DOCUMENTAÇÃO ML.BIGQUERY PANDAS FRAUD DETECTION

1. Foram realizados 3 testes:

TESTE 1 com seleção de colunas diferentes.

TESTE 2 e **TESTE 2** AUTOWEIGHTS com as mesmas colunas porém um com o AUTO_CLASS_WEIGHTS = TRUE.

TESTE 1

Sem o AUTO_CLASS_WEIGHTS=TRUE

IMPORTAÇÃO DA TABELA transaction.



Nome do campo	Tipo	Modo
ssn	STRING	NULLABLE
cc_num	INTEGER	NULLABLE
first	STRING	NULLABLE
last	STRING	NULLABLE
gender	STRING	NULLABLE
street	STRING	NULLABLE
city	STRING	NULLABLE
state	STRING	NULLABLE
zip	INTEGER	NULLABLE
city_pop	INTEGER	NULLABLE
job	STRING	NULLABLE
dob	DATE	NULLABLE
acct_num	INTEGER	NULLABLE
profile	STRING	NULLABLE
trans_num	STRING	NULLABLE
trans_date	DATE	NULLABLE
trans_time	TIME	NULLABLE
unix_time	INTEGER	NULLABLE
category	STRING	NULLABLE
amt	FLOAT	NULLABLE
is_fraud	INTEGER	NULLABLE
merchant	STRING	NULLABLE
merch_lat	STRING	NULLABLE
merch_long	STRING	NULLABLE

CRIANDO UMA NOVA TABELA is not null DA COLUNA is_fraud COM AS COLUNAS SELECIONADAS.

```
CREATE TABLE 'pandasfraude.fraudteste1.transaction_notnull' AS
SELECT

ssn,
cc_num,
first,
last,
gender,
city,
state,
trans_time,
unix_time,
amt,
is_fraud
FROM
'fraudteste1.transaction'
WHERE is_fraud IS NOT NULL
```

```
SELECT 'is fraud' As Category,
COUNT (*) As TotalRecords,
SUM(CASE WHEN is_fraud is null THEN 1 ELSE 0 END) AS MissingRecords,
CONCAT(CAST(ROUND(180*(SUM(CASE WHEN is_fraud is null THEN 1 ELSE 0 END)/Count(*)),2) AS STRING),'%')AS MissingRate
FROM 'pandasfraude.fraudteste1.transaction_notnull'
GROUP BY 1
```

Res	Resultados da consulta								
INFO	RMAÇÕES D	O JOB RE	ESULTADOS	JSON	DETALHES DA EXECUÇÃO				
Linha	Category	TotalRecords	MissingRecords	MissingRate					
1	is fraud	29301	0	0%					

COLUNAS

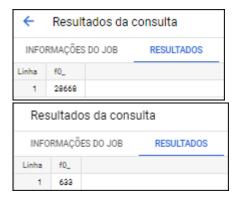
Nome do campo	Tipo	Modo
ssn	STRING	NULLABLE
cc_num	INTEGER	NULLABLE
first	STRING	NULLABLE
last	STRING	NULLABLE
gender	STRING	NULLABLE
city	STRING	NULLABLE
state	STRING	NULLABLE
trans_time	TIME	NULLABLE
unix_time	INTEGER	NULLABLE
amt	FLOAT	NULLABLE
is_fraud	INTEGER	NULLABLE

• TABELA is not null, A QUANTIDADE QUE OCORREU FRAUDE E NÃO OCORREU FRAUDE.

is_fraud = 0 → Fraude NÃO is_fraud = 1 → Fraude SIM

```
SELECT count(*) FROM 'pandasfraude.fraudtestel.transaction_notnull'
where is_fraud=0;

SELECT count(*) FROM 'pandasfraude.fraudtestel.transaction_notnull'
where is_fraud=1;
```



