

Índice general

1. Cuerpo	3
1.1. Análisis exploratorio de datos	3
1.1.1. Distribución de la variable objetivo	4
1.1.2. Análisis univariantes variables numéricas	5
1.1.3. Análisis multivariantes de las variables numéricas	10
1.1.4. Análisis de las variables categóricas	12
1.2. Modelización	13
1.2.1. Regresión logística con penalización	14
1.2.2. Regresión logística con penalización + PCA	15
1.2.3. Árboles de decisión	15
1.2.4. Bosques aleatorios	16
1.2.5. KNN	17
1.2.6. SVM lineal	17
1.2.7. SVM radial	17
1.3. Comparación	18

Capítulo 1

Cuerpo

1.1. Análisis exploratorio de datos

En esta sección se aplicarán distintos métodos numéricos y gráficos de análisis de datos a la muestra generada siguiendo el procedimiento detallado en el capítulo anterior. Se usarán principalmente técnicas de estadística descriptiva para comprender las características del conjunto de datos y extraer conocimiento útil para el problema que se intenta abordar, predecir incendios forestales. Es importante tener presente que se trata de datos correlados espacial y temporalmente, lo que hace necesario el uso de métodos específicos para este tipo de datos. Los objetivos de esta etapa son:

1. Generar conocimiento sobre el conjunto de datos que nos permita evaluar la calidad de este, sin olvidar las limitaciones que ya se han comentado en la sección anterior.
2. Conocer, al menos de forma descriptiva, el impacto de cada variable en la variable objetivo. Este conocimiento será necesario para evaluar e interpretar los modelos que se construirán en la próxima sección.
3. Analizar las características de las distintas variables, de cara a usar posteriormente técnicas de preprocesamiento adecuadas para cada modelo.

Antes de abordar el estudio detallado de cada una de las variables y las relaciones entre estas, en la Figura 1.1 se recoge un resumen de todo el conjunto de datos, sin incluir la columna de geometría. En este resumen se puede observar que en el conjunto de datos hay 4 tipos de variables (además de la variable *geometry* que es de tipo *simple feature column POINT*, abreviado como *sfc_POINT*): cadenas de caracteres, fechas, factores y variables numéricas.

Se puede observar que hay registros en 749 municipios diferentes (de los 785 municipios de que hay en Andalucía). Probablemente el hecho de que en algunos municipios no haya habido observaciones sea debido a los datos faltantes. Las variables *municipio* y *cod_municipio* no se incorporarán a los modelos. De la misma forma, se puede ver que hay observaciones en 3691 días diferentes. El conjunto cuenta con 5 variables de tipo factor: *fire* (la variable objetivo), *WD10M*, *orientacion*, *enp* y *uso_suelo*; y con 18 variables numéricas. Aunque cada una de ellas se analizará a continuación con detalle, ya cabe hacer algunos comentarios:

- El 38 % de las observaciones se encuentran en espacios de vegetación arbustiva y/o herbácea (código 32).
- Como era de esperar, por la forma en la que se ha tomado la muestra, el conjunto está balanceado.
- El 81 % de las observaciones se encuentran fuera de Espacios Naturales Protegidos.
- Todas las variables, salvo *T2M* y *curvatura*, son positivas y la mayoría de ellas presentan una marcada distribución asimétrica hacia la derecha.
- Las variables muestran escalas muy diversas entre ellas, siendo *GWETTOP* la que presenta menor desviación típica (0.145) y *poblacion* la que tiene una desviación típica mayor (64453). Se evidencia la necesidad de incluir algún método de normalización de las variables en el preprocesamiento de los datos.

Data Summary										
Name	Values									
Number of rows	datos									
Number of columns	26									
Column type frequency:										
character	2									
Date	1									
factor	5									
numeric	18									
Group variables										
None										
Variable type: character										
skim_variable	n_missing	complete_rate	min	max	empty	n_unique	whitespace			
1 cod_municipio	0	1	5	5	0	749	0			
2 municipio	0	1	3	32	0	749	0			
Variable type: Date										
skim_variable	n_missing	complete_rate	min	max	median	n_unique				
1 date	0	1	2002-01-02	2022-11-29	2012-08-04	3691				
Variable type: factor										
skim_variable	n_missing	complete_rate	ordered	n_unique	top_counts					
1 fire	0	1	FALSE	2	1: 10794, 0: 10752					
2 WD10M	0	1	FALSE	8	SW: 4965, W: 4867, S: 3786, SE: 3316					
3 orientacion	0	1	FALSE	9	S: 3267, SW: 3090, SE: 2956, W: 2544					
4 enp	0	1	FALSE	2	0: 17393, 1: 4153					
5 uso_suelo	0	1	FALSE	15	32: 8068, 21: 3128, 24: 2798, 22: 2786					
Variable type: numeric										
skim_variable	n_missing	complete_rate	mean	sd	p0	p25	p50	p75	p100	hist
1 T2M	0	1	24.6	5.20	-0.8	22.7	25.6	28.0	36.0	
2 GWETTOP	0	1	0.318	0.145	0.09	0.2	0.29	0.42	0.91	
3 RH2M	0	1	46.4	16.1	9.23	33.8	44.6	57.5	96.8	
4 WS10M	0	1	3.64	1.42	0.99	2.67	3.34	4.25	13.3	
5 PRECTOTCORR	0	1	0.229	1.38	0	0	0	0	46.1	
6 elevacion	0	1	494.	400.	0	169.	425.	711.	3351.	
7 pendiente	0	1	12.3	11.8	0	3.46	8.24	17.9	98.0	
8 curvatura	0	1	0.00549	0.0563	-0.294	-0.0193	-0.000100	0.0255	0.420	
9 dist_carretera	0	1	1799.	1907.	0.0706	507.	1200.	2425.	17662.	
10 dist_poblacion	0	1	902.	800.	0	379.	713.	1170.	8215.	
11 dist_electr	0	1	5253.	5640.	0.220	1216.	3462.	7276.	48069.	
12 dist_ferrocarril	0	1	15311.	13521.	0.824	5086.	11855.	21467.	85242.	
13 dist_camino	0	1	762.	741.	0.0238	240.	539.	1060.	7090.	
14 dist_sendero	0	1	5619.	4805.	0.0465	1781.	4361.	8276.	25103.	
15 poblacion	0	1	22095.	64453.	114	2252	4860	16759	704414	
16 dens_poblacion	0	1	105.	320.	2.30	12.2	30.8	71.1	4974.	
17 dist_rios	0	1	6781.	5836.	1.94	2162.	5237.	10123.	37074.	
18 NDVI	0	1	0.412	0.136	0	0.314	0.393	0.495	0.944	

Figura 1.1: Incendios durante el periodo de estudio

1.1.1. Distribución de la variable objetivo

En primer lugar, se estudiará la distribución de la *fire* espacial y temporalmente.

En la Figura 1.2 se muestran los histogramas de la variable objetivo en función del día de la semana, del mes y del año, respectivamente. En primero de ellos se observa que mientras que la distribución de los casos negativos es uniforme entre los días de la semana, en los casos positivos se aprecia un ligero aumento en el fin de semana, especialmente en

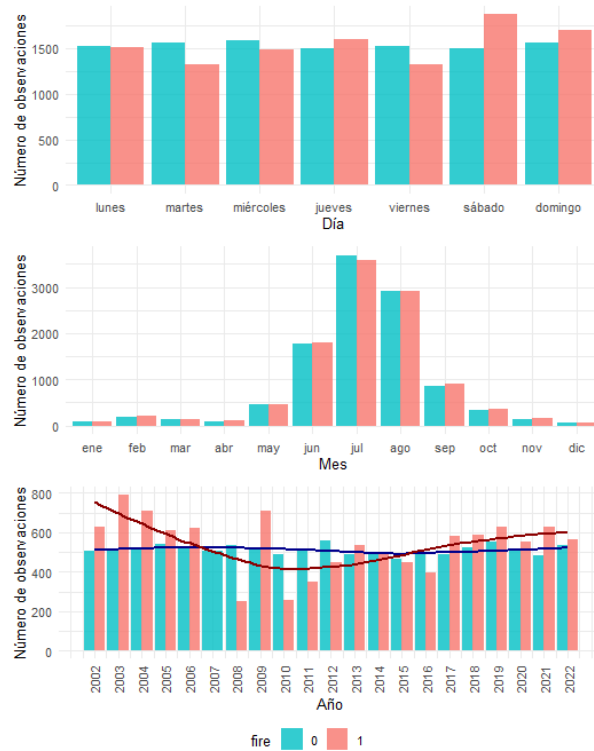


Figura 1.2: Distribución temporal de las observaciones en función de la variable objetivo.

el sábado. En el segundo histograma, se observa como las observaciones se concentran en los meses de verano y en cada mes hay una cantidad balanceada de muestras de ambas clases (esto es fruto del proceso de muestreo de las observaciones negativas, que como se ha explicado en la sección anterior, se ha llevado a cabo asegurando que la proporción de casos negativos en cada mes sea igual a la de los casos positivos). En el tercer histograma es remarcable que, mientras las observaciones negativas están uniformemente distribuidas entre los 20 años del estudio, las positivas muestran una disminución importante en los años 2008 y 2010. En el año 2007 no hay observaciones positivas, debido a que los 4 polígonos de incendios mayores de 100ha que había registrados ese año no disponían de la fecha de inicio del incendio, por lo que no pudieron usarse para el estudio. Se desconoce la causa del reducido número de incendios (mayores de 100ha) en 2007, 2008 y 2010.

