Big Data + Data Mining

Beer & Diapers

















- 1. Determinación de las <u>fuentes</u> de los datos.
 - Capturar/Extraer los datos. ¿Qué está disponible?
 - Almacenar los datos.



SQL

NoSQL









- 1. Determinación de las <u>fuentes</u> de los datos.
 - Capturar/Extraer los datos. ¿Qué está disponible?
 - Almacenar los datos.



- Investigación preliminar de los datos para comprender sus características.
- Limpiar los datos para obtener un conjunto de datos de calidad.
- Manipular los datos para que estén en el formato necesario para su posterior uso.



(1y2) DB del Big Data: Datos Estructurados

VENTAS

R CAE

FK cliente

ITEMS

FK CAE

id_registro

FK id_producto

cantidad

descuentos

precio

total

otros conceptos

IVA

sucursal

metodo_pago

fecha

Ejemplo de una posible Base de Datos en Microsoft SQL Server y su respectivo Diagrama de Entidad Relación.

VALENTIN\SQLEXPRE...arket - Diagram 0 → ×

SUCURSALES

8 id sucursal

nombre

direccion

encargado

¥ ■ ▼ ♂ ↔ ⊕ ■ Graph Tables

■ dbo.CLIENTES

□ Columns

- id_registro (PK, int, not null)

c= id producto (FK, int, not null)

€ CAE (FK. int. not null)

目 IVA (float, not null)

CAE (PK, int, not null)
cliente (FK, int, not null)

€= sucursal (FK, int, not null)

fecha (datetime2(7), null)
metodo pago (nchar(10), nul

antidad (float, not null)

descuentos (float, not null)
otros_conceptos (float, not null)
precio (float, not null)
total (float, not null)

