

Temperatura Crítica de Superconductores

¿Es suficiente una regresión múltiple?

Grupo A - Estadística

Pontificia Universidad Católica de Chile

Facultad de Matemáticas

EYP2307 - Análisis de Regresión

1 de Diciembre de 2020



Contenido

Avance 1

Nuevos modelos

Elegimos modelo

Ridge y Lasso Regression

Conclusiones

Referencias bibliográficas



Contenido

Avance 1

Nuevos modelos

Elegimos modelo

Ridge y Lasso Regression

Conclusiones

Referencias bibliográficas



Recursos Utilizados

1. Usamos RStudio.
2. R Markdown y R Sweave.
3. GitHub.
4. Bases de datos.
 - ▶ `train.csv`
 - ▶ `unique_m.csv`



Resumen del Avance 1

- ▶ El objetivo era predecir la Temperatura Crítica de los Superconductores, con un modelo de regresión lineal simple.
- ▶ Se limpió la base de datos: de **169** variables se pasaron a **34**.
- ▶ Se hizo un modelo de regresión simple con la variable `std_ThermalConductivity`, ya que es modelo con mejor R^2 respecto `critical_temp` ($R^2 = \mathbf{0.43}$).



Resumen del Avance 1

- ▶ Buscamos alternativas para mejorar el R^2 .
- ▶ Se crearon **7** bases de datos según range_Valence, ya que es la variable categórica que mejores correlaciones nos da.
- ▶ Finalmente obtuvimos **7** modelos para predecir la variable respuesta, con un R^2 conjunto igual a **0.56**.



Objetivo del Avance 2

- Predecir la temperatura crítica de los superconductores en base a nuestra variable respuesta, aplicando nuevas herramientas para mejorar los resultados obtenidos en el Avance 1.



Contenido

Avance 1

Nuevos modelos

Elegimos modelo

Ridge y Lasso Regression

Conclusiones

Referencias bibliográficas



Nuevos modelos

- ▶ Creamos una serie de nuevos modelos de regresión lineal múltiple:
 1. *Backward*.



Nuevos modelos

- ▶ Creamos una serie de nuevos modelos de regresión lineal múltiple:
 1. *Backward*.
 2. *Forward*.



Nuevos modelos

- ▶ Creamos una serie de nuevos modelos de regresión lineal múltiple:
 1. *Backward*.
 2. *Forward*.
 3. *Backward-Forward*.



Nuevos modelos

- ▶ Creamos una serie de nuevos modelos de regresión lineal múltiple:
 1. *Backward*.
 2. *Forward*.
 3. *Backward-Forward*.
 4. *add1*.



Nuevos modelos

- ▶ Creamos una serie de nuevos modelos de regresión lineal múltiple:
 1. *Backward*.
 2. *Forward*.
 3. *Backward-Forward*.
 4. *add1*.
 5. *drop1*.



Nuevos modelos

- ▶ Creamos una serie de nuevos modelos de regresión lineal múltiple:
 1. *Backward*.
 2. *Forward*.
 3. *Backward-Forward*.
 4. *add1*.
 5. *drop1*.
 6. *VIF*.



Nuevos modelos

- ▶ Creamos una serie de nuevos modelos de regresión lineal múltiple:
 1. *Backward*.
 2. *Forward*.
 3. *Backward-Forward*.
 4. *add1*.
 5. *drop1*.
 6. *VIF*.
 7. Modelo con la idea del Avance **1**.



Nuevos modelos

- ▶ Creamos una serie de nuevos modelos de regresión lineal múltiple:
 1. *Backward*.
 2. *Forward*.
 3. *Backward-Forward*.
 4. *add1*.
 5. *drop1*.
 6. *VIF*.
 7. Modelo con la idea del Avance 1.
 8. *Ridge Regression*.



Nuevos modelos

- Creamos una serie de nuevos modelos de regresión lineal múltiple:

1. *Backward.*
2. *Forward.*
3. *Backward-Forward.*
4. *add1.*
5. *drop1.*
6. *VIF.*
7. Modelo con la idea del Avance 1.
8. *Ridge Regression.*
9. *Lasso Regression.*



Nuevos modelos

- ▶ Se utilizó la base de datos limpiada en el Avance **1** para trabajar solo con **34** variables.



