

Mineria de Datos

Clasificación Supervisada: Regresión Logística

Dr. Edgar Acuna
Departamento de Matemáticas

Universidad de Puerto Rico- Mayagüez

math.uprrm.edu/~edgar

Consideraremos por ahora que solo tenemos dos clases. O sea, que nuestro conjunto de datos consiste de una muestra de tamaño $n=n_1+n_2$, n_1 observaciones son de la clase C_1 y n_2 son de la clase C_2 .

Para cada observación \mathbf{x}_j se introduce una variable binaria Y que vale 1 si ella es de la clase C_1 y vale 0 si la observacion pertenece a la clase C_2 .

La variable Y tiene una *probabilidad a priori* π_1 de que y sea igual 1.

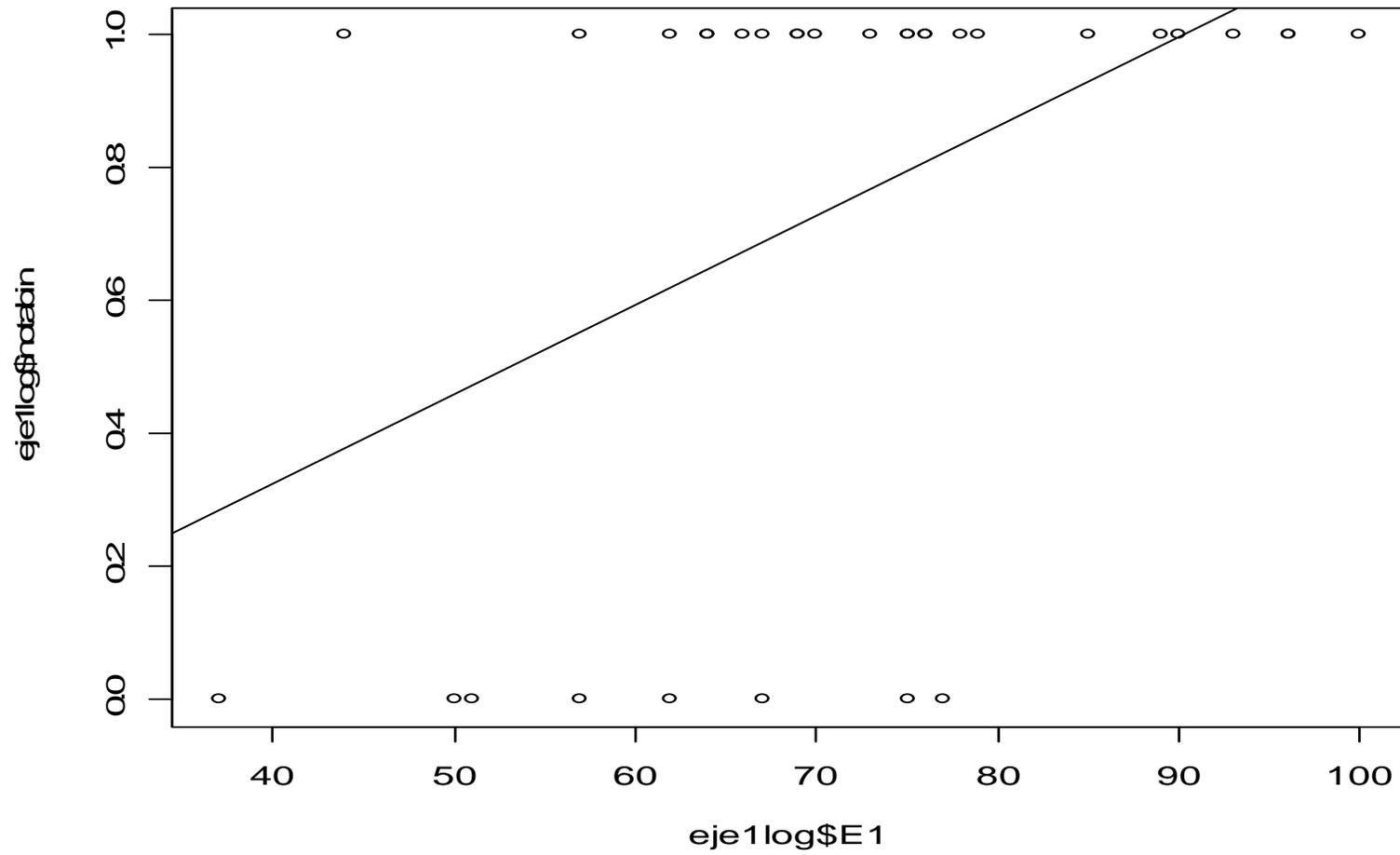
EJEMPLO DE PREDICCIÓN DE LA NOTA FINAL USANDO SOLO EX1

```
> > eje1log[,c(1,4)]
```

```
E1 notabin
```