■ ■ dbo.ITEMS

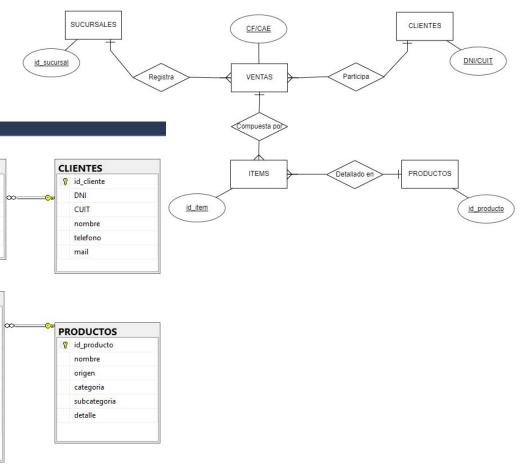
■ Keys

⊞ dbo.SUCURSALES

☐ Columns

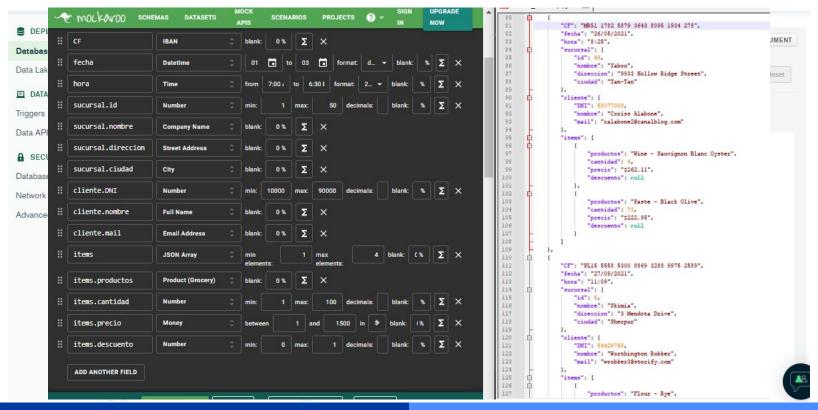
 ☐ ■ dbo.VENTAS

■ Keys



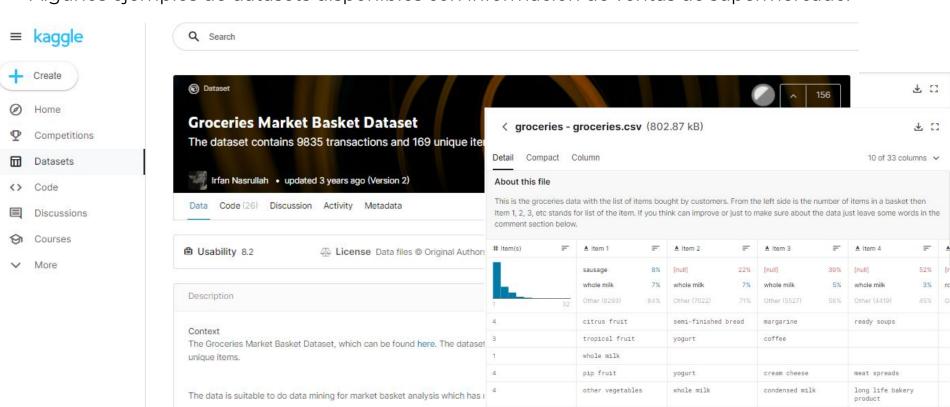
(1y2) DB del Big Data: Datos No Estructurados

Ejemplo de una posible Base de Datos en NoSQL MongoDB Atlas (Cloud Database) y la mock data creada con Mockaroo.



(1y2) Ejemplos de datasets disponibles

Algunos ejemplos de datasets disponibles con información de ventas de supermercado.



- 1. Determinación de las <u>fuentes</u> de los datos.
 - Capturar/Extraer los datos. ¿Qué está disponible?
 - Almacenar los datos.



- > Investigación preliminar de los datos para comprender sus características.
- Limpiar los datos para obtener un conjunto de datos de calidad.
- Manipular los datos para que estén en el formato necesario para su posterior uso.

3. Procesado y análisis de los datos.

- Elección de una técnica para analizar los datos.
- Elaboración de un modelo a partir de los datos disponibles.
- Validar el modelo (conjuntos de prueba o nuevos datos).



1. Determinación de las <u>fuentes</u> de los datos.

- Capturar/Extraer los datos. ¿Qué está disponible?
- Almacenar los datos.

2. Exploración y pre-procesado de los datos → Prepararlos.

- Investigación preliminar de los datos para comprender sus características.
- Limpiar los datos para obtener un conjunto de datos de calidad.
- Manipular los datos para que estén en el formato necesario para su posterior uso.

3. Procesado y análisis de los datos.

- Elección de una técnica para analizar los datos.
- Elaboración de un modelo a partir de los datos disponibles.
- Validar el modelo (conjuntos de prueba o nuevos datos).

4. Comunicación de los resultados.

Presentar los resultados y las conclusiones (storytelling, reporting, data visualization, etc). Conclusiones que disparen decisiones (data-driven).



Determinación de las <u>fuentes</u> de los datos.

- Capturar/Extraer los datos. ¿Qué está disponible?
- Almacenar los datos.



- Investigación preliminar de los datos para comprender sus características.
- Limpiar los datos para obtener un conjunto de datos de calidad.
- Manipular los datos para que estén en el formato necesario para su posterior uso.

3. Procesado y análisis de los datos.

- Elección de una técnica para analizar los datos.
- Elaboración de un modelo a partir de los datos disponibles.
- > Validar el modelo (conjuntos de prueba o nuevos datos).

4. Comunicación de los resultados.

Presentar los resultados y las conclusiones (storytelling, reporting, data visualization, etc). Conclusiones que disparen decisiones (data-driven).

5. Ejecución de las decisiones tomadas.

Transformar en conocimiento en acción. Controlar el plan ejecutado.



Se trata de un problema de **Asociación**, donde se pretende encontrar patrones ocultos a través de reglas que permiten determinar cuando una serie de eventos ocurren juntos.

Este caso en particular se trata de un análisis de canastas de mercado o carritos de compra, con el fin de obtener *insights* sobre el comportamiento de los clientes.

Se parte de un conjunto de *n* transacciones, con *m* artículos o ítems cada una (a modo de ejemplo, se ejemplificará con 5 transacciones y hasta 4 ítems por compra):

Transacción	Items			
1	Pañales	Pan	Leche	
2	Pan	Pañales	Cerveza	Huevos
3	Leche	Pañales	Cerveza	Manteca
4	Pan	Leche	Pañales	Cerveza
5	Pan	Leche	Pañales	Manteca

Crear sets de ítems

El primer paso de este algoritmo consiste en establecer sets o conjuntos de ítems/productos. Por ejemplo, un set podría ser **{Pañales}**, otro podría ser **{Pan, Leche}**.

En este ejemplo se cuenta con 6 artículos distintos, por lo que pueden plantearse 6 sets de un ítem cada uno.

