Detecção de Fraudes no Tráfego de Cliques em Propagandas de Aplicações Mobile

Gilson Santana - gcardososantana@gmail.com

02/11/2020

Informações gerais

Projeto da DSA como parte do treiamento Big Data Analytics com R e Microsoft Azure Machine Learning.

O projeto consiste na criação de modelo de Machine Learning que possa prever se um click para download de aplicativo é ou não fraudulento. Para esse trabalho foi utilizado a base de dados train_sample.csv, disponível no link https://www.kaggle.com/c/talkingdata-adtracking-fraud-detection/data. Maiores detalhe do desafio também pode ser obtido no site do Kaggle.

Acesse o arquivo Readme para informações complementares.

Carga & visualização

```
oldw <- getOption("warn")</pre>
options(warn = -1)
library(dplyr)
##
## Attaching package: 'dplyr'
## The following objects are masked from 'package:stats':
##
       filter, lag
##
## The following objects are masked from 'package:base':
##
       intersect, setdiff, setequal, union
library(ROSE)
## Loaded ROSE 0.0-3
library(lubridate)
##
## Attaching package: 'lubridate'
## The following objects are masked from 'package:base':
##
##
       date, intersect, setdiff, union
library(ggplot2)
library(gridExtra)
```

```
##
## Attaching package: 'gridExtra'
## The following object is masked from 'package:dplyr':
##
##
       combine
#Diretório de trabalho
setwd('D:/OneDrive/EstudosTecnicos/CienciaDados/DtScienceTrab/BigDataRAzure/Cap20/Projeto01')
# Carregar dados - Utilizada a base train-sample.csv devido ao tamanho da base train
dfDados <- read.csv('train_sample.csv', stringsAsFactors= F, header =T)
str(dfDados)
                    100000 obs. of 8 variables:
  'data.frame':
##
                     : int 87540 105560 101424 94584 68413 93663 17059 121505 192967 143636 ...
## $ app
                     : int
                           12 25 12 13 12 3 1 9 2 3 ...
## $ device
                     : int
                            1 1 1 1 1 1 1 1 2 1 ...
## $ os
                           13 17 19 13 1 17 17 25 22 19 ...
                     : int
##
  $ channel
                            497 259 212 477 178 115 135 442 364 135 ...
                     : int
                            "2017-11-07 09:30:38" "2017-11-07 13:40:27" "2017-11-07 18:05:24" "2017-11-
##
  $ click_time
                     : chr
   $ attributed_time: chr
                            ... ... ... ...
  $ is_attributed : int
                            0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 ...
# View(dfDados)
summary(dfDados)
##
          ip
                          app
                                           device
                                                               os
##
  Min.
          :
                 9
                     {\tt Min.}
                            : 1.00
                                      Min.
                                                 0.00
                                                         Min.
                                                                : 0.00
   1st Qu.: 40552
                     1st Qu.: 3.00
                                      1st Qu.:
                                                  1.00
                                                         1st Qu.: 13.00
                     Median : 12.00
## Median: 79827
                                      Median:
                                                  1.00
                                                         Median: 18.00
##
   Mean
           : 91256
                     Mean
                            : 12.05
                                      Mean
                                                21.77
                                                         Mean
                                                                : 22.82
##
   3rd Qu.:118252
                     3rd Qu.: 15.00
                                                  1.00
                                                         3rd Qu.: 19.00
                                      3rd Qu.:
##
  Max.
           :364757
                     Max.
                            :551.00
                                      Max.
                                              :3867.00
                                                         Max.
                                                                :866.00
##
                     click_time
                                       attributed_time
                                                           is attributed
       channel
   Min. : 3.0
                    Length: 100000
                                       Length:100000
##
                                                           Min.
                                                                  :0.00000
##
   1st Qu.:145.0
                    Class :character
                                       Class :character
                                                           1st Qu.:0.00000
  Median :258.0
                    Mode :character
                                       Mode :character
                                                           Median :0.00000
           :268.8
## Mean
                                                           Mean
                                                                  :0.00227
   3rd Qu.:379.0
                                                           3rd Qu.:0.00000
##
  Max.
           :498.0
                                                           Max.
                                                                  :1.00000
```

Explorar

Download (e o não download) do App por número de clicks repetidos para diversas variáveis