1	96	1
2	96	1
3	100	1
4	93	1
5	90	1
6	75	1
7	75	1
8	64	1
9	89	1
10	57	1
11	70	1
12	44	1
13	

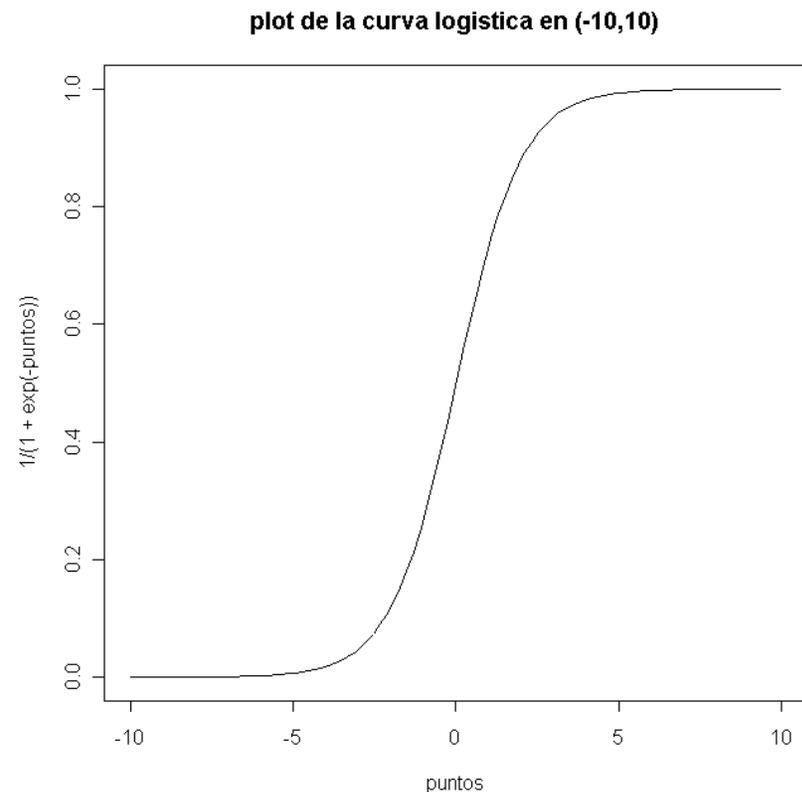
regresion lineal para predecir nota final



La Curva Logística

Funcion de distribución
logística

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



En el modelo logístico se asume que

$$\log\left(\frac{f(x/C_1)}{f(x/C_2)}\right) = \alpha + \beta'x$$

Aquí x es un vector p -dimensional de variables predictoras y β es un vector de p parámetros. Entre las distribuciones que satisfacen esta suposición está la Normal multivariada con igual matriz de covarianza por clase.