10	Set	do	ita	me
1-	Jet	ue	ıte	1113

1- Set de Itellis			
Sets de ítem	Support		
[Cerveza]	3/5>	0,6	
[Huevos]	1/5>	0,2	
[Leche]	4/5>	0,8	
[Manteca]	2/5>	0,4	
[Pan]	4/5>	0,8	
[Pañales]	5/5>	1	

2. Identificar los sets de ítems más frecuentes

Para ello se utiliza el *Support*. Esta medida establece para cada set de ítems la frecuencia relativa de ese set en particular dentro del conjunto total de transacciones.

$$Support(X) = \frac{Cantidad\ de\ transacción\ con\ el\ ítem\ X}{Cantidad\ total\ de\ transacciones}$$

Para ello se establece un *Support* mínimo, de modo tal que aquellos sets de ítems que tengan un valor inferior a mínimo se descartan.

Por ejemplo, con un valor de ¾ se descartan los siguientes sets de 1, 2 y 3 ítems (coloreados en

rojo).

Transacción	Items			
1	Pañales	Pan	Leche	= 1
2	Pan	Pañales	Cerveza	Huevos
3	Leche	Pañales	Cerveza	Manteca
4	Pan	Leche	Pañales	Cerveza
5	Pan	Leche	Pañales	Manteca

3º Set de items		
Sets de ítem	Support	
[Pan, Leche, Pañales]	3/5> 0,6	

1º Set de items			
Sets de ítem	Support		
[Cerveza]	3/5> 0,6	5	
[Huevos]	1/5> 0,2	,	
[Leche]	4/5> 0,8	3	
[Manteca]	2/5> 0,4	ŀ	
[Pan]	4/5> 0,8	3	
[Pañales]	5/5> 1		

2º Set de items

Sets de ítem	Support		
[Pan, Leche]	3/5> 0,6		
[Pan, Cerveza]	2/5> 0,4		
[Pan, Pañales]	4/5> 0,8		
[Leche, Cerveza]	2/5> 0,4		
[Leche, Pañales]	4/5> 0,8		
[Cerveza, Pañales]	3/5> 0,6		

3. Crear reglas de asociación con estos sets de ítems frecuentes

Los sets de ítems resultantes del paso 2 son los siguientes:

1º Set de items		
Sets de ítem	Support	
[Cerveza]	3/5	
[Leche]	4/5	
[Pan]	4/5	
[Pañales]	5/5	

2º Set de items		
Sets de ítem	Support	
[Pan, Leche]	3/5	
[Pan, Pañales]	4/5	
[Leche, Pañales]	4/5	
[Cerveza, Pañales]	3/5	

3º Set de items		
Sets de ítem	Support	
[Pan, Leche, Pañales]	3/5	

Estas reglas tienen la siguiente estructura, con X e Y siendo sets de ítems. Las mismas se leen "Si X, entonces Y":

$$X \Longrightarrow Y$$
;
 $X = Antecedente; Y = Consecuente$

Por ejemplo, la regla **{Pañales} => {Cerveza}** representa que si se compra pañales, entonces también se compra cerveza.

Para determinar la fiabilidad de una regla de asociación se recurre a una medida denominada *Confianza* o *Confidence*. Esta mide la frecuencia con la que aparecen los artículos Y en las transacciones que contienen artículos X.

Confidence
$$(X \to Y) = \frac{Support(X \cup Y)}{Support(X)}$$

Para restringir la cantidad de reglas a mantener, se utiliza un umbral mínimo de confianza:

Sólo aquellas reglas de asociación con una confianza mayor a este umbral mínimo se consideran significativas y se conservarán para el análisis.

A continuación se presentan 2 ejemplos de su cálculo, fijando un nivel de confianza del 95%.

2º Set de items

Sets de ítem	Support
[Pan, Leche]	3/5
[Pan, Pañales]	4/5
[Leche, Pañales]	4/5
[Cerveza, Pañales]	3/5

3º Set de items

Regla de Asociación candidata: $\{Pan, Leche\} \rightarrow \{Pa\tilde{n}ales\}$

$$\frac{Confidence (\{Pan, Leche\} \rightarrow \{Pa\~nales\})}{Support (Pan, Leche, Pa\~nales)} = \frac{Support (Pan, Leche, Pa\~nales)}{Support (Pan, Leche)}$$
$$= \frac{3/5}{3/5} = \underline{1}$$

En este caso la confianza de la regla es del 100%, es decir que cada vez que se compra pan y leche, también se compra pañales.