Dada la clara influencia del mes y la aparente influencia del día de la semana en la aparición de incendios, estas variables serán incluidas en los modelos a través del procesamiento de la variable *date*.

En la Figura 1.3 se observa claramente como las 10752 muestras negativas están uniformemente distribuidas dentro de los límites de la Comunidad Autónoma de Andalucía, mientras que las 10794 muestras positivas se concentran a ambos lados de la cuenca del río Guadalquivir, con una mayor densidad de observaciones en la provincia de Huelva y en algunas zonas de la costa mediterránea (como ya se apreciaba en la Figura ??).

1.1.2. Análisis univariantes variables numéricas

El análisis univariante de las variables numéricas se lleva a cabo desde 3 enfoques complementarios:

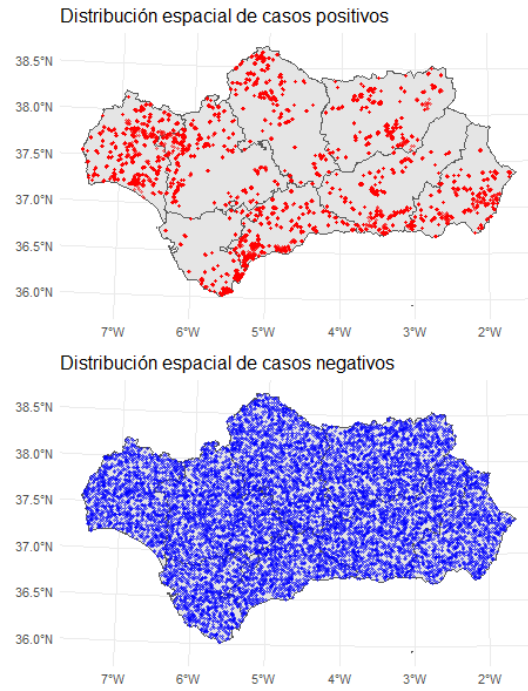


Figura 1.3: Distribución espacial de las observaciones en función de la variable objetivo.

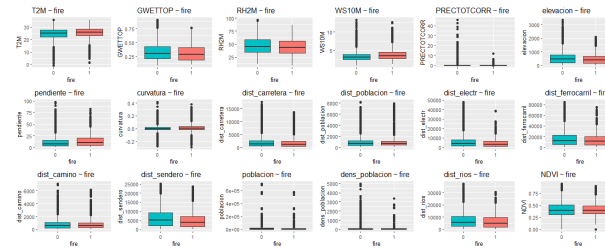


Figura 1.4: Boxplot de cada variable numérica en función de la variable objetivo.

1. A través de la los resúmenes numéricos recogidos en la Figura 1.1 y del análisis gráfico de los diagramas de caja y bigote (1.4).
2. Estudiando la media mensual de cada variable en función de la variable *fire*.
3. Analizando la distribución espacial de cada variable separando por mes si corresponde.

En los *boxplots* de las variables numéricas en función de la variable *fire* (1.4) destacan varios aspectos. Por un lado, como ya se había comentado anteriormente, que las variables presentan escalas muy diferentes y que la mayoría de las variables tienen una marcada asimetría hacia la derecha. Por otro lado, es evidente la gran cantidad de valores *outliers* que se observan en los datos, lo que tendrá implicaciones en los modelos que se construyan con ellos. Sin embargo, es importante destacar que no se trata de observaciones erróneas, si no que son inherentes a la naturaleza de los datos. Por ejemplo, en el caso de la variable *PRECTOTCORR* el valor máximo observado es 46.06mm en un día, un valor elevado que sin duda es atípico en esta región de clima seco, pero sin embargo, posible. Es también remarcable que todas las variables presentan una variabilidad similar en ambos niveles del factor *fire*, lo que indica que no será un problema de clasificación trivial. A

priori, solo con los diagramas de caja y bigotes y los resúmenes numéricos es difícil llegar a sacar más conclusiones, sin embargo, sí pueden observarse sutiles diferencias entre las distribuciones de algunas variables para ambos niveles del factor *fire*.

Dada la naturaleza temporal de algunas variables, el análisis gráfico de los *boxplots* resulta insuficiente. Con el fin de considerar la componente estacional de las variables climáticas y de vegetación, a continuación, se estudiará la media mensual de cada una de estas variables función de la variable objetivo.

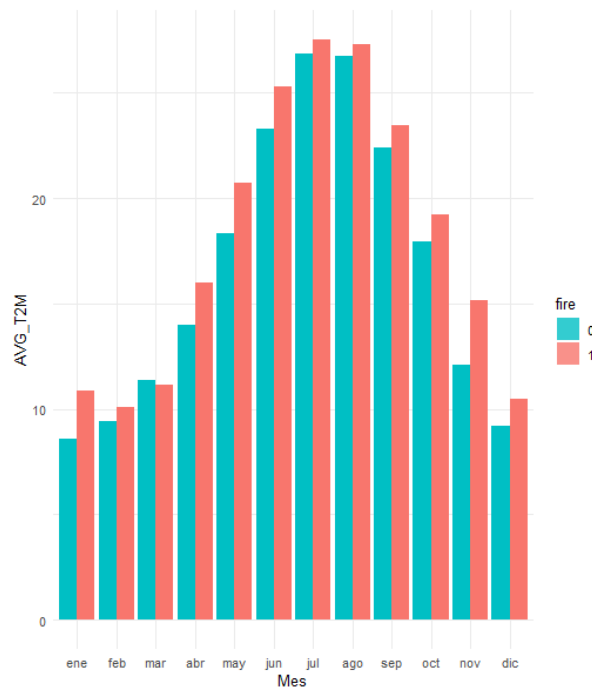


Figura 1.5: Media mensual de la temperatura en función de fire.

En la Figura 1.5 se puede observar como en casi todos los meses, la temperatura media mensual es superior en las observaciones en las que se ha registrado un incendio forestal.

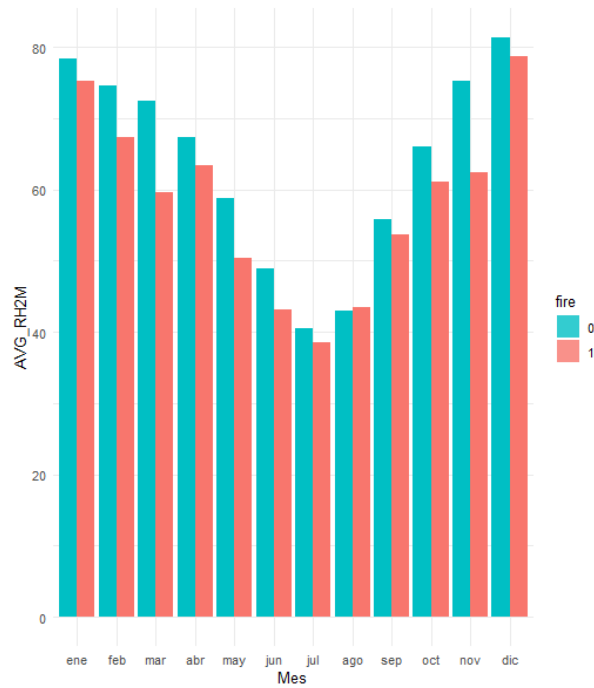


Figura 1.6: Media mensual de la humedad relativa en función de fire.

