

### Modelos de clasificación

- Previo: heurística vs conclusiones estadísticas
- 1.Algoritmos: regresión logística, árboles, kvecinos, ensembles y Naive-Bayes
- 2. Métricas específicas de clasificación
- 3. Caso en Big ML de clasificación binaria
- 4. Clasificación múltiple
- 5. Caso en Big ML de clasificación múltiple





#### Heurística vs conclusiones estadísticas

La ciencia de datos es una disciplina que engloba tantos conocimientos de áreas distintas que sería muy complejo aplicar todo de forma rigurosa con una fiabilidad alta.

Es por esto que en general, incluso en grandes empresas que explotan muchos datos como pueden ser los vendedores de seguros, se aplican los modelos guíandose por la mera heurística (dar una solución empírica que aproxime el problema y funcione en la práctica) que en la toma de decisiones basada en criterios estadísticos como intervalos de confianza y contrastes de hipótesis.

Esto es así puesto que la necesidades de tiempo, desarrollo y aparataje matemático y estadístico en general sobrepasan las capacidades de análisis en la práctica.

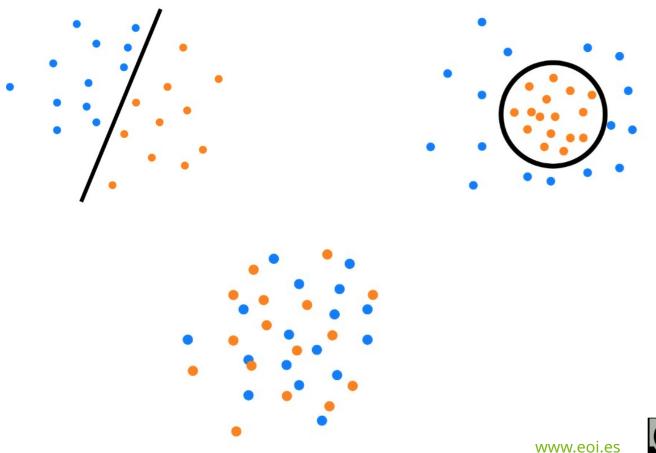
No significa esto que se ignoren cuando se puedan usar, sino que se prefiere en muchas ocasiones la intuición y experiencia sobre el rigor.





### ML supervisado: clasificación

Los casos de clasificación son los más abundantes los entornos de negocio, particularmente la clasificación binaria 0 - 1







#### ML supervisado: clasificación binaria

En el problema de clasificación binaria tenemos una entrada y queremos etiquetarla como 0 ó 1.

Los modelos de clasificación aportan una puntuación *p* entre 0 y 1 donde más próximo a 0 indica más probabilidad de etiquetado 0 y más próximo a 1 más probabilidad de etiquetado 1.

Generalmente, estableceremos un umbral U de modo que

- Predice 1 si la puntuación de predicción es mayor que U
- Predice 0 si la puntuación de predicción es menor ó igual que U

Para algunos modelos como la regresión logística, esta cantidad p de salida indica la **probabilidad de ser de la clase 1**. Las salidas de otros modelos son simples puntuaciones.





### Regresión logística

En la regresión logística modelamos el *logit* 

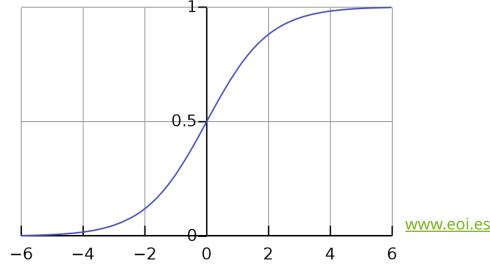
$$\operatorname{logit}(p) = \operatorname{log}\!\left(rac{p}{1-p}
ight) = \operatorname{log}(p) - \operatorname{log}(1-p)$$

linealmente respecto a los predictores

$$\log \frac{p}{1-p} = \beta_0 + \beta_1 x_1 + \beta_2 x_2 + \dots + \beta_k x_k$$

La regresión logística no es más que una regresión lineal cuya salida se ha transformado usando la **función sigmoide**, una de las funciones más

importantes en ML







### Regresión logística: log odds ratio

Los resultados de los coeficientes de una regresión logística tienen interpretabilidad en forma de comparación de probabilidades

Suponemos que la probabilidad de éxito de un suceso es p = 0.8. Entonces el odd ratio es  $\frac{p}{1-p} = \frac{0.8}{1-08} = 4$ 

Esto significa que hay 4 veces más probabilidad de éxito que de fracaso, ya que el *odd ratio* es el cociente entre la probabilidad de éxito (1) y la de fracaso (0).