Nuevos modelos

- ▶ Se utilizó la base de datos limpiada en el Avance **1** para trabajar solo con **34** variables.
- ▶ Se solucionó el problema de multicolinearidad en cada modelo viendo el *VIF* (Excepto en *Ridge* y *Lasso Regression*).



Nuevos modelos

- ▶ Se utilizó la base de datos limpiada en el Avance **1** para trabajar solo con **34** variables.
- ▶ Se solucionó el problema de multicolinearidad en cada modelo viendo el *VIF* (Excepto en *Ridge y Lasso Regression*).
- ▶ En todos los modelos se usó criterio AIC (excepto en Modelo con VIF).



Modelo con *Backward*

- ▶ Multicolinealidad → **2** variables eliminadas.



Modelo con *Backward*

- ▶ Multicolinealidad → **2** variables eliminadas.
- ▶ Modelo conformado finalmente por **27** β 's.



Modelo con *Forward*

- Multicolinealidad → **4** variables eliminadas.



Modelo con *Forward*

- ▶ Multicolinealidad → **4** variables eliminadas.
- ▶ Modelo conformado finalmente por **28** β 's.



Modelo con *Backward-Forward*

- ▶ Multicolinealidad → **2** variables eliminadas.



Modelo con *Backward-Forward*

- ▶ Multicolinealidad → **2** variables eliminadas.
- ▶ Modelo conformado finalmente por **27** β 's.



Modelo con add1

- ▶ Multicolinealidad → **3** variables eliminadas.



Modelo con add1

- ▶ Multicolinealidad → **3** variables eliminadas.
- ▶ Modelo conformado finalmente por **28** β 's.



Modelo con drop1

- Multicolinealidad → **1** variable eliminada.



Modelo con drop1

- ▶ Multicolinealidad → **1** variable eliminada.
- ▶ Modelo conformado finalmente por **25** β 's.



Modelo con VIF

- ▶ Se consideró el modelo conformado por todas las variables de la base de datos.



Modelo con VIF

- ▶ Se consideró el modelo conformado por todas las variables de la base de datos.
- ▶ Se fue eliminando el problema de multicolinealidad progresivamente.



Modelo con VIF

- ▶ Se consideró el modelo conformado por todas las variables de la base de datos.
- ▶ Se fue eliminando el problema de multicolinealidad progresivamente.
- ▶ Modelo conformado finalmente por **28** variables.



Modelo con la idea del Avance 1

- ▶ Se crearon **7** bases de datos según `range_Valence`.



Modelo con la idea del Avance 1

- ▶ Se crearon **7** bases de datos según `range_Valence`.
- ▶ Se creó un modelo para cada base de datos mediante selección *Backward*.



Modelo con la idea del Avance 1

- ▶ Se crearon **7** bases de datos según `range_Valence`.
- ▶ Se creó un modelo para cada base de datos mediante selección *Backward*.
- ▶ Cantidad de variables:
 1. Modelo para `range_Valence = 0`: **25** variables.
 2. Modelo para `range_Valence = 1`: **23** variables.
 3. Modelo para `range_Valence = 2`: **24** variables.
 4. Modelo para `range_Valence = 3`: **25** variables.
 5. Modelo para `range_Valence = 4`: **22** variables.
 6. Modelo para `range_Valence = 5`: **19** variables.
 7. Modelo para `range_Valence = 6`: **27** variables.



Contenido

Avance 1

Nuevos modelos

Elegimos modelo

Ridge y Lasso Regression

Conclusiones

Referencias bibliográficas



AIC, BIC y R^2 de los modelos.

Modelo	AIC	BIC	R^2
<i>Backward</i>	126489.9	127064.9	0.66
<i>Forward</i>	126880.5	127103.5	0.66
<i>Backward-Forward</i>	126849.9	127064.9	0.66
add1	126858.4	127081.4	0.66
drop1	126849.6	127048.7	0.66
VIF	126880.5	127103.5	0.66
Idea Avance 1	121021.6	121840.3	0.74



Modelo Elegido: *Backward*

► abc



Supuesto de *Independencia*

- Se utilizó el Test de *Durbin-Watson*.



