1 Análisis Multivariado - Práctica 5

1.1 Clasificación y Coordenadas discriminantes

1. Sea $\mathbf{x} \sim Bi(n, \theta_i)$ en G_i, con $i = 1, 2$. Encontrar la regla óptima de clasificación y mostrar que puede llevarse a una función discriminante lineal.

2. Supongamos que $\mathbf{x} \sim Exp(\lambda_i)$ en G_i, con $i = 1, 2$.

   (a) Encontrar la regla óptima de clasificación y expresarla como una función discriminante lineal.

   (b) Calcular la probabilidad total de mala clasificación $P(\mathcal{R}, \mathbf{f})$ cuando $\pi_1 = \pi_2$.

   (c) Tomemos $\lambda_1 = 1$ y $\lambda_2 = \lambda > 1$. Estudiar el límite de $P(\mathcal{R}, \mathbf{f})$ cuando $\lambda \to \infty$. Sacar conclusiones.

3. Una regla de clasificación es *minimax* si las regiones que definen el criterio de clasificación se buscan de modo que minimicen $\max\{P(1 \mid 2), P(2 \mid 1)\}$.

   (a) Dado $\alpha \in (0, 1)$, verificar que

   $$\max\{P(1 \mid 2), P(2 \mid 1)\} \geq (1 - \alpha)P(1 \mid 2) + \alpha P(2 \mid 1)$$

   (b) Para cada α, encontrar la regla que minimiza el lado derecho de la ecuación anterior.

   (c) Probar que la regla minimax está dada por

   $$R_1 = \left\{ x : \frac{f_1(x)}{f_2(x)} > c \right\}$$

   donde c satisface que $P(1 \mid 2) = P(2 \mid 1)$.

4. Sea $\mathbf{x}$ un vector aleatorio, y sean $\mu_1 = E(\mathbf{x} \mid G_1)$, $\mu_2 = E(\mathbf{x} \mid G_2)$. Supongamos que la matriz de covarianza $\Sigma = E\left((\mathbf{x} - \mu_i)(\mathbf{x} - \mu_i)'\right)$ $(i = 1, 2)$ es la misma para ambas poblaciones, que los costos son iguales y que las π_i también lo son.

   (a) Si B se define como $B = c(\mu_1 - \mu_2)(\mu_1 - \mu_2)'$ para alguna constante c, verificar que $\mathbf{e} = c\Sigma^{-1}(\mu_1 - \mu_2)$ es de hecho un autovector (sin escalar) de $\Sigma^{-1}B$.

   (b) Deducir que cuando $k = 2$, el criterio de clasificación de Fisher (es decir el análisis discriminante) coincide con la regla óptima para la normal.

5. Sea el siguiente modelo de regresión: $z = b\prime\mathbf{x} + \mathbf{e}$, $\mathbf{e}$ con distribución logística. Supongamos que sólo observamos si $z > 0$ ó $z < 0$, (no su valor). Mostrar que estimar a b coincide con encontrar el estimador de los parámetros del modelo de clasificación basada en el modelo de regresión logística en el caso $k = 2$.

6. Consideremos los datos "iris" del R. Es un conjunto de datos analizados por Fisher que consisten en 4 mediciones realizadas en 50 flores iris de cada una de 3 especies distintas (Setosa, Versicolor y Virginica). Las 4 variables, medidas en centímetros, son

$$\begin{aligned} X_1 &= \text{Longitud de los sépalos (sepal length)} \\ X_2 &= \text{Ancho de los sépalos (sepal width)} \\ X_3 &= \text{Longitud de los pétalos (petal length)} \\ X_4 &= \text{Ancho de los pétalos (petal width)} \end{aligned}$$

   (a) Suponiendo normalidad en los datos, hacer una clasificación lineal y calcular el error de clasificación por los 3 métodos:

      i. "Ingenuo" (calcular la proporción de datos mal clasificados) o error aparente
      ii. Validación cruzada

   (b) Ídem b) pero con la clasificación cuadrática y comparar los resultados.

7. Del conjunto de datos "iris" consideremos las variables $X_2 =$ Ancho de los sépalos y $X_4 =$ Ancho de los pétalos para las 3 especies de flores.

   (a) Suponiendo que la distribución es normal bivariada para cada población, construir la regla de clasificación cuadrática, asumiendo costos de mala clasificación iguales y probabilidad a priori de pertenecer a cada grupo iguales. Usando esta regla de clasificación recién construida clasificar la nueva observación $\mathbf{x}_0 = (3.5, 1.75)\prime$ como perteneciente a alguno de los 3 grupos.

   (b) Supongamos que las matrices de covarianza Σ_i son las mismas para las 3 poblaciones normales bivariadas. Construir la regla de clasificación lineal, asumiendo costos de mala clasificación iguales y probabilidad a priori de pertenecer a cada grupo iguales, y usarla para clasificar la nueva observación $\mathbf{x}_0 = (3.5, 1.75)\prime$ como perteneciente a alguno de los 3 grupos. Comparar los resultados obtenidos en b) y c). ¿Cuál enfoque es preferible en este caso?

   (c) Graficar en un scatterplot las regiones halladas en b).

   (d) Usando la clasificación lineal realizada en b), clasificar las observaciones de la muestra. Calcular el error aparente total y la estimación insesgada del error que se obtiene por validación cruzada.

8. Aproximadamente 2 años antes de la bancarrota de algunas empresas se recolectan datos financieros de las mismas, y también se recolectan datos de empresas sanas financieramente alrededor del mismo momento. A continuación figuran los datos de 4 variables:

$$\begin{aligned} X_1 &= \text{(flujo de caja)/(deuda total)} \\ X_2 &= \text{(ingreso neto)/(total de activos)} \\ X_3 &= \text{(activos corrientes)/(pasivos corrientes)} \\ X_4 &= \text{(activos corrientes)/(ventas netas)} \end{aligned}$$

   (a) Graficar los datos para los pares de observaciones $(X_1, X_2), (X_1, X_3)$ y (X_1, X_4). Para alguno de estos pares de variables, ¿tienen aspecto de provenir de una distribución normal bivariada?

(b) Usando los $n_1 = 21$ pares de observaciones (X_1, X_2) de empresas en bancarrota y los $n_2 = 25$ pares de observaciones (X_1, X_2) de empresas sanas financieramente, calcular los vectores de medias muestrales $\bar{X}_1$ y $\bar{X}_2$ y las matrices de covarianza muestrales S_1 y S_2.

(c) Usando los resultados de b) y asumiendo que las dos muestras aleatorias provienen de dos poblaciones normales, construir la regla de clasificación cuadrática asumiendo $\pi_1 = \pi_2$ y $c(1 \mid 2) = c(2 \mid 1)$.

(d) Evaluar la performance de la regla de clasificación desarrollada en c) calculando el error aparente total y la estimación del error actual esperado que se obtiene por validación cruzada.

(e) Repetir los items c) y d) tomando $\pi_1 = 0.05$ y $\pi_2 = 0.95$ y $c(1 \mid 2) = c(2 \mid 1)$. ¿Es razonable esta elección de probabilidades a priori?

(f) Repetir los items b) a e) usando las variables (X_1, X_3) y (X_1, X_4). ¿Parecen ser algunas variables mejores clasificadoras que otras?

h) Repetir los items b) a e) usando las 4 variables.