

# **Sobre la elección del número de componentes principales,**

## **desde el criterio del codo hasta los resultados de matrices aleatorias**

J. Antonio García R.

5 de febrero, 2019

# Esquema

- Motivación
- Objetivo
- Experimento
  - Instancias
  - EDA
  - Implementación y **determinación del número de componentes**
- Resultados
- Conclusiones
- Trabajos Futuros
- Anexo: Extensiones
- Bibliografía

- Análisis multivariado: número de factores a mantener (PCA, FA, ...)
- Contexto **variables latentes**
- Reducción de dimensión (peculiaridades, cuando  $N \ll p$ )
- Series de tiempo (DFM, multicolinealidad)

# Objetivo

Confrontar la elección del número de factores a considerar, para la tarea de predicción que requieren algunos métodos de reducción de dimensión

Evaluamos el desempeño de regresión por componentes principales (PCR) y la regresión por mínimos cuadrados parciales (PLS).

Muchas técnicas <sup>1</sup> requieren de precisar el número de componentes a utilizar, lo cual involucra un criterio de selección.

---

<sup>1</sup>MDS o la regresión por componentes supervisada,...

# Experimento

Comparamos 3 métodos: El criterio de Kaiser [4] (criticado en sus aspectos teóricos y muestrales en [3]), el Parallel Analysis y proponemos uno basado en el teorema de Marchenko-Pastur

El **Parallel Analysis** conlleva simular matrices de correlación de una función de distribución multivariada desconocida por lo que es imperativo una implementación eficiente.

# El experimento

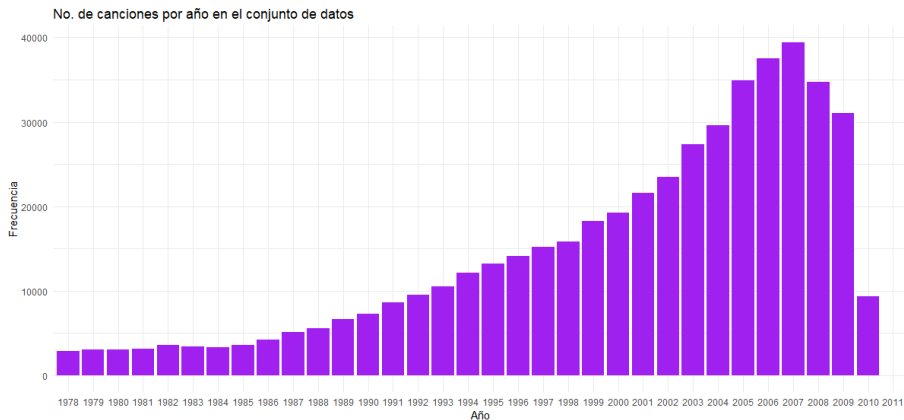
Se construyeron tres instancias, con las mismas dimensiones ( $515,345 \times 90$ ) y con la misma partición para entrenamiento y prueba (463,715 y 51,630)

$$Y = \sum_{i=0}^{90} x_i \beta_i + e_i$$

- La primera consiste en 90 variables con distribución  $N(0, \sigma_i)$ .
- La segunda con 90 variables con distribución  $Rayleigh(\sigma_i)$ .
- La tercera es uno de los datasets de *Million Song Dataset*, con información de canciones <sup>2</sup>. Lanzadas en [1978,2011]

---

<sup>2</sup>Tiene entre uno de sus fines alentar la investigación en algoritmos a escalas comerciales (por lo cual lo encontramos de interés)