2º Set de items

Sets de ítem	Support
[Pan, Leche]	3/5
[Pan, Pañales]	4/5
[Leche, Pañales]	4/5
[Cerveza, Pañales]	3/5

3º Set de items

Sets de ítem	Support
[Pan, Leche, Pañales]	3/5

Regla de Asociación candidata: $\{Pan, Pa\tilde{n}ales\} \rightarrow \{Leche\}$

$$\frac{Confidence (\{Pan, Pa\~nales\} \rightarrow \{Leche\})}{Support (Pan, Pa\~nales, Leche)} = \frac{Support (Pan, Pa\~nales, Leche)}{Support (Pan, Pa\~nales)}$$

$$= \frac{3/5}{4/5} = \frac{3}{4} = \underbrace{0.75}_{0.75} o.75\%$$

En este caso, al fijarse un nivel mínimo de confianza del 95%, la regla candidata es descartada.



Dado que cada ítem en un set de ítems puede utilizarse como antecedente o como consecuente de la regla, utilizar fuerza bruta para determinar las reglas de asociación es computacionalmente prohibitivo.

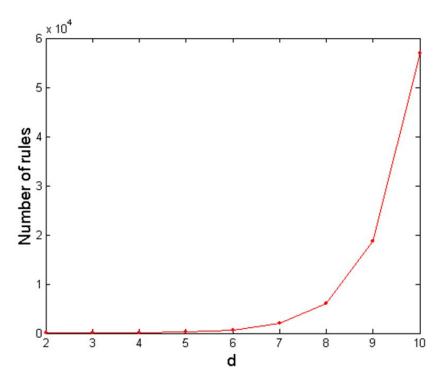
1º Set de ite	ems	Posibles reglas
Sets de ítem	Support	
[Cerveza]	3/5	0
[Leche]	4/5	0
[Pan]	4/5	0
[Pañales]	5/5	0

2º Set de items

Sets de ítem	Support	
[Pan, Leche]	3/5	2
[Pan, Pañales]	4/5	2
[Leche, Pañales]	4/5	2
[Cerveza, Pañales]	3/5	1

3º Set de items

Sets de ítem	Support	
[Pan, Leche, Pañales]	3/5	3



Dados d únicos ítems:

- Total de sets de ítems posibles: 2^d
- Total de posibles reglas de asociación:

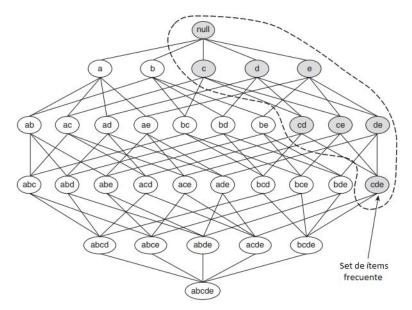
$$R = \sum_{k=1}^{d-1} \left[\binom{d}{k} \times \sum_{j=1}^{d-k} \binom{d-k}{j} \right]$$
$$= 3^{d} - 2^{d+1} + 1$$

<u>Fuente:</u> Introduction to Data Mining - 2° edition

Para reducir el número de sets de ítems candidatos, y por lo tanto la cantidad de reglas de asociación candidatas, se recurre a diversos algoritmos.

En particular el siguiente teorema, conocido como *Principio Apriori*, establece:

"Si un set de ítems es frecuente, entonces todos sus subsets son frecuentes".



Representación del Principio Apriori.

El **Factor de Interés**, o *Lift*, mide la proporción entre la confianza de una regla y la confianza esperada para el producto consecuente.

$$I(A,B) = \frac{s(A,B)}{s(A) \times s(B)} = \frac{Nf_{11}}{f_{1+}f_{+1}}.$$

Por ejemplo, para la regla {Pañales} -> {Leche}, resulta:

$$Lift(\{Pa\~nales\} \rightarrow \{Leche\}) = \frac{Support(\{Pa\~nales, Leche\})}{Support(\{Pa\~nales\}) \times Support(\{Leche\})} = \frac{0.8}{1 \times 0.8} = 1$$

$$Lift(\{Pa\|ales\} \rightarrow \{Leche\}) = \frac{Confidence(\{Pa\|ales\} \rightarrow \{Leche\})}{Cantidad(\{Leche\})/Transacciones} = \frac{0.8}{4/5} = 1$$