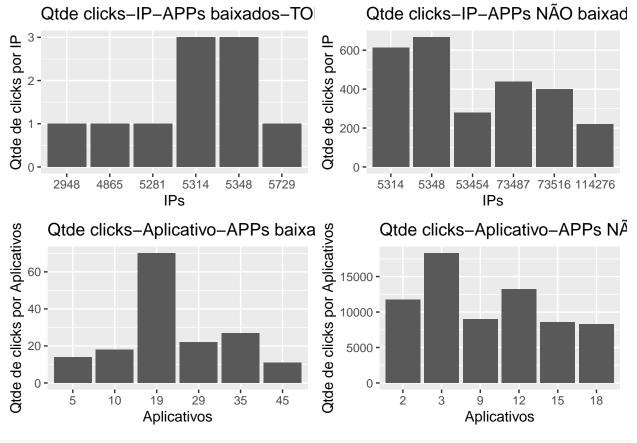
A quantidade de cliks que não resultam em download para o mesmo IP chama a atenção, sugere fraude. Em outras variáveis essa característica é semelhante, porém não sugestiona fraude na mesma proporção do IP.

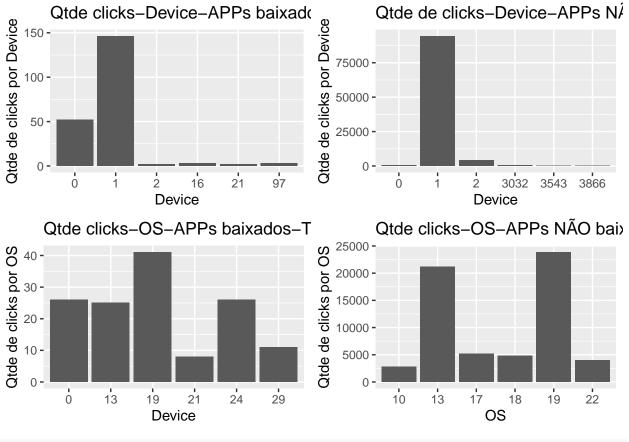
```
# ip
#par(mfrow = c(1,2))
dfAux<- dfDados %>%
    select(is_attributed, ip) %>%
    group_by(is_attributed, ip) %>%
    summarise(repeticoes=n())
```

