



UNIVERSIDAD DE CHILE  
FACULTAD DE CIENCIAS FÍSICAS Y MATEMÁTICAS  
DEPARTAMENTO DE INGENIERÍA INDUSTRIAL

## **MODELAMIENTO Y SEGUIMIENTO DE TÓPICOS PARA DETECCIÓN DE MODUS OPERANDI EN ROBO DE VEHÍCULOS**

TESIS PARA OPTAR AL GRADO DE MAGÍSTER EN GESTIÓN DE OPERACIONES

MEMORIA PARA OPTAR AL TÍTULO DE INGENIERO CIVIL INDUSTRIAL

**DIEGO GARRIDO**

PROFESOR GUÍA:  
RICHARD WEBER

MIEMBROS DE LA COMISIÓN:  
PROFESOR 2  
PROFESOR 3

Este trabajo ha sido parcialmente financiado por:  
NOMBRE INSTITUCIÓN

SANTIAGO, CHILE  
2020

*Una frase de dedicatoria,  
pueden ser dos líneas.*

***Saludos***

# Agradecimientos

TODO

# Tabla de Contenidos

<b>1. Introducción</b>	<b>2</b>
1.1. Metodología Propuesta . . . . .	2
1.2. Caso de estudio . . . . .	3
1.3. Revisión del estado del arte . . . . .	4
1.4. Estructura de la tesis . . . . .	5
<b>2. Marco teórico</b>	<b>6</b>
2.1. Mixture Models . . . . .	6
2.1.1. Distribución Dirichlet . . . . .	7
2.1.2. Dirichlet Process . . . . .	9
2.1.3. Stick Breaking Process . . . . .	10
2.1.4. Chinese Restaurant Process . . . . .	12
2.2. Modelos de tópicos . . . . .	13
2.2.1. Latent Dirichlet Allocation . . . . .	14
2.2.2. Hierarchical Dirichlet Process . . . . .	15
2.2.2.1. Stick Breaking Construction . . . . .	16
2.2.2.2. Chinese Restaurant Franchise Process . . . . .	17
2.3. Modelamiento de la evolución de los tópicos en el tiempo . . . . .	18
2.3.1. Gráfo de similitud temporal . . . . .	18
2.3.2. Construcción automática del grafo de similitud . . . . .	19
<b>3. Metodología</b>	<b>21</b>
3.1. Procesamiento . . . . .	21
3.2. Modelos de tópicos . . . . .	22
3.2.1. Configuración de hiperparámetros . . . . .	22
3.2.2. Interpretación de tópicos . . . . .	23
3.3. Construcción del grafo temporal . . . . .	24
3.3.1. Word Mover's Distance . . . . .	25
3.3.2. WMD complejidad . . . . .	26
3.3.3. Word Embeddings . . . . .	27
3.3.4. Métricas . . . . .	27
3.4. Resumen metodología . . . . .	28
<b>4. Caso de estudio</b>	<b>29</b>
4.1. Datos . . . . .	29
4.2. Procesamiento . . . . .	30
4.3. Análisis cuantitativo de resultados . . . . .	34

4.4. Análisis cualitativo de resultados . . . . .	34
<b>5. Conclusiones y trabajo futuro</b>	<b>35</b>
5.1. Datos . . . . .	35
5.2. Procesamiento . . . . .	36
5.3. Análisis cuantitativo de resultados . . . . .	40
5.4. Análisis cualitativo de resultados . . . . .	40
<b>Bibliografía</b>	<b>41</b>

# Índice de Tablas

4.1.	Estadísticas del corpus bajo distintos niveles de procesamientos, <b>t</b> : tokenización, <b>ch</b> : procesamiento de caracteres, <b>f</b> : filtro por frecuencia, <b>v</b> : filtro por vocabulario, <b>s</b> : eliminación de <i>stopwords</i> . . . . .	33
4.2.	Evolución del vocabulario en el tiempo, <b>t-1</b> : corresponde al vocabulario del período anterior a la época respectivame, <b>t-1</b> : corresponde al vocabulario de la época actual, <b>t-1</b> [%] : porcentaje de palabras del período $t - 1$ que ya no están en el período $t$ y <b>t</b> [%]: porcentaje de palabras del período $t$ que no están en el período $t - 1$ . . . . .	34
5.1.	Estadísticas del corpus bajo distintos niveles de procesamientos, <b>t</b> : tokenización, <b>ch</b> : procesamiento de caracteres, <b>f</b> : filtro por frecuencia, <b>v</b> : filtro por vocabulario, <b>s</b> : eliminación de <i>stopwords</i> . . . . .	39
5.2.	Evolución del vocabulario en el tiempo, <b>t-1</b> : corresponde al vocabulario del período anterior a la época respectivame, <b>t-1</b> : corresponde al vocabulario de la época actual, <b>t-1</b> [%] : porcentaje de palabras del período $t - 1$ que ya no están en el período $t$ y <b>t</b> [%]: porcentaje de palabras del período $t$ que no están en el período $t - 1$ . . . . .	40

# Índice de Ilustraciones

1.1.	Cantidad de robos de vehículos y robos de accesorios de vehículos anuales en Chile entre los años 2006-2016. Fuente: Informe anual Carabineros, 2006-2016, INE. . . . .	3
2.1.	Densidad de la distribución Dirichlet para $K = 3$ define una distribución sobre el <i>simplex</i> , el cual puede ser representado por una superficie trinagular. . . . .	8
2.2.	Muestra de una distribución Dirichlet simétrica para $\alpha \in \{0.1, 1, 10\}$ y $K \in \{2, 10, 100\}$ . . . . .	9
2.3.	Ilustración de <i>stick breaking process</i> . Tenemos una barra de largo 1, la cual se rompe en un punto aleatorio $\beta_1$ , el largo de la pieza que conservamos es llamada $\pi_1$ , luego recursivamente rompemos la barra restante, así generando $\pi_2, \pi_3, \dots$ Fuente: Figura 2.22 de (Sudderth, 2006). . . . .	11
2.4.	(a) Muestra de una distribución GEM para diferentes parámetros de concentración $\alpha \in \{0.1, 0.6, 6\}$ . (b) Medidas aleatorias generadas a partir de un Dirichlet Process con medida base normal $\mathcal{N}(0, 1)$ para diferentes parámetros de concentración $\alpha \in \{0.1, 0.6, 6\}$ . . . . .	12
2.5.	Representación gráfica de LDA: círculos denotan variables aleatorias, círculos abiertos denotan parámetros, círculos sombreados denotan variables observadas y los platos indican replicación. . . . .	14
2.6.	Representación gráfica de HDP: círculos denotan variables aleatorias, círculos abiertos denotan parámetros, círculos sombreados denotan variables observadas y los platos indican replicación. . . . .	16
2.7.	Representación gráfica de la construcción stick-breaking de HDP: círculos denotan variables aleatorias, círculos abiertos denotan parámetros, círculos sombreados denotan variables observadas y los platos indican replicación. . . . .	17
2.8.	Ilustración conceptual del grafo de similitud que modela la dinámica de los tópicos en el tiempo. Un nodo corresponde a un tópico en una época específica; el ancho de los arcos es proporcional a la similitud entre los tópicos, arcos ausentes fueron eliminados por presentar una similitud menor a un umbral. Fuente: Figura 3 de (Beykikhoshk et al., 2018) . . . . .	19
2.9.	Estimación empírica de la función de densidad acumulada (cdf) de la similitud entre tópicos de épocas adyacentes en el grafo <i>fully connected</i> para tres medidas de similitud. Fuente: Figura 4 (Beykikhoshk et al., 2018). . . . .	20
3.1.	Función de densidad de probabilidad (pdf) de una distribución Gamma para diferentes parámetros de forma $\alpha$ y tasa $\beta$ . . . . .	23
3.2.	Espacio vectorial de los <i>word embeddings</i> de las palabras de dos documentos con un vocabulario de tamaño 4. Fuente: Figura de (Niculae, 2015). . . . .	25
3.3.	Esquema de la metodología de descubrimiento y evolución de tópicos. . . . .	28

4.1.	Cantidad de robos registrados por año en base de datos AACH. . . . .	29
4.2.	Frecuencia acumulada del vocabulario en orden decreciente de ocurrencia aplicando hasta el primer nivel de procesamiento. . . . .	30
4.3.	Frecuencia acumulada del vocabulario en orden decreciente de ocurrencia aplicando hasta el segundo nivel de procesamiento. . . . .	31
4.4.	Frecuencia acumulada del vocabulario en orden decreciente de ocurrencia aplicando hasta el tercer nivel de procesamiento. . . . .	32
4.5.	Frecuencia acumulada del vocabulario en orden decreciente de ocurrencia aplicando hasta el cuarto nivel de procesamiento. . . . .	32
4.6.	Frecuencia acumulada del vocabulario en orden decreciente de ocurrencia aplicando hasta el quinto nivel de procesamiento. . . . .	33
5.1.	Cantidad de robos registrados por año en base de datos AACH. . . . .	35
5.2.	Frecuencia acumulada del vocabulario en orden decreciente de ocurrencia aplicando hasta el primer nivel de procesamiento. . . . .	36
5.3.	Frecuencia acumulada del vocabulario en orden decreciente de ocurrencia aplicando hasta el segundo nivel de procesamiento. . . . .	37
5.4.	Frecuencia acumulada del vocabulario en orden decreciente de ocurrencia aplicando hasta el tercer nivel de procesamiento. . . . .	38
5.5.	Frecuencia acumulada del vocabulario en orden decreciente de ocurrencia aplicando hasta el cuarto nivel de procesamiento. . . . .	38
5.6.	Frecuencia acumulada del vocabulario en orden decreciente de ocurrencia aplicando hasta el quinto nivel de procesamiento. . . . .	39



RESUMEN DE LA MEMORIA PARA OPTAR  
AL TÍTULO DE MAGÍSTER EN CIENCIAS  
DE LA INGENIERÍA  
POR: **DIEGO GARRIDO**  
FECHA: 2020  
PROF. GUÍA: RICHARD WEBER

## **MODELAMIENTO Y SEGUIMIENTO DE TÓPICOS PARA DETECCIÓN DE MODUS OPERANDI EN ROBO DE VEHÍCULOS**

En este trabajo se describe una metodología para el descubrimiento de tópicos en el tiempo. La metodología propuesta está basada en (i) discretización del corpus en épocas, (ii) descubrimiento de tópicos en cada época mediante Hierarchical Dirichlet Process (HDP), (iii) la construcción de un grafo de similitud entre tópicos de épocas adyacentes, el cual permite modelar cambios entre los tópicos como: nacimiento, muerte, evolución, división y fusión. En contraste a trabajos anteriores, la metodología propuesta utiliza Word Mover's Distance (WMD) como medida de similitud entre tópicos, medida que destaca por ser robusta a tópicos que no poseen un vocabulario común, debido a que trabaja con sus *word embeddings*. Se reportan resultados experimentales tanto cuantitativos como cualitativos en el fenómeno de robo de vehículos en Chile, usando como corpus los relatos de víctimas de robo de vehículo entre los años 2011-2016 provistos por la Asociación de Aseguradores de Chile (AACH). El algoritmo propuesto logra capturar bien los tópicos latentes del corpus, descubriendo delitos tales como “portonazo”, apropiación indebida y robo con violencia.

# Todo list

TODO . . . . .	ii
Motivación . . . . .	29
Describir organización del contenido . . . . .	29
Diseño del experimento . . . . .	29
Descripción del dataset: mejorar estilo y añadir ejemplos . . . . .	29
Rehacer . . . . .	34
Análisis cualitativo de tópicos . . . . .	34
Motivación . . . . .	35
Describir organización del contenido . . . . .	35
Diseño del experimento . . . . .	35
Descripción del dataset: mejorar estilo y añadir ejemplos . . . . .	35
Rehacer . . . . .	40
Análisis cualitativo de tópicos . . . . .	40

# Capítulo 1

## Introducción

Grandes volúmenes de datos digitales son almacenados día a día, en forma de noticias, blogs, páginas web, artículos científicos, libros, imágenes, sonido, video, redes sociales, etc. Volviéndose cada vez más difícil encontrar y descubrir lo que estamos buscando. Necesitamos herramientas computacionales que ayuden a organizar, buscar y entender grandes colecciones de datos.

Si pudiéramos buscar y explorar documentos en base a sus temas, podríamos enfocar nuestra búsqueda en temas específicos o más amplios, podríamos observar como estos temas cambian en el tiempo o como se relacionan unos a otros. En vez de buscar documentos únicamente a través de palabras claves, podríamos primero hallar temas que son de nuestro interés, y luego examinar los documentos relacionados a ese tema. Por ejemplo, podríamos descubrir nuevas tendencias de investigación, analizar la evolución de la contingencia social, estudiar la efectividad de campañas publicitarias en base a la opinión de los consumidores, organizar y recomendar contenido en un blog, etc.

El objetivo del trabajo de tesis es desarrollar una metodología que permita descubrir tópicos en el tiempo, siendo capaz de modelar cambios tales como: nacimiento, muerte, evolución, división y fusión. Adicionalmente, que sea robusta a cambios en el vocabulario en el tiempo, permitiendo comparar tópicos entre épocas adyacentes a pesar que no posean un vocabulario común.

### 1.1. Metodología Propuesta

Los modelos de tópicos probabilísticos nos ayudan a descubrir los temas latentes (*clusters*) en una colección de documentos, como estos temas están conectados unos a otros y cómo cambian en el tiempo. Permiten resumir una gran colección de documentos a través de sus temas y organizarlos entorno a estos.

Los modelos probabilísticos tratan un tópico como una distribución de probabilidad discreta sobre el vocabulario del corpus, siendo una práctica habitual interpretar un tópico a partir de sus  $N$  palabras más probables. Por ejemplo, para  $N = 5$  las palabras más probables de un tópico son: “llaves”, “domicilio”, “individuos”, “casa” y “porton”, por lo que una etiqueta válida para este tópico podría ser “portonazo”.

En este trabajo se propone una metodología para el descubrimiento de tópicos en el tiempo. Esta metodología consiste en la discretización del corpus en épocas, el descubrimiento de tópicos en cada época mediante Hierarchical Dirichlet Process (HDP), la construcción de un grafo de similitud entre tópicos de épocas adyacentes, el cual permite modelar cambios entre los tópicos como: nacimiento, muerte, evolución, división y fusión. En contraste a trabajos anteriores, la metodología propuesta utiliza Word Mover’s Distance (WMD) como medida de similitud entre tópicos. Esta medida destaca por su robustez ante tópicos que no poseen un vocabulario común, debido a que trabaja sobre el espacio de los *word embeddings*.

## 1.2. Caso de estudio

Se escoge el problema del robo de vehículos o accesorios de vehículos como caso de estudio, debido a que es un problema que afecta a toda la sociedad en Chile y en el mundo, problema que se ha vuelto más relevante el último tiempo debido al crecimiento en el robo de vehículo motorizado y accesorios (ver Figura 1.1).

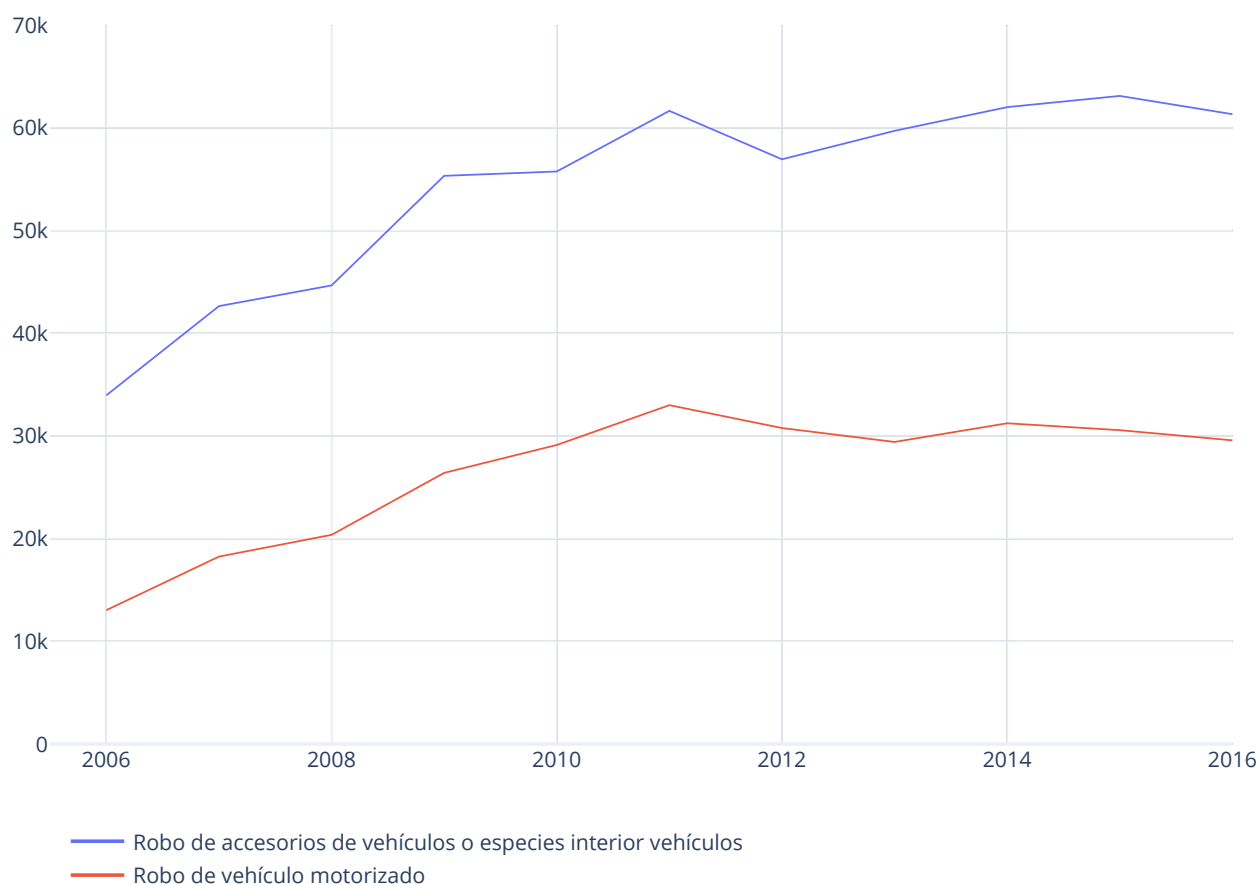


Figura 1.1: Cantidad de robos de vehículos y robos de accesorios de vehículos anuales en Chile entre los años 2006-2016. Fuente: Informe anual Carabineros, 2006-2016, INE.

