**REPORTE DE RESULTADOS DE PREDICCIÓN DE LA VARIABLE CORRUPCIÓN INTENSA**

**1. Detalles sobre el presente reporte**

* Fecha: 15 de febrero de 2024
* Nivel de observación: año inicial del reporte por municipalidad y año.
* Variables predictoras: SIAF, Renamu y variables políticas
* Variable predicha: corrupción amplia
* Periodo en el que fue entrenado el modelo: 2016-2020
* Tipo de predicción: clasificación

**Etapas de preprocesamiento**

1. **Imputación de las variables de SIAF.** Se imputó a todas las variables provenientes de la base de datos SIAF con el valor de 0.
2. **Filtro de valores perdidos**. Se descartaron todas aquellas variables con un porcentaje de valores perdidos mayor o igual al umbral de 0.1.
3. **Imputación de variables de Renamu**. Se imputó a todas las variables provenientes de la base de datos Renamu. Las variables discretas fueron imputadas con moda, y las variables continuas, con media.
4. **Filtro de variabilidad**. Se descartaron todas aquellas variables constantes, es decir, con una variabilidad de 0.
5. **Imputación de outliers**. En este paso se considera solamente las variables de SIAF. Se imputaron los valores superiores al percentil 99% con el valor del percentil 99%.
6. **Transformaciones logarítmicas**. En este paso se considera solamente las variables de SIAF y consta de 3 etapas. Primero, se identifica todas las variables con al menos un valor negativo, y se las divide entre 1 millón. Segundo, se suma 1 a todas las variables de SIAF para evitar que los valores a ser transformados logarítmicamente tomen valores negativos. Tercero, se aplica la transformación logarítmica

**Número de variables**

La tabla 1 presenta información sobre el número de variables en la base de datos empleada, cuyo nivel de observación es año inicial del reporte por municipalidad y año.

Tabla 1. Número de variables antes y después del preprocesamiento

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **Fuente** | **Número de variables antes del preprocesamiento** | **Número de variables después del preprocesamiento** |
| SIAF | 17 550 | 14 300 |
| RENAMU | 737 | 217 |
| Variables políticas | 4 | 4 |
| Total | 18 291 | 14 521 |
| Fuente: elaboración propia | | |

**Métodos de (re)muestreo**

Se implementaron tres métodos de (re)muestreo sobre el conjunto de entrenamiento para balancear el número de observaciones por categoría de predicción. El conjunto de prueba mantiene su proporción original.

**Tabla 2.** Número de observaciones por categoría de predicción según método de (re)muestreo

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **Método de muestreo** | **Total de observaciones** | **Total de observaciones en las que sí ocurrió corrupción amplia** | **Total de observaciones en las que no ocurrió corrupción amplia** |
| Original | 967 | 896 | 71 |
| SMOTE | 1 792 | 896 | 896 |
| SMOTE Tomek-Links | 1 686 | 843 | 843 |
| Naive Random Oversampling | 1 792 | 896 | 896 |
| Fuente: elaboración propia | | | |

**Hiperparámetros considerados en el Grid Search**

Se utilizó el algoritmo gridsearchcv para realización una búsqueda exhaustiva de la mejor combinación de hiperparámetros (Grid Search). Los rangos de hiperparámetros considerados se presentan en las tablas 3 y 4.

**Tabla 3.** Hiperparámetros considerados en el Grid Search de los Métodos Basados en Árboles

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **Modelo** | **n\_estimators** | **max\_depth** | **max\_features** |
| Random Forest | 250, 500 y 1000 | 20 y 30 | 20%, 30%, 40% |
| Gradient Boosting Trees | 250, 500 y 1000 | 1 y 2 | 20%, 30%, 40% |
| LGBM Classifier | 250, 500 y 1000 | 1 y 2 | - |
| Regression Forest | 252, 500 y 1000 | 10, 20 y 30 | - |
| Fuente: elaboración propia | | | |