Ejemplo: en una regresión logística donde se explica la "probabilidad de comprar un producto respecto al número de hijos", suponemos que el coeficiente del número de hijos es 0.1. Entonces el aumento de probabilidad de comprar el producto por cada hijo es de

$$e^{\beta} = e^{0.1} = 1.105171$$

Esto es, por cada hijo la probabilidad de que compre el producto aumenta en un 10.51%.

www.eoi.es

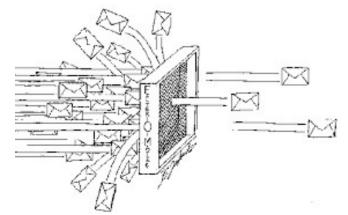


### ML supervisado en clasificación: otros modelos

Así como en supervisado de regresión, se pueden aplicar también en clasificación los modelos:

- Árboles de decisión
- K vecinos
- Modelos ensemble: RandomForest y Gradient Boosting

Además, para clasificación en el caso de tener muchísimos predictores, como puede ser el caso de un filtro de *spam*, se tienen modelos estilo Naive-Bayes. Estos modelos no requieren entrenamiento, ya que son meros cálculos de estimación realizados sobre los datos que aportan al final una probabilidad. Por lo general sólo se usan si hay muchos predictores y el problema es inabarcable, ya que dan rendimientos muy inferiores al resto.







### Métricas en clasificación y matriz de confusión

	Predicciones					
	Positivo Negativo					
Positivo en la realidad	TP	FN				
Negativo en la realidad	FP	TN				

Las descripciones de las componentes de la matriz de confusión:

- **TP**: cantidad de predicciones positivas que son realmente positivas
- **FP**: cantidad de predicciones positivas que son realmente negativas
- **TN**: cantidad de predicciones negativas que son realmente negativas
- **FN**: cantidad de predicciones negativas que son realmente positivas
- TPR: tasa de verdaderos positivos

$$TPR = TP/P = TP/(TP + FN)$$

FPR: tasa de falsos positivos

$$FPR = FP/N = FP/(FP + TN)$$





### Métricas en clasificación y matriz de confusión

Accuracy: precisión global a través de todas las clases.

$$\frac{TP + TN}{TP + TN + FP + FN}$$

• **Precission**: capacidad de acierto dentro de la clase predicha como positiva.

$$\frac{TP}{TP + FP}$$

Recall (igual a TPR): capacidad de acierto dentro de la clase positiva.

$$\frac{TP}{TP + FN}$$

• **F1-score**: media armónica entre precission y recall. Es una métrica equilibrada entre tener pocos falsos positivos y pocos falsos negativos.

$$2\frac{Precision * Recall}{Precision + Recall}$$

 Área bajo la curva ROC: valor entre 0.5 (clasificador aleatorio) y 1 (clasificador perfecto), que permite ajustar la TPR y la FPR





#### Más métricas de clasificación

- Correlación de Mathews ó coeficiente Phi: está basado en la distancia usando el estadístico Chi Cuadrado normalizado entre histogramas. -1 indica modelo inverso, 0 es un modelo aleatorio y 1 un modelo perfecto.
- Lift: ratio que representa la ganancia de usar el modelo respecto a no usar ninguno (random guessing)
- Estadístico K-S: es el máximo valor de la diferencia entre TPR y FPR tomado entre todos los umbrales posibles
- Tau de Kendall: indicador entre -1 y 1. Más próximo a 1 indica un mejor modelo
- Rho de Spearman: indicador entre -1 y 1. Más próximo a 1 indica un mejor modelo. Valores negativos indican que el modelo invertido es mejor...

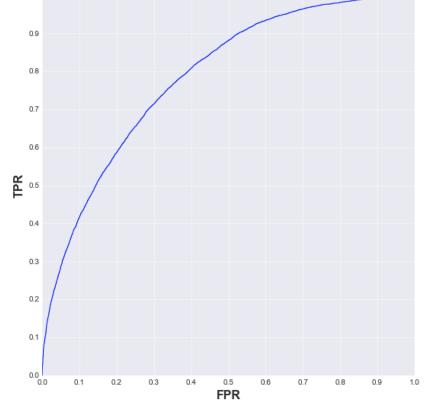




#### Métricas en clasificación: curva ROC y umbrales

Al elegir el modelo con mayor **área bajo la curva ROC (AUC ROC)**, estamos también maximizando el potencial beneficio que aportará un modelo. En función del tipo de problema son razonables distintos valores de ROC AUC. Se elige un umbral que aporte FPR y TPR que maximice el ROI de la aplicación del modelo de clasificación. Cada FP tiene un coste y cada TP un beneficio.