Este fenómeno trae consigo un montón de costos para la sociedad, como incremento en la percepción de la seguridad, aumentos en la prima de los seguros de los asegurados, aumento en los costos de las aseguradoras <sup>1</sup> y el incremento de otros tipos de delitos <sup>2</sup>

El corpus utilizado corresponde a una colección de 49015 relatos de víctimas de robo de vehículo, entre los años 2011-2016, provistos por la Asociación de Aseguradores de Chile (AACH). Cabe destacar que se estima que un tercio del parque automotriz se encuentra asegurado, por lo que se trabaja con una muestra del parque automotriz.

En el contexto de robo de vehículos, los tópicos vendrían siendo los “*modu operandi*” que utilizan los delincuentes para robar un vehículo. Así, la metodología propuesta permitiría descubrir los *modus operandi* ocultos en los relatos de las víctimas y caracterizarlos a partir de las palabras, como también ver su evolución a través del tiempo, siendo capaz de detectar cuando nacen y mueren, y como cambian en el tiempo.

### 1.3. Revisión del estado del arte

El problema planteado consiste en un problema de *clustering*, puesto que no se cuenta con una etiqueta del tema al que corresponde cada documento, siendo el propósito del trabajo descubrirla. Dentro de los métodos de *clustering* que involucran texto el modelamiento de tópicos es uno de los enfoques más prometedores.

El modelamiento de tópicos es una poderosa herramienta que nos permite analizar grandes colecciones de documentos. En procesamiento de texto, un documento es una colección de palabras y el conjunto de documentos lleva por nombre corpus. Estos modelos encuentran los temas (*clusters*) ocultos presentes en el corpus, permitiendo resumir, organizar y explorar grandes colecciones de datos.

Algunas de las técnicas de modelamiento de tópicos están basadas en factorización matricial como LSI (Latent Semantic Indexing) (Dumais, 2004) o NMF (Non-negative Matrix Factorization)(Xu et al., 2003), pero en este trabajo está basado en modelos probabilísticos generativos, como LDA (Latent Dirichlet Allocation)(Blei et al., 2003) o HDP (Hierarchical Dirichlet Process)(Teh et al., 2005). Ambos enfoques tienen sus pros y contras, en este trabajo se prefiere el enfoque probabilístico ya que es capaz de expresar incertidumbre en la asignación de un tópico a un documento y en la asignación de palabras a los tópicos, además, este enfoque suele aprender tópicos más descriptivos (Stevens et al., 2012).

En el modelamiento de tópicos se pueden presentar los siguientes dinamismos:

1. **Evolución de los tópicos:** la evolución de los tópicos se refleja en el cambio en la distribución sobre las palabras. Por ejemplo, el “portonazo” en un determinado momento

<sup>1</sup> Considerando que el costo promedio incurrido en un auto asegurado robado y no recuperado es de \$ 5.000.000 de pesos, la pérdida total considerando solo los vehículos no recuperados para el año 2015 es de unos \$15.720 millones de pesos.

<sup>2</sup> El destino de los vehículos robados es variado, se usan los autos para perpetrar otros delitos y huir, venderlos por piezas en talleres clandestinos o blanquear sus documentos para pasarlos por la frontera y venderlos o cambiarlos por droga en el extranjero.

se comete en grupos de 2-3 personas con arma blanca, luego evoluciona de arma blanca a arma de fuego y lo perpetran jóvenes menores de edad.

2. **Dinamismo en la mezcla de tópicos:** esto permite capturar la popularidad de los tópicos en el tiempo.
3. **Nacimiento, muerte, fusión y división de tópicos:** En el contexto de robos es natural que en el tiempo aparezcan nuevos *modus operandi* como también que desaparezcan aquellos que ya no parecen tan atractivos.

En el modelamiento de tópicos estático destaca LDA y HDP. La diferencia principal en estos dos modelos es que el primero necesita de antemano fijar el número de tópicos a descubrir y el segundo lo infiere a partir del corpus.

Dentro de los primeros modelos de tópicos dinámicos que fueron exitosos podemos encontrar a Dynamic Topic Modelling (DTM) junto Topic Over Time (TOC) (Wang and McCallum, 2006). Estos modelos mantienen el número de tópicos fijo en el tiempo, por lo que si aparece un nuevo tópico este quedará clasificado dentro de un tópico preexistente desde el comienzo, por lo que solo es capaz de capturar el punto 1 y 2.

En (Ahmed and Xing, 2012) se propone Dynamic Hierarchical Dirichlet Process (DHDP), modelo que no mantiene el número de tópicos fijo en el tiempo, sino que lo infiere a partir del corpus. Sin embargo, este modelo no es capaz de capturar fusión y división de tópicos. Además, a diferencia de los otros modelos de tópicos mencionados, DHDP no es una tecnología madura, puesto que no cuenta con una implementación disponible, por lo que se desconoce su desempeño en otras fuentes de información.

En (Wilson and Robinson, 2011) y (Beykikhoshk et al., 2018) se propone una metodología que permite capturar los dinámismos mencionados utilizando LDA y HDP respectivamente. Estas consisten en dividir el corpus en épocas, entrenar de forma independiente un modelo de tópico en cada época, para finalmente unir los resultados obtenidos. En este trabajo se utilizan técnicas de modelado dinámico de tópicos bajo este enfoque, usando como HDP para el descubrimiento de tópicos en cada época.

## 1.4. Estructura de la tesis

En el capítulo 2 se describen los fundamentos teóricos en los que se basa la metodología propuesta la cual es descrita en el capítulo 3. Luego, en el capítulo 4 se presenta un análisis cuantitativo y cualitativo de la metodología propuesta al fenómeno de robo de vehículos. Finalmente, en el capítulo 5 se presentan las conclusiones y futuras líneas de investigación.

# Capítulo 2

## Marco teórico

En este capítulo se describen los conceptos fundamentales para comprender la metodología propuesta en el capítulo 3. El capítulo es estructurado como sigue. En la sección 2.1 se introducen a nivel general los modelos de *clustering* probabilísticos conocidos como *mixture models*. En la sección 2.2 se introduce los modelos de tópicos LDA y HDP. Finalmente, en la sección 2.3 se describe una metodología que modela la evolución en el tiempo una vez los tópicos son descubiertos.

### 2.1. Mixture Models

Uno de los supuestos básicos en *clustering* es asumir que cada observación  $x_i$  pertenece a un solo *cluster*  $k$ . Podemos expresar la asignación a un *cluster* como una variable aleatoria  $z_i$ , donde  $z_i = k$  significa que  $x$  pertenece al *cluster*  $k$ , esta variable no es observada en los datos y se considera una variable oculta. Podemos obtener la distribución que caracteriza a un solo *cluster*  $k$  condicionando en  $z_i$

$$p(x_i|z_i = k, \phi) = p(x_i|\phi_k) \quad (2.1)$$

$$(2.2)$$

Además, podemos definir la probabilidad de que una nueva observación pertenezca al *cluster*  $k$

$$p(z_i = k|\pi) = \pi_k \quad (2.3)$$

$\sum_k \pi_k = 1$ , ya que  $\pi_k$  son probabilidades de eventos mutuamente excluyentes. La distribución de  $x_i$  es entonces de la forma

$$p(x_i) = \sum_k \pi_k p(x_i|\phi_k) \quad (2.4)$$

Podemos escribir  $p(x_i|\phi_k)$  como  $x_i \sim F(\phi_{z_i})$ , donde  $F$  es la distribución asociada a las observaciones.

Una representación equivalente para este modelo viene de considerar que el parámetro  $\bar{\phi}_i$  usado para generar la observación  $x_i$  proviene de una distribución discreta  $G$ , la cual tiene la forma

$$G(\phi) = \sum_k \pi_k \delta_{\phi_k}(\phi) \quad (2.5)$$

Así,  $G$  es una mezcla de funciones delta, donde la probabilidad que  $\bar{\phi}_i$  es igual a  $\phi_k$  es  $\pi_k$ . Luego, un *mixture model* podría representarse como sigue

$$\phi_{z_i} \sim G \quad (2.6)$$

$$x_i \sim F(\phi_{z_i}) \quad (2.7)$$

Un **Bayesian mixture model** es un *mixture model* con una medida aleatoria para las mezclas. En la sección 2.1.1. y 2.1.2 nos referimos a dos priors ampliamente usados para construir *bayesian mixture model*: la distribución Dirichlet que nos permite construir un **finite mixture model**, donde el número de átomos o *clusters* a descubrir es finito, denotado por  $K$  y un prior no paramétrico denominado Dirichlet Process (DP), el cual permite construir un **infinite mixture model**, donde el número de *clusters* no está acotado.

### 2.1.1. Distribución Dirichlet

La distribución Dirichlet (Minka, 2000) es una generalización multivariada de la distribución beta, la cual tiene soporte sobre un **simplex**, definido por:

$$S_K = \{x : 0 \leq x_k \leq 1, \sum_{k=1}^K x_k = 1\} \quad (2.8)$$

Luego, su función de densidad de probabilidad (pdf):

$$Dir(x|\alpha) = \frac{1}{B(\alpha)} \prod_{k=1}^K x_k^{\alpha_k-1} \mathbb{I}(x \in S_K) \quad (2.9)$$

donde  $B(\alpha) = B(\alpha_1, \dots, \alpha_K)$  es la generalización de la función beta a  $K$  variables:

$$B(\alpha) \triangleq \frac{\prod_{k=1}^K \Gamma(\alpha_k)}{\Gamma(\alpha_0)} \quad (2.10)$$

donde  $\alpha_0 \triangleq \sum_{k=1}^K \alpha_k$ .

En la Figura 2.1 se observa el efecto de los parámetros en la distribución Dirichlet para  $K = 3$ . Cuando  $\alpha_k = 1$  se tiene una distribución uniforme en el dominio  $S_K$ . El parámetro  $\alpha_k$  controla la *sparsity*, mientras más se acerca a 0 los vectores generados tienen más átomos nulos y se concentra la masa en unas pocas coordenadas, mientras más grande  $\alpha_k$  la masa más se concentra en el centro  $(1/3, 1/3, 1/3)$ , por último, cuando  $\alpha$  no es simétrico la masa



se concentra proporcionalmente en las coordenadas con  $\alpha_k$  mayor.

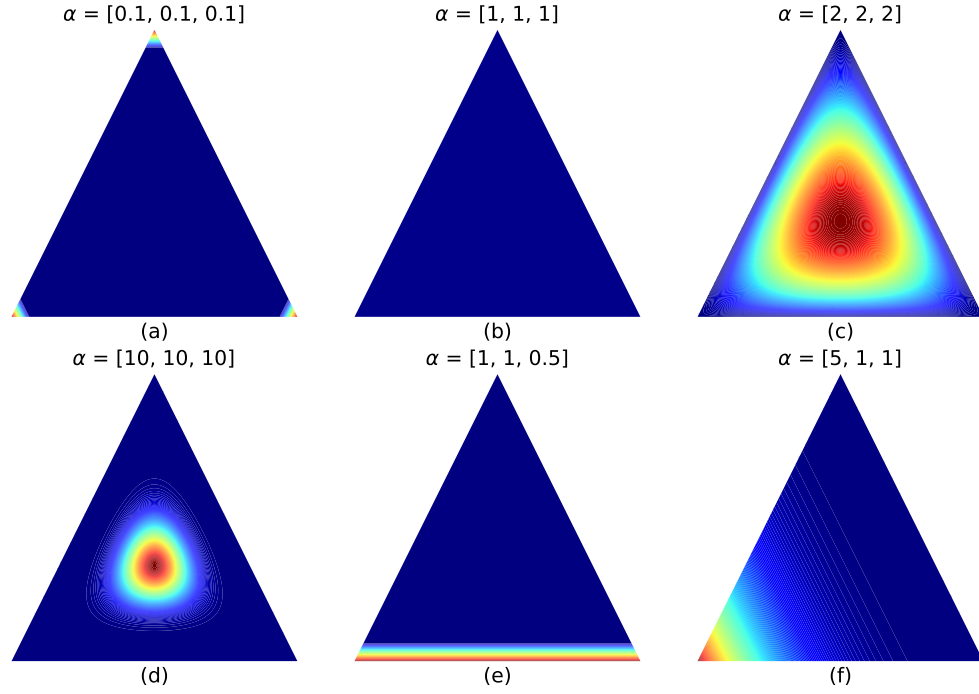


Figura 2.1: Densidad de la distribución Dirichlet para  $K = 3$  define una distribución sobre el *simplex*, el cual puede ser representado por una superficie trinagular.

En general se asume simetría en los parámetros de la distribución Dirichlet de la forma  $\alpha_k = \frac{\alpha}{K}$ , de esta manera  $\alpha$  funciona como parámetro de concentración. En la Figura 2.2 se observa una realización de una distribución Dirichlet para  $\alpha \in \{0.1, 1, 10\}$  y  $K \in \{2, 10, 100\}$ , donde podemos observar que a mayor  $\alpha$  los componentes del vector  $x$  más similares se vuelven, esto es más notorio a mayor dimensionalidad debido a que hay más dimensiones donde distribuir la masa.

La distribución Dirichlet es comúnmente usada en estadística Bayesiana, ya que es un prior conjugado con la distribución categórica (multinoulli) y la distribución multinomial. Así, la distribución Dirichlet puede ser utilizado como prior en un *finite mixture model* asumiendo que  $\pi \sim \text{Dir}(\frac{\alpha}{K} \mathbf{1}_K)$  y  $\phi_k \sim H$ .

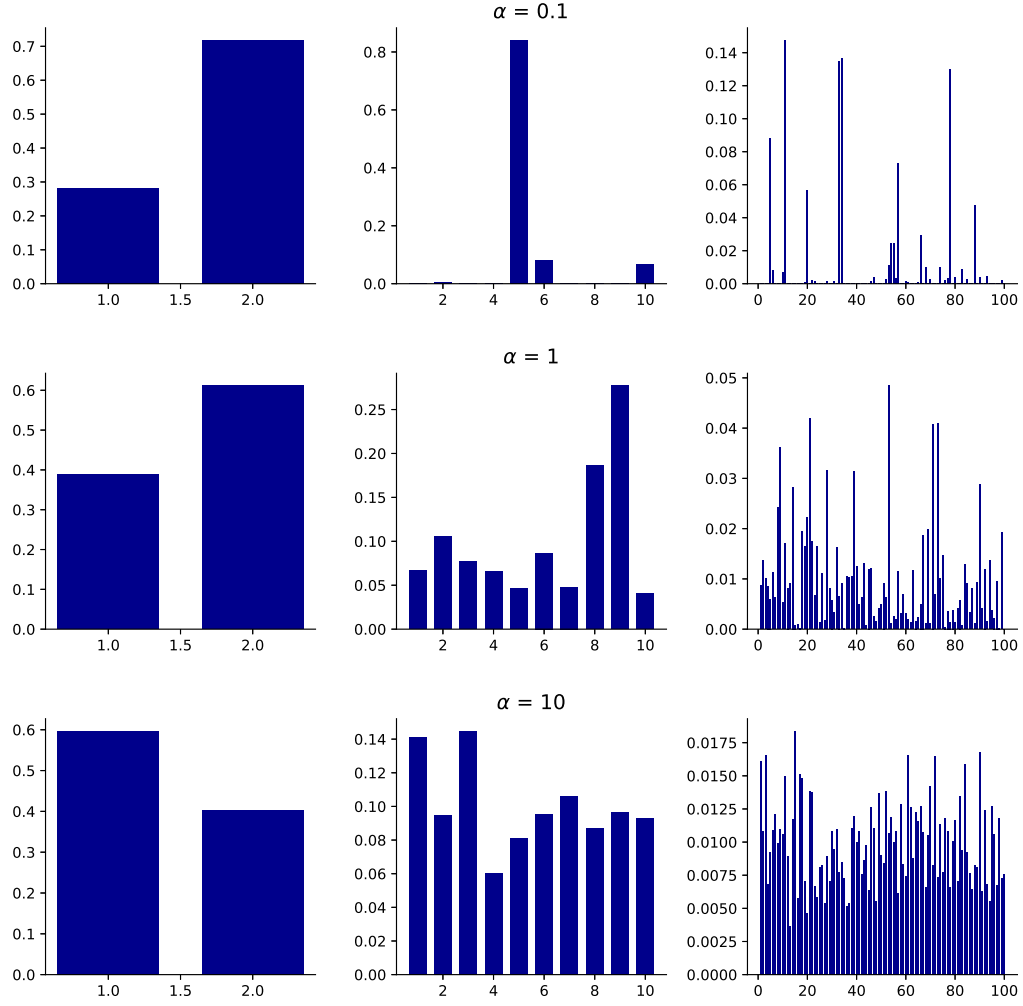


Figura 2.2: Muestra de una distribución Dirichlet simétrica para  $\alpha \in \{0.1, 1, 10\}$  y  $K \in \{2, 10, 100\}$ .

### 2.1.2. Dirichlet Process

En un *finite mixture model* tenemos  $G(\phi) = \sum_{k=1}^K \pi_k \delta_{\phi_k}(\phi)$ , luego si muestreamos a partir de  $G$ , con probabilidad uno obtendremos exactamente  $K$  *clusters*. Nos gustaría tener un modelo más flexible, que pueda generar un número variable de *clusters*. La forma de hacer esto es remplazar la distribución discreta  $G$  por una medida aleatoria de probabilidad. El Dirichlet Process (Ferguson, 1973), denotado  $G \sim \text{DP}(\alpha, H)$ , es una manera de hacer esto.

