

UNIVERSIDAD NACIONAL DE ASUNCIÓN
FACULTAD POLITÉCNICA
INGENIERÍA EN INFORMÁTICA



**Pronóstico de la demanda en empresas retail.
Técnica basada en Business Intelligence y Machine
Learning**

Postulantes: Raúl Benítez
Alberto Garcete

PROYECTO DE GRADO PARA OBTENER EL DIPLOMA
ACADÉMICO DE INGENIERÍA EN INFORMÁTICA.

Asesores: PhD. Diego P. Pinto Roa
Ing. Aditardo Vázquez

2018

Capítulo 1

Introducción

En las *empresas retail*¹ o de ventas minoristas uno de los principales problemas con que se enfrentan es el manejo eficiente del stock de manera a evitar tener los productos en exceso en los depósitos que incurran en sobrecostos. En el otro extremo, la falta de dichos productos o ruptura de stock conlleva a pérdidas de oportunidades de ventas por no disponer del producto que puede generar insatisfacción de los clientes y a su vez ésto repercute en las utilidades de la empresa. Uno de los mayores desafíos en empresas de este sector es pronosticar de manera eficiente la demanda para el próximo período comercial [Gio17].

Actualmente en el proceso de gestión de compras se utilizan ciertas técnicas de pronósticos para determinar las cantidades de las órdenes de compra, dichas técnicas pueden ser cuantitativas o cualitativas [ASW⁺11]. Independientemente de la técnica elegida, el problema real de los pronósticos es su falta de confiabilidad, ya que por lo general no son precisos, entonces, la interrogante será siempre si los pronosticos son superiores o inferiores a la demanda real y en que medida [JLF12].

En consecuencia a lo anterior en el presente trabajo se plantea una nueva técnica para estimar los volúmenes de demanda del siguiente período comercial. Luego, esta estimación servirá de apoyo en la toma de decisión de la cantidad establecida en las órdenes de compras para la reposición de stock. En este nuevo enfoque se integran técnicas de Business Intelligence y Machine Learning.

En la etapa de Business Intelligence el objetivo principal es calcular los Indicadores Claves de Rendimiento abreviado por las siglas KPI (*del inglés “Key Performance Indicators”*) [Alv13] de los productos en base a los datos históricos obtenidos de las bases de datos transaccionales. Luego, cada serie de KPI obtenidos pasan por un proceso de etiquetado, donde el experto en compras los analiza y determina qué nivel de compra conviene para cada serie de KPI, para el proceso de aprendizaje.

En la etapa de Machine Learning se utilizan como entrada las series de KPI con sus etiquetas obtenidas en la etapa anterior y constituyen las instancias que alimentan los distintos algoritmos

¹Una empresa retail es cualquier comercio que vende sus productos al consumidor final, desde un supermercado a una tienda de barrio, desde un negocio de electrodomésticos a una franquicia textil, ya sea con cientos de puntos de venta o con un solo establecimiento.

de clasificación. Nótese que el enfoque corresponde a un proceso de aprendizaje supervisado. Posteriormente tienen lugar los procesos de entrenamiento y testeo para finalmente evaluar los distintos desempeños.

1.1. Motivación

En general las técnicas de pronóstico de la demanda cuantitativas dependen en gran medida de la variable: *cantidad de ventas*. Mientras que los pronósticos de demanda cualitativos dependen en gran medida de la opinión y experiencia del experto; que si bien pueden ser válidos se utilizan principalmente en casos donde la proyección es a largo plazo o ante carencia de datos históricos [ASW⁺11].

Otra debilidad de los pronósticos es que no se adaptan, es decir, las herramientas de pronósticos existentes en su mayoría utilizan algoritmos genéricos con la suposición de que la demanda puede predecirse de igual forma para todas las empresas, todas las industrias, todos los productos y para cualquier ubicación geográfica. Este enfoque de algoritmos genéricos obtiene pronósticos que no reflejan el impacto de los diferentes factores que afectan a la demanda; de la misma forma no se adapta a la evolución del mercado y el comportamiento de los consumidores [Gio17].

La oportunidad que surge es poder implementar una técnica de pronóstico de demanda automática o con una mínima intervención manual. Esta técnica permitiría paliar las debilidades de los modelos actuales, y a su vez que integraría las características esenciales de las técnicas cualitativas y cuantitativas existentes.

Como ya se mencionó, cualquiera sea la técnica aplicada el problema con los pronósticos es que generalmente no son precisos. En [SBO98], los autores mencionan que las desviaciones normales del pronóstico en general con respecto a los valores reales oscilan entre el 5 y el 40 %. Para el sector retail, la mayoría de las empresas puede pronosticar la demanda total de todos los productos, como un grupo con errores menores al 5 %, no obstante el pronóstico de la demanda de un producto puede generar errores considerablemente mayores [ASW⁺11].

En otros ámbitos, la importancia del pronóstico es de igual relevancia. Según un estudio realizado sobre pronósticos de tráfico en proyectos de infraestructura de transporte con una muestra importante que cubrió 210 proyectos en 14 países con un valor de U\$ 59.000 millones demostró que los pronosticadores realizan un trabajo pobre al realizar la estimación de la demanda de proyectos de infraestructura de transporte, para 9 de cada 10 proyectos ferroviarios, las previsiones de pasajeros fueron sobrestimadas con un promedio de 106 %, mientras que para la mitad de los proyectos de carreteras, la diferencia entre el tráfico real y el previsto es ± 20 %. El resultado es un riesgo financiero sustancial que los tomadores de decisiones suelen ignorar o minimizar en detrimento del bienestar social y económico [FHB05].

1.2. Planteamiento del Problema

Dado un conjunto de productos que una empresa retail ofrece en venta, este trabajo aborda el problema del pronóstico de la demanda para la reposición de stock. Se considera que la empresa retail opera un stock cíclico, con períodos de reposición regulares y se analizan los productos que no son estacionales.

En este contexto, este trabajo apuesta por una solución que automatice la toma de decisiones de reposición de stock, una técnica de pronóstico de la demanda basada en Business Intelligence y Machine Learning aplicadas en forma secuencial; que busca a través de los KPI, la opinión de un experto en compras y de los algoritmos de clasificación prever volúmenes eficientes de productos para la reposición de stock. La primera etapa, a partir del histórico de movimientos de stock y de los detalles de ventas, el módulo de Business Intelligence obtiene los KPI asociados por producto y período. En la segunda etapa, estos datos son utilizados como entradas al módulo de clasificación para determinar los volúmenes de compras para el siguiente periodo de ventas.

1.3. Objetivos

A continuación se dan a conocer el objetivo general y los objetivos específicos que se pretenden alcanzar con este trabajo.

1.3.1. Objetivo General

El objetivo general y aporte principal del presente trabajo es:

- Desarrollar una nueva técnica de pronóstico de la demanda para la toma de decisión en la reposición de stock integrando herramientas y conceptos de Business Intelligence y Machine Learning.

1.3.2. Objetivos Específicos

Los objetivos particulares para el logro del objetivo principal son:

- Reportar las principales soluciones que abordan el problema.
- Aplicar el proceso de Business Intelligence para obtener los KPI.
- Realizar el proceso de etiquetado y obtener las instancias de entrenamiento.
- Realizar el proceso de entrenamiento con los distintos clasificadores.
- Evaluar el rendimiento de los distintos clasificadores entrenados.

1.4. Organización del Trabajo Final de Grado

El libro se estructura de la siguiente manera:

- El Capítulo 2 presenta el concepto de Pronóstico de la Demanda y las principales técnicas de pronóstico utilizadas en la actualidad.
- El Capítulo 3 aborda los conceptos de Business Intelligence.
- El Capítulo 4 se enfoca en los conceptos referentes a Machine Learning.
- En el Capítulo 5 se explica el proceso de Business Intelligence para obtener los KPI junto con el etiquetado de los datos.
- En el Capítulo 6 se desarrolla el proceso de entrenamiento y selección de los algoritmos clasificadores, se muestran los resultados experimentales y se analiza el desempeño de los algoritmos.
- En el Capítulo 7 se extraen las conclusiones generales del trabajo, se contrastan los objetivos propuestos con los resultados obtenidos. Se describen las propuestas de trabajos futuros que complementarían la técnica propuesta.

Capítulo 2

Pronóstico de la Demanda

El pronóstico de la demanda es una técnica utilizada para estimar la cantidad de bienes o servicios que los consumidores demandarán en el futuro basadas en el conocimiento del pasado, como los datos históricos [Cha06]. La elaboración de pronósticos de demanda precisos es uno de los retos más importantes en empresas del tipo retail, determinar que sucederá en el futuro con el fin de tomar decisiones adecuadas es un problema que se presenta con frecuencia [SBO98]. En un escenario inicial se tienen los depósitos llenos de productos listos para ser llevados a los mostradores. A medida que pasa el tiempo la cantidad en depósito va decreciendo por la demanda de los clientes y llegado un momento crítico hay que tomar la decisión de reponer el stock. Si bien la reposición de stock se lleva a cabo dentro de un proceso empresarial llamado *Administración de Compras*, hay un componente vital dentro de este proceso que es la estimación de la cantidad o volumen de productos a adquirir para reponer el stock. Es ahí donde entra en juego el pronóstico de la demanda [AE91].

A continuación se explicará sintéticamente el proceso de *Administración de Compras*, para luego analizar las principales técnicas de pronósticos de demanda que están vigentes en el mundo empresarial.

2.1. Administración de compras

Los términos *compras*, *adquisiciones*, *administración de materiales*, *logística*, *abastecimiento*, *administración del suministro* y *administración de la cadena de suministro* se utilizan de manera indistinta ya que no existe un consenso general sobre la terminología. El proceso de adquisición es el eje central de la actividad empresarial de administración de compras y del suministro. Cualquier organización requiere de proveedores por lo que es muy importante acoplarlos con efectividad al entorno organizacional, y que las decisiones de compras no contradigan las estrategias de la empresa. Las empresas centran sus esfuerzos en aumentar sus ingresos, disminuir sus costos, o una combinación de ambos a fin de obtener ganancias de la forma más eficiente posible [JLF12].

Este trabajo intenta contribuir a lograr decisiones eficientes de compras basadas en pronósti-

cos de demanda precisos. Se considera que es un componente importante dentro de la planeación estratégica y operacional la estimación eficiente de la cantidad o volumen de productos para la reposición del stock del siguiente período de ventas [PMAR07].

El stock o existencia de una empresa es el conjunto de materiales y artículos que se almacenan, tanto aquellos que son necesarios para el proceso productivo como los destinados a la venta [DDM15]. La función que desempeña el stock o existencia en una empresa son [A10]:

- Evitar la escasez, ante la incertidumbre de la demanda o ante un posible retraso en la reposición o suministro de los pedidos.
- Aprovechar la disminución de los costes a medida que aumenta el volumen de compras o de fabricación.
- Lograr un equilibrio entre las compras y las ventas para alcanzar la máxima competitividad.

El proceso de compras o adquisiciones se trata de un conjunto de etapas:

1. Detectar la necesidad.
2. Traducir la necesidad en una especificación comercial.
3. Buscar potenciales proveedores.
4. Seleccionar el proveedor adecuado.
5. Detallar la orden de compra y pactar el suministro.
6. Recibir los productos.
7. Pagar a los proveedores.

En el punto 5, en el detalle de la orden se ven reflejadas las estimaciones de las cantidades a comprar de los productos, en este proceso el caso ideal por supuesto sería poder adivinar por cada producto la cantidad exacta que se va a vender en el siguiente periodo de venta. De este modo al finalizar cada periodo de ventas se dispondría de un stock de cero unidades, con lo cual se llegaría a una máxima eficiencia en la cantidad o volumen de productos comprados. Sin embargo adivinar es una tarea imposible, lo que si se puede hacer es predecir eficientemente la demanda futura.

Del por qué la importancia de estimar de forma correcta esta cantidad o volumen, los expertos en negocios explican que los productos parados en stock mientras no se venden es capital inmovilizado, además que generan sobrecostos de mantenimiento como seguros, personal encargado, fecha de vencimiento de los productos, etc [PMAR07]. Otro hecho no deseado a causa de una mala estimación es la ruptura de stock, es decir, no disponer de un producto cuando existan clientes interesados en comprarlo, lo cual también se considera como una pérdida para

la empresa. En este punto, con una estimación acertada lo que se desea es mantener un nivel de stock óptimo, es decir, tener suficiente cantidad para satisfacer la demanda sin roturas de stock y por otra parte evitar que haya un exceso inútil del mismo. Si bien el presente trabajo no toma en cuenta los costos asociados al almacenamiento, lo que se busca es pronosticar la cantidad o volumen de demanda de productos de forma eficiente utilizando las herramientas de Business Intelligence y Machine Learning para el siguiente periodo.

Una administración efectiva de las compras y del suministro contribuye de manera significativa al éxito organizacional. La función del suministro evoluciona a medida que la tecnología y el ambiente competitivo mundial requieren enfoques innovadores [JLF12].

Antes de realizar una compra surgen las siguientes preguntas:

- Cuándo debemos realizar un pedido?
- Qué cantidad debemos solicitar en cada pedido?
- Cuántas unidades de cada artículo debemos mantener en stock?

Para responder estas preguntas una de las herramientas que ayudan son las técnicas de pronósticos de demanda, entre las que se destacan los *Métodos de Pronósticos Cualitativos* y los *Métodos de Pronósticos Cuantitativos* [ASW⁺11] [HH08].

2.2. Métodos de pronósticos cualitativos

Las principales técnicas cualitativas de pronóstico de demanda son [VAH11][HH08]:

- Opinión del Gerente: El pronóstico se basa en la opinión, experiencia o el conocimiento técnico de las condiciones de un solo gerente. Pueden haber datos en los cuales el gerente apoya su decisión.
- Junta de opinión ejecutiva: Similar al método anterior, la diferencia está en que se basa en un grupo de ejecutivos que intercambian opiniones, perspectivas y conocimientos, luego formulan y componen ideas comunes que sirven de base para emitir un pronóstico unificado, compartiendo de este modo la responsabilidad.
- Consulta a la fuerza de ventas: Esta técnica se basa en la experiencia del personal más cercano al cliente que es el cuerpo de vendedores de la empresa. Cada vendedor realiza una estimación de la demanda en su zona de influencia. Luego las estimaciones son revisadas por los mandos superiores, para obtener un pronóstico corporativo final.
- Encuesta en el mercado de consumo: Se encuesta a los clientes acerca de sus planes de compras, sus intereses por determinados productos o posibles nuevas características. La estimación se extrae de los resultados de las encuestas. Son útiles para elaborar planes de marketing, lanzamiento de nuevos productos, etc.

- Método Delphi: Se basa en identificar un panel de expertos que pueden ser gerentes, empleados comunes, o expertos del sector. Se tiene un cuestionario donde cada uno de ellos lo completa de forma aislada. Se integran todas las respuestas, luego cada experto tiene acceso al set de respuestas y puede ajustar su respuesta conforme le parezca conveniente. Este proceso se repite iterativamente hasta alcanzar un cierto nivel de consenso. Finalmente los resultados de este panel de expertos sirven de base para las decisiones de pronóstico de las gerentes.
- Analogía de productos similares: Se basa en el comportamiento de las ventas de un producto similar o modelo. Técnica útil para nuevos productos que se quieren introducir en el mercado y de los cuales no se dispone de información histórica de ventas, entonces se puede pronosticar haciendo analogía con productos sustitutos o complementarios.

2.3. Métodos de pronósticos cuantitativos

Estos modelos se basan en métodos de pronósticos estadísticos que a partir de los datos históricos de ventas y suponiendo que las tendencias históricas continuarán, son capaces de anticipar la demanda futura [HH08]. En general, para modelar cuantitativamente se debe disponer de información sobre la variable a pronosticar, la información debe ser cuantificable y el patrón histórico de cierto modo se debe repetir en el futuro [ASW⁺11].

El pronóstico de la demanda de productos es sólo una aplicación importante de estos métodos. En otros casos, los pronósticos se podrían utilizar para evaluar los requerimientos de cantidades variadas como las partes de repuestos, el rendimiento de la producción y las necesidades de personal. Las técnicas de pronóstico se usan también frecuentemente para anticipar las tendencias económicas a nivel regional, nacional o incluso internacional [HH08].

En general, los métodos cuantitativos se clasifican en técnicas de series de tiempo y en pronósticos causales.

2.3.1. Métodos de series de tiempo

Una serie de tiempo es un conjunto de observaciones de la variable a pronosticar, medidas en puntos o períodos sucesivos del tiempo pasado [HH08]. El histórico de ventas de un producto donde se observan valores diarios de las cantidades vendidas constituye un buen ejemplo de serie de tiempo. Los datos históricos de la variable a predecir están limitados a sus valores pasados.

El objetivo del método es obtener una buena predicción del valor futuro de la variable a pronosticar, enmarcado por supuesto en la serie de tiempo. Para lograr el objetivo, el método debe descubrir el patrón dentro de la serie y luego ser capaz de extrapolarlo hacia el futuro [ASW⁺11]. De cierta manera, hay una suposición intrínseca al modelo de que los factores que influyen en las ventas pasadas y presentes continuarán a futuro.

Si bien el volumen de ventas es un buen indicador de la historia de la demanda, no toma en cuenta muchos aspectos del proceso entero de las ventas, como pueden ser la ruptura de

stock, plazos de reposición de stock, precio del producto, la incidencia del marketing u otros. De igual modo se pueden descubrir tendencias, estacionalidad, ciclos, etc., en la historia de la demanda para luego extrapolarlo a un tiempo futuro. También hay que destacar que el intervalo del muestreo tiene mucha influencia en el pronóstico y por ende en los resultados obtenidos [PMAR07].

En el sentido estricto de la interpretación es erróneo hablar de pronosticar el siguiente valor de la observación en una serie de tiempo. Como este valor puede ser cualquiera y dependerá de circunstancias futuras que son ajenas al control humano, entonces es imposible predecirlo exactamente. El siguiente valor de una serie de tiempo es una variable al azar y tiene alguna distribución de probabilidades. Si ese siguiente valor es la media de la distribución de probabilidades acertaría el problema, pero se desconoce su distribución de probabilidades así como también su media [REF].

Lo mejor que se puede realizar es una estimación de la media tan cerca como sea posible, utilizando todos los datos disponibles. La meta de los métodos de pronóstico de series de tiempo es estimar la media de la distribución de probabilidades subyacente del siguiente valor de la serie de tiempo tan cerca como sea posible. Para una serie de tiempo que tiene exactamente la misma distribución para todos y cada uno de los periodos, el método de pronóstico de promedios proporciona la mejor estimación de la media, pero en general se usan otros métodos de pronósticos porque la distribución cambia con el paso del tiempo. Si la distribución de probabilidad de una serie sigue siendo la misma en el siguiente periodo entonces se dice que es estable (puede haber cambios en la distribución pero deben ser pequeños). Si la distribución de probabilidad presenta cambios grandes y frecuentes entonces se dice que es inestable [HH08].