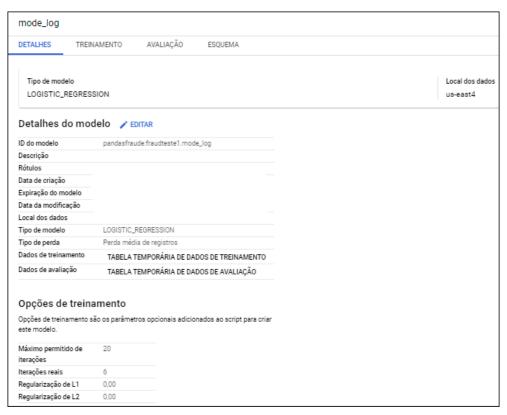
CRIAÇÃO DO MODELO

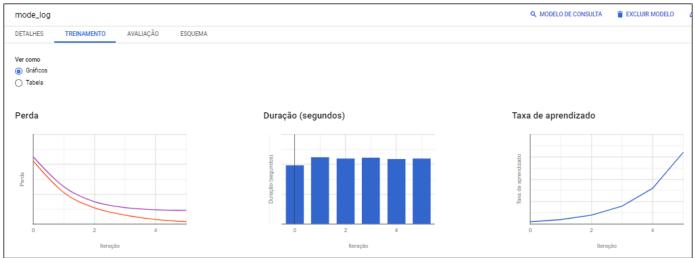
A tabela possui 29301 linhas, foi retirado 15% (4395) para verificação do modelo.

```
CREATE OR REPLACE MODEL 'fraudteste1.mode_log'
OPTIONS(model_type='logistic_reg') AS
SELECT

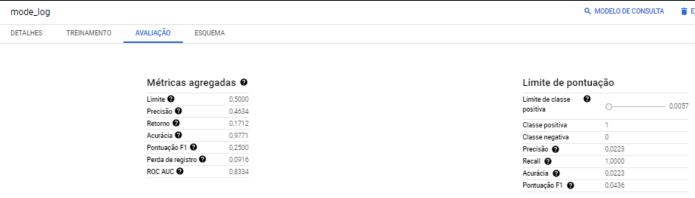
* EXCEPT(cc_num, state, is_fraud),
is_fraud AS label,
FROM

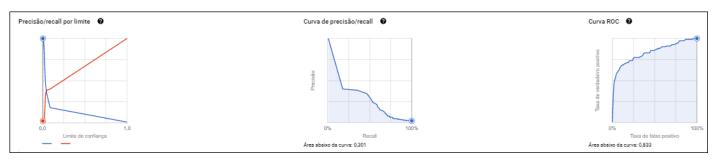
'pandasfraude.fraudteste1.transaction_notnull'
ORDER BY
| first
LIMIT 24986;
```













• VIEW TRAINING AND MODEL STATISTICS

Resultados da consulta								
INFO	RMAÇÕES DO J	IOB I	RESULTADOS	JSON	DETALHES DA EXE	CUÇÃO		
Linha	training_run	iteration	loss		eval_loss	learning_rate	duration_ms	
1	0	5	0.01616540172	9458927	0.091631824883518231	6.4	2203	
2	0	4	0.03061125395	2648219	0.095555901955901356	3.2	2188	
3	0	3	0.06015298	8794777	0.11028265033544002	1.6	2230	
4	0	2	0.1088146578	1349445	0.14977560526831324	0.8	2202	
5	0	1	0.2101891655	1672162	0.24918596056611081	0.4	2240	
6	0	0	0.4221502192	0193818	0.44995557238816242	0.2	1969	

• EVALUETION MODEL COM OS DADOS RETIRADOS (4395)

Resultados da consulta								
INFO	RMAÇÕES DO JOB	RESULTADOS	JSON	DETALHES DA EX	ECUÇÃO			
Linha	precision	recall		accuracy	f1_score	log_loss	roc_auc	
1	1 0.088235294117647065 0.034090909090909088		088 (0.97360637087599544 0.049180327868852458 0.20976043393699373			0.78838061938061943	