FPR (%)	TPR (%)
5	30
10	42
15	52
20	60
30	72





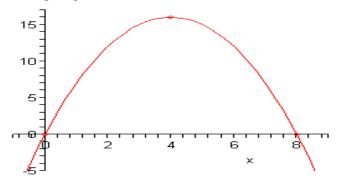


### Métricas en clasificación: maximización de ROI y selección de umbral

- **PR:** ratio de positivos. Es la proporción de positivos reales en los datos
- NR: ratio de negativos. Es la proporción de negativos reales en los datos
- TPR: la proporción de verdaderos positivos que da un predictor una vez seleccionado un umbral de decisión U
- FPR: la proporción de falsos positivos que da un predictor una vez seleccionado un umbral de decisión U
- W: ganancia estimada según las acciones tomadas ante un verdadero positivo
- L: pérdida estimada según las acciones tomadas ante un falso positivo

Elegiremos U de modo que los valores de TPR y FPR (que dependen de U) maximicen la expresión de beneficio:

$$Beneficio(U) = w \cdot PR \cdot TPR - l \cdot NR \cdot FPR$$

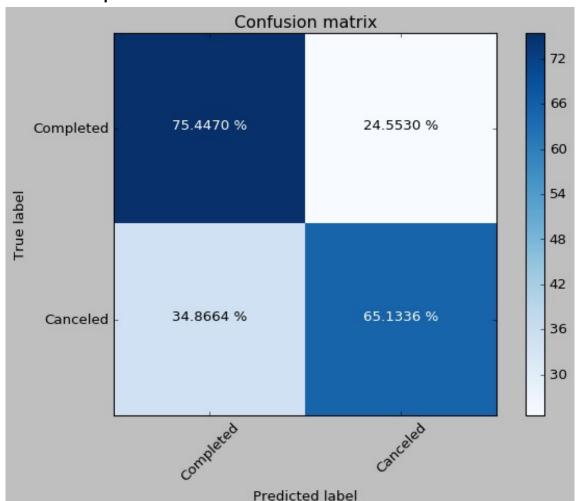






### Métricas en clasificación curva ROC y umbrales

Tras elegir un umbral en las puntuaciones del modelo clasificador, damos la matriz de confusión esperada:

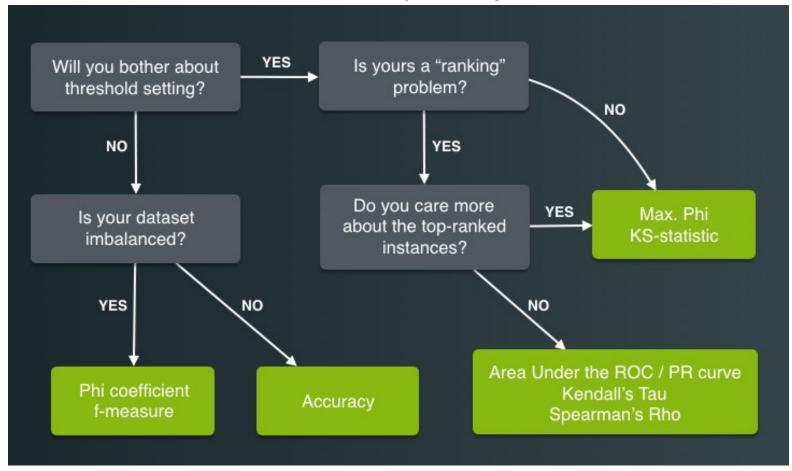






### Métricas en clasificación curva ROC y umbrales

Selección de métricas de clasificación para elegir modelo:







#### Aplicaciones de modelos de clasificación

#### Clasificación binaria:

- Modelos de fraude
- Modelos de fuga
- Modelos de concesión de crédito
- Modelos de probabilidad de compra de un producto
- Modelos de out-of-stock
- Modelos de cancelación
- Modelos de éxito de un trade
- Modelo de análisis de sentimiento

### Clasificación múltiple:

- Modelo de clasificación de imágenes ó vídeos
- Modelo de clasificación de topics de documentos
- Modelo de clasificación de tipo de cliente respecto a productos





### Los procesos de la ciencia de datos

#### **Business Understanding**

#### **Determine Business Objectives**

Background **Business Objectives** Business Success Criteria

#### **Assess Situation**

*Inventory of Resources* Requirements, Assumptions, and *Constraints* Risks and Contingencies Terminology Costs and Benefits