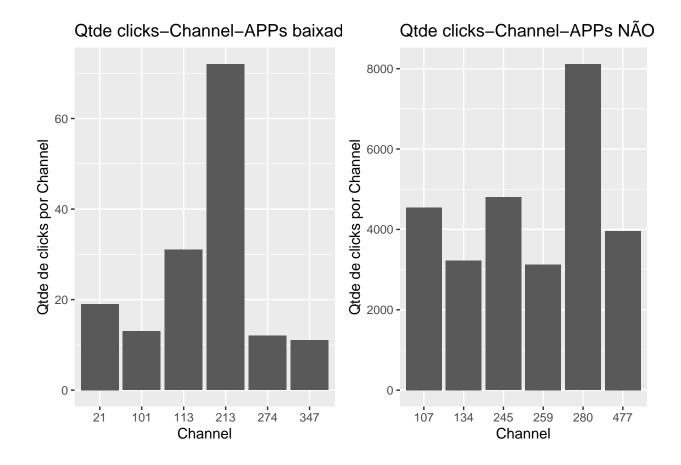
`summarise()` regrouping output by 'is_attributed' (override with `.groups` argument)

```
plot01<- dfAux %>% filter(is_attributed == 1) %>% arrange(desc(repeticoes)) %>% head(6) %>%
          ggplot(aes(factor(ip), repeticoes)) +
          geom_col() +
          ggtitle('Qtde clicks-IP-APPs baixados-TOP 6') +
          xlab('IPs') +
          ylab('Qtde de clicks por IP')
    plot02<- dfAux %>% filter(is attributed == 0) %>% arrange(desc(repeticoes)) %>% head(6) %>%
          ggplot(aes(factor(ip), repeticoes)) +
          geom col() +
          ggtitle('Qtde clicks-IP-APPs NÃO baixados-TOP 6') +
          xlab('IPs') +
          ylab('Qtde de clicks por IP')
     # app
     dfAux<- dfDados %>%
          select(is_attributed, app) %>%
          group_by(is_attributed, app) %>%
          summarise(repeticoes=n())
## `summarise()` regrouping output by 'is_attributed' (override with `.groups` argument)
     plot03<- dfAux %>% filter(is_attributed == 1) %>% arrange(desc(repeticoes)) %>% head(6) %>%
          ggplot(aes(factor(app), repeticoes)) +
          geom_col() +
          ggtitle('Qtde clicks-Aplicativo-APPs baixados-TOP 6') +
          xlab('Aplicativos') +
          ylab('Qtde de clicks por Aplicativos')
     plot04<- dfAux %>% filter(is_attributed == 0) %>% arrange(desc(repeticoes)) %>% head(6) %>%
          ggplot(aes(factor(app), repeticoes)) +
          geom_col() +
          ggtitle('Qtde clicks-Aplicativo-APPs NÃO baixados-TOP 6') +
          xlab('Aplicativos') +
          ylab('Qtde de clicks por Aplicativos')
     # device
     dfAux<- dfDados %>%
          select(is_attributed, device) %>%
          group_by(is_attributed, device) %>%
          summarise(repeticoes=n())
## `summarise()` regrouping output by 'is_attributed' (override with `.groups` argument)
     plot05<- dfAux %>% filter(is_attributed == 1) %>% arrange(desc(repeticoes)) %>% head(6) %>%
          ggplot(aes(factor(device), repeticoes)) +
          geom_col() +
          ggtitle('Qtde clicks-Device-APPs baixados-TOP 6') +
          xlab('Device') +
          ylab('Qtde de clicks por Device')
     plot06<- dfAux %>% filter(is_attributed == 0) %>% arrange(desc(repeticoes)) %>% head(6) %>%
          ggplot(aes(factor(device), repeticoes)) +
          geom_col() +
```

```
ggtitle('Qtde de clicks-Device-APPs NÃO baixados-TOP 6') +
          xlab('Device') +
          ylab('Qtde de clicks por Device')
     # OS (Sistema Operacional)
     dfAux<- dfDados %>%
          select(is attributed, os) %>%
          group_by(is_attributed, os) %>%
          summarise(repeticoes=n())
## `summarise()` regrouping output by 'is_attributed' (override with `.groups` argument)
     plot07<- dfAux %>% filter(is_attributed == 1) %>% arrange(desc(repeticoes)) %>% head(6) %>%
          ggplot(aes(factor(os), repeticoes)) +
          geom_col() +
          ggtitle('Qtde clicks-OS-APPs baixados-TOP 6') +
          xlab('Device') +
          ylab('Qtde de clicks por OS')
    plot08<- dfAux %>% filter(is_attributed == 0) %>% arrange(desc(repeticoes)) %>% head(6) %>%
          ggplot(aes(factor(os), repeticoes)) +
          geom col() +
          ggtitle('Qtde clicks-OS-APPs NÃO baixados-TOP 6') +
          xlab('OS') +
          ylab('Qtde de clicks por OS')
     # channel
     dfAux<- dfDados %>%
          select(is_attributed, channel) %>%
          group_by(is_attributed, channel) %>%
          summarise(repeticoes=n())
## `summarise()` regrouping output by 'is_attributed' (override with `.groups` argument)
     plot09<- dfAux %>% filter(is_attributed == 1) %>% arrange(desc(repeticoes)) %>% head(6) %>%
          ggplot(aes(factor(channel), repeticoes)) +
          geom col() +
          ggtitle('Qtde clicks-Channel-APPs baixados-TOP 6') +
          xlab('Channel') +
          ylab('Qtde de clicks por Channel')
    plot10<- dfAux %>% filter(is_attributed == 0) %>% arrange(desc(repeticoes)) %>% head(6) %>%
          ggplot(aes(factor(channel), repeticoes)) +
          geom col() +
          ggtitle('Qtde clicks-Channel-APPs NÃO baixados-TOP 6') +
          xlab('Channel') +
          ylab('Qtde de clicks por Channel')
          #Exibir plots
     grid.arrange(plot01, plot02, plot03, plot04, ncol=2, nrow=2)
```







Relação attributed_time X is_attributed

Se App baixado implica na existendia do atributed_time, assim essa variável é consequência da variável target (is_attributed), não pode figurar como perditora

```
nrow(dfDados %>% filter(attributed_time == ''))

## [1] 99773
    nrow(dfDados %>% filter(is_attributed == '0'))

## [1] 99773
    nrow(dfDados %>% filter(attributed_time == '' & is_attributed == '0'))

## [1] 99773
    dfDados$attributed_time <- NULL</pre>
```