Un **Dirichlet Process** (DP) es una distribución sobre medidas de probabilidad  $G : \Phi \rightarrow \mathbb{R}^+$ , donde  $G(\phi) \geq 0$  y  $\int_{\Phi} G(\phi) d\phi = 1$ . Un DP se define implícitamente por cumplir

$$G(A_1), \dots, G(A_K) \sim \text{Dir}(\alpha H(A_1), \dots, \alpha H(A_K)) \quad (2.11)$$

para cualquier partición finita  $(A_1, \dots, A_K)$  de  $\Phi$ . En este caso, decimos que  $G \sim \text{DP}(\alpha, H)$ , donde  $\alpha$  es llamado el **parámetro de concentración** y  $H : \Phi \rightarrow \mathbb{R}^+$  es llamado la **medida base**.

Como  $p(G(A_1), \dots, G(A_K))$  es Dirichlet, la distribución marginal en cada partición distribuye beta  $\text{Beta}(\alpha H(A_i), \alpha \sum_{j \neq i} H(A_j))$ . El DP es considerado consistentemente definido, en el sentido de que si particionamos  $\bar{A}_1$  en  $A_1$  y  $A_2$ , entonces  $G(\bar{A}_1)$  y  $G(A_1) + G(A_2)$  siguen la misma distribución beta.

Sea  $\phi \sim \text{Dir}(\alpha)$ , y  $z|\phi \sim \text{Cat}(\pi)$ , si integramos  $\pi$  afuera obtenemos la distribución predictiva del modelo Dirichlet-multinoulli:

$$z \sim \text{Cat}(\alpha_1/\alpha_0, \dots, \alpha_K/\alpha_0) \quad (2.12)$$

donde  $\alpha_0 = \sum_k \alpha_k$ . Es decir,  $p(z = k|\alpha) = \alpha_k/\alpha_0$ . Además, la posterior de  $\pi$  dada una observación viene dada por

$$\pi|z \sim \text{Dir}(\alpha_1 + \mathbb{I}(z = 1), \dots, \alpha_K + \mathbb{I}(z = K)) \quad (2.13)$$

El DP generaliza el resultado anterior a particiones arbitrarias. Si  $G \sim \text{DP}(\alpha, H)$ , luego  $p(\phi \in A_i) = H(A_i)$  y la posterior es

$$p(G(A_1), \dots, G(A_K)|\phi, \alpha, H) = \text{Dir}(\alpha H(A_1) + \mathbb{I}(\phi \in A_1), \dots, \alpha H(A_K) + \mathbb{I}(\phi \in A_K)) \quad (2.14)$$

Esto se mantiene para cualquier conjunto de particiones. Por lo tanto, si observamos múltiples muestras  $\bar{\phi}_{1:N} \sim G$ , la nueva posterior está dada por

$$G|\bar{\phi}_{1:N}, \alpha, H \sim \text{DP}\left(\alpha + N, \frac{1}{\alpha + N} \left( \alpha H + \sum_{i=1}^N \delta_{\phi_i} \right)\right) \quad (2.15)$$

Por ende el DP define un prior conjugado para cualquier espacio medible, donde el parámetro de concentración  $\alpha$  es como el tamaño de nuestro efectivo de la medida base  $H$ .

Existen diferentes perspectivas que ayudan a entender la propiedad de *clustering* de un Dirichlet Process. En la sección 2.1.3. y 2.1.4. nos referimos a dos: el Stick Breaking Process y Chinese Restaurant Process (CRP).

### 2.1.3. Stick Breaking Process

En esta sección describiremos una definición constructiva de un DP, conocida como *stick breaking process* (Sethuraman, 1994). Sea  $\pi = \{\pi_k\}_{k=1}^{\infty}$  una mezcla de pesos infinita derivada

a partir del siguiente proceso:

$$\beta_k \sim \text{Beta}(1, \alpha) \quad (2.16)$$

$$\pi_k = \beta_k \prod_{l=1}^{k-1} (1 - \beta_l) = \beta_k (1 - \sum_{l=1}^{k-1} \pi_l) \quad (2.17)$$

Esto se suele denotar como  $\pi \sim \text{GEM}(\alpha)$ , donde GEM representa Griffiths, Engen y McCloskey, ver Figura 2.3 para una ilustración.

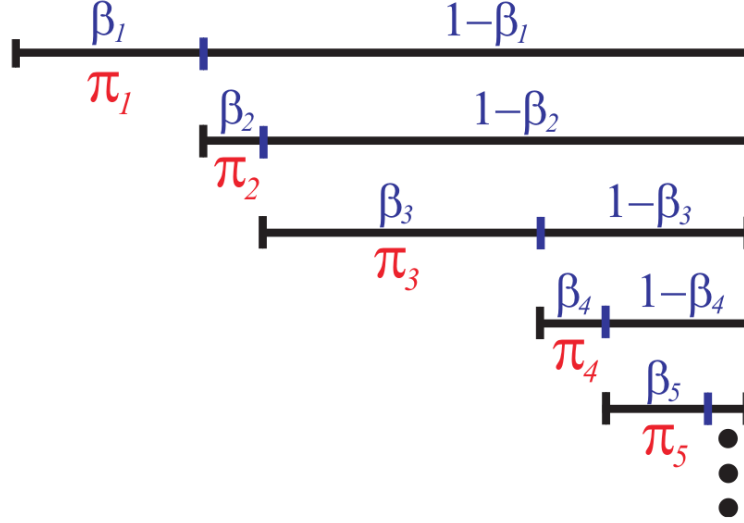


Figura 2.3: Ilustración de *stick breaking process*. Tenemos una barra de largo 1, la cual se rompe en un punto aleatorio  $\beta_1$ , el largo de la pieza que conservamos es llamada  $\pi_1$ , luego recursivamente rompemos la barra restante, así generando  $\pi_2, \pi_3, \dots$ . Fuente: Figura 2.22 de (Sudderth, 2006).

Algunos ejemplos de este proceso son mostrados en la Figura 2.4 (a). A mayor  $\alpha$ , menos varianza y mayor número de átomos, por el contrario, pequeños valores de  $\alpha$  muestran una alta varianza y menor número de átomos, adicionalmente exhiben mayor varianza en el número de átomos.

Se puede demostrar que este proceso terminará con probabilidad uno, a pesar que el número de elementos que este genera incrementa con  $\alpha$ . Además, el tamaño del componente  $\pi_k$  decrece en promedio. Ahora definamos

$$G(\phi) = \sum_{k=1}^{\infty} \pi_k \delta_{\phi_k}(\phi) \quad (2.18)$$

donde  $\pi \sim \text{GEM}(\alpha)$  y  $\phi_k \sim H$ , se puede demostrar que  $G \sim \text{DP}(\alpha, H)$ . Como consecuencia de esta construcción, las muestras de un DP son **discretas con probabilidad uno**. En otras palabras, al ir muestreando  $\bar{\phi}_i \sim G$  veremos valores repetidos, por lo que la mayoría de los datos vendrán de los  $\phi_k$  con  $\pi_k$  más largos. En la Figura 2.4 (b) muestra un par de medidas aleatorias generadas a partir de un DP con una medida base normal.

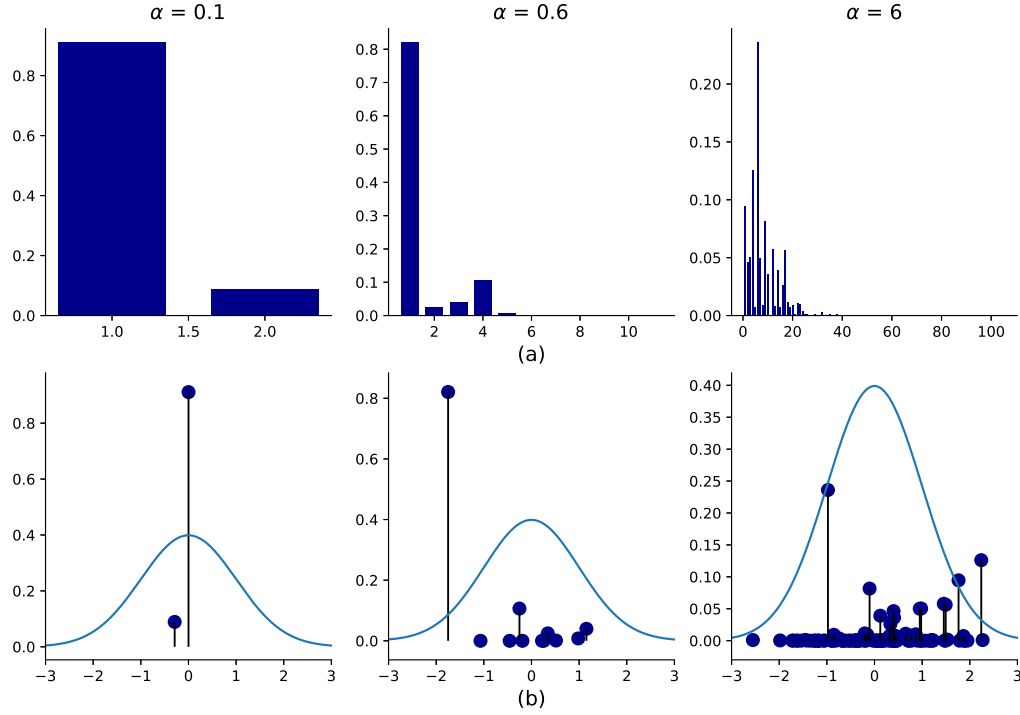


Figura 2.4: (a) Muestra de una distribución GEM para diferentes parámetros de concentración  $\alpha \in \{0.1, 0.6, 6\}$ . (b) Medidas aleatorias generadas a partir de un Dirichlet Process con medida base normal  $\mathcal{N}(0, 1)$  para diferentes parámetros de concentración  $\alpha \in \{0.1, 0.6, 6\}$

#### 2.1.4. Chinese Restaurant Process

Trabajar con infinitos átomos puede ser bastante problemático. Para sortear esta dificultad podemos explotar la propiedad de *clustering* de un DP. Sea  $\bar{\phi}_{1:N} \sim G$  observaciones generadas a partir de  $G \sim \text{DP}(\alpha, H)$ , sea  $K$  los distintos valores de  $\bar{\phi}_{1:N}$ , luego la distribución predictiva condicionada en las  $N$  observaciones está dada por

$$p(\bar{\phi}_{N+1} = \phi | \bar{\phi}_{1:N}, \alpha, H) = \frac{1}{\alpha + N} \left( \alpha H(\phi) + \sum_{k=1}^K N_k \delta_{\bar{\phi}_k}(\phi) \right) \quad (2.19)$$

donde  $N_k$  es el número de observaciones previas iguales a  $\phi_k$ . Este esquema de muestreo es llamado *Polya urn* o *Blackwell-MacQueen*. Esta construcción provee una forma constructiva para muestrear de un DP. Es más conveniente trabajar con variables discretas  $z_i$  que especifican cual valor de  $\phi_k$  usar, así, definimos  $\bar{\phi}_i = \phi_{z_i}$ . Basado en esta expresión Tenemos

$$p(z_{N+1} = z | z_{1:N}, \alpha) = \frac{1}{\alpha + N} \left( \alpha \mathbb{I}(z = k^*) + \sum_{k=1}^K N_k \mathbb{I}(z = k) \right) \quad (2.20)$$

donde  $k^*$  representa un nuevo *cluster* que no ha sido usado aún. Este proceso es llamado Chinese Restaurant Process (CRP) (Aldous, 1985), basado en la oferta aparentemente infinito de mesas en ciertos restaurantes Chinos. La analogía es la siguiente: Las tablas del restaurante son los *clusters* y los clientes son las observaciones. Cuando una persona entra al restaurante, esta puede escoger sentarse en una tabla existente con probabilidad proporcional al número de personas ya sentadas en esa tabla ( $N_k$ ), en otro caso, con una probabilidad decreciente a medida que más personas entran al restaurante (debido a  $1/(\alpha + N)$ ) escogerá sentarse en una nueva tabla  $k^*$ . El resultado de este proceso es una distribución sobre particiones de los naturales, la cual es como una distribución de clientes a tablas.

El hecho de que las tablas actualmente ocupadas son más probables de obtener nuevos clientes se le suele llamar el fenómeno del *rich get richer*. En efecto, se puede demostrar que la distribución del número de *clusters* que induce este prior es básicamente una ley de potencia, donde el número de tablas  $K$  con probabilidad 1 se aproxima a  $\alpha \log(N)$  cuando  $N \rightarrow \infty$ , mostrando que la complejidad del modelo crece logarítmicamente con el tamaño de los datos.

## 2.2. Modelos de tópicos

Los modelos de tópicos probabilísticos nos ayudan a descubrir los temas latentes (*clusters*) en una colección de documentos, como estos temas están conectados unos a otros y cómo cambian en el tiempo. Permiten resumir un gran colección de documentos a través de sus temas y organizarlos entorno a estos.

Los modelos probabilísticos tratan un tópico como una distribución de probabilidad discreta sobre el vocabulario del corpus, siendo una práctica habitual interpretar un tópico a partir de sus  $N$  palabras más probables. Por ejemplo, para  $N = 5$  las palabras más probables de un tópico son: “llaves”, “domicilio”, “individuos”, “casa” y “porton”, por lo que una etiqueta valida para este tópico podría ser “portonazo”.

En *text mining* se suele trabajar bajo la asunción de **bag of words** (bolsa de palabras), es decir, tanto los documentos como las palabras son tratadas como intercambiables. Es importante hacer notar que intercambiabilidad no es equivalente a que las variables aleatorias son independientes e idénticamente distribuidas. Más bien, intercambiabilidad esencialmente puede ser interpretado como condicionalmente independientes e idénticamente distribuidas, donde el condicionamiento es con respecto a los parámetros de una distribución de probabilidad. Por lo tanto, el supuesto de intercambiabilidad es claramente un supuesto de simplificación cuya principal justificación es la construcción de algoritmos computacionalmente más eficientes.

Un *mixture model* bien conocido que trabaja bajo la asunción de *bag of words* es *mixture of unigrams* (Nigam et al., 2000), el cual asume que todos los documentos provienen de un solo *cluster* dentro de un conjunto finito de  $K$  *clusters*. Los documentos de un *cluster* discuten solo un tópico particular  $z$ , y cada tópico  $z$  está asociado a una distribución categórica. Así, la verosimilitud de observar un documento  $d$  es

$$w|z \sim \text{Cat}(\theta_z) \quad (2.21)$$

$$p(w_1, \dots, w_{N_d}) = \sum_{z=1}^K p(z) \prod_{i=1}^{N_d} p(w_i|z) \quad (2.22)$$

En comparación a *mixture of unigrams*, LDA y HDP suponen que las palabras de un documento provienen de un mismo *mixture model*. A nivel corpus los *mixture models* comparten parámetros, que vienen siendo los tópicos, pero las *mixtures of topics* son específicas de cada documento. Esto permite relajar la asunción de que cada documento es generado por un solo tópico, permitiendo que un documento pueda tener presencia de más de un tema debido a que cada palabra proviene de algún tópico.

En las secciones 2.2.1-2.2.2 se describe en detalle dos modelos de tópicos probabilísticos, Latent Dirichlet Allocation (LDA) y Hierarchical Dirichlet Process (HDP), considerado la generalización no paramétrica de LDA, donde el número de tópicos a descubrir no está acotado y se infiere a partir del corpus.

### 2.2.1. Latent Dirichlet Allocation

En Latent Dirichlet Allocation (LDA) (Blei et al., 2003) cada tópico es una distribución de probabilidad sobre un vocabulario fijo  $V$ . Cada documento  $d$  tiene su propia mezcla de tópicos  $\pi_d$ . La asignación  $z_{d,n} \in \{1, \dots, K\}$  de una palabra  $n$  a un tópico  $z$  es dibujada a partir de  $\pi_d$ . El modelo completo es como sigue

$$\phi_k|\eta \quad \sim \quad \text{Dir}\left(\frac{\eta}{|V|}1_{|V|}\right) \quad (2.23)$$

$$\pi_d|\alpha \quad \sim \quad \text{Dir}\left(\frac{\alpha}{K}1_K\right) \quad (2.24)$$

$$z_{d,n}|\pi_d \quad \sim \quad \text{Cat}(\pi_d) \quad (2.25)$$

$$w_{d,n}|z_{d,n}, \phi_{1:K} \quad \sim \quad \text{Cat}(\phi_{z_{d,n}}) \quad (2.26)$$

Esto es ilustrado en la Figura 2.5.

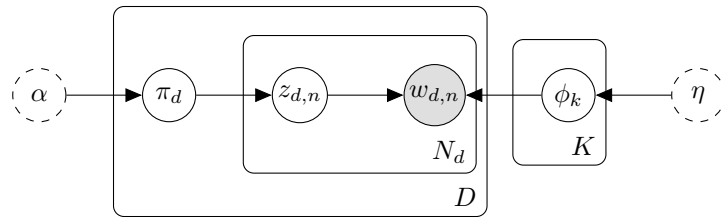


Figura 2.5: Representación gráfica de LDA: círculos denotan variables aleatorias, círculos abiertos denotan parámetros, círculos sombreados denotan variables observadas y los platos indican replicación.

La probabilidad conjunta del modelo:

$$p(\phi, \pi, z, w|\alpha, \eta) = \prod_{k=1}^K p(\phi_k|\eta) \prod_{d=1}^D p(\pi_d|\alpha) \prod_{n=1}^{N_d} p(z_{n,d}|\pi_d) p(w_{d,n}|\phi_{1:K}, z_{d,n}) \quad (2.27)$$

La distribución a posterior:

$$p(\phi, \pi, z|w, \alpha, \eta) = \frac{p(\phi, \pi, z, w|\alpha, \eta)}{p(w|\alpha, \eta)} \quad (2.28)$$

La distribución posterior es computacionalmente intratable para inferencia exacta, debido a que para normalizar la distribución debemos marginalizar sobre todas las variables ocultas y escribir la constante de normalización en términos de los parámetros del modelo. Para poder computar la posterior es necesario utilizar algoritmos de inferencia aproximada, donde el enfoque habitual es Markov Chain Monte Carlo (MCMC) (Andrieu et al., 2003) e Inferencia Variacional (VI) (Blei et al., 2017). En (Blei et al., 2003) se propone un algoritmo basado en VI y en (Griffiths and Steyvers, 2004) en MCMC.