#### **Determine Data Mining Goals**

Data Mining Goals Data Mining Success Criteria

#### **Produce Project Plan**

Proiect Plan *Initial Assessment of* Tools and *Techniques* 

#### Data **Understanding**

#### **Collect Initial Data** *Initial Data Collection* Report

#### **Describe Data** Data Description

Report

#### **Explore Data** Data Exploration Report

## **Verify Data Quality**

# Data Quality Report

#### Data **Preparation**

#### **Select Data**

Rationale for Inclusion/ Exclusion

#### Clean Data

Data Cleaning Report

### **Construct Data**

Derived Attributes Generated Records

#### **Integrate Data** Merged Data

#### **Format Data** Reformatted Data

Dataset Dataset Description

#### Modeling

#### **Select Modeling Techniques**

Modeling Technique Modeling **Assumptions** 

### **Generate Test Design**

Test Design

#### **Build Model**

Parameter Settinas Models *Model Descriptions* 

#### **Assess Model**

Model Assessment Revised Parameter Settings

#### **Evaluation**

#### **Evaluate Results**

Assessment of Data Mining Results w.r.t. **Business Success** Criteria Approved Models

#### **Review Process** Review of Process

**Determine Next Steps** List of Possible Actions Decision

#### **Deployment**

#### **Plan Deployment** Deployment Plan

#### Plan Monitoring and **Maintenance**

Monitoring and Maintenance Plan

#### **Produce Final Report**

Final Report Final Presentation

#### **Review Project**

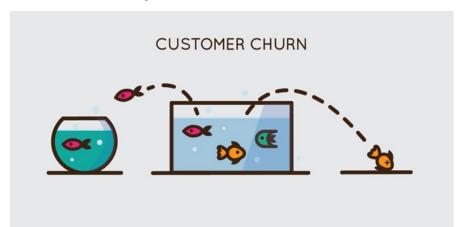
Experience Documentation



Los modelos de fuga intentan captar las circunstancias que se verifican en un cliente que va a abandonar una compañía con antipicación.

¿un cliente seleccionado se va a dar de baja en los siguientes X meses?

Esto permite tomar acciones como ofrecer promociones con permanencia que fidelicen al cliente durante un período.



Son mucho más costosas las campañas de captación que las medidas para fidelizar, por tanto los modelos de fuga son vitales hoy en día en mercados fuertemente competitivos como el de las telecomunicaciones.

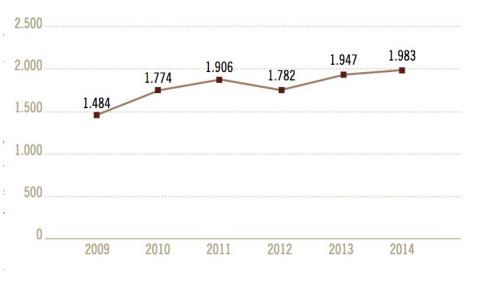


### Caso en Big ML de clasificación binaria: Telecom churn - background

### Dimensión del problema

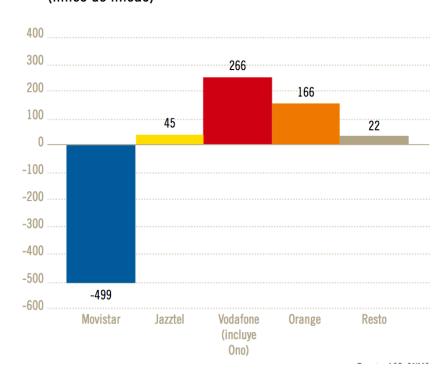
En el 2014 el *churn rate* fue del 29,1%, un de los más altos en el histórico de Europa.

#### Portabilidad de líneas fijas (miles de líneas)



Fuente: CNMC

# Saldo neto de portabilidad por operador en 2014 (miles de líneas)





### Caso en Big ML de clasificación binaria: Telecom churn - background

### Documentación sobre estudios previos del problema

Intentamos aprender todo lo que se ha hecho para atacar este problema en la comunidad de la ciencia de datos.

Esto nos permite partir del *estado del arte*, y como consecuencia tendremos más capacidad de conseguir buenos rendimientos

Ahn, J. H., Han, S. P., & Lee, Y. S. (2006). **Customer churn analysis: Churn determinants and mediation effects of partial defection in the Korean mobile telecommunications service industry**. *Telecommunications policy*, 30(10), 552-568.

Hypothesis test results: customer churn determinants

Dependent variable	Independent variable	Hypothesis	Result
Customer churn	Call drop rate	H1a	Accept
	Call failure rate	H1b	Reject
	Number of complaints	H1c	Accept
	Loyalty points	H2a	Accept
	Membership card	H2b	Reject
	Billed amounts	H3a	Accept
	Unpaid balances	H3b	Reject
	Number of unpaid monthly bills	Н3с	Reject
	Customer status	H4	Accept



### Caso en Big ML de clasificación binaria: Telecom churn - background

#### <u>Predictores en el dataset</u>

Analizamos el conjunto de predictores disponibles y buscamos ó planteamos potenciales predictores interesantes.