El rol del analista es capturar los componentes del patrón de la demanda y luego traducirlo a un valor de pronóstico. Para Johnson [JLF12] este patrón tiene seis componentes básicos: valor constante (la fluctuación de los datos alrededor de una media constante), tendencia (el incremento o decremento sistemático de la media a lo largo del tiempo), variaciones estacionales, cíclicas, aleatorias y puntos críticos. Para Anderson [ASW⁺11] el patrón de los datos en una serie de tiempo tienen cuatro componentes separados: tendencia, cíclico, estacional e irregular, y que luego se combinan para generar los valores de la serie de tiempo.

Se analizan estos cuatro componentes:

1. *Componente de tendencia*: Los valores de la serie de tiempo pueden ir cambiando gradualmente, tendiendo hacia valores que incrementan o que disminuyen. Cuando estos incrementos o disminuciones se dan por periodos de tiempo prolongados se dice que la serie tiene un componente de tendencia. La figura 2.1.a) muestra una tendencia no lineal; en este caso la serie de tiempo indica poco crecimiento inicial, luego un periodo de rápido crecimiento y por último una estabilización. En la figura 2.1.b) la tendencia lineal decreciente de la gráfica es útil para las series de tiempo que muestran una declinación constante en el tiempo. En la figura 2.1.c) la línea horizontal en la gráfica representa una serie de tiempo que no tiene un aumento o disminución constante en el

tiempo, y por tanto no muestra tendencia. Generalmente el componente tendencia se debe a factores a largo plazo.

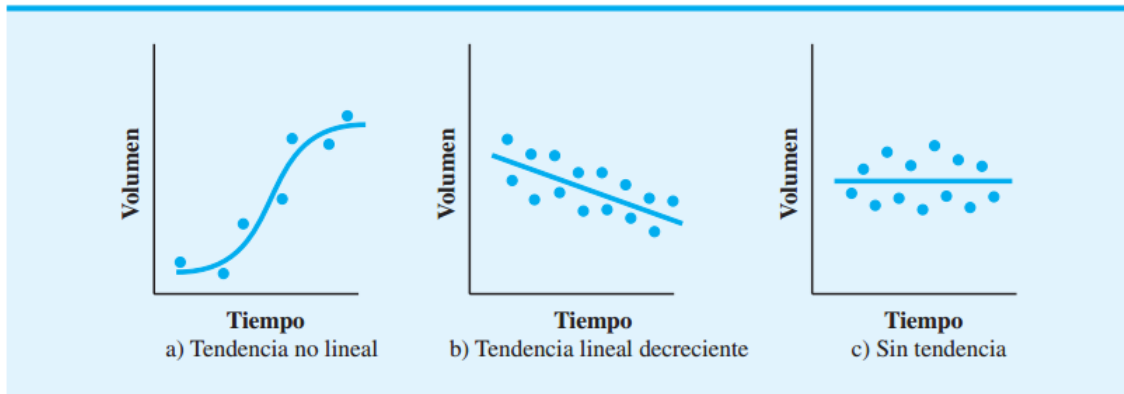


Figura 2.1: Ejemplos del componente tendencia en las series de tiempo [ASW⁺11].

2. *Componente cíclico*: es habitual que los puntos de la serie de tiempo se encuentren por encima o por debajo de la línea de tendencia. Cuando el patrón de puntos está de forma alterna por encima y por debajo de la línea de tendencia durante períodos mayor a un año, entonces estamos ante presencia del componente cíclico de la serie de tiempo. Esto se observa en la figura 2.2

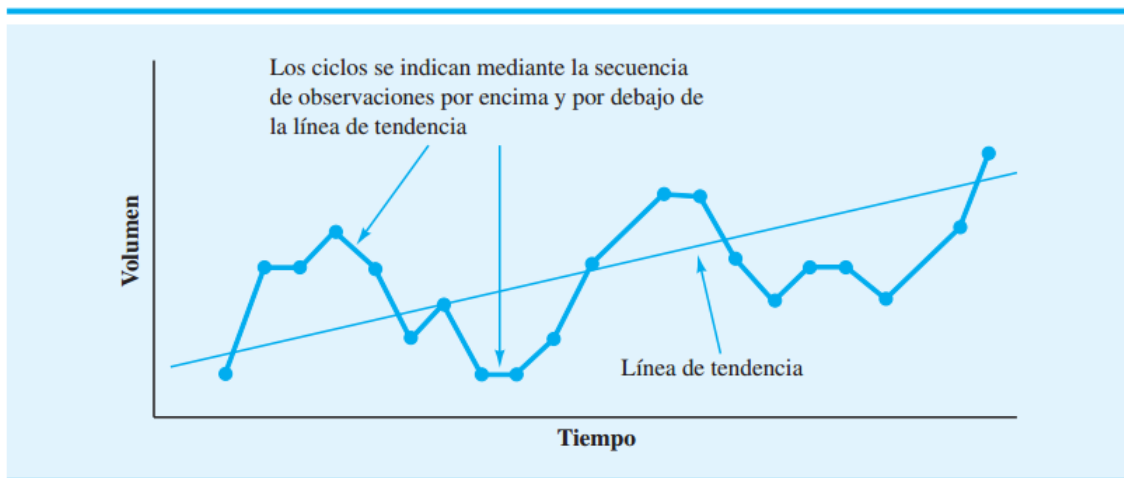


Figura 2.2: Ejemplo del componente cíclico y de tendencia en las series de tiempo [ASW⁺11].

3. *Componente estacional*: Cuando el patrón de puntos está por encima o por debajo de la línea de tendencia durante períodos alternos menores o igual a un año, entonces estamos ante presencia del componente estacional de la serie de tiempo. Las altas cantidades de ventas de abrigo durante el otoño e invierno son patrones que se repite debido a la influencia estacional. En ciertos tipos de productos, las ventas que se anticipan en un mes particular están influidas por la temporada del año. Por ejemplo, un producto que es popular en Navidad, podría tener ventas en diciembre que son dos veces mayores que las ventas de enero [HH08].

4. *Componente irregular*: Se refiere a la presencia de variabilidad aleatoria en la serie de tiempo. Corresponde a aquellos puntos que aparecieron desviados en relación a lo esperado de los efectos del componente de tendencia, cíclico y estacional. Como este componente es impredecible no se puede cuantificar el impacto que tiene en la serie de tiempo. Generalmente es debido a factores a corto plazo o a circunstancias casuales.

En general, los métodos de series de tiempo se clasifican en [HH08]:

- El método de pronóstico del último valor: Este método utiliza solamente el último valor de la serie de tiempo como pronóstico del valor futuro. También es conocido como método ingenuo, porque sin mucho análisis aparentemente resulta ingenuo elegir un solo valor de toda la serie. Pero en ocasiones sí es una buena aproximación, como por ejemplo cuando hay demasiada fluctuación en la serie y entonces el último valor se convierte en el más fiable. Recomendable para series de tiempo inestables.

$$\text{Pronóstico} = \text{último valor} \quad (2.1)$$

- El método de pronóstico por promedios: En este caso se utilizan todos los valores de la serie y luego se promedia para obtener el valor de pronóstico de la serie. Recomendable para series de tiempo estables, razón por la cual todos los valores tienen el mismo peso y son considerados relevantes.

$$\text{Pronóstico} = \text{promedio de todos los valores hasta la fecha} \quad (2.2)$$

- El método de pronóstico de promedio móvil: Consiste en considerar solamente los últimos n períodos y luego promediarlo para así obtener el valor de pronóstico de la serie. Recomendable para series de tiempo medianamente estables, razón por la cual se toman en cuenta únicamente n valores que tienen el mismo peso y que son considerados importantes.

$$\text{Pronóstico} = \text{promedio de los últimos } n \text{ valores} \quad (2.3)$$

donde:

$$n = \text{número de periodos más recientes}$$

- El método de pronóstico por suavizamiento exponencial: Con este método se asignan pesos diferentes a los valores de la serie. El último período es el de mayor peso y así paulatinamente se van asignando pesos cada vez menores a los valores más antiguos de la serie. Este resultado se puede obtener de forma simple y sintética mediante una combinación del último valor de la serie y del último pronóstico correspondiente a dicho último valor.

$$\text{Pronóstico} = \alpha * (\text{último valor}) + (1-\alpha) * (\text{último pronóstico}) \quad (2.4)$$

donde:

α es una constante entre 0 y 1 llamada “constante de suavizamiento”.

Para series de tiempo estables es recomendable valores de α pequeños como 0,1, y para series de tiempo inestables valores mayores. En general en aplicaciones de hoy en día se utilizan valores entre 0,1 y 0,3.

- El método de suavizamiento exponencial con tendencia: El inconveniente del método de pronóstico por suavizamiento exponencial sin tendencia es que justamente se retrasa respecto de la tendencia ya que no lo toma en cuenta. Al considerar la tendencia se obtienen pronósticos más precisos. Se calcula la pendiente actual de la línea de tendencia para luego ajustar el nuevo pronóstico a la pendiente obtenida. Los valores más recientes de la serie de tiempo se utilizan para obtener la línea de tendencia actual y pueden tener dirección ascendente, descendente u horizontal.

■

$$\text{Pronóstico} = \alpha * (\text{último valor}) + (1-\alpha) * (\text{último pronóstico}) + \text{tendencia estimada} \quad (2.5)$$

donde:

$$\text{tendencia estimada} = \beta * (\text{última tendencia}) * (1-\beta) * (\text{estimación anterior}) \quad (2.6)$$

$$\begin{aligned} \text{última tendencia} = & \alpha * (\text{último valor} - \text{penúltimo valor}) + \\ & (1-\alpha) * (\text{último pronóstico} - \text{penúltimo pronóstico}) \end{aligned} \quad (2.7)$$

con β (beta) es una constante de suavizamiento de tendencia entre 0 y 1. La elección del valor y rango de β tienen igual significado que α .

- **ARIMA (Auto Regresive Integrated Moving Average):** *En estadística y econometría, en particular en series temporales, ARIMA es un modelo estadístico que utiliza variaciones y regresiones de datos estadísticos con el fin de encontrar patrones para una predicción hacia el futuro. Se trata de un modelo dinámico de series temporales, es decir, las estimaciones futuras vienen explicadas por los datos del pasado y no por variables independientes. Fue desarrollado a finales de los sesenta del siglo XX. Box y Jenkins (1976) lo sistematizaron*

2.3.2. Pronósticos causales

Ciertamente las series de tiempo se basan en un solo indicador clave, como lo es por ejemplo la variable ventas. Siguiendo el ejemplo, el objetivo de la serie de tiempo es encontrar un valor

de pronóstico de la variable ventas a partir de valores pasados. Ahora bien, si tenemos dos variables en relación causa-efecto las series de tiempo no nos sirven.

El pronóstico causal obtiene una proyección de la cantidad de interés (la variable dependiente) relacionándola directamente con una o más cantidades (las variables independientes) que impulsan la cantidad de interés. Por ejemplo, las promociones sobre uno o varios productos pueden ser la causa de una mayor cantidad de ventas en dichos artículos, como tal tenemos una relación causa (promociones)-efecto (mayores ventas), es decir las promociones provocan cambios en los niveles de ventas [HH08].

Una de las técnicas para resolver problemas de pronósticos causales es la *regresión lineal*. El objetivo de este método es encontrar la línea recta que más se aproxime a la relación entre la variable dependiente y la/s variable/s independiente/s. Cuando hay una sola variable independiente la forma de la ecuación es la de la recta:

$$y = a + bx \quad (2.8)$$

donde:

y = variable dependiente,

x = variable independiente,

a = intersección de la línea con el eje y ,

b = pendiente de la línea

Para obtener a y b se utiliza el método llamado de *mínimos cuadrados*, que encuentra el par de valores a y b tal que la suma del cuadrado de los errores de estimación sea el menor posible. Para problemas donde se consideran varios indicadores clave como variables independientes, la ecuación presenta la siguiente forma:

$$y = a + b_1x_1 + b_2x_2 + \dots + b_nx_n \quad (2.9)$$

Donde el proceso de obtención de a y b_1, b_2, \dots, b_n es también por el método de *mínimos cuadrados*.

2.3.3. Precisión de los métodos cuantitativos

Para medir la desviación que hay entre el pronóstico y el valor real se utiliza normalmente el valor del *error promedio del pronóstico*, conocido como *Desviación Media Absoluta (MAD - Median Absolute Deviation)* y que se calcula con la siguiente fórmula:

$$MAD = \frac{\text{suma de los errores de pronóstico}}{\text{número de pronósticos}} \quad (2.10)$$

Otra forma significativa de medir la precisión es a través del *Error Cuadrático Promedio* (*MSE - Mean Squared Error*) y que se calcula de la siguiente forma:

$$MSE = \frac{\text{suma de los cuadrados de los errores de pronóstico}}{\text{número de pronósticos}} \quad (2.11)$$

El resultado de esta última fórmula pone de relieve los errores grandes de pronóstico, así como también destaca si el método de pronóstico es preciso. Se utiliza como complemento informativo a MAD.

2.4. Revisión Literaria acerca del pronóstico de la demanda

Los pronósticos de la demanda son de vital importancia para todas las organizaciones de negocios, así como para la toma de decisiones importantes de los gerentes, es una técnica fundamental utilizada para el logro de los objetivos en la decisiones estratégicas y tácticas de la organización y su gestión. El propósito del pronóstico es estimar la cantidad de bienes y servicios que los clientes consumirán en el futuro [SS17]. En esta sección se hace una revisión acerca de la literatura existente respecto al pronóstico de la demanda, los métodos de pronósticos utilizados y sus áreas de aplicación.

En el trabajo [HGS17], los autores se enfocan en pronosticar la demanda diaria de productos alimenticios perecederos utilizando el método ARIMA

2.5. Relación con el problema de estudio

Este capítulo pretendió dar a conocer las técnicas de pronósticos de demanda clásicas ampliamente conocidas y estudiadas en los diferentes textos consultados [JLF12][VAH11][HH08][ASW⁺11]. Si bien el presente trabajo también busca encontrar una estimación de pronóstico como lo hacen las técnicas de esta sección, debe quedar claro que la solución propuesta es una alternativa distinta, es decir, no se trata de un método cualitativo ni cuantitativo propiamente dicho, sin embargo toma ciertos aspectos de ambos y se implementa con conceptos, tecnologías y herramientas de solución totalmente diferentes.

2.6. Resumen

Capítulo 3

Business Intelligence

En la actualidad Business Intelligence está siendo cada vez más adoptado por las organizaciones debido a la necesidad de los mandos superiores de contar con información rápida y precisa necesaria para la toma de decisiones y su importancia a nivel estratégico y operativo, en este capítulo se presenta los conceptos y una introducción al Business Intelligence [Sch08][JC10].

3.1. Definición

Business Intelligence no se trata ni de un producto ni de un sistema, es una arquitectura que engloba un conjunto de conceptos, técnicas de computación y herramientas para analizar y transformar los datos empresariales en información significativa y útil que permite ser de apoyo a las organizaciones en la toma de decisiones y brindarles una visión estratégica, táctica y operativa más efectivas mediante un acceso fácil a los datos empresariales. Las tecnologías de Business Intelligence ofrecen vistas históricas, actuales y predictivas de las operaciones, son procesos que se extienden en el tiempo, capaces de manejar grandes volúmenes de datos que ayudan a identificar, crear y desarrollar nuevas estrategias de negocios para mejorar la competitividad. La era actual de las tecnologías de la información ha llevado a la necesidad de tener mejores, más rápidas y más eficientes métodos de extraer los datos de una organización, transformarlo en información y distribuirlo a las cadenas de mando. Business Intelligence responde a dicha necesidad [MA03][JC10][Can07].

El primero que acuñó el término fue Howard Dresner, quién fue consultor de Gartner Group. Dresner utilizó el término para describir un conjunto de conceptos y métodos que mejoran la toma de decisiones, partiendo de la información disponible acerca de los hechos. Del glosario de términos de Gartner se extrae la siguiente definición [Gar06]:

“Business Intelligence es un proceso interactivo para explorar y analizar información estructurada sobre un área (normalmente almacenada en un datawarehouse), para descubrir tendencias o patrones, a partir de las cuales derivar ideas y extraer conclusiones. Las áreas incluyen clientes, proveedores, productos, servicios y competidores. El proceso de business intelligence incluye la comunicación de los descubrimientos y efectuar los cambios”.

The Datawarehouse Institute propone una definición mas formal [EH05]:

“Business Intelligence es un término paraguas que abarca los procesos, las herramientas y las tecnologías para convertir datos en información, información en conocimiento y planes para conducir de forma eficaz las actividades de los negocios. Business Intelligence abarca las tecnologías de datawarehousing, los procesos en el ‘back end’¹, consultas, informes, análisis y las herramientas para mostrar información (herramientas de Business Intelligence) y los procesos en el ‘front end’”.

3.1.1. Objetivos

Según lo expuesto en la definición, Business Intelligence tiene los siguientes objetivos principales [Can07]:

- Convertir datos en información, información en conocimiento y conocimiento en planes operativos o estratégicos.
- Facilitar la disponibilidad de información a los usuarios de negocios, que les ayude a tomar decisiones más rápidamente.
- Apoyar de forma sostenible y continuada a las organizaciones para mejorar su competitividad, ante el entorno de negocios cambiante de forma que puedan adaptarse a él.
- Ante la cantidad de información que va creciendo, disponer de más tiempo en analizarla, en vez de gastar mucho tiempo en prepararla, organizarla y estructurarla.
- Permitir a las organizaciones dirigir de mejor forma, decidir, medir, gestionar y optimizar el alcance de la eficiencia y los resultados financieros.
- Disminuir sustancialmente la incertidumbre que existe ante la toma de decisiones respecto a un plan estratégico.

3.2. Componentes de Business Intelligence

Implementar un proyecto de Business Intelligence en una organización es un proceso que sigue una serie de pasos, cada paso puede verse como un componente. En la figura 3.1 observamos los distintos componentes que forman parte de Business Intelligence [Can07]:

¹ Los términos “back end” y “front end” comúnmente usados en Sistemas de Información significan, respectivamente, la parte más cercana al área tecnológica y la más cercana a los usuarios. Si hiciéramos un paralelismo con una tienda, serían la “trastienda” y el “mostrador”.