• PREDICT

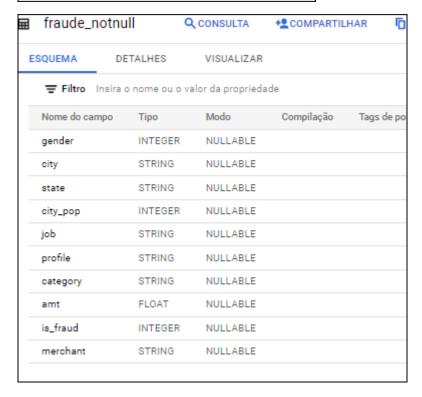
INFO	RMAÇÕES DO JOB	RESULTA	ADOS JSON	DETALHES DA I	EXECUÇÃO									
Linha	predicted_label	prediclabel	predicprob	SSN	cc_num	first	last	gender	city	state	trans_time	unix_time	amt	is_fraud
1	0	1	0.012520006561959759	358-97-6253	4906250000000000	Judith	Nelson	FEMININO	Bronx	NY	20:10:34	1644610234	61.15	0
		0	0.98747999343814119											
2	0	1	0.012390959629205419	358-97-6253	4906250000000000	Judith	Nelson	FEMININO	Bronx	NY	09:05:01	1650099901	63.23	0
		0	0.98760904037079456											
3	0	1	0.012815826414303295	358-97-6253	4906250000000000	Judith	Nelson	FEMININO	Bronx	NY	08:23:14	1642148594	67.8	0
		0	0.98718417358569666											
4	0	1	0.012383917166398067	358-97-6253	4906250000000000	Judith	Nelson	FEMININO	Bronx	NY	08:21:05	1645963665	59.06	0
		0	0.98761608283360192											
5	0	1	0.013049307975665664	358-97-6253	4906250000000000	Judith	Nelson	FEMININO	Bronx	NY	10:14:04	1644660844	99.86	0
		0	0.98695069202433439											
6	0	1	0.012045609691237351	358-97-6253	4906250000000000	Judith	Nelson	FEMININO	Bronx	NY	09:22:29	1644398549	8.72	0
		0	0.98795439030876264											
7	0	1	0.011725527746304918	358-97-6253	4906250000000000	Judith	Nelson	FEMININO	Bronx	NY	18:07:16	1647367636	2.65	0
		0	0.98827447225369514											
8	0	1	0.011510164349173237	358-97-6253	4906250000000000	Judith	Nelson	FEMININO	Bronx	NY	19:56:36	1650916596	13.18	0
		0	0.98848983565082671											
9	0	1	0.025186157930723461	358-97-6253	4906250000000000	Judith	Nelson	FEMININO	Bronx	NY	01:13:46	1648170826	2.17	0

SELECT * FROM ML.WEIGHTS(MODEL 'fraudteste1.mode_log')

	processed_input	category_weights.category	category_weights.weight
1.	trans_time	23:54:34	6.25200638291529
2.	trans_time	23:19:14	6.249403215916304
3.	trans_time	01:44:00	6.21934100281764
4.	trans_time	22:03:00	6.136214120359135
5.	trans_time	22:03:21	6.133999507024293
6.	trans_time	23:08:04	6.112043847927879
7.	trans_time	23:23:11	6.111090121846779
8.	trans_time	01:20:19	6.0983791760798765
9.	trans_time	00:08:12	6.096760996986403
10.	trans_time	01:36:19	6.0896405730321534
11.	trans_time	00:43:53	6.086323286074734
12.	trans_time	04:43:23	6.078931656462106
13.	trans_time	22:10:34	6.070104797297633
14.	trans_time	01:46:12	6.02295177447846
15.	trans_time	19:10:29	6.022913021984513
16.	trans_time	23:43:17	6.019318591913749
17.	trans_time	22:47:47	6.017813922559107
18.	trans_time	22:22:21	6.00921101653125
19.	trans_time	23:13:05	6.009170426194605
20.	trans_time	17:53:32	6.0085425439427755

CRIAÇÃO DA TABELA COM AS COLUNAS ESCOLHIDAS:

```
CREATE TABLE 'pandasfraude.detectionfraud.fraude_notnull' AS
SELECT
gender,
city,
state,
city_pop,
job,
profile,
category,
ant,
is_fraud,
merchant
FROM
'pandasfraude.detectionfraud.fraude'
WHERE is_fraud IS NOT NULL
```



CRIAÇÃO DO MODELO

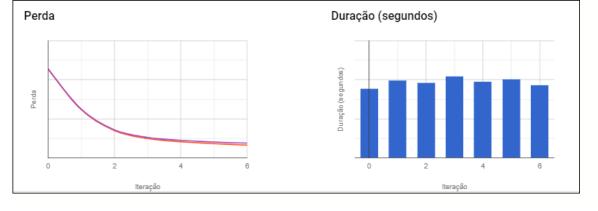
A tabela possui 29301 linhas, foi retirado 15% (4395) para verificação do modelo.