Los predictores que disponemos son de las siguientes categorías:

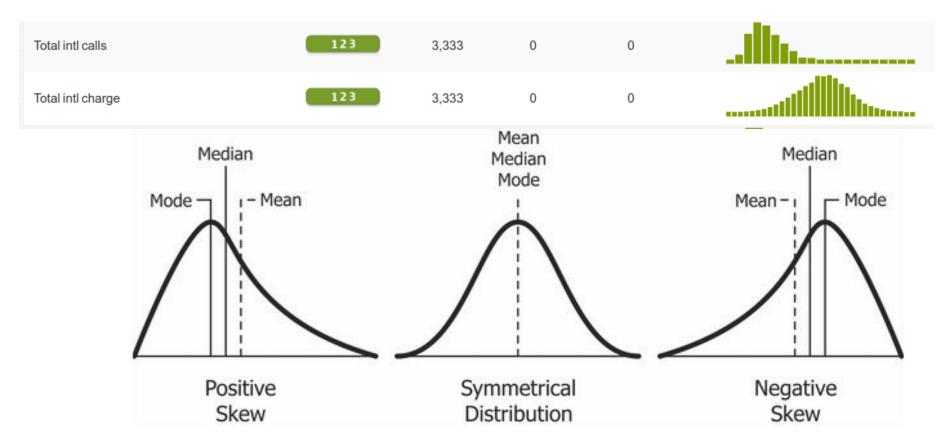
- Características demográficas: edad, sexo, ciudad de residencia, etc.
- Características de soporte: interacción del usuario con el servicio de asistencia: número de llamadas, cuestiones planteadas, valoración de su satisfacción.
- Características de uso: uso que hace el cliente del servicio: número de interacciones con el servicio, planes contratados, gasto mensual.
- Características adicionales o de contexto: otro tipo de información útil para la predicción (ej, antigüedad del cliente).





### Distribuciones en Big ML

- Para distribuciones no sesgadas (skewed), la media puede ser una buena indicación de un valor típico y ser menos sensible a outliers, pero solo en esos casos.
- Un recurso para eliminar ese sesgo es tomar el logaritmo de la variable
- La mediana es más robusta en otros casos.





### Distribuciones en Big ML

- BigML descarta automáticamente variables basadas en su distribución.
- Esto puede o no ser correcto para lo que buscamos, especialmente en el caso de variables nominales.







- Vemos la web <a href="http://www.r2d3.us/visual-intro-to-machine-learning-part-1/">http://www.r2d3.us/visual-intro-to-machine-learning-part-1/</a>
- Cargamos el dataset en el proyecto ML supervisado clasificación
- Exploramos el dataset creando imágenes como la de abajo y buscando separación
- ¿ Qué variables tienen mayor capacidad predictiva?
- Observa la variable churn. Es una clase desequilibrada
- Dividimos el dataset en train y test







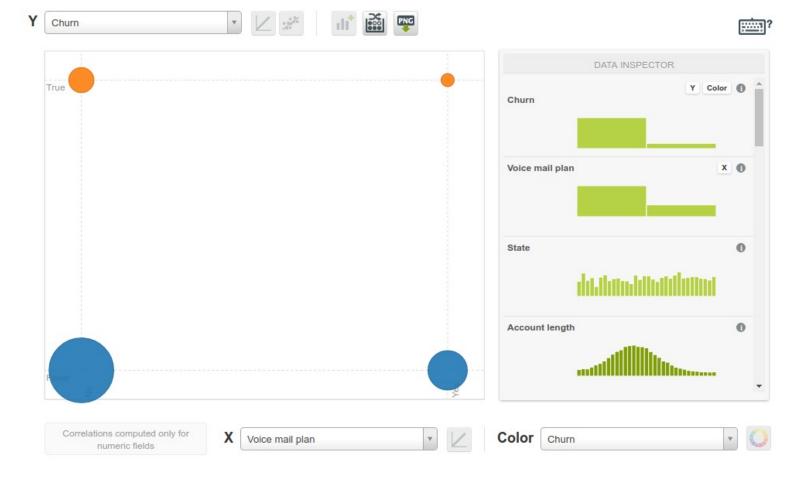
- ¿Qué se puede decir de la relación entre International Plan y Churn?
- ¿Hay diferencias? Comparar con la tabla de contingencia

	0 1	•	•	
			International Plan	
		No	Yes	Total
Churn	False	Count 2664 Col% 88.5%	Count 186 Col% 57.6%	Count 2850 Col% 85.5%
	True	Count 346 Col% 11.5%	Count 137 Col% 42.4%	Count 483 Col% 14.5%
	Total	3010	323	3333





- ¿Qué se podría decir de la relación entre Voice Mail Plan y Churn?
- Parece que la proporción de churners es más alta independientemente de VMP.