Por otro lado sea $p = P(Y=1/x)$ la probabilidad a posteriori de que y sea igual a 1, entonces se puede notar que:

$$\frac{p}{1-p} = \frac{\frac{\pi_1 f(x/C_1)}{f(x)}}{\frac{\pi_2 f(x/C_2)}{f(x)}} = \frac{\pi_1 f(x/C_1)}{\pi_2 f(x/C_2)}$$

donde $\frac{p}{1-p}$

es llamado la razón de apuestas (**odds ratio**). Tomando logaritmos en ambos lados se obtiene

$$\log\left(\frac{p}{1-p}\right) = \log\left(\frac{\pi_1}{\pi_2}\right) + \log\frac{f(\mathbf{x}/C_1)}{f(\mathbf{x}/C_2)}$$

Assumiendo distribución normal multivariada de las predictoras se obtiene.

$$\log\left(\frac{p}{1-p}\right) = \log\left(\frac{\pi_1}{\pi_2}\right) + (\mu_1 - \mu_2)' \Sigma^{-1} [\mathbf{x} - (1/2)(\mu_1 + \mu_2)]$$

que puede ser escrita de la forma

$$\log\left(\frac{p}{1-p}\right) = \alpha + \beta' \mathbf{x}$$

o de la forma

$$p = \frac{\exp(\alpha + \beta' \mathbf{x})}{1 + \exp(\alpha + \beta' \mathbf{x})}$$