De esta medida se puede concluir lo siguiente:

$$I(A,B) \left\{ \begin{array}{l} = 1, & \text{if A and B are independent;} \\ > 1, & \text{if A and B are positively related;} \\ < 1, & \text{if A and B are negatively related.} \end{array} \right.$$

Existe una gran cantidad de medidas propuestas para estimar la bondad de una regla de asociación. Algunos ejemplos:

יי	p103.				
#	Measure	Formula			
1	φ-coefficient	$\frac{P(A,B)-P(A)P(B)}{\sqrt{P(A)P(B)(1-P(A))(1-P(B))}}$			
2	Goodman-Kruskal's (λ)	$\frac{\sum_{j} \max_{k} P(A_{j}, B_{k}) + \sum_{k} \max_{j} P(A_{j}, B_{k}) - \max_{j} P(A_{j}) - \max_{k} P(B_{k})}{2 - \max_{j} P(A_{j}) - \max_{k} P(B_{k})}$			
3	Odds ratio (α)	$\frac{P(A,B)P(\overline{A},\overline{B})}{P(A,\overline{B})P(\overline{A},B)}$			
4	Yule's Q	$\frac{P(A,B)P(\overline{AB})-P(A,\overline{B})P(\overline{A},B)}{P(A,B)P(\overline{AB})+P(A,\overline{B})P(\overline{A},B)} = \frac{\alpha-1}{\alpha+1}$			
5	Yule's Y	$\frac{\sqrt{P(A,B)P(\overline{AB})} - \sqrt{P(A,\overline{B})P(\overline{A},B)}}{\sqrt{P(A,B)P(\overline{AB})} + \sqrt{P(A,\overline{B})P(\overline{A},B)}} = \frac{\sqrt{\alpha} - 1}{\sqrt{\alpha} + 1}$			
6	Kappa (κ)	$\frac{\dot{P}(A,B)+P(\overline{A},\overline{B})-\dot{P}(A)P(B)-P(\overline{A})P(\overline{B})}{1-P(A)P(B)-P(\overline{A})P(\overline{B})}$			
7	Mutual Information (M)	$\frac{\sum_{i} \sum_{j} P(A_{i}, B_{j}) \log \frac{P(A_{i}, B_{j})}{P(A_{i}) P(B_{j})}}{\min(-\sum_{i} P(A_{i}) \log P(A_{i}), -\sum_{j} P(B_{j}) \log P(B_{j}))}$			
8	J-Measure (J)	$\max\left(P(A,B)\log(\frac{P(B A)}{P(B)}) + P(A\overline{B})\log(\frac{P(\overline{B} A)}{P(\overline{B})}),\right)$			
	100	$P(A,B)\log(\frac{P(A B)}{P(A)}) + P(\overline{A}B)\log(\frac{P(\overline{A} B)}{P(A)})$			
9	Gini index (G)	$\max \left(P(A)[P(B A)^3 + P(\overline{B} A)^3] + P(\overline{A})[P(B \overline{A})^3 + P(\overline{B} \overline{A})^3] \right)$			
		$-P(B)^2-P(\overline{B})^2$,			
		$P(B)[P(A B)^{2} + P(\overline{A} B)^{2}] + P(\overline{B})[P(A \overline{B})^{2} + P(\overline{A} \overline{B})^{2}]$			
		$-P(A)^3 - P(\overline{A})^3$			
10	Support (s)	P(A,B)			
11	Confidence (c)	$\max(P(B A), P(A B))$			
12	Laplace (L)	$\max\left(\frac{NP(A,B)+1}{NP(A)+2},\frac{NP(A,B)+1}{NP(B)+2}\right)$			
13	Conviction (V)	$\max\left(\frac{P(A)P(\overline{B})}{P(A\overline{B})}, \frac{P(B)P(\overline{A})}{P(B\overline{A})}\right)$			
14	Interest (I)	$\frac{P(A,B)}{P(A)P(B)}$			
15	cosine (IS)	$\frac{P(A,B)}{\sqrt{P(A)P(B)}}$			
16	Piatetsky-Shapiro's (PS)	P(A,B) - P(A)P(B)			
17	Certainty factor (F)	$\max\left(rac{P(B A)-P(B)}{1-P(B)},rac{P(A B)-P(A)}{1-P(A)} ight)$			
18	Added Value (AV)	$\max(P(B A) - P(B), P(A B) - P(A))$			
19	Collective strength (S)	$\frac{P(A,B)+P(\overline{AB})}{P(A)P(B)+P(A)P(\overline{B})} \times \frac{1-P(A)P(B)-P(\overline{A})P(\overline{B})}{1-P(A,B)-P(\overline{AB})}$			
20	Jaccard (ζ)	$\frac{P(A,B)}{P(A)+P(B)-P(A,B)}$			
21	Klosgen (K)	$\sqrt{P(A,B)}\max(P(B A)-P(B),P(A B)-P(A))$			

<u>Fuente:</u> Introduction to Data Mining - 2° edition

Algoritmo Apriori para generar sets de ítems.

