados para la selección de los participantes, en mejores condiciones se estará de construir un buen grupo de comparación [4]. Para tener una mejor comprensión, los investigadores se pueden guiar por los



modelos económicos que describen el fenómeno bajo estudio, investigaciones previas y conocimiento del diseño institucional [1]. Además, como dijimos anteriormente, estas características deben ser medidas en la línea de base, y no una vez aplicado el programa, ya que se pueden haber visto afectadas por el mismo.

Con respecto al cálculo del puntaje de propensión (paso **3**), la idea es especificar un modelo  $P(D = 1|X) = f(X)$ , es decir, la probabilidad de participación como una función que puede ser lineal o no lineal en las características observables de los individuos,  $X$  [1]. Con frecuencia se prefieren los modelos de regresión logística (*logit*) o de probabilidad (*probit*) [1]. En este trabajo, utilizaremos la regresión logística, por lo que resulta conveniente saber de qué se trata.

En lo que refiere al algoritmo de emparejamiento, estos suelen establecer tanto la manera en que se encuentra el individuo (o grupo de individuos) parecido a un tratamiento como así también la manera en que se pondera la diferencia a la hora de hacer la comparación. También se los llama estimadores ya que en fin, determinar una forma de estimar el *ATT*.

Uno de los más usados y más simples de entender es el de vecino más cercano (o *NN matching*, por su sigla en inglés, *nearest neighbor*) [1]. En el *NN matching*, una opción es emparejar cada individuo de tratamiento con aquel del grupo de no tratados que tenga la probabilidad de participación más cercana. Es decir, la unidad no tratada tal que la distancia entre su puntaje y el del individuo tratado sea mínima. En este caso, una vez que se haya emparejado a cada individuo tratado, el *ATT* se calcula como el promedio simple de las diferencias entre las variables de resultado en cada pareja.

Otra opción es dado un individuo tratado, tomar los  $k$  vecinos más cercanos del grupo de no tratados con respecto al puntaje de propensión estimado, y estos formarán el grupo de comparación para el tratado. Aquí, para calcular el impacto del programa, se puede dar igual peso a cada uno de los  $k$  vecinos, en cuyo caso el impacto para una unidad tratada estará dada por la diferencia entre la variable observada de ella y el promedio simple de las variables de resultado de los vecinos cercanos [1]. Otra alternativa es hacer un promedio ponderado de las observaciones de los vecinos, según qué tan comparable es cada vecino: así, el valor de la variable de resultado de un vecino más cercano tiene más peso que el de uno no tan cercano.

Existen algunas cuestiones a tener en cuenta al utilizar este algoritmo, como puede ser el hecho que la diferencia de puntajes entre un tratado y su vecino más cercano no sea lo suficientemente pequeña como para asegurar que ambos son muy parecidos, y aún así la diferencia entre sus variables de resultado contribuirá al cálculo del *ATT*.

Otros algoritmos utilizados para el emparejamiento son los de *kernel* y regresión lineal local. Estos son estimadores no paramétricos que emparejan a cada individuo del grupo de tratamiento con un promedio ponderado de (potencialmente) todos los individuos del grupo de control [1]. En principio, con estos, se puede comparar a cada individuo de tratamiento con todos los no tratados, y darles menos peso en la comparación a aquellos con probabilidades de participación más lejanas [1]. Una ventaja de ellos es que tienen

menor varianza a la hora de calcular las diferencias individuales (que vecino más cercano por ejemplo) porque usan más información [1]. Para más detalles sobre cada uno de estos, se puede consultar el Capítulo 6 de [1].

Una evaluación en la que se utilizó la técnica de PSM, particularmente con el algoritmo del vecino más cercano, fue la llevada a cabo a partir del año 2021 por la Unidad de Evaluación Integral de la Calidad y Equidad Educativa de la Ciudad Autónoma de Buenos Aires (CABA) sobre el impacto del programa “Jornada Extendida” en el clima escolar [15], aplicado sobre diferentes escuelas primarias de la ciudad. El PSM fue empleado para seleccionar las escuelas del grupo de control en base a tres características: el ISSAP (Índice de Situación Socioeconómica de los/as Alumnos/as en Escuelas Primarias), la tasa de sobreedad y la tasa de repitencia.

Como mencionamos anteriormente, la gran ventaja del método de PSM es que es flexible, pudiéndose utilizar en numerosos contextos, independientemente de la regla de asignación de un programa, por lo que se emplea con frecuencia [1].

Sin embargo, es muy importante notar que los resultados arrojados por el PSM serán confiables solamente si se cumple el supuesto de IC. Es decir, cuando existan razones para pensar que las variables no observables o no disponibles en la base de datos no son un determinante fundamental tanto de la participación en el programa como de las variables de resultado potenciales. En otros términos, cuando no haya diferencias sistemáticas en las características no observables entre las unidades tratadas y las de comparación pareadas que puedan influir en el resultado.

Cabe aclarar que el supuesto de IC no puede ser demostrado, ya que no se puede verificar si lo no observado afecta o no la decisión de participación, pero su plausibilidad puede ser argumentada basándose en el conocimiento sustantivo del área de estudio. Otra alternativa que se lleva a cabo en la práctica es calcular las diferencias en las variables observables  $X$ ; si los dos grupos son demasiados diferentes en estas, esto podría ser evidencia de que es probable que también existan diferencias entre los dos grupos en características no observadas [1].

Por otro lado, si bien el cálculo del  $ATT$  se puede restringir a aquellos individuos que se encuentra en la región de soporte común entre tratados y no tratados, esta restricción puede volverse preocupante cuando hay una fracción importante de individuos tratados que quedan sin emparejar. Esto implica que existirá un conjunto de individuos para el cual no se puede decir nada acerca del efecto del programa [1].

En este trabajo, utilizaremos el PSM con el algoritmo de [*nombre del algoritmo*] como referencia para compararlo con nuestro enfoque, lo cual se explicará con más detalle en la sección 3.

A continuación, introducimos el área de Inteligencia Artificial, dentro de la cual se enmarcan los algoritmos propuestos en este trabajo.

## 2.2. Inteligencia Artificial

La definición más general acerca de la Inteligencia Artificial (IA) establece que es el área de las Ciencias de la Computación que se enfoca tanto en entender como en crear sistemas que simulen comportamientos *inteligentes*. Si bien existen distintas perspectivas sobre qué significa que una computadora actúe de manera inteligente, la que más ha prevalecido a lo largo de los años es aquella que refiere con la capacidad de computar cómo actuar de la mejor manera posible en una determinada situación [20].

En sus comienzos, los métodos desarrollados en el área de la IA estaban principalmente **basados en conocimiento**, es decir reglas matemáticas formales que permitían a las computadoras llevar a cabo inferencias lógicas y de esta forma resolver problemas que eran intelectualmente difíciles para los humanos [5].

Sin embargo, determinar reglas que describan la complejidad y diversidad de la realidad no era una tarea fácil. De esta manera, con el objetivo de hacer a estos sistemas más flexibles y capaces de adaptarse y entender diferentes situaciones, se transicionó hacia un enfoque en el que estos pudieran obtener su propio conocimiento aprendiendo patrones directamente a partir de los datos en lugar de depender exclusivamente de reglas predefinidas.

Este cambio de paradigma dio lugar a lo que hoy se conoce como **Aprendizaje Automático**, la subdisciplina de la IA que permite a los algoritmos mejorar su desempeño en una tarea específica automáticamente a partir de la experiencia. Diversos factores como la creciente disponibilidad de datos, el aumento en la capacidad computacional, y los avances en los algoritmos de optimización [5] han hecho que esta área sea la que mayor desarrollo e impacto ha tenido durante las últimas décadas.

Actualmente, la IA abarca una diversidad de tareas, que van desde lo general, como son las habilidades de aprendizaje, razonamiento, y percepción, entre otras; hasta lo específico, como probar teoremas matemáticos, manejar vehículos, mejorar procesos industriales o incluso diagnosticar enfermedades.

### 2.2.1. Aprendizaje Automático

El Aprendizaje Automático, más conocido por su nombre en inglés *Machine Learning* (ML), es un campo dentro de la IA cuyo objetivo es desarrollar técnicas que permitan que las computadoras *aprendan* automáticamente a partir de la *experiencia* - los datos -, sin la necesidad de ser explícitamente programadas para hacerlo.

Un ejemplo de estos algoritmos puede ser un clasificador de correo spam, que aprende a distinguir correos spam de regulares viendo ejemplos de cada tipo de correo. Otro ejemplo puede ser un sistema que aprenda a predecir la edad de una persona a partir de una imagen habiendo experimentado previamente algunos ejemplos de imagen-edad.

En 1997, Tom Mitchell definió en su libro *Machine Learning* [11] el concepto de “aprender” de la siguiente manera: “Se dice que un programa de computadora aprende de la

experiencia  $E$  con respecto a una clase de tareas  $T$  y una medida de desempeño  $P$ , si su desempeño en las tareas de  $T$ , medido por  $P$ , mejora con la experiencia  $E$ ". Para tener un mejor entendimiento, nos enfocamos a continuación en cada uno de estos tres componentes.

Las tareas de ML se describen usualmente en términos de cómo el sistema debería procesar un *ejemplo* o *entrada*, entendiendo a esta como un conjunto de características (o en inglés, *features*) medidas cuantitativamente a partir de un cierto objeto o evento [5]. Por ejemplo, una entrada puede estar compuesta por los datos de un hogar, como la cantidad de habitaciones y de baños, si tiene patio o no, el tamaño de la cocina, etcétera. Dentro de las tareas que pueden ser resueltas por un sistema de ML se encuentran la clasificación, la regresión, la traducción, la detección de objetos en imágenes, la generación de nuevos datos, la detección de valores atípicos, entre muchas otras. Siguiendo con el ejemplo, podríamos querer que, en base a las features de las casa, el sistema nos provea un estimado de su valor.

La experiencia hace referencia al tipo de información que el algoritmo "puede ver" durante su proceso de aprendizaje o *entrenamiento* [3]. A esta información se la conoce como "conjunto (de datos) de entrenamiento", y es un subconjunto del *dataset*, que es simplemente el conjunto de todos los ejemplos o datos con los que se cuenta. En base a la experiencia, los algoritmos de ML se clasifican en dos grandes categorías:

- **Algoritmos de Aprendizaje Supervisado:** experimentan un dataset que contiene pares de entrada-salida, esto es cada ejemplo contiene sus características pero también su "etiqueta", que vendría a ser la "respuesta correcta" para dicha entrada, y la que se espera que el sistema aprenda. De esta forma, el algoritmo aprende una función que asigna (*mapea*) entradas a salidas. Las tareas más comunes llevadas a cabo con este tipo de aprendizaje son las de regresión, en donde la etiqueta corresponde a un valor continuo; y clasificación, en donde la solución viene dada por la categoría (dentro de un conjunto predefinido de categorías) a la que pertenece un ejemplo.
- **Algoritmos de Aprendizaje No Supervisado:** ven un dataset que cuenta solamente con features de cada entrada pero sin etiquetas, e intentan aprender automáticamente patrones y propiedades útiles de la estructura de los datos. Algunas tareas que se llevan a cabo con este tipo de aprendizaje son *clustering*, reducción de dimensionalidad, y detección de anomalías.

También existen otros tipos de algoritmos, como los de **Aprendizaje Semi-supervisado**, en donde el dataset contiene algunos ejemplos etiquetados y otros sin etiquetas; y los de **Aprendizaje por Refuerzo**, en donde el algoritmo aprende la mejor estrategia para una situación a partir de la interacción con su entorno en forma de recompensas y castigos.

Por último, para medir el desempeño de estos algoritmos, se definen métricas cuantitativas que dependen de la tarea que se esté realizando y del objetivo que se intente lograr.

Por ejemplo, en clasificación, una de las más comunes es la de exactitud (*accuracy*), que es la proporción de ejemplos para los cuales se predijo la salida correcta (dada por el dataset); aunque también existen otras como la precisión, sensibilidad, especificidad, y el puntaje F1, que pueden resultar más adecuadas según el dominio del problema. Por otro lado, en tareas de regresión, algunas métricas que se suelen utilizar son el Error Cuadrático Medio y el Error Absoluto Medio.

El objetivo fundamental del ML es que un algoritmo actúe correctamente ante nuevas entradas desconocidas, es decir que **generalice** más allá de los ejemplos del conjunto de entrenamiento. Por ello, aunque las métricas anteriores pueden calcularse durante el entrenamiento para verificar que el algoritmo esté mejorando, su verdadero desempeño se evalúa en un subconjunto del dataset distinto al de entrenamiento, denominado “conjunto de test”. Como buena práctica, este conjunto debe permanecer completamente separado del proceso de aprendizaje para obtener una estimación realista de la capacidad de generalización del algoritmo.

Habiendo presentado una idea general sobre cuál es el objetivo de los algoritmos de Aprendizaje Automático, ahora nos enfocaremos en los de Aprendizaje Supervisado, que son los que usaremos en este trabajo.

### 2.2.2. Aprendizaje Supervisado

Como mencionamos anteriormente, en el Aprendizaje Supervisado el algoritmo aprende de una función que mapea entradas a salidas a partir de un conjunto de entrenamiento compuesto por datos etiquetados. El objetivo es que al presentarle a esta función una nueva entrada no vista previamente, esta sea capaz de computar la salida que mejor se ajusta a los **patrones** aprendidos durante el entrenamiento.