esta ecuación es llamada regresión logística y

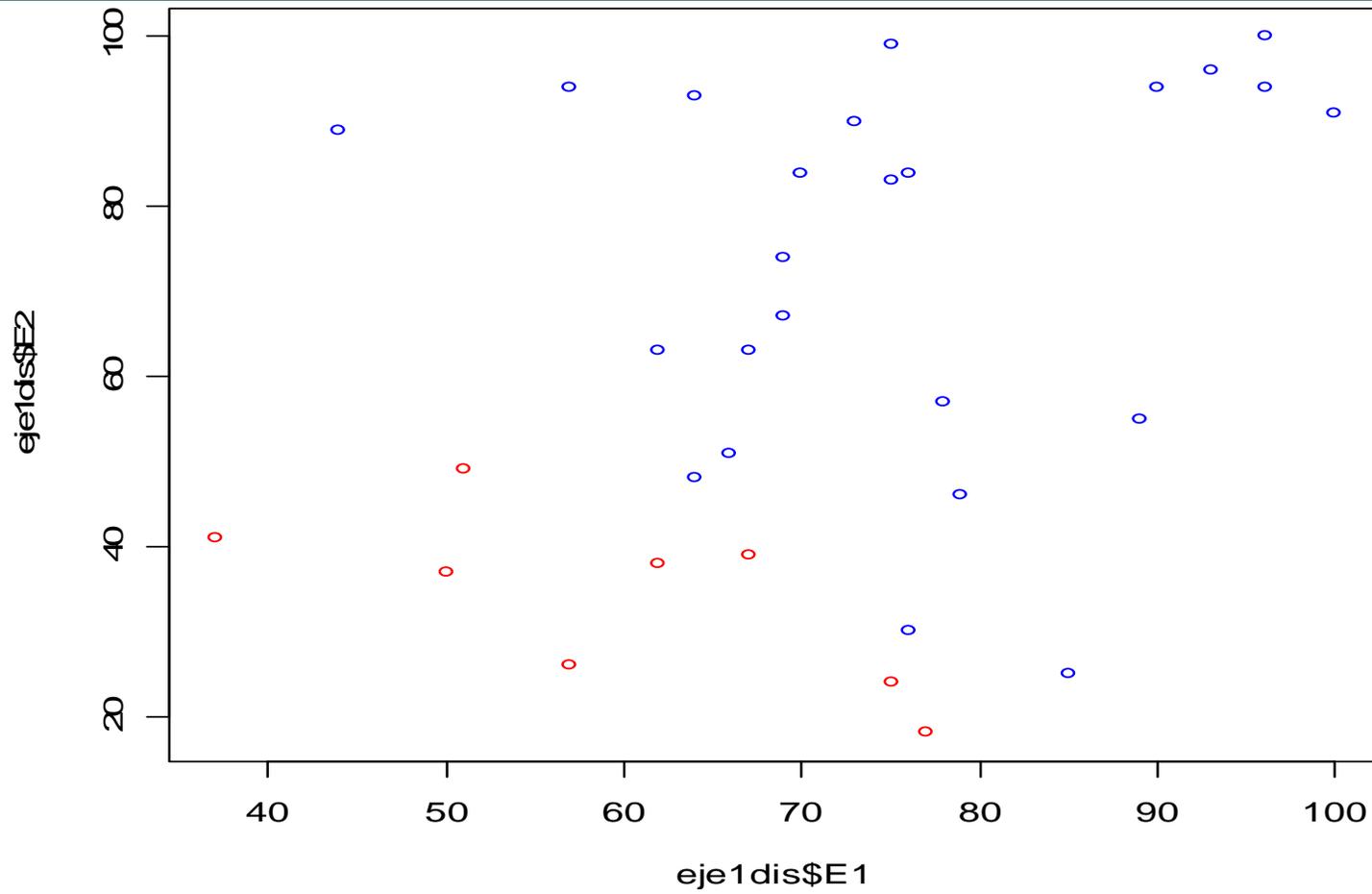
$$\log\left(\frac{p}{1-p}\right)$$

es llamado la transformación **logit**.

Los estimados $\tilde{\alpha}$ y $\tilde{\beta}$ son aquellos que maximizan la función anterior y son encontrados aplicando métodos iterativos tales como Newton-Raphson (SAS) o mínimos cuadrados reponderados iterativos (MINITAB, R).

Sin embargo algunas veces hay problemas de convergencia, generado cuando hay separabilidad entre las clases.

Total Separability



Regresion logistica en R

```
> notaslog=glm(notabin~E1+E2,data=eje1log,family=binomial)
```

Warning messages:

```
1: In glm.fit(x = X, y = Y, weights = weights, start = start, etastart =  
etastart, :
```

```
algorithm did not converge
```

```
2: In glm.fit(x = X, y = Y, weights = weights, start = start, etastart =  
etastart, :
```

```
fitted probabilities numerically 0 or 1 occurred
```

```
> notaslog
```

```
Call: glm(formula = notabin ~ E1 + E2, family = binomial, data = eje1log)
```

```
Coefficients:
```

(Intercept)	E1	E2
-1233.64	13.08	8.67

```
Degrees of Freedom: 31 Total (i.e. Null); 29 Residual
```

```
Null Deviance: 35.99
```

```
Residual Deviance: 1.791e-08 AIC: 6
```

Regresion logistica en R

```
> notaslog$fit
  1      2      3      4      5      6
1.000000e+00 1.000000e+00 1.000000e+00 1.000000e+00 1.000000e+00 1.000000e+00
  7      8      9     10     11     12
1.000000e+00 1.000000e+00 1.000000e+00 1.000000e+00 1.000000e+00 1.000000e+00
 13     14     15     16     17     18
1.000000e+00 1.000000e+00 1.000000e+00 1.000000e+00 1.000000e+00 1.000000e+00
 19     20     21     22     23     24
1.000000e+00 1.000000e+00 1.000000e+00 1.000000e+00 1.000000e+00 1.000000e+00
 25     26     27     28     29     30
2.220446e-16 2.220446e-16 4.525405e-09 2.220446e-16 2.220446e-16 2.220446e-16
 31     32
2.220446e-16 2.220446e-16
```

Hay una probabilidad 1 de que los 24 primeros estudiantes aprueban las clases y una probabilidad 0 de que los 8 ultimos aprueben las clases. Esto ocurre porque hay total separability

Regresion logistica para classificacion

Para efectos de clasificación la manera más fácil de discriminar es considerar que si $p > 0.5$ entonces la observación pertenece a la clase que uno está interesado. Pero algunas veces esto puede resultar injusto sobre todo si se conoce si una de las clases es menos frecuente que la otra.