**Figura 1:** No. de canciones por año en el conjunto de datos de la instancia 3

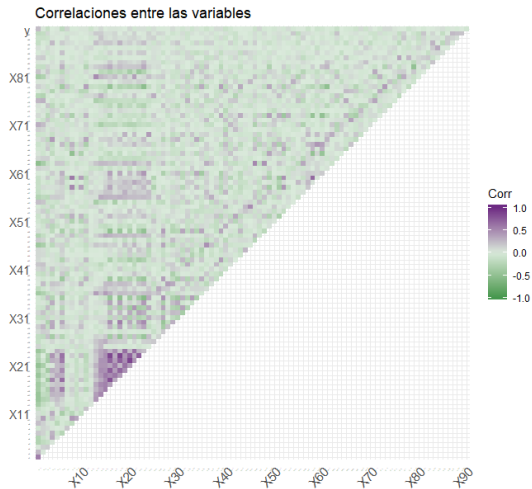
# PCA



**Figura 2:** Proyección de dos muestras (0.1 % y 1 % del total ), varianza explicada 19 %.



# Linealidad ?



**Figura 3:** Correlación entre  $Y$  y las variables exógenas.

# Implementación

- Kaiser: Eigendescomposición
- Parallel analysis:
  - Muestreo apriori
  - Bootstrap
- M-K: Simulación y promedio  $O(n)$

La implementación es conceptualmente fácil de paralelizar, en una arquitectura multihilo. Los cálculos fueron efectuados en una instancia Standard F16s\_v2 (16 vcpu, 64 GB de memoria) de un proveedor de servicios en la nube