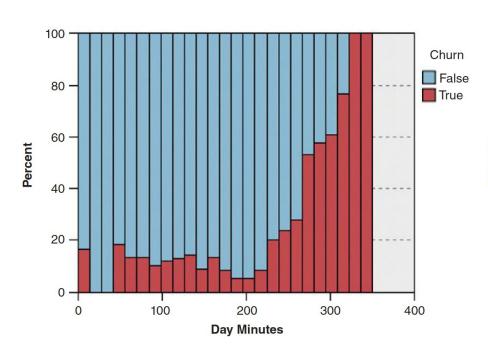


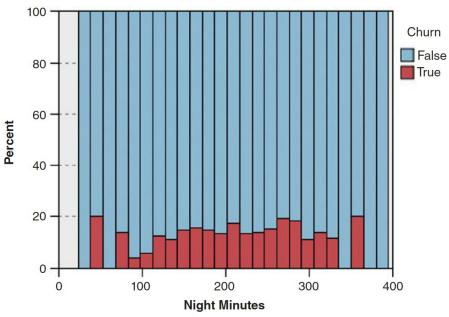
### ¿Qué se podría decir de la variable Customer Service Calls?





Observamos distintas distribuciones de *churn* ó patrones según sea día ó noche









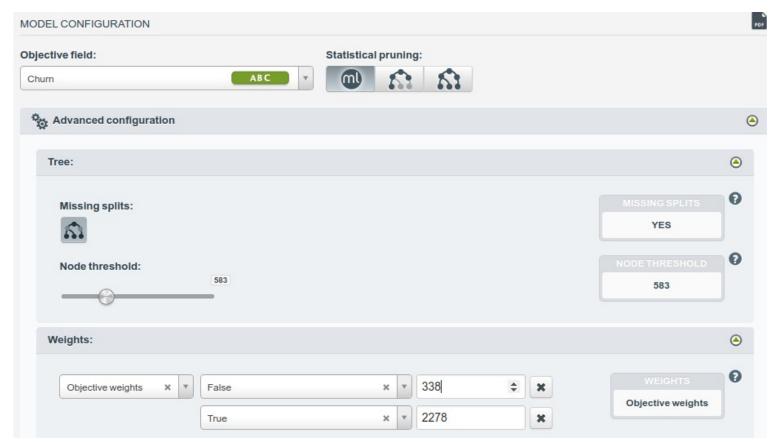
### Preparación de los datos

- En este caso no encontramos valores faltantes, y no parece que haya valores extremos.
- Sin embargo "Area Code" tiene solo tres valores, es extraño.
- Una observación es que las dos clases están muy desbalanceadas.
  - La "paradoja de la exactitud". Si los casos de una clase son poco comunes, por ejemplo, un 10%, un clasificador que siempre de la clase mayoritaria tiene un 90% de exactitud ante una muestra.
  - Podríamos considerar:
    - Resampling: añadir copias sintéticas de ciertos datos.
    - Evaluaciones estratificadas: incluir volúmenes parecidos de las dos clases.
    - No utilizar la *accuracy* sino alguna otra medida: F-score, matrices de confusión, Cohen's Kappa, curvas ROC.
    - NOTA: En BigML los modelos se equilibran automáticamente con pesos.



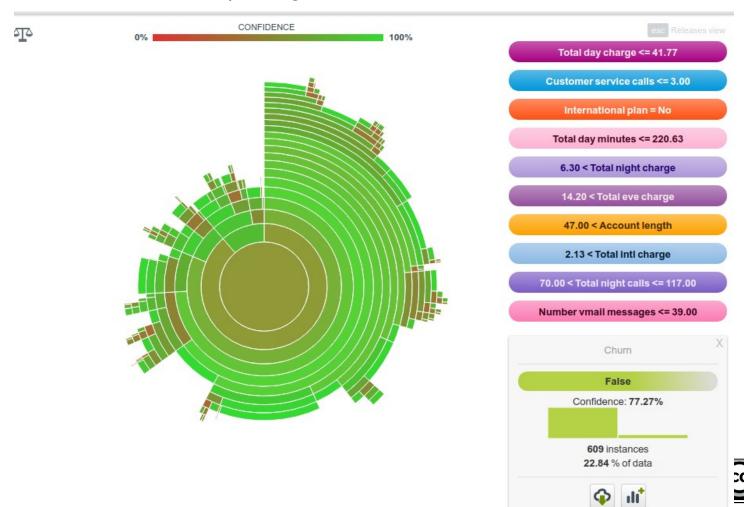


Como son clases desequilibradas, introducimos los pesos de la cantidad de la clase contraria al entrenar un modelo en **configure model** . En este caso hay 2278 False y 388 True en el conjunto de entrenamiento y ponderamos así:





La salida del árbol aporta grados de confianza sobre *churn* en cada hoja





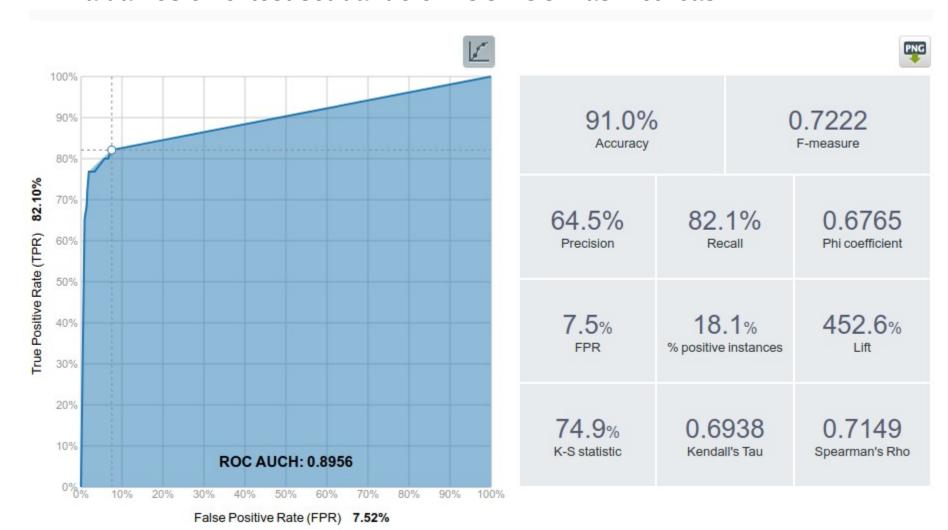
### Evaluamos en el test set

Arriba a la derecha podemos comparar el rendimiento del modelo enfrentándolo a uno aleatorio ó con uno modal.

	Precision			Recall			Phi coefficient	
MODEL 64.5%	12.3%	DIFFERENCE ◆52.1%	MODEL 82.1%	RANDOM 42.1%	difference ◆40.0%	0.6765	RANDOM -0.0528	±0.7292
		Accuracy				F-measu	re	
91.0%		49.2%	<b>-41.8</b> %	)	0.7222	0.1909	9 •	0.5313
MODEL		RANDOM	DIFFERENCE		MODEL	RANDOM		FFERENCE
PRECIS	ION	96.89%	64.46%		80.67% AVG. PRECISION	91.00% ACCURACY		
PREDIC	TED	546	121		667	87.29% AVG. RECALL	0.83 AVG. F	0.68 AVG. Phi
True	True 17 78			95	82.10%	0.72	0.68	
Fals	e	529	43		572	92.48%	0.95	0.68
ACTUAL VS. P		False	True		ACTUAL	RECALL	F	Phi



### Evaluamos en el test set dando el ROC AUC más métricas





### Aplicamos una regresión logística e interpretamos los coeficientes

Imputamos la mediana en los valores faltantes, ponemos pesos en variable objetivo, siempre escalamos los campos y se pueden añadir

regularizaciones L1 y L2

SISTIC REGRESSION CONFIGUR	RATION							0	
ective field:		meric value:		No missing nume	erics:	Eps:	0.0001	Stats:	
Advanced configuration									
Weights:									<u>@</u>
Objective weights × v	False	×	<b>T</b>	338		×	WEIGHTS Objective weig		€
	True	×	<b>v</b>	2278	<b>\$</b>	×			
	<b>+</b> New weight								
Scales:									(
Blas: Fields:					IAS (es	AL	JTO-SCALED FIELD Yes	s	•
Regularization:									Q
Regularization: Strength	(c):				REGU	LARIZATION	STRENGTH (	C)	•



### Regularización L1 y L2

Para no hacer sobreajuste en la **regresión lineal y logística**, se suelen poner costes a los valores de los coeficientes que se suman a la función de error a minimizar por el algoritmo.

De este modo conseguimos ponderar que los valores que se alejen de 0 de lo coeficientes de la regresión logística deben estar justificados con un buen rendimiento explicativo respecto a la variable objetivo.

Hay dos tipos de regularización:

- L2: reduce suavemente los coeficientes
- L1: hace nulos los coficientes menos explicativos.
   Construye lo que se conoce como un modelo sparse ó hueco.





### Salida de la regresión logística e interpretación

Tenemos coeficientes y sesgo descritos con valores y significaciones. También un contraste del modelo respecto al modelo constante.