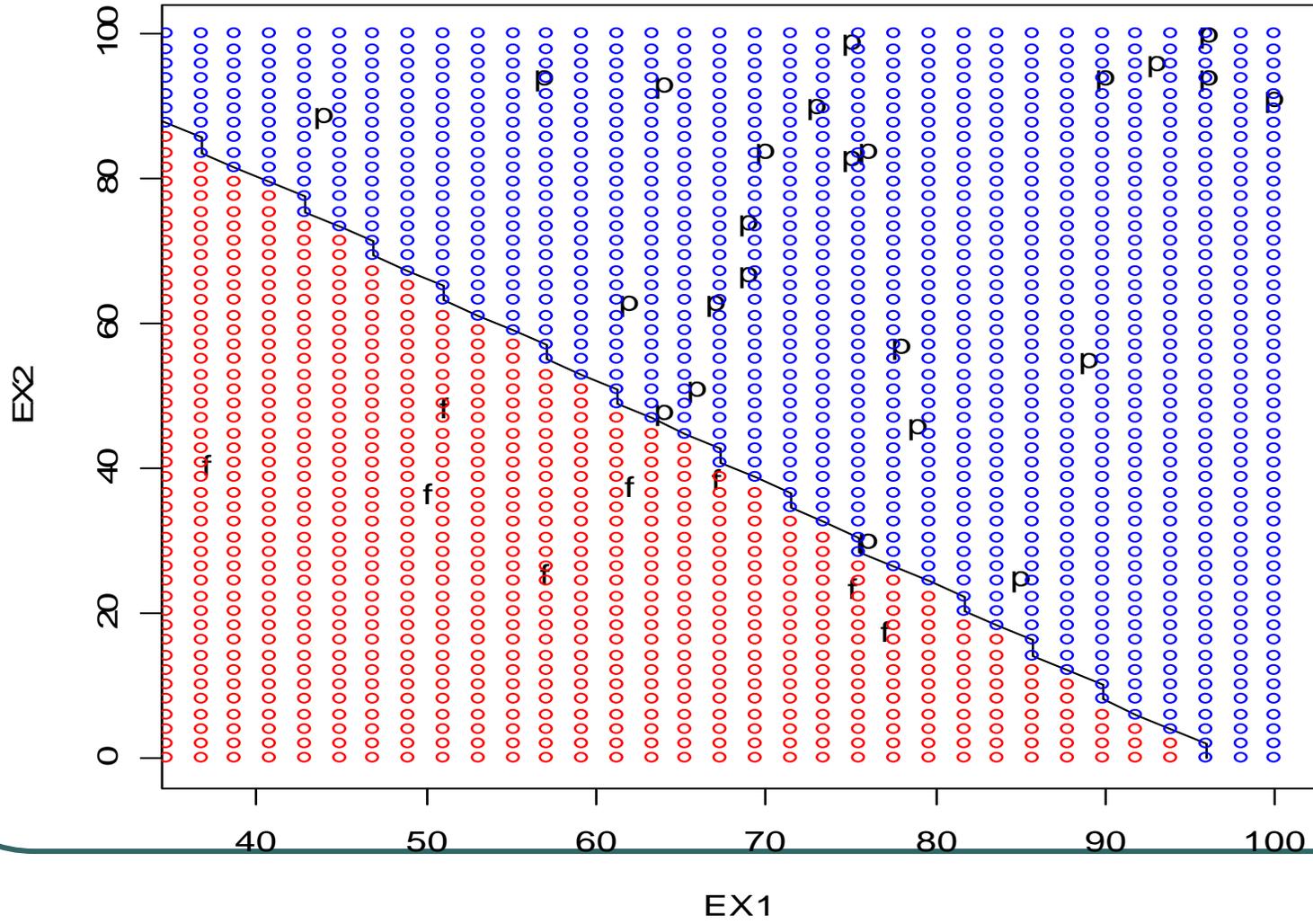
Métodos alternos son:

i) Plotear el porcentaje de observaciones que poseen el evento (o sean que pertenecen al grupo 1) y que han sido correctamente clasificadas (Sensitividad) versus distintos niveles de probabilidad y el porcentaje de observaciones de la otra clase que han sido correctamente clasificadas (especificidad) versus los mismos niveles de probabilidad anteriormente usados, en la misma gráfica. La probabilidad que se usará para clasificar las observaciones se obtienen intersectando las dos curvas.

ii) Usar la curva ROC (receiver operating characteristic curva). En este caso se grafica la sensibilidad versus (1-especificidad)100%, y se coge como el p ideal aquel que está más cerca a la esquina superior izquierda, o sea al punto (0,100).