En la Figura 1.6 se puede observar que en todos los meses la media mensual de la humedad relativa del aire a 2m sobre la superficie es menor en las observaciones en las que se ha registrado un incendio forestal. Sin embargo, las diferencias se reducen durante los meses de verano, en los que la humedad presenta valores bajos en ambas clases.

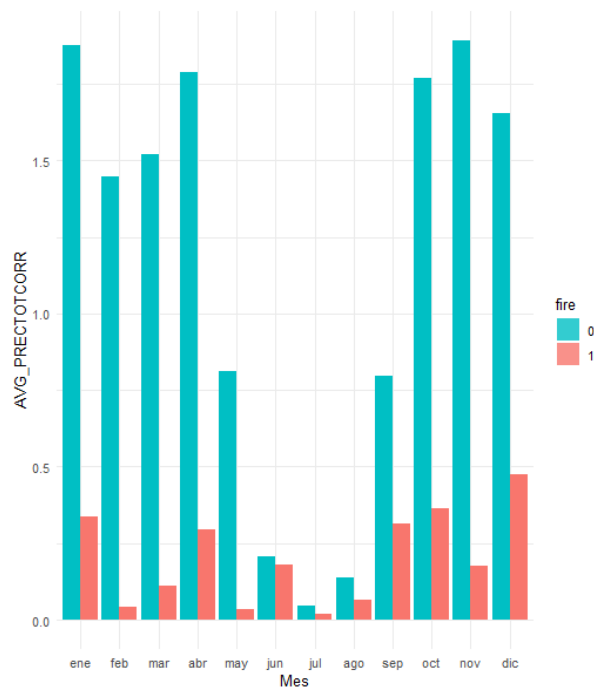


Figura 1.7: Media mensual de la precipitaciones en función de fire.

En la Figura 1.7 se observa una clara diferencia en la media mensual de las precipitaciones diarias en función del de si se ha registrado o no un incendio forestal en la observación,

siendo significativamente mayor en este último caso.

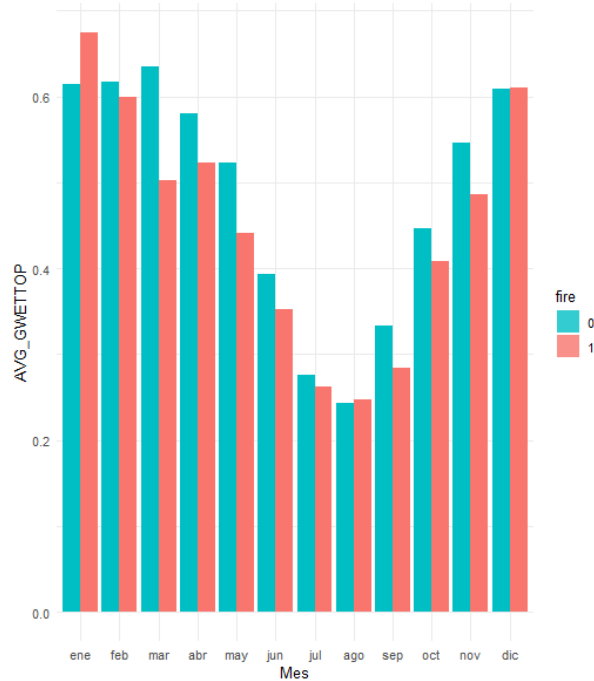


Figura 1.8: Media mensual de la humedad del suelo en función de fire.

En la Figura 1.8 se observa un gráfico similar al de la humedad relativa del aire, con valores medios más elevados en las observaciones en las que no se han registrado incendio forestal. Sin embargo, también parece que las diferencias son más reducidas durante la estación estival.

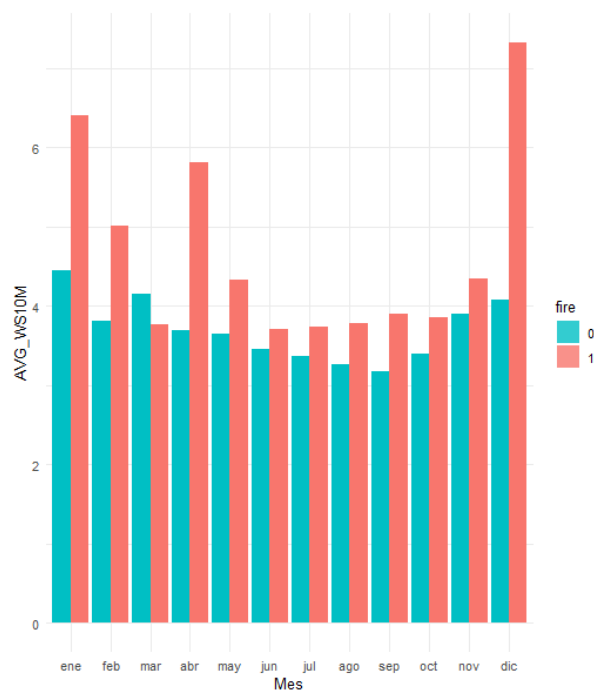


Figura 1.9: Media mensual de la humedad del suelo en función de fire.

En la Figura 1.9 se observa como durante todos los meses, la media mensual de la velocidad del viento a 10 metros sobre la superficie es mayor en los registros en los que ha habido un incendio forestal.

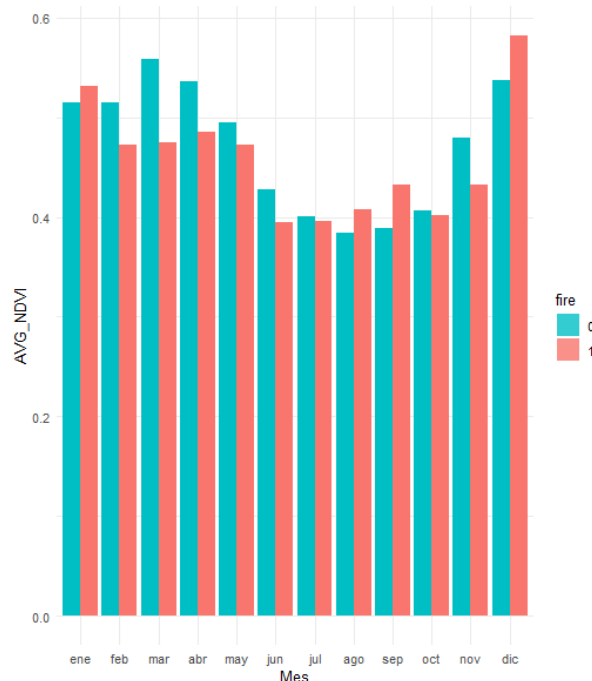


Figura 1.10: Media mensual de la humedad del suelo en función de fire.

Como se observa en la Figura 1.10, las diferencias entre los casos en los que se ha registrado incendio y los que no en términos del *NDVI* no están claras.

En el [Apéndice: Gráficos espaciales EDA] se recogen los gráficos espaciales y espacio_temporales de todas las variables numéricas. En ellos se refleja como la valores de las variables en estudio son coherentes con lo que cabría esperar de la realidad. Además, permiten una comprensión mayor de la distribución espacial (y temporal) de las variables en el área de estudio, lo que será útil de cara a interpretar los modelos que se construyan.