## Instancia 1 (1000 monte-carlo)

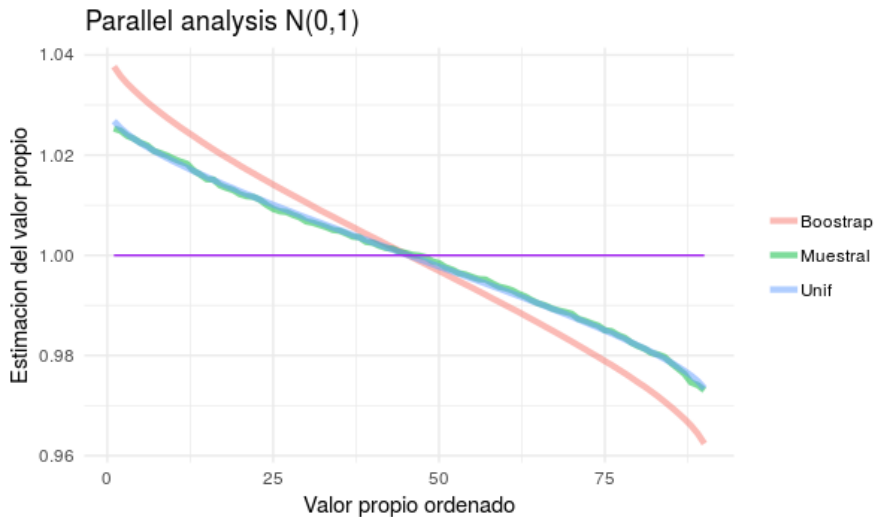


Figura 4: Bootstrap instancia 1

# Instancia 1

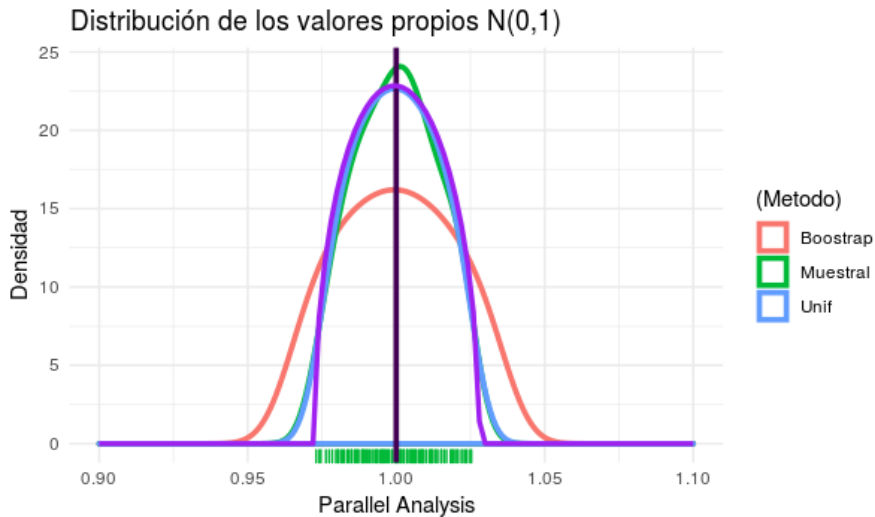


Figura 5: Densidades muestrales

## Instancia 2 (1000 monte-carlo)

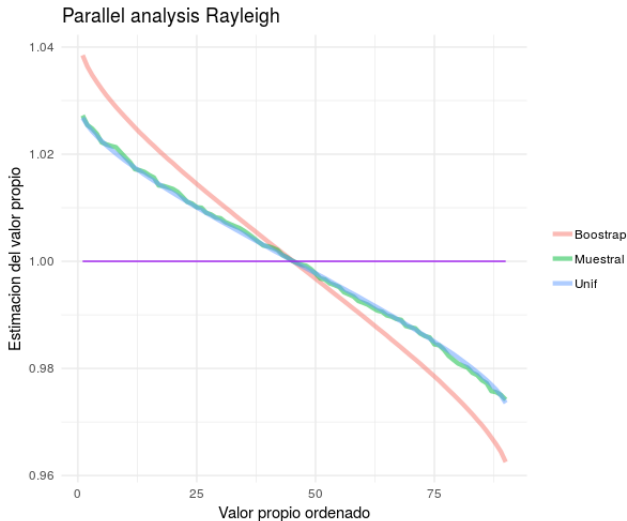


Figura 6:

## Instancia 2 (1000 monte-carlo)

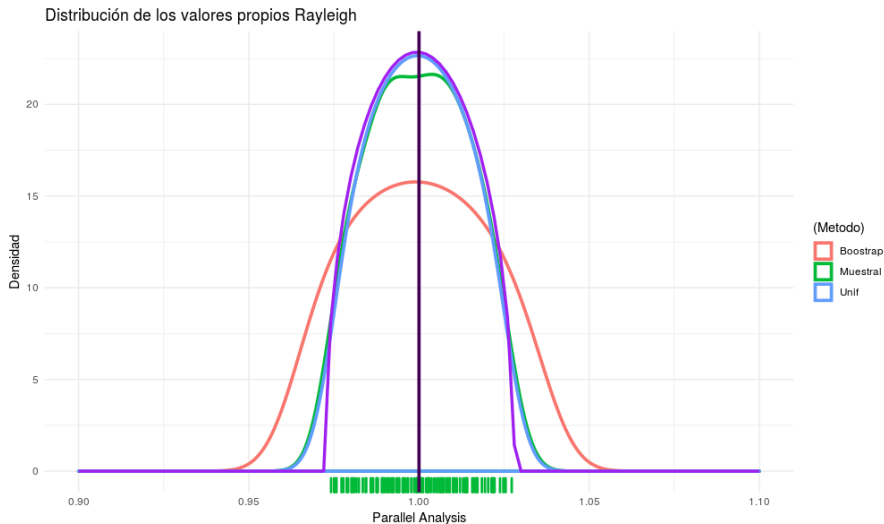


Figura 7:

## Resumen instancias 1 y 2

Los resultados en estas instancias son los esperados: el criterios de Kaiser, el parallel analysis uniforme y con bootstrap sugieren el mismo número de componentes (45, el punto en donde las curvas se intersectan).<sup>3</sup>

La distribución límite de Marchenko Pastur encierra a todos los valores propios, esto nos sugiere que el criterio que estamos tomando usando resultados de matrices aleatorias podrían extenderse, a las distribuciones de la familia exponencial

---

<sup>3</sup>El criterio 'del codo' ?