En **R** para hacer discriminación logística con dos clases se usa la función **glm** (modelo lineal general) con la opción **family=binomial**, También se puede usar la función **lrm** de la librería Design.

Grafica de las fronteras de logistica



Example: Bupa

```
bupalog=glm(V7~.,data=bupa1,family=binomial)
```

```
phat=bupalog$fit
```

```
b=as.numeric(names(phat[phat>=.5]))
```

```
nobs=345
```

```
classes=rep(0,nobs)
```

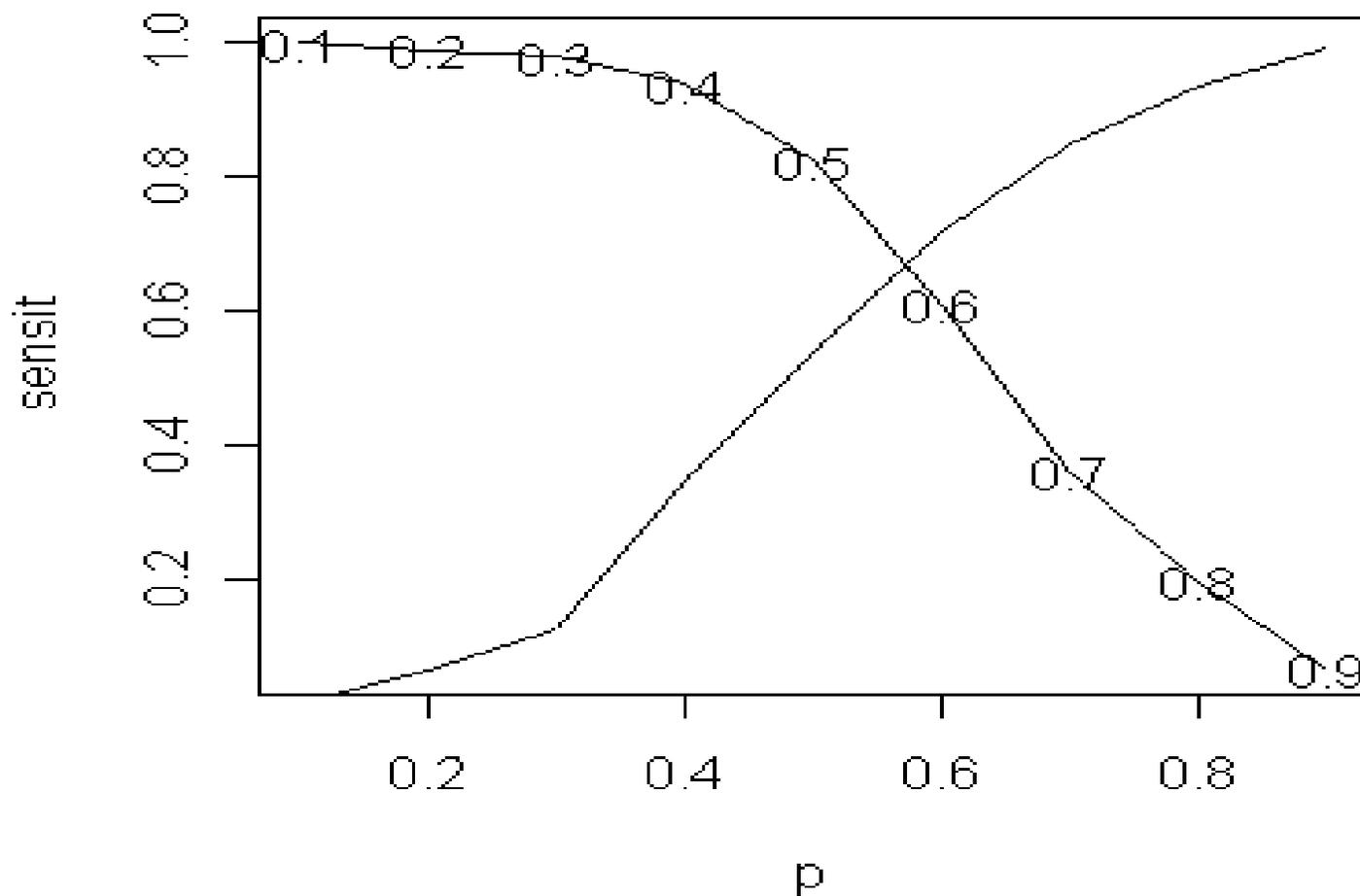
```
classes[b]=1
```

```
mean(classes!=bupa1[,7])
```