Una representación equivalente en LDA sería generar cada palabra de un documento  $d$  a partir de un tópico dibujado por una distribución  $G_d$ ,

$$\phi_k|\eta \sim \text{Dir}\left(\frac{\eta}{|V|} 1_{|V|}\right) \quad (2.29)$$

$$\pi_d|\alpha \sim \text{Dir}\left(\frac{\alpha}{K} 1_K\right) \quad (2.30)$$

$$G_d(\phi) = \sum_{k=1}^K \pi_{d,k} \delta_{\phi_k}(\phi) \quad (2.31)$$

$$\phi_{d,n}|\pi_d, \phi_{1:K} \sim G_d \quad (2.32)$$

$$w_{d,n}|\phi_{d,n} \sim \text{Cat}(\phi_{d,n}) \quad (2.33)$$

## 2.2.2. Hierarchical Dirichlet Process

Hierarchical Dirichlet Process (HDP)(Teh et al., 2005) es un prior no paramétrico, donde la medida base  $G_0$  de un conjunto de DPs es dibujada a partir de un DP. En el caso de modelamiento de tópicos, tenemos una medida global  $G_0$  a nivel corpus que es dibujada a partir de un DP con medida base Dirichlet y una medida para cada documento que es dibujada a partir de un DP cuya medida base es  $G_0$ . El modelo completo es como sigue

$$H = \text{Dir}\left(\frac{\eta}{|V|} 1_{|V|}\right) \quad (2.34)$$

$$G_0|\gamma, H \sim \text{DP}(\gamma, H) \quad (2.35)$$

$$G_d|\alpha, G_0 \sim \text{DP}(\alpha_0, G_0) \quad (2.36)$$

$$\phi_{d,n}|G_d \sim G_d \quad (2.37)$$

$$w_{d,n}|\phi_{d,n} \sim \text{Cat}(\phi_{d,n}) \quad (2.38)$$



Esto es ilustrado en la Figura 2.6.

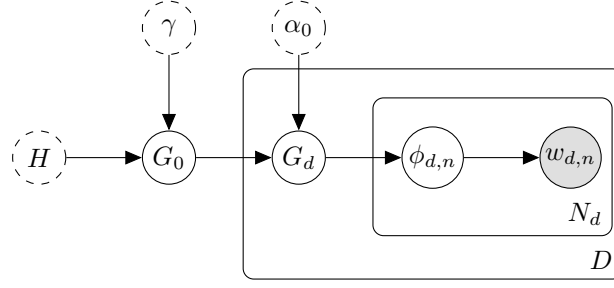


Figura 2.6: Representación gráfica de HDP: círculos denotan variables aleatorias, círculos abiertos denotan parámetros, círculos sombreados denotan variables observadas y los platos indican replicación.

La discretitud a nivel corpus de  $G_0$  asegura que todos los documentos comparten el mismo conjunto de tópicos (*mixture components*). A nivel documento  $G_d$  hereda los tópicos de  $G_0$ , pero los pesos de cada tópico (*mixture proportions*) es específica del documento.

### 2.2.2.1. Stick Breaking Construction

Aplicando *stick breaking construction* se tiene que para el DP dibujado a nivel corpus la siguiente representación:

$$\beta'_k \sim \text{Beta}(1, \gamma) \quad (2.39)$$

$$\beta_k = \beta'_k \prod_{l=1}^{k-1} (1 - \beta'_l) \quad (2.40)$$

$$\phi_k \sim H \quad (2.41)$$

$$G_0(\phi) = \sum_{k=1}^{\infty} \beta_k \delta_{\phi_k}(\phi) \quad (2.42)$$

Así,  $G_0$  es discreto y tiene soporte en los átomos  $\phi = \{\phi_k\}_{k=1}^{\infty}$  con pesos  $\beta = \{\beta_k\}_{k=1}^{\infty}$ , siendo la distribución de  $\beta$  escrita como  $\beta \sim \text{GEM}(\gamma)$ . La construcción a nivel documento de  $G_d$  es:

$$\pi'_{d,k} \sim \text{Beta}(\alpha_0 \beta_k, \alpha_0 (1 - \sum_{l=1}^k \beta_l)) \quad (2.43)$$

$$\pi_{d,k} = \pi'_{d,k} \prod_{l=1}^{k-1} (1 - \pi'_{d,l}) \quad (2.44)$$

$$G_d(\phi) = \sum_{k=1}^{\infty} \pi_{d,k} \delta_{\phi_k}(\phi) \quad (2.45)$$

$$\phi_{d,n} | \pi_d, \phi_{1:\infty} \sim G_d \quad (2.46)$$

Donde  $\phi = \{\phi_k\}_{k=1}^{\infty}$  son los mismos átomos de  $G_0$ . Esto es ilustrado en la Figura 2.7.

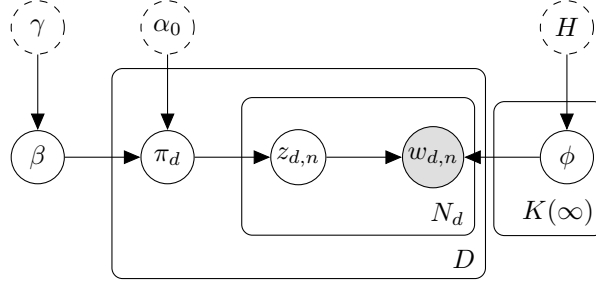


Figura 2.7: Representación gráfica de la construcción stick-breaking de HDP: círculos denotan variables aleatorias, círculos abiertos denotan parámetros, círculos sombreados denotan variables observadas y los platos indican replicación.

#### 2.2.2.2. Chinese Restaurant Franchise Process

Una construcción alternativa de HDP es conocida bajo el nombre de *Chinese Restaurant Franchise Process* (CRF), una extensión del CRP, que permite compartir un conjunto de platos a través de una cadena de restaurantes Chinos. La analogía es la siguiente, tenemos  $D$  restaurantes, cada uno con  $N_d$  clientes  $\phi_{d,i}$ , que se sientan en tablas  $t_{d,i}$ , en cada tabla es servido un único plato  $\phi_k \sim H$  a partir de un menú común para todos los restaurantes.

Sea  $m_{dk}$  el número de tablas sirviendo el plato  $k$  en el restaurante  $d$ , así  $m_d$  representa el número de tablas en el restaurante  $d$ ,  $m_{.k}$  representa el número de tablas sirviendo el plato  $k$ , y  $m_{..}$  el número total de tablas ocupadas. Primero, procedemos a integrar afuera  $G_d$ , siendo la probabilidad condicional del cliente  $i$  en la tabla  $t$

$$p(t_{di} = t | t_{d1}, \dots, t_{d,i-1}, \alpha_0, G_0) = \frac{1}{\alpha_0 + i - 1} \left( \alpha_0 \mathbb{I}(t = t^*) + \sum_{t'=1}^{m_d} N_{dt'} \mathbb{I}(t = t') \right) \quad (2.47)$$

donde  $N_{dt'}$  representa los clientes del restaurante  $d$  que están sentados en la tabla  $t'$ . Con probabilidad proporcional a los clientes sentados en la tabla  $t$  los clientes del restaurante se sentarán en esta y con probabilidad proporcional a  $\alpha_0$  en una nueva. Una vez todos los clientes estan sentados tenemos una partición sobre  $\phi_{d1}, \dots, \phi_{dN_d}$  para cada documento  $d$ . Luego, procedemos a integrar afuera  $G_0$ , obteniéndose

$$p(z_{dt} = z | z_{11}, z_{12}, \dots, z_{d1}, \dots, z_{d,t-1} | \gamma, H) = \frac{1}{\gamma + m_{..}} \left( \gamma \mathbb{I}(z = k^*) + \sum_{k=1}^K m_{.k} \mathbb{I}(z = k) \right) \quad (2.48)$$

en este caso se tiene que la tabla  $t$  del restaurante  $d$  con probabilidad proporcional al número de tablas que sirven el plato  $k$  ( $m_{.k}$ ) servirá el plato  $k$  y con probabilidad proporcional a  $\gamma$  servirá un nuevo plato.

Al igual que LDA la distribución posterior es intratable, en (Teh et al., 2005) se propone un algoritmo basado en MCMC bajo la construcción CRF de un HDP.

## 2.3. Modelamiento de la evolución de los tópicos en el tiempo

En (Wilson and Robinson, 2011) y (Beykikhoshk et al., 2018) se propone una metodología que permite capturar los dinámismos mencionados usando LDA y HDP respectivamente. Donde se propone dividir el corpus en  $T$  épocas, en cada época se entrena un modelo de tópicos estático, obteniéndose así  $T$  conjuntos de tópicos  $\phi = \{\phi_1, \dots, \phi_T\}$ , con  $\phi_t = \{\phi_{t,1}, \dots, \phi_{t,K_t}\}$  el conjunto de tópicos que describen la época  $t$ , y  $K_t$  el número de tópicos inferido en esa época. Una vez descubiertos los tópicos se hace uso de medidas de distancia o similitud para relacionar tópicos de épocas adyacentes

En las secciones 2.3.1-2.3.2 se describe la metodología propuesta en (Beykikhoshk et al., 2018) para relacionar los tópicos descubiertos de épocas adyacentes.

### 2.3.1. Gráfo de similitud temporal

Para relacionar los tópicos de una época necesitamos una medida de similitud  $\rho \in [0, 1]$ , con esta mérida de similitud se puede construir un gráfo, donde los nodos son los tópicos de una época y los arcos relacionan tópicos de una época con la siguiente, siendo el peso del arco la similitud entre los tópicos. Una vez construido el grafo se eliminan las conexiones débiles en base a un umbral  $\zeta \in [0, 1]$  a definir, reteniendo solo aquellas conexiones entre tópicos suficientemente similares entre épocas adyacentes, matemáticamente podemos el arco entre los tópicos  $\phi_{t,i}$  y  $\phi_{t+1,j}$  si  $\rho(\phi_{t,i}, \phi_{t+1,j}) \leq \zeta$ .

Está metodología permite fácilmente detectar desaparición de un tópico, nacimiento de un nuevo tópico, como también división o fusión entre diferentes tópicos. A continuación se define en detalle cada uno de estos dinamismos:

- **Nacimiento de un tópico:** Si un tópico no tiene ningún arco entrante, por ejemplo, en la Figura 2.8 el tópico  $\phi_{j+2}$  en  $t$ .
- **Muerte de un tópico:** Si un tópico no tiene ningún arco saliente, por ejemplo, en la Figura 2.8 el tópico  $\phi_j$  en  $t$ .
- **Evolución de un tópico:** Cuando un tópico tiene exactamente un arco de entrada y salida, por ejemplo, en la Figura 2.8 entre las épocas  $t$  y  $t + 1$  se tiene que el tópico  $\phi_{j+2}$  evoluciona del tópico  $\phi_{k+1}$ .
- **División de un tópico:** Si un tópico tiene más de un arco saliente, por ejemplo, en la Figura 2.8 el tópico  $\phi_i$  de  $t - 1$  se divide en  $t + 1$  en los tópicos  $\phi_j$  y  $\phi_{j+1}$ .
- **Fusión de un tópico:** Cuando un tópico tiene más de un arco entrante, este tipo de tópicos también pueden ser entendidos como un nuevo tópico, por ejemplo, en la Figura 2.8 los tópicos  $\phi_i$  y  $\phi_{i+1}$  de  $t - 1$  forman al tópico  $\phi_{j+1}$  en  $t$ .

Una ilustración conceptual del grafo de similitud es mostrado en la Figura 2.8, este muestra tres épocas consecutivas.

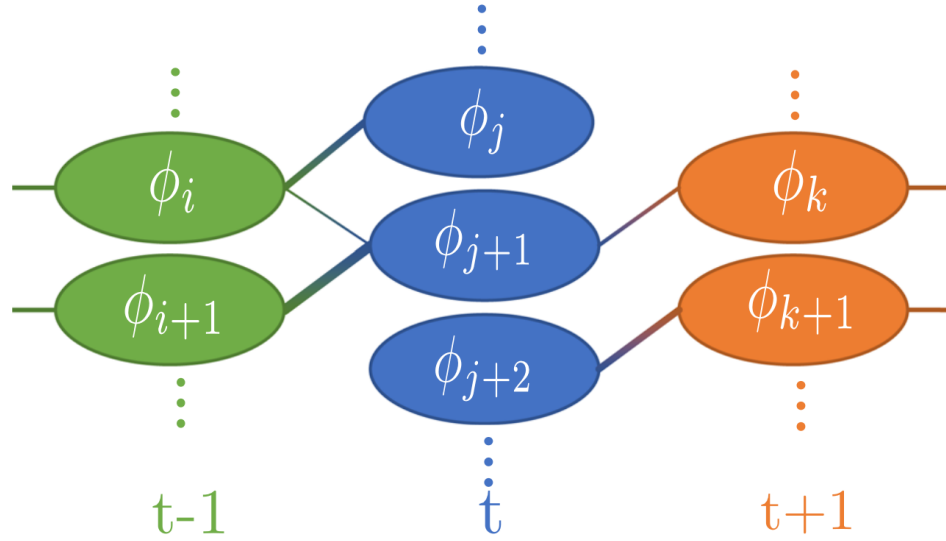


Figura 2.8: Ilustración conceptual del grafo de similitud que modela la dinámica de los tópicos en el tiempo. Un nodo corresponde a un tópico en una época específica; el ancho de los arcos es proporcional a la similitud entre los tópicos, arcos ausentes fueron eliminados por presentar una similitud menor a un umbral. Fuente: Figura 3 de (Beykikhoshk et al., 2018)

### 2.3.2. Construcción automática del grafo de similitud

Un aspecto relevante de esta metodología es definir el umbral de corte, el cual no es fácilmente interpretable, además el umbral depende de la medida de similitud escogida, dificultando así la comparación entre medidas de similitud. En (Beykikhoshk et al., 2018) proponen una alternativa más interpretable para definir el umbral, para esto estiman la función de densidad acumulada (cdf) del grafo inicial, donde todos los nodos de una época están conectados con todos los nodos de la época adyacente, al que llamaremos grafo *fully connected*.

Sea  $F_p$  la cdf sobre las similitudes del grafo inicial, luego sea  $\zeta \in [0, 1]$  el punto operante de la cdf, luego eliminamos el arco entre los tópicos  $\phi_{t,i}$  y  $\phi_{t+1,j}$  si  $\rho(\phi_{t,i}, \phi_{t+1,j}) \leq F_p^{-1}(\zeta)$ , donde  $F_p^{-1}(\zeta)$  es el cuantil  $\zeta$  de  $F_p$ . En 2.9 se tiene una ilustración para tres medidas de similitud, en esta se observa que la elección de un umbral de corte arbitrario depende fuertemente de la medida de similitud escogida, por lo que la elección en base a la cdf puede ser más apropiada.

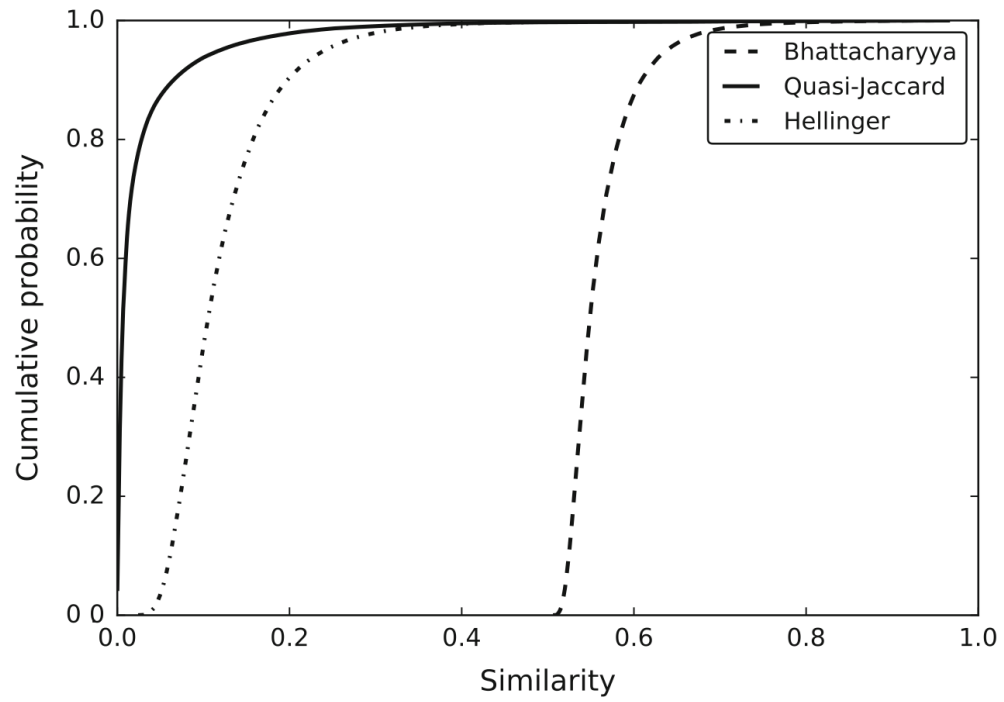


Figura 2.9: Estimación empírica de la función de densidad acumulada (cdf) de la similitud entre tópicos de épocas adyacentes en el grafo *fully connected* para tres medidas de similitud. Fuente: Figura 4 (Beykikhoshk et al., 2018).