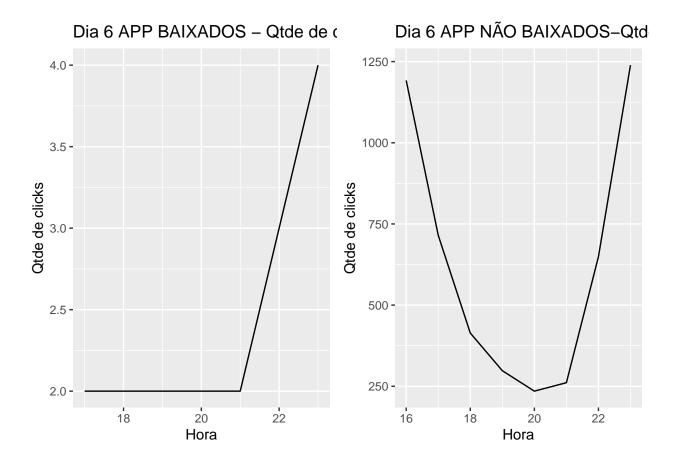
Análise temporal

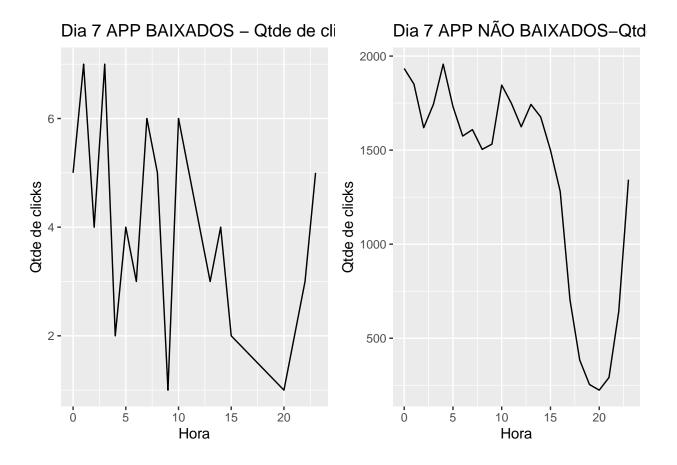
Variável click_time - indica o momento do click.