Algorithm 5.1 Frequent itemset generation of the *Apriori* algorithm.

```
1: k = 1
2: F_k = \{ i \mid i \in I \land \sigma(\{i\}) \geq N \times minsup \}. {Find all frequent 1-itemsets}
3: repeat
4: k = k + 1.
 5: C_k = \text{candidate-gen}(F_{k-1}). {Generate candidate itemsets.}
6: C_k = \text{candidate-prune}(C_k, F_{k-1}). {Prune candidate itemsets.}
 7: for each transaction t \in T do
8: C_t = \operatorname{subset}(C_k, t). {Identify all candidates that belong to t.}
9: for each candidate itemset c \in C_t do
10: \sigma(c) = \sigma(c) + 1. {Increment support count.}
11: end for
      end for
13: F_k = \{ c \mid c \in C_k \land \sigma(c) \geq N \times minsup \}. {Extract the frequent k-itemsets.}
14: until F_k = \emptyset
15: Result = | JF_k \rangle
```

(*) Cervezas y pañales

DSS News
D. J. Power, Editor
November 10, 2002 -- Vol. 3, No. 23
A Bi-Weekly Publication of DSSResources.COM

What is the "true story" about using data mining to identify a relation between sales of beer and diapers?

This is one of those recurring questions related to a famous decision support example... The following are some versions of the tale \dots

An article in The Financial Times of London (Feb. 7, 1996) stated, "The oft-quoted example of what data mining can achieve is the

case of a large US supermarket chain which association for many customers between a br (diapers) and a brand of beer. Most customer also bought the beer. The best hypothesiser find it difficult to propose this combinations showed it existed, and the retail outlet we moving the products closer together on the

Bill Palace at UCLA Spring 1996) in his we example, one Midwest grocery chain used the capacity of Oracle software to analyze local discovered that when men bought diapers on also tended to buy beer. Further analysis: typically did their weekly grocery shopping On Thursdays, however, they only bought at concluded that they purchased the beer to the upcoming weekend. The grocery chain could a information in various ways to increase remove the beer display closer to the diaper sure beer and diapers were sold at full pri

Hermiz and Manganaris (1999) stated "One of (though likely fabricated) data mining storthat beer and diapers frequently appear to the explanation goes that when fathers are diapers, they often purchase a six-pack of reward."

So what are the facts? In 1992, Thomas Blischok, manager of a retail consulting group at Teradata, and his staff prepared an analysis of 1.2 million market baskets from about 25 Osco Drug stores. Database queries were developed to identify affinities. The analysis "did discover that between 5:00 and 7:00 p.m. that consumers bought beer and diapers". Osco managers did NOT exploit the beer and diapers relationship by moving the products closer together on the shelves. This decision support study was conducted using query tools to find an association. The true story is very bland compared to the legend.

So if someone asks you about the story of "data mining, beer and diapers" you now know the facts. The story most people tell is fiction and legend. You can continue telling the story, but remember no matter how you tell it, the story of "data mining, beer and diapers" is NOT a good example of the possiblities for decision support with current data mining technologies.

Forbes

Apr 6, 1998, 12:00am EDT

Diaper-beer syndrome



Follow

This article is more than 10 years old.

IT'S PART OF the folklore of data processing. A retail chain put all its checkoutcounter data into a giant digital warehouse and set the disk drives spinning.

Out popped a most unexpected correlation: sales of diapers and beer.

e-night run to the store to pick up by were there.

ced the disparate items together.

see box). But that didn't stop it from ware: telling corporations how to set tons of transaction data," said the iderful insights into your customers,

netimes. Empire Blue Cross and Blue are among those that have mined nes it doesn't work.

Gracias!

Ante cualquier inquietud: <u>valentinsilvestri@outlook.com</u>