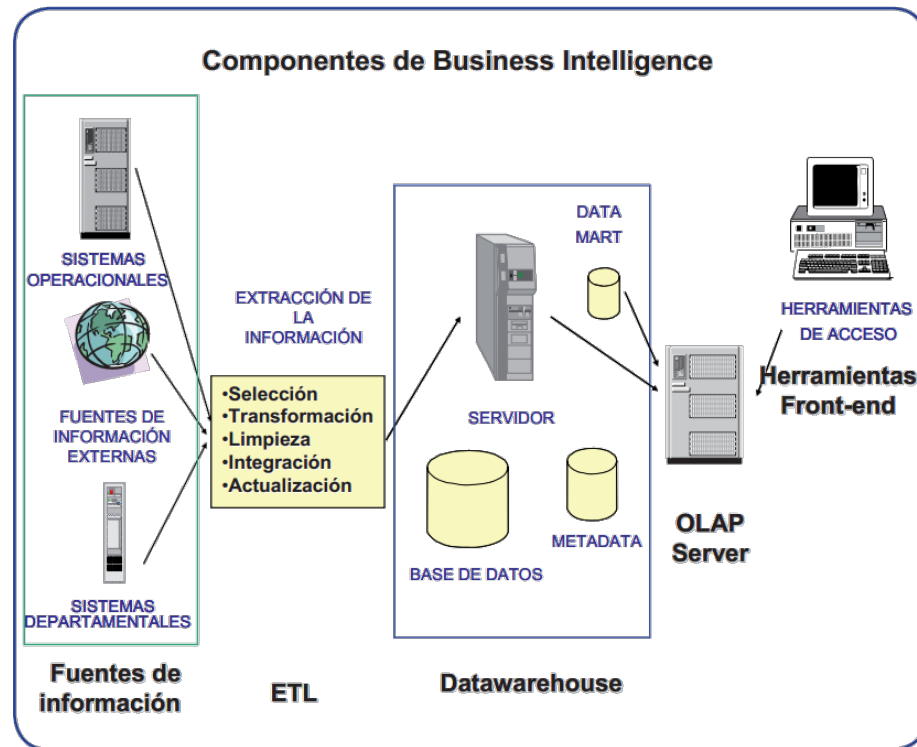


Figura 3.1: Componentes de Business Intelligence [Can07]

A continuación, una breve descripción de los componentes de Business Intelligence:

3.2.1. Fuentes de Información

Las fuentes de información representan el origen de los datos con la cual se alimenta de información al datawarehouse. Estas pueden provenir de diferentes sistemas como:

- Sistemas operacionales o transaccionales, que incluyen aplicaciones desarrolladas a medida, ERP, CRM, SCM, etc.
- Sistemas de información departamentales: previsiones, presupuestos, hojas de cálculo, etc.
- Fuentes de información externa, en algunos casos comprada a terceros. Las fuentes de información externas podrían ser importantes para enriquecer la información acerca de los clientes. En algunos casos es interesante incorporar información referente, por ejemplo, a población, número de habitantes, etc.

También las fuentes de información son usualmente heterogéneas, pueden contener los siguientes tipos de datos [JC10]:

- Estructurados: almacenados en las bases de datos.
- Semi estructurados: son formatos entendibles por los computadores como Html tabulado, Excel, CSV u otros que pueden ser obtenidos mediante técnicas estándar de extracción de datos.

- No estructurados: son formatos no legibles para computadoras como Word, Html no tabulado, PDF, etc. que pueden obtenerse mediante técnicas avanzadas de extracción de datos.

3.2.2. Extracción, Transformación y Carga

La extracción, transformación y carga, comúnmente abreviado por las siglas ETL (*del inglés “Extract, Transform and Load”*) es un tipo de integración de datos que consiste en todo el proceso que se realiza entre las fuentes de información y el área de presentación de los datos [Kim92]. Es utilizado para extraer los datos de los sistemas de origen, transformarlos en función a los requerimientos del negocio y cargar los datos en el entorno de destino.

El proceso ETL se divide en 5 subprocesos [Can07]:

Extracción

La extracción es el primer paso en el proceso de obtención de los datos, recupera los datos físicamente de las distintas fuentes de información. En este punto se dispone de los datos en bruto. El principal objetivo es extraer aquellos datos de los sistemas transaccionales que son necesarios y prepararlos para el resto de los subprocesos de ETL. Para ello se deben determinar las mejores fuentes de información, las de mejor calidad. Para tal finalidad, se debe analizar las fuentes disponibles y escoger aquellas que sean mejores.

Limpieza

Este proceso recupera los datos en bruto y comprueba su calidad, elimina los duplicados y, cuando es posible, corrige los valores erróneos y completa los valores vacíos, es decir se transforman los datos -siempre que sea posible- para reducir los errores de carga. En este momento se disponen de datos limpios y de alta calidad.

Los sistemas transaccionales contienen datos que no han sido depurados y que deben ser limpiados. Algunas causas que provocan que los datos estén “sucios” son:

- Valores por defecto.
- Ausencia de valor.
- Campos que tienen distintas utilidades.
- Valores contradictorios.
- Uso inapropiado de los campos.
- Re utilización de claves primarias.
- Selección del primer valor de una lista.

- Problemas de carga de antiguos sistemas o de integración entre sistemas.

La limpieza de datos se divide en distintas etapas:

- **Depurar los valores** (*parsing*): localiza e identifica los elementos individuales de información en las fuentes de datos. Por ejemplo: separa el nombre completo en: nombre, primer apellido, segundo apellido; o la dirección en: calle, número, etc.
- **Corregir** (*correcting*): corrige los valores individuales de los atributos usando algoritmos de corrección y fuentes de datos externas. Por ejemplo: comprueba la dirección y su código postal correspondiente.
- **Estandarizar** (*standardizing*): aplica rutinas de conversión para transformar valores en formatos definidos y consistentes. Por ejemplo: trato de Sra. o Sr. cambiar a sus correspondientes nombres completos.
- **Relacionar** (*matching*): busca y relaciona los valores de registros, corrigiéndolos y estandarizándolos para eliminar duplicados. Por ejemplo: identificando nombres y direcciones similares.

Transformación

La transformación de los datos se realiza partiendo de los datos una vez limpios, se transforman los datos de acuerdo a las reglas y necesidades del negocio. El resultado de este proceso es la obtención de datos limpios, consistentes, resumizados y útiles.

La transformación incluye:

- Cambios de formato.
- Sustitución de códigos.
- Valores derivados y agregados.

Los agregados como las sumas de las ventas normalmente se precalculan y se almacenan para conseguir mayores rendimientos. En este proceso también se ajusta el nivel de granularidad o detalle, por ejemplo: se puede tener detalles a nivel de líneas de factura en los datos extraídos, pero en el datawarehouse lo que se almacena son las ventas semanales o mensuales. La diferencia del nivel de detalle en el análisis es lo que se denomina granularidad.

Integración

Este proceso valida que los datos que cargamos en el datawarehouse son consistentes con las definiciones y formatos del datawarehouse; los integra en los distintos modelos de las distintas áreas de negocio que hemos definido en el mismo. Estos procesos pueden ser complejos.

Actualización

Este proceso es el que nos permite añadir los nuevos datos al datawarehouse, determina la periodicidad con el que haremos nuevas cargas de datos al datawarehouse.

3.2.3. DATAWAREHOUSE

El datawarehouse o “almacén de datos” son colecciones de datos acerca de los procesos de negocios de una organización, proporciona una visión global, común e integrada de los datos. Hoy en día se piensa que son las principales tecnologías que apoyan el entorno heterogéneo de toma de decisiones, el datawarehouse tiene las siguientes propiedades: no volátil, coherente, fiable y con información histórica [Inm92, JC10].

El profesor Hugh J. Watson [Wat06] lo define como:

“Un datawarehouse es una colección de información creada para soportar las aplicaciones de toma de decisiones. Datawarehousing es el proceso completo de extraer información, transformarla y cargarla en un datawarehouse y el acceso a esta información por los usuarios finales y las aplicaciones.”

Bill Inmon [Inm92] definió las características que debe cumplir un datawarehouse:

- Orientado a un área: cada parte del datawarehouse está construida para resolver un problema de negocio. Por ejemplo: entender los hábitos de compra de clientes, analizar la calidad de los productos, analizar la productividad de una línea de fabricación.
- Integrado: la información debe ser transformada en medidas comunes, códigos comunes y formatos comunes para ser útil. Por ejemplo: la moneda en que están expresadas los importes es común.
- Indexado en el tiempo: se mantiene la información histórica. Ejemplo: analizar la evolución de las ventas en los periodos deseados.
- No volátil: los usuarios no la mantienen como lo harían en los entornos transaccionales. No se ve actualizado continuamente, sino periódicamente de forma preestablecida. La información se almacena para la toma de decisiones

Ralph Kimbal [Kim92] define los objetivos que debería cumplir un datawarehouse:

- El alcance de un datawarehouse puede ser bien un departamento o bien corporativo.
- El datawarehouse no es sólo información sino también las herramientas de consulta, análisis y presentación de la información.
- La información del datawarehouse es consistente.
- La calidad de información en el datawarehouse es el motor de business reengineering.

Se debe tener en cuenta que existen otros elementos en el contexto de un datawarehouse [JC10]:

- **Datawarehousing:** es el proceso de extraer y filtrar datos de las operaciones procedentes de los distintos sistemas de información operacionales y sistemas externos, para transformarlos, integrarlos y almacenarlos en un almacén de datos con el fin de acceder a ellos para dar soporte en el proceso de toma de decisiones.
- **Data Mart:** es un subconjunto de datos del datawarehouse cuyo objetivo es responder a un determinado análisis.
- **Operational Data Store (ODS):** es un tipo de almacén de datos que proporciona sólo los últimos valores de los datos y no su historial.
- **Staging Área:** es el sistema que permanece entre las fuentes de datos y el datawarehouse con el objetivo de:
 - Facilitar la extracción de datos desde fuentes de origen con una heterogeneidad y complejidad grande.
 - Mejorar la calidad de los datos.
 - Ser usado como caché de datos operacionales con el que posteriormente se realiza el proceso de datawarehousing.
 - Uso de la misma para acceder en detalle a información no contenida en el datawarehouse.
- **Procesos ETL:** tecnología de integración de datos basada en la consolidación de datos que se usa tradicionalmente para alimentar el datawarehouse, data mart, staging área y ODS.
- **Metadatos:** datos estructurados y codificados que describen características de instancias; aportan informaciones para ayudar a identificar, descubrir, valorar y administrar las instancias descritas.

Elementos de una datawarehouse

El diseño de una base de datos operacional con una estructura relacional sigue las “formas normales” [KH03]. Un datawarehouse no debe seguir ese patrón de diseño. La idea principal es que en el datawarehouse la información esté almacenada con una estructura desnormalizada, para optimizar las consultas. Para ello se debe identificar, en la organización, los procesos de negocio, las vistas para el proceso de negocio y las medidas cuantificables asociadas a los mismos. Los elementos de un datawarehouse son [JC10]:

- **Tabla de hecho:** es la representación en el datawarehouse de los procesos de negocio de la organización. A nivel de diseño es una tabla que permite guardar dos tipos de atributos diferenciados:
 - Medidas del proceso de trabajo que se pretende modelizar.

- Claves foráneas hacia registros de una tabla de dimensión.
- **Dimensión:** es la representación en el datawarehouse de una vista para un cierto proceso de negocio.
- **Métrica:** son los indicadores de negocio de un proceso de negocio. Aquellos conceptos cuantificables que permiten medir el proceso de negocio.

Tipos de esquemas para estructurar los datos en un datawarehouse

- **Esquema en estrella:** consiste en estructurar la información en procesos, vistas y métricas recordando a una estrella. A nivel de diseño, consiste en una tabla de hechos en el centro para el hecho objeto de análisis y una o varias tablas de dimensión por cada punto de vista del análisis que participan en la descripción de ese hecho.
- **Esquema en copo de nieve:** es un esquema de representación derivado del esquema en estrella, en el que las tablas de dimensión se normalizan en múltiples tablas. Por esta razón la tabla de hechos deja de ser la única tabla del esquema que se relaciona con otras tablas.

3.2.4. OLAP

Existen múltiples tecnologías que permiten analizar la información almacenada en un datawarehouse, uno de los más importantes es OLAP (*Online Analytical Processing*), esta tecnología permite realizar un análisis multidimensional de un hecho desde distintas perspectivas o dimensiones mediante consultas complejas que van desde pocas hasta docenas de operaciones de unión, filtrado, agrupación y agregación. El principal objetivo es la de agilizar la consulta de grandes cantidades de datos [Wre06][Can07][JC10].

Una definición formal de OLAP sería [JC10]:

“Se entiende por OLAP o proceso analítico en línea, al método ágil y flexible para organizar datos, especialmente metadatos, sobre un objeto o jerarquía de objetos como en un sistema u organización multidimensional, y cuyo objetivo es recuperar y manipular datos y combinaciones de los mismos a través de consultas o incluso informes”

En la figura 3.2 se observa una representación gráfica del OLAP también conocida como cubo. En el ejemplo el cubo tiene 3 dimensiones (Tiempo, Producto y Región) sobre las cuales se pueden realizar consultas, ej.: Monto total de venta del producto “A” en el año “B” en la región “C”. Los cubos OLAP también permiten representar jerarquías, en el caso de la dimensión Tiempo la jerarquía podría estar compuesta por año, semestre, mes, semana y día.



Figura 3.2: Cubo OLAP

Existen distintos tipos de OLAP, las cuales difieren principalmente en la forma de guardar los datos:

- **MOLAP** (Multidimensional OLAP): es la forma tradicional del OLAP, accede directamente sobre una base de datos multidimensional, que utiliza estructuras de datos optimizadas para la recuperación de los mismos, es eficaz en los tiempos de respuestas de las consultas.
- **ROLAP** (Relational OLAP): accede directamente a las bases de datos relacionales que almacenan los datos base y las tablas dimensionales como tablas relacionadas.
- **HOLAP** (Hybrid OLAP): es una combinación de las dos anteriores, permite almacenar parte de los datos en una base de datos multidimensional y otra parte de en una relacional. En la base de datos relacional se guardan cantidades mas grandes de información detallada, mientras que en la multidimensional se almacenan datos menos detallados o agregados.

3.2.5. HERRAMIENTAS DE BI

Las principales herramientas de Business Intelligence son [EH05]:

- *Generadores de informes*: Utilizadas por desarrolladores profesionales para crear informes estándar para grupos, departamentos o la organización.
- *Herramientas de usuario final de consultas e informes*: Empleadas por usuarios finales para crear informes para ellos mismos o para otros; no requieren programación.
- *Herramientas OLAP*: Permiten a los usuarios finales tratar la información de forma multidimensional para explorarla desde distintas perspectivas y periodos de tiempo.

- *Herramientas de Dashboard y Scorecard*: Permiten a los usuarios finales ver información crítica para el rendimiento con un simple vistazo utilizando iconos gráficos y con la posibilidad de ver más detalle para analizar información detallada e informes, si lo desean.
- *Herramientas de planificación, modelización y consolidación*: Permite a los analistas y a los usuarios finales crear planes de negocio y simulaciones con la información de Business Intelligence. Pueden ser para elaborar la planificación, los presupuestos, las previsiones. Estas herramientas proveen a los dashboards y los scorecards con los objetivos y los umbrales de las métricas.
- *Herramientas datamining*: Permiten a estadísticos o analistas de negocio crear modelos estadísticos de las actividades de los negocios. Datamining es el proceso para descubrir e interpretar patrones desconocidos en la información mediante los cuales resolver problemas de negocio. Los usos más habituales del datamining son: segmentación, venta cruzada, sendas de consumo, clasificación, previsiones, optimizaciones, etc.

3.3. Indicadores Clave de Rendimiento

Los KPI (*Key Performance Indicators*) o Indicadores Clave de Rendimiento se tratan de indicadores que son decisivos para analizar de forma rápida la situación del negocio y facilitar la toma de decisiones. Una característica es que todos los KPI son indicadores, pero no todos los indicadores son KPI. Otra característica es que cada organización debe definir sus propios KPI según la actividad realizada, el tipo de producto o la estrategia de negocios, no pueden copiarse ya que cada organización es diferente y requiere de una reflexión estratégica de donde saldrán los KPI. Otro elemento importante de los KPI es que pueden no se exclusivamente del tipo financiero, pueden medir otros valores como por ejemplo: calidad del servicio. Por último los KPI son un elemento importante en la estrategia de negocios por su capacidad de comunicar resultados a las personas que forman parte del proyecto. [Alv13]

Un cuadro de gestión o de mando no debe excederse en la cantidad de KPI, porque puede darse el problema de “la parálisis por el análisis” que ocurre cuando se pasa de no tener ninguna información a contar con decenas de indicadores y una de las características del entorno competitivo actual es que se deben tomar decisiones de forma rápida y antes de que lo hagan los demás competidores [Alv13].

En el capítulo 5 haremos uso de los conceptos, herramientas y tecnologías que nos provee Business Intelligence para obtener los datos que ayudarán a desarrollar una solución al problema de estudio sobre pronóstico de la demanda. Iniciaremos con una breve descripción de la fuente de información, el proceso ETL (Extracción, Transformación y Carga), la especificación del datawarehouse, la definición de los indicadores clave de rendimiento y finalmente el etiquetado a cada tupla de indicadores que se transformarán en datos de entrada para el proceso de aprendizaje automático.

3.4. Aplicaciones de BI

Los sistemas de Business Intelligence abarcan un grupo cada vez mayor de usuarios como especialistas en tareas de control, información financiera, personal de ventas, directivos y gerentes [RGS02]. En el cuadro 3.1 se puede ver algunas de las áreas en las que se puede implementar sistemas de Business Intelligence, en la primera columna se citan las áreas que utilizan con mayor frecuencia como: compañías comerciales, compañías de seguros, entidades financieras, telecomunicaciones y empresas de manufactura; en la segunda columna se expone algunos casos de aplicación como: análisis de ventas, planificación de pedidos, análisis de clientes, gestión de créditos, etc.