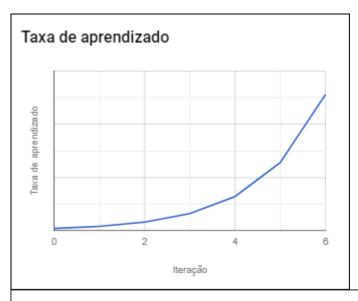
```
CREATE OR REPLACE MODEL 'detectionfraud.fraudelogreg'
OPTIONS(model_type='logistic_reg') AS
SELECT

* EXCEPT(state, city_pop, is_fraud),
is_fraud AS label,
FROM
   'detectionfraud.fraude_notnull'
ORDER BY
profile
LIMIT 24986;
```

fraudelogreg				Q MODELO D
DETALHES	TREINAMENTO	AVALIAÇÃO	ESQUEMA	
Tipo de modelo LOGISTIC_REO				Local dos dados us-east4
Detalhes do	modelo 🥕 E	DITAR		
ID do modelo	pandasfra	ude:detectionfraud.fr	raudelogreg	
	pandasfra	ude:detectionfraud.fr	raudelogreg	
Descrição	pandasfra	ude:detectionfraud.fr	raudelogreg	
Descrição Rótulos		ude:detectionfraud.fr		
ID do modelo Descrição Rótulos Data de criação Expiração do mode	domingo, 1	17 de julho de 2022 1		
Descrição Rótulos Data de criação Expiração do mode	domingo, 1	17 de julho de 2022 1	7:58:00 GMT-03:00 2022 17:58:00 GMT-03:00	
Descrição Rótulos Data de criação Expiração do mode Data da modificaçã	domingo, 1	17 de julho de 2022 1 a, 15 de setembro de	7:58:00 GMT-03:00 2022 17:58:00 GMT-03:00	
Descrição Rótulos Data de criação	domingo, 1 domingo, 1 domingo, 1 us-east4	17 de julho de 2022 1 a, 15 de setembro de	7:58:00 GMT-03:00 2022 17:58:00 GMT-03:00	
Descrição Rótulos Data de criação Expiração do mode Data da modificaçã Local dos dados	domingo, 1 elo quinta-feir domingo, 1 us-east4 LOGISTIC_	17 de julho de 2022 1 a, 15 de setembro de 17 de julho de 2022 1	7:58:00 GMT-03:00 2022 17:58:00 GMT-03:00	
Descrição Rótulos Data de criação Expiração do mode Data da modificaçã Local dos dados Tipo de modelo	domingo, 1 quinta-feiri domingo, 1 us-east4 LOGISTIC_ Perda méd	17 de julho de 2022 1 a, 15 de setembro de 17 de julho de 2022 1 REGRESSION dia de registros	7:58:00 GMT-03:00 2022 17:58:00 GMT-03:00	

fraudelogreg			
DETALHES TR	EINAMENTO	AVALIAÇÃO	ESQUEMA
Opções de trei	namento		
Opções de treinament este modelo.	o são os parâme	tros opcionais adicio	onados ao script para criar
Máximo permitido de iterações	20		
lterações reais	7		
Regularização de L1	0,00		
Regularização de L2	0,00		
Parada antecipada	verdadeiro		
Progresso relativo mínimo	0,01		
Estratégia de taxa de aprendizado	Pesquisa d	de linha	
Taxa de aprendizagem inicial da pesquisa de linha	0,10		
Calcular valores P	falso		





Ver como

Gráficos

Tabela

Iteração	Perda de dados de treinamento	Perda de dados de avaliação	Taxa de aprendizado	Duração (segundos)
6	0,0661	0,0762	12,8	1,86
5	0,0733	0,0818	6,4	2,01
4	0,0833	0,0904	3,2	1,95
3	0,0996	0,1051	1,6	2,10
2	0,1399	0,1438	0,8	1,92
1	0,2476	0,2499	0,4	1,99
0	0,4568	0,4577	0,2	1,77