# Capítulo 3

## Metodología

En este capítulo se describe la metodología propuesta para el descubrimiento de tópicos y su evolución en el tiempo. En la sección 3.1 se describe la metodología de procesamiento usada para limpiar los datos, previa a la utilización del modelo de tópicos. En la sección 3.2 se justifica la elección del modelo de tópicos, junto a la configuración de hiperparámetros usada y la herramienta a usar para facilitar su interpretación. Por último, en la sección ?? se describe la metodología utilizada para modelar la evolución en el tiempo y la métrica de similitud utilizada para comparar tópicos de épocas adyacentes.

### 3.1. Procesamiento

El propósito del procesamiento en *text mining* es simplificar los datos lo más posible tal que se mantiene el *core* de palabras del corpus. En el caso de modelamiento de tópicos, esta etapa puede reducir significativamente el vocabulario. Como consecuencia, esto puede traer una mejora en la significancia estadística de los modelos, puesto que se puede obtener un mejor balance entre cantidad de parámetros y observaciones. Adicionalmente, puede facilitar la interpretación de los tópicos, removiendo palabras que aportan poca información.

En este experimento se aplicaron cinco etapas:

1. **Tokenización:** La tokenización es una operación sobre una cadena de caracteres (*string*) que consiste en dividir el *string* (ej: por el carácter espacio) en un conjunto de términos, obteniéndose así una lista de elementos llamados *tokens*, que en términos simples pueden considerarse como una palabra.
2. **Procesamiento de caracteres:** En esta etapa se suelen aplicar algunas operaciones básicas de procesamiento. En este proceso se llevan los tokens a unicode y minúsculas. Luego, se eliminan patrones de caracteres que difícilmente pueden tener algún significado, como correos electrónicos, símbolos de puntuación, tokens con números y letras o solo números.
3. **Eliminación de stopwords:** Las *stopwords* (Wilbur and Sirotkin, 1992) son palabras que aportan poca información (ej: artículos, preposiciones y conectores), usualmente tienen una alta frecuencia dentro del corpus. Para esto se utiliza una lista de palabras de *stopwords* disponible en el paquete NLTK de Python de 313 palabras (Bird et al., 2009). Además, esta lista se alimenta con 951 *stopwords* contextuales, palabras específicas

del corpus que aportan poca información, en el caso del robo de vehículos palabras relacionadas a “robo” o “vehículo” no aportan ninguna información, puesto a que todos los relatos hablan del robo de un vehículo.

4. **Filtro por vocabulario:** Con el propósito de mantener las palabras que son “humanamente legibles” se utiliza un vocabulario. Para esto se utilizó el vocabulario del corpus SUC descrito en la sección anterior, de esta manera toda palabra tiene su *word embedding*.
5. **Filtro por frecuencia:** El último nivel de procesamiento corresponde a eliminar *tokens* con baja frecuencia. Esta etapa viene motivada del hecho de que un modelo difícilmente aprenderá algún patrón de un evento que tiene muy pocas realizaciones, menos si tiene una realización única. Esta etapa se aplica a nivel época, eliminando aquellos tokens que aparecen en menos del 0.1 % de los documentos de su respectiva época.

## 3.2. Modelos de tópicos

Se escoge HDP como modelo de tópicos base de la metodología. Si bien, HDP es un modelo similar en estructura a LDA, cuenta con la ventaja de que el número de tópicos no está acotado y es inferido a partir de los datos, en cambio LDA requiere de escoger el número de tópicos  $K$  por adelantado.

En un enfoque tradicional, se requiere de entrenar múltiples veces LDA para diferentes valores de  $K$  y se escoge la configuración con mejor desempeño en un conjunto de validación, por lo que LDA termina siendo computacionalmente más costoso que HDP, además este enfoque se vuelve impracticable cuando el conjunto de datos es lo suficientemente grande.

En el aspecto cualitativo ambos modelos entregan tópicos igual de consistentes. En cuanto a métricas de desempeño como *perplexity* HDP suele tener mejor desempeño (Teh et al., 2005).

Para el descubrimiento de tópicos se utilizó la implementación disponible en C++ (Wang and Blei, 2010) de HDP para modelamiento de tópicos. Esta implementación está basada en el algoritmo de Gibbs Sampling propuesto en (Teh et al., 2005).

### 3.2.1. Configuración de hiperparámetros

HDP tiene tres hiperparámetros, el parámetro de concentración a nivel corpus  $\gamma$ , el parámetro de concentración a nivel documento  $\alpha_0$  y  $\eta$  el parámetro de la medida base Dirichlet.

En modelamiento de tópicos se prefiere usar  $\eta \in (0, 1)$ , esto generará distribuciones *sparse* sobre el vocabulario. Así, se suelen tener tópicos más distinguibles, donde el *core* de palabras del tópico concentra la masa de la distribución. Además, como la semántica del tópico está compactada en pocas palabras se facilita la interpretación. En este caso se utilizó un punto intermedio, fijando  $\eta = 0.5$ .

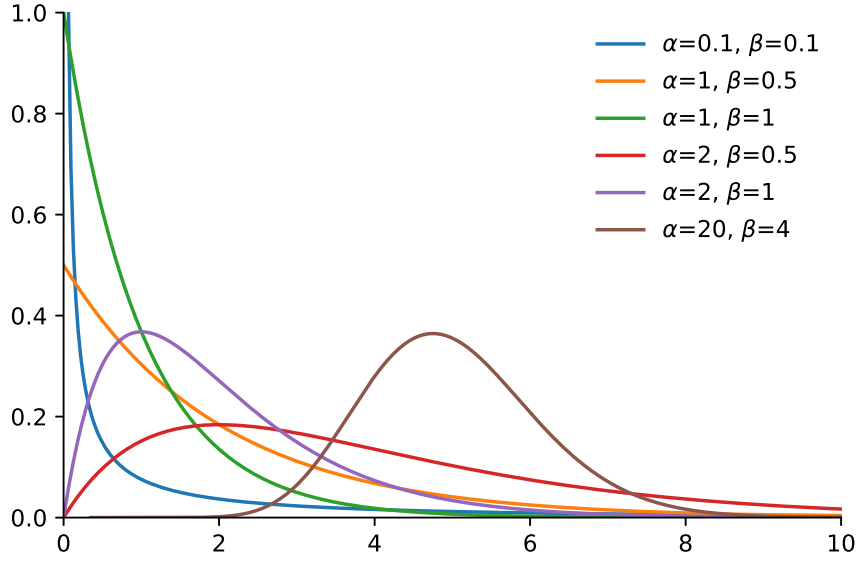


Figura 3.1: Función de densidad de probabilidad (pdf) de una distribución Gamma para diferentes parámetros de forma  $\alpha$  y tasa  $\beta$ .

En (Teh et al., 2005) los parámetros de concentración se integran afuera usando un prior *vague gamma* (Escobar and West, 1995). Un prior *vague gamma* es una distribución Gamma con una gran parte de la masa en torno a cero y una cola pesada (ver Figura 3.1 para una ilustración de la pdf para diferentes parámetros). Por consecuencia, el prior tendrá un menor efecto de regularización y a medida que más datos se obtienen la posterior coincidirá con las observaciones empíricas. En este caso se utilizó un prior  $\Gamma(\alpha = 1, \beta = 1)$ .

### 3.2.2. Interpretación de tópicos

Los modelos de tópicos probabilísticos se caracterizan por tener un alto poder interpretativo, esto se debe a que la distribución de probabilidad de cada tópico sobre el vocabulario nos da una idea del tema al que pertenece, por otro lado, la mezcla de tópicos de cada documento nos muestra que tan importante es cada tópico en la generación de estos, como también dentro del corpus.

En este sentido, las visualizaciones nos pueden ayudar a interpretar mejor los resultados de los modelos de tópicos. Para la interpretación de los tópicos la metodología propuesta se basa en la herramienta de visualización desarrollada en (Sievert and Shirley, 2014), la cual responde las siguientes preguntas, ¿Cuál es el significado de cada tópico? ¿Cuán predominante es cada tópico? ¿Cómo se relacionan los tópicos entre sí?

Para responder la pregunta 1 se incorpora un gráfico de barras que muestra las palabras más relevantes del tópico seleccionado dado un parámetro  $\lambda \in [0, 1]$ . A través de una visualización espacial responde la pregunta 2 y 3. La visualización espacial consiste en aplicar técnicas de reducción de dimensionalidad como TSNE (Maaten and Hinton, 2008) o PCA (Wold et al., 1987) (en este caso se utilizó TSNE) a la matriz de distancia entre tópicos, usando Jensen-



Shannon divergence (Endres and Schindelin, 2003) como medida de distancia. Una vez cada t3pico es mapeado a un punto en un espacio de dos dimensiones se dibuja un c3rculo con centro en este punto y con radio proporcional a la cantidad de tokens generados por el t3pico.

Para interpretar un t3pico, lo usual es examinar una lista ordenada de las palabras m3s probables del t3pico, usando ya sea desde cinco a treinta t3rminos. Un problema frecuente que se presenta en este caso es que los t3rminos que son comunes al corpus frecuentemente aparecen en el top de las palabras m3s probables de un t3pico, haciendo dif3cil discernir el significado de estos. Para esto en (Sievert and Shirley, 2014) se define una m3trica denominada *relevance*, la cual define la relevancia de una palabra no solo por su probabilidad dentro del t3pico sino tambi3n por su exclusividad dentro del corpus. La *relevance* de una palabra  $w$  en el t3pico  $k$  dado  $\lambda$  est3 dada a trav3s de la siguiente expresi3n:

$$r(w, k|\lambda) = \lambda \log(\phi_{kw}) + (1 - \lambda) \lambda \log\left(\frac{\phi_{kw}}{p_w}\right) \quad (3.1)$$

, donde  $\lambda$  determina el peso que se le da a la probabilidad de la palabra  $w$  dentro del t3pico  $k$  ( $\phi_{kw}$ ) relativo a su *lift*, el cual se define por el ratio entre la probabilidad de la palabra dentro del t3pico y su probabilidad marginal a lo largo del corpus ( $p_w$ ). Fijando  $\lambda = 1$  se obtiene el ranking de t3rminos decrecientes en orden de su probabilidad dentro del t3pico, y fijando  $\lambda = 0$  el ranking se basa solo en el *lift*.

### 3.3. Construcci3n del grafo temporal

Nuestro objetivo no es solo descubrir t3picos sino tambi3n modelar sus interacciones en el tiempo, como nacimiento, muerte, evoluci3n, divisi3n y fusi3n. As3, la metodolog3a propuesta se basa en la metodolog3a descrita en la secci3n 2.3.1 propuesta en (Beykikhoshk et al., 2018), debido que esta captura los dinamismos mencionados.

En general las medidas de similitud o distancia comparan vectores con el mismo dominio y dimensi3n, esto significa que los t3picos de 3pocas adyacentes deben compartir el mismo vocabulario. Matem3ticamente, sea  $\phi_{t,i}$  un t3pico de la 3poca  $t$  y  $V_t$  su vocabulario, sea  $\phi_{t+1,j}$  un t3pico de la 3poca  $t + 1$  y  $V_{t+1}$  su vocabulario. Con una alta probabilidad existan palabras en  $V_t$  que no est3n en  $V_{t+1}$  y viceversa. Para poder comparar t3picos en 3pocas adyacentes se debe construir un vocabulario global  $V'_{t+1} = V_t \cup V_{t+1}$ , luego aplicar *padding* a los vectores  $\phi_{t,i}$  y  $\phi_{t+1,j}$ , es decir, rellenar con ceros las posiciones que no est3n en el vocabulario de su dominio.

Una gran desventaja del enfoque anterior es que no captura similitud entre palabras, puesto que cada palabra ocupa una posici3n dentro del vector y no hay forma de comparar palabras que no son com3nes en ambas 3pocas. El peor caso ser3a considerar los vocabularios  $V_t$  y  $V_{t+1}$ , con  $V_t \cap V_{t+1} = \emptyset$ , a pesar de que cada palabra en  $V_t$  tiene un sin3nimo en  $V_{t+1}$  la similitud entre t3picos entre las 3pocas  $t$  y  $t + 1$  ser3a cero.

### 3.3.1. Word Mover's Distance

Para lidiar con el problema anterior, se propone utilizar una medida de distancia conocida como Word Mover's Distance (WMD) (Kusner et al., 2015), medida utilizada para comparar dos documentos bajo una representación *bag of words* a través de sus *word embeddings* (Mikolov et al., 2013).

WMD calcula el costo mínimo de transformar un documento en otro, en este caso particular sería el costo mínimo de llevar un tópico a otro. Para esto se resuelve el problema de transporte, donde los flujos son los pesos  $\phi_{t,i}$  y  $\phi_{t+1,j}$  y la matriz de costos es una matriz de distancia euclidiana entre los *word embeddings* de todas las palabras de  $V_t$  con  $V_{t+1}$ . En la Figura 3.2 se ilustra el espacio en el que viven las palabras de dos documentos.

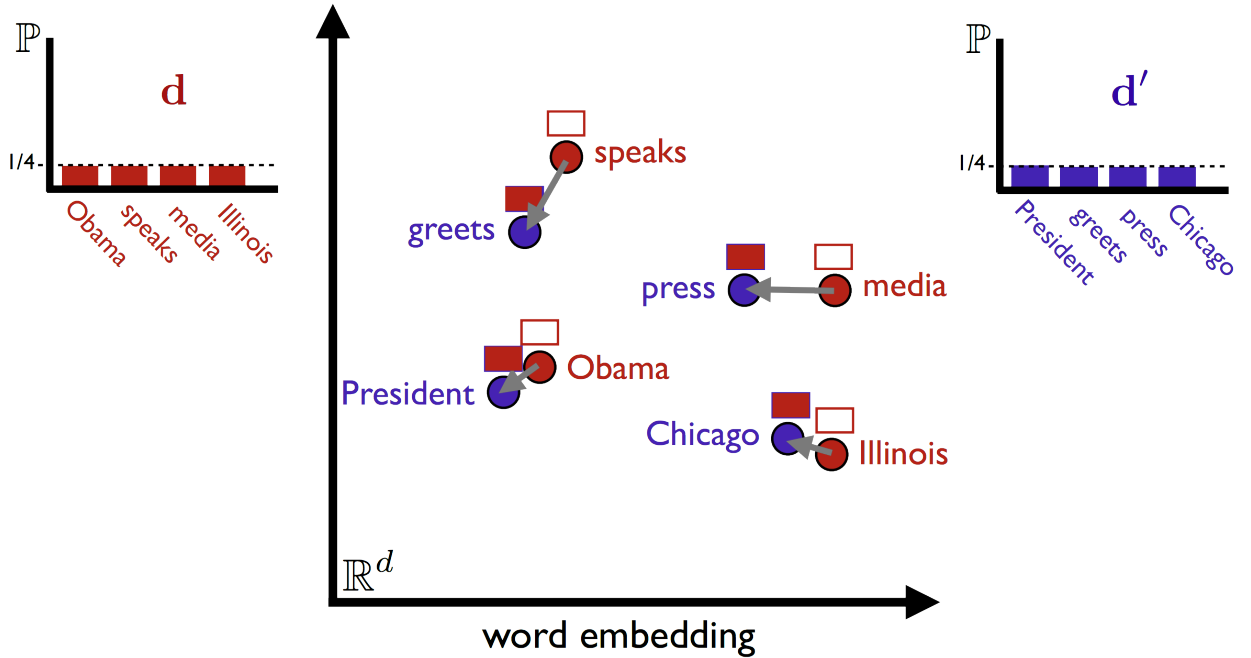


Figura 3.2: Espacio vectorial de los *word embeddings* de las palabras de dos documentos con un vocabulario de tamaño 4. Fuente: Figura de (Niculae, 2015).

Sea  $V_i$  y  $V_j$  los vocabularios del tópico  $i$  y  $j$  respectivamente, luego su WMD viene dado por  $WMD(\phi_i, \phi_j)$ :

$$\min_x \sum_{u \in V_i} \sum_{v \in V_j} c_{u,v} x_{u,v} \quad (3.2)$$

$$\text{s.t.} \sum_{v \in V_j} x_{u,v} = \phi_{i,u}, \quad u \in V_i \quad (3.3)$$

$$\sum_{u \in V_i} x_{u,v} = \phi_{j,v}, \quad v \in V_j \quad (3.4)$$

$$x_{u,v} \geq 0, \quad u \in V_i, v \in V_j \quad (3.5)$$

Donde  $x_{u,v}$  es el flujo que va de la palabra  $u$  del t3pico  $i$  a la palabra  $v$  del t3pico  $j$ ,  $\phi_{i,u}$  es la probabilidad de la palabra  $u$  en el t3pico  $i$ ,  $c_{u,v}$  es el costo de mover una unidad de flujo por el arco  $(u, v)$ , el costo entre palabras se mide como la distancia euclidiana entre los *word embedding* de dichas palabras.

La primera restricci3n indica que el flujo que se mueve de una palabra  $u$  del t3pico  $i$  a todas las palabras del t3pico  $j$  debe sumar su peso ( $\phi_{i,u}$ ), la segunda restricci3n significa que el flujo que se mueve de una palabra  $v$  del t3pico  $j$  a todas las palabras del t3pico  $i$  debe sumar su peso ( $\phi_{j,v}$ ). Lo anterior implica que esta medida de distancia es sim3trica, es decir,  $WMD(\phi_i, \phi_j) = WMD(\phi_j, \phi_i)$ .

WMD se puede f3cilmente transformar en una m3dida de similitud,  $\rho(\phi_i, \phi_j) = \frac{1}{1+WMD(\phi_i, \phi_j)}$ , notar que si la WMD es 0 la similitud es 1 y si es  $\infty$  la similitud es 0.