Tabla 3.1: Áreas de aplicación de BI

| <i>Áreas de aplicación de BI</i> | <i>Casos de uso</i> |
|----------------------------------|---|
| Empresas Retail | <ul style="list-style-type: none"> ■ Proporcionar un análisis de las transacciones de los clientes. Determinar los productos más vendidos, promociones, hábitos de compras. ■ Pronóstico. Uso de datos históricos para pronosticar la demanda y basarse en el pronóstico para definir los requisitos de inventario con mayor precisión. |
| Inventario | <ul style="list-style-type: none"> ■ Planificación de Inventarios. Ayudar a identificar el nivel de inventario necesario para garantizar la demanda de los clientes. |
| Gestión de Pedidos | <ul style="list-style-type: none"> ■ Pedido y reposición. Uso de la información para tomar decisiones más rápidas sobre los artículos a pedir y determinar cantidades óptimas. |
| Contabilidad | <ul style="list-style-type: none"> ■ El uso de datos contables permite una mejor oportunidad de administración del riesgo, agilizar las operaciones, identificar ahorros de costos y oportunidades estratégicas de ingresos. |

| | |
|--------------------------------|---|
| Bancos, Financieras y Valores. | <ul style="list-style-type: none"> ■ Análisis de rentabilidad del cliente: Analizar la rentabilidad global del cliente, a corto y largo plazo, proporcionar la base para las ventas de alta rentabilidad y la banca de relación, maximizar las ventas a clientes de alto valor, reducir los costos para los clientes de bajo valor, maximizar la rentabilidad de nuevos productos y servicios. ■ Gestión de créditos: Establecer patrones de progresión de problemas de crédito por clase y tipo de clientes, alertar a los clientes para evitar problemas de crédito, gestionar límites de crédito, evaluar la cartera crediticia del banco, reducir pérdidas crediticias. ■ Atención en sucursales: Mejorar el servicio y la atención al cliente, aperturas de nuevas cuentas, fortalecer la lealtad del cliente. |
| Telecomunicaciones | <ul style="list-style-type: none"> ■ Perfil y segmentación de clientes. Determinar perfiles de productos de alto beneficio y segmentos de clientes, proporcionar perfiles de clientes detallados e integrados, desarrollar programas individualizados de llamadas frecuentes, determinar futuras necesidades de los clientes. ■ Previsión de la demanda del cliente. Prever las necesidades futuras del producto o actividad de servicio, proporcionar una base para el análisis y control de la rotación para mejorar la retención de clientes. |
| Transporte | <ul style="list-style-type: none"> ■ Aerolíneas. Analizar conductas, tarifas abonadas, respuestas a promociones, canje de millas, categorías de los pasajeros frecuentes de la empresa. |
| Educación | <ul style="list-style-type: none"> ■ Universidades y Colegios. Análisis del proceso de admisión de alumnos, registros de cursos y asistencia estudiantil, monitoreo del progreso de los alumnos. |

| | |
|-------|---|
| Salud | <ul style="list-style-type: none">■ Analizar los resultados, identificar tendencias, detectar patrones y predecir los resultados para mejorar el desempeño clínico y operacional.■ Monitorear iniciativas de calidad y programas de atención.■ Seguimiento y monitoreo de ingresos, márgenes y rendimiento operacional. |
|-------|---|

3.5. Resumen

Capítulo 4

Machine Learning

El objetivo de este capítulo es visualizar qué aspectos de Machine Learning fueron tomados como componentes de solución al problema de estudio.

En lo que va de la Edad Contemporánea, el hombre siente fuertemente la necesidad de encontrar respuestas a ciertos aspectos de sus propias capacidades. Respuestas de cómo funciona el cerebro humano, cómo se van originando e hilando los pensamientos, cómo se va adquiriendo el conocimiento, cómo la racionalidad está presente en las decisiones humanas, cuál es el mecanismo de toma de decisiones de la mente humana, cómo utiliza su inteligencia para resolver problemas e ideas abstractas, cuál es el proceso que sigue la mente para poder aprender, interrogantes sobre la memoria del cerebro y cómo los sentidos van alimentando de percepciones para tener una visión única del universo. La ciencia de la computación ha abierto la puerta a dichas respuestas.

En 1950 Alan Turing dio uno de los saltos más importantes al proponer el enfoque de su “Prueba de Turing”, donde un computador es considerado como agente inteligente si un evaluador humano, sin interactuar con el computador, realiza preguntas y no es capaz de distinguir si las respuestas vienen de una persona o del computador. En su artículo “Computing Machinery and Intelligence” [Tur50] expuso este y otros conceptos y como tal es considerado padre de la Inteligencia Artificial (IA).

Aunque hoy en día aún es válida la Prueba de Turing, el desafío no está en construir un agente inteligente total, sino mas bien buscar que un computador tenga capacidades como [RN04]:

1. Procesamiento del lenguaje natural
2. Representación del conocimiento
3. Razonamiento automático
4. Aprendizaje automático (Machine Learning)
5. Visión computacional
6. Robótica

Entre los precursores de IA están John McCarthy, Marvin Minsky, Allen Newell y Herbert Simon, todos ganadores del premio “ACM A.M. Turing Award” por sus notables aportes en los inicios de IA. McCarthy acuñó el término Artificial Intelligence en el taller “Dartmouth Summer Research Project on Artificial Intelligence” que organizó y se desarrolló en junio del año 1956. En palabras transcritas, el taller perseguía el siguiente objetivo: *“El estudio debe proceder sobre la base de la conjetura de que cada aspecto del aprendizaje o cualquier otra característica de la inteligencia puede, en principio, describirse tan precisamente que se puede hacer que una máquina lo simule. Se intentará encontrar cómo hacer que las máquinas usen el lenguaje, formen abstracciones y conceptos, resuelvan tipos de problemas ahora reservados para los humanos y se mejoren a sí mismos. Creemos que se puede lograr un avance significativo en uno o más de estos problemas si un grupo de científicos cuidadosamente seleccionados trabajan juntos durante un verano”*. Entre los aportes mas destacados de McCarthy se pueden mencionar la definición del lenguaje de alto nivel Lisp, la creación del tiempo compartido y el artículo “Programs with Common Sense” [McC59] donde define su *Generador de Consejos*, todos estos aportes desarrollados en 1958. Minsky diseñó SNARC (Stochastic Neural Analog Reinforcement Calculator) la primera máquina a partir de una red neuronal, en el año 1951, junto a Seymour Papert publicó el libro “Perceptrons: an introduction to computational geometry” [MP87] en el año 1969 y también creó un modelo de redes semánticas denominadas “marcos” publicado en “A framework for representing knowledge” en el año 1974 [Min74].

En setiembre de 1956 en el “MIT Symposium on Information Theory” se mostraron trabajos muy importantes como el de George Miller que presentó “The Magical Number Seven, Plus or Minus Two: Some Limits on our Capacity for Processing Information”, Noam Chomsky presentó “Three Models for the Description of Language”, y Allen Newell y Herbert Simon presentaron “The Logic Theory Machine”: programa de computador capaz de hacer la demostración de un teorema y considerado el primer programa de IA. El campo de la ciencia cognitiva echó sus raíces en este simposio evidenciando que los modelos informáticos se pueden utilizar para modelar la psicología de la memoria, el lenguaje y el pensamiento lógico. En 1959 presentaron el programa “General Problem Solver” (GPS), pretendía funcionar como una máquina universal para resolver problemas y fue el primer programa de computador que separó su conocimiento de los problemas (reglas representadas como datos de entrada) de su estrategia de cómo resolver problemas (un motor de resolución genérico).

Machine Learning como subcampo de IA está presente en muchas aplicaciones de la vida real, especialmente en aquellas donde se requiere el procesamiento de grandes cantidades de datos. Por esta razón la tecnología de la información la toma como aliado esencial. Muchos avances tecnológicos de última generación utilizan algoritmos de Machine Learning para realizar un análisis inteligente de los datos [SV08]. Entre algunas aplicaciones conocidas se destacan:

- Reconocimiento facial de Facebook: técnicas de Computer Vision and Pattern Recognition. <https://research.fb.com/learning-to-segment/>
- Kinect para Xbox 360: técnicas de reconocimiento de voz y reconocimiento facial para la

identificación automática de los usuarios.

- Voice recognition.
- La tecnología del habla y el campo relacionado del reconocimiento de caracteres manuscritos.
- Motores de búsqueda, sistemas de recomendación, y los sistemas para la construcción de portales Web.
- Recommender system en plataformas como Amazon, Netflix, Facebook .
- Reconocimiento automático de ciertas áreas en el mundo realizado por satélites.

Para recalcar el veloz crecimiento de los datos en el mundo, en un estudio publicado por la International Data Corporation (IDC) y patrocinado por DELL EMC que se denomina: “The Digital Universe in 2020: Big Data, Bigger Digital Shadows, and Biggest Growth in the Far East” [GR12] se analiza qué tan rápido crecen los datos cada año, una medida que incluyen todos los datos digitales creados, replicados y consumidos en un solo año. En la Figura 4.1 se muestra una proyección del tamaño hasta el 2020.

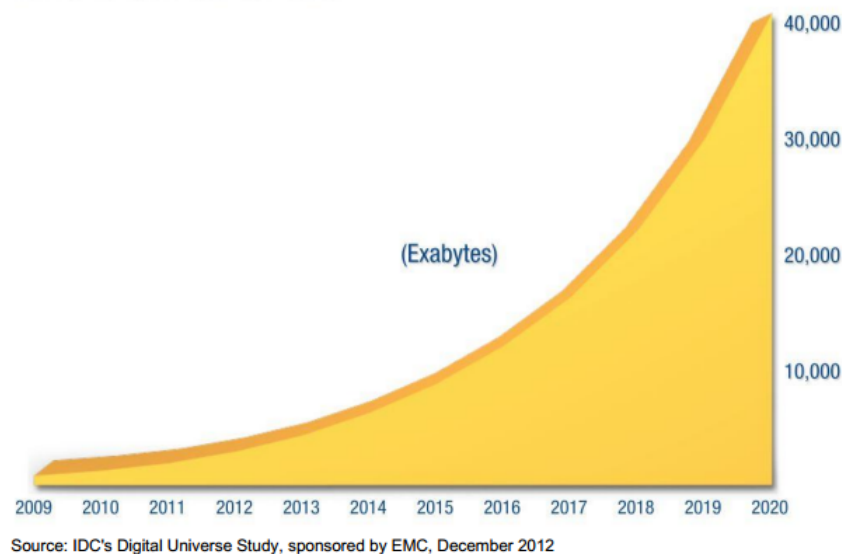


Figura 4.1: Del 2005 al 2020 el universo digital crecerá en un factor de 300, de 130 exabytes a 40,000 exabytes, es decir se duplicará cada dos años.

El universo digital analizado está compuesto por imágenes y vídeos en teléfonos móviles cargados en YouTube, películas digitales, datos bancarios en cajeros automáticos, imágenes de seguridad en aeropuertos y en eventos importantes como los Juegos Olímpicos, colisiones subatómicas registradas por el Gran Colisionador de Hadrones en el CERN, llamadas de voz a través de líneas telefónicas digitales y los mensajes de texto. Las mediciones indican que en el 2005 existían 130 exabytes en datos digitales, en el 2010 llegó a 1200 exabytes, en el 2015 a unos 7900 exabytes y para el 2020 se pronostica que llegará a los 40000 exabytes. IDC estima

que para 2020, hasta el 33 % del universo digital contendrá información que podría ser valiosa si se analiza.

4.1. Definición

Arthur Samuel acuñó el término Machine Learning en 1959 mientras trabaja para IBM. En el IBM Journal publicó “Some Studies in Machine Learning Using the Game of Checker” en el cual escribió: *“Programming computers to learn from experience should eventually eliminate the need for much of this detailed programming effort”* [Sam59] por lo que de su artículo se interpreta que *“Machine Learning es un campo de estudio que da a las computadoras la capacidad de aprender a resolver problemas sin ser explícitamente programados”*. Samuel desarrolló en el año 1952 un programa que aprendió a jugar Damas, hasta llegar a una categoría equivalente al amateur. Este pionero ya demostraba que los programas a través del aprendizaje pueden efectuar tareas de toma de decisiones sin ser programadas explícitamente dichas decisiones. Cabe destacar que Arthur Samuel fue uno de los asistentes del “Dartmouth Summer Research Project on Artificial Intelligence”.

Otro investigador, Tom Mitchell propuso en 1998 la siguiente definición: *“Well posed Learning Problem: A computer program is said to learn from experience E with respect to some task T and some performance measure P , if its performance on T , as measured by P , improves with experience E ”*. Donde se nos indica que el aprendizaje en las máquinas deberá ser parecido al aprendizaje en los humanos, por ejemplo cuando una criatura comienza a hablar a través de la experiencia de pronunciar las palabras y de su interacción con otras personas, entonces sucede que su capacidad de hablar se va perfeccionando o mejorando.

Otra definición es *“The purpose of machine learning is to learn from training data in order to make as good as possible predictions on new, unseen, data”*[Pug16]. La dificultad radica en que debemos construir modelos que nos acerquen a una buena predicción sobre datos aún no conocidos o imprevistos.

En el contexto de IA y según el enfoque propuesto en el libro “Inteligencia Artificial Un Enfoque Moderno” [RN04], se conciben los sistemas inteligentes como agentes racionales dotados de capacidades específicas. Entre las capacidades principales están el poder percibir el entorno de trabajo (“problemas para los cuales fueron hechos”) con la ayuda de sus sensores, actuar en ese entorno mediante sus actuadores y contar con una medida de rendimiento para medir el éxito. Estructuralmente un agente = arquitectura + programa. Los sensores y actuadores forman parte de la arquitectura, la arquitectura es el medio físico que podría ser una PC común o un sofisticado robot con brazos mecánicos, cámaras, sensores, etc. El objetivo principal de IA es construir el programa del agente, que es donde se implementa la función del agente. Para que el agente sea considerado un agente que aprende, el programa debe contener el “Elemento de aprendizaje”. En la Figura 4.2 se grafica el concepto, un modelo de agente inteligente que aprende.

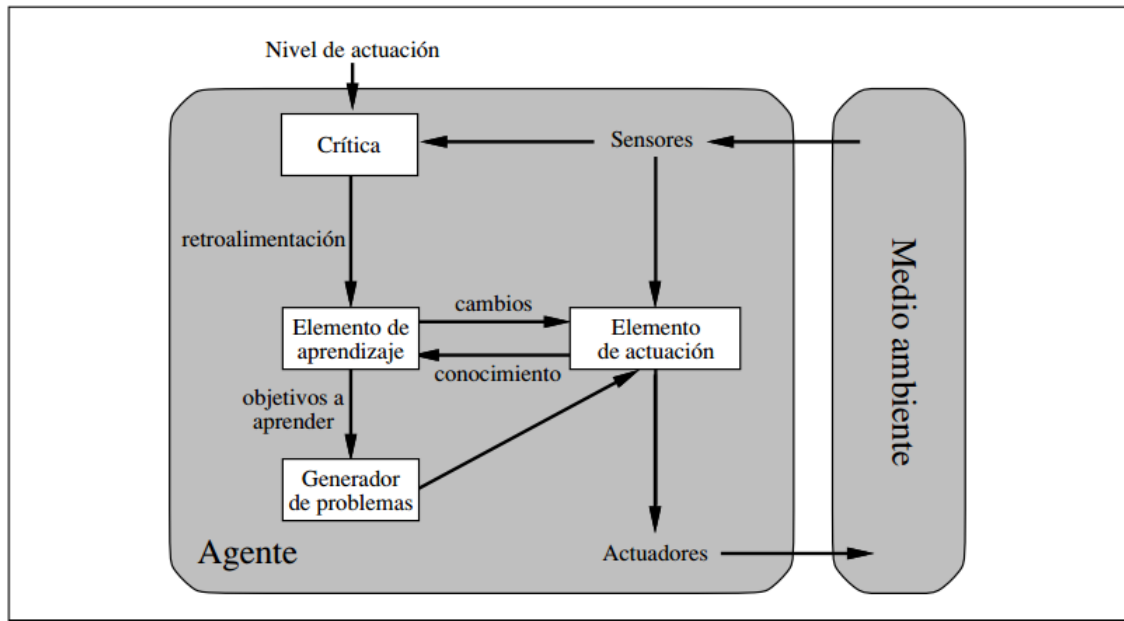


Figura 4.2: Modelo general para agentes que aprenden [RN04].

4.2. Formas de Aprendizaje

Los algoritmos de aprendizaje automático se pueden agrupar según la forma en que se realiza el aprendizaje, conforme a la información que poseen o que pueden llegar a poseer. Uno de los componentes más importantes al momento de diagnosticar la naturaleza del problema de aprendizaje es el tipo de retroalimentación disponible para el aprendizaje. Hay tres tipos distintos de aprendizaje: supervisado, no supervisado y por refuerzo [RN04].

4.2.1. Aprendizaje supervisado

Los agentes inteligentes que implementan algoritmos de aprendizaje supervisado (supervised learning), tienen como objetivo aprender una función de hipótesis “ h ” que se aproxime a la función verdadera “ f ” y que es solución al problema que se intenta resolver. Lo que se conoce de “ f ” son los llamados “ejemplos”, que son puntos concretos dentro de la desconocida curva que representa la función verdadera “ f ”. En otras palabras, la definición matemática de la función “ f ” no se conoce, solamente se conocen un conjunto de ejemplos definidos por valores correctos de entradas y salidas de la función “ f ”.

Estos “ejemplos” son datos de entrada para los algoritmos de aprendizaje supervisado y actúan como datos de entrenamiento, persiguiendo el objetivo principal de encontrar la función “ h ”. En el caso más general, un instructor provee el valor correcto de la salida de cada ejemplo. Problemas del tipo clasificación o regresión se resuelven normalmente con aprendizaje supervisado. Como ejemplo de aplicaciones que implementan esta técnica están los vehículos autoconducidos que deben aprender a diferenciar entre una calle y de la que no es (salida booleana es calle o no es calle?), también debe aprender a frenar (salida booleana frenar o no

frenar?), etc. Entre los algoritmos que implementan aprendizaje supervisado están: Logistic Regression y Back Propagation Neural Network.

El problema de estudio en cuestión utiliza algoritmos de aprendizaje supervisado, donde el experto en compras da la respuesta correcta a cada ejemplo.

4.2.2. Aprendizaje no supervisado

En los problemas de aprendizaje no supervisado (unsupervised learning) los algoritmos reciben como entrada datos de entrenamiento que no tienen resultados conocidos ni etiquetas. Se buscan estructuras presentes y como resultado se pueden extraer reglas generales, o reducir sistemáticamente la redundancia, o se pueden organizar los datos por similitud. Se aprende a partir de patrones de entrada de los que no se dispone de sus valores de salida, es decir *a priori* no hay etiquetas o respuesta correcta en los ejemplos. Como ejemplo de implementaciones está el caso de la computadora que aprendió sola el concepto de lo que es un animal gato, otro ejemplo es el reconocimiento de dígitos escritos a mano. Entre los algoritmos que implementan aprendizaje no supervisado están: Bayesian Network, Neural Networks y Support Vector Machines (SVM) o Máquinas Núcleo.

4.2.3. Aprendizaje por refuerzo

El aprendizaje por refuerzo (reinforcement learning) es el más general entre las tres categorías. En vez de que un instructor indique al agente qué hacer, el agente inteligente debe aprender cómo se comporta el entorno mediante recompensas (refuerzos) o castigos, derivados del éxito o del fracaso respectivamente. El objetivo principal es aprender la función de valor que le ayude al agente inteligente a maximizar la señal de recompensa y así optimizar sus políticas de modo a comprender el comportamiento del entorno y a tomar buenas decisiones para el logro de sus objetivos formales.