Métricas agregadas @

Limite 🛭	0,5000
Precisão 🕜	0,7857
Retorno 🕜	0,1019
Acurácia 🕜	0,9801
Pontuação F1 🔞	0,1803
Perda de registro 🚱	0,0762
ROC AUC 🕜	0,8347

Limite de pontuação

Limite de classe 🕜 positiva	0	0,0006
Classe positiva	1	
Classe negativa	0	
Precisão 😯	0,0215	
Recall 🕜	1,0000	
Acurácia 🕜	0,0215	
Pontuação F1 🔞	0,0421	









VIEW TRAINING AND MODEL STATISTICS

SELECT * FROM ML.TRAINING_INFO(MODEL 'detectionfraud.fraudelogreg')

Resultados da consulta									
INFO	RMAÇÕES DO J	JOB	RESULTADOS JSON	DETALHES DA EXE	ECUÇÃO				
Linha	training_run	iteration	loss	eval_loss	learning_rate	duration_ms			
1	0	6	0.0660689048175093	0.076211590107441288	12.8	1862			
2	0	5	0.0733322592129123	0.0818471968291359	6.4	2013			
3	0	4	0.083274893248983586	0.090380551469115028	3.2	1953			
4	0	3	0.099596756583153048	0.10514496604271718	1.6	2102			
5	0	2	0.13992833832035029	0.14380429430332167	0.8	1924			
6	0	1	0.24756823850895485	0.2498506750300602	0.4	1994			
7	0	0	0.45678170962249204	0.45771485850754284	0.2	1772			

• EVALUETION MODEL

```
SELECT

*

FROM

ML.EVALUATE(

MODEL 'detectionfraud.fraudelogreg', (

SELECT

* EXCEPT(state, city_pop, is_fraud),

is_fraud AS label,

FROM

'detectionfraud.fraude_notnull'

ORDER BY profile DESC

LIMIT 4395

));
```

Res	ultados da consul	ta	📥 SALVAR RESUI	≜ SALVAR RESULTADOS ▼			
INFO	RMAÇÕES DO JOB	RESULTADOS J	SON DETALHES D	A EXECUÇÃO			
Linha	precision	recall	accuracy	f1_score	log_loss	roc_auc	
1	0.5168539325842697	0.32857142857142857	0.96882821387940843	0.40174672489082969	0.270673729250454	0.86228471528471529)

• PREDICT

```
SELECT

*
FROM
ml.PREDICT(
| MODEL 'detectionfraud.fraudelogreg',(
SELECT
| * EXCEPT(state, city_pop)
FROM
| 'detectionfraud.fraude_notnull'
)
);
```

Res	Resultados da consulta									★ SALVAR RESULTADOS ▼		
INFO	RMAÇÕES DO JOB	RESULTA	ADOS JSON	DETALHES D	A EXECUÇ	ÃO						
Linha	predicted_label	prediclabel	predicprob	gender	city	job	profile	category	amt	is_fraud	merchant	
1	0	1	0.024193180236516402	FEMININO	Bronx	Chartered accountant	adults_50up_female_urban.json	home	159.47	0	fraud_Schmidt-Larkin	
		0	0.9758068197634836									
2	0	1	0.016103652435063971	FEMININO	Bronx	Chartered accountant	adults_50up_female_urban.json	home	9.37	0	fraud_Durgan	
		0	0.983896347564936									
3	0	1	0.016563050228628664	FEMININO	Bronx	Chartered accountant	adults_50up_female_urban.json	home	17.55	0	fraud_Stark-Koss	
		0	0.9834369497713713									
4	0	1	0.0167859938660795	FEMININO	Bronx	Chartered accountant	adults_50up_female_urban.json	home	25.86	0	fraud_Ernser-Feest	
		0	0.98321400613392052									