Bias and predictors	Туре	\$	False	\$	True	•
Total intl charge	123	P	-13.36090	$\triangle$ $\sigma$	13.36090	<u></u> σ
Total eve minutes	123	T	-4.24046	Δσ	4.24046	Δ σ
Total night minutes	123	T	-2.81241	Δσ	2.81241	Δ σ
International plan = Yes	ABC		-2.42101	σ	2.42101	Δσ
Customer service calls	123	T	-0.80461	Δσ	0.80461	Δσ
Number vmail messages	123	T	-0.59937	σ	0.59937	Δσ
Total day minutes	123	T	-0.46750	Δσ	0.46750	<u></u> σ
Total day charge	123	T	-0.26325	Δσ	0.26325	<u></u> σ
Total day calls	123	T	-0.11760	σ	0.11760	Δσ
Account length	123	T	-0.06654	Δσ	0.06654	<u></u> σ
T-1-!!!-	123	ΔΤΔ	0.02002	A (7)	0.02002	A (7)



### Evaluación de la regresión logística

Observamos que el rendimiento de la regreissión logística es bastante peor que el del árbol de decisión. ¿ Se podría mejorar este resultado cambiando parámetros? ¿ Qué pasa si se mueve el probability threshold en la pantalla ROC?





### Reejucución y evaluación de la regresión logística

- No imputamos valores faltantes
- No ponemos pesos en la variable objetivo

Ejecutamos de nuevo la regresión logística y reevaluamos obtniendo mejores resultados. Aun así no mejora los del modelo de árbol.



¿ Cómo cambia la probabilidad de abandono de un cliente con plan internacional frente a un cliente sin el mismo?

Por cada llamada a atención al cliente, ¿ cuánto aumenta la probabilidad de abandono?





### Reejecución y evaluación de la regresión logística

- No imputamos valores faltantes
- No ponemos pesos en la variable objetivo

Ejecutamos de nuevo la regresión logística y reevaluamos obtniendo mejores resultados. Aun así no mejora los del modelo de árbol.



¿ Cómo cambia la probabilidad de abandono de un cliente con plan internacional frente a un cliente sin el mismo?

Por cada llamada a atención al cliente, ¿ cuánto aumenta la probabilidad de abandono?

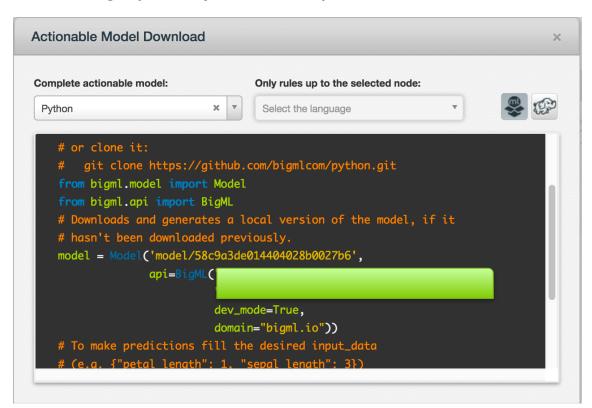




### Despliegue del modelo

Si usamos la API de Big ML para crear un modelo tenemos las siguientes opciones para deplegarlo y usarlo:

- Generar código para integrar en los sistemas actuales.
- Generar código para ejecutar las predicciones en la nube.







### Clasificación múltiple

Se propone como actividad ó ejercicio el análisis completo de otto\_dataset.csv proviniente del famoso concurso de Kaggle con 10 categorías a predecir

https://www.kaggle.com/c/otto-group-product-classification-challenge

En Kaggle, los participantes obtienen entorno a un 84% accuracy.

Vemos la entrevista de los enfoques del ganador y el segundo:

- <a href="https://www.kaggle.com/c/otto-group-product-classification-challenge/discussion/14335">https://www.kaggle.com/c/otto-group-product-classification-challenge/discussion/14335</a>
- <a href="http://blog.kaggle.com/2015/06/09/otto-product-classification-winners-interview-2nd-place-alexander-guschin/">http://blog.kaggle.com/2015/06/09/otto-product-classification-winners-interview-2nd-place-alexander-guschin/</a>
- ¿ Qué se puede hacer para mejorar los rendimientos una vez llegado a un límite de precisión?

# Ingeniería de atributos

Damos ejemplos en la pizarra de aplicaciones que permiten dividir los datos incorporando estas técnicas que suben de dimensión convenientemente los mismos.



#### Técnicas avanzadas de combinación de modelos

Además de la ingeniería de atributos y combinaciones de modelos más básicas, se pueden construir estructuras bastante complejas que suben el rendimiento considerablemente.

Eso sí, siempre con el **principio de parsimonia** en mente...

Una estructura interesante la montó el ganador del concurso de clasificación de hojas