Resulta conveniente introducir en este punto un término muy utilizado en el ML: **modelo**. Un modelo es simplemente una ecuación matemática, que se presenta como una forma simplificada de describir hechos de la realidad. En este contexto, será una manera de intentar capturar las relaciones entre los datos, con el objetivo de hacer predicciones basadas en los patrones aprendidos de ejemplos previos. En general, se suele utilizar la palabra modelo para referirse a la función de la que hablamos en el párrafo anterior.

Formalmente, una tarea de Aprendizaje Supervisado es la siguiente:

Dado un conjunto de entrenamiento de  $N$  ejemplos de entrada-salida:

$$(\mathbf{x}_1, \mathbf{y}_1), (\mathbf{x}_2, \mathbf{y}_2), \dots, (\mathbf{x}_N, \mathbf{y}_N)$$

donde cada  $\mathbf{x}_i$  es un vector de características ( $\mathbf{x}_i \in \mathbb{R}^n$  para algún  $n \in \mathbb{N}$ ) e  $\mathbf{y}_i$  es la salida correspondiente ( $\mathbf{y}_i \in \mathbb{R}^m$  para algún  $m \in \mathbb{N}$ ), y cada par fue

---

<sup>1</sup>Hablaremos de estas más adelante, dando sus fórmulas y lo que representan.

generado por una **función desconocida**  $\mathbf{y} = f(\mathbf{x})$ , descubrir una función  $h$  que aproxime a la función real  $f$  [20].

Denotaremos con  $\mathbf{X}$  al vector de entradas del conjunto de entrenamiento, y con  $\mathbf{Y}$  al vector de salidas, ambos de tamaño  $N$  y bien ordenados. Es decir:

$$\begin{aligned}\mathbf{X} &= (\mathbf{x}_1, \mathbf{x}_2, \dots, \mathbf{x}_N) \\ \mathbf{Y} &= (\mathbf{y}_1, \mathbf{y}_2, \dots, \mathbf{y}_N)\end{aligned}$$

De esta forma, el modelo es la función  $h$ , que toma un vector de entrada  $\mathbf{x}$  y devuelve una salida  $\mathbf{y}$ , y se presenta como una **hipótesis** de  $f$ . La suposición sobre la que se trabaja es que si el modelo funciona bien para los pares de entrenamiento, entonces se espera que va a realizar buenas predicciones para nuevas entradas cuya etiqueta se desconoce.

Ahora bien, esta función  $h$  se obtiene a partir de un **espacio de funciones**, que es elegido por quien diseña el modelo. Este espacio podría ser el conjunto de funciones lineales, de polinomios de grado 2, de polinomios de grado 3, etcétera. Por lo tanto, el espacio determina la forma o “**arquitectura**” que va a tener la función  $h$ , y consecuentemente cuáles son sus parámetros, cuyo vector denotaremos con la letra  $\mathbf{w}$ , y a los que también se suele llamar “**pesos**”. De esta forma, este espacio determina la familia de posibles relaciones entre entradas y salidas, y los parámetros especifican la relación particular (el modelo).

Por ejemplo, si suponemos que cada entrada  $\mathbf{x} \in \mathbb{R}$ , y establecemos como espacio el conjunto de funciones lineales, entonces la forma de  $h$  será:

$$h(\mathbf{x}) = w_1 \mathbf{x} + w_0$$

y sus parámetros  $\mathbf{w} = (w_0, w_1)$ . Este caso es comúnmente conocido como regresión lineal unidimensional (ya que la entrada es simplemente un número real). Dentro de este espacio, distintas asignaciones de valores a los parámetros generan distintos modelos. Por ejemplo, tomando la asignación  $\mathbf{w} = (13, 5)$ , tenemos el modelo  $h(x) = 5x + 13$ , y tomando  $\mathbf{w} = (1.25, \pi)$ ,  $h(\mathbf{x}) = \pi \mathbf{x} + 1.25$ , entre muchos otros.

En cambio, si tomamos el conjunto de polinomios de grado 2 y seguimos suponiendo  $\mathbf{x} \in \mathbb{R}$ , entonces la forma de  $h$  será:

$$h(\mathbf{x}) = w_2 \mathbf{x}^2 + w_1 \mathbf{x} + w_0$$

y sus parámetros  $\mathbf{w} = (w_0, w_1, w_2)$ . A este caso se lo suele llamar regresión polinómica de segundo grado unidimensional.

Otro caso un poco más “complejo” podría ser en el que  $\mathbf{x} \in \mathbb{R}^3$ , es decir  $\mathbf{x} = (x_1, x_2, x_3)$  y seguimos tomando una relación lineal. Aquí,  $h$  sería:

$$h(\mathbf{x}) = w_1 x_1 + w_2 x_2 + w_3 x_3 + w_0$$

y sus parámetros  $\mathbf{w} = (w_0, w_1, w_2, w_3)^2$ .

Notemos entonces que, fijado un espacio de funciones, quienes van a determinar qué modelo es “mejor” que otro en este espacio, es decir qué modelo aproxima mejor a  $f$ , son los valores de los parámetros  $w_i$ . Por lo tanto,  $h$  en realidad es una función de la entrada  $\mathbf{x}$  pero también de los parámetros, establecidos por el espacio de funciones elegido:

$$h(\mathbf{x}, \mathbf{w})$$

Y lo que queremos idealmente es hallar el vector de parámetros  $\mathbf{w}^*$  que hagan que el modelo resultante cumpla:

$$f(\mathbf{x}) \approx h(\mathbf{x}, \mathbf{w}^*)$$

para cada  $\mathbf{x}$  en el conjunto de entrenamiento.

Entonces, cuando un modelo se entrena o aprende, lo que realmente hace es intentar encontrar los valores de los parámetros que describan la verdadera relación entre entradas y salidas [14]. Un algoritmo de aprendizaje toma el conjunto de entrenamiento y manipula los parámetros de forma iterativa hasta que las predicciones dadas por él sean lo más cercanas posible a las etiquetas verdaderas.

Para que el algoritmo sepa cómo modificar estos parámetros para mejorar sus predicciones, necesita una forma de conocer cómo está siendo su desempeño. Para esto, se define lo que se conoce como **función de pérdida** o **función de error**, que denotaremos con la letra  $L$  y que justamente hace eso: retorna un número que resume qué tan bien o mal está funcionando el modelo con sus parámetros  $\mathbf{w}'$  actuales, en términos de qué tan lejos están sus predicciones de las respuestas reales del conjunto de entrenamiento.

Como venimos enfatizando, lo que caracteriza al modelo en cada iteración es el valor de sus parámetros. Por lo tanto, tiene sentido tratar a la función de pérdida como una que depende de estos, es decir  $L(\mathbf{w})^3$ . A continuación, se mencionan dos ejemplos de funciones de error:

- Una función de pérdida que se es común usar en problemas de regresión es la de Error Cuadrático Medio (ECM), dada por:

$$ECM(\mathbf{w}) = \frac{1}{N} \sum_{i=1}^N (h(\mathbf{x}_i, \mathbf{w}) - \mathbf{y}_i)^2$$

---

<sup>2</sup>Para simplificar la notación, lo que se suele hacer es asumir que la entrada  $\mathbf{x}$  tiene un componente adicional constante  $x_0$  con el valor 1, es decir  $\mathbf{x} = (x_0, x_1, x_2, x_3) = (1, x_1, x_2, x_3)$ . De esta forma, podríamos escribir:  $h(\mathbf{x}) = \mathbf{x} \cdot \mathbf{w}$ , donde el operador  $\cdot$  representa el producto escalar. Retomaremos esta idea más adelante al hablar sobre Redes Neuronales.

<sup>3</sup>En realidad la función de pérdida también depende de los datos de entrenamiento, por lo que si somos estrictos deberíamos escribir  $L(\{\mathbf{X}, \mathbf{Y}\}, \mathbf{w})$ . Sin embargo, como estos datos están fijos durante todo el proceso de aprendizaje, podemos omitirlos.

- Para problemas de clasificación binaria como el que tratamos en este trabajo, vamos a tener  $\mathbf{y}_i \in \mathbb{R}$ , y se suele emplear la Entropía Cruzada Binaria (ECB), dada por:

$$ECB(\mathbf{w}) = -\frac{1}{N} \sum_{i=1}^N [\mathbf{y}_i \ln(h(\mathbf{x}_i, \mathbf{w})) + (1 - \mathbf{y}_i) \ln(1 - h(\mathbf{x}_i, \mathbf{w}))]$$

donde  $\ln$  es la función de logaritmo natural. A grandes rasgos, lo que mide esta función es la diferencia entre dos distribuciones de probabilidad, que en este caso son la distribución real de los datos dada por el conjunto de entrenamiento y la distribución predicha por el modelo en su estado actual.

Para comprender un poco mejor cómo funciona de manera intuitiva, tomemos un ejemplo simple. Supongamos que tenemos una entrada  $\mathbf{x}'$  cuya etiqueta es  $\mathbf{y}' = 1$ , y que la salida del modelo es  $h(\mathbf{x}', \mathbf{w}') = 0.95$ . En primera instancia, vamos a tener que el lado derecho del término de la sumatoria directamente se anula (ya que  $1 - \mathbf{y}' = 1 - 1 = 0$ ). Y, para ver qué pasa con el lado izquierdo, notemos que  $\ln(h(\mathbf{x}', \mathbf{w}')) = \ln(0.95) \approx -0.05$ , por lo que multiplicando por el  $(-1)$  del comienzo de la fórmula, vamos a tener como resultado 0.05, lo cual es bajo e indica una buena predicción del modelo. Si en cambio la predicción hubiera sido  $h(\mathbf{x}', \mathbf{w}') = 0.25$ , tendríamos  $\ln(h(\mathbf{x}', \mathbf{w}')) = \ln(0.25) \approx -1.39$ , dando una pérdida de 1.39.

Lo que se puede ver es que el lado izquierdo influye cuando la salida esperada para la entrada actual es 1, y el lado derecho lo hará cuando la salida esperada es 0.

En general, se asume que un valor más bajo de  $L(\mathbf{w})$  indica un mejor desempeño del modelo, y por lo tanto el objetivo del proceso de entrenamiento se convierte en **encontrar los parámetros  $\mathbf{w}^*$  que minimicen la función de pérdida** (en los datos del conjunto de entrenamiento):

$$\mathbf{w}^* = \arg \min_{\mathbf{w}} L(\mathbf{w})$$

donde el operador  $\arg \min_{\alpha} g(\alpha)$  da el valor de  $\alpha$  que minimiza  $g(\alpha)$ .

Si luego de la minimización la pérdida es baja, quiere decir que hemos encontrado parámetros que hacen que el modelo prediga precisamente las salidas de entrenamiento  $\mathbf{y}_i$  a partir de las entradas  $\mathbf{x}_i$  (con  $i = 1, \dots, N$ ). Sin embargo, como explicamos previamente, la evaluación final del modelo se debe hacer con el conjunto de test, sobre el cual se puede también calcular la pérdida.

La pregunta que surge entonces es cómo hacer para lograr esta minimización. Dependiendo del espacio de funciones y de la función de costo seleccionada, puede que exista una fórmula cerrada para  $\mathbf{w}^*$ , que se calcule analíticamente.

Sin embargo, si la función de costo tiene muchas variables (parámetros) o los modelos son complejos, resulta más útil recurrir a métodos numéricos para aproximar este mínimo.

El algoritmo por defecto que se utiliza para resolver este problema de optimización es el llamado **Descenso por el Gradiente** (DG), y es muy potente ya que se puede aplicar



a una gran variedad de funciones de pérdida [20], siempre que esta sea diferenciable (a continuación veremos por qué).

La idea del DG es ir modificando los parámetros iterativamente hasta eventualmente llegar a un “valle” de la función de pérdida. El algoritmo se basa en que la dirección dada por el gradiente<sup>4</sup> de una función en un punto es la de máximo crecimiento, y por lo tanto su opuesta es la de máximo decrecimiento. En este caso, la función de la cual se calcula el gradiente es la de error, con respecto a los parámetros en  $\mathbf{w}$ .

Concretamente, se empieza con un vector de parámetros  $\mathbf{w}_0$  con valores arbitrarios que va mejorando gradualmente, tomando un paso a la vez en dirección opuesta al gradiente, con el objetivo de reducir el valor de la función de pérdida, hasta que el algoritmo *converja* a un mínimo (local o global) de la función de pérdida.

Un hiperparámetro<sup>5</sup> determinante en el algoritmo del DG es el tamaño de los pasos, llamado **tasa de aprendizaje**, que denotaremos con la letra  $\eta$  y supondremos por el momento que se mantiene constante en todo el proceso. Si el valor  $\eta$  es muy pequeño, entonces el algoritmo va a tener que realizar muchas iteraciones para converger [3]. Si en cambio el valor es muy alto, entonces puede ser que vayamos “saltando” de un lado a otro de un valle de la función, haciendo que el algoritmo diverja [3].