• EXPLAIN MODEL

SELECT * FROM ML.WEIGHTS(MODEL 'detectionfraud.fraudelogreg')

	processed_input	category_weights.category	category_weights.weight -
1.	city	East Liverpool	6.020137176654214
2.	job	Music tutor	3.5396194484601717
3.	city	Kingsport	3.5396194484601717
4.	job	Private music teacher	3.1673547046539454
5.	city	Austin	3.1673547046539454
6.	job	Community education officer	2.968887100682255
7.	city	Orlando	2.968887100682255
8.	merchant	fraud_Gibson-Deckow	1.7844888200591091
9.	merchant	fraud_Hamill-Daugherty	1.7447740745286155
10.	merchant	fraud_Stehr	1.5338814946022903
11.	merchant	fraud_Huel-Langworth	1.4614119752266637
12.	merchant	fraud_Padberg-Welch	1.3109856792099994
13.	merchant	fraud_Rodriguez	1.2955908989732294
14.	merchant	fraud_Dooley-Thompson	1.2225352378952936
15.	merchant	fraud_Kuhic LLC	1.1398444020336576
16.	merchant	fraud_Hayes	0.9950717838359999
17.	merchant	fraud_Fritsch LLC	0.9512126416586079
18.	merchant	fraud_Heathcote LLC	0.848004186166883
19.	merchant	fraud_Kassulke PLC	0.8456628318786367
20.	merchant	fraud_Berge LLC	0.8159448328275194

TESTE 2 COM AUTO_CLASS_WEIGHTS = TRUE

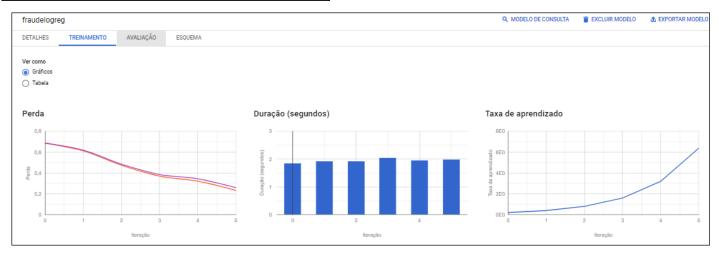
CRIAÇÃO DO MODELO

A tabela possui 29301 linhas, foi retirado 15% (4395) para verificação do modelo.

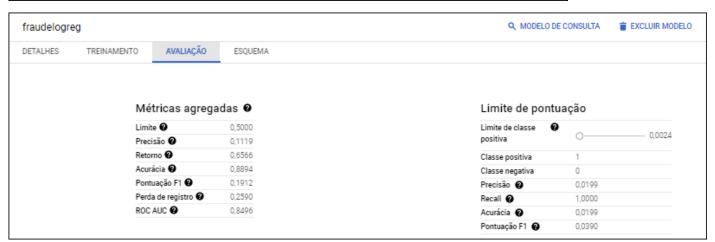
```
CREATE OR REPLACE MODEL 'detectionfraud.fraudelogreg'
OPTIONS(model_type='logistic_reg', AUTO_CLASS_WEIGHTS=TRUE) AS
SELECT

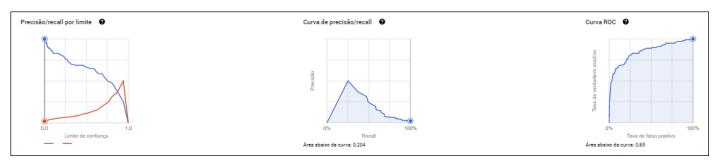
* EXCEPT(state, city_pop, is_fraud),
is_fraud AS label,
FROM

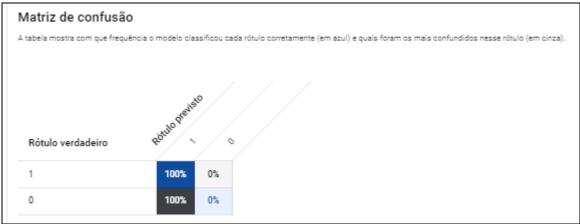
'detectionfraud.fraude_notnull'
ORDER BY
profile
LIMIT 24986;
```











VIEW TRAINING AND MODEL STATISTICS

SELECT * FROM ML.TRAINING_INFO(MODEL 'detectionfraud.fraudelogreg')