1.1.3. Análisis multivariantes de las variables numéricas

En la Figura 1.11 se muestra un gráfico con las correlaciones entre las variables. La interpretación es sencilla, cuanto más intenso sea el color y cuanto mayor sea la excentricidad de la elipse, mayor será la correlación (en valor absoluto) para ese par de variables. El color de la elipse indica el signo del coeficiente de correlación. De esta forma, se observa que las variables más correlacionadas en la muestra son:

- *T2M* con *RH2M* (negativamente, -0.71)
- *T2M* con *GWETTOP* (negativamente, -0.69)
- *GWETTOP* con *R2HM* (positivamente, 0.68)
- *poblacion* con *dens_poblacion* (positivamente, 0.63)

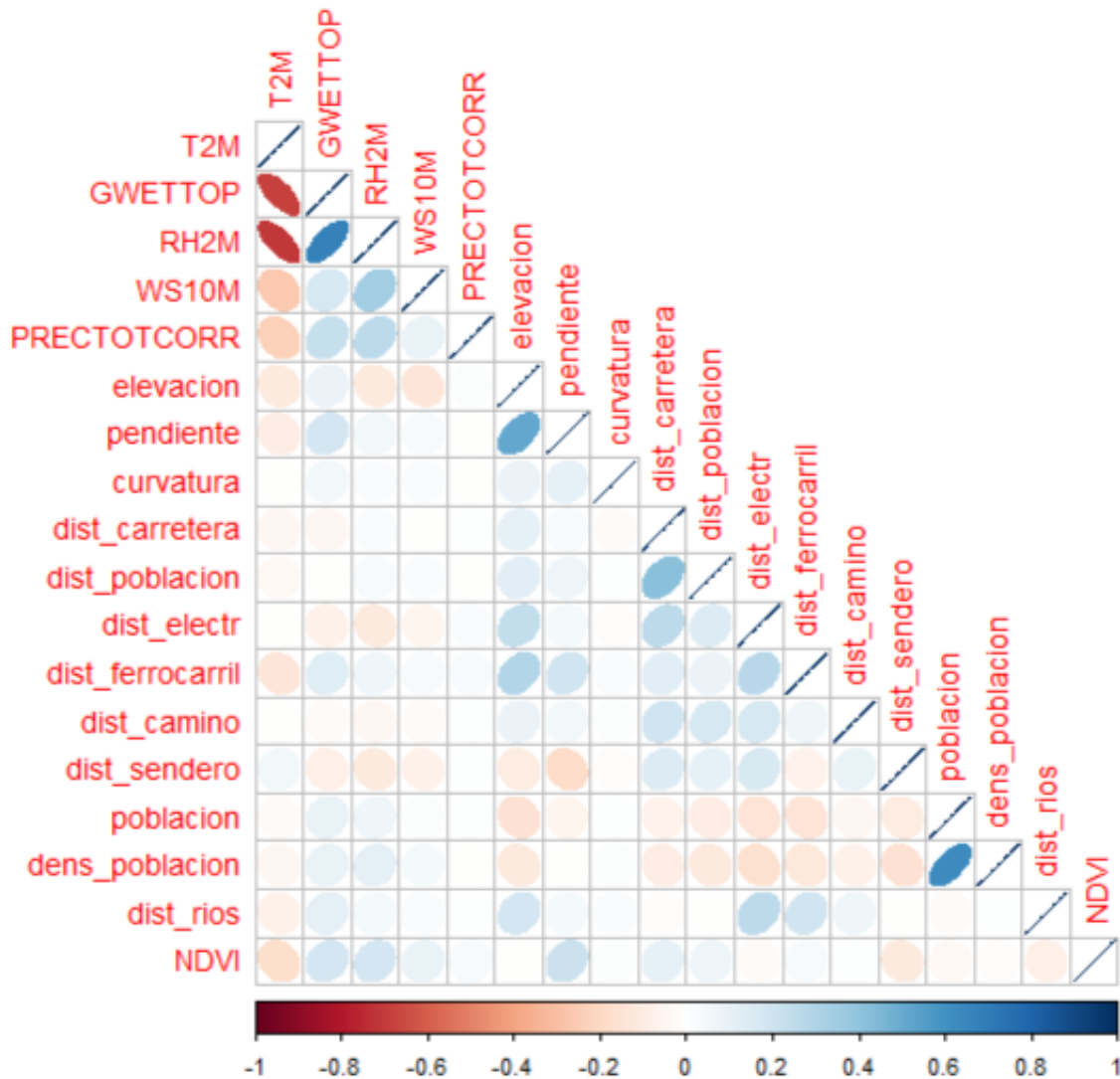


Figura 1.11: Correlaciones entre variables numéricas

En la Figura 1.12 se muestra el gráfico de coordenadas paralelas de las variables tipificadas a una normal estándar, es decir, restándoles la media y dividiendo por la desviación típica. Este gráfico complementa la información de los *boxplots*, pues refleja también las relaciones entre las variables. Si bien es cierto que al tener un número bastante elevado de observaciones el gráfico no es tan claro, pueden hacerse algunas observaciones importantes.

En primer lugar, se observa que la variable con mayor variabilidad (una vez tipificada) es PRECTOTCORR, que presenta bastantes valores atípicos, todos ellos en observaciones en las que no se ha registrado incendio. También destacan en este sentido *dens_poblacion* y *poblacion*, entre las que además puede observarse que no hay una relación lineal clara (hay municipios con un elevado número de habitantes pero con una densidad de población reducida y viceversa). Además, puede verse que todas las variables tienen una marcada asimetría positiva (salvo *curvatura*, *T2M* y *NDVI*). Este gráfico es útil también pues permite ver a que clase de *fire* corresponden los valores más atípicos de cada variable. Por ejemplo: la mayor parte de los valores más elevados de *WS10M*, *dist_poblacion*, *curvatura* y *dist_camino* se dan en observaciones positivas, mientras que en *PRECTOTCORR*,

elevacion, *GWTTOP*, *dist_Carretera*, *dist_electr* y *dist_rios* sucede lo contrario.

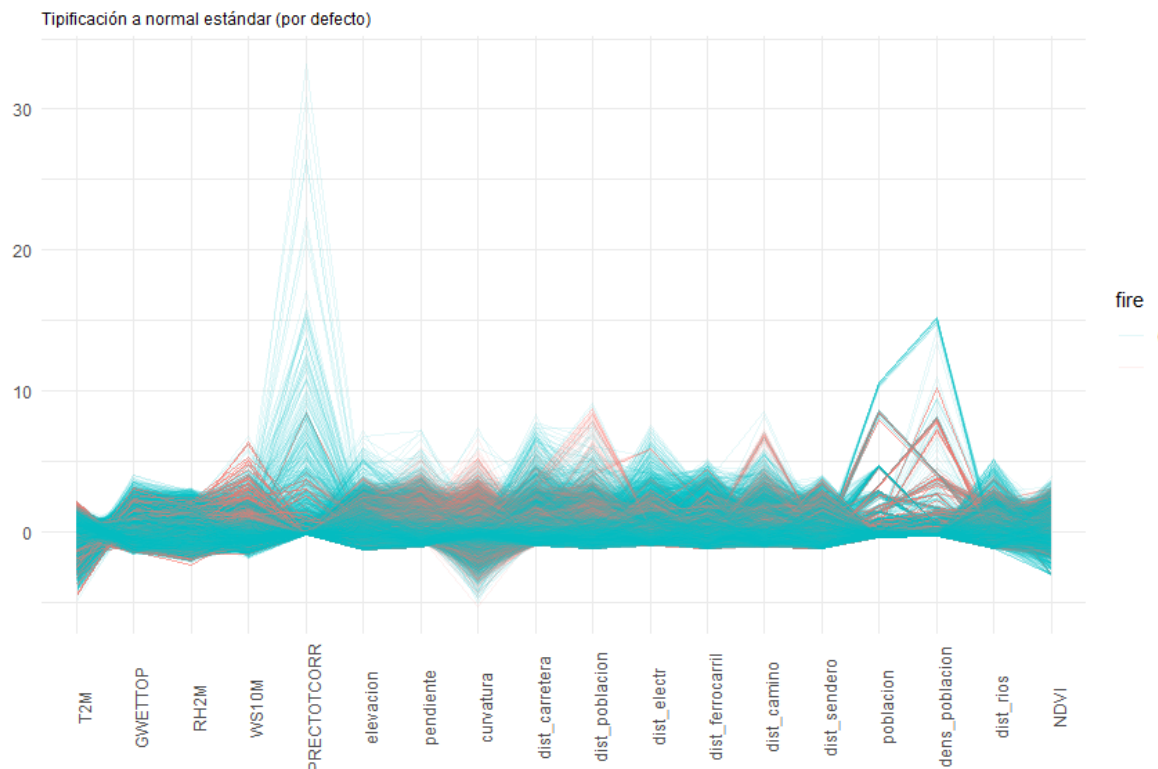


Figura 1.12: Gráfico de coordenadas paralelas.

Los resultados de aplicar análisis de componentes principales sobre la matriz de correlaciones de las 18 variables numéricas se muestran en la Figura 1.13. Como se puede observar, se necesitan al menos 11 componentes principales para lograr explicar el 80 % de la varianza de la muestra, y 14 para alcanzar el 90 % de la varianza de los datos. Estos resultados se aplicarán más adelante en los modelos, pero a nivel meramente explicativo ya indican que se trata de un conjunto de datos complejo en cuanto a la dimensión real de estos.