De esta forma, la regla del DG está dada por:

$$\mathbf{w}^{(p+1)} = \mathbf{w}^{(p)} - \eta \nabla L(\mathbf{w}^{(p)})$$

donde  $p$  indica el número de iteración actual, y  $\nabla L(\mathbf{w}^{(p)})$  es el gradiente de la función de error con respecto a los pesos del modelo, evaluado en los valores de los pesos de la iteración actual.

Algo importante a notar es que en la forma que lo presentamos hasta ahora, el cómputo del gradiente de la función de peso involucra recorrer todas las muestras del conjunto de entrenamiento, lo cual computacionalmente es “pesado” y puede demorar el tiempo de entrenamiento. Es decir, en cada iteración, el cálculo del gradiente requiere evaluar la contribución de cada una de las muestras, lo que puede ser caro cuando  $N$  es muy grande. Para mitigar este problema, existen variantes del DG que buscan aproximar el gradiente

---

<sup>4</sup>Dada una función  $g$  de varias variables, es decir,  $g(v_1, v_2, \dots, v_M)$ , el **gradiente** de  $g$  es el vector formado por las derivadas parciales de  $g$  con respecto a cada uno de sus parámetros:

$$\nabla g = \left( \frac{\partial g}{\partial v_1}, \frac{\partial g}{\partial v_2}, \dots, \frac{\partial g}{\partial v_M} \right)$$

donde la notación  $\frac{\partial g}{\partial v_i}$  representa la **derivada parcial** de  $g$  con respecto a  $v_i$ , que mide cómo cambia  $g$  cuando se varía  $v_i$  mientras se mantienen constantes las demás variables. Algo a notar es que el vector resultante es un vector de funciones, y cuando se lo evalúa en un punto, da la dirección de mayor crecimiento de  $g$  desde ese punto.

<sup>5</sup>Hablaremos más adelante sobre qué es un hiperparámetro, pero lo importante es que no es un parámetro que se aprende, como lo son los contenidos en el vector  $\mathbf{w}$ .

utilizando subconjuntos del conjunto de entrenamiento. Retomaremos este tema en la próxima sección de Redes Neuronales.

## Resumen

Hasta aquí hemos hablado de cómo está compuesto prácticamente cualquier algoritmo de Aprendizaje Supervisado. Los distintos elementos presentes son:

- Un **conjunto de entrenamiento**, que contiene ejemplos de entrada-salida.
- Un **conjunto de test**, que servirá para evaluar el desempeño real del modelo, y nos dará una noción de su capacidad de **generalización** una vez entrenado.
- Un **espacio de funciones**, que determina la forma de la función  $h$  y los parámetros  $\mathbf{w}$ .
- Una **función de pérdida**  $L(\mathbf{w})$ , que mide el desempeño del modelo y ayuda a guiar el entrenamiento.
- Un **algoritmo de optimización**, que busca minimizar la función de pérdida, siendo el más común el Descenso por el Gradiente.

Con esto, el objetivo es encontrar los parámetros  $\mathbf{w}^*$  que minimicen la función de pérdida en el conjunto de entrenamiento. Para esto, se comienza con pesos  $\mathbf{w}$  arbitrarios y, haciendo uso del algoritmo de optimización, se los va modificando iterativamente hasta llegar a un mínimo (local o global) de  $L(\mathbf{w})$ .

Se trabaja sobre la hipótesis que minimizando el error en el conjunto de entrenamiento, el modelo tendrá una buena capacidad de generalización. Es decir, habiendo llegado a  $\mathbf{w}^*$ , se espera que el modelo encontrado tendrá un buen desempeño en el conjunto de test.

Algo que no hemos discutido hasta el momento es la correspondencia del espacio de funciones con el conjunto de datos con el que estamos tratando.

El éxito del Aprendizaje Supervisado depende en gran medida de elegir un espacio de funciones adecuado que sea capaz de capturar la distribución de los datos. Por ejemplo, si elegimos un modelo lineal cuando los datos tienen una relación cuadrática, el modelo no podrá representar correctamente la estructura del problema. Por otro lado, si seleccionamos un espacio de funciones altamente flexibles - o *expresivas* -, como polinomios de grado alto, puede ocurrir que el modelo termine describiendo peculiaridades de los datos de entrenamiento que son atípicas y llevan a predicciones inusuales [14].

Si bien existen otros modelos que permiten identificar relaciones no lineales y no polinómicas, varios de ellos requieren tener un buen conocimiento sobre la estructura de los datos, y muchas veces su desempeño está condicionado a ciertas transformaciones sobre los mismos, proceso que se conoce por su nombre en inglés *feature engineering*.

En este punto es donde aparecen los modelos conocidos como **Redes Neuronales**, que permiten describir un espacio de funciones complejas, expresivas, y no lineales sin

la necesidad de tener un conocimiento profundo sobre los datos. En cambio, son capaces de aprender las representaciones subyacentes automáticamente. En la sección siguiente, explicaremos el funcionamiento de estos modelos.

## 2.3. Redes Neuronales Artificiales

Las Redes Neuronales Artificiales (RNAs) son un modelo específico dentro del ML, cuya estructura y funcionamiento estuvieron inspirados inicialmente por el intento de ser modelos computacionales del aprendizaje biológico, es decir modelos de cómo el aprendizaje podría ocurrir en el cerebro [5]. Durante los últimos años, ha sido el área que más desarrollo e impacto ha tenido, principalmente gracias a su versatilidad, potencia y escalabilidad, cualidades que hacen que estos modelos sean capaces de enfrentar problemas grandes y complejos [3], y que sobre todo parecían extremadamente difíciles de resolver, como son el reconocimiento de voz y la detección de objetos.

A continuación, damos un breve contexto histórico y luego ahondamos en su funcionamiento.

### 2.3.1. Breve Contexto Histórico

Aunque su gran éxito ha sido reciente, lo cierto es que la idea de las RNAs data desde 1943, cuando Warren McCulloch y Walter Pitts presentaron en su artículo *A Logical Calculus of Ideas Immanent of Nervous Activity* [10] un modelo computacional simplificado utilizando lógica proposicional acerca de cómo funcionan las neuronas de cerebros animales en conjunto para llevar a cabo cómputos complejos [3]. Presentaron una versión muy simplificada de la neurona biológica, que solamente tenía una o más entradas binarias y una salida binaria.

Posteriormente, en 1958, Frank Rosenblatt presentó una de las formas o *arquitecturas* más simples de RNAs: el “Perceptrón” [17]. Este servía principalmente para resolver problemas de clasificación en donde los datos son linealmente separables. Sin embargo, su aporte más notorio fue que definió un algoritmo para el entrenamiento del Perceptrón que le permitía mejorar automáticamente sus parámetros internos para poder llegar a la solución óptima.

Más tarde, se descubrió que los problemas que no podían ser resueltos por el Perceptrón, sí podían ser resueltos “apilando” múltiples perceptrones, lo cual llevó a la invención del “Perceptrón Multicapa” (PMC), también conocido actualmente como “Red Neuronal de Propagación Directa”<sup>6</sup>(del inglés *Feedforward Neural Networks*, FFNN) [5], las cuales conforman el punto de partida de las redes neuronales actuales.

Para explicar la idea y los elementos presentes detrás de estos algoritmos, tomaremos

---

<sup>6</sup>Si bien estos términos se suelen usar indistintamente, la realidad es que las redes neuronales feedforward tienen algunas diferencias con respecto al Perceptrón Multicapa.

como referencia las redes neuronales Feedforward, y en particular las llamadas “totalmente conectadas” (*fully connected*), que definiremos a continuación.

### 2.3.2. Red Neuronal Feedforward

Como dijimos anteriormente, las redes neuronales son un modelo particular de Aprendizaje Automático. Aquí, las funciones hipótesis se caracterizan por incorporar **no linealidad** y toman la forma de circuitos algebraicos complejos con conexiones que pueden tener diferentes “intensidades” [20]. La idea principal en estos circuitos es que el “camino” recorrido al realizar el cómputo tenga varios pasos como para permitir que las variables de entrada puedan interactuar de formas complejas. Esto hace que sean lo suficientemente expresivos como para poder capturar la complejidad de los datos del mundo real [20].

Más concretamente, estos modelos son llamados *redes* porque el espacio de funciones que proveen está formado en realidad por la composición de varias funciones [5]. Por ejemplo, podríamos tener la composición de tres funciones  $f^{(1)}$ ,  $f^{(2)}$  y  $f^{(3)}$  para formar la siguiente función:

$$f(\mathbf{x}) = f^{(3)}(f^{(2)}(f^{(1)}(\mathbf{x}))) \quad (2.13)$$

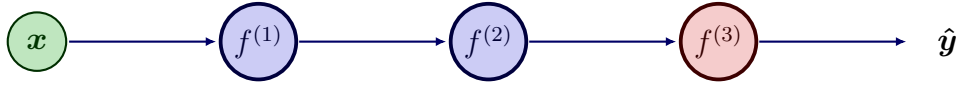
donde  $\mathbf{x}$  es un vector de dimensión  $n$  de números reales:  $\mathbf{x} = (x_1, x_2, \dots, x_n)$ , es decir  $\mathbf{x} \in \mathbb{R}^n$ .

Usualmente, se dice que las redes están organizadas en **capas**. De esta forma, en la ecuación anterior, a  $\mathbf{x}$  se la conoce como **capa de entrada**, a las funciones  $f^{(1)}$  y  $f^{(2)}$  como **capa ocultas o intermedias**, y a  $f^{(3)}$ , que es la que produce el resultado final, como **capa de salida**. La longitud de esta cadena de funciones es la que va a dar la **profundidad** de la red.

Las RNAs tienen una capa de entrada y una de salida, pero el número de capas ocultas depende de quien la diseñe. Cuando tienen una capa oculta, se las llama “superficiales” (o poco profundas, del inglés *shallow*), y cuando tienen más de una, *profundas*. Es por esto que al hablar de redes neuronales, muchas veces se hace referencia al término **Aprendizaje Profundo**.

Recordemos que uno de los elementos presentes en el Aprendizaje Supervisado es el conjunto de entrenamiento, compuesto por pares de entrada-etiqueta. Ahora bien, lo interesante de estos modelos es que si bien este conjunto especifica qué tiene que producir la capa de salida ante cada entrada particular, no determina cuál debe ser el comportamiento de las otras capas [5]. En cambio, es el algoritmo de aprendizaje el que tiene que decidir cómo usarlas para lograr una buena aproximación de la función desconocida.

Una forma muy común y más intuitiva de pensar estos modelos es a través de grafos dirigidos cuyas flechas describen cómo están compuestas las funciones y cómo fluye la información a través de ellas. Si hay una flecha que une a dos nodos, diremos que están “conectados”. Por ejemplo, la Ecuación 2.13 se representaría de la siguiente manera:



En este caso, la entrada  $\mathbf{x}$  va a la función  $f^{(1)}$ , la salida de  $f^{(1)}(\mathbf{x})$  va a  $f^{(2)}$ , y la salida de  $f^{(2)}(f^{(1)}(\mathbf{x}))$  va directamente a  $f^{(3)}$  para de esa forma producir el resultado final  $\hat{\mathbf{y}} = f(\mathbf{x}) = f^{(3)}(f^{(2)}(f^{(1)}(\mathbf{x})))$ .

Es justamente el comportamiento anterior el que caracteriza a las redes neuronales de tipo **Feedforward**: los datos y resultados fluyen en una sola dirección; cada nodo computa su resultado y se lo pasa a su sucesor (o sucesores, como veremos más adelante). En el grafo, esta situación se refleja en el hecho que no hay ciclos, por lo que las redes de este tipo se representan por medio de grafos dirigidos y acíclicos.

Ahora bien, ¿qué es exactamente una capa? En la terminología de redes neuronales, una capa es un conjunto de **unidades** o, tomando en cuenta su inspiración biológica, **neuronas**, que actúan en paralelo. Cada unidad representa una función que toma un vector y retorna un escalar, y se asemejan a las neuronas biológicas en el sentido que reciben entradas (o estímulos) de otras unidades y computan su propio valor de activación [5].

De esta forma, la capa de entrada va a tener tantas neuronas como la dimensión de los datos de entrada ( $\mathbf{x}$ ). Es decir, si  $\mathbf{x}$  es de dimensión  $n$ , entonces la capa de entrada va a tener  $n$  unidades. Sin embargo, la cantidad de neuronas de cada capa oculta depende del diseño de la red, y la de la capa de salida depende sobre todo del problema que se esté tratando de resolver. Si se trata por ejemplo de un problema de clasificación, entonces la capa de salida va a tener en general tantas neuronas como categorías existan en el dominio del problema.

Teniendo el concepto de neuronas, podemos introducir el de redes **totalmente conectadas** (*fully connected*), que son aquellas en las que cada unidad de una capa se conecta con todas las de la capa siguiente, “pasándole” su valor computado a todas ellas.

Con esto en mente, podemos concretizar un poco más el ejemplo con el que venimos trabajando suponiendo que  $\mathbf{x}$  es un vector de dimensión 3, las capas ocultas dadas por  $f^{(1)}$  y  $f^{(2)}$  tienen 4 y 3 neuronas respectivamente y la capa de salida tiene 2. Así, suponiendo que nuestra red es fully connected, nuestro grafo resultaría en el de la Figura 2.2, donde el superíndice de cada nodo indica el número de capa y el subíndice hace referencia al número de neurona en esa capa.