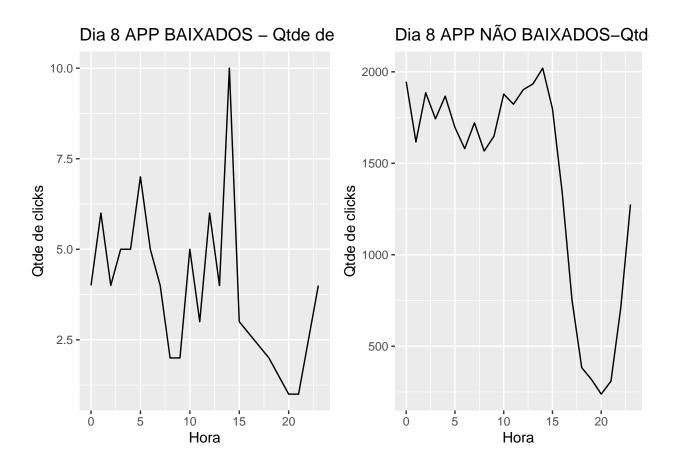
```
dfDados$dt <- date(dfDados$click_time)
dfDados$year <- year(dfDados$dt)
dfDados$month <- month(dfDados$dt)
dfDados$day <- day(dfDados$dt)
dfDados$weekday <- wday(dfDados$dt)</pre>
```

```
dfDados$hour <- hour(dfDados$click_time)</pre>
    str(dfDados)
## 'data.frame':
                  100000 obs. of 13 variables:
                 : int 87540 105560 101424 94584 68413 93663 17059 121505 192967 143636 ...
## $ ip
## $ app
                 : int 12 25 12 13 12 3 1 9 2 3 ...
## $ device
                 : int 1 1 1 1 1 1 1 2 1 ...
                 : int 13 17 19 13 1 17 17 25 22 19 ...
## $ os
## $ channel
                : int 497 259 212 477 178 115 135 442 364 135 ...
## $ click_time : chr "2017-11-07 09:30:38" "2017-11-07 13:40:27" "2017-11-07 18:05:24" "2017-11-07
## $ is attributed: int 0000000000...
## $ dt
                : Date, format: "2017-11-07" "2017-11-07" ...
## $ year
                 : num 2017 2017 2017 2017 2017 ...
## $ month
                 : num 11 11 11 11 11 11 11 11 11 11 ...
## $ day
                  : int 7777999788 ...
                 : num 3 3 3 3 5 5 5 3 4 4 ...
## $ weekday
## $ hour
                  : int 9 13 18 4 9 1 1 10 9 12 ...
    # year e month - essas variáveis tem uma dimensão apenas, é
    # como uma constante. A amostra se resuma a um ano e um mês, apenas
    str(factor(dfDados$year))
## Factor w/ 1 level "2017": 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 ...
  str(factor(dfDados$month))
## Factor w/ 1 level "11": 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 ...
    dfDados$year <- NULL
    dfDados$month <- NULL
    # day e weekday - se tornaram redudantes devido ao tamanho da amostra: apenas
    # 4 dias consecutivos no mês 11 de 2017, sendo que não contempla fim de semana
    # nem sinaliza feriados. Qualquer análise de comportamento na linha semanal ou
    # de períodos mensais seria "forçação" de barra.
    # Foi mantida a variável day e eliminada a weekday
    str(factor(dfDados$day))
## Factor w/ 4 levels "6","7","8","9": 2 2 2 2 4 4 4 2 3 3 ...
    dfDados %>% distinct(day) %>% arrange(day)
##
    day
## 1 6
## 2
     7
## 3
## 4
    str(factor(dfDados$weekday))
## Factor w/ 4 levels "2", "3", "4", "5": 2 2 2 2 4 4 4 2 3 3 ...
    dfDados %>% distinct(weekday) %>% arrange(weekday)
##
    weekday
## 1
          2
## 2
          3
## 3
          4
```

```
## 4
    dfDados$weekday <- NULL
     # hour - Avaliar comportamento por hora
     # O desbalanceamento da classe is_attributed é muito acentuado, isso limita os insighs
     # Recomenda-se repetir a análise após o balanceamento da classe. Poderá ser feito em uma
     # continuidade desse trabalho.
     # Para um análise temporal, a amostra se apresentou bastante limitada.
     dfAux<- dfDados %>%
          select(is_attributed, day, hour) %>%
          group_by(is_attributed, day, hour) %>%
          summarise(qtdCliks=n())
## `summarise()` regrouping output by 'is_attributed', 'day' (override with `.groups` argument)
     # Função - plotagem por dia
     plotD <- function(dia){</pre>
          plotd1<- ggplot(dfAux[dfAux$is_attributed == 1 & dfAux$day == dia,], aes(x = hour, y = qtdCli
               geom_line() +
               ylab("Qtde de clicks") + xlab("Hora") +
               labs(title = paste("Dia ", as.character(dia), " APP BAIXADOS - Qtde de clicks por hora",
         plotd2<- ggplot(dfAux[dfAux$is_attributed == 0 & dfAux$day == dia,], aes(x = hour, y = qtdCli
               geom_line() +
               ylab("Qtde de clicks") + xlab("Hora") +
               labs(title = paste("Dia ", as.character(dia), " APP NÃO BAIXADOS-Qtde de clicks por hora
          grid.arrange(plotd1 , plotd2, ncol=2, nrow=1)
    }
     dias<- unlist(distinct(dfAux[, 'day']))</pre>
     lapply(dias, plotD)
```



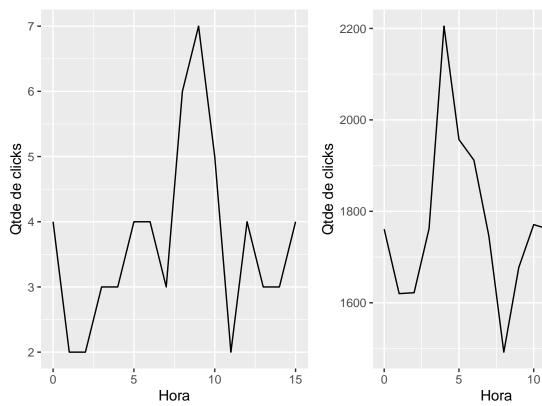




Dia 9 APP BAIXADOS - Qtde de cli

Dia 9 APP NÃO BAIXADOS-Qtd

15



```
## $day1
## TableGrob (1 x 2) "arrange": 2 grobs
           cells
                   name
## 1 1 (1-1,1-1) arrange gtable[layout]
## 2 2 (1-1,2-2) arrange gtable[layout]
##
## $day2
## TableGrob (1 x 2) "arrange": 2 grobs
          cells
                   name
## 1 1 (1-1,1-1) arrange gtable[layout]
## 2 2 (1-1,2-2) arrange gtable[layout]
##
## $day3
## TableGrob (1 x 2) "arrange": 2 grobs
           cells
                  name
## 1 1 (1-1,1-1) arrange gtable[layout]
## 2 2 (1-1,2-2) arrange gtable[layout]
##
## $day4
## TableGrob (1 x 2) "arrange": 2 grobs
           cells
                    name
   Z
## 1 1 (1-1,1-1) arrange gtable[layout]
## 2 2 (1-1,2-2) arrange gtable[layout]
```