Importance of components:									
	Comp.1	Comp.2	Comp.3	Comp.4	Comp.5	Comp.6	Comp.7	Comp.8	Comp.9
Standard deviation	1.6830901	1.5509109	1.26704790	1.18114361	1.13860921	1.00151777	0.98498153	0.92948032	0.92853341
Proportion of variance	0.1573773	0.1336291	0.08918946	0.07750557	0.07202394	0.05572433	0.05389937	0.04799631	0.04789857
Cumulative Proportion	0.1573773	0.2910065	0.38019595	0.45770152	0.52972546	0.58544979	0.63934916	0.68734547	0.73524404
	Comp.10	Comp.11	Comp.12	Comp.13	Comp.14	Comp.15	Comp.16	Comp.17	Comp.18
Standard deviation	0.91036573	0.86805852	0.85739620	0.78965012	0.72570700	0.65041713	0.60872397	0.52343451	0.48001944
Proportion of variance	0.04604254	0.04186253	0.04084046	0.03464152	0.02925837	0.02350236	0.02058583	0.01522132	0.01280104
Cumulative Proportion	0.78128658	0.82314912	0.86398958	0.89863109	0.92788946	0.95139182	0.97197765	0.98719896	1.00000000

Figura 1.13: PCA sobre la matriz de correlaciones de las variables numéricas

1.1.4. Análisis de las variables categóricas

Las variables categóricas se analizarán a través de los histogramas de cada variable en función de la variable *fire* (Figura 1.14).

En la variable *WD10M* cabe destacar la escasez de observaciones con dirección del viento norte. En el histograma no se observa una clara relación de esta variable con la

variable objetivo, aunque entre las observaciones con viento con dirección sur o suroeste hay más observaciones negativas y entre las que tienen dirección noroeste o este hay una mayor presencia de observaciones positivas.

En el caso de la variable *orientación*, la relación tampoco está clara, aunque puede verse una mayor proporción de observaciones positivas en las superficies con orientación sur (sureste, sur y suroeste).

En términos de la variable *enp* por si sola no se observan diferencias significativas entre ambas clases.

La variable *uso_suelo* sí que muestra una distribución marcadamente diferenciada entre ambas clases. La mayoría de las observaciones positivas se dan en espacios de vegetación arbustiva y/o herbácea, clase en la que hay casi el doble de observaciones positivas que negativas. En tierras de labor y cultivos permanentes la proporción de observaciones negativas es mucho mayor, mientras que en zonas agrícolas heterogéneas y en espacios abiertos con poca o sin vegetación hay una mayor presencia de observaciones positivas. También es relevante el hecho de que casi la totalidad de las observaciones se encuentran en zonas agrícolas y en zonas forestales, mientras que en las demás clases la proporción de observaciones es mucho menor (3.5 de total). Es por ello que antes de construir los modelos, todas las categorías de uso de suelo que no se corresponden con zonas agrícolas o forestales (es decir, todas cuyo código no comience por 2 o 3) se agruparán en el nivel *Otro*. En ?? puede observarse la distribución espacial de esta variable.

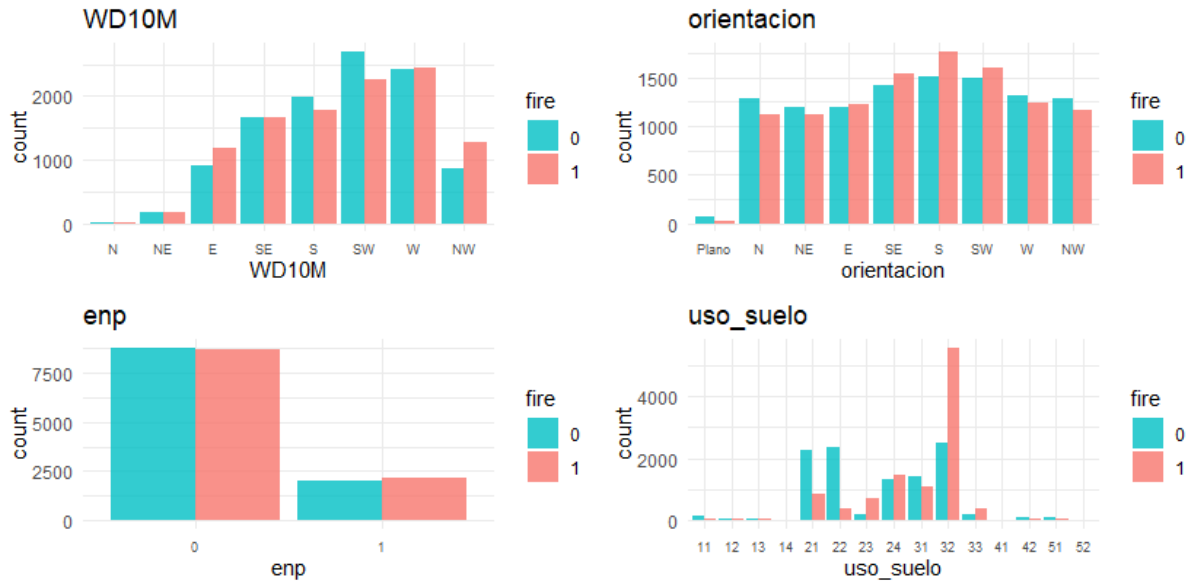


Figura 1.14: Histogramas de las variables categóricas en función de fire.

1.2. Modelización

A continuación se va a utilizar el conjunto de datos construido en el capítulo [Construcción del conjunto de datos] para entrenar los modelos de clasificación binaria explicados en la sección [Modelos]. Es evidente que el rendimiento de los modelos debe evaluarse en observaciones futuras, por lo que las técnicas habituales de validación cruzada o partición

aleatoria en entrenamiento/test no son adecuadas para este problema, ya que sufrirían el llamado efecto *look-ahead*. Por tanto, el enfoque que se seguirá en este trabajo será trabajar con una partición en entrenamiento/validación/test construida a partir de la ordenación temporal de las observaciones.

Se compararán los resultados obtenidos en 7 modelos diferentes: Regresión logística con penalización, Regresión logística con penalización + PCA, Árboles de decisión, Bosques aleatorios, KNN, SVM lineal y SVM radial.

Se ha seguido el flujo de trabajo habitual de *tidymodels*:

1º. Crear una partición temporal en entrenamiento (60 %), validación (20 %) y test (20 %), que será utilizada en todos los modelos.

2º. Definir cada uno de los modelos, indicando los parámetros del modelo deberán ajustarse.

3º. Crear la receta (*recipe*) con el preprocesamiento que se usará en cada modelo. Como se observó en la sección Análisis exploratorio de datos, se incluirán en todos los modelos variables categóricas que indiquen el día de la semana y el mes de cada observación, haciendo uso de la función `step_date`. Igualmente, como también se indicó en el EDA, se modificará la variable `uso_suelo` para unificar todos los niveles que no sean agrícolas o forestales en un solo nivel que se llamará *Otro*. Esto último se hará fuera del *workflow*, antes de realizar la partición del conjunto de datos, haciendo uso de la función `fct_lump` del paquete *forcats*. Los detalles del preprocesamiento que se ha llevado a cabo en cada modelo pueden consultarse en el código, que se adjunta en el Apéndice 2, donde aparecen debidamente comentados. 4º. Crear el *workflow* con el modelo y la receta.

5º. Crear la rejilla (*grid*) con los posibles valores de los parámetros que se deben ajustar.

6º. Entrenar el modelo para cada combinación de los valores de los parámetros a ajustar sobre los datos de entrenamiento.

7º. Evaluar el rendimiento de cada modelo sobre los datos de validación y seleccionar el mejor en base a las medidas de rendimiento ya mencionadas. El objetivo con estos modelos es predecir incendios forestales, por lo que es de vital importancia que los modelos funcionen especialmente bien en la clase positiva, es decir, que si un incendio se va a producir, que el modelo lo detecte. Sin embargo, es fundamental que el modelo tenga un buen desempeño general (un modelo que todo lo clasifique como incendio no serviría de nada, poniendo un ejemplo extremo). Por tanto, cada modelo se valorará de forma individual, considerando todas las métricas de rendimiento mencionadas y priorizando la sensibilidad (o *recall*). Sin embargo, en la mayoría de los casos maximizar la tasa de acierto maximiza también la sensibilidad, garantizando además un buen desempeño general. Por ello, en la mayoría de modelos se maximizará la tasa de acierto, pero porque analizando las salidas individualmente se ha considerado que es la mejor opción ya que produce la mayor sensibilidad sin bajar demasiado las otras medias.