Res	Resultados da consulta									
INFORMAÇÕES DO JOB RESULTADOS JSON DETALHES DA EXECUÇÃO										
Linha	training_run	iteration	loss	eval_loss	learning_rate	duration_ms				
1	0	5	0.23273609039595519	0.25900120443167751	6.4	1994				
2	0	4	0.32155541574638391	0.34454977392012533	3.2	1964				
3	0	3	0.36948390905071443	0.38494275776209708	1.6	2044				
4	0	2	0.47493651140184023	0.49512749872368538	0.8	1927				
5	0	1	0.61243352305329	0.618797773392912	0.4	1925				
6	0	0	0.6848020869916428	0.69766665069291274	0.2	1847				

EVALUETION MODEL

```
SELECT

| *
| FROM | ML.EVALUATE( | MODEL 'detectionfraud.fraudelogreg', ( | SELECT | * EXCEPT(state, city_pop, is_fraud), | is_fraud AS label, | FROM | 'detectionfraud.fraude_notnull' ORDER BY profile DESC | LIMIT 4395 | );
```

Resultados da consulta								
INFO	INFORMAÇÕES DO JOB RESULTADOS JSON DETALHES DA EXECUÇÃO							
Linha	precision	recall	accuracy	f1_score	log_loss	roc_auc		
1	0.14682080924855492	0.92028985507246375	0.82957906712172924	0.25324027916251246	0.5177075076623544	0.9331038961038961		

PREDICT

```
SELECT

*
FROM
ml.PREDICT(
    MODEL 'detectionfraud.fraudelogreg',(
    SELECT
    | * EXCEPT(state, city_pop)
    FROM
    | 'detectionfraud.fraude_notnull'
)
);
```

Res	Resultados da consulta											
INFO	RMAÇÕES DO JOB	RESULTA	ADOS JSON	DETALHES [A EXECU	ÇÃO						
Linha	predicted_label	prediclabel	predicprob	gender	city	job	profile	category	amt	is_fraud	merchant	SPLIT
1	0	1	0.26391331605130726	FEMININO	Bronx	Chartered accountant	adults_50up_female_urban.json	home	159.47	0	fraud_Schmidt-Larkin	null
		0	0.7361966939496929									
2	0	1	0.16142930005134379	FEMININO	Bronx	Chartered accountant	adults_50up_female_urban.json	home	9.37	0	fraud_Durgan	null
		0	0.83857069994865618									
а	0	1	0.166192607572752	FEMININO	Bronx	Chartered accountant	adults_50up_female_urban.json	home	17.55	0	fraud_Stark-Koss	null
		0	0.933907392427249									
4	0	1	0.16966022342039306	FEMININO	Bronx	Chartered accountant	adults_50up_female_urban.json	home	25.86	0	fraud_Ernser-Feest	null
		0	0.830339776579617									
5	0	1	0.17837736778130703	FEMININO	Bronx	Chartered accountant	adults_50up_female_urban.json	home	39.96	0	fraud_Ernser-Feest	null
		0	0.821622632218693									

• EXPLAIN MODEL

 ${\tt SELECT * FROM ML.WEIGHTS(MODEL `detectionfraud.fraudelogreg`)}$

	processed_input	category_weights.category	category_weights.weight •
1.	city	East Liverpool	5.799209691878422
2.	job	Music tutor	3.7903394656780254
3.	city	Kingsport	3.7903394656780254
4.	merchant	fraud_Reichert-Weissnat	3.6682076568208766
5.	merchant	fraud_Kozey-Kuhlman	3.5257847377600204
6.	job	Private music teacher	3.405738282956069
7.	city	Austin	3.405738282956069
8.	merchant	fraud_Weimann-Lockman	3.3893589250179588
9.	job	Community education officer	3.3324095525863258
10.	city	Orlando	3.3324095525863258
11.	merchant	fraud_Reilly and Sons	3.2359065956509916
12.	merchant	fraud_Schiller Ltd	3.225530044655185
13.	merchant	fraud_Block Group	3.1121491026460464
14.	merchant	fraud_Labadie LLC	3.0453683295998317
15.	merchant	fraud_Connelly PLC	2.893895070630142
16.	merchant	fraud_Ritchie	2.8659997232857064
17.	merchant	fraud_Lakin	2.7888853935472215
18.	merchant	fraud_Gottlieb-Hansen	2.7883877146115874
19.	merchant	fraud_Nader-Maggio	2.704018678695351
20.	merchant	fraud_Funk Group	2.6795635315665534