Supuesto de *Independencia*

- ▶ Se utilizó el Test de *Durbin-Watson*.
- ▶ Independencia de residuos \Leftrightarrow Valor D entre **1.5** y **2.5**.



Supuesto de *Independencia*

- ▶ Se utilizó el Test de *Durbin-Watson*.
- ▶ Independencia de residuos \Leftrightarrow Valor D entre **1.5** y **2.5**.
- ▶ Valor D = **0.89** \rightarrow No se cumple el supuesto.



Supuesto de *Normalidad*

- ▶ Se utilizó el Test de *Kolmogorov-Smirnov*.



Supuesto de *Normalidad*

- ▶ Se utilizó el Test de *Kolmogorov-Smirnov*.
- ▶ Criterio: valor- $p > \mathbf{0.05}$.



Supuesto de *Normalidad*

- ▶ Se utilizó el Test de *Kolmogorov-Smirnov*.
- ▶ Criterio: valor- $p > \mathbf{0.05}$.
- ▶ El modelo no cumple con este supuesto.



Supuesto de *Normalidad*

- ▶ Se utilizó el Test de *Kolmogorov-Smirnov*.
- ▶ Criterio: valor- $p > \mathbf{0.05}$.
- ▶ El modelo no cumple con este supuesto.
- ▶ *Primera solución aplicada*: Transformación de *Box-Cox*.



Supuesto de *Normalidad*

- ▶ Se utilizó el Test de *Kolmogorov-Smirnov*.
- ▶ Criterio: valor- $p > \mathbf{0.05}$.
- ▶ El modelo no cumple con este supuesto.
- ▶ *Primera solución aplicada*: Transformación de *Box-Cox*.
- ▶ *Segunda solución aplicada*: Transformación de *Johnson*.



Supuesto de *Normalidad*

- ▶ Se utilizó el Test de *Kolmogorov-Smirnov*.
- ▶ Criterio: valor- $p > \mathbf{0.05}$.
- ▶ El modelo no cumple con este supuesto.
- ▶ *Primera solución aplicada*: Transformación de *Box-Cox*.
- ▶ *Segunda solución aplicada*: Transformación de *Johnson*.
- ▶ No se lograron resultados satisfactorios.



Supuesto de *Homocedasticidad*

- ▶ Se utilizó el Test de *Breusch-Pagan*.



Supuesto de *Homocedasticidad*

- ▶ Se utilizó el Test de *Breusch-Pagan*.
- ▶ Criterio: valor-p > 0.05 .



Supuesto de *Homocedasticidad*

- ▶ Se utilizó el Test de *Breusch-Pagan*.
- ▶ Criterio: valor- $p > \mathbf{0.05}$.
- ▶ El modelo no cumple con este supuesto.



Supuesto de *Homocedasticidad*

- ▶ Se utilizó el Test de *Breusch-Pagan*.
- ▶ Criterio: valor- $p > \mathbf{0.05}$.
- ▶ El modelo no cumple con este supuesto.
- ▶ Solución propuesta para Heterocedasticidad:

Weighted Least Squares Regression.



Weighted Least Squares Regression

► abc



Diapositiva

► abc



Contenido

Avance 1

Nuevos modelos

Elegimos modelo

Ridge y Lasso Regression

Conclusiones

Referencias bibliográficas



Ridge Regression

- **Objetivo:** Minimizar **RSS**.



Ridge Regression

- ▶ **Objetivo:** Minimizar **RSS**.
- ▶ *Shrinkage Penalty* : $RSS_{\text{Ridge}} = RSS_{\text{AMC}} + \lambda \sum_{j=1}^p \beta_j^2$.
 - ▶ $\lambda = \mathbf{0}$: $RSS_{\text{Ridge}} = RSS_{\text{AMC}}$.
 - ▶ $\lambda \geq \mathbf{0}$: Impacto en valores de β .
 - ▶ $\lambda \rightarrow \infty$: $\beta \rightarrow \vec{\mathbf{0}}$.



Ridge Regression: λ óptimo

- Es aquel que reduce la mayor varianza del modelo sin apenas perder ajuste.