Análise de correlação

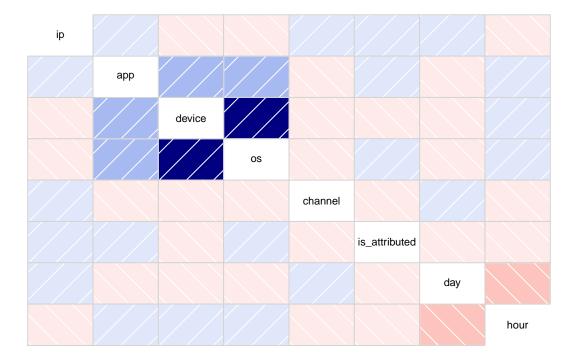
```
library(corrgram)

## Registered S3 method overwritten by 'seriation':

## method from

## reorder.hclust gclus

corrgram(dfDados)
```



Variáveis categóricas

Reconhecer as variáveis categóricas do dataset. Foram disponisibilizadas com o tipo inteiro

```
toFactor<- function(df, var) {
    for(v in var) df[,v]= factor(df[,v])
    return(df)
}

VarToFactor<- c('ip', 'app','device','os','channel','is_attributed', 'day', 'hour')
dfDados<- toFactor(dfDados, VarToFactor)</pre>
```

Valores missing

Checar e tratar valores missing

```
# Tratar valores NA - Não tem valores missing any(is.na(dfDados))
```

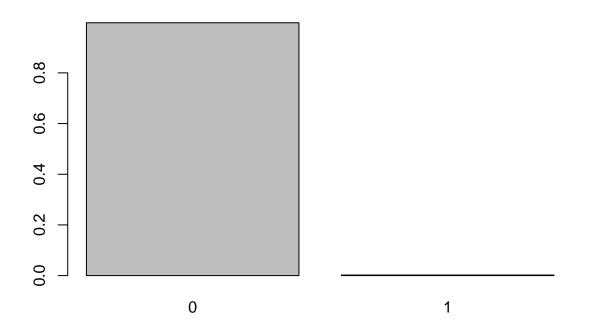
```
## [1] FALSE
```

Dados de teste e treino

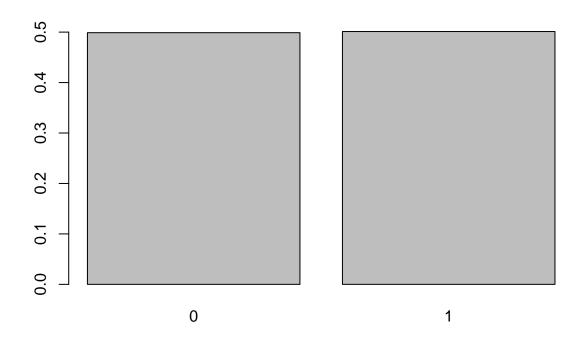
```
#Divisão dos dados de teste e treino
    linhas <- sample(1:nrow(dfDados), 0.7 * nrow(dfDados))
    dfTrain <- dfDados[linhas,]
    dfTest <- dfDados[-linhas,]</pre>
```

Balanceamento de classe

O dataset está bastante desbalenceado em relação a classe is_attributed, variável target.