A partir de la Figura 2.2, se puede ver que cada neurona de la capa de entrada representa un elemento del vector de entrada, pero las neuronas de tanto la capa oculta como la de salida reciben las salidas de las neuronas de la capa anterior. Veamos entonces qué hace precisamente una neurona o unidad.

Una neurona simplemente calcula una suma pesada de sus entradas, provenientes de las unidades de la capa anterior, y luego aplica una función **no lineal** para producir su salida. Formalmente, si denotamos con:

- $s_j^{(k)}$  a la salida de la unidad  $j$  de la capa  $k$

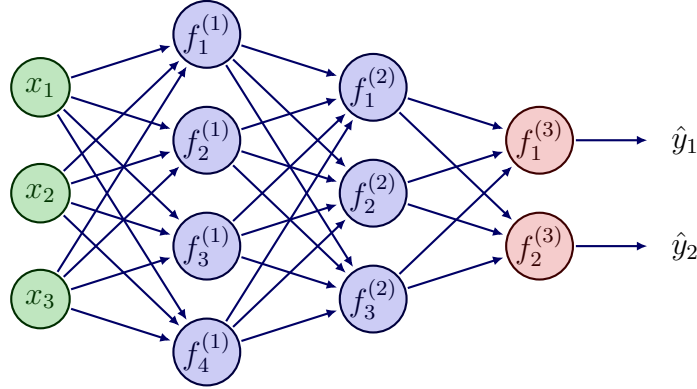


Figura 2.2: Red Neuronal de tipo Feedforward y totalmente conectada, con la capa de entrada formada por 3 neuronas, dos capas ocultas, cada una formada por 4 y 3 neuronas respectivamente, y la capa de salida, formada por dos neuronas. En este caso, la red “acepta” entradas  $\mathbf{x} \in \mathbb{R}^3$  y produce salidas  $\hat{\mathbf{y}} \in \mathbb{R}^2$ . Adaptado de [12].

- $a_j^{(k)}$  a la función no lineal de la unidad  $j$  de la capa  $k$
- $w_{i,j}^{(k)}$  la intensidad o **peso** de la conexión entre la neurona  $i$  de la capa  $k$  y la  $j$  de la capa  $(k + 1)$ ,

tenemos que:

$$s_j^{(k)} = a_j^{(k)} \left( \sum_i w_{i,j}^{(k-1)} s_i^{(k-1)} \right) \quad (2.14)$$

donde el índice  $i$  de la sumatoria va a recorrer todas las neuronas de la capa anterior.

La función  $a_j^{(k)}$  se denomina **función de activación**, y el hecho que sea no lineal es importante ya que de no ser así, cualquier composición de unidades estaría representando una función lineal [20]. Como mencionamos anteriormente, es justamente esta no linealidad lo que permite a estos modelos representar funciones arbitrarias [20] y complejas. En general, se asume que todas las neuronas de una capa tienen la misma función de activación, pero puede ocurrir que diferentes capas tengan diferentes funciones de activación.

Más precisamente, una función de activación es una función no lineal que toma cualquier valor real como entrada y produce como resultado un número en un determinado rango. Algunas funciones de activación comunes son las siguientes:

- **Sigmoide**: produce un valor entre 0 y 1. Es por ello que se suele usar en problemas de clasificación binaria para que una única neurona en la capa de salida represente la probabilidad de que la entrada pertenezca a la clase “positiva” (la que corresponde a la etiqueta 1).

$$\sigma(x) = \frac{1}{1 + e^{-x}}$$

- **ReLU** (abreviatura de *Rectified Linear Unit*): produce un valor entre 0 e  $\infty$ . Se utiliza mayormente en las neuronas de capas ocultas.

$$\text{ReLU}(x) = \max(0, x)$$

- **Tangente hiperbólica**: produce un valor entre -1 y 1. Lo particular de esta es que mantiene el signo de la entrada.

$$\tanh(x) = \frac{e^x - e^{-x}}{e^x + e^{-x}}$$

Actualmente, la más utilizada es la ReLU y variantes de ella.

Volviendo a la Fórmula 2.14, si en nuestro ejemplo tomamos la neurona  $f_1^{(2)}$ , tenemos que su salida estará dada por:

$$\begin{aligned} s_1^{(2)} &= a_1^{(2)} \left( \sum_{i=1}^3 w_{i,1}^{(1)} s_i^{(1)} \right) \\ &= a_1^{(2)} \left( w_{1,1}^{(1)} s_1^{(1)} + w_{2,1}^{(1)} s_2^{(1)} + w_{3,1}^{(1)} s_3^{(1)} \right) \end{aligned}$$

En las redes, se estipula que cada unidad tiene una entrada extra desde una neurona *dummy* de la capa anterior, para la cual utilizaremos el subíndice 0, cuyo valor de salida se fija en 1 y su peso correspondiente es  $w_{0,j}^{(k)}$  para una neurona  $j$  de una capa  $k$ . Este peso se suele llamar **bias**<sup>7</sup> y permite que la entrada a dicha neurona sea distinta de 0 incluso cuando todas las salidas de la capa anterior sean 0 [20]. Agregándolo, podemos escribir la Ecuación 2.14 de forma vectorizada:

$$s_j^{(k)} = a_j^{(k)} \left( \left( \mathbf{w}_j^{(k-1)} \right)^T \mathbf{s}_j^{(k-1)} \right) \quad (2.15)$$

donde:

- $\mathbf{w}_j^{(k-1)}$  es el vector de todos los pesos que salen de las neuronas de la capa  $(k-1)$  y se dirigen a la unidad  $j$  de la capa  $k$  (incluyendo  $w_{0,j}$ )
- $\mathbf{s}_j^{(k-1)}$  es el vector de todas las salidas de la capa anterior que se dirigen a la unidad  $j$  de la capa  $k$  (incluyendo el 1 fijo de la neurona dummy).

Con esta notación, si tomamos nuevamente a  $f_1^{(2)}$ , los vectores involucrados van a ser  $\mathbf{w}_1^{(1)}$  y  $\mathbf{s}_1^{(1)}$ , dados en este caso por:

$$\mathbf{w}_1^{(1)} = (w_{0,1}, w_{1,1}, w_{2,1}, w_{3,1}, w_{4,1}), \mathbf{s}_1^{(1)} = (1, s_1^{(1)}, s_2^{(1)}, s_3^{(1)}, s_4^{(1)})$$

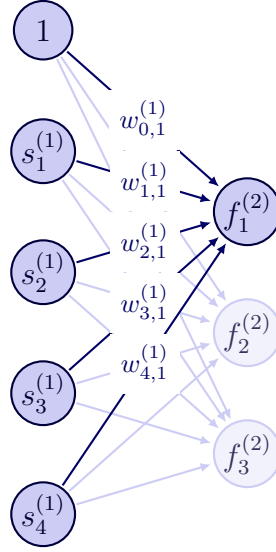


Figura 2.3: Entradas a la neurona  $f_1^{(2)}$ , junto con sus pesos asociados. Se incluyen tanto la neurona dummy de la capa anterior como su bias. Adaptado de [12].

Esto se puede ver mejor gráficamente haciendo foco en dicha neurona, como lo ilustra la Figura 2.3.

Así como utilizamos vectores para describir el cómputo de una neurona, podemos emplear matrices para describir el comportamiento de toda una capa. Para ello, tomemos la siguiente notación, para lo cual resulta conveniente fijar una capa  $k$ , que tiene  $m$  neuronas:

- $\mathbf{s}^{(k)}$  es el vector columna formado por las salidas de la capa  $k$ . Es decir:  $\mathbf{s}^{(k)} = (s_0^{(k)}, s_1^{(k)}, \dots, s_m^{(k)})^T = (1, s_1^{(k)}, \dots, s_m^{(k)})^T$ , de dimensión  $m \times 1$ .
- $\mathbf{a}^{(k)}$  es la función de activación de la capa  $k$ , con una aplicación elemento a elemento. Es decir:  $\mathbf{a}^{(k)}(x_1, x_2, \dots, x_m) = (a^{(k)}(x_1), a^{(k)}(x_2), \dots, a^{(k)}(x_m))$ , donde  $a^{(k)}$  es la función de activación de todas las neuronas de la capa  $k$  con aplicación a un número.
- $\mathbf{W}^{(k)}$  es la matriz de pesos que salen de la capa  $k$ . Cada fila  $j$  de esta matriz corresponde a los pesos que sale de todas las neuronas de la capa  $k$  (incluyendo el bias) y se dirigen a la neurona  $j$  de la capa  $(k + 1)$ . Es decir cada fila es  $\mathbf{w}_j^{(k)}$  con  $j = 1, \dots, n$ , y  $n$  la cantidad de neuronas de la capa  $(k + 1)$  (sin contar la dummy, que “aparece después”). Así, esta matriz tiene dimensiones  $n \times m$ .

<sup>7</sup>En la bibliografía sobre redes neuronales, también se suele presentar a este peso como un elemento “aparte” de la neurona, no como un peso extra, y se lo denota como  $b_j^{(k)}$ .



Con esto, tenemos que la salida de una capa  $k$  está dada por:

$$\mathbf{s}^{(k)} = \mathbf{a}^{(k)} (\mathbf{W}^{(k-1)} \mathbf{s}^{(k-1)})$$

Con todo esto en mente, veamos cuál es la función que describe la red neuronal presentada como ejemplo:

$$\begin{aligned} \hat{\mathbf{y}} &= \mathbf{s}^{(3)} \\ &= \mathbf{a}^{(3)} (\mathbf{W}^{(2)} \mathbf{s}^{(2)}) \\ &= \mathbf{a}^{(3)} (\mathbf{W}^{(2)} \mathbf{a}^{(2)} (\mathbf{W}^{(1)} \mathbf{s}^{(1)})) \\ &= \mathbf{a}^{(3)} (\mathbf{W}^{(2)} \mathbf{a}^{(2)} (\mathbf{W}^{(1)} \mathbf{a}^{(1)} (\mathbf{W}^{(0)} \mathbf{s}^{(0)}))) \\ &= \mathbf{a}^{(3)} (\mathbf{W}^{(2)} \mathbf{a}^{(2)} (\mathbf{W}^{(1)} \mathbf{a}^{(1)} (\mathbf{W}^{(0)} \mathbf{x}^T))) \end{aligned}$$

Y si queremos profundizar aún más esta ecuación para ver dónde aparece cada peso:

$$\begin{aligned} \hat{\mathbf{y}} &= \mathbf{a}^{(3)} (\mathbf{W}^{(2)} \mathbf{a}^{(2)} (\mathbf{W}^{(1)} \mathbf{a}^{(1)} (\mathbf{W}^{(0)} \mathbf{x}^T))) \\ &= \mathbf{a}^{(3)} \left( \mathbf{W}^{(2)} \mathbf{a}^{(2)} \left( \mathbf{W}^{(1)} \mathbf{a}^{(1)} \left( \mathbf{W}^{(0)} \begin{bmatrix} 1 \\ x_1 \\ x_2 \\ x_3 \end{bmatrix} \right) \right) \right) \\ &= \mathbf{a}^{(3)} \left( \mathbf{W}^{(2)} \mathbf{a}^{(2)} \left( \mathbf{W}^{(1)} \mathbf{a}^{(1)} \left( \begin{bmatrix} w_{0,1}^{(0)} & w_{1,1}^{(0)} & w_{2,1}^{(0)} & w_{3,1}^{(0)} \\ w_{0,2}^{(0)} & w_{1,2}^{(0)} & w_{2,2}^{(0)} & w_{3,2}^{(0)} \\ w_{0,3}^{(0)} & w_{1,3}^{(0)} & w_{2,3}^{(0)} & w_{3,3}^{(0)} \\ w_{0,4}^{(0)} & w_{1,4}^{(0)} & w_{2,4}^{(0)} & w_{3,4}^{(0)} \end{bmatrix} \begin{bmatrix} 1 \\ x_1 \\ x_2 \\ x_3 \end{bmatrix} \right) \right) \right) \\ &= \mathbf{a}^{(3)} \left( \mathbf{W}^{(2)} \mathbf{a}^{(2)} \left( \mathbf{W}^{(1)} \mathbf{a}^{(1)} \left( \begin{bmatrix} w_{0,1}^{(0)} + w_{1,1}^{(0)} x_1 + w_{2,1}^{(0)} x_2 + w_{3,1}^{(0)} x_3 \\ w_{0,2}^{(0)} + w_{1,2}^{(0)} x_1 + w_{2,2}^{(0)} x_2 + w_{3,2}^{(0)} x_3 \\ w_{0,3}^{(0)} + w_{1,3}^{(0)} x_1 + w_{2,3}^{(0)} x_2 + w_{3,3}^{(0)} x_3 \\ w_{0,4}^{(0)} + w_{1,4}^{(0)} x_1 + w_{2,4}^{(0)} x_2 + w_{3,4}^{(0)} x_3 \end{bmatrix} \right) \right) \right) \\ &= \mathbf{a}^{(3)} \left( \mathbf{W}^{(2)} \mathbf{a}^{(2)} \left( \mathbf{W}^{(1)} \begin{bmatrix} a^{(1)} \left( w_{0,1}^{(0)} + w_{1,1}^{(0)} x_1 + w_{2,1}^{(0)} x_2 + w_{3,1}^{(0)} x_3 \right) \\ a^{(1)} \left( w_{0,2}^{(0)} + w_{1,2}^{(0)} x_1 + w_{2,2}^{(0)} x_2 + w_{3,2}^{(0)} x_3 \right) \\ a^{(1)} \left( w_{0,3}^{(0)} + w_{1,3}^{(0)} x_1 + w_{2,3}^{(0)} x_2 + w_{3,3}^{(0)} x_3 \right) \\ a^{(1)} \left( w_{0,4}^{(0)} + w_{1,4}^{(0)} x_1 + w_{2,4}^{(0)} x_2 + w_{3,4}^{(0)} x_3 \right) \end{bmatrix} \right) \right) \\ &= (\dots) \end{aligned}$$

Las librerías que implementan estos modelos utilizan esta notación matricial ya que suelen estar optimizadas para cálculos con matrices.