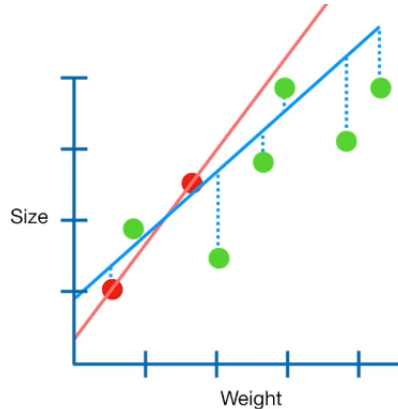


Ridge Regression: λ óptimo

- ▶ Es aquel que reduce la mayor varianza del modelo sin apenas perder ajuste.
- ▶ *Validación cruzada.*



Ridge Regression: Visualización



Ridge Regression: Ventajas

- ▶ Reduce la varianza.



Ridge Regression: Ventajas

- ▶ Reduce la varianza.
- ▶ Datos de Entrenamiento vs. Datos de Prueba.



Ridge Regression: Ventajas

- ▶ Reduce la varianza.
- ▶ Datos de Entrenamiento vs. Datos de Prueba.
- ▶ Minimiza la influencia sobre el modelo de los predictores menos relacionados con la variable respuesta.



Ridge Regression: Limitación

- ▶ Modelo final incluye todos los predictores.



Lasso Regression

- ▶ Misma idea que en *Ridge Regression*.



Lasso Regression

- ▶ Misma idea que en *Ridge Regression*.
- ▶ Realiza selección de predictores.



Lasso Regression

- ▶ Misma idea que en *Ridge Regression*.
- ▶ Realiza selección de predictores.
- ▶ *Shrinkage Penalty* : $RSS_{\text{Lasso}} = RSS_{\text{AMC}} + \lambda \sum_{j=1}^p |\beta_j|$.



Comparación entre *Ridge* y *Lasso Regression*

- Usamos uno u otro dependiendo del escenario.



Comparación entre *Ridge* y *Lasso Regression*

- ▶ Usamos uno u otro dependiendo del escenario.
- ▶ *Ridge Regression*: cuando los $\beta's \neq \mathbf{0}$ y tienen la misma magnitud aproximadamente.



Comparación entre *Ridge* y *Lasso Regression*

- ▶ Usamos uno u otro dependiendo del escenario.
- ▶ *Ridge Regression*: cuando los $\beta's \neq \mathbf{0}$ y tienen la misma magnitud aproximadamente.
- ▶ *Lasso Regression*: cuando un gran grupo de parámetros $\approx \mathbf{0}$.



Resultados de la implementación en R

► *Ridge Regression:*



Resultados de la implementación en R

- ▶ *Ridge Regression*:
- ▶ *Lasso Regression*:



Contenido

Avance 1

Nuevos modelos

Elegimos modelo

Ridge y Lasso Regression

Conclusiones

Referencias bibliográficas



Conclusiones

- Sobre los nuevos modelos.



Conclusiones

- ▶ Sobre los nuevos modelos.
- ▶ Sobre el cumplimiento de los supuestos.



Conclusiones

- ▶ Sobre los nuevos modelos.
- ▶ Sobre el cumplimiento de los supuestos.
- ▶ Sobre *Ridge* y *Lasso Regression*.



Conclusiones

- ▶ Sobre los nuevos modelos.
- ▶ Sobre el cumplimiento de los supuestos.
- ▶ Sobre *Ridge* y *Lasso Regression*.
- ▶ Contraste con Avance 1.



Conclusiones

- ▶ Sobre los nuevos modelos.
- ▶ Sobre el cumplimiento de los supuestos.
- ▶ Sobre *Ridge* y *Lasso Regression*.
- ▶ Contraste con Avance 1.
- ▶ ¿Es suficiente una regresión múltiple?



Contenido

Avance 1

Nuevos modelos

Elegimos modelo




Ridge y Lasso Regression

Conclusiones

Referencias bibliográficas



Referencias bibliográficas

- 
<https://online.stat.psu.edu/stat501/lesson/13/13.1>
Weighted Least Squares.
 2018
- 
https://rpubs.com/Joaquin_AR/242707
Selección de predictores: Ridge y Lasso.
 2016
- 
<https://rstatisticsblog.com/data-science-in-action/machine-learning/ridge-regression-in-r/>
Simple Guide To Ridge Regression In R.
 2020