# Caso práctico

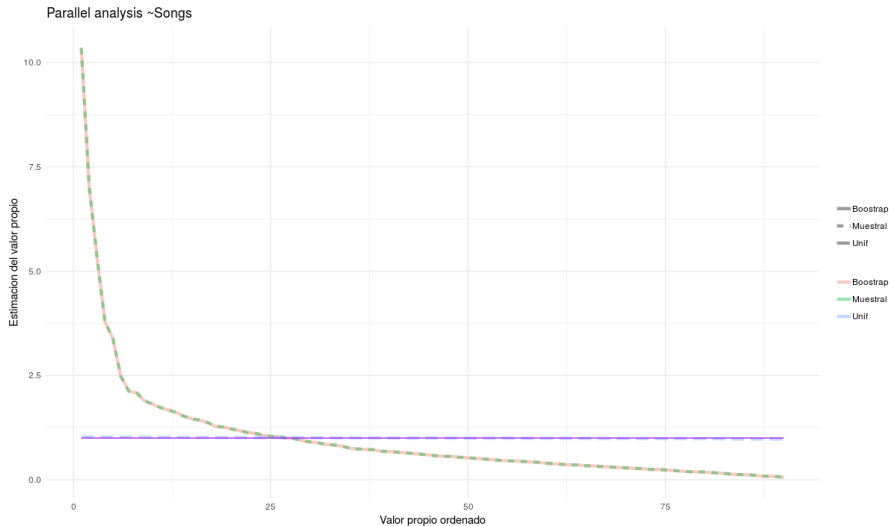


Figura 8: Bootstrap caso práctico



## Comentario simulación instancia 3

El parallel analysis presenta menor varianza que en las dos instancias anteriores, i.e. las muestras simuladas son igual de 'informativas' que la original

## Instancia 3 (Million Song Dataset)

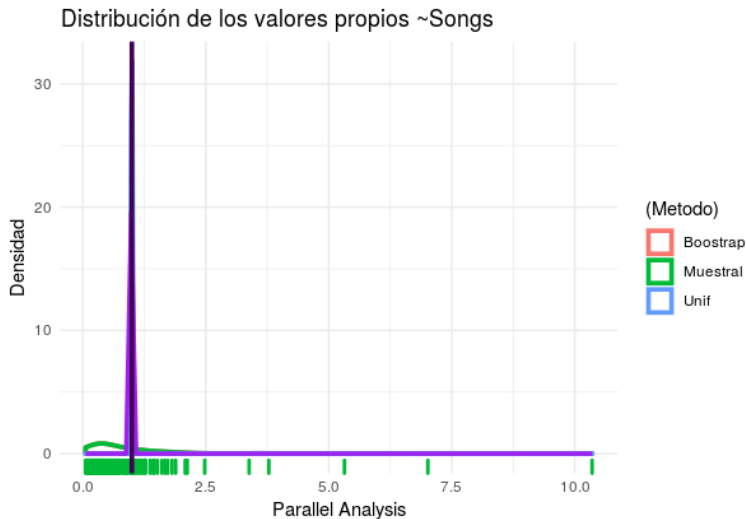


Figura 0:

## Instancia 3 (Million Song Dataset, zoom)

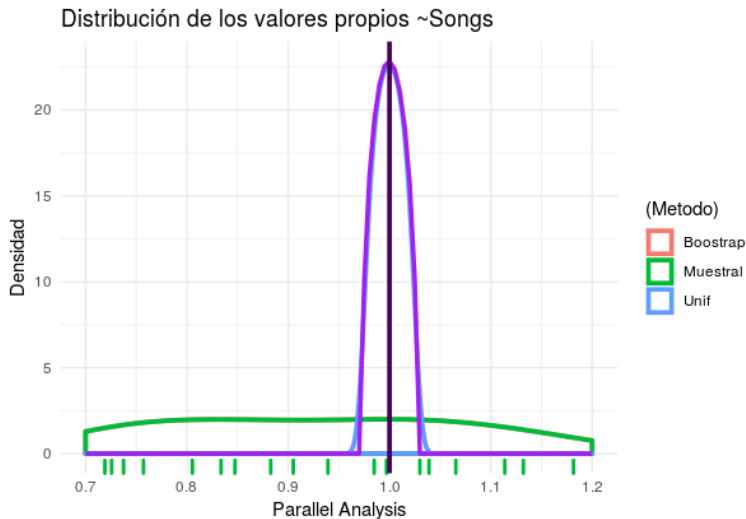


Figura 10.