## Entrenamiento

En el caso de las redes neuronales, los parámetros a optimizar van a ser las intensidades de las conexiones entre las neuronas, que también venimos llamando pesos. La gran mayoría de los optimizadores que se utilizan actualmente se basan en la regla del DG, aunque con algunas mejoras que describiremos a continuación.

Como mencionamos en la sección anterior, lo costoso de la regla del DG presentada hasta el momento es que requiere evaluar la función de pérdida considerando *todas* las muestras del conjunto de entrenamiento. Para reducir esta carga, lo que se suele usar en realidad es una técnica conocida como **Descenso por el Gradiente Estocástico** (DGE), que permite obtener una aproximación del gradiente a partir del gradiente promedio de un subconjunto del conjunto de entrenamiento, que recibe el nombre de **lote**. Luego, se actualizan los pesos en base a este estimación. Cabe aclarar que el tamaño de lote, es decir la cantidad de ejemplos que se eligen cada vez, se mantiene fijo en todo el entrenamiento y constituye un hiperparámetro.

Teniendo esto en cuenta, podemos definir el concepto de **época**. Una época se refiere al proceso completo en el cual el modelo se entrena utilizando **todos** los datos disponibles en el conjunto de entrenamiento una vez. A grandes rasgos, los pasos involucrados en una época son los siguientes:

1. Mezclar el conjunto de entrenamiento. Este paso en realidad es opcional pero evita que el modelo aprenda patrones no deseados debido al orden de los datos.
2. Seleccionar un lote del tamaño predefinido del conjunto de datos de entrenamiento.
3. Para cada ejemplo del lote:
  - a) Computar la predicción del modelo.
  - b) Calcular la pérdida.
4. Promediar el error a lo largo de todos los ejemplos del lote. Este valor escalar no se utiliza directamente en el entrenamiento, pero se emplea comúnmente para monitorear el progreso del aprendizaje.
5. Calcular el gradiente utilizando solamente las muestras del lote.
6. Actualizar los pesos.
7. Volver a 2.
8. Una vez que se han recorrido todos los lotes, finaliza la época.

Ahora bien, un paso fundamental en el entrenamiento de las redes neuronales y del que vale la pena profundizar es el del cálculo del gradiente. De hecho, no encontrar una solución eficiente para lograrlo detuvo el avance de estos modelos durante varios años. El algoritmo que vino a dar respuesta y que es el utilizado hasta hoy es conocido como **retropropagación** (del inglés *backpropagation*) y fue presentado en el año 1986 [19]).

El backpropagation se basa fundamentalmente en la regla de la cadena para derivadas de funciones compuestas y se divide en dos etapas: primero, el paso hacia adelante (*forward pass*) y luego, el paso hacia atrás (*backward pass*). Para entender estas etapas, supondremos que solamente una entrada es provista a la red.

En el forward pass, la red simplemente lleva a cabo una predicción para la entrada, realizando todo el cómputo intermedio necesario para llegar a producir una salida.

El backward pass comienza por calcular el error cometido por la red para la entrada dada, y consiste en propagar este error desde la capa de salida hasta la de entrada, midiendo la contribución al error de cada conexión [3]. Este paso se basa fuertemente en la idea que un pequeño cambio en uno de los pesos causa un efecto cadena sobre el cómputo restante de la red [14]. Para verlo, supongamos que tenemos una red neuronal con tres capas ocultas, que denotaremos con  $\mathbf{h}^{(1)}$ ,  $\mathbf{h}^{(2)}$  y  $\mathbf{h}^{(3)}$  (la cantidad de neuronas en cada capa es irrelevante), y veamos cómo computaríamos el efecto de un cambio en un peso [14]:

- Para calcular cómo un cambio en un peso que se dirige a  $\mathbf{h}^{(3)}$  modifica el valor de la pérdida, necesitamos saber (i) cómo un cambio en  $\mathbf{h}^{(3)}$  modifica la salida  $\mathbf{f}$  del modelo y (ii) cómo un cambio en la salida modifica la pérdida.
- Para calcular cómo un cambio en un peso que se dirige a  $\mathbf{h}^{(2)}$  modifica el valor de la pérdida, necesitamos saber (i) cómo un cambio en  $\mathbf{h}^{(2)}$  afecta a  $\mathbf{h}^{(3)}$ , (ii) cómo un cambio en  $\mathbf{h}^{(3)}$  modifica la salida  $\mathbf{f}$  del modelo y (iii) cómo un cambio en la salida modifica la pérdida.
- Para calcular cómo un cambio en un peso que se dirige a  $\mathbf{h}^{(1)}$  modifica el valor de la pérdida, necesitamos saber (i) cómo un cambio en  $\mathbf{h}^{(1)}$  afecta a  $\mathbf{h}^{(2)}$ , (ii) cómo un cambio en  $\mathbf{h}^{(2)}$  afecta a  $\mathbf{h}^{(3)}$ , (iii) cómo un cambio en  $\mathbf{h}^{(3)}$  modifica la salida  $\mathbf{f}$  del modelo y (iv) cómo un cambio en la salida modifica la pérdida.

Mientras nos movemos hacia las primeras capas de la red, vemos que la mayoría de los términos que se necesitan ya han sido calculados en pasos anteriores, por lo que no es necesario recomputarlos. Justamente calcular los efectos de los cambios - que son básicamente las derivadas parciales - de esta manera es conocido como el backward pass.

El paso final del backpropagation es actualizar los pesos con los gradientes calculados en el backward pass y utilizando la regla del DG.

## Hiperparámetros

Al entrenar un modelo, existen ciertos ajustes que tienen que ver con la arquitectura o diseño del modelo y otros que son utilizados para controlar el proceso de entrenamiento y son llamados **hiperparámetros**. Los valores de los hiperparámetros no son aprendidos por el modelo [5], sino que se fijan de antemano y no se modifican a lo largo del entrenamiento.

Algunos de estos hiperparámetros son los siguientes:

- La cantidad de capas ocultas de la red.
- La cantidad de neuronas en cada capa oculta.
- La función de activación de cada capa.
- La tasa de aprendizaje del optimizador.
- El número de épocas de entrenamiento.
- El tamaño de lote.

Todos estos pueden contribuir a que el modelo mejore su desempeño, por lo que surge el problema de cómo hacer para encontrar el valor óptimo de cada uno. Para ello, se utiliza la búsqueda u optimización de hiperparámetros.

Una técnica para hacerlo consiste en construir una tercera partición del conjunto de datos, además de la de entrenamiento y la de test, llamada **conjunto de validación**.

Otra estrategia se denomina **validación cruzada** (*cross-validation*) y consiste en dividir el conjunto de entrenamiento en  $k$  partes, y luego entrenar el modelo  $k$  veces, cada vez utilizando  $k - 1$  partes para el entrenamiento y la parte restante para la validación.

En las siguientes secciones, hablaremos sobre dos tipos particulares de redes neuronales de las que hacemos uso en este trabajo: las Redes Neuronales Convolucionales y las Redes Neuronales Recurrentes. Cada una fue diseñada originalmente para trabajar con un tipo específico de datos. Las convolucionales son ideales para procesar datos estructurados en forma de grilla, mientras que las recurrentes son adecuadas para secuencias temporales. Presentaremos la intuición sobre detrás de ellas y nos concentraremos en su aplicación sobre series de tiempo, relevante para nuestro trabajo.

## 2.4. Redes Neuronales Convolucionales

Como mencionamos anteriormente, las Redes Neuronales Convolucionales (RNC) son un tipo especializado de redes neuronales pensadas para el procesamiento de datos que tienen una estructura de grilla [5]. Ejemplos de estos datos son las series de tiempo, que pueden pensarse como una grilla unidimensional y las imágenes, que pueden verse como una grilla bidimensional de píxeles.

Si bien las RNCs se han usado principalmente para el procesamiento de imágenes, en este trabajo nos enfocaremos en su uso para analizar series de tiempo, en particular unidimensionales. Veremos cómo su funcionamiento permite capturar patrones temporales en los datos.

Sin entrar en detalles<sup>8</sup>, una **serie de tiempo univariada o unidimensional** se puede representar como un vector ordenado  $U$  de valores reales, en el que cada valor corresponde a una medición en el tiempo sobre un determinado fenómeno:

$$U = (x_1, x_2, \dots, x_N)$$

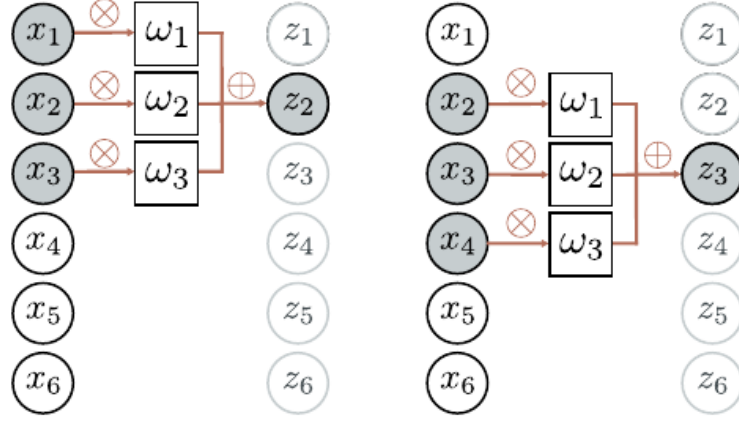


Figura 2.4: Fuente: [14]. Ejemplo de convolución unidimensional con un filtro  $w$  de tamaño 3.

donde  $N$  es la dimensión del vector.

Ahora bien, el término *convolucionales* proviene del hecho que lo que caracteriza a estas redes es la utilización de una operación matemática llamada **convolución**<sup>9</sup>[5]. Las capas de la red que aplican esta operación son llamadas *capas convolucionales*.

La convolución toma dos argumentos: por un lado, la *entrada* y por otro lado, un *filtro* o *kernel*. En el contexto del ML, ambos son usualmente arreglos multidimensionales de números reales, también comúnmente llamados tensores [5]. Intuitivamente, la operación consiste en “deslizar” el filtro sobre la entrada, y en cada momento calcular el producto escalar. Para verlo más claramente en el caso unidimensional, tomemos un ejemplo.

Dado como entrada a la convolución un vector  $x$ , si tomamos un filtro de tamaño 3, dado por  $w = (w_1, w_2, w_3)^T$ , entonces el resultado de la convolución es un vector  $z$  en donde cada componente  $z_i$  es una suma pesada de las entradas “cercanas”:

$$z_i = w_1 x_{i-1} + w_2 x_i + w_3 x_{i+1}$$

En la Figura 2.4, se puede ver cómo se computan  $z_2$  y  $z_3$ . Un detalle a notar aquí es que al calcular  $z_2$  y  $z_3$ , el filtro “entra” por completo en la entrada, pero si quisiéramos calcular  $z_1$ , pareciera que  $w_1$  no puede multiplicarse por nada. Existen alternativas para solucionar este problema, que detallaremos más adelante.

Si generalizamos y tomamos un vector  $x$  de tamaño  $n$  correspondiente a la entrada y un vector  $w$  de tamaño  $l$  correspondiente al kernel, entonces el resultado de la convolución

<sup>8</sup>En una sección posterior, hablaremos más en profundidad sobre las series de tiempo unidimensionales.

<sup>9</sup>En realidad, la operación que está presente en estas redes es una relacionada con la convolución, llamada **correlación cruzada**.

<sup>3</sup>Por conveniencia, el primer elemento de los vectores será indexado en 1, y no en 0.

es un vector  $\mathbf{z}$  donde:

$$z_i = \sum_{j=1}^l w_j x_{j+i-(l+1)/2} \quad (2.16)$$

En otras palabras, para generar cada componente  $i$  de la salida, se toma el producto escalar entre el kernel  $\mathbf{w}$  y una parte de  $\mathbf{x}$  de largo  $l$  centrada en  $x_i$  [20].

A partir de aquí, se puede ver que aplicar una convolución resulta en una salida usualmente de menor tamaño que la entrada. La salida de la convolución suele llamarse **mapa de características** (*feature map*) [5], que resalta las áreas de la entrada que son “similares” a la característica que el filtro está tratando de capturar [3]. Para ver esto, tomemos otro ejemplo.