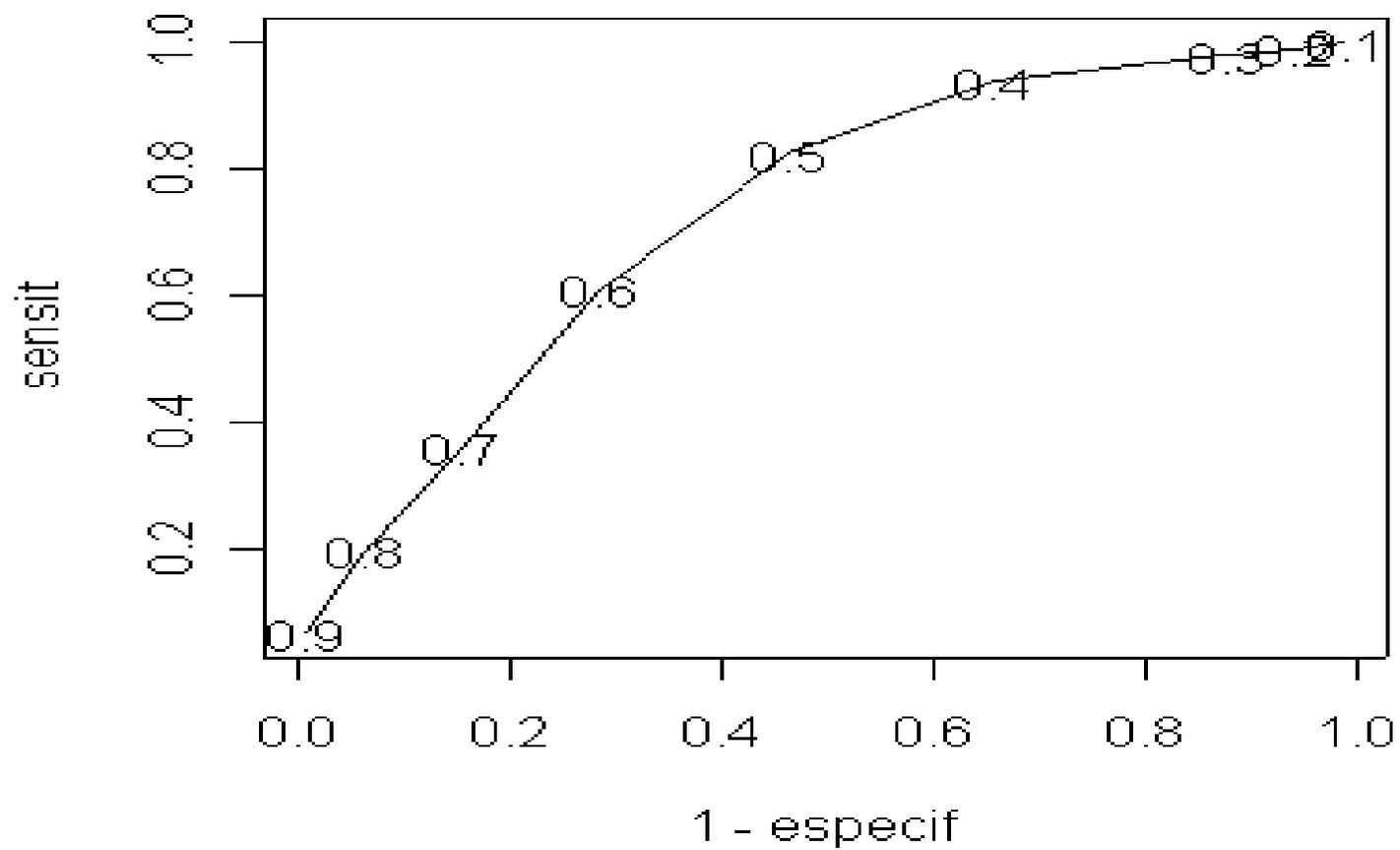
```
[1] 0.2956522
```

```
>
```

Ploteando la sensibilidad y especificidad para varios p



La curva ROC



```
#Notar que para  $p=.57$  la curva esta mas cerca a la esquina
superior izquierda
> #Clasificacion final
> clasesf<-rep(0,nobs)
> for(i in 1:nobs)
+ {if(phat[i]>=0.57){clasesf[i]<-1}
+ }
> ratef<-mean(clasesf!=bupa1[,7])
> cat("la tasa de mala clasificacion optima es=",ratef,"\n")
la tasa de mala clasificacion optima es= 0.3246377
>
```

Multiclass logistic regression

Si se tuvieran K clases entonces los odds ratios son tomados con respecto a una de ellas, por decir la k -ésima clase. Así,

$$\text{Log}[P(Y=j/x)/P(Y=K/x)]=\alpha_j+\beta'_j\mathbf{x} \quad \text{para } j=1,2,\dots,K-1$$

De donde,

$$\sum_{j=1}^{K-1} P(Y = j / x) = P(Y = K / x) \exp(\alpha_j + \beta'_j x)$$

y usando el hecho que

$$\sum_{j=1}^K P[Y = j / \mathbf{x}] = 1$$

Multiclass logistic regression

Se tiene que

$$p_j = P[Y = j / \mathbf{x}] = \frac{\exp(\alpha_j + \beta'_j \mathbf{x})}{1 + \sum_{j=1}^{K-1} \exp(\alpha_j + \beta'_j \mathbf{x})}$$

Para $j=1,2,\dots,K-1$, y,

$$p_K = P[Y = K / \mathbf{x}] = \frac{1}{1 + \sum_{j=1}^{K-1} \exp(\alpha_j + \beta'_j \mathbf{x})}$$