# Resultados

Resumimos los números de componentes que propone cada criterio sobre las tres instancias, así como sus respectivos tiempos de cómputo que requiere la simulación:

Id	Kaiser	Uniforme	Bootstrap	M-P	Tiempo
1	45	45	45	46	12.2mins + 36.54 mins
2	45	45	45	45	13.54 mins + 44.25 mins
3	25	31	37	27	13.02 mins + 50.41 mins

## Resultados (regresión)

En un trabajo del donador de los datos [2] se reporta un error sobre el conjunto de prueba de 10.20 y 8.76 (medido en la misma escala que en nuestro experimento) utilizando el método de 50 vecinos más cercanos y el algoritmo de Vowpal Wabbit. Nuestro resultado final es de **9.5**. casi en el punto medio sin embargo nosotros nos restringimos a métodos de regresión lineales.

# Conclusiones

Nuestro criterio basado en la distribución de Marchenko Pastur:

- Ahorra de recursos para la elección del número de componentes frente a cv en PCR.
- Acota el espacio de búsqueda de las componentes de PLS.

Diseñamos un experimento de simulación donde se tienen tres estratos el primero muy cercano a los supuestos necesarios del teorema de Marchenko-Pastur<sup>4</sup>, el segundo no satisfaciendo la normalidad y el tercero (datos reales) solo con media cero y desviación estándar estimada igual a la unidad.

- La estimación utilizando técnicas de reducción de dimensionalidad, en particular PLS con una proporción bastante pequeña respecto al número de variables siempre presentó un mejor desempeño aún en casos teóricos y prácticos.

<sup>4</sup>Cuyo paper original se encuentra en ruso



# Conclusión

- La agregación puede aportar grandes ganancias por encima de los componentes individuales, NO FUERZA BRUTA
- Citando a Stephen M. Stigler <sup>5</sup> sobre el cuento de Jorge Luis Borges *Funes el memorioso* de 1942

***Funes era big data sin estadística***

---

<sup>5</sup>ver [1] pág. 23

Extender el criterio definido en este trabajo

- Implementación en paralelo del 'test' (en una arquitectura GPU) <sup>6</sup>
- Utilizar el test en conjuntos de datos con alta correlación donde esperamos mejores resultados aunque esto requiere de una adaptación de PLS.
- Probar su utilidad y robustez en modelos de cointegración y factores dinámicos en series de tiempo.

---

<sup>6</sup>Horn a finales de su trabajo [3] sugiere implementar un método en el software estadístico (pues al día de hoy desconocemos una implementación popular)



Hemos encontrado que nuestro criterio se desempeña mejor en la regresión PCR y PLS al pronosticar el índice SP500 que no requiere de estacionalidad y estacionariedad en los datos. Sin embargo el número de componentes del criterio es **dependiente** de realizar las transformaciones sobre las series de tiempo mencionadas.

En [1] se desarrolla un nuevo criterio de selección de componentes 'Empirical Kaiser Criterion' cuya metodología es ligeramente diferente a la desarrollada.



Braeken, J., y van Assen, M. A. L. M. *An empirical Kaiser criterion*. Psychological Methods, 22(3), 450-466.  
<http://dx.doi.org/10.1037/met0000074>, 2017.



A. Edelman; *Random Matrix Theory and its Innovative Applications*; 2013.



Horn, J. L.; *A Rationale and Test For the Number of Factors in Factor Analysis*; Psychometrika, 30, 179-85; 1965.



Kaisert H.; *The application of electronic computers to factor analysis*; Paper read at a symposium on application of computers to psychological problems. Meeting of Amer. Psychol. Ass., 1959.



Stephen M. Stigler; *Los siete pilares de la sabiduría estadística*; Libros Grano de Sal, 1er edición 2017.



T. Bertin-Mahieux, D. P.W. Ellis, B. Whitman y P. Lamere ; *THE MILLION SONG DATASET*; recuperado de <https://www.ee.columbia.edu/~dpwe/pubs/BertEWL11-msd.pdf> el 3 de noviembre de 2018.