1.2.1. Regresión logística con penalización

Antes de aplicar este modelo, se han transformado las variables categóricas a variables *dummy* y se han tipificado todas las variables (media 0 y varianza 1). Los parámetros a ajustar son λ (parámetro de penalización o *penalty*) y α (parámetro de mixtura o *mixture*).

Se consideran 10 valores equiespaciados para cada parámetro (en el caso de λ entre 10^{-4} y 10^{-1} y el caso de α entre 0 y 1) y se construye el grid tomando todas las combinaciones de estos valores.

Las métricas obtenidas por cada combinación de parámetro sobre los datos de validación se representan en la Figura 1.15

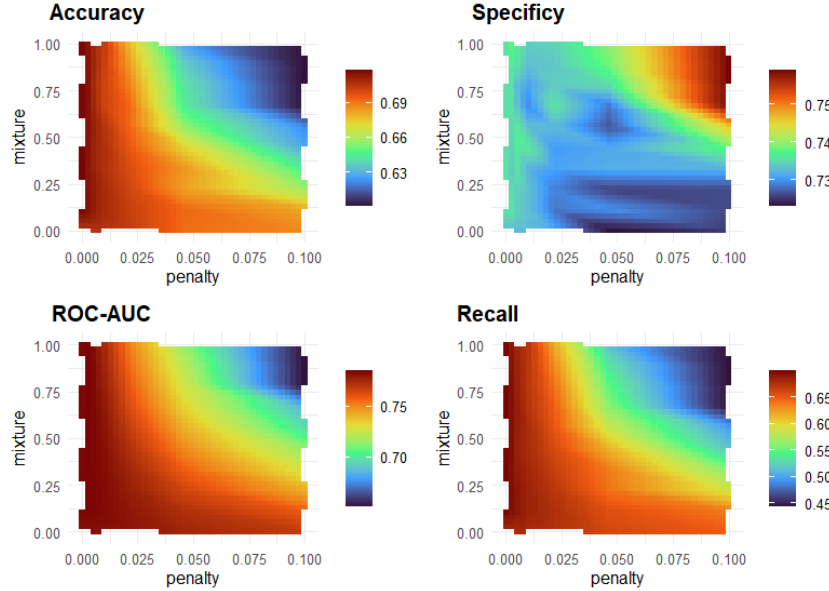


Figura 1.15: Métricas de rendimiento de los modelos de regresión logística con penalización.

Finalmente, se elige el modelo que maximiza la tasa de acierto, cuyos parámetros son: $\alpha = 1$ y $\lambda = 0.000464$. Es decir, un modelo de regresión logística *lasso* puro. Los coeficientes de este modelo se muestran en la Figura ??.

1.2.2. Regresión logística con penalización + PCA

A continuación se considera el mismo modelo de regresión logística con penalización que en la sección anterior pero en lugar de trabajar con los datos directamente, se aplica análisis de componentes principales sobre los datos normalizados en el preprocesamiento, ajustando el número de componentes principales utilizadas. Para construir el *grid* de parámetros se consideran los mismos valores que en el modelo sin PCA para los parámetros de penalización y mixtura pero ahora se consideran también 7 posibles valores para el número de componentes principales ($\{20, 25, 30, \dots, 50\}$). Finalmente, el modelo que maximiza la tasa de acierto es el que tiene 40 componentes principales, $\alpha = 0.333$ y $\lambda = 0.00464$.

1.2.3. Árboles de decisión

Se construirán los árboles de decisión usando el índice de Gini como función de impureza y se elegirá el parámetro de coste-complejidad (α) que maximice la tasa de acierto. Se considera un *grid* con 10 valores del parámetro de coste-complejidad que oscilan entre

$1.28e-10$ y $3.02e-2$. La mejor tasa de acierto en el conjunto de validación se obtiene con $\alpha = 0.00182$. En la Figura 1.16 se muestran las distintas métricas de rendimiento sobre los datos de validación para cada uno de los valores del parámetro a ajustar.

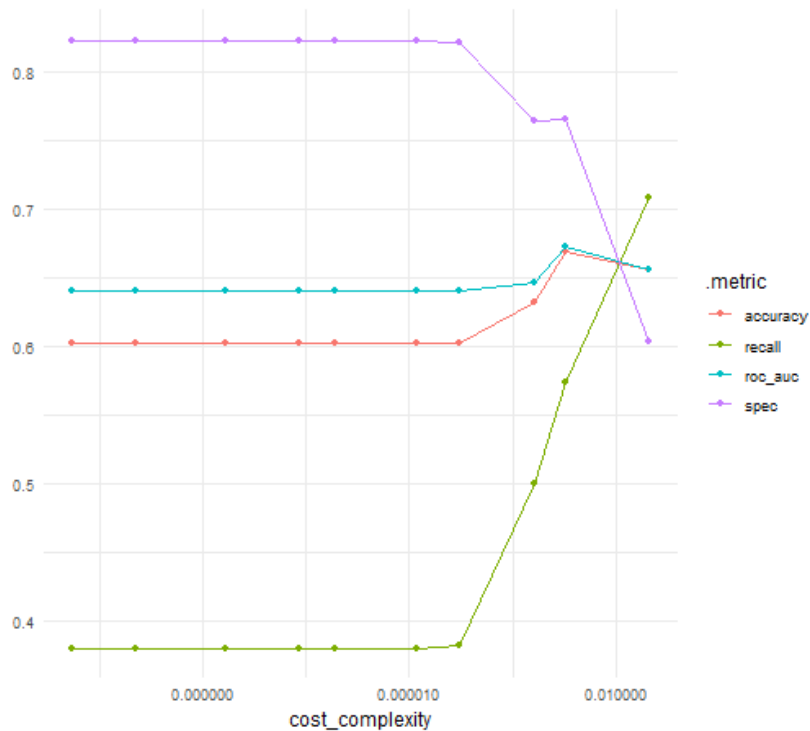


Figura 1.16: Métricas de rendimiento del árbol de decisión en función de el parámetro de costecomplejidad.

1.2.4. Bosques aleatorios

En este modelo se ha fijado el número de árboles a 1000 y se han ajustado los parámetros *mtry* (el número de variables que se seleccionarán aleatoriamente en cada nodo) y *min_n* (el número de observaciones en un nodo a partir del cual no se sigue dividiendo y se convierte en nodo hoja). En este caso se ha optado por un enfoque diferente, motivado por el amplio rango de valores que puede tomar el parámetro *min_n* y por las limitaciones computacionales del equipo disponible.

De esta forma, la estimación de parámetros se ha hecho en dos etapas. En una primera etapa se ha fijado el parámetro *mtry* = 4 y se ha estimado el parámetro *min_n* considerando para ello un *grid* equiespaciado de 1000 a 2500 tomando valores de 100 en 100 ($\{1000, 1100, \dots, 2500\}$). Para elegir entre los distintos modelos esta vez se ha usado como criterio la sensibilidad, obteniendo el valor más elevado para *min_n* = 2100. En la segunda etapa, una vez *min_n*, este se ha considerado fijo y se ha estimado *mtry*, considerando una rejilla de 10 valores equiespaciados tomados del 1 al 10 ($\{1, 2, \dots, 10\}$). De nuevo se ha utilizado la sensibilidad para elegir el modelo final, eligiendo así *min_n* = 7. En la Figura ?? se recogen los resultados de las dos etapas de *tuning*. El modelo final elegido tiene *min_n* = 2100 y *min_n* = 7.