### 3.3.2. WMD complejidad

WMD es una medida de distancia intensiva en recursos computacionales. Para entender mejor esto utilizaremos la representaci3n poliedral del problema, sea  $N$  el tama3o del vocabulario entre dos 3pocas adyacentes, luego la regi3n factible del problema anterior se puede representar como  $\{x | Ax = b, x \geq 0\}$  sobre un grafo bipartito, con  $A \in \mathbb{R}^{2N \times N^2}$  la matriz de incidencia,  $b \in \mathbb{R}^{2N}$  la capacidad de los nodos y  $x \in \mathbb{R}^{N^2}$  el flujo a enviar por cada uno de los arcos. Para resolver este problema se utiliz3 (Doran, 2014), la cual est3 basada en el algoritmo (Pele and Werman, 2009), cuya complejidad del mejor tiempo promedio escala  $\mathcal{O}(N^2 \log N)$ .

Los t3picos siguen una distribuci3n con forma de ley de potencia sobre el vocabulario, donde una peque3a fracci3n de las palabras concentran la mayor parte de la masa de la distribuci3n. Adem3s, en la pr3ctica la interpretaci3n de los t3picos se basa en los top  $N$  palabras m3s probables con  $N \in [5, 30]$ , entonces, podemos aprovechar esta estructura para efectos de computar la WMD de un forma m3s eficiente, por ejemplo, utilizando solo las palabras que capturan un  $X\%$  de la distribuci3n acumulada del t3pico. De hecho si se reduce el vocabulario a un d3cimo esto traera en el peor caso promedio un *speed up* de 200.

### 3.3.3. Word Embeddings

Computar WMD requiere contar con *word embeddings*. Para estó se utilizó una de las más grandes colecciones de *word embeddings* en español (Cañete, 2019a), que cuenta con 1.313.423 *embeddings*, colección obtenida utilizando el algoritmo FasText (Bojanowski et al., 2017) sobre el corpus Spanish Unannotated Corpora (SUC) (Cañete, 2019b), uno de los más grandes corpus de texto en español. FasText en comparación a otros enfoques para extraer *embeddings* representa los *tokens* a través de n-gramas de caracteres, de esta manera se pueden obtener *embeddings* de *tokens* no vistos durante el entrenamiento a partir de los *embeddings* de los caracteres que lo componen.

### 3.3.4. Métricas

En la metodología propuesta podemos considerar dos fuentes de evaluación de desempeño, el descubrimiento de tópicos y cómo se relacionan. En ambos casos no se cuenta con el *ground truth* para medir correctamente el desempeño. Si conociéramos el *ground truth*, podríamos utilizar *purity* (Manning et al., 2008) para comparar la asignación de los documentos en torno a los tópicos con la etiqueta. En el caso del grafo temporal, si conociéramos las conexiones presentes y ausentes podríamos utilizar métricas de clasificación.

En (Blei et al., 2003; Griffiths and Steyvers, 2004; Cao et al., 2009; Arun et al., 2010; Deveaud et al., 2014; Zhang et al., 2017) se describen algunas métricas que no requieren de una etiqueta, que pueden ser útil para realizar selección de modelo de tópico. Cabe destacar que estas métricas carecen de significado y sirven para comparar si un modelo de tópicos es superior a otro.

El trabajo propuesto no tiene por objetivo calibrar los hiperparámetros del HDP y se utilizó la configuración especificada en la sección 3.2.1. Por el contrario, se enfoca en medir el desempeño de las interacciones entre los tópicos descubiertos, asumiendo que los tópicos descubiertos están correctos. El desempeño es medido mediante métricas de clasificación sobre un grafo etiquetado. Esto es posible debido a que el fenómeno de robo de vehículos no presenta muchos tópicos a diferencia de los tópicos latentes que podríamos encontrar en Wikipedia.

La métrica escogida en este caso es el *macro average recall* (Forman, 2003), esta corresponde al promedio simple entre la tasa de aciertos de la clase presencia y ausencia de conexión. En general, debería haber más ausencia que presencia de conexión, así bajo esta métrica la clase presencia de conexión no será menospreciada, ya que el macro recall considera que el tasa de actividad de ambas clases son igual de importantes.

Adicionalmente, al contar con un grafo etiquetado podemos observar el efecto de los hiperparámetros  $\zeta$  y  $q$  en la métrica de desempeño escogida. El hiperparámetro  $\zeta \in [0, 1]$  define el umbral de corte, representa el punto operante de la cdf del grafo *fully connected*, permite definir el cuantil que se usará como umbral para eliminar arcos con similitud menor a este. El parámetro  $q \in [0, 1]$  define el soporte de los tópicos, utilizando aquellas palabras más probables que explican 100q % de la distribución acumulada del tópico.

### 3.4. Resumen metodología

En la Figura 3.3 se presenta un esquema que resume de la metodología propuesta para el descubrimiento y seguimiento de tópicos en el tiempo. El primer proceso de la metodología corresponde al procesamiento, el cual toma el corpus original y lo divide en épocas, luego a nivel época se aplican cinco niveles de procesamiento de forma secuencial: tokenización, procesamiento de caracteres, eliminación de *stopwords*, filtro por vocabulario y filtro por frecuencia. Como producto del proceso anterior se obtiene un corpus listo para la aplicación de algún modelo de tópicos, en este caso corresponde al modelo HDP, el cual se aplica de forma independiente sobre cada una de las épocas. Por último, una vez descubiertos los tópicos se procede a construir el grafo temporal, para esto es necesario computar la WMD entre los tópicos de épocas adyacentes, luego se podan los arcos cuya similitud es menor al cuantil  $\zeta$  de la distribución acumulada del grafo *fully connected*.

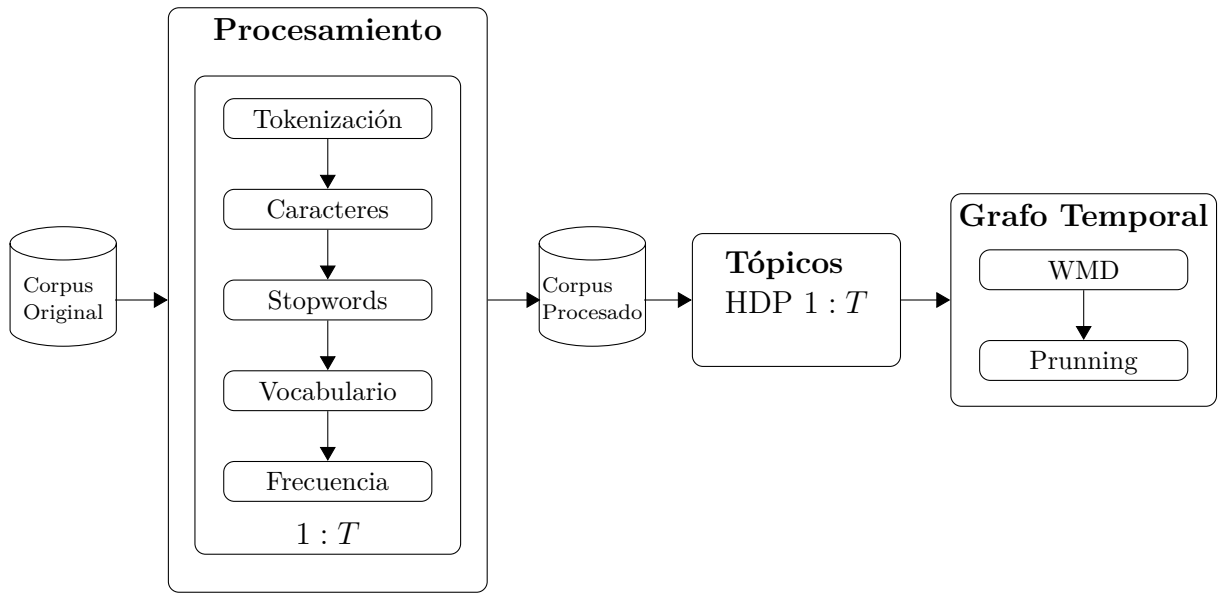


Figura 3.3: Esquema de la metodología de descubrimiento y evolución de tópicos.

# Capítulo 4

## Caso de estudio

Motivación

Describir organización del contenido

Diseño del experimento

### 4.1. Datos

Para este experimento se cuenta con relatos de víctimas del robo de vehículos provistos por la Asociación de Aseguradores de Chile (AACH). Esta base de datos consta con 49015 relatos entre los años 2011 y 2016. En la Figura .. se muestra la cantidad de relatos por año.

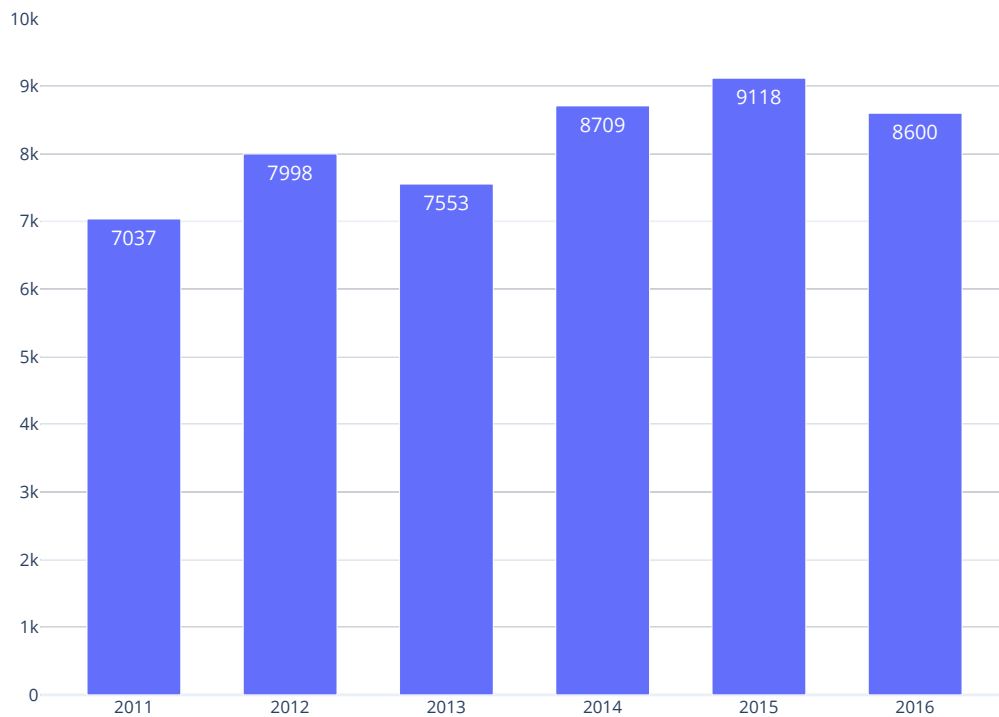


Figura 4.1: Cantidad de robos registrados por año en base de datos AACH.

Descripción del dataset: mejorar estilo y añadir ejemplos

En la figura ... se detallan algunos ejemplos de relatos  
Características ... falta de estandarización ....  
-> Procesamiento

## 4.2. Procesamiento

En esta sección se detallan los resultados de aplicar el procesamiento descrito en la sección 3.1. Con fines gráficos los resultados del procesamiento se describen en un orden distinto al descrito en dicha sección, con el objetivo de mostrar en como estas afectan el tamaño del vocabulario. El orden es el siguiente, (i) tokenización, (ii) procesamiento de caracteres, (iii) eliminación de palabras poco frecuentes, (iv) filtro por vocabulario y (v) eliminación de *stopwords*.

En la Figura 5.2 se muestran la distribución acumulada del corpus original tras solo aplicar tokenización. En este caso los *tokens* totales corresponden a 2030980 asociado a un vocabulario de 93203 palabras.

La Figura ?? muestra los resultados al aplicar la etapa de procesamiento de caracteres, de esta se observa que se reduce el tamaño del vocabulario en cerca de la mitad, específicamente a 42921 palabras, similarmente con la cantidad de tokens, que ahora son 1028412.

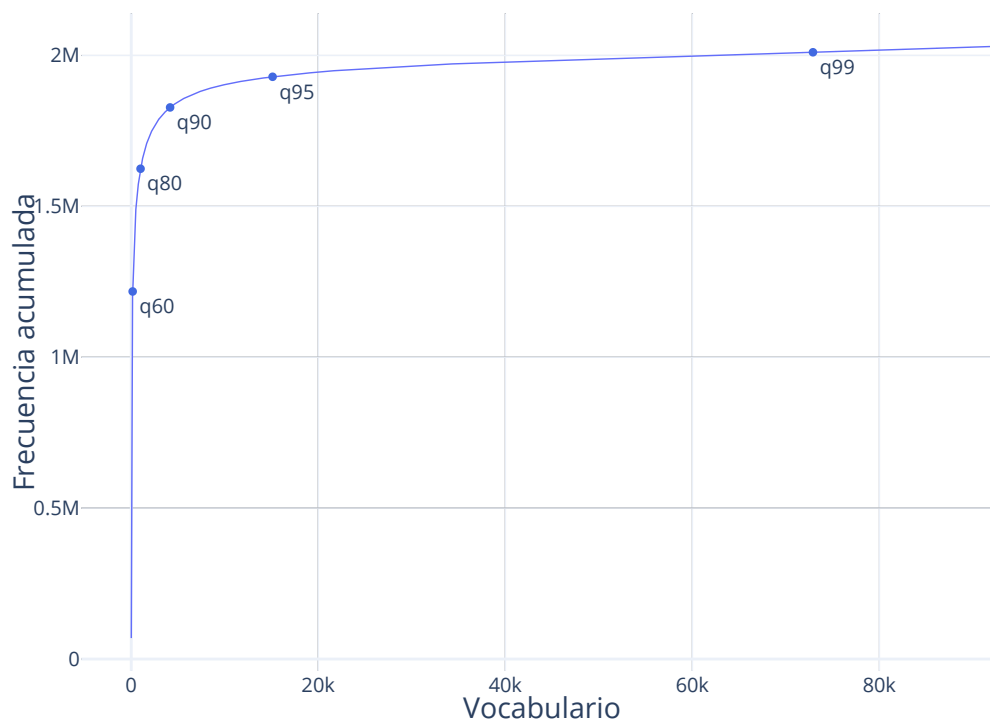


Figura 4.2: Frecuencia acumulada del vocabulario en orden decreciente de ocurrencia aplicando hasta el primer nivel de procesamiento.

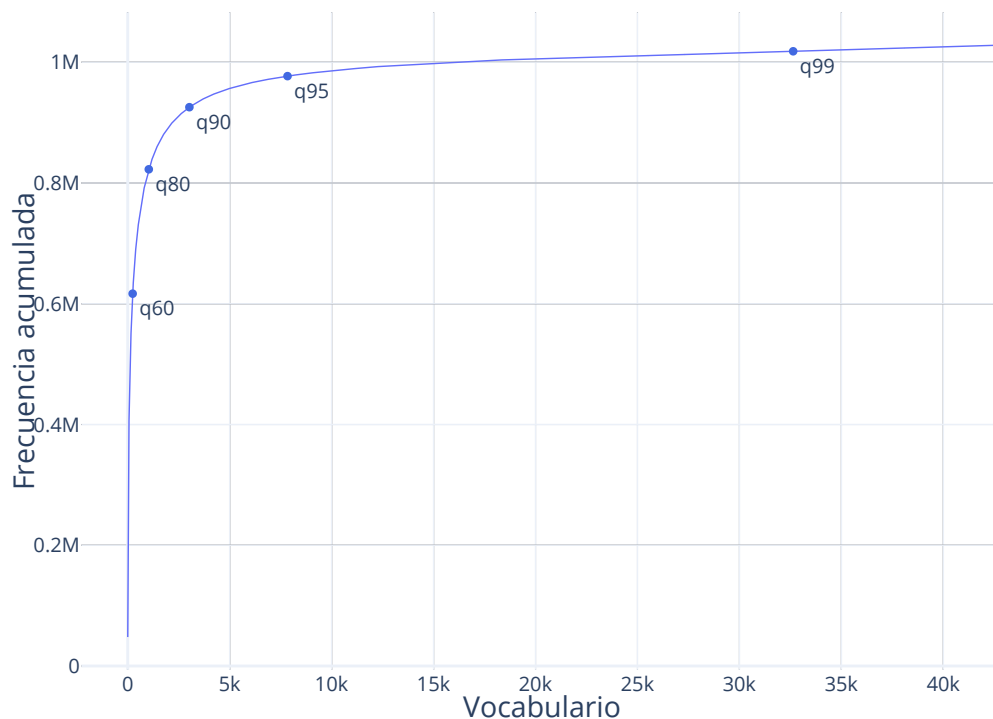


Figura 4.3: Frecuencia acumulada del vocabulario en orden decreciente de ocurrencia aplicando hasta el segundo nivel de procesamiento.

Hasta este nivel de procesamiento se tiene que al menos el 50 % de las palabras ocurren una única vez y al menos un 80 % tiene una frecuencia igual o menor a 4. El 95 % de la distribución acumulada puede ser explicada con 7837 palabras (un 18 % del vocabulario actual). En conclusión, la distribución de las palabras tiene una cola bastante pesada.

En la Figura 5.4 se muestra la nueva distribución tras eliminar las palabras que aparecen en menos del 0.1 % de los documentos de su época. En este nivel de procesamiento se redujo bastante el tamaño del vocabulario a 3148 (al rededor de 14 veces) sin alterar tan significativamente la cantidad de tokens (alrededor de un 10 %), siendo ahora 925693 tokens.

Luego se filtran palabras usando el vocabulario extraído del SUC. En la Figura 5.5 se observa que el vocabulario se redujo a 2902 y el corpus a 901745 tokens. En este caso la variación no fue tan significativa, alrededor de un 8 % en el tamaño del vocabulario y de un 3 % en el caso del corpus.

Finalmente, se eliminan las *stopwords*, de la Figura 5.6 se puede observar que esto significó una reducción significativa de tanto el vocabulario como en el tamaño del corpus, respectivamente en 32 % (1960 palabras) y 45 % (495182 *tokens*). La reducción abrupta en la cantidad de *tokens* se debe principalmente a que las *stopwords* son parte de las palabras más frecuentes dentro del corpus.