Supongamos que tenemos el filtro  $\mathbf{w} = (1, 0, -1)$  (de tamaño  $l = 3$ ). Entonces, usando la Ecuación 2.16, veamos qué calcula este filtro en cada posición  $i$  de la salida:

$$\begin{aligned} z_i &= \sum_{j=1}^3 w_j x_{j+i-(3+1)/2} \\ &= \sum_{j=1}^3 w_j x_{j+i-2} \\ &= w_1 x_{1+i-2} + w_2 x_{2+i-2} + w_3 x_{3+i-2} \\ &= 1 \times x_{i-1} + 0 \times x_i + (-1) \times x_{i+1} \\ &= x_{i-1} - x_{i+1} \end{aligned}$$

O sea, lo que hace es dada una posición  $i$ , calcular la diferencia entre el “vecino” izquierdo de  $i$  y el derecho. De esta forma, si para un  $i$  el valor es positivo, quiere decir que hubo una transición de un valor mayor a uno menor, y si es negativo, viceversa. En este caso, se podría decir que el filtro “detecta” regiones de la entrada en donde hubo un cambio de tendencia.

Con esto, podemos ver que un filtro se encarga de identificar una característica específica en la entrada. Y por lo tanto, diferentes filtros actuando en conjunto podrán detectar diferentes características puntuales.

Ahora que ya tenemos una intuición clara sobre qué hace una convolución, veamos cómo esta operación se traslada a las redes neuronales. Para empezar, lo que va a ocurrir ahora es que los parámetros a optimizar van a ser los pesos involucrados en cada filtro.

Las redes convolucionales son un ejemplo de red Feedforward, ya que la información fluye en una sola dirección. Ahora bien, vimos que en las redes totalmente conectadas, cada neurona de una capa está conectada con todas las de la capa anterior. En cambio, en las capas convolucionales lo que ocurre es que cada neurona está conectada con un subconjunto de neuronas (consecutivas) de la capa anterior, sobre las cuales aplicará el filtro, y que recibe el nombre de **campo receptivo**. Es importante notar que cada

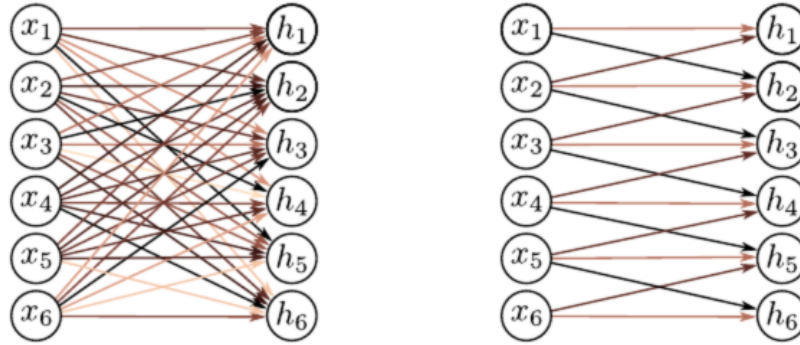


Figura 2.5: Fuente: [14]. Capas de una red fully connected (izquierda) vs capas convolucionales (derecha). Denotamos con  $x$  a la capa de la izquierda, y con  $h$  a la de la derecha, en ambos casos. En las capas de la fully connected, vemos que cada neurona de la capa  $x$  está conectada con todas las neuronas de la capa  $h$ , habiendo un total de  $6 \times 6 = 36$  pesos entre ellas. En cambio, en la convolucional, asumiendo que se aplica un filtro de tamaño  $l = 3$ , tenemos que cada neurona de la capa  $h$  computa una suma pesada (con los mismos pesos) de  $l = 3$  neuronas consecutivas de la capa  $x$ .

neurona de una capa convolucional aplica el mismo filtro, por lo tanto todas ellas comparten los mismos pesos. Esto significa que la cantidad de parámetros a aprender en una red convolucional es mucho menor que en una red totalmente conectada, y es algo que caracteriza a las RNCs. Este comportamiento se puede ver en la Figura 2.5.

Con esta idea de campo receptivo, podemos pensar en una red con dos capas convolucionales seguidas y en las que se aplica un filtro de tamaño 3. Lo que va a ocurrir entonces es que las neuronas de la primera capa oculta toman una suma pesada de conjuntos de 3 neuronas consecutivas de la capa de entrada. Luego, las unidades de la segunda capa oculta toman una suma pesada de conjuntos de 3 neuronas consecutivas de la primera capa oculta, que son a su vez sumas pesadas de 3 neuronas de entrada. Por lo tanto, las neuronas de la segunda capa oculta en realidad tienen un campo receptivo de 5 neuronas. De esta forma, el campo receptivo de las unidades en las capas siguientes va aumentando [14]. Esto provoca que la primera capa oculta se concentre en características de bajo nivel, más específicas, luego la siguiente en otras de mayor nivel como resultado de integrar las anteriores, y así sucesivamente [3].

Hasta ahora vimos una capa convolucional que aplica solamente un filtro, lo que nos va a dar como resultado solamente un mapa de características. Sin embargo, una misma capa puede aplicar varios filtros (todos del mismo tamaño), cada uno de los cuales va a generar su propio feature map. Para esto, lo que se hace es darle a la capa una “profundidad” de tantos filtros como querramos aplicar sobre la entrada, obteniendo de esta forma un feature map para cada nivel profundidad, cada uno capturando una característica puntual de la imagen. Así, se suele decir que una capa tiene varios *canales*.

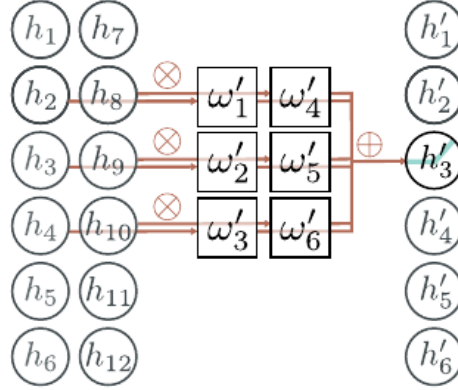


Figura 2.6: Fuente: [14]. La capa de neuronas  $h_i$  tiene dos canales: aquel formado por las neuronas  $h_1$  a  $h_6$  y aquel formado por las neuronas  $h_7$  a  $h_{12}$ . La capa de neuronas  $h'_i$  aplica un filtro de tamaño  $l = 3$  sobre cada uno de los canales de la capa anterior. Por lo tanto ahora termina habiendo  $2 \times 3 = 6$  pesos entre cada neurona de la capa  $h'_i$  y la capa  $h_i$ .

Algo que cabe notar en este punto es que cuando una neurona aplica el filtro correspondiente sobre las de la capa anterior, si esta última tiene varios canales, entonces el filtro es aplicado en todos ellos. Es decir, si por ejemplo la capa anterior tenía  $C$  canales y el filtro tiene tamaño  $l$ , entonces al aplicar el filtro, ahora vamos a tener una cantidad de pesos  $l \times C$ . Esto se puede ver en la Figura 2.6.

Además de la cantidad de filtros en una capa, y su tamaño  $l$ , existen otros hiperparámetros de las capas convolucionales:

- El **paso** (*stride*), que representa la distancia entre dos campos receptivos consecutivos. Un stride igual a 1 quiere decir que el filtro se aplica en cada posición de la entrada.
- El **relleno** (*padding*), que controla cuántos valores “fantasma” se agregan artificialmente a los extremos de la entrada de forma tal que el tamaño de la salida de la convolución no sea tanto menor al de la entrada. En la práctica, se usa el 0 para este relleno (*zero-padding*). Con esto, se puede computar el valor de  $z_1$  que presentamos como ejemplo anteriormente.
- La **dilatación** (*dilation*), que determina cuántos 0s se intercalan en los pesos del filtro. Con este parámetro, se puede convertir un filtro de  $l = 5$  a uno “dilatado” de tamaño 3 fijando el segundo y cuarto elementos en 0. Esto permite seguir “integrando” la información de una región de la entrada de tamaño 5 pero requiriendo solamente 3 pesos para hacerlo [14].

Otros de los componentes particulares de las RNCs son las capas de *pooling*, cuyo objetivo principal es reducir el tamaño del mapa producido por la convolución [3]. Es



decir, se aplican luego de la convolución y lo que hacen es reemplazar valores contiguos presentes en una determinada sección del mapa por una medida resumen de ellos, entre las cuales algunas comúnmente utilizadas son el máximo (*max pooling*) y el promedio (*average pooling*). Esta reducción de tamaño no solo disminuye la cantidad de parámetros sino que también hace a la red más robusta ante desplazamientos de la imagen [3].

Una capa convolucional típica de una RNC se compone de tres etapas: en primer lugar, se producen las convoluciones, que se encargan de producir activaciones lineales; luego, cada una de estas activaciones pasa por una función de activación no lineal; y finalmente se aplica pooling para reducir (aún más) el tamaño de la salida [5]. Y así, una Red Neuronal Convolucional profunda se compone de varias de estas capas.

## 2.5. Redes Neuronales Recurrentes

Las Redes Neuronales Recurrentes (RNR) son una familia de redes neuronales pensadas específicamente para trabajar con **datos secuenciales** en donde el orden importa. Es por esto que han sido y continúan siendo muy útiles en tareas como análisis de series temporales y procesamiento de lenguaje natural. Se emplean por ejemplo para predecir cuáles van a ser los próximos valores en una serie de tiempo, cuáles van a ser las palabras que continúan una oración, y también para clasificar series de tiempo, que es para lo que las usaremos nosotros.

A diferencia de las redes feedforward como las que venimos presentando hasta el momento, en donde la información fluye solamente en una dirección, pasando de las neuronas de una capa a las de la capa siguiente, lo que caracteriza a las RNR es la presencia de ciclos en su grafo. Estos ciclos hacen que las neuronas de la red puedan tomar como entradas sus propias salidas de pasos anteriores, permitiéndole a la red de esta forma tener un **estado interno** o **memoria**: entradas recibidas en pasos más tempranos afectan la respuesta de la red ante la entrada actual [20].

Para comprender un poco más este comportamiento, tomemos la más simple de las RNR, compuesta por una única neurona (oculta) que recibe la entrada correspondiente al tiempo  $t$ , produce una salida y se la envía a sí misma [3], como se puede ver a la izquierda del Diagrama 2.7. Así, en cada paso  $t$ , la neurona “*recurrente*” recibe no solo la entrada  $x_t$  sino también su propia salida computada en el paso anterior,  $y_{t-1}$ . Esto se hace aún más evidente cuando “desenrollamos” la red a lo largo del tiempo, cuya representación se encuentra a la derecha de la Figura 2.7 y se asemeja a la de una feedforward.

Cada neurona realiza lo mismo que en una red feedforward, en el sentido que computan una suma pesada de sus entradas y aplican una función de activación sobre esta. Sin embargo, a partir de la Figura 2.7, podemos notar dos particularidades con respecto a las redes recurrentes:

- Por un lado, cada neurona tiene un peso extra además del que se aplica sobre la entrada  $x_t$ , el cual está denotado en la Figura con  $w_{x,f}$ . Este peso extra corresponde

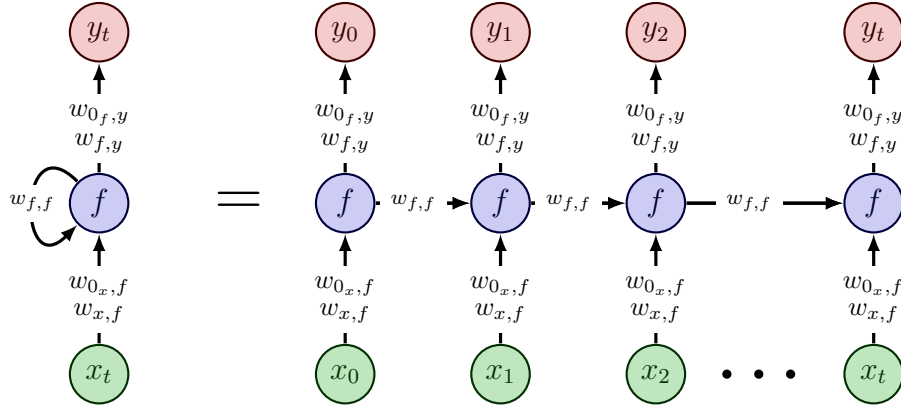


Figura 2.7: A la izquierda, se ve la más simple de las Redes Neuronales Recurrentes, con solamente la capa de entrada, una capa oculta formada por una neurona con su respectiva conexión recurrente, y la capa de salida. A la derecha, se ve la misma red pero “desenrollada” a lo largo del tiempo. Asumiremos por simplicidad que tanto la entrada como la salida en cada momento  $t$  son simplemente números real, es decir  $x_t, y_t \in \mathbb{R} \forall t$ . Denotamos con  $w_{x,f}$  al peso que va desde la entrada a la neurona oculta, con  $w_{0_x,f}$  al asociado a la neurona dummy con valor fijo en 1 que está en la entrada, con  $w_{f,y}$  al que va desde la neurona oculta hasta la capa de salida, con  $w_{0_f,y}$  al bias entre la oculta y la de salida, y con  $w_{f,f}$  al peso que aplica la neurona sobre su propia salida del paso anterior.

al que se aplica sobre la salida de la neurona en el paso anterior  $f_{t-1}$ , denotado con  $w_{f,f}$ .