**Tabla 4**. Hiperparámetros considerados en el Grid Search de los Métodos de Regularización

|  |  |
| --- | --- |
| **Modelo** | **Cs (Fuerza de la regularización)** |
| Lasso | De 108 a 10-6, 100 valores en escala logarítmica |
| Ridge | De 108 a 10-6, 100 valores en escala logarítmica |
| Elastic Net | De 108 a 10-6, 100 valores en escala logarítmica |
| Fuente: elaboración propia | |

También debe considerarse que en el Grid Search se empleó, para todos los modelos, una validación cruzada en K-Folds, donde siempre tuvo el valor de 5. La métrica de desempeño usada para comparar los distintos modelos durante el Grid Search fue F1 (a excepción del método Regression Forest, donde se usó el R2).

**Resultados (métricas de desempeño)**

La tabla 5 presenta los resultados de los modelos de Machine Learning para el conjunto de entrenamiento NRO. Tomando en cuenta la métrica F1, el modelo con el mejor desempeño es el modelo **Random Forest** entrenado con el conjunto de entrenamiento SMOTE. Las combinaciones óptimas de hiperparámetros se reportan en los anexos 1 y 2.

**Tabla 5**. Métricas de desempeño de los modelos entrenados con el conjunto de entrenamiento SMOTE.

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Métrica** | **Regresión Logística** | **Lasso** | **Ridge** | **Elastic Net** | **Random Forest** | **Gradient Boosting Trees** | **LGBM Classifier** | **Regression Forest (threshold = 0.5)** |
| F1 | 0.326 | 0.426 | 0.426 | 0.426 | 0.627 | 0.594 | 0.557 | 0.604 |
| Accuracy | 0.340 | 0.427 | 0.427 | 0.427 | 0.725 | 0.723 | 0.701 | 0.643 |
| AUC ROC | 0.494 | 0.515 | 0.515 | 0.515 | 0.680 | 0.645 | 0.626 | 0.672 |
| F1 (Sí) | 0.230 | 0.447 | 0.447 | 0.447 | 0.818 | 0.823 | 0.810 | 0.729 |
| F1 (No) | 0.422 | 0.405 | 0.405 | 0.405 | 0.436 | 0.365 | 0.303 | 0.479 |
| Fuente: elaboración propia | | | | | | | | |

Asimismo, se presentan los 5 modelos con mejor considerando los distintos métodos de remuestreo empleados (SMOTE, SMOTE Tomek-Links y Naive Random Oversampling). Este ranking se realiza teniendo en cuenta la métrica F1:

**Tabla 6**. Cinco modelos con mayor poder predictivo considerando los distintos métodos de remuestreo

|  |  |
| --- | --- |
| **Modelo** | **F1** |
| Regression Forest NRO (threshold = 0.4) | 0.631 |
| Random Forest SMOTE | 0.627 |
| Regression Forest Original (threshold = 0.7) | 0.626 |
| Random Forest SMOTE Tomek-Links | 0.609 |
| Regression Forest NRO (threshold = 0.5) | 0.607 |
| Fuente: elaboración propia | |

El gráfico 1. Muestra el ajuste del modelo óptimo (**Random Forest** entrenado con el conjunto de entrenamiento SMOTE) a través de los distintos hiperparámetros considerados durante el proceso de Grid Search.