En el area de neural networks estas funciones son llamadas softmax. El objeto \mathbf{x} es asignado a la clase j^* tal que $j^* = \text{argmax}(p_j)$. En el algoritmo el vector de K clases es transformado en una matriz de k columnas con entradas 0 y 1 y en el output son reemplazadas por las probabilidades posteriores. Para hacer discriminación logística con varias clases se usa la función **Multinom** de la librería **nnet**.

Example: Vehicle

```
> cv10log(vehicle,10)
```

los estimados del error en cada repeticion son

```
[1] 0.1914894 0.2033097 0.1950355 0.1985816 0.1926714  
0.1985816 0.1973995
```

```
[8] 0.2044917 0.2033097 0.1973995
```

El estimado del error por VC en el numero de repeticiones dados es

```
[1] 0.1982270
```

```
>
```

Example: Iris

```
library(nnet)
> cv10lda(my.iris, repet=10)
[1] 0.02133333
➤ cv10log(my.iris, repet=10)
los estimados del error en cada repeticion son
[1] 0.04000000 0.02000000 0.02666667 0.03333333 0.03333333
0.03333333
[7] 0.02666667 0.02000000 0.02666667 0.02000000
El estimado del error por VC en el numero de repeticiones dados es
[1] 0.028
```

Si la suposicion de normalidad se cumple entonces el discriminante lineal es mejor que la regresion logistica. La regresion logistica se relaciona con otro clasificador llamado maquina de soporte vectorial (SVM).