Los principales algoritmos de aprendizaje por refuerzo se desarrollan dentro de los métodos de resolución de problemas de decisión finitos de Markov, que incorporan las ecuaciones de Bellman y las funciones de valor. Los tres métodos principales son: la Programación Dinámica (Dynamic Programming o DP), los métodos de Monte Carlo y el aprendizaje de Diferencias Temporales (Temporal-Difference learning o TD) [SB98].

Entre las implementaciones desarrolladas está AlphaGo, un programa de IA desarrollado por Google DeepMind para jugar el juego de mesa Go. En marzo de 2016 AlphaGo le ganó una partida al jugador profesional Lee Se-Dol que tiene la categoría noveno dan y 18 títulos mundiales. Entre los algoritmos que utiliza se encuentra el árbol de búsqueda Monte Carlo, también utiliza aprendizaje profundo con redes neuronales. Puede ver lo ocurrido en el documental de Netflix “AlphaGo” <https://www.netflix.com/title/80190844>.

4.3. Algoritmos de aprendizaje supervisado y no supervisado

El Dr. Jason Brownlee es un especialista en aprendizaje automático, desarrollador, escritor y empresario. Ha trabajado en sistemas de aprendizaje automático para la defensa, startups y pronósticos meteorológicos. Tiene una comunidad en <https://machinelearningmastery.com/>, la cual empezó porque le apasiona ayudar a los desarrolladores profesionales a comenzar y aplicar con confianza Machine Learning que les permita resolver problemas complejos. Los algoritmos de aprendizaje automático se pueden agrupar según la similaridad en términos de su forma o función, como por ejemplo los métodos basados en árboles y los métodos inspirados en redes neuronales. Se muestra en la Figura 4.3 lo propuesto por el Dr. Jason:



Figura 4.3: Agrupación de algoritmos según el Dr. Jason.

No hay un consenso general de cómo agrupar los algoritmos de Machine Learning en términos de su función o de cómo trabajan. La Figura 4.3 mostró un método útil de agrupación, que no es perfecto y ni exhaustivo en los grupos y algoritmos. Hay algoritmos que pueden encajar en varias categorías como Learning Vector Quantization que es a la vez un método inspirado en una red neuronal y un método basado en instancia. También hay categorías que tienen el mismo nombre que describen el problema y la clase de algoritmo como Regression y Clustering. Se podría manejar estos casos listando los algoritmos dos veces o insertando en el grupo al que subjetivamente se ajusta mejor. Se utiliza este último enfoque de no duplicar algoritmos.

4.3.1. Algoritmos de regresión

Los Algoritmos de Regresión (Regression Algorithms) modelan la relación que existe entre variables, se mejora iterativamente utilizando una medida de error en las predicciones hechas por el modelo. Los métodos de regresión son herramientas de las estadísticas que se han adoptado en el aprendizaje de la máquina. Se pueden utilizar el término regresión para referirse a la clase de problema y también a la clase de algoritmo. Para ser más exactos, la regresión es realmente un proceso. Estos algoritmos se implementan en problemas de aprendizaje supervisado.

4.3.2. Algoritmos basados en instancia

El modelo de aprendizaje Basado en Instancia (Instance-Based Learning) es un problema de decisión con instancias o ejemplos de datos de entrenamiento que se consideran importantes o requeridos para el modelo. Estos métodos típicamente construyen una base de datos con ejemplos y los compara con los nuevos datos utilizando una medida de similaridad para así encontrar la mejor coincidencia y hacer la predicción. Por esta razón, los métodos basados en la instancia también se llaman métodos de aprendizaje basado en memoria. El enfoque se pone en la representación de las instancias almacenadas y las medidas de similaridad utilizadas entre instancias. Estos algoritmos se implementan en problemas de aprendizaje supervisado.

4.3.3. Algoritmos de regularización

Los Algoritmos de Regularización (Regularization), comprende una extensión hecha a otros métodos (típicamente a los métodos de regresión). Penaliza los modelos basándose en sus complejidades, favoreciendo modelos más simples que también son mejores de generalizar. Son populares, potentes y en general simples modificaciones de otros métodos. Estos algoritmos se implementan en problemas de aprendizaje supervisado y no supervisado.

4.3.4. Algoritmos de árboles de decisión

Los métodos de Árboles de Decisión (Decision Tree) construyen un modelo de decisiones hechas en base a los valores de atributos en los datos. Las decisiones se bifurcan en la estructura del árbol hasta que se tome una decisión de predicción para un registro dado. Los árboles de decisión son entrenados en los datos para problemas de clasificación y regresión. Los árboles de decisión son a menudo rápidos y precisos y un gran favorito en aprendizaje automático. Estos algoritmos se implementan en problemas de aprendizaje supervisado.

4.3.5. Algoritmos bayesianos

Los métodos Bayesianos (Bayesian) son los que aplican explícitamente el teorema de Bayes para problemas tales como la clasificación y la regresión. Estos algoritmos se implementan en problemas de aprendizaje supervisado.

4.3.6. Algoritmos de agrupación

La Agrupación (Clustering) así como también la regresión describen la clase de problema y la clase de método. Los métodos de agrupación suelen estar organizados según el enfoque del modelado, tales como los basados en centroides y los jerárquicos. Todos los métodos atañen a la utilización de las estructuras inherentes en los datos, para organizar dichos datos de la mejor manera posible en grupos de máxima uniformidad. Estos algoritmos se implementan en problemas de aprendizaje no supervisado.

4.3.7. Algoritmos de aprendizaje de reglas de asociación

Los métodos de aprendizaje de Reglas de Asociación (Rule System) extraen reglas que mejor explican las relaciones observadas entre variables en los datos. Estas reglas pueden descubrir asociaciones importantes y comercialmente útiles, en grandes conjuntos de datos multidimensionales que pueden ser explotados por una organización. Estos algoritmos se implementan en problemas de aprendizaje supervisado.

4.3.8. Algoritmos de redes neurales artificiales

Las Redes Neuronales artificiales (Neural Networks) son modelos inspirados en la estructura y/o función de las redes neuronales biológicas. Son una clase de búsqueda de patrones que se utilizan comúnmente para problemas de regresión y clasificación. Es realmente un enorme subcampo compuesto de cientos de algoritmos y variaciones para todo tipo de tipos de problemas. Se ha separado el aprendizaje profundo de las redes neuronales debido a su enorme crecimiento y popularidad. Estos algoritmos se implementan en problemas de aprendizaje supervisado, no supervisado y por refuerzo.

4.3.9. Algoritmos de aprendizaje profundo

Los métodos de Aprendizaje Profundo (Deep Learning) son una moderna actualización de las redes neuronales artificiales que explotan el abundante y barato poder de computación. Se ocupan en construir redes neuronales mucho más grandes y complejas y, muchos métodos se refieren a problemas de aprendizaje semi-supervisados donde grandes conjuntos de datos contienen muy pocos datos etiquetados. Estos algoritmos se implementan en problemas de aprendizaje supervisado y no supervisado.

4.3.10. Algoritmos de reducción de dimensionalidad

Al igual que los métodos de agrupación, la Reducción de la Dimensionalidad (Dimensionality Reduction) busca y explora la estructura inherente en los datos, pero en este caso de una manera no supervisada o en orden a resumir o describir los datos utilizando menos información. Esto puede ser útil para visualizar datos dimensionales o para simplificar datos que luego se

pueden utilizar en un método de aprendizaje supervisado. Muchos de estos métodos pueden ser adaptados para su uso en clasificación y regresión. Estos algoritmos se implementan en problemas de aprendizaje no supervisado.

4.3.11. Algoritmos ensemble

Métodos de Ensemble (Ensemble) son modelos compuestos por múltiples modelos más débiles, que son entrenados independientemente y cuyas predicciones son combinadas de alguna manera para hacer la predicción general. Mucho esfuerzo se pone en qué tipos de aprendices débiles combinar y las formas en que hay que combinarlos. Esta es una clase de técnica muy poderosa y como tal es muy popular. Estos algoritmos se implementan en problemas de aprendizaje supervisado y no supervisado.

4.3.12. Algoritmos no lineales

Uno de los mas importante es Support Vector Machines. Estos algoritmos se implementan en problemas de aprendizaje supervisado y no supervisado.

4.4. Algoritmos de aprendizaje por refuerzo

Se puede complementar el listado propuesto por el Dr. Jason con alguno de los algoritmos de aprendizaje por refuerzo.

4.4.1. Programación dinámica

Estos son los principales algoritmos:

- Programación dinámica con Policy Iteration.
- Programación dinámica con Value Iteration.
- Programación dinámica con Generalized policy iteration (GPI).
- Asynchronous DP.
- Bootstrapping.

4.4.2. Método de Monte Carlo

Tiene como principales algoritmos:

- On-Policy Monte Carlo Control.
- Off-Policy Monte Carlo Control.

4.4.3. Aprendizaje por Diferencias Temporales

Sus principales algoritmos son:

- Sarsa: On-Policy TD Control.
- Q-learning: Off-Policy TD Control.
- Actor-Critic Methods.
- R-Learning for Undiscounted Continual Tasks.

4.5. Problemas de clasificación y regresión

4.5.1. Clasificación

4.5.1.1. Clasificación binaria

En su forma más simple se reduce a la siguiente cuestión: dado un patrón x extraído de un dominio X , estimar qué valor asumirá una variable aleatoria binaria asociada $y \in \{\pm 1\}$ [SV08].

La clasificación binaria es probablemente el problema más estudiado en el aprendizaje automático y ha dado lugar a una gran cantidad de desarrollos algorítmicos y teóricos importantes durante el siglo pasado. En su forma más simple, se reduce a la pregunta: dado un patrón x extraído de un dominio X , estimar qué valor asumirá una variable aleatoria binaria asociada $y \in \{\pm 1\}$.

Por ejemplo, si se muestran imágenes de manzanas y naranjas, podemos indicar si el objeto en cuestión es una manzana o una naranja. Igualmente bien, si se quiere predecir si un propietario de vivienda podría incumplir su préstamo dado sus datos de ingresos y su historial de crédito, o si un correo electrónico determinado es spam o no.

4.5.1.2. Clasificación multiclase

Es la extensión lógica de la clasificación binaria. La principal diferencia es que ahora $y \in \{1, 2, 3, \dots, N\}$ puede asumir un rango de valores diferentes [SV08]. El problema de estudio en cuestión utiliza clasificación multiclase, donde $y \in \{Nada, Poco, Medio, Mucho\}$. Por ejemplo, es posible que se desee clasificar un documento de acuerdo con el idioma en el que fue escrito (inglés, francés, alemán, español, hindi, japonés, chino, ...).

La principal diferencia es que el costo del error puede depender en gran medida del tipo de error que se comete. Por ejemplo, en el problema de evaluar el riesgo de cáncer, hace una diferencia significativa si clasificamos erróneamente una etapa temprana del cáncer como saludable (en cuyo caso es probable que el paciente muera) o una etapa avanzada de cáncer (en cuyo caso es probable que el paciente sufra molestias por un tratamiento excesivamente agresivo).

Para desarrollar un modelo o esquema de Machine Learning para resolver problemas de clasificación multiclase, es necesario conocer los componentes esenciales que la forman [WFH11].

Ejemplos o instancias

La entrada de un esquema de aprendizaje automático es un conjunto de instancias. Estas instancias son las cosas que deben ser clasificadas, asociadas o agrupadas. En el escenario estándar, cada instancia es un ejemplo individual e independiente del concepto que se debe aprender.

Características o atributos

Las instancias son caracterizadas mediante los valores de un conjunto predeterminado de atributos. Cada instancia proporciona una entrada al aprendizaje automático y es caracterizado por los valores de un conjunto fijo y predefinido de características o atributos.

Etiquetas

Las cantidades nominales tienen valores que son símbolos distintos. Los valores mismos sirven como etiquetas o nombres, de ahí el término nominal, que viene de la palabra latina para nombre. Los atributos nominales a veces se llaman categorizados, enumerados o discretos.

Conjunto de entrenamiento

El grupo de ejemplos utilizados en el proceso de entrenamiento de los algoritmos de aprendizaje automático constituyen el conjunto de entrenamiento.

Algoritmos de clasificación multiclase

Constituye el conjunto de algoritmos de machine learning que soportan problemas de clasificación multiclase. Cada algoritmo se construye con su Función Objetivo (f), Variables de entrada (X), Variable de salida (Y), donde $Y = f(X)$

Conjunto de prueba

Para predecir el rendimiento de un clasificador sobre nuevos datos, necesitamos evaluar su tasa de error en un conjunto de datos que no desempeñó ningún papel en la formación del clasificador. Este conjunto de datos independiente se denomina conjunto de prueba.

4.5.2. Regression

Es otra aplicación prototípica. Aquí el objetivo es estimar una variable de valor real $y \in \mathbb{R}$ dado un patrón x . Por ejemplo, se podría querer estimar el valor de un stock al día siguiente, el rendimiento de un fabuloso semiconductor dado el proceso actual, el contenido de hierro de las mediciones de espectroscopia de masas dadas por el mineral o la frecuencia cardíaca de un atleta, dada la información del acelerómetro. Una de las cuestiones clave en las que los problemas de regresión difieren entre sí es la elección de una pérdida. Por ejemplo, al estimar los

valores de stock, nuestra pérdida para una opción de venta será decididamente unilateral. Por otro lado, a un deportista aficionado solo le importaría que nuestra estimación de la frecuencia cardíaca coincidiera con la media real.

4.6. Algoritmos de clasificación en Weka

Weka es una colección de algoritmos de aprendizaje automático para tareas de minería de datos. Los algoritmos pueden ser aplicados directamente a un conjunto de datos o llamados desde código Java. Weka contiene herramientas para pre-procesamiento de datos, clasificación, regresión, clustering, reglas de asociación y visualización. También es adecuado para desarrollar nuevos esquemas de aprendizaje automático [atUoW]. En el problema de estudio se utiliza el conjunto de algoritmos de clasificación de Weka [WFHP16]. Los algoritmos de clasificación de Weka que se utilizarán son los siguientes [htt]:

Tabla 4.1: Clasificadores Weka

| <i>Categoría del clasificador</i> | <i>Nombre del clasificador</i> | <i>Modelo, técnica o algoritmo que implementa</i> |
|-----------------------------------|---------------------------------|--|
| Clasificadores bayesianos | BayesNet | Bayes Network (Red Bayesiana) [BFH ⁺ 16] |
| Clasificadores bayesianos | NaiveBayes | Naive Bayes [JL95] |
| Clasificadores bayesianos | NaiveBayesMultinomial | Naive Bayes multinomial [MN98] |
| Clasificadores bayesianos | NaiveBayesMultinomialUpdateable | Naive Bayes multinomial actualizable [MN98] |
| Clasificadores bayesianos | NaiveBayesUpdateable | Naive Bayes actualizable [JL95] |
| Basado en funciones | Logistic | Regresión Logística [lCvH92] |
| Basado en funciones | MultilayerPerceptron | Red Neuronal con <i>back propagation</i> |
| Basado en funciones | SimpleLogistic | Regresión Logística lineal con LogitBoost [LHF05] [SFH05] |
| Basado en funciones | SMO | Sequential Minimal Optimization con Support Vector [Pla98] [KSBM01] [HT98] |
| Clasificadores perezosos | IBk | K-nearest neighbours (K vecinos más cercanos) [AK91] |

| | | |
|--------------------------|---------------------------------|--|
| Clasificadores perezosos | KStar | K* con función de distancia basada en entropía [CT95] |
| Clasificadores perezosos | LWL | Locally Weighted Learning (Aprendizaje Ponderado Localmente) [FHP03] [AMS96] |
| Meta algoritmos | AdaBoostM1 | Adaboost M1 [FS96] |
| Meta algoritmos | AttributeSelectedClassifier | Selección de atributos |
| Meta algoritmos | Bagging | Bagging [Bre96] |
| Meta algoritmos | ClassificationViaRegression | Métodos de regresión [FWI ⁺ 98] |
| Meta algoritmos | CVParameterSelection | Selección de parámetros [Koh95a] |
| Meta algoritmos | FilteredClassifier | Filtro arbitrario |
| Meta algoritmos | IterativeClassifierOptimizer | Optimización del número de iteraciones |
| Meta algoritmos | LogitBoost | Regresión Logística aditiva [FHT98] |
| Meta algoritmos | MultiClassClassifier | Metaclasificador |
| Meta algoritmos | MultiClassClassifierUpdateable | Metaclasificador actualizable |
| Meta algoritmos | MultiScheme | Selección del clasificador |
| Meta algoritmos | RandomCommittee | Conjunto aleatorizado de clasificadores base |
| Meta algoritmos | RandomizableFilteredClassifier | Clasificador arbitrario con filtro arbitrario |
| Meta algoritmos | RandomSubSpace | Árbol de decisión [Ho98] |
| Meta algoritmos | Stacking | Combinación de clasificadores utilizando apilamiento [Wol92] |
| Meta algoritmos | Vote | Combinación de clasificadores [Kun04] [KHDM98] |
| Meta algoritmos | WeightedInstancesHandlerWrapper | Soporte de instancias ponderadas |
| Sistema de reglas | DecisionTable | Tabla de decisión simple [Koh95b] |
| Sistema de reglas | JRip | “Repeated Incremental Pruning to Produce Error Reduction” (RIPPER) [Coh95] |

| | | |
|---------------------|---------------|---|
| Sistema de reglas | OneR | Clasificador 1R [Hol93] |
| Sistema de reglas | PART | Divide y vencerás para construir un árbol de decisión C4.5 parcial [FW98] |
| Sistema de reglas | ZeroR | Clasificador 0-R |
| Árboles de decisión | DecisionStump | Decision stump in conjunction with a boosting algorithm |
| Árboles de decisión | HoeffdingTree | Algoritmo de inducción incremental del árbol de decisión [HSD01] |
| Árboles de decisión | J48 | Árbol de decisión C4.5 podado o no podado [Qui93] |
| Árboles de decisión | LMT | “Árboles de Modelos Logísticos” o “Logistic Model Trees” (LMT) [LHF05] [SFH05] |
| Árboles de decisión | RandomForest | “Bosque de Árboles Aleatorios” o “Forest of Random Trees” [Bre01] |
| Árboles de decisión | RandomTree | Considera K atributos elegidos al azar en cada nodo. No realiza poda. |
| Árboles de decisión | REPTree | Construye un árbol de decisión/regresión utilizando la información de ganancia/varianza |

4.7. Técnicas de evaluación para aprendizaje supervisado

La evaluación es la clave para lograr avances reales en el aprendizaje automático. Entre las técnicas de evaluación para problemas de aprendizaje supervisado se destacan:

4.7.1. Entrenamiento y prueba sobre los mismos datos

Recompensa modelos demasiado complejos que "sobreajustan" los datos de entrenamiento y que no necesariamente generalizan.