**Gráfico 1.** Grid Search F1 vs. Grid Search Parameters for the Random Forest SMOTE model.

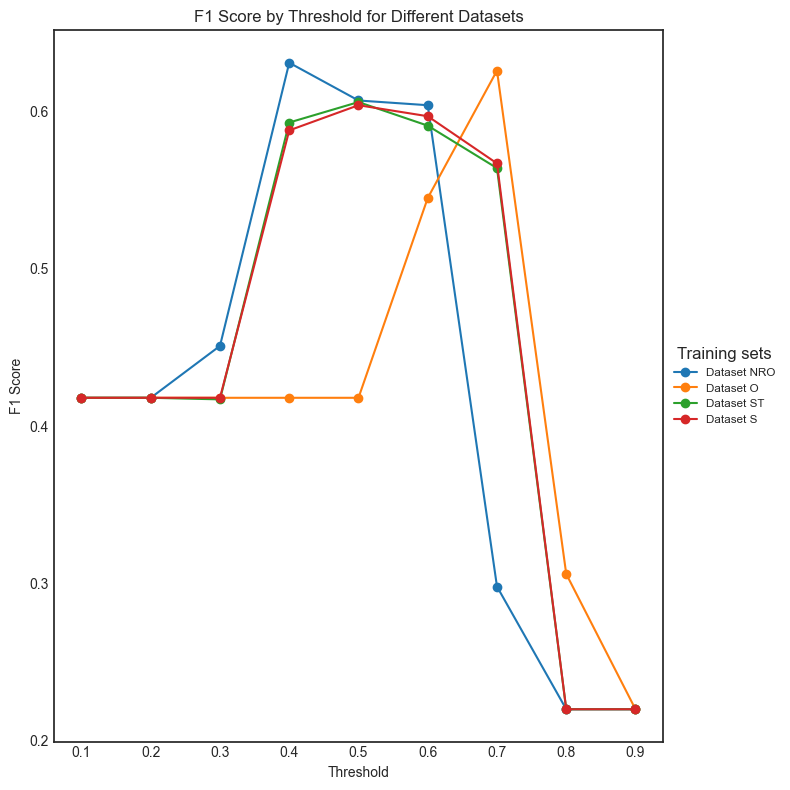
Gráfico, Gráfico de líneas

Descripción generada automáticamente

**Modelo Regression Forest a distintos thresholds**

Aunque está diseñado para tareas de regresión, el modelo Regression Forest genera predicciones que varían de 0 a 1. Las métricas anteriormente reportadas aplican un threshold de 0.5 para categorizar las predicciones en dos clases y calcular las métricas. A continuación se presenta un gráfico de cómo varía la métrica F1 en función de distintos thresholds en el rango [0.1, 0.9].

**Gráfico 2.** F1 en función de distintos thesholds para distintos conjuntos de entrenamiento. .



**Variables más importantes según el criterio de impureza de Gini**

En esta sección se presentan las 20 variables más importantes según el criterio de impureza de Gini (estimado mediante el comando feature importance) para el modelo óptimo.