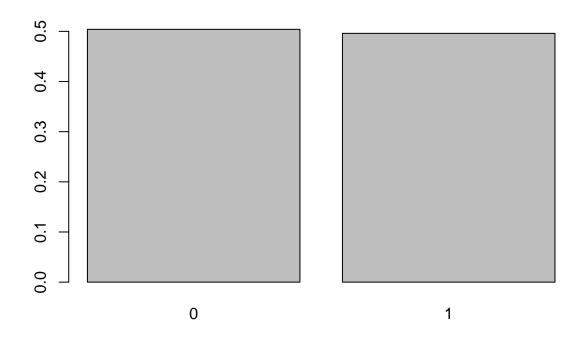
```
dfTrainBal <- ROSE(is_attributed ~ ip +</pre>
                           app +
                           device +
                           os +
                           channel +
                           day +
                           hour,
                      data = dfTrain, seed = 1)$data
     # Nova Proporção
     summary(dfTrainBal$is_attributed)
##
## 34919 35081
     prop.table(table(dfTrainBal$is_attributed))
##
           0
##
## 0.4988429 0.5011571
     barplot(prop.table(table(dfTrainBal$is_attributed)))
```



```
any(is.na(dfTrainBal))
```

[1] FALSE

```
# Balancear Teste
     dfTestBal <- ROSE(is_attributed ~ ip +</pre>
                            app +
                            device +
                            os +
                            channel +
                            day +
                            hour,
                       data = dfTest, seed = 1)$data
     summary(dfTestBal$is_attributed)
      0
##
           1
## 15121 14879
     prop.table(table(dfTestBal$is_attributed))
##
##
           0
## 0.5040333 0.4959667
     barplot(prop.table(table(dfTestBal$is_attributed)))
```



```
any(is.na(dfTestBal))
```

[1] FALSE

Treinando modelos

library(C50) #algorítimo C5.0

OBS: O Radom Forest não aceita trabalhar com variáveis categóricas com mais de 53 níveis. Por esse motivo, algumas Variáveis foram ajustadas para o tipo character.

```
library(e1071) #naiveBayes
     library(randomForest)
## randomForest 4.6-14
## Type rfNews() to see new features/changes/bug fixes.
## Attaching package: 'randomForest'
## The following object is masked from 'package:gridExtra':
##
##
       combine
## The following object is masked from 'package:ggplot2':
##
##
       margin
## The following object is masked from 'package:dplyr':
##
##
       combine
     #Árvore de decisão - algorítimo C5.0
     m.Arvore1 <- C5.0(is_attributed ~ ., data = dfTrainBal, rules = TRUE)
     m.Naive1<- naiveBayes(is_attributed ~ ., data = dfTrainBal, laplace = 0)</pre>
     # Radom Forest - Não aceita trabalhar com factor com mais de 53 níveis. Variáveis
     # ajustadas para o tipo character.
     dfTrainBalRandom<- dfTrainBal
     dfTrainBalRandom$ip<- as.character(dfTrainBalRandom$ip)</pre>
     dfTrainBalRandom$app<- as.character(dfTrainBalRandom$app)</pre>
     dfTrainBalRandom$device <- as.character(dfTrainBalRandom$device)
     dfTrainBalRandom$os<- as.character(dfTrainBalRandom$os)</pre>
     dfTrainBalRandom$channel<- as.character(dfTrainBalRandom$channel)
     #str(dfTrainBalRandom)
     m.Random1 <- randomForest( is_attributed ~ ip +</pre>
                                   app +
                                   device +
                                   os +
                                   channel +
                                   day +
                                   hour,
                              data = dfTrainBalRandom,
                              ntree = 100, nodesize = 10)
```