- Por otro lado, la red utiliza los mismos pesos  $w_{x,f}$ ,  $w_{f,f}$  y  $w_{f,y}$  en *todos* los pasos de tiempo.

Con esto en cuenta, vamos a tener que el cómputo llevado a cabo por la red en cada paso de tiempo  $t$  está dado por:

$$\begin{aligned} f_t &= a_f(w_{x,f}x_t + w_{f,f}f_{t-1} + w_{0_f,y}) \\ y_t &= a_y(w_{f,y}f_t + w_{0_f,y}) \end{aligned}$$

donde  $a_f$  denota la función de activación seleccionada para la capa oculta y  $a_y$  la de la capa de salida. Algo que vale la pena aclarar es que para el primer paso de tiempo, lo que sería la salida del paso anterior se establece manualmente, como por ejemplo con el valor 0.

Nos concentremos en la salida de la neurona recurrente en el tiempo  $t$ , es decir en  $f_t$ , dejando la salida de la red  $y_t$  de lado. A partir de las Ecuaciones anteriores, podemos ver lo que venimos explicando:  $f_t$  es una función de tanto la entrada en el tiempo actual  $x_t$  y

de su salida en el paso anterior  $f_{t-1}$ . Entonces, si tomamos un  $t' > 0$  fijo, vamos a tener que:

- $f_{t'}$  es una función de  $x_{t'}$  y de  $f_{t'-1}$ , pero
- $f_{t'-1}$  es a su vez una función de  $x_{t'-1}$  y de  $f_{t'-2}$ , pero
- $f_{t'-2}$  es a su vez una función de  $x_{t'-2}$  y de  $f_{t'-3}$ ,
- y así sucesivamente

Este comportamiento hace que  $f_{t'}$  sea una función de todas las entradas vistas desde  $t = 0$ , constituyendo de esta forma una especie *memoria*, que se suele llamar **estado oculto** de la neurona. En este caso, como la red solamente tiene una capa oculta con una neurona recurrente, el estado oculto de la neurona coincide con el estado oculto de la red.

De la misma forma en que lo hicimos anteriormente para las redes feedforward, podemos empezar a complejizar esta red agregando varias neuronas recurrentes en la capa oculta, cada una con su propio ciclo, como se puede ver en la Figura 2.8.

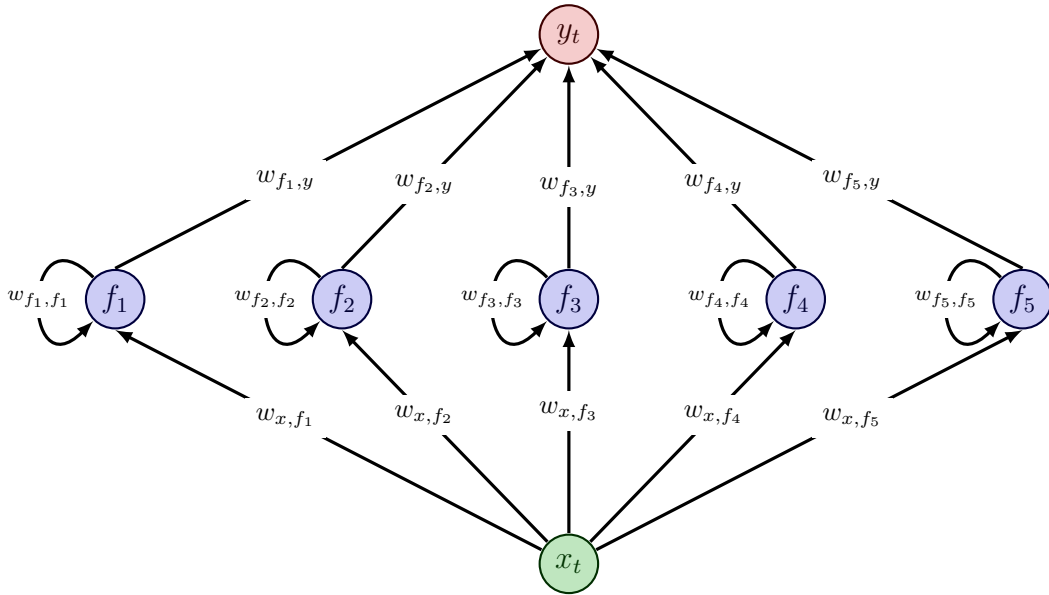


Figura 2.8: Red Neuronal Recurrente con una capa oculta de 5 neuronas recurrentes, cada una con su ciclo. Similarmente al Diagrama anterior, denotamos con ... **TODO**

Con esto, vamos a tener que el estado oculto de la red va a ser un vector formado por el estado oculto de las 5 neuronas. O sea, si denotamos con  $f_t$  al estado oculto de la red en el tiempo  $t$  y con  $f_{i_t}$  al estado oculto de la neurona oculta  $i$ , en el tiempo  $t$  vamos a tener que:

$$f_t = (f_{1_t}, f_{2_t}, f_{3_t}, f_{4_t}, f_{5_t})$$

Y también podemos volver a utilizar la notación matricial para describir el comportamiento de la red:

$$\begin{aligned} f_t &= \mathbf{a}_t (\mathbf{W}_x x^T + \mathbf{W}_f f_{t-1}^T) \\ y_t &= \mathbf{a}_y (\mathbf{W}_y f_t) \end{aligned}$$

donde:

- $\mathbf{a}_t$  es la función de activación de la capa oculta, aplicada elemento a elemento, es decir  $\mathbf{a}_t(x_0, x_1, \dots, x_n) = (a_t(x_0), a_t(x_1), \dots, a_t(x_n))$ .
- $\mathbf{W}_x$  es la matriz de tamaño  $k \times (n+1)$  de pesos que salen desde la capa de entrada hasta la capa oculta, incluyendo el bias, donde  $k$  es el número de neuronas en la capa oculta y  $n$  el tamaño de la entrada.
- $x^T$  es el vector transpuesto de la entrada, junto con el 1 del bias. En este caso, estamos asumiendo  $x \in \mathbb{R}$ .
- $\mathbf{W}_f$  es la matriz diagonal de tamaño  $k \times k$  de pesos recurrentes. En cada elemento de la diagonal  $i$  se encuentra el peso que va desde la neurona  $i$  a sí misma, es decir  $w_{f_i, f_i}$ .
- $f_{t-1}^T$  es el estado oculto de la red en el paso de tiempo anterior.
- $\mathbf{a}_y$  es la función de activación de la capa de salida, aplicada elemento a elemento, al igual que  $\mathbf{a}_t$ .
- $\mathbf{W}_y$  es la matriz de tamaño  $o \times (k+1)$  de pesos que van desde la capa oculta hasta la capa de salida, incluyendo el bias, donde  $o$  es el tamaño de la salida. En nuestra red, tomamos  $o = 1$ .

Al igual que antes, se pueden agregar más capas de neuronas recurrentes a la red, permitiendo de esta manera que cada capa tenga su propio estado oculto. En este caso, lo que va a ocurrir es que el estado oculto producido por las neuronas de una capa

## El problema del Gradiente Desvaneciente

### 2.5.1. Long Short-Term Memory

Las redes conocidas como Long Short-Term Memory (LSTM) son un tipo particular de RNRs que fueron introducidas en el año 1997 en [6] para solucionar el problema del gradiente desvaneciente que tenían las RNRs estándar, lo que las hace capaces de aprender dependencias de largo plazo. Han demostrado funcionar de manera efectiva en una gran variedad de problemas, y los mayores avances obtenidos con redes recurrentes se han logrado utilizando esta arquitectura [13].

Como hemos visto hasta el momento, todas las redes recurrentes tienen una estructura de cadena de “módulos” o “bloques” [13] - las neuronas recurrentes -, es decir, unidades que se repiten a lo largo de la secuencia temporal. En una RNR estándar, este módulo es simplemente una aplicación de una función de activación, particularmente la tangente hiperbólica, sobre una suma pesada de sus entradas. En las LSTM, estas neuronas se complejizan para incorporar mecanismos que permiten mantener una memoria a largo plazo en la red. Las llamaremos “celdas” o neuronas LSTM.

El principal componente que introducen las LSTM para poder retener información por largos períodos de tiempo es el **estado de celda**, que denotaremos con la letra  $C$ . La particularidad de este estado es que a medida que “fluye” por la red, se mantiene prácticamente intacto, salvo por algunas interacciones lineales [13], pero no es afectado por ningún peso o bias, lo que permite justamente solucionar el problema del gradiente desvaneciente.

Así, vamos a tener dos estados que interactúan entre sí para realizar predicciones:

- Por un lado, el **estado de celda**, que representa la **memoria a largo plazo** de la red, y no es afectado por ningún peso o bias.
- Por otro lado, el **estado oculto** (del que venimos hablando), que representa la **memoria a corto plazo** de lado, y sí es calculado por medio de sumas pesadas en donde hay pesos y biases.

Ahora bien, con este nuevo elemento, la idea es que la red aprenda qué almacenar en este estado de celda, qué descartar y qué leer de él [3], y a esto lo hace a través de otros nuevos elementos llamados **compuertas**. En particular, se introducen tres tipos de compuertas:

- **Compuerta de olvido  $f$**  (del inglés *forget*): determina si cada elemento del estado de celda es recordado (copiado al paso siguiente) u olvidado, fijándolo en 0.
- **Compuerta de entrada  $i$**  (del inglés *input*): determina si cada elemento del estado de celda es actualizado agregando nueva información del vector de entrada en el paso de tiempo actual.
- **Compuerta de salida  $o$**  (del inglés *output*):

De esta forma, las compuertas son una manera de opcionalmente dejar pasar información [13]. Los valores de estas están siempre en el rango  $[0, 1]$  y se obtienen como la salida de una función sigmoide aplicada sobre la entrada actual y el estado oculto anterior [20]. El valor entre 0 y 1 representa la proporción de información que se deja pasar a través de la compuerta correspondiente.

A continuación, detallamos las operaciones producidas por una celda LSTM en un paso de tiempo. Utilizaremos la siguiente notación:

- $\mathbf{x}_t$  para el vector de entrada del tiempo  $t$ .
- $\mathbf{h}_t$  para el estado oculto en el tiempo  $t$ .
- $C_t$  para el estado de celda en el tiempo  $t$ .
- $\tilde{C}_t$  para el “potencial” estado de celda en el tiempo  $t$ .
- $f_t, i_t, o_t$  para las salidas de las compuertas de olvido, entrada y salida en el tiempo  $t$  respectivamente.
- $\mathbf{W}$  para denotar la matriz de pesos que se aplica sobre la entrada.
- $\mathbf{W}$  para denotar la matriz de pesos que se aplica sobre el estado oculto.

La celda toma tres entradas: el estado de celda del paso anterior  $C_{t-1}$ , el estado oculto del paso anterior  $\mathbf{h}_{t-1}$ , y el vector de entrada del paso actual  $\mathbf{x}_t$ .

La primera compuerta que actúa es la de olvido, para determinar que información ya presente en el estado de celda se “sigue recordando”. Esta decisión se toma aplicando una función sigmoide aplicada sobre el estado oculto anterior,  $\mathbf{h}_{t-1}$  y la entrada actual  $\mathbf{x}_t$ , produciendo un número entre 0 y 1 para cada valor presente en  $C_{t-1}$ :

$$f_t = \sigma(\mathbf{W}_f \mathbf{x}_t + \mathbf{W}_h \mathbf{h}_{t-1})$$

Este resultado empieza a modificar el estado de celda que teníamos hasta el momento:

$$C_t = C_{t-1} f_t$$

El próximo paso es decidir qué nueva información ingresa a  $C_t$ . Este esta compuesto por dos partes:

- Por un lado, se calcula una “potencial memoria a largo plazo”  $\tilde{C}_t$ . Esto se hace combinando el estado oculto del paso anterior  $\mathbf{h}_{t-1}$  y la entrada actual  $\mathbf{x}_t$  (con pesos distintos a los del paso anterior) y aplicando una tangente hiperbólica sobre esta combinación:

$$\tilde{C}_t = \tanh(\mathbf{W}_i)$$

- Por el otro, a través de la compuerta de entrada, se calcula qué porcentaje de la potencial memoria a largo plazo ingresa al estado de celda.

### 2.5.2. Gated Recurrent Unit

## 2.6. Clasificación de Series de Tiempo

Una **serie de tiempo** es una secuencia **ordenada** de valores medidos sucesivamente en intervalos de tiempo igualmente espaciados [8]. Este tipo de datos está presente en distintos fenómenos, como lecturas meteorológicas, registros financieros, señales fisiológicas, y observaciones industriales [21].

Formalmente, una serie de tiempo **univariada**  $U$  es un conjunto ordenado de valores reales  $U = (x_1, x_2, \dots, x_N)$ , y su dimensión está dada por la cantidad  $N$  de valores [8].