**Tabla 7**. Veinte variables más importantes de acuerdo con el criterio de impureza de Gini

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **Variable** | **Etiqueta** | **Fuente** | **Importance Score** |
| \_tejgfun\_f5ct06amb | Total Ejecutado rezagado de la Fuente 5 (Recursos Determinados) en la Categoría 6 (Gastos de Capital) para la Función Ambiente | SIAF | 0.032 |
| \_tejgtotfun\_f5r18amb | Total Ejecutado rezagado de la Fuente 5 (Recursos Determinados) en el Rubro 18 (Canon y Sobrecanon, Regalías, Renta de Aduanas y Participaciones) para la Función Ambiente | SIAF | 0.024 |
| \_tejgfun\_f5ct06ambpc | Total Ejecutado rezagado per cápita de la Fuente 5 (Recursos Determinados) en la Categoría 6 (Gastos de Capital) para la Función Ambiente | SIAF | 0.018 |
| \_tejgtotfun\_f5amb | Total Ejecutado rezagado de la Fuente 5 (Recursos Determinados) para el gasto total de la Función Ambiente | SIAF | 0.011 |
| devppimtotfun\_f5r18opseg | Porcentaje Devengado del PIM de la Fuente 5 (Recursos Determinados) en el Rubro 18 (Canon y Sobrecanon, Regalías, Renta de Aduanas y Participaciones) para la Función Orden Público y Seguridad | SIAF | 0.009 |
| \_tejgtotfun\_f5r18ambpc | Total Ejecutado rezagado per cápita de la Fuente 5 (Recursos Determinados) en el Rubro 18 para la Función Ambiente | SIAF | 0.008 |
| \_tejgtotfun\_f5r08pgrco | Total Ejecutado rezagado de la Fuente 5 (Recursos Determinados) en el Rubro 08 (Impuestos Municipales) para la Función Planeamiento, Gestión y Reserva de Contingencia | SIAF | 0.007 |
| \_tejgge\_r08ct05biser | Total Ejecutado rezagado en el Rubro 08 (Impuestos Municipales), Categoría 5 (Gastos Corrientes), para la genérica de Bienes y Servicios | SIAF | 0.006 |
| \_tejgrb\_impm | Total Ejecutado rezagado en el Rubro de Impuestos Municipales | SIAF | 0.006 |
| empinc\_7 | La municipalidad realizó acciones realizadas en promoción de MYPES/educación financiera (dicotómica) | Renamu | 0.005 |
| tejgfun\_f5ct05prots | Total Ejecutado de la Fuente 5 (Recursos Determinados) en la Categoría 5 (Gastos Corrientes) para la Función 23 (Protección Social) | SIAF | 0.005 |
| \_tejgfun\_f5r18ct05pgrco | Total Ejecutado rezagado de la Fuente 5 (Recursos Determinados) en el Rubro 18 (Canon y Sobrecanon, Regalías, Renta de Aduanas y Participaciones), Categoría 5 (Gastos Corrientes) para la Función 03 (Planeamiento, Gestión y Reserva de Contingencia) | SIAF | 0.005 |
| tejgtotfun\_f5r07ambpc | Total Ejecutado per cápita de la Fuente 5 (Recursos Determinados) en el Rubro 07 (Fondo de Compensación Municipal), para la Función Ambiente | SIAF | 0.005 |
| empinc\_4 | La municipalidad realizó acciones realizadas en promoción de MYPES/convenios con ONGs, empresas privadas (dicotómica) | Renamu | 0.004 |
| tejgtotfun\_f5r18ambpc | Total Ejecutado per cápita de la Fuente 5 (Recursos Determinados) en el Rubro 18 (Canon y Sobrecanon, Regalías, Renta de Aduanas y Participaciones) para la Función Ambiente | SIAF | 0.004 |
| \_tejgct\_r08gstcr | Total Ejecutado rezagado en la Categoría de Gastos Corrientes del Rubro 08 (Impuestos Municipales) | SIAF | 0.004 |
| \_tejgtotfun\_f5r07amb | Total Ejecutado rezagado de la Fuente 5 (Recursos Determinados) en el Rubro 07 (Fondo de Compensación Municipal) para la Función Ambiente | SIAF | 0.004 |
| tejgtotfun\_f5r18amb | Total Ejecutado de la Fuente 5 (Recursos Determinados) en el Rubro 18 (Canon y Sobrecanon, Regalías, Renta de Aduanas y Participaciones) para la Función Ambiente | SIAF | 0.003 |
| tejgtotfun\_f5r07amb | Total Ejecutado de la Fuente 5 (Recursos Determinados) en el Rubro 07 (Fondo de Compensación Municipal) para la Función Ambiente | SIAF | 0.003 |
| \_tejgge\_r09ct05biser | Total Ejecutado rezagado en el Rubro 09 (Recursos Directamente Recaudados), Categoría 5 (Gastos Corrientes), para la genérica de Bienes y Servicios | SIAF | 0.003 |

Asimismo, se visualiza la correlación entre las 20 variables más importantes según el criterio de impureza de Gini y las variables de Canon.

**Gráfico 3.** Correlación entre las 20 variables más importantes según el criterio de impureza de Gini y las variables de Canon.

Gráfico, Calendario, Gráfico de rectángulos

Descripción generada automáticamente

**Variables más importantes según el criterio de SHAP Values**

En esta sección se presentan las 20 variables más importantes según el criterio de SHAP Values para el modelo óptimo.