4.7.2. Porcentaje de División

La técnica de Porcentaje de División (Percentage Split) divide el conjunto de datos en dos partes, de modo que el modelo pueda ser entrenado y probado sobre diferentes datos. Presenta una mejor estimación del rendimiento fuera de la muestra, pero sigue siendo una estimación de "alta varianza". Útil debido a su velocidad, simplicidad y flexibilidad.

Divide el conjunto de datos en dos conjuntos: un conjunto de entrenamiento (generalmente el 70 % del conjunto de datos completo) del que aprende el modelo y un conjunto de prueba (el otro 30 %). Debido a que el conjunto de prueba se retiene del modelo durante el entrenamiento, puede contribuir a una evaluación imparcial de qué tan bien se desempeña un modelo en datos nunca antes vistos. Esto protege contra el sobreajuste y permite evaluar cómo el modelo funcionaría con los nuevos datos a medida que surgen.

4.7.3. Validación Cruzada de k pasadas

La técnica de Validación Cruzada de k pasadas (k-fold Cross-Validation) consiste en dividir los datos en un número de particiones iguales. Por ejemplo, en una validación cruzada de 4 pasadas se divide el conjunto de datos en cuatro particiones de igual tamaño. Luego se entrena el modelo en tres de esas cuatro particiones y se prueba el modelo en la partición restante. Luego, se repite el proceso, seleccionando una partición diferente para que sea el grupo de prueba y entrenando un nuevo modelo en el conjunto restante de tres particiones. El proceso se repite dos veces más, para un total de cuatro rondas de validación cruzada, una por cada pasada. Luego se tienen cuatro modelos diferentes, cada uno ha sido entrenado y probado en un subconjunto diferente de datos y cada uno tiene su propio peso y exactitud de predicción. Al final, se combinan estos modelos al promediar sus pesos para estimar un modelo predictivo final. La validación cruzada es otro antídoto contra el sobreajuste.

La técnica estándar para predecir la tasa de error es Stratified k-fold Cross-Validation, donde la estratificación se refiere al proceso de reorganizar los datos de tal manera a asegurar que cada partición sea una buena representación del conjunto. Comúnmente se acepta que 10 es el número de particiones con el que se obtiene la mejor estimación de error, idea basada en diversas pruebas sobre conjuntos de datos diferentes y para distintas técnicas de aprendizaje [WFH11].

4.8. Métricas de desempeño para problemas de clasificación

Las métricas de clasificación son las medidas contra las cuales se evalúan los modelos. Para los problemas de clasificación, es natural medir el rendimiento de un clasificador en términos de la tasa de error (error rate). El clasificador predice la clase de cada instancia: si es correcta se cuenta como un éxito, sino se cuenta como un error. La tasa de error es sólo la proporción de

errores cometidos sobre un conjunto de instancias, y mide el rendimiento general del clasificador. Por supuesto, lo que interesa es el probable desempeño futuro en nuevos datos, no el rendimiento sobre datos pasados.

Para predecir el rendimiento de un clasificador sobre nuevos datos, necesitamos evaluar su tasa de error en un conjunto de datos que no desempeñó ningún papel en la formación del clasificador. Este conjunto de datos independiente se denomina conjunto de prueba. En tales situaciones se suele hablar de tres conjuntos de datos, los datos de entrenamiento, los datos de validación y los datos de prueba [WFH11]. Los datos de entrenamiento son utilizados por uno o más esquemas de aprendizaje para conocer clasificadores. Los datos de validación se utilizan para optimizar los parámetros de los clasificadores, o para seleccionar uno determinado. A continuación, los datos de prueba se utilizan para calcular la tasa de error del método final optimizado. Cada uno de los tres conjuntos debe ser independiente: El conjunto de validación debe ser diferente del conjunto de entrenamiento para obtener un buen desempeño en la etapa de optimización o selección y el conjunto de prueba debe ser diferente de ambos para obtener una estimación confiable de la tasa de error real.

Por fines prácticos generalmente se utiliza la metodología de dividir los datos en dos conjuntos, el conjunto de entrenamiento y el conjunto de prueba, como es el caso del trabajo actual donde se utilizan valores por defecto en los parámetros de los clasificadores.

4.8.1. Porcentaje de Acierto

Porcentaje de instancias correctamente clasificadas o de predicciones correctas. La métrica más simple y más común es la tasa de acierto. La tasa de acierto se calcula dividiendo el número de predicciones correctas entre el número total de predicciones. Por ejemplo, en un modelo de clasificación supervisada para transacciones bancarias, si probamos el modelo en cien transacciones y se predice correctamente la etiqueta (fraude/no fraude) para noventa de ellas, entonces el porcentaje de acierto del modelo es del 90 %.

$$Aciertos = \frac{Nro\ Predicciones\ Correctas}{Número\ Total\ Predicciones} \quad (4.1)$$

4.8.2. Matriz de confusión

El porcentaje de acierto es la métrica de clasificación más fácil, simple y entendible que se puede utilizar. Pero no dice sobre la distribución subyacente de los valores de respuesta, ni dice qué "tipos" de errores está cometiendo el clasificador. No distingue entre falsos positivos, transacciones incorrectamente clasificadas como fraude y falsos negativos, transacciones incorrectamente clasificadas como no fraudulentas. Es por eso que se necesita la matriz de confusión.

Una matriz de confusión es una tabla de N por N que clasifica las predicciones en una de cuatro clasificaciones: verdadero positivo (True Positive - TP), verdadero negativo (True Negative - TN), falso positivo (False Positive - FP) y falso negativo (False Negative - FN). En

problemas de clasificación para aplicaciones reales normalmente los errores cuestan diferentes cantidades. Por ejemplo en bancos y financieras el costo de prestar a una persona que no paga sus deudas es mayor que el costo de rechazar un préstamo a una persona que es pagadora. Los Verdaderos Positivos y Verdaderos Negativos son clasificaciones correctas. Un Falso Positivo es cuando el resultado se predice incorrectamente como positivo cuando es realmente negativo. Un Falso Negativo es cuando el resultado se predice incorrectamente como negativo cuando es realmente positivo.

La matriz de confusión brinda una imagen más completa de cómo está funcionando el clasificador. También permite calcular varias métricas de clasificación y estas métricas pueden guiar la selección del modelo. La elección de la métrica depende del objetivo de su negocio. Es importante identificar si FP o FN es más relevante reducir, para luego elegir la métrica con la variable relevante (FP o FN en la ecuación). Entre las métricas calculadas a partir de una matriz de confusión se encuentran:

4.8.2.1. Exactitud de clasificación (Classification accuracy)

En general, ¿con qué frecuencia es correcto el clasificador?.

$$Exactitud = \frac{TP + TN}{TP + TN + FP + FN} \quad (4.2)$$

4.8.2.2. Error de clasificación (Classification error)

En general, ¿con qué frecuencia el clasificador es incorrecto?. También conocido como "Tasa de clasificación incorrecta".

$$Error = \frac{FP + FN}{TP + TN + FP + FN} \quad (4.3)$$

4.8.2.3. Sensibilidad (Sensitivity)

Cuando el valor real es positivo, ¿con qué frecuencia es correcta la predicción?. Algo que queremos maximizar. ¿Qué tan "sensible" es el clasificador para detectar instancias positivas?. También conocido como "Tasa positiva real" o "Recordar" (True Positive Rate or Recall).

Todo positivo = TP + FN.

$$Sensibilidad = \frac{TP}{TP + FN} \quad (4.4)$$

4.8.2.4. Especificidad (Specificity)

Cuando el valor real es negativo, ¿con qué frecuencia es correcta la predicción?. Algo que queremos maximizar. ¿Qué tan "específico" (o "selectivo") es el clasificador en predecir las instancias positivas?

Todo negativo = TN + FP.

$$\text{Especificidad} = \frac{TN}{TN + FP} \quad (4.5)$$

4.8.2.5. Tasa de falsos positivos (False positive rate)

Cuando el valor real es negativo, ¿con qué frecuencia la predicción es incorrecta?

$$\text{Tasa de falsos positivos} = \frac{FP}{TN + FP} \quad (4.6)$$

4.8.2.6. Precisión (Precision)

Cuando se predice un valor positivo, ¿con qué frecuencia es correcta la predicción?. ¿Cuán "preciso" es el clasificador al predecir instancias positivas?.

$$\text{Precisión} = \frac{TP}{TP + FP} \quad (4.7)$$

4.8.2.7. Medida F (F-measure)

La Medida F es una medida de la exactitud de una prueba. La Medida F puede interpretarse como un promedio ponderado de la precisión y sensibilidad, donde alcanza su mejor valor en 1 y el peor en 0. Se define como:

$$\text{Medida F} = \frac{2 * \text{Sensibilidad} * \text{Precision}}{(\text{Sensibilidad} + \text{Precision})} \quad (4.8)$$

4.8.2.8. Estadística Kappa (Kappa Statistic)

En la predicción multiclase, cada elemento de la matriz de confusión muestra el número de ejemplos de prueba para los que la clase real es la fila y la clase prevista es la columna. Son buenos resultados los grandes números en la diagonal principal e idealmente cero fuera de la diagonal principal. “Kappa se utiliza para medir el acuerdo entre la predicción y la observación de las categorizaciones de un conjunto de datos, mientras que se corrige para un acuerdo que ocurre por casualidad”. Si los evaluadores están totalmente de acuerdo Kappa alcanza un valor máximo igual a 1. Si no hay total acuerdo entre los evaluadores, entonces Kappa tiene un valor < 1 .

$$\kappa = \frac{Pr(a) - Pr(e)}{1 - Pr(e)} \quad (4.9)$$

Donde: $Pr(a)$ es el acuerdo observado relativo entre los observadores y $Pr(e)$ es la probabilidad hipotética de acuerdo al azar utilizando los datos observados para calcular las probabilidades de que cada observador clasifique aleatoriamente cada categoría.

4.9. [DEFINICION DE SESGO Y VARIANZA]

4.10. Resumen

Capítulo 5

Modelado del problema

5.1. Planteamiento del problema

Esta sección se centra en los tres primeros componentes de Business Intelligence siguiendo el proceso de modelado dimensional[Kim92]. Uno de los principales problemas con los que se enfrentan las empresas retail, trata acerca de pronosticar la demanda, es decir, determinar la cantidad de productos que se deben disponer para satisfacer la demanda de los clientes en el siguiente periodo. Utilizando los conceptos y herramientas de Business Intelligence, se parte con el análisis de una fuente de información auténtica obtenida de una empresa retail; se diseña el datawarehouse que será poblado con información de las transacciones operacionales diarias del negocio; posteriormente se definen los indicadores claves de rendimiento como métricas, se calculan los valores de los indicadores con los datos históricos almacenados en el datawarehouse para cada periodo de tiempo establecido y se asigna una etiqueta a cada tupla de valores KPI que finalmente servirán como parámetros de entrada de las herramientas de aprendizaje automático para diseñar una solución que pronostique la demanda.

5.1.1. Fuente de Información

Para el presente trabajo, se cuenta con una base de datos relacional Oracle 10g con las operaciones transaccionales de una empresa retail dedicada a la venta de productos alimenticios y artículos de limpieza, algunas de las líneas de productos con que cuenta la empresa son: aceites corporales, acondicionadores, aromatizantes, cuidado corporal, desodorantes, limpiadores, salud e higiene, salud y belleza, aguas, gaseosas, cervezas, vinos, chocolates, galletitas, enlatados, lácteos, yerbas y varias líneas de productos más. La base de datos almacena datos de las operaciones comprendidas entre noviembre de 2013 y octubre de 2016. A continuación una reseña de las principales tablas tenidas en cuenta para el diseño del datawarehouse.

- **Tabla de Productos:** almacena datos como descripción, unidad de medida, categoría, tipo de impuesto, línea del producto, marca, código de barras, proveedor, costo, precio de venta, fecha de registro, etc., de los productos disponibles para la venta, la tabla cuenta

con 13.200 artículos registrados.

- **Tabla Proveedores:** almacena datos como denominación, dirección, teléfono, ruc, email, página web, ciudad, país, propietario, etc., de los proveedores de la empresa, la tabla cuenta con 1.623 proveedores registrados.
- **Tabla de Ventas Cabecera:** es una de las tablas principales donde se registran los movimientos de ventas de la empresa. Contiene datos como número de factura, moneda, tipo de comprobante, caja, usuario, fecha, cliente, monto total, monto gravado, monto impuesto, monto exenta, etc., la tabla cuenta con 301.316 registros de ventas correspondientes al periodo mencionado previamente.
- **Tabla de Ventas Detalle:** contiene los registros de los productos que fueron comercializados, cada detalle está relacionado a un registro de la tabla venta cabecera. Contiene datos de la fecha, el producto, precio de costo unitario, precio de venta unitario, cantidad, importe grabado, importe del impuesto entre otros datos, la tabla cuenta con 981.402 detalles de ventas registrados.
- **Tabla de Movimientos de Stock:** contiene los registros de movimientos de stock de ventas y compras detallado. Contiene datos de fecha, producto, cantidad, tipo de movimiento, costo unitario, precio unitario, entre otro datos, la tabla cuenta con 1.062.440 movimientos de compra y ventas registradas.

5.1.2. Proceso ETL.

En el proceso ETL posterior a la extracción y previa a la carga de los datos al datawarehouse fueron realizadas algunas transformaciones y limpieza sobre los datos de origen.

- **Tabla de Productos:** se detectaron registros de artículos con las siguientes inconsistencias:
 - Datos del proveedor con valores nulos, los cuales eran completados con un proveedor por defecto de la tabla dimensional de proveedores.
 - Artículos con valores de costo nulo, en tales casos los valores eran asignados con un costo promedio tomados de la tabla de Ventas Detalle.
 - Artículos con valores donde el costo eran mayor al precio de venta unitario, en dichos casos los datos fueron completados con el costo promedio tomados de la tabla de Ventas Detalle.
 - Artículos cuyo precio de venta unitario era nulo, en los cuales los datos eran completados con el precio de venta mas reciente tomado de la tabla de Ventas Detalle.
- **Tabla de Ventas Cabecera:** se encontraron registros donde los datos del cliente eran nulos, en dichos casos fueron asignados un cliente por defecto tomados de la tabla dimensional de clientes.

- **Tabla de Ventas Detalle:** se detectaron registros con las siguientes falencias:
 - Registros de detalles donde los valores de costo eran iguales a cero, los cuales eran modificados por el costo promedio de la tabla dimensional de productos.
 - Registros de detalle donde el costo unitario eran mayores al precio de venta unitario, las cuales fueron corregidas con el costo promedio, tomados de la tabla dimensional de productos.

5.1.3. Datawarehouse

El datawarehouse se diseña partiendo de la definición de las tablas de hechos y dimensiones utilizando el modelo en esquema estrella [Kim92].

Tablas de hechos

De las tablas transaccionales se definen 3 tablas de hechos a partir de las cuales se obtienen los valores de los KPI que se utilizan en la solución propuesta.

- **Tabla de hechos Cabecera:** almacena los datos históricos de las ventas, cada registro de la tabla de hechos guarda datos de: fecha, cliente, caja, número de factura y monto total, monto exento, monto gravado IVA. Las métricas definidas para la tabla de hechos son: monto total, monto exento, monto gravado IVA.
- **Tabla de hechos Detalles:** almacena los datos históricos en detalle por cada producto vendido, cada registro guarda información del número de comprobante, fecha, producto, proveedor, cliente, cantidad, costo unitario, precio unitario, impuesto e importe total. Las métricas asociadas a la tabla de hechos son: cantidad, precio unitario, impuesto, costo unitario y el importe total.
- **Tabla de hechos Stock:** almacena los datos históricos de cada movimiento ya sea compra o de venta realizada, cada registro contiene información como fecha, producto, tipo de movimiento, cantidad, precio unitario y costo unitario. Las métricas definidas para la tabla de hechos son: cantidad, precio unitario y costo unitario.

Dimensiones

Las tablas de dimensiones diseñadas para el modelado del datawarehouse y que se encuentran relacionadas a las tablas de hechos son:

- **Dimensión Fecha:** La tabla de dimensión fecha está ligada a todas las tablas de hechos, sirve para limitar o agrupar los datos de las tablas de hechos al momento de realizar consultas sobre estas en el tiempo. Con la dimensión fecha se pueden establecer niveles jerárquicos en días, semanas, meses, trimestres, semestres y años.

- **Dimensión Productos:** La tabla de dimensión producto está relacionada a las tablas de hechos Detalles y Stock. Contiene los atributos o campos (ej.: nombre del producto) por las cuales se pueden filtrar o agrupar datos.
- **Dimensión Proveedores:** La tabla de dimensión proveedores está relacionada a la tabla de hechos Detalles. Contiene los atributos o campos (ej.: nombre del proveedor) por las cuales se pueden realizar filtros o agrupaciones de datos.
- **Dimensión Clientes:** La tabla de dimensión Clientes está relacionada a las tablas de hechos Cabecera y Detalles. Contiene los atributos o campos (ej.: nombre del cliente) por las cuales se pueden hacer consultas de datos.
- **Dimensión Cajas:** La tabla de dimensión Cajas está relacionada a la tabla de hechos Cabecera. Contiene los atributos o campos (ej.: número de caja) por las cuales se pueden filtrar o agrupar datos.

En figura 5.1 observamos un ejemplo del modelo en esquema estrella de la tabla de hechos Detalles.