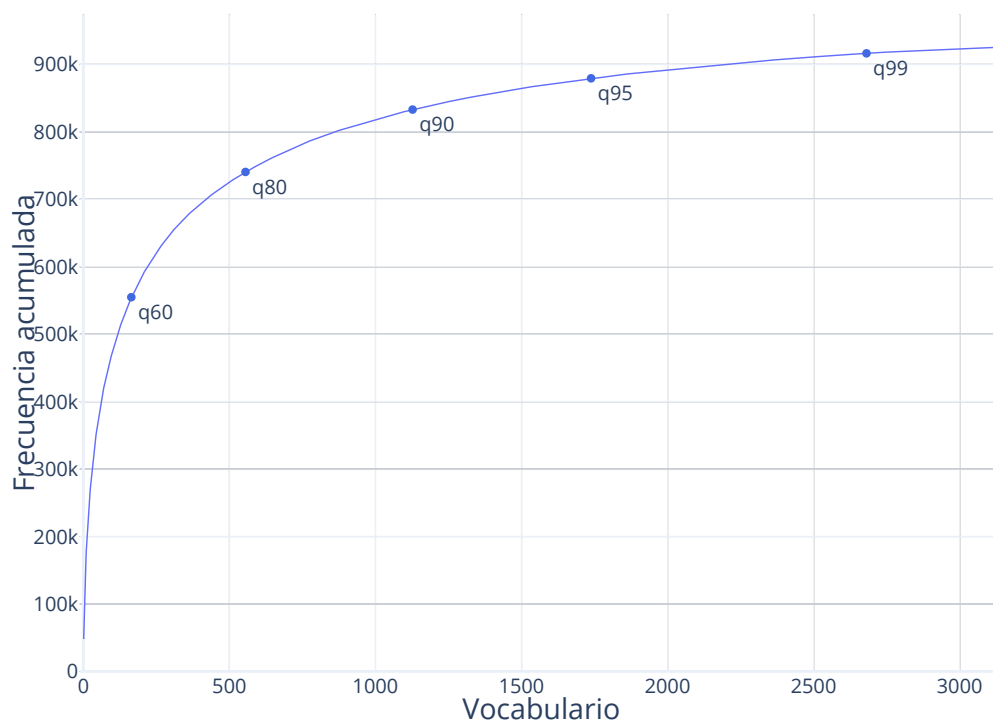


Figura 4.4: Frecuencia acumulada del vocabulario en orden decreciente de ocurrencia aplicando hasta el tercer nivel de procesamiento.

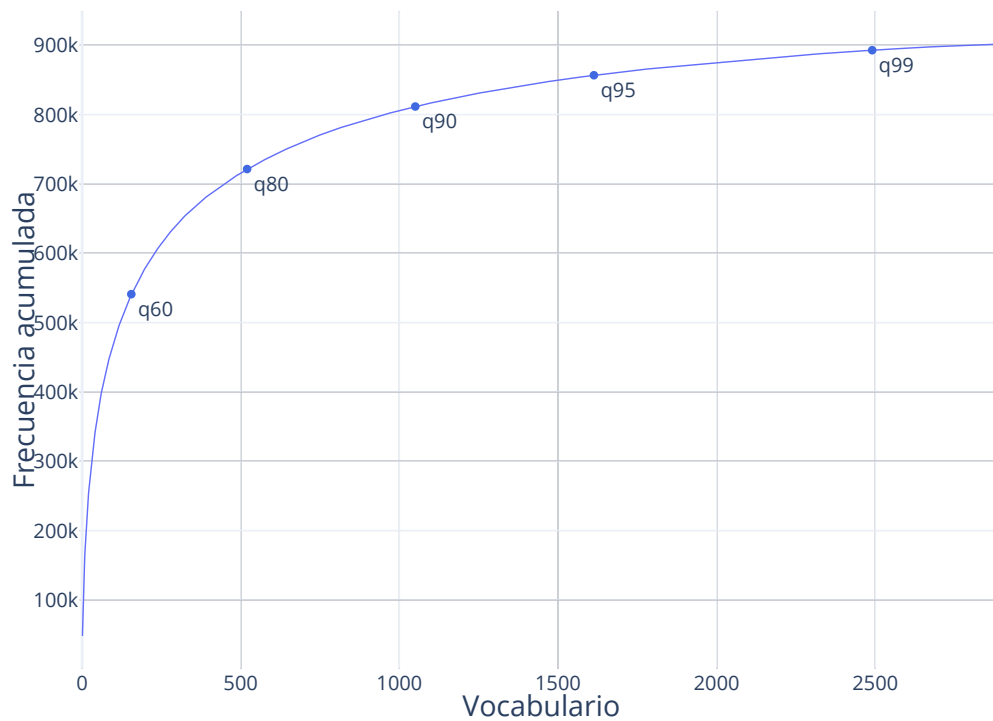


Figura 4.5: Frecuencia acumulada del vocabulario en orden decreciente de ocurrencia aplicando hasta el cuarto nivel de procesamiento.

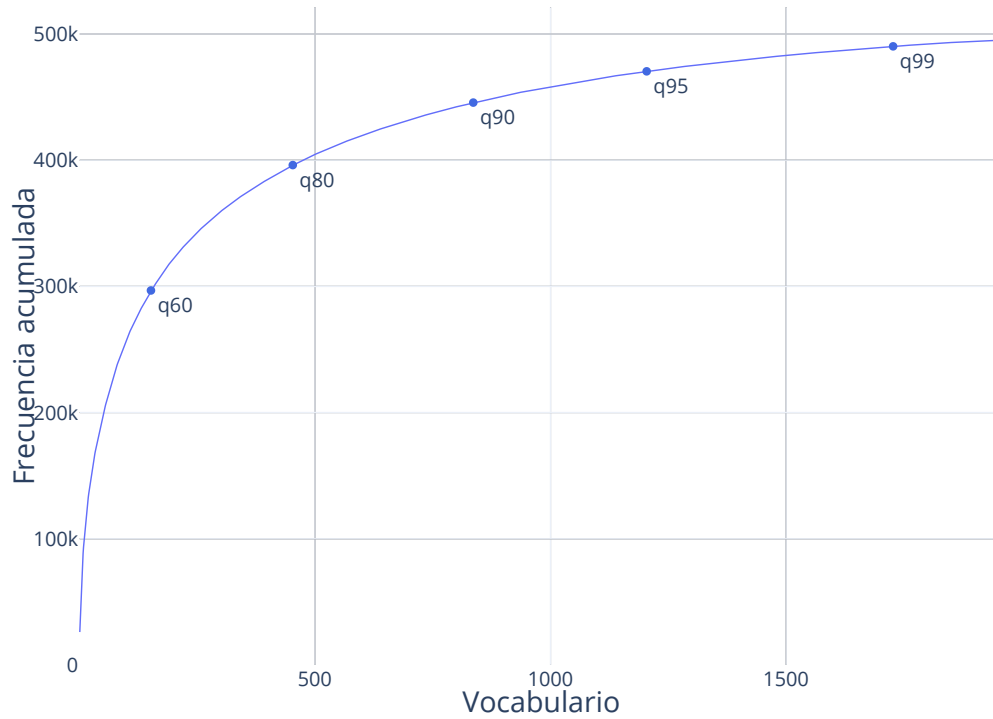


Figura 4.6: Frecuencia acumulada del vocabulario en orden decreciente de ocurrencia aplicando hasta el quinto nivel de procesamiento.

En la tabla 5.1 se muestra un cuadro resumen con estadísticas del corpus bajo distintos niveles de procesamiento. De aquí se extrae que el tamaño del vocabulario, el corpus y la cantidad de tokens se redujo en alrededor de un 98 %, un 1 % y un 76 % respectivamente.

procesamiento	documentos	vocabulario	tokens
t	49015	93203	2030980
t+ch	49003	42921	1028412
t+ch+f	48988	3148	925693
t+ch+f+v	48988	2902	901745
t+ch+f+v+s	48566	1960	495182

Tabla 4.1: Estadísticas del corpus bajo distintos niveles de procesamiento, **t**: tokenización, **ch**: procesamiento de caracteres, **f**: filtro por frecuencia, **v**: filtro por vocabulario, **s**: eliminación de *stopwords*.

En la tabla 5.2 se muestra el detalle del vocabulario para cada una de las épocas tras procesar el corpus, de aquí se extrae que en promedio un 12.83 % del vocabulario se olvida de una época a otra y un 18.92 % es nuevo, es otras palabras, en promedio alrededor de un 32 % del vocabulario no es común entre tópicos de épocas adyacentes. Esto justifica la necesidad por utilizar medidas de similitud robustas a cambios en el vocabulario, permitiendo así una comparación más justa entre tópicos que no tienen un vocabulario común.

época	<b>t-1</b>	<b>t</b>	<b>t-1 [%]</b>	<b>t [%]</b>
2	1145	1187	14.41	18.08
3	1187	1281	13.56	21.48
4	1281	1329	13.35	17.10
5	1329	1405	12.57	18.28
6	1405	1537	10.25	19.64

Tabla 4.2: Evolución del vocabulario en el tiempo, **t-1**: corresponde al vocabulario del período anterior a la época respectivamente, **t-1**: corresponde al vocabulario de la época actual, **t-1 [%]** : porcentaje de palabras del período  $t - 1$  que ya no están en el período  $t$  y **t [%]**: porcentaje de palabras del período  $t$  que no están en el período  $t - 1$ .

### 4.3. Análisis cuantitativo de resultados

Rehacer

### 4.4. Análisis cualitativo de resultados

Análisis cualitativo de tópicos

# Capítulo 5

## Conclusiones y trabajo futuro

Motivación

Describir organización del contenido

Diseño del experimento

### 5.1. Datos

Para este experimento se cuenta con relatos de víctimas del robo de vehículos provistos por la Asociación de Aseguradores de Chile (AACH). Esta base de datos consta con 49015 relatos entre los años 2011 y 2016. En la Figura .. se muestra la cantidad de relatos por año.

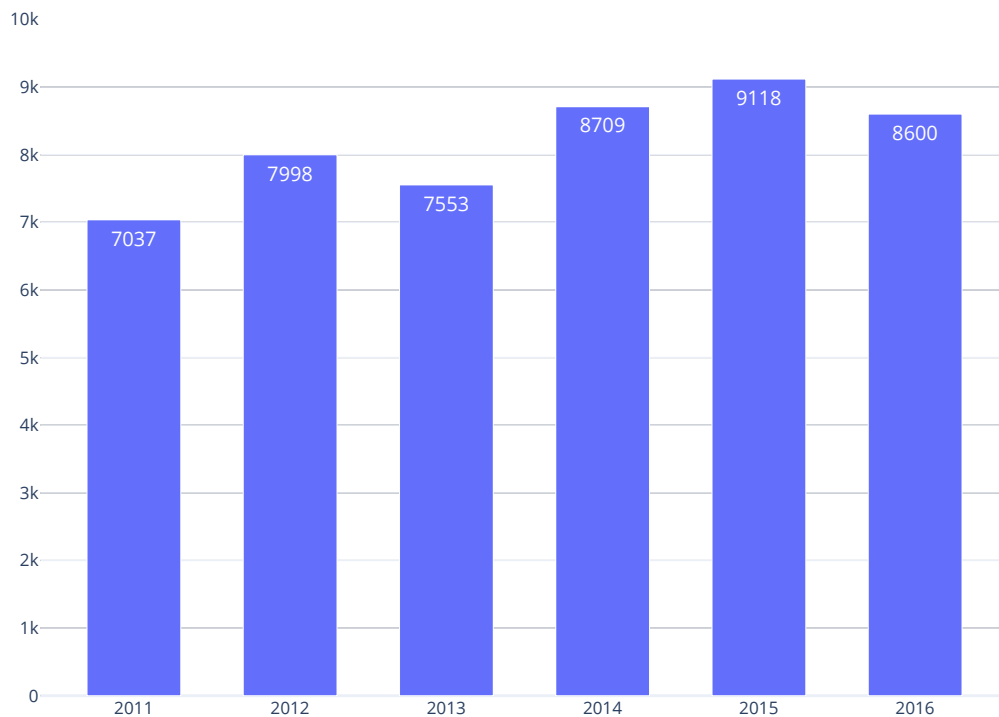


Figura 5.1: Cantidad de robos registrados por año en base de datos AACH.

Descripción del dataset: mejorar estilo y añadir ejemplos

En la figura ... se detallan algunos ejemplos de relatos  
Características ... falta de estandarización ....  
-> Procesamiento

## 5.2. Procesamiento

En esta sección se detallan los resultados de aplicar el procesamiento descrito en la sección 3.1. Con fines gráficos los resultados del procesamiento se describen en un orden distinto al descrito en dicha sección, con el objetivo de mostrar en como estas afectan el tamaño del vocabulario. El orden es el siguiente, (i) tokenización, (ii) procesamiento de caracteres, (iii) eliminación de palabras poco frecuentes, (iv) filtro por vocabulario y (v) eliminación de *stopwords*.

En la Figura 5.2 se muestran la distribución acumulada del corpus original tras solo aplicar tokenización. En este caso los *tokens* totales corresponden a 2030980 asociado a un vocabulario de 93203 palabras.

La Figura ?? muestra los resultados al aplicar la etapa de procesamiento de caracteres, de esta se observa que se reduce el tamaño del vocabulario en cerca de la mitad, específicamente a 42921 palabras, similarmente con la cantidad de tokens, que ahora son 1028412.

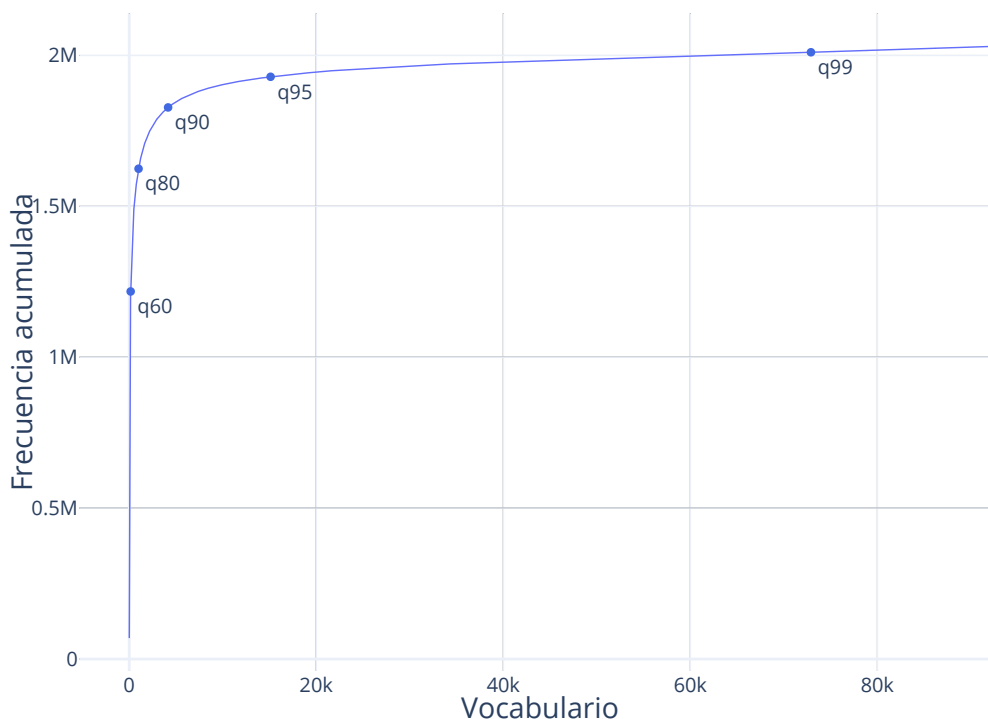


Figura 5.2: Frecuencia acumulada del vocabulario en orden decreciente de ocurrencia aplicando hasta el primer nivel de procesamiento.

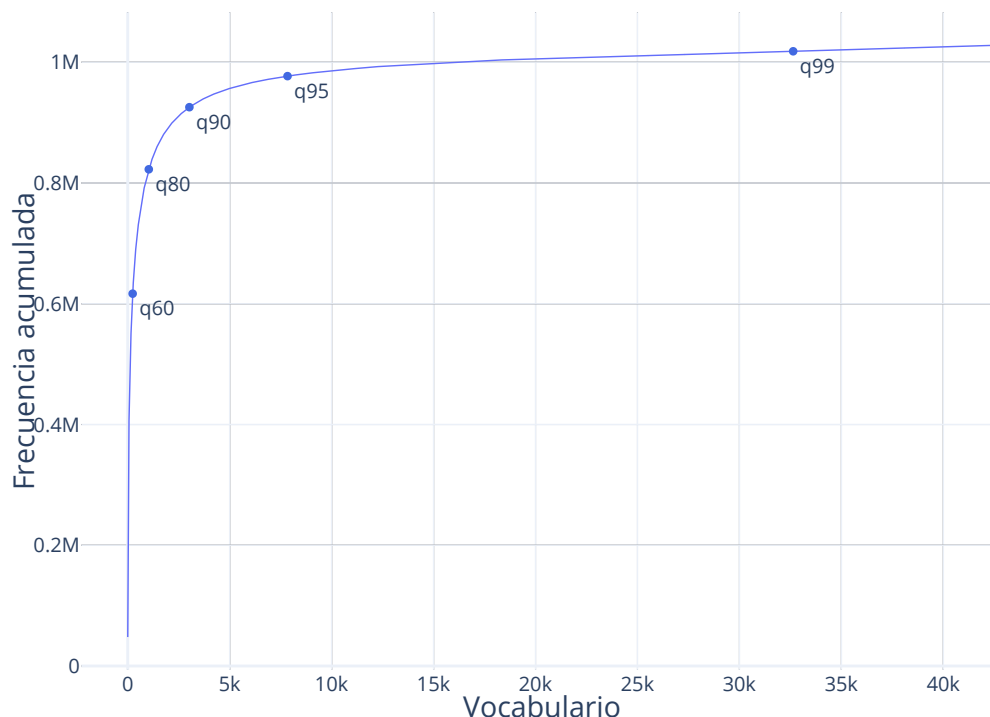


Figura 5.3: Frecuencia acumulada del vocabulario en orden decreciente de ocurrencia aplicando hasta el segundo nivel de procesamiento.