**Tabla 8**. Veinte variables más importantes de acuerdo con el criterio de SHAP Values.

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **Variable** | **Etiqueta** | **Fuente** | **SHAP Values** |
| \_tejgfun\_f5ct06amb | Total Ejecutado rezagado de la Fuente 5 (Recursos Determinados) en la Categoría 6 (Gastos de Capital) para la Función Ambiente | SIAF | 0.031 |
| \_tejgtotfun\_f5r18amb | Total Ejecutado rezagado de la Fuente 5 (Recursos Determinados) en el Rubro 18 (Canon y Sobrecanon, Regalías, Renta de Aduanas y Participaciones) para la Función Ambiente | SIAF | 0.024 |
| \_tejgfun\_f5ct06ambpc | Total Ejecutado rezagado per cápita de la Fuente 5 (Recursos Determinados) en la Categoría 6 (Gastos de Capital) para la Función Ambiente | SIAF | 0.017 |
| \_tejgtotfun\_f5amb | Total Ejecutado rezagado de la Fuente 5 (Recursos Determinados) para el gasto total de la Función Ambiente | SIAF | 0.012 |
| \_tejgtotfun\_f5r18ambpc | Total Ejecutado rezagado per cápita de la Fuente 5 (Recursos Determinados) en el Rubro 18 para la Función Ambiente | SIAF | 0.008 |
| devppimtotfun\_f5r18opseg | Porcentaje Devengado del PIM de la Fuente 5 (Recursos Determinados) en el Rubro 18 (Canon y Sobrecanon, Regalías, Renta de Aduanas y Participaciones) para la Función Orden Público y Seguridad | SIAF | 0.007 |
| \_tejgge\_r08ct05biser | Total Ejecutado rezagado en el Rubro 08 (Impuestos Municipales), Categoría 5 (Gastos Corrientes), para la genérica de Bienes y Servicios | SIAF | 0.007 |
| \_tejgtotfun\_f5r08pgrco | Total Ejecutado rezagado de la Fuente 5 (Recursos Determinados) en el Rubro 08 (Impuestos Municipales) para la Función Planeamiento, Gestión y Reserva de Contingencia | SIAF | 0.007 |
| empinc\_7 | La municipalidad realizó acciones realizadas en promoción de MYPES/educación financiera (dicotómica) | Renamu | 0.006 |
| tejgfun\_f5ct05prots | Total Ejecutado de la Fuente 5 (Recursos Determinados) en la Categoría 5 (Gastos Corrientes) para la Función 23 (Protección Social) | SIAF | 0.005 |
| \_tejgrb\_impm | Total Ejecutado rezagado en el Rubro de Impuestos Municipales | SIAF | 0.005 |
| empinc\_4 | La municipalidad realizó acciones realizadas en promoción de MYPES/convenios con ONGs, empresas privadas (dicotómica) | Renamu | 0.005 |
| \_tejgfun\_f5r18ct05pgrco | Total Ejecutado rezagado de la Fuente 5 (Recursos Determinados) en el Rubro 18 (Canon y Sobrecanon, Regalías, Renta de Aduanas y Participaciones), Categoría 5 (Gastos Corrientes) para la Función 03 (Planeamiento, Gestión y Reserva de Contingencia) | SIAF | 0.005 |
| tejgtotfun\_f5r07ambpc | Total Ejecutado per cápita de la Fuente 5 (Recursos Determinados) en el Rubro 07 (Fondo de Compensación Municipal), para la Función Ambiente | SIAF | 0.005 |
| tejgtotfun\_f5r18ambpc | Total Ejecutado per cápita de la Fuente 5 (Recursos Determinados) en el Rubro 18 (Canon y Sobrecanon, Regalías, Renta de Aduanas y Participaciones) para la Función Ambiente | SIAF | 0.004 |
| tejgtotfun\_f5r18amb | Total Ejecutado de la Fuente 5 (Recursos Determinados) en el Rubro 18 (Canon y Sobrecanon, Regalías, Renta de Aduanas y Participaciones) para la Función Ambiente | SIAF | 0.004 |
| tejgtotfun\_f5r07amb | Total Ejecutado de la Fuente 5 (Recursos Determinados) en el Rubro 07 (Fondo de Compensación Municipal) para la Función Ambiente | SIAF | 0.004 |
| \_tejgtotfun\_f5r07amb | Total Ejecutado rezagado de la Fuente 5 (Recursos Determinados) en el Rubro 07 (Fondo de Compensación Municipal) para la Función Ambiente | SIAF | 0.003 |
| \_tejgct\_r09gstcr | Total Ejecutado rezagado en la Categoría de Gastos Corrientes del Rubro 09 (Recursos Directamente Recaudados) | SIAF | 0.003 |
| \_tejgge\_r09ct05biser | Total Ejecutado rezagado en el Rubro 09 (Recursos Directamente Recaudados), Categoría 5 (Gastos Corrientes), para la genérica de Bienes y Servicios | SIAF | 0.003 |