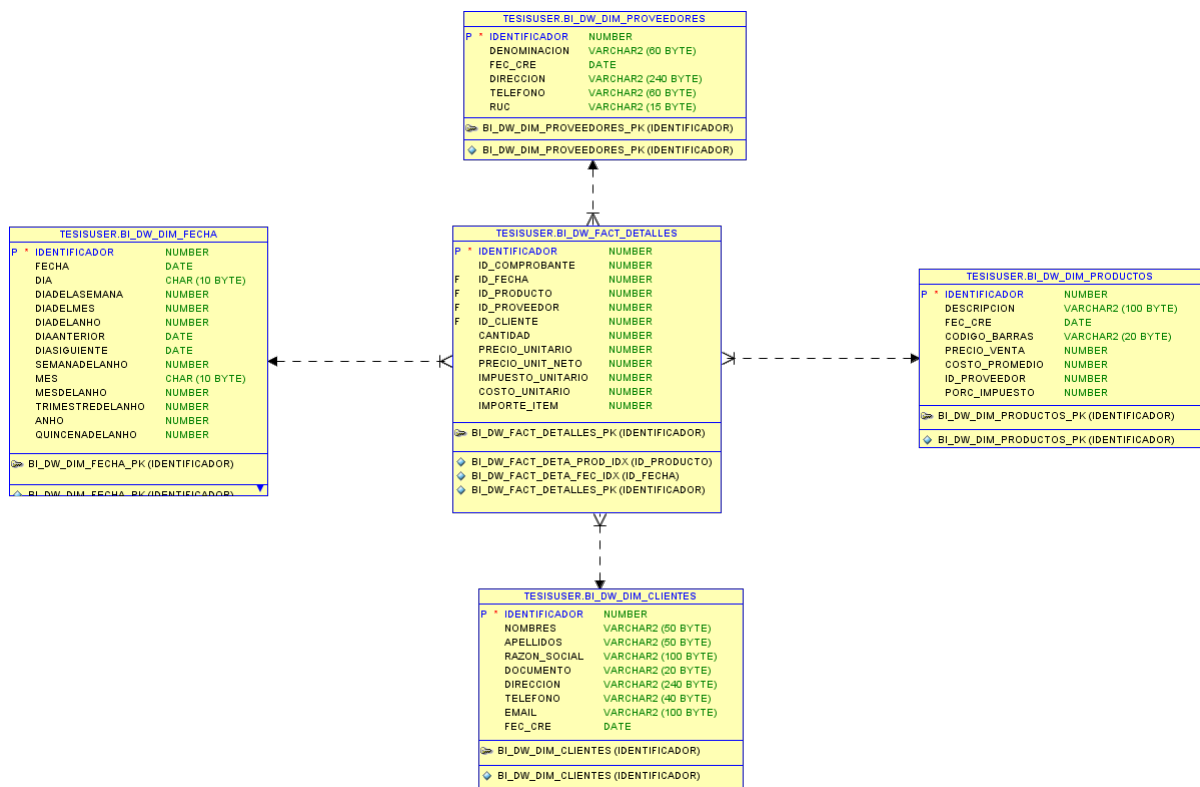


Figura 5.1: Tabla de hechos Detalles

5.1.4. Definición de los Indicadores Claves de Rendimiento

En el marco de este trabajo, en esta sección se definen los KPIs y se obtienen los valores que serán utilizados como datos de entrada en las herramientas de aprendizaje automático para el desarrollo de una técnica para pronosticar la demanda y que servirá de apoyo en la toma

de decisiones para la reposición de stock del siguiente periodo[Alv13] (Ej.: cantidad a comprar para satisfacer la demanda de la siguiente semana, quincena, o mes).

Los KPIs definidos fueron adaptados a la solución planteada debido a que en los textos consultados los KPI engloban a toda la organización en áreas como compras, ventas, marketing, recursos humanos y otros. Cada KPI mide un valor obtenido de los datos históricos almacenados en el datawarehouse. El cálculo de cada KPI se realiza por cada producto y periodo de tiempo (semanal, quincenal o mensual). A continuación se definen los KPIs

Ticket Medio. Es la cantidad media por cada transacción de venta que se realiza de un determinado producto. El indicador viene determinado por dos variables: a) la cantidad total vendida del producto, b) el total de tickets en las que fue vendido el producto. Aplicando la siguiente fórmula obtenemos el valor de la cantidad media de venta para cada producto.

$$TM = \frac{Cantidad\ Vendida\ Periodo}{Total\ Tickets\ Periodo} \quad (5.1)$$

Cifra de Ventas La cifra de ventas es un KPI que sirve para explicar el importe total de ventas que se ha obtenido para un producto. Se obtiene de la siguiente fórmula.

$$CV = Precio * Cantidad\ Vendida\ Periodo \quad (5.2)$$

Margen Comercial Es la razón entre el precio de venta y precio de costo del producto, es un indicador que permite conocer el porcentaje de rentabilidad del producto. Se obtiene de la siguiente fórmula.

$$MC = \frac{(Precio - Costo) * Cantidad\ Vendida\ Periodo}{Precio * Cantidad\ Vendida\ Periodo} * 100 \quad (5.3)$$

Rotación de Stock Este indicador mide la cantidad de veces que el stock del producto se renueva durante un determinado ciclo comercial, es decir, la cantidad de veces que se recupera la inversión. Se obtiene de la siguiente fórmula.

$$RS = \frac{Total\ Ventas\ Periodo}{\left(\frac{Stock\ Inicial\ Periodo - Stock\ Final\ Periodo}{2} \right)} \quad (5.4)$$

Coeficiente de Rentabilidad El indicador mide la rentabilidad obtenida por la empresa basada en el margen y la rotación, el objetivo de toda empresa retail es aumentar los niveles de rotación. El coeficiente se obtiene de la siguiente fórmula.

$$CR = ((Precio - Costo) * Cantidad\ Vendida\ Periodo) * RS \quad (5.5)$$

Cobertura de Stock Este indicador muestra el periodo de tiempo (habitualmente se expresa en días o semanas) que el negocio puede continuar vendiendo con el stock de que dispone en el momento, sin incorporar nuevas cantidades de ese producto.

$$CS = \frac{\text{Stock Actual Periodo}}{\text{Promedio Cantidad Venta Ultimos N Periodos}} \quad (5.6)$$

5.1.5. Obtención de los valores para los Indicadores Clave de Rendimiento.

Se obtiene los valores de KPI por cada producto y periodo, mediante codificación de sentencias SQL que operan sobre los datos almacenados en el datawarehouse, y todos los resultados obtenidos de la ejecución se almacenan en una tabla base. En dicha tabla base además de los valores de KPI, en cada registro se guarda adicionalmente información de cantidad, fecha, año, mes, quincena, semana y periodo. Durante el cálculo de los valores de los KPI se establecieron ciertas restricciones, como por ejemplo si un producto no fue vendido durante un número consecutivo de periodos entonces era descartado, ya que los resultados para algunos KPI daban como resultado un valor cero, el cual no tiene relevancia.

PERIODOS DE ANÁLISIS

De la tabla base donde se almacenan los valores obtenidos de los KPI, por la columna *periodo* se pueden agrupar los registros en los tres periodos de análisis: semanal, quincenal y mensual.

SEMANAL En la figura 5.2 se puede observar un extracto de los valores de la tabla base agrupados por periodo semanal para un determinado producto. Por ejemplo, el primer registro corresponde al producto con Id 133, periodo 'S' (semanal), semana 49, mes 12 y año 2013, observamos que para el KPI Rotación de Stock según la fórmula 5.4 se obtuvo un valor 0,769230.

| KPI_TIKET_MEDIO | KPI_CIFRA_VENTAS | KPI_MARGEN_COMERCIAL | KPI_ROTACION_STOCK | KPI_COEF_RENTABILIDAD | KPI_COBERTURA_STOCK | CANTIDAD | FECHA | ANHO | MES | QUINCENA | SEMANA | ID_PRODUCTO | PERIODO |
|-----------------|------------------|----------------------|--------------------|-----------------------|---------------------|----------|------------|------|-----|----------|--------|-------------|---------|
| 5000 | 25000 | 7380,95238095238 | 0,769230769230769 | 5677,65567765568 | 1,2 | 5 | 01/12/2013 | 2013 | 12 | | 49 | 133 | S |
| 5000 | 20000 | 5904,7619047619 | 0,571428571428571 | 3374,14965986395 | 2,07692307692308 | 4 | 08/12/2013 | 2013 | 12 | | 50 | 133 | S |
| 5000 | 15000 | 4428,57142857143 | 0,272727272727273 | 1207,79220779221 | 0,9375 | 3 | 15/12/2013 | 2013 | 12 | | 51 | 133 | S |
| 5000 | 10000 | 2952,38095238095 | 0,125 | 369,047619047619 | 4,25 | 2 | 22/12/2013 | 2013 | 12 | | 52 | 133 | S |
| 5000 | 10000 | 2952,38095238095 | 0,142857142857143 | 421,768707482993 | 5 | 2 | 29/12/2013 | 2013 | 12 | | 53 | 133 | S |
| 5000 | 5000 | 1476,19047619048 | 0,08 | 118,095238095238 | 5,57142857142857 | 1 | 01/01/2014 | 2014 | 1 | | 1 | 133 | S |
| 5000 | 15000 | 4428,57142857143 | 0,285714285714286 | 1265,30612244898 | 7,2 | 3 | 05/01/2014 | 2014 | 1 | | 2 | 133 | S |
| 5000 | 20000 | 5904,7619047619 | 0,571428571428571 | 3374,14965986395 | 4,5 | 4 | 12/01/2014 | 2014 | 1 | | 3 | 133 | S |
| 5000 | 20000 | 5904,7619047619 | 1,33333333333333 | 7873,01587301587 | 1,875 | 4 | 19/01/2014 | 2014 | 1 | | 4 | 133 | S |
| 5000 | 10000 | 2952,38095238095 | 0,2 | 590,47619047619 | 0,272727272727273 | 2 | 26/01/2014 | 2014 | 1 | | 5 | 133 | S |

Figura 5.2: Ejemplo de valores KPI para un periodo semanal

QUINCENAL En la figura 5.3 se puede observar un extracto de los valores de la tabla base agrupados por periodo quincenal para un determinado producto. Por ejemplo, el primer registro corresponde al producto con Id 133, periodo 'Q' (quincenal), quincena 23, mes 12 y año 2013, observamos que para el KPI Cobertura de Stock según la fórmula 5.6 se obtuvo un valor de 1,2.

| KPI_TIKET_MEDIO | KPI_CIFRA_VENTAS | KPI_MARGEN_COMERCIAL | KPI_ROTACION_STOCK | KPI_COEF_RENTABILIDAD | KPI_COBERTURA_STOCK | CANTIDAD | FECHA | AÑO | MES | QUINCENA | SEMANA | ID_PRODUCTO | PERIODO |
|-----------------|------------------|----------------------|--------------------|-----------------------|---------------------|-------------------|--------------|------|-----|----------|--------|-------------|---------|
| 1 | 5000 | 45000 | 13285,7142857143 | 2 | 26571,4285714286 | 1,2 | 9 01/12/2013 | 2013 | 12 | 23 | | 133 | Q |
| 2 | 5000 | 35000 | 10333,3333333333 | 0,77777777777778 | 8037,03703703704 | 0,789473684210526 | 7 16/12/2013 | 2013 | 12 | 24 | | 133 | Q |
| 3 | 5000 | 35000 | 10333,3333333333 | 0,736842105263158 | 7614,0350877193 | 1,625 | 7 01/01/2014 | 2014 | 1 | 1 | | 133 | Q |
| 4 | 5000 | 35000 | 10333,3333333333 | 0,56 | 5786,66666666667 | 0,78260695652174 | 7 16/01/2014 | 2014 | 1 | 2 | | 133 | Q |
| 5 | 5000 | 35000 | 10333,3333333333 | 0,451612903225806 | 4666,66666666667 | 2,71428571428571 | 7 01/02/2014 | 2014 | 2 | 3 | | 133 | Q |
| 6 | 5000 | 15000 | 4428,57142857143 | 0,285714285714286 | 1265,30612244898 | 1,71428571428571 | 3 16/02/2014 | 2014 | 2 | 4 | | 133 | Q |
| 7 | 5000 | 5000 | 1476,19047619048 | 0,117647058823529 | 173,669467787115 | 1,58823529411765 | 1 01/03/2014 | 2014 | 3 | 5 | | 133 | Q |
| 8 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 2,18181818181818 | 0 16/03/2014 | 2014 | 3 | 6 | | 133 | Q |
| 9 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 6 | 0 01/04/2014 | 2014 | 4 | 7 | | 133 | Q |
| 10 | 2500 | 5000 | 1476,19047619048 | 0,133333333333333 | 196,825396825397 | 24 | 1 16/04/2014 | 2014 | 4 | 8 | | 133 | Q |
| 11 | 5000 | 10000 | 2952,38095238095 | 0,333333333333333 | 984,126804126804 | 21 | 2 01/05/2014 | 2014 | 5 | 9 | | 133 | Q |
| 12 | 5000 | 10000 | 2952,38095238095 | 0,5 | 1476,19047619048 | 5 | 2 16/05/2014 | 2014 | 5 | 10 | | 133 | Q |
| 13 | 5000 | 10000 | 2952,38095238095 | 1 | 2952,38095238095 | 1,8 | 2 01/06/2014 | 2014 | 6 | 11 | | 133 | Q |

Figura 5.3: Ejemplo de valores KPI para un periodo quincenal

MENSUAL En la figura 5.4 se puede observar un extracto de los valores de la tabla base agrupados por periodo mensual para un determinado producto. Por ejemplo, el primer registro corresponde al producto con Id 133, periodo 'M' (mensual), mes 12 y año 2013, observamos que para el KPI Margen Comercial según la fórmula 5.3 se obtuvo un valor 23619,047619.

| KPI_TIKET_MEDIO | KPI_CIFRA_VENTAS | KPI_MARGEN_COMERCIAL | KPI_ROTACION_STOCK | KPI_COEF_RENTABILIDAD | KPI_COBERTURA_STOCK | CANTIDAD | FECHA | AÑO | MES | QUINCENA | SEMANA | ID_PRODUCTO | PERIODO |
|-----------------|------------------|----------------------|--------------------|-----------------------|---------------------|---------------|-------|-----|-----|----------|--------|-------------|---------|
| 5000 | 80000 | 23619,0476190476 | 1,88235294117647 | 44459,3837535014 | 1,2 | 16 01/12/2013 | 2013 | 12 | | | | 133 | M |
| 5000 | 70000 | 20566,6666666667 | 0,875 | 18068,3333333333 | 1,5 | 14 01/01/2014 | 2014 | 1 | | | | 133 | M |
| 5000 | 50000 | 14761,9047619048 | 0,714285714285714 | 10544,2176807048 | 1,425 | 10 01/02/2014 | 2014 | 2 | | | | 133 | M |
| 5000 | 5000 | 1476,19047619048 | 0,117647058823529 | 173,669467787115 | 0,675 | 1 01/03/2014 | 2014 | 3 | | | | 133 | M |
| 2500 | 5000 | 1476,19047619048 | 0,133333333333333 | 196,825396825397 | 0,96 | 1 01/04/2014 | 2014 | 4 | | | | 133 | M |
| 5000 | 20000 | 5904,7619047619 | 0,8 | 4723,80952380952 | 1,75 | 4 01/05/2014 | 2014 | 5 | | | | 133 | M |
| 5000 | 15000 | 4428,57142857143 | 3 | 13285,7142857143 | 1,5 | 3 01/06/2014 | 2014 | 6 | | | | 133 | M |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | -0,375 | 0 01/07/2014 | 2014 | 7 | | | | 133 | M |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | -0,428571428571428 | 0 01/08/2014 | 2014 | 8 | | | | 133 | M |
| 5000 | 30000 | 8571,42857142857 | 0,363636363636364 | 3116,88311688312 | 19 | 6 01/09/2014 | 2014 | 9 | | | | 133 | M |
| 5000 | 70000 | 20000 | 2 | 40000 | 7 | 14 01/10/2014 | 2014 | 10 | | | | 133 | M |

Figura 5.4: Ejemplo de valores KPI para un periodo mensual

5.1.6. Asignación de etiquetas

A cada tupla de KPI se le debe asignar una sola etiqueta de entre las siguientes “Nada”, “Poco”, “Medio” o “Mucho”. El etiquetado es uno de los puntos focales para el aprendizaje automático.

Para una mayor fiabilidad esta asignación de etiquetas debe ser realizada y revisada por el experto del área de compras (que podría ser el gerente de administración de compras u otra persona a cargo de la reposición de stock), es decir, el experto debería analizar los KPI por cada tupla y tomar la decisión en base a sus conocimientos y experiencia el volumen de compra apropiado para la reposición de stock para el siguiente periodo. Por ejemplo si el experto escoge la etiqueta *Nada* para una tupla dada, significa que el considera no realizar ninguna compra para el siguiente periodo.

Para el presente trabajo el etiquetado fue realizado en forma empírica, sin la intervención de un experto por la dificultad de contar con una persona especializada en el área. La estrategia para el etiquetado se basa en los siguientes pasos:

Paso 1:

Para cada KPI se define una tabla con un rango de valores, luego de acuerdo al valor calculado para dicho KPI se le asigna una determinada letra. A continuación mostramos la tabla de rangos para cada KPI.

Tabla 5.1: **RANGO KPI TICKET MEDIO**

| | |
|---|---|
| $(=)$ igual a 0 | a |
| $>$ (mayor) a 0 y $<$ (menor) a 1 | b |
| \geq (mayor o igual) a 1 y \leq (menor o igual) a 3 | c |
| $>$ (mayor) a 3 | d |

Tabla 5.2: **RANGO KPI CIFRA VENTAS (%)**

| | |
|--|---|
| \geq (mayor o igual) a 0 y \leq (menor o igual) a 20 | e |
| $>$ (mayor) a 20 y \leq (menor o igual) a 50 | f |
| $>$ (mayor) a 50 y \leq (menor o igual) a 80 | g |
| $>$ (mayor) a 80 y \leq (menor o igual) a 100 | h |

Tabla 5.3: **RANGO KPI MARGEN COMERCIAL (%)**

| | |
|--|---|
| \geq (mayor o igual) a 0 y \leq (menor o igual) a 20 | i |
| $>$ (mayor) a 20 y \leq (menor o igual) a 50 | j |
| $>$ (mayor) a 50 y \leq (menor o igual) a 80 | k |
| $>$ (mayor) a 80 y \leq (menor o igual) a 100 | l |

Tabla 5.4: **RANGO KPI ROTACIÓN STOCK**

| | |
|---|---|
| $(=)$ igual a 0 | m |
| $>$ (mayor) a 0 y $<$ (menor) a 1 | n |
| \geq (mayor o igual) a 1 y \leq (menor o igual) a 3 | o |
| $>$ (mayor) a 3 | p |

Tabla 5.5: **RANGO KPI COBERTURA STOCK**

| | |
|---|---|
| $(=)$ igual a 0 | q |
| $>$ (mayor) a 0 y $<$ (menor) a 1 | r |
| \geq (mayor o igual) a 1 y \leq (menor o igual) a 3 | s |
| $>$ (mayor) a 3 y \leq (menor o igual) a 10 | t |
| $>$ (mayor) a 10 | u |

Paso 2:

Posteriormente cada tupla queda definida por un conjunto de 5 letras, luego a cada combinación de letras se asignó de forma empírica una de las posibles etiquetas “*Nada*”, “*Poco*”, “*Medio*” o “*Mucho*” denotado en el cuadro 5.6.

| KPI TIKET | KPI CIFRA | KPI MARGEN | KPI ROTACION | KPI COEF | KPI COBERTURA | | | | | | |
|--------------|--------------|---------------|-----------------|--------------|------------------|----------|------|-----|--------|-----------|--|
| MEDIO | VENTAS | COMERCIAL | STOCK | RENTABILIDAD | STOCK | CANTIDAD | AÑO | MES | SEMANA | RESULTADO | |
| 4667 | 28000 | 12008 | 0.483 | 5797 | 2.571 | 7 | 2013 | 12 | 49 | Mucho | |
| 4000 | 4000 | 1715 | 0.061 | 104 | 3.4 | 1 | 2013 | 12 | 50 | Nada | |
| 4000 | 20000 | 8577 | 0.27 | 2318 | 4.364 | 5 | 2013 | 12 | 51 | Nada | |
| 4000 | 16000 | 6862 | 0.211 | 1445 | 4.846 | 4 | 2013 | 12 | 52 | Nada | |
| 4000 | 8000 | 3431 | 0.125 | 429 | 5.1 | 2 | 2013 | 12 | 53 | Nada | |
| 4000 | 20000 | 8577 | 0.4 | 3431 | 4.091 | 5 | 2014 | 1 | 1 | Medio | |
| 6000 | 12000 | 5146 | 0.353 | 1816 | 2.727 | 3 | 2014 | 1 | 2 | Nada | |
| 4000 | 12000 | 5146 | 0.353 | 1816 | 2.1 | 3 | 2014 | 1 | 3 | Nada | |
| 5600 | 28000 | 12008 | 1.077 | 12932 | 2.727 | 7 | 2014 | 1 | 4 | Medio | |

Figura 5.5: Ejemplo de etiquetado para periodo semanal.