Predição e avaliação

```
# Predições
     p.Arvore1<- predict(m.Arvore1, dfTestBal)</pre>
     p.Naive1<- predict(m.Naive1, dfTestBal)</pre>
     dfTestBalRandom<- dfTestBal
     dfTestBalRandom$ip<- as.character(dfTestBalRandom$ip)</pre>
     dfTestBalRandom$app<- as.character(dfTestBalRandom$app)</pre>
     dfTestBalRandom$device<- as.character(dfTestBalRandom$device)</pre>
     dfTestBalRandom$os<- as.character(dfTestBalRandom$os)
     dfTestBalRandom$channel<- as.character(dfTestBalRandom$channel)
     p.Random1<- predict(m.Random1, dfTestBalRandom)</pre>
#Avaliando predições
     library(caret)
## Loading required package: lattice
## Attaching package: 'lattice'
## The following object is masked from 'package:corrgram':
##
##
       panel.fill
     confusionMatrix(dfTestBal$is_attributed, p.Arvore1)
## Confusion Matrix and Statistics
##
             Reference
##
## Prediction
                  0
            0 13136 1985
##
##
            1 3940 10939
##
##
                  Accuracy: 0.8025
##
                    95% CI: (0.7979, 0.807)
##
       No Information Rate: 0.5692
##
       P-Value [Acc > NIR] : < 2.2e-16
##
##
                     Kappa: 0.6046
##
    Mcnemar's Test P-Value : < 2.2e-16
##
##
               Sensitivity: 0.7693
##
##
               Specificity: 0.8464
            Pos Pred Value: 0.8687
##
            Neg Pred Value: 0.7352
##
                Prevalence: 0.5692
##
##
            Detection Rate: 0.4379
##
      Detection Prevalence: 0.5040
##
         Balanced Accuracy: 0.8078
##
##
          'Positive' Class : 0
##
     confusionMatrix(dfTestBal$is_attributed, p.Naive1)
```

```
## Confusion Matrix and Statistics
##
##
             Reference
                0
## Prediction
##
            0 14067 1054
##
            1 1889 12990
##
                  Accuracy: 0.9019
##
##
                    95% CI: (0.8985, 0.9052)
##
       No Information Rate: 0.5319
##
       P-Value [Acc > NIR] : < 2.2e-16
##
##
                     Kappa: 0.8037
##
##
   Mcnemar's Test P-Value : < 2.2e-16
##
##
               Sensitivity: 0.8816
##
               Specificity: 0.9250
##
            Pos Pred Value: 0.9303
##
            Neg Pred Value: 0.8730
##
                Prevalence: 0.5319
##
            Detection Rate: 0.4689
##
      Detection Prevalence: 0.5040
##
         Balanced Accuracy: 0.9033
##
##
          'Positive' Class: 0
##
     confusionMatrix(dfTestBal$is_attributed, p.Random1)
## Confusion Matrix and Statistics
##
##
             Reference
## Prediction
            0 15094
                       27
##
##
            1 14387
                      492
##
##
                  Accuracy : 0.5195
##
                    95% CI: (0.5139, 0.5252)
##
       No Information Rate: 0.9827
       P-Value [Acc > NIR] : 1
##
##
##
                     Kappa: 0.0315
##
   Mcnemar's Test P-Value : <2e-16
##
##
##
               Sensitivity: 0.51199
##
               Specificity: 0.94798
##
            Pos Pred Value: 0.99821
##
            Neg Pred Value: 0.03307
##
                Prevalence: 0.98270
##
            Detection Rate: 0.50313
##
      Detection Prevalence: 0.50403
##
         Balanced Accuracy: 0.72998
```

##

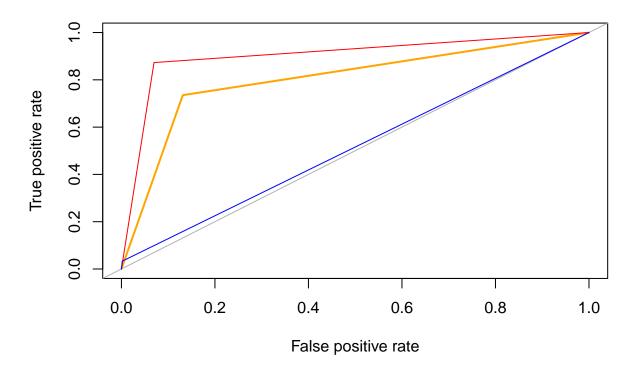
```
## 'Positive' Class : 0
##

# ROC Curves com o ROSE
    roc.curve(dfTestBal$is_attributed, p.Arvore1, plotit = T, col = "orange", add.roc = F)

## Area under the curve (AUC): 0.802
    roc.curve(dfTestBal$is_attributed, p.Naive1, plotit = T, col = "red", add.roc = T)

## Area under the curve (AUC): 0.902
    roc.curve(dfTestBal$is_attributed, p.Random1, plotit = T, col = "blue", add.roc = T)
```

ROC curve



```
## Area under the curve (AUC): 0.516
options(warn = oldw)
```

Conclusões

O moldelo baseado no Naive apresentou melhor acurácia, poderia seguir com um refinamento do processo de otimização.

O C5.0 vem em seguida. Apresenta também como candidado a seguir com uma otimização.

O modelo de Radom Forest não conseguiu rodar com as variáveis categóricas (factor) com mais de 53 níveis. Assim, algumas variáveis foram convertidas para caracter. isso pode ter influenciando no seu baixo desempenho.

OBS: aqui não se fez um trabalho expoloratório com os dados balanceados por se tratar de um projeto

acadêmico, cuja finalidade maior é foi o exercício inicial da análise sobre dados. Essa exploração não seria nos dados de treino ou teste, seria em dataframe específico para esse fim.