Hasta este nivel de procesamiento se tiene que al menos el 50 % de las palabras ocurren una única vez y al menos un 80 % tiene una frecuencia igual o menor a 4. El 95 % de la distribución acumulada puede ser explicada con 7837 palabras (un 18 % del vocabulario actual). En conclusión, la distribución de las palabras tiene una cola bastante pesada.

En la Figura 5.4 se muestra la nueva distribución tras eliminar las palabras que aparecen en menos del 0.1 % de los documentos de su época. En este nivel de procesamiento se redujo bastante el tamaño del vocabulario a 3148 (al rededor de 14 veces) sin alterar tan significativamente la cantidad de tokens (alrededor de un 10 %), siendo ahora 925693 tokens.

Luego se filtran palabras usando el vocabulario extraído del SUC. En la Figura 5.5 se observa que el vocabulario se redujo a 2902 y el corpus a 901745 tokens. En este caso la variación no fue tan significativa, alrededor de un 8 % en el tamaño del vocabulario y de un 3 % en el caso del corpus.

Finalmente, se eliminan las *stopwords*, de la Figura 5.6 se puede observar que esto significó una reducción significativa de tanto el vocabulario como en el tamaño del corpus, respectivamente en 32 % (1960 palabras) y 45 % (495182 *tokens*). La reducción abrupta en la cantidad de *tokens* se debe principalmente a que las *stopwords* son parte de las palabras más frecuentes dentro del corpus.

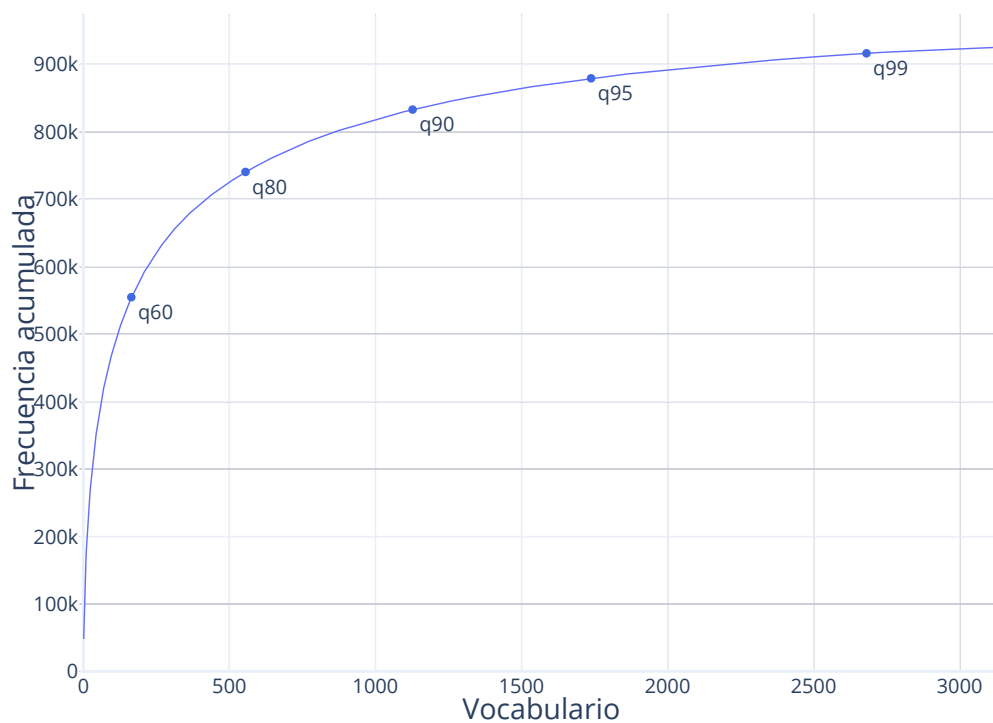


Figura 5.4: Frecuencia acumulada del vocabulario en orden decreciente de ocurrencia aplicando hasta el tercer nivel de procesamiento.

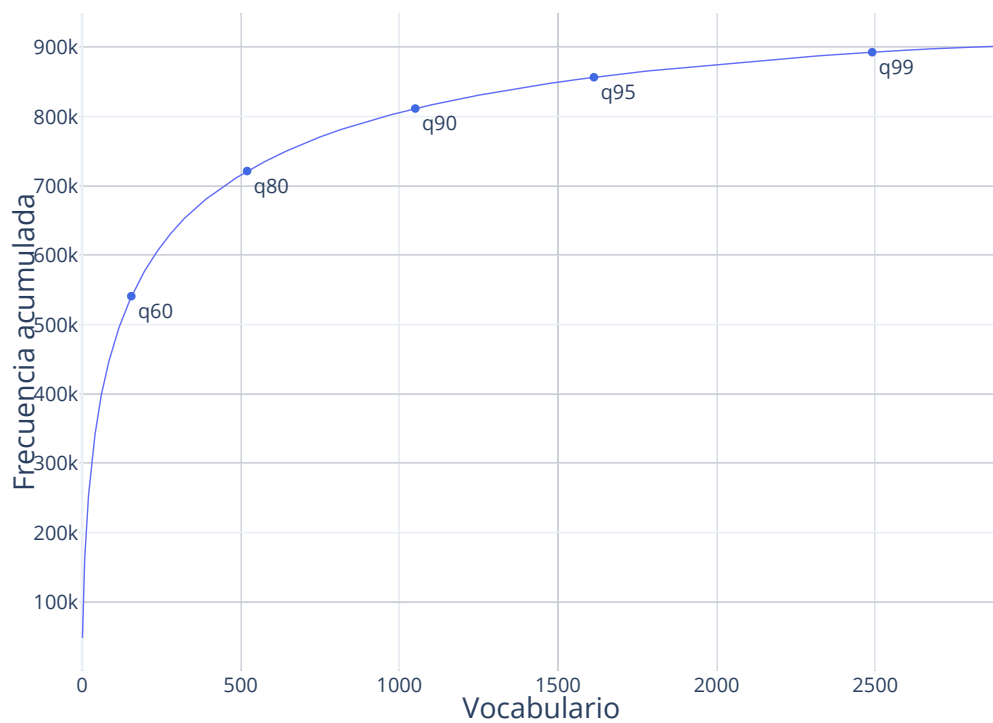


Figura 5.5: Frecuencia acumulada del vocabulario en orden decreciente de ocurrencia aplicando hasta el cuarto nivel de procesamiento.

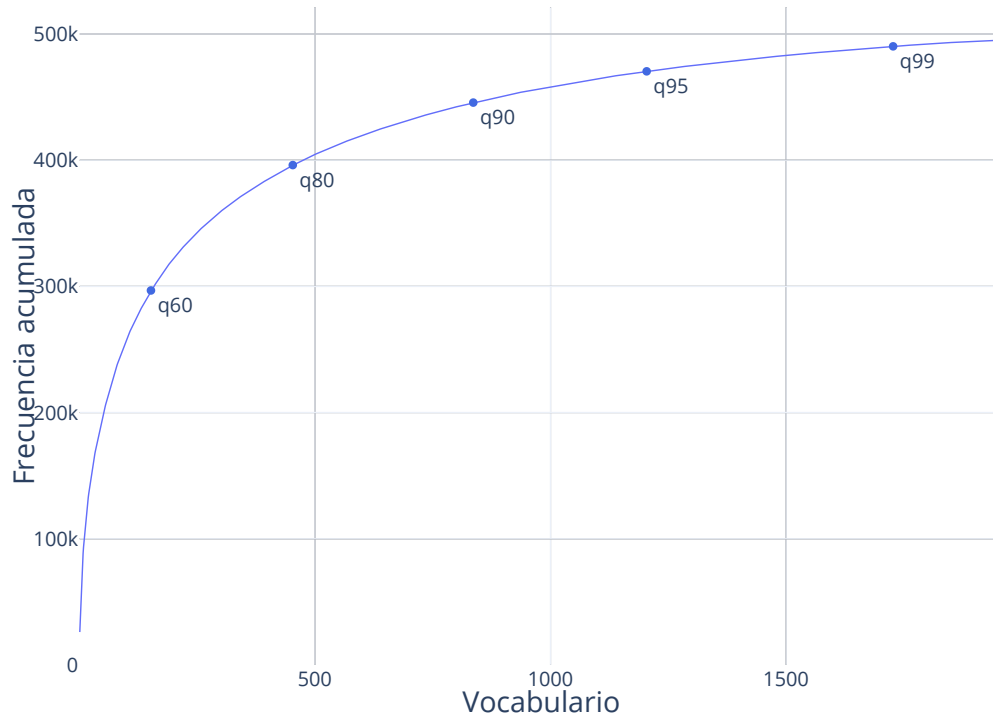


Figura 5.6: Frecuencia acumulada del vocabulario en orden decreciente de ocurrencia aplicando hasta el quinto nivel de procesamiento.

En la tabla 5.1 se muestra un cuadro resumen con estadísticas del corpus bajo distintos niveles de procesamiento. De aquí se extrae que el tamaño del vocabulario, el corpus y la cantidad de tokens se redujo en alrededor de un 98 %, un 1 % y un 76 % respectivamente.

procesamiento	documentos	vocabulario	tokens
t	49015	93203	2030980
t+ch	49003	42921	1028412
t+ch+f	48988	3148	925693
t+ch+f+v	48988	2902	901745
t+ch+f+v+s	48566	1960	495182

Tabla 5.1: Estadísticas del corpus bajo distintos niveles de procesamiento, **t**: tokenización, **ch**: procesamiento de caracteres, **f**: filtro por frecuencia, **v**: filtro por vocabulario, **s**: eliminación de *stopwords*.

En la tabla 5.2 se muestra el detalle del vocabulario para cada una de las épocas tras procesar el corpus, de aquí se extrae que en promedio un 12.83 % del vocabulario se olvida de una época a otra y un 18.92 % es nuevo, es otras palabras, en promedio alrededor de un 32 % del vocabulario no es común entre tópicos de épocas adyacentes. Esto justifica la necesidad por utilizar medidas de similitud robustas a cambios en el vocabulario, permitiendo así una comparación más justa entre tópicos que no tienen un vocabulario común.



época	t-1	t	t-1 [%]	t [%]
2	1145	1187	14.41	18.08
3	1187	1281	13.56	21.48
4	1281	1329	13.35	17.10
5	1329	1405	12.57	18.28
6	1405	1537	10.25	19.64

Tabla 5.2: Evolución del vocabulario en el tiempo, **t-1**: corresponde al vocabulario del período anterior a la época respectivamente, **t**: corresponde al vocabulario de la época actual, **t-1 [%]** : porcentaje de palabras del período  $t - 1$  que ya no están en el período  $t$  y **t [%]**: porcentaje de palabras del período  $t$  que no están en el período  $t - 1$ .

### 5.3. Análisis cuantitativo de resultados

Rehacer

### 5.4. Análisis cualitativo de resultados

Análisis cualitativo de tópicos

# Bibliografia

- Susan T Dumais. Latent semantic analysis. *Annual review of information science and technology*, 38(1):188–230, 2004.
- Wei Xu, Xin Liu, and Yihong Gong. Document clustering based on non-negative matrix factorization. In *Proceedings of the 26th annual international ACM SIGIR conference on Research and development in informaion retrieval*, pages 267–273, 2003.
- David M Blei, Andrew Y Ng, and Michael I Jordan. Latent dirichlet allocation. *Journal of machine Learning research*, 3(Jan):993–1022, 2003.
- Yee W Teh, Michael I Jordan, Matthew J Beal, and David M Blei. Sharing clusters among related groups: Hierarchical dirichlet processes. In *Advances in neural information processing systems*, pages 1385–1392, 2005.
- Keith Stevens, Philip Kegelmeyer, David Andrzejewski, and David Buttler. Exploring topic coherence over many models and many topics. In *Proceedings of the 2012 Joint Conference on Empirical Methods in Natural Language Processing and Computational Natural Language Learning*, pages 952–961. Association for Computational Linguistics, 2012.
- Xuerui Wang and Andrew McCallum. Topics over time: a non-markov continuous-time model of topical trends. In *Proceedings of the 12th ACM SIGKDD international conference on Knowledge discovery and data mining*, pages 424–433, 2006.
- Amr Ahmed and Eric P Xing. Timeline: A dynamic hierarchical dirichlet process model for recovering birth/death and evolution of topics in text stream. *arXiv preprint arXiv:1203.3463*, 2012.
- Andrew T Wilson and David G Robinson. Tracking topic birth and death in lda. *Sandia National Laboratories*, 2011.
- Adham Beykikhoshk, Ognjen Arandjelović, Dinh Phung, and Svetha Venkatesh. Discovering topic structures of a temporally evolving document corpus. *Knowledge and Information Systems*, 55(3):599–632, 2018.
- Thomas Minka. Estimating a dirichlet distribution, 2000.
- Thomas S Ferguson. A bayesian analysis of some nonparametric problems. *The annals of statistics*, pages 209–230, 1973.
- Jayaram Sethuraman. A constructive definition of dirichlet priors. *Statistica sinica*, pages 639–650, 1994.
- Erik Blaine Sudderth. *Graphical models for visual object recognition and tracking*. PhD thesis, Massachusetts Institute of Technology, 2006.

- David J Aldous. Exchangeability and related topics. In *École d'Été de Probabilités de Saint-Flour XIII—1983*, pages 1–198. Springer, 1985.
- Kamal Nigam, Andrew Kachites McCallum, Sebastian Thrun, and Tom Mitchell. Text classification from labeled and unlabeled documents using em. *Machine learning*, 39(2-3): 103–134, 2000.
- Christophe Andrieu, Nando De Freitas, Arnaud Doucet, and Michael I Jordan. An introduction to mcmc for machine learning. *Machine learning*, 50(1-2):5–43, 2003.
- David M Blei, Alp Kucukelbir, and Jon D McAuliffe. Variational inference: A review for statisticians. *Journal of the American statistical Association*, 112(518):859–877, 2017.
- Thomas L Griffiths and Mark Steyvers. Finding scientific topics. *Proceedings of the National academy of Sciences*, 101(suppl 1):5228–5235, 2004.
- W John Wilbur and Karl Sirotkin. The automatic identification of stop words. *Journal of information science*, 18(1):45–55, 1992.
- Steven Bird, Ewan Klein, and Edward Loper. *Natural language processing with Python: analyzing text with the natural language toolkit*. O'Reilly Media, Inc., 2009.
- Chong Wang and David Blei. HDP: Hierarchical dirichlet process C++, 2010. URL <https://github.com/blei-lab/hdp>.
- Michael D Escobar and Mike West. Bayesian density estimation and inference using mixtures. *Journal of the american statistical association*, 90(430):577–588, 1995.
- Carson Sievert and Kenneth Shirley. Ldavis: A method for visualizing and interpreting topics. In *Proceedings of the workshop on interactive language learning, visualization, and interfaces*, pages 63–70, 2014.
- Laurens van der Maaten and Geoffrey Hinton. Visualizing data using t-sne. *Journal of machine learning research*, 9(Nov):2579–2605, 2008.
- Svante Wold, Kim Esbensen, and Paul Geladi. Principal component analysis. *Chemometrics and intelligent laboratory systems*, 2(1-3):37–52, 1987.
- Dominik Maria Endres and Johannes E Schindelin. A new metric for probability distributions. *IEEE Transactions on Information theory*, 49(7):1858–1860, 2003.
- Matt Kusner, Yu Sun, Nicholas Kolkin, and Kilian Weinberger. From word embeddings to document distances. In *International conference on machine learning*, pages 957–966, 2015.
- Tomas Mikolov, Ilya Sutskever, Kai Chen, Greg S Corrado, and Jeff Dean. Distributed representations of words and phrases and their compositionality. In *Advances in neural information processing systems*, pages 3111–3119, 2013.
- Vlad Niculae. Word mover’s distance in python, 2015. URL <http://vene.ro/blog/word-movers-distance-in-python.html>.
- Gary Doran. PyEMD: Earth mover’s distance for Python, 2014. URL <https://github.com/garydoranjr/pyemd>.
- Ofir Pele and Michael Werman. Fast and robust earth mover’s distances. In *2009 IEEE 12th International Conference on Computer Vision*, pages 460–467. IEEE, 2009.

- José Cañete. Fasttext embeddings from SUC. <https://github.com/BotCenter/spanishWordEmbeddings>, 2019a.
- Piotr Bojanowski, Edouard Grave, Armand Joulin, and Tomas Mikolov. Enriching word vectors with subword information. *Transactions of the Association for Computational Linguistics*, 5:135–146, 2017.
- José Cañete. Spanish Unannotated Corpora, 2019b. URL <https://github.com/josecannete/spanish-corpora>.
- Christopher D Manning, Hinrich Schütze, and Prabhakar Raghavan. *Introduction to information retrieval*. Cambridge university press, 2008.
- Juan Cao, Tian Xia, Jintao Li, Yongdong Zhang, and Sheng Tang. A density-based method for adaptive lda model selection. *Neurocomputing*, 72(7-9):1775–1781, 2009.
- Rajkumar Arun, Venkatasubramanian Suresh, CE Veni Madhavan, and MN Narasimha Murthy. On finding the natural number of topics with latent dirichlet allocation: Some observations. In *Pacific-Asia conference on knowledge discovery and data mining*, pages 391–402. Springer, 2010.
- Romain Deveaud, Eric SanJuan, and Patrice Bellot. Accurate and effective latent concept modeling for ad hoc information retrieval. *Document numérique*, 17(1):61–84, 2014.
- Wen Zhang, Yangbo Cui, and Taketoshi Yoshida. En-lda: An novel approach to automatic bug report assignment with entropy optimized latent dirichlet allocation. *Entropy*, 19(5):173, 2017.
- George Forman. An extensive empirical study of feature selection metrics for text classification. *Journal of machine learning research*, 3(Mar):1289–1305, 2003.