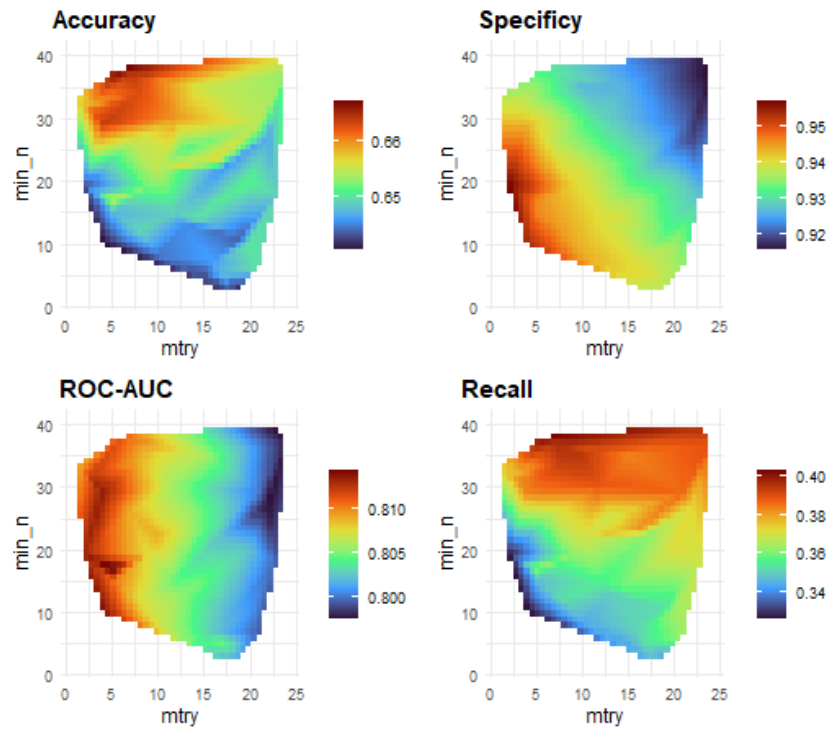


Figura 1.17: Métricas de rendimiento de Random Forest en función de los parámetros.

1.2.5. KNN

Para aplicar el modelo, primero se han transformado las variables categóricas en variables *dummy* y, posteriormente, se han tipificado las todas las variables. Se ha usado la distancia euclídea entre los vectores transformados. Para ajustar el parámetro k del modelo se han tomado valores entre 1 y 400. La mayor tasa de acierto sobre los datos de validación se ha obtenido con $k = 275$. Los resultados del *tuning* se muestran en la Figura 1.18.

1.2.6. SVM lineal

Antes de construir el modelo, se han transformado las variables categóricas usando variables *dummy* y se han tipificado todas las variables. Se ha probado con 15 valores del parámetro *coste* entre 0.001949 y 24.666648. La mayor tasa de acierto y el mayor *recall* se han obtenido para $C = 0.0437$. Los resultados del *tuning* se muestran en la Figura 1.19

1.2.7. SVM radial

Por último, se ha construido el modelo de SVM usando un kernel gaussiano. El pre-procesamiento ha sido el mismo que en el caso del kernel lineal. Dado el elevado tiempo de entrenamiento de este modelo solo se ha probado con 8 combinaciones de valores para los parámetros C y γ , que oscilan entre 0.005 y 31.7 y entre 0 y 0.05. La mayor tasa de acierto sobre los datos de validación se ha conseguido para $C = 31.7$ y $\gamma = 0.0000496$.

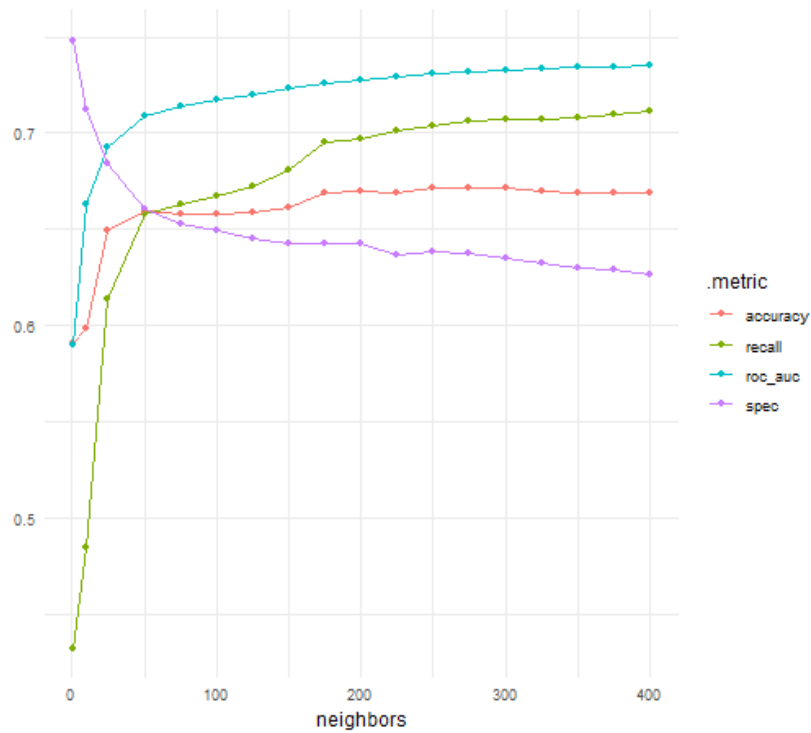


Figura 1.18: Métricas de rendimiento de KNN en función del número de vecinos.

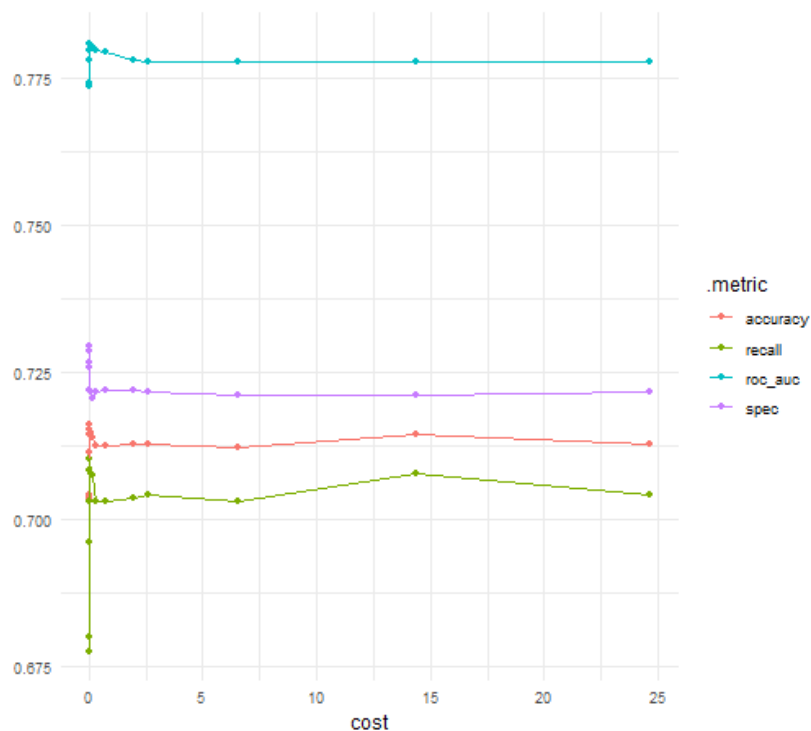


Figura 1.19: Métricas de rendimiento de svm en función del coste.

1.3. Comparación

A continuación se muestran las métricas de cada uno de los modelos seleccionados en los datos de validación en la Tabla 1.1 y en la Figura 1.20. Las curvas ROC de todos los

model_name	roc_auc	accuracy	recall	specificity	precision
lr	0.785	0.719	0.700	0.738	0.727
lr_pca	0.727	0.659	0.624	0.694	0.670
dt	0.656	0.656	0.709	0.604	0.641
rf	0.781	0.725	0.758	0.693	0.711
svm_linear	0.781	0.716	0.710	0.722	0.718
svm_rbf	0.777	0.710	0.692	0.728	0.717
knn	0.732	0.672	0.706	0.637	0.660

Tabla 1.1: Métricas de los modelos seleccionados sobre el conjunto de validación.

modelos se muestran en la Figura 1.21.

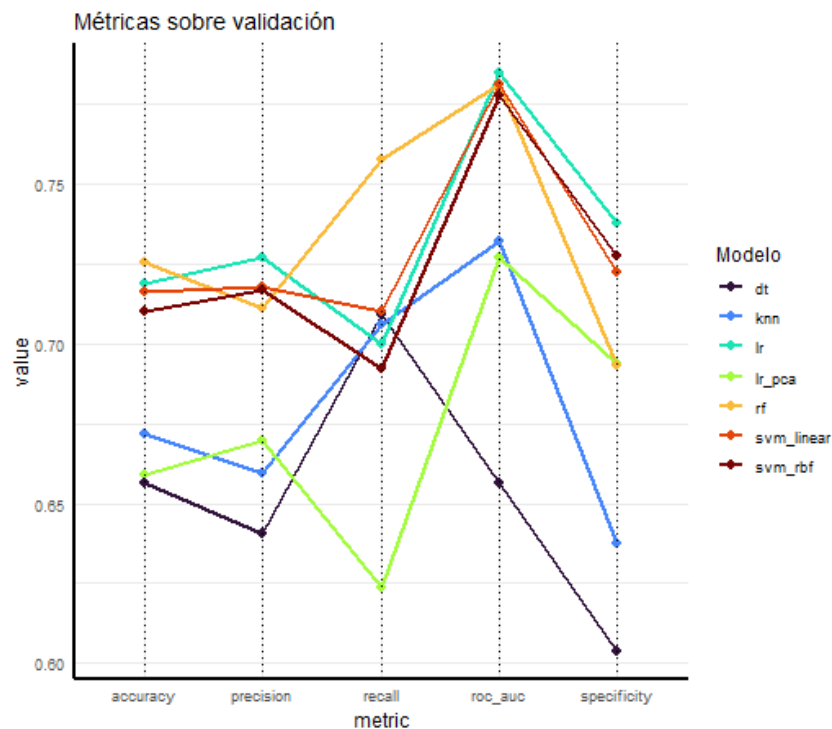


Figura 1.20: Métricas obtenidas sobre el conjunto de validación por cada uno de los modelos seleccionados.