Asimismo, se visualiza la correlación entre las 20 variables más importantes según el criterio SHAP Values y las variables de Canon.

**Gráfico 4.** Correlación entre las 20 variables más importantes según el criterio de SHAP Values y las variables de Canon.

Gráfico, Calendario, Gráfico de rectángulos

Descripción generada automáticamente

Adicionalmente se presenta un gráfico de SHAP Values que indica cómo cada una de las 10 variables más importantes influye en la predicción de casos de corrupción intensa para el modelo óptimo seleccionado. Cada punto representa una observación: los puntos rojos indican valores altos de la característica y los azules, valores bajos. La posición horizontal de los puntos refleja la magnitud de la influencia de la característica en la predicción. Las características están ordenadas de mayor a menor impacto en el eje vertical. Un punto hacia la derecha sugiere que la característica incrementa la probabilidad de corrupción intensa, mientras que un punto hacia la izquierda sugiere lo contrario. La concentración de puntos muestra la variabilidad de la influencia de la característica: una mayor dispersión indica mayor variabilidad en su impacto en las predicciones.

**Gráfico 5.** 10 variables más importantes según criterio SHAP para casos positivos de Corrupción Intensa

Imagen que contiene Gráfico

Descripción generada automáticamente

**Reentranamiento del modelo óptimo**

Una vez seleccionado el modelo óptimo (Random Forest SMOTE), se seleccionaron las variables más importantes según el criterio de impureza de Gini a un 80% de suma acumulada. En total fueron **3038 variables**. Una vez seleccionadas las variables, se reentró el modelo Random Forest SMOTE con los mismos hiperparámetros que en el modelo óptimo seleccionado (véase el Anexo 1). La tabla 9 presenta las métricas de desempeño sobre el conjunto de prueba.

**Tabla 9.** Métricas de desempeño para el modelo óptimo entrenado con variables seleccionadas mediante el 80% de suma acumulada según el criterio de impureza de Gini

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Modelo** | **F1** | **Accuracy** | **ROC AUC** | **F1 (Sí)** | **F1 (No)** |
| Random Forest SMOTE (variables = 80% de suma acumulada según el criterio de impureza de Gini). | 0.604 | 0.713 | 0.665 | 0.812 | 0.396 |
| Fuente: elaboración propia | | | | | |

**ANEXOS**

**Anexo 1. Combinación óptima de hiperparámetros para modelos SMOTE en árboles**

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **Modelo** | **n\_estimators** | **max\_depth** | **max\_features** |
| Regression Forest | 500 | 20 | - |
| LGBM Classifier | 1000 | 2 | - |
| Gradient Boosting Trees | 1000 | 2 | 20% |
| Random Forest | 500 | 30 | 20% |
| Fuente: elaboración propia | | | |

**Anexo 2. Combinación óptima de hiperparámetros para modelos SMOTE de regularización**

|  |  |
| --- | --- |
| **Modelo** | **Cs (Fuerza de la regularización)** |
| Lasso | 1450829 |
| Ridge | 1450829 |
| Elastic Net | 1450829 |
| Fuente: elaboración propia | |