### 2.6.1. Clasificación de Series de Tiempo con Aprendizaje Automático

Teniendo una definición de una serie de tiempo, el problema de **Clasificación de Series de Tiempo** (CST) consiste en: dado un conjunto de clases o categorías  $Y$ , y un conjunto de datos  $D$  formado por series de tiempo univariadas  $U_i$  donde a cada una le corresponde una etiqueta  $y(U_i) \in Y$ , el objetivo es encontrar una función  $f$ , a la que llamaremos “clasificador” o “modelo” de forma tal que  $f(U) = y(U)$  [8]. Como venimos explicando, un buen modelo será uno que pueda capturar y generalizar el patrón de las series de datos de forma tal que sea capaz de clasificar correctamente nuevos datos. El repositorio que se suele tomar como referencia para evaluar los diferentes modelos de CST es el de la Universidad de California Riverside, llamado *UCR Time Series Classification Archive* [2].

Durante las últimas décadas, se han propuestos diferentes métodos para afrontar este problema. Los primeros trabajaban directamente sobre las series de tiempo utilizando alguna medida de similitud predefinida que pueda capturar la similitud entre ellas, como por ejemplo la distancia euclídeana o la deformación dinámica del tiempo (*Dynamic Time Warping*) [21].

Se han desarrollado también algoritmos basados en características o *features*, en donde cada serie temporal es convertida en un conjunto de features globales, que es posteriormente usando para definir la semejanza entre pares de series de tiempo [8]. Algunos de los más conocidos son ...

El gran problema de todas las estrategias mencionadas es que requieren un gran preprocesamiento de los datos y una ingeniería de atributos (*feature engineering*) [21], para lo cual generalmente se necesita tener un buen conocimiento de campo sobre las series sobre las que se está trabajando.

Es por esto que recientemente, las redes neuronales profundas han comenzado a ser utilizadas para clasificar series temporales [21] ya que permiten trabajar de forma directa con los datos, y se encargan de detectar automáticamente cuáles son las características

que distinguen a las series. Algunas arquitecturas utilizadas hasta el momento son el perceptrón multicapa [21], redes neuronales convolucionales [21], y estas últimas combinadas con unidades LSTM unidireccionales [7] y bidireccionales [8].



## Capítulo 3

### Presentación del problema

Como explicamos anteriormente, el principal problema en la Evaluación de Impacto de tratamientos sin asignación aleatoria es el de la identificación de un grupo de control o comparación adecuado, que cumpla las características descritas previamente.

Cuando el ingreso al tratamiento por parte de los individuos se realiza en un único instante de tiempo, el grupo de control obtenido mediante la técnica de PSM conforma el mejor estimador del contrafactual. Sin embargo, cuando la entrada al programa ocurre de manera secuencial, los modelos logísticos no son capaces de gestionar esa probabilidad variable en el tiempo. Lo que se hace entonces es estimar la probabilidad por camada de ingreso al programa, es decir se agrupan individuos que hayan ingresado al tratamiento en temporalidades similares, y se buscan controles separadamente para cada una de estas camadas.

En este trabajo, exploramos una alternativa distinta para este último caso. Proponemos la utilización de redes neuronales, específicamente del tipo LSTM **y convolucionales????**, capaces de incorporar la dimensión temporal de los datos, para la detección automática de grupos de control, en el caso particular en que el programa en cuestión se implementa **secuencialmente** y existe una **alta dependencia temporal** entre una variable observada de los individuos y el momento de ingreso al tratamiento. El principal objetivo es evaluar el potencial y la efectividad de estas redes para capturar dependencias dinámicas y características temporales inherentes a los datos observados, para de esta forma mejorar el proceso de inferencia causal en la evaluación de impacto.



# Capítulo 4

## Marco Experimental

### 4.1. Conjuntos de Datos

A continuación, detallamos la metodología utilizada para llevar a cabo las simulaciones y medir el desempeño de las redes, y explicamos cómo este problema se termina enmarcando dentro de una clasificación de series de tiempo.

El primer paso para poder llevar a cabo los experimentos es contar con datos. Nuestro entorno - *framework* - de simulación está diseñado para generar **datos sintéticos** que imiten escenarios reales en donde la asignación al tratamiento es no aleatoria, escalonada y potencialmente dependiente de resultados pasados.

El proceso de generación de datos involucra la creación de una serie de tiempo univariada para cada individuo, que incorpora efectos fijos, componentes autoregresivos e impactos del tratamiento. Trabajamos bajo el supuesto que el comportamiento dinámico de la variable modelada para cada unidad es el que determina si esta ingresa al tratamiento o no, y es la misma sobre la que se espera que el tratamiento tenga un efecto.

Los parámetros para la generación de los datos son los siguientes:

- `n_sample`: cantidad de individuos en la simulación.
- `treated_pct`: porcentaje de individuos tratados.
- `control_pct`: porcentaje de individuos de control.
- `T`: cantidad de períodos observados de cada individuo.
- `first_tr_period`: primer período de tratamiento (o único, dependiendo de la cantidad de cohortes).
- `n_cohorts`: cantidad de cohortes.
- `phiT`: persistencia auto-regresiva para los tratados.
- `phiC`: persistencia auto-regresiva para los controles.

- `n_dep_periods`: cantidad de períodos de dependencia para la participación en el tratamiento.

El resultado de la simulación es un conjunto de datos de panel compuesto por series de tiempo univariadas de longitud  $T$  para los distintos tipos de individuos:

- **Individuos de tipo 1**: son aquellos que han recibido el tratamiento en algún período. Notar que en una situación real, son datos con los que contamos. Los llamaremos también “tratados”.
- **Individuos de tipo 2**: son aquellos que en los datos sintéticos, sabemos que forman parte del grupo de control. Es importante notar que en un escenario real, no sabemos quiénes son estos individuos sino que son los que tratamos de identificar. Nos referiremos a ellos también como “controles”.
- **Individuos de tipo 3**: son aquellas unidades que no han sido tratadas y que en los datos sintéticos, sabemos que no forman parte del grupo de control. A estos también los mencionaremos como “NiNi” (ni tratado ni control).

En el dataset, cada individuo tiene un identificador y su tipo; y aquellos de tipo 1 y 2 tienen como feature extra el período (desde `first_tr_period` hasta `first_tr_period + n_cohorts`) en el que ingresaron al programa. A continuación, se muestran algunos ejemplos, tomando  $T = 6$ , `first_tr_period = 3` y `n_cohorts = 2`:

En este punto cabe recordar cuál es nuestra meta: a partir de información sobre los individuos que fueron tratados, queremos identificar de entre los no tratados, quiénes son los que podrían formar parte del grupo de control.

También resulta muy importante tener en cuenta que en los datos generados sintéticamente, sabemos quiénes son los controles, pero en la realidad esto es justamente lo que queremos identificar.

Ahora bien, para entrenar y evaluar a nuestros modelos, tomamos en cuenta lo que ocurriría en un escenario real, en el que sabríamos solamente quiénes son los tratados y quiénes los no tratados. Por lo tanto, construimos el conjunto de entrenamiento con la totalidad de los individuos de tipo 1 con etiqueta 1 y algunos de tipo 3 con etiqueta 0, y en el conjunto de test colocamos a todos los de tipo 2, queriendo predecir en ellos un 1, y al resto de tipo 3, queriendo predecir en ellos un 0.

Más aún, como queremos identificar a los grupos de control de cada cohorte,

## 4.2. Arquitecturas de Redes Neuronales

## 4.3. Herramientas

A continuación, nombramos las herramientas que nos ayudaron a llevar a cabo los experimentos, desde la generación de datos sintéticos hasta el diseño, entrenamiento y

evaluación de los modelos, junto con la búsqueda de hiperparámetros óptimos.

**4.3.1. Hardware****4.3.2. Python****4.3.3. PyTorch****4.3.4. Pandas****4.3.5. Numpy****4.3.6. Jupyter****4.3.7. Optuna****4.3.8. MLflow**



# Capítulo 5

## Resultados





## Capítulo 6

### Conclusiones y Trabajos Futuros



# Bibliografía

- [1] Raquel Bernal y Ximena Peña. *Guía práctica para la evaluación de impacto*. 1.<sup>a</sup> ed. Universidad de los Andes, Colombia, 2011. ISBN: bernal2011. URL: <http://www.jstor.org/stable/10.7440/j.ctt1b3t82z> (visitado 10-02-2025).
- [2] Hoang Anh Dau et al. *The UCR Time Series Classification Archive*. [https://www.cs.ucr.edu/~eamonn/time\\_series\\_data\\_2018/](https://www.cs.ucr.edu/~eamonn/time_series_data_2018/). Oct. de 2018.
- [3] Aurélien Géron. *Hands-On Machine Learning with Scikit-Learn and TensorFlow*. 1st. O'Reilly Media, 2017. ISBN: 9781491962299.
- [4] Paul Gertler et al. *La evaluación de impacto en la práctica: Segunda edición*. Banco Internacional para la Reconstrucción y el Desarrollo/Banco Mundial, 2016. DOI: <https://doi.org/10.18235/0006529>. URL: <https://hdl.handle.net/10986/25030>.
- [5] Ian Goodfellow, Yoshua Bengio y Aaron Courville. *Deep Learning*. <http://www.deeplearningbook.org>. MIT Press, 2016.
- [6] Sepp Hochreiter y Jürgen Schmidhuber. «Long Short-Term Memory». En: *Neural Computation* 9 (nov. de 1997), págs. 1735-1780. DOI: 10.1162/neco.1997.9.8.1735.
- [7] Fazle Karim et al. «LSTM Fully Convolutional Networks for Time Series Classification». En: *IEEE Access* 6 (2018), págs. 1662-1669. ISSN: 2169-3536. DOI: 10.1109/access.2017.2779939. URL: <http://dx.doi.org/10.1109/ACCESS.2017.2779939>.
- [8] Riaz A. et al. Khan M. Wang H. «Bidirectional LSTM-RNN-based hybrid deep learning frameworks for univariate time series classification». En: *The Journal of Supercomputing* (2021), págs. 7021-7045. URL: <https://doi.org/10.1007/s11227-020-03560-z>.
- [9] Sebastian Martinez, Sophie Naudeau y Vitor Azevedo Pereira Pontual. «The promise of preschool in Africa : a randomized impact evaluation of early childhood development in rural Mozambique (English)». En: (2012). URL: <http://documents.worldbank.org/curated/en/819111468191961257>.

- [10] Warren McCulloch y Walter Pitts. «A logical calculus of the ideas immanent in nervous activity». En: *The bulletin of mathematical biophysics* (19430). URL: <https://doi.org/10.1007/BF02478259>.
- [11] Tom M. Mitchell. *Machine Learning*. McGraw-hill, 1997. ISBN: 0070428077.
- [12] Izaak Neutelings. *Neural Networks with TikZ*. URL: [https://tikz.net/neural\\_networks/](https://tikz.net/neural_networks/).
- [13] Christopher Olah. *Understanding LSTM Networks*. 2015. URL: <http://colah.github.io/posts/2015-08-Understanding-LSTMs/>.
- [14] Simon J.D. Prince. *Understanding Deep Learning*. The MIT Press, 2024. URL: <http://udlbook.com>.
- [15] *Programa Jornada Extendida y su impacto en el clima escolar*. Informe de evaluación de impacto. Publicado en la Biblioteca Digital de la UEICEE. Unidad de Evaluación Integral de la Calidad y Equidad Educativa (UEICEE), Ministerio de Educación, Gobierno de la Ciudad de Buenos Aires, 2023. URL: <https://bde-ueicee.bue.edu.ar/documentos/708-programa-jornada-extendida-y-su-impacto-en-el-clima-escolar>.
- [16] PAUL R. ROSENBAUM y DONALD B. RUBIN. «The central role of the propensity score in observational studies for causal effects». En: *Biometrika* 70.1 (1983), págs. 41-55. ISSN: 0006-3444. DOI: 10.1093/biomet/70.1.41. URL: <https://doi.org/10.1093/biomet/70.1.41>.
- [17] Frank Rosenblatt. «The Perceptron: A Probabilistic Model for Information Storage and Organization in the Brain». En: *Psychological Review* 65.6 (1958), págs. 386-408. DOI: 10.1037/h0042519.
- [18] Donald Rubin. «ESTIMATING CAUSAL EFFECTS OF TREATMENTS IN EXPERIMENTAL AND OBSERVATIONAL STUDIES». En: *Journal of Educational Psychology* 66.5 (1974), págs. 688-701. DOI: <https://doi.org/10.1002/j.2333-8504.1972.tb00631.x>. URL: <https://onlinelibrary.wiley.com/doi/abs/10.1002/j.2333-8504.1972.tb00631.x>.
- [19] David E. Rumelhart, Geoffrey E. Hinton y Ronald J. Williams. «Learning representations by back-propagating errors». En: *Nature* (1986). DOI: 10.1038/323533a0. URL: <https://doi.org/10.1038/323533a0>.
- [20] Stuart J. Russell y Peter Norvig. *Artificial Intelligence: A Modern Approach*. 4, Global Edition. Pearson Education, 2020. ISBN: 9781292401133.
- [21] Zhiguang Wang, Weizhong Yan y Tim Oates. *Time Series Classification from Scratch with Deep Neural Networks: A Strong Baseline*. 2016. arXiv: 1611.06455 [cs.LG]. URL: <https://arxiv.org/abs/1611.06455>.

- [22] Howard White. «Theory-based impact evaluation: principles and practice». En: *Journal of development effectiveness* 1.3 (2009), págs. 271-284.