Por último, para conocer la capacidad de generalización de los modelos construidos, estos se evaluarán sobre nuevas observaciones, el conjunto de datos test. Recuérdese que el entrenamiento de los modelos se ha realizado con el conjunto de entrenamiento, formado por 12927 observaciones tomadas entre el 2002 y mediados de 2014 y para ajustar los parámetros de cada modelo, se han utilizado 4309 observaciones tomadas entre mediados de 2014 y mediados de 2019. Finalmente, se evaluará la capacidad de predicción de los modelos sobre 4310 nuevas observaciones tomadas entre mediados de 2019 y 2022. Para ello, primero se juntarán los conjuntos de entrenamiento y validación para reentrenar los modelos con la configuración de parámetros seleccionada en cada caso, y posterior mente se compararán los valores predichos por los modelos con los valores reales. Los resultados obtenidos se muestran en la Tabla 1.2 y el la Figura 1.22. Las curvas ROC de los distintos modelos sobre el conjunto de datos test se muestra en la Figura 1.23.

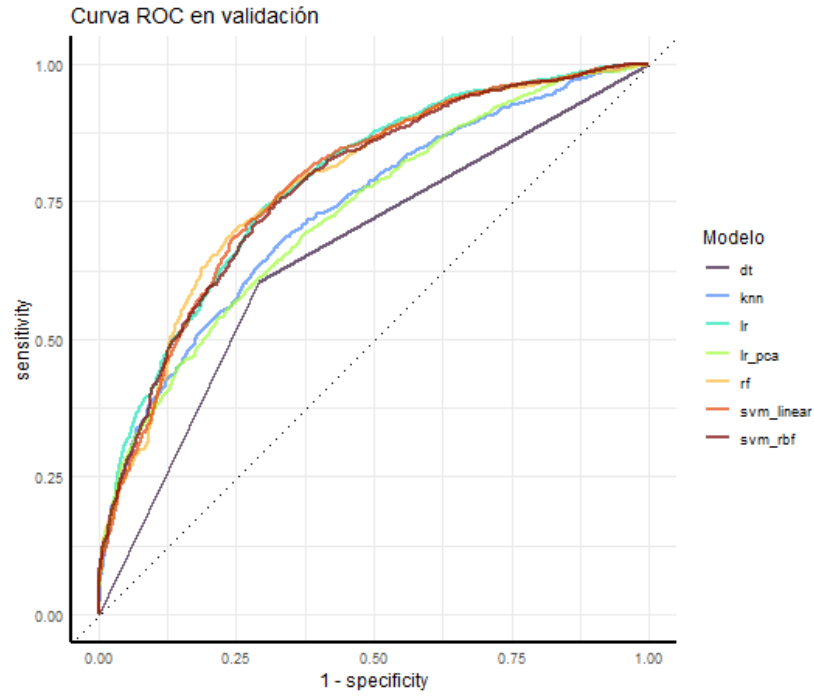


Figura 1.21: Curvas ROC sobre el conjunto de validación.

model_name	roc_auc	accuracy	recall	specificity	precision
lr	0.795	0.710	0.726	0.693	0.718
lr_pca	0.715	0.645	0.631	0.661	0.667
dt	0.667	0.668	0.712	0.621	0.670
rf	0.762	0.699	0.727	0.669	0.703
svm_linear	0.790	0.705	0.729	0.680	0.710
svm_rbf	0.789	0.706	0.727	0.683	0.712
knn	0.744	0.673	0.719	0.624	0.673

Tabla 1.2: Métricas sobre el conjunto test.

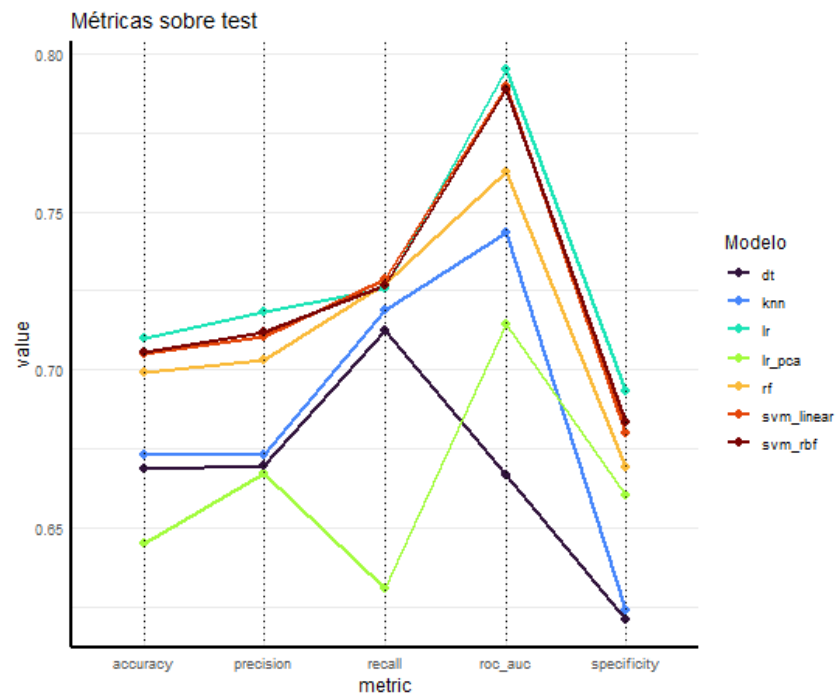


Figura 1.22: Métricas obtenidas sobre el conjunto test por cada uno de los modelos seleccionados.

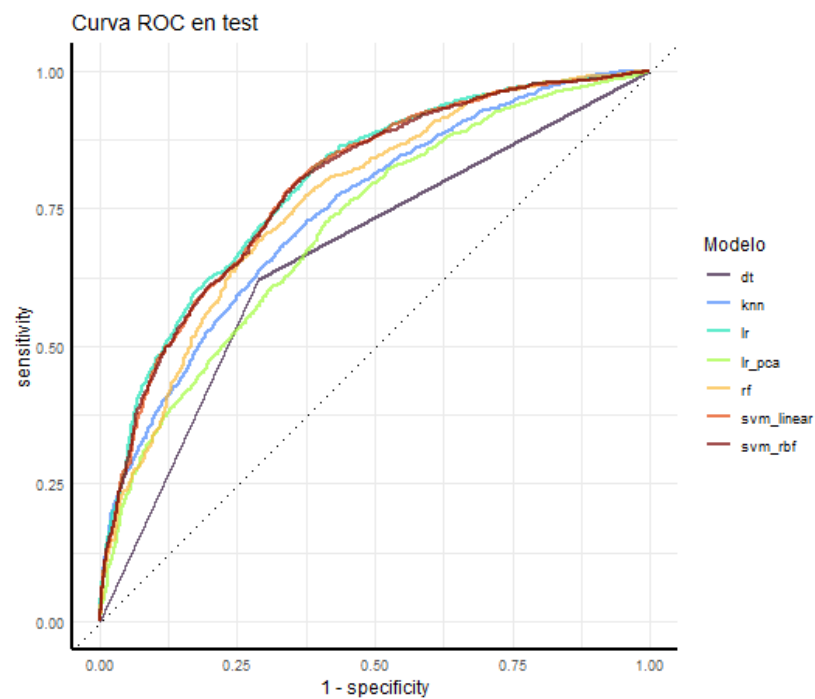


Figura 1.23: Curvas ROC sobre test.