Tabla 5.6: TABLA DE ETIQUETADO POR EL EXPERTO

| | | | | | |
|-------|------|-------|------|-------|-------|
| aeimq | Nada | bejmq | Poco | bejoq | Poco |
| aeimr | Nada | bejnr | Poco | bejpq | Medio |
| aeims | Nada | bejns | Nada | beknq | Poco |
| aeimt | Nada | bejnt | Nada | beknr | Poco |
| aeimu | Nada | bejnu | Nada | bekns | Nada |
| ... | ... | ... | ... | ... | ... |

En la figura 5.5 se muestra un extracto del etiquetado para un periodo semanal. La última columna contiene las etiquetas como resultado del proceso.

5.2. Resumen

Sintetizando el capítulo se puede resumir que el modelado del problema se basa en tres grandes procesos: a) proceso de Business Intelligence y sus etapas b) proceso de obtención de KPI y c) proceso de etiquetado.

El proceso de Business Intelligence abarcó tres de sus principales etapas, 1) el acceso a las fuentes de información, 2) el proceso de extracción, transformación y carga de los datos obtenidos de la fuente de origen y 3) el diseño y construcción del datawarehouse. El acceso a la fuente de información de los datos no representó mayores inconvenientes, el proceso consistió en restaurar en un servidor local el backup de los datos de la empresa que proporcionó la información. Durante el ETL se tuvo que identificar las columnas de las tablas relevantes para la *extracción* que posteriormente generan las métricas de las tablas de hechos, los problemas encontrados en esta etapa se dieron por ciertas inconsistencias de datos, valores vacíos y datos nulos los cuales fueron corregidos en la *transformación* y posterior *carga* de los datos al datawarehouse. Para construir el datawarehouse el trabajo clave consistió en definir las tablas de hechos que sirven de base para el calculo de los KPI junto con sus principales dimensiones utilizando el esquema estrella.

En el proceso de obtención de KPI, el principal trabajo fue la selección de los KPI relevantes en las áreas de negocios ventas y productos. Debido a que en la literatura los KPI miden los procesos de negocios a un nivel de generalización donde se ven a los productos como un todo, las fórmulas fueron adaptadas de modo que las mediciones fueron bajadas a un nivel de productos individuales.

El en etiquetado, lo esencial es contar con la participación de un experto en administración en compras con conocimientos y capacidad de interpretación de KPI. En este proceso se simula al experto mediante un conjunto de reglas para indicar la etiqueta a cada tupla de KPI.

Capítulo 6

Experimentación

6.1. Experimentación

Se describirá cómo es la implementación del proceso de aprendizaje automático para este caso de estudio. Se mostrará primeramente cómo está constituida la salida del proceso de Business Intelligence, que en esencia proveen las instancias necesarias para la entrada del proceso de aprendizaje automático. También se verá qué clasificadores fueron utilizados, cómo se realizó el proceso de entrenamiento y de evaluación, y cuáles son las métricas de evaluación consideradas para medir el rendimiento de los clasificadores.

Para resumir la técnica propuesta, en la figura 6.1 se ilustra el esquema general de la solución.



F:/TESIS_2016/Libro-Paper/tesisLibroBIML/06_Experimentation

Figura 6.1: Esquema general de solución

6.1.1. Datos proveídos por Business Intelligence

La salida de Business Intelligence provee tres conjuntos de datos independientes que se corresponden con los períodos de análisis: Mensuales, Quincenales y Semanales.

- Períodos Mensuales: Se analizaron 309 productos diferentes, y por cada producto se tiene un máximo de 34 instancias. Cada instancia tiene los siguientes atributos: Ticket Medio, Cifra de Ventas, Margen Comercial, Rotación de Stock, Coeficiente de Rentabilidad, Cobertura de Stock, Cantidad, Año, Mes. La clase de cada instancia está definida por $y \in \{Nada, Poco, Medio, Mucho\}$.
- Períodos Quincenales: Se analizaron 228 productos diferentes, y por cada producto se tiene un máximo de 68 instancias. Cada instancia tiene los siguientes atributos: Ticket Medio, Cifra de Ventas, Margen Comercial, Rotación de Stock, Coeficiente de Rentabi-

lidad, Cobertura de Stock, Cantidad, Año, Quincena. La clase de cada instancia está definida por $y \in \{Nada, Poco, Medio, Mucho\}$.

- **Períodos Semanales:** Se analizaron 127 productos diferentes, y por cada producto se tiene un máximo de 151 instancias. Cada instancia tiene los siguientes atributos: Ticket Medio, Cifra de Ventas, Margen Comercial, Rotación de Stock, Coeficiente de Rentabilidad, Cobertura de Stock, Cantidad, Año, Semana. La clase de cada instancia está definida por $y \in \{Nada, Poco, Medio, Mucho\}$.

6.1.2. Esquema general de procesamiento

Se implementa el siguiente esquema de procesamiento con el dataset:

- **Instancias de Períodos Mensuales:** Por cada producto, se realiza el entrenamiento y testeo de sus instancias con todos los algoritmos de clasificación posibles, luego se analizan las métricas de desempeño arrojadas por cada algoritmo y finalmente se elige el mejor clasificador que será utilizado para la predicción de la demanda en períodos mensuales futuros.
- **Instancias de Períodos Quincenales:** Por cada producto, se realiza el entrenamiento y testeo de sus instancias con todos los algoritmos de clasificación posibles, luego se analizan las métricas de desempeño arrojadas por cada algoritmo y finalmente se elige el mejor clasificador que será utilizado para la predicción de la demanda en períodos quincenales futuros.
- **Instancias de Períodos Semanales:** Por cada producto, se realiza el entrenamiento y testeo de sus instancias con todos los algoritmos de clasificación posibles, luego se analizan las métricas de desempeño arrojadas por cada algoritmo y finalmente se elige el mejor clasificador que será utilizado para la predicción de la demanda en períodos semanales futuros.

6.1.3. Entrenamiento y evaluación

Como se mencionó en el esquema general de procesamiento, el entrenamiento y testeo se realiza con todos los algoritmos de clasificación posibles, para ello se utiliza la herramienta WEKA y sus algoritmos de clasificación según la tabla 4.1. Otra forma de categorizar los clasificadores incluidos en WEKA es como sigue:

- **Bayesianos:** BayesNet, NaiveBayes, NaiveBayesUpdateable.
- **Basados en funciones:** Logistic, MultilayerPerceptron, SimpleLogistic, SMO.
- **Basados en reglas:** OneR, DecisionTable, JRip, PART, ZeroR.
- **Basados en árboles:** DecisionStump, J48, LMT, RandomForest, RandomTree, REPTree.

En el algoritmo 6.1 se presenta la estrategia de aprendizaje y selección de los clasificadores.

Algoritmo 6.1 Pseudocódigo para el proceso de clasificación.

```

for cada período de análisis {mensual, quincenal, semanal}:
    for cada producto con sus instancias:
        establecer conjunto de entrenamiento;
        establecer conjunto de testeo;
        for cada algoritmo de clasificación:
            construir clasificador (conjunto de entrenamiento);
            evaluar clasificador (conjunto de testeo);
            obtener métricas de evaluación;
        endfor;
        criterios de línea de base (ZeroR, criterios del experto u otro);
        seleccionar mejor clasificador (max(Kappa));
        guardar clasificador;
    endfor;
endfor;

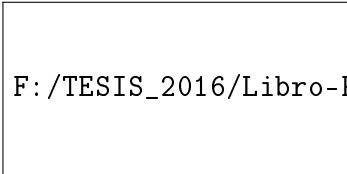
```

La evaluación se hace por el método Stratified k-fold Cross Validation para un valor de k igual a 10 y las métricas de desempeño consideradas son el *Porcentaje de Acierto* y la *Estadística Kappa*. El criterio de línea de base utilizado fue el clasificador ZeroR, el cual es uno de los criterios de línea de base más representativos para problemas de clasificación. Se considera que también puede resultar conveniente que el experto en compras establezca su propio criterio de línea de base, como puede ser un umbral mínimo de porcentaje de acierto aceptado.

[GRAFICO ZERO-R] COMPARATIVO CON GRAFICO DE LINEAS ENTRE LOS ACIERTOS DE NUESTROS ALGORITMOS Y LA LINEA BASE ZERO-R

[GRAFICO SESGO Y VARIANZA]

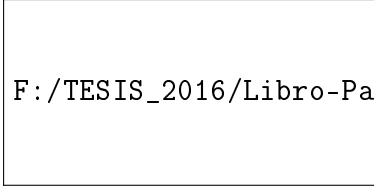
Por cada producto y período de análisis se elige como clasificador aquel que haya alcanzado el mayor valor de *Kappa*. En la figura 6.2 se muestra como quedó la distribución de clasificadores para períodos mensuales. Por ejemplo, el clasificador *Logistic* resultó una mejor solución para 149 productos para periodos mensuales.



F:/TESIS_2016/Libro-Paper/tesisLibroBIML/06_Experimentac

Figura 6.2: Conteo de clasificadores para período mensual.

Se puede observar en la figura 6.3 que la técnica propuesta alcanza altos porcentajes de aciertos en promedio, tanto para periodos mensuales, quincenales como semanales.



F:/TESIS_2016/Libro-Paper/tesisLibroBIML/06_Experimentaci

Figura 6.3: Promedio de porcentaje de aciertos para los tres períodos de análisis.

Como se trata de una prueba exhaustiva, por cada producto se intenta con todos los algoritmos de clasificación posible y se evalúa con el método Stratified 10-fold Cross Validation. Estas métricas de desempeño preliminares dan indicio de que la técnica propuesta en este trabajo puede alcanzar altos grados de confiabilidad. Obtener buenos resultados depende en gran medida de que la obtención de valores de *KPI* y la asignación de etiquetas hayan sido realizadas correctamente.

6.1.4. Cómo hacer las predicciones

En el algoritmo 6.2 se muestra el mecanismo para obtener el pronóstico de la demanda en un ambiente de producción.

Algoritmo 6.2 Pseudocódigo para el proceso de pronóstico de la demanda.

```

for cada próximo período a pronosticar {mensual, quincenal, semanal}:
    for cada producto:
        obtener KPIs del período actual finalizado;
        ejecutar su mejor clasificador (KPIs);
        obtener etiqueta {nada, poco, medio, mucho}
        extrapolar a valores continuos(criterio experto);
    endfor;
endfor;

```

Como se mencionó anteriormente, la técnica propuesta arroja como resultado un valor discreto $y \in \{Nada, Poco, Medio, Mucho\}$. Luego en función de la etiqueta resultante, del tipo de producto y del período seleccionado, el experto extrapola a un valor continuo que representa la cantidad en la orden de compra. El significado de las etiquetas también varía en función del tipo de producto.

6.2. Discusión

6.2.1. Impacto del período de análisis

Una de las decisiones que se debe tomar es acerca del tiempo asignado al período de análisis. En este trabajo se analizaron tres períodos distintos: mensuales, quincenales y semanales con propósitos experimentales y por ser los más comunes en el ámbito comercial. En la práctica, la

elección del período es una decisión estratégica a nivel gerencial que depende en gran medida del sector y tamaño de la empresa, tipos de productos y otros criterios.

En el presente trabajo, por tratarse de períodos de tiempo muy cercanos (1, 2 y 4 semanas) no se observan diferencias significativas en el porcentaje de aciertos. Otro factor a tener en cuenta es que para períodos de tiempo muy extensos (6, 12 meses) existe mayor incertidumbre en el pronóstico.

6.2.2. Impacto del etiquetado

La técnica propuesta se trata de un sistema parametrizado, donde las variables principales son el período comercial y las etiquetas seleccionadas para la clasificación. Por cuestiones de practicidad y generalidad se eligió para este trabajo un enfoque de problema de clasificación. El etiquetado proporciona mayor flexibilidad al sistema y un entorno más controlable, en comparación a un sistema de asignación de valores continuos. La flexibilidad del sistema permitió emular la opinión del experto en compras y encontrar una cantidad eficiente de etiquetas.

Capítulo 7

Conclusiones

7.1. Conclusiones

Este trabajo se enfocó en proponer una nueva técnica de estimación de la demanda de productos, para reposición de stock en empresas retail. Como se mencionó en la Sección 2, la gestión de compras es uno de los ejes centrales en la actividad empresarial y la decisión del volumen de compras para cada producto es un desafío que enfrentan las empresas al momento de reponer el stock. Partiendo de esta premisa y analizando las técnicas de pronóstico de la demanda empleadas en la actualidad, y el creciente incremento del uso de tecnologías de Business Intelligence en las organizaciones, se encontró la oportunidad de desarrollar una nueva técnica de pronóstico. En esta nueva técnica se utilizan los Indicadores Claves de Rendimiento y apoyados en la experiencia de un experto en compras (gerente o encargado de compras) se realiza el modelado utilizando algoritmos de clasificación de Machine Learning.

De acuerdo a los resultados experimentales se obtuvieron altas tasas de aciertos, haciendo pruebas exhaustivas con varios algoritmos de clasificación y evaluando con un método ampliamente aceptado. La técnica propuesta pretende que este nuevo modelo se convierta en una herramienta de apoyo en la toma de decisiones del gerente de compras en el proceso de reposición de stock.

Bibliografía

- [A10] M.M.P.A.I.B.B. ' and M.M.P. Ana. *Introducción a la gestión de stocks: El proceso de control, valoración y gestión de stocks*. Ideaspropias Editorial, 2010. 6
- [AE91] E.E. Adam and R.J. Ebert. *Administración de la producción y las operaciones: conceptos, modelos y funcionamiento*. Prentice Hall, 1991. 5
- [AK91] D. Aha and D. Kibler. Instance-based learning algorithms. *Machine Learning*, 6:37–66, 1991. 40
- [Alv13] Marcos Alvarez. *Cuadro de Mando Retail*. Profit, 2013. 1, 24, 52
- [AMS96] C. Atkeson, A. Moore, and S. Schaal. Locally weighted learning. *AI Review*, 1996. 41
- [ASW⁺11] David R. Anderson, Dennis J. Sweeney, Thomas A. Williams, Jeffrey D. Camm, and Kipp Martin. *Métodos cuantitativos para los negocios*. © D.R. 2011 por Cengage Learning Editores, S.A. de C.V., una compañía de Cengage Learning, Inc, 11 edition, 2011. 1, 2, 7, 8, 9, 10, 14
- [atUoW] Machine Learning Group at the University of Waikato. Weka 3: Data mining software in java. 40
- [BFH⁺16] Remco R. Bouckaert, Eibe Frank, Mark Hall, Richard Kirkby, Peter Reutemann, Alex Seewald, and David Scuse. *WEKA Manual for Version 3-8-0*, April 2016. 40
- [Bre96] Leo Breiman. Bagging predictors. *Machine Learning*, 24(2):123–140, 1996. 41
- [Bre01] Leo Breiman. Random forests. *Machine Learning*, 45(1):5–32, 2001. 42
- [Can07] Josep Lluís Cano. *Busines Intelligence: Competir con información*. ESADE, Banesto, Banesto Pyme, 2007. 15, 16, 17, 18, 22
- [Cha06] S.N. Chapman. *Planificación y control de la producción*. Pearson educación. Pearson Educación, 2006. 5
- [Coh95] William W. Cohen. Fast effective rule induction. In *Twelfth International Conference on Machine Learning*, pages 115–123. Morgan Kaufmann, 1995. 41

- [CT95] John G. Cleary and Leonard E. Trigg. K*: An instance-based learner using an entropic distance measure. In *12th International Conference on Machine Learning*, pages 108–114, 1995. 41
- [DDM15] A. DE DIEGO MORILLO. *Gestión de pedidos y stock*. Paraninfo, 2015. 6
- [EH05] Wayne W. Eckerson and Cindi Howson. Enterprise business intelligence: Strategies and technologies for deploying bi on an enterprise scale tdwi report series. 2005. 16, 23
- [FHB05] Bent Flyvbjerg, Mette K. Skamris Holm, and Søren L. Buhl. How (in)accurate are demand forecasts in public works projects?: The case of transportation. *Journal of the American Planning Association*, 71(2):131–146, 2005. 2
- [FHP03] Eibe Frank, Mark Hall, and Bernhard Pfahringer. Locally weighted naive bayes. In *19th Conference in Uncertainty in Artificial Intelligence*, pages 249–256. Morgan Kaufmann, 2003. 41
- [FHT98] J. Friedman, T. Hastie, and R. Tibshirani. Additive logistic regression: a statistical view of boosting. Technical report, Stanford University, 1998. 41
- [FS96] Yoav Freund and Robert E. Schapire. Experiments with a new boosting algorithm. In *Thirteenth International Conference on Machine Learning*, pages 148–156, San Francisco, 1996. Morgan Kaufmann. 41
- [FW98] Eibe Frank and Ian H. Witten. Generating accurate rule sets without global optimization. In J. Shavlik, editor, *Fifteenth International Conference on Machine Learning*, pages 144–151. Morgan Kaufmann, 1998. 42
- [FWI⁺98] E. Frank, Y. Wang, S. Inglis, G. Holmes, and I.H. Witten. Using model trees for classification. *Machine Learning*, 32(1):63–76, 1998. 41
- [Gar06] Gartner. Glosario de gartner, www.gartner.com, enero 2006. gartner es una consultora internacional especializada en tecnologías de información y comunicación, January 2006. 15
- [Gio17] Marcello Giordano. Pronostico de la demanda - meetlogistics. <https://meetlogistics.com/demand-planning/pronostico-de-la-demanda/>, 2017. (Accessed on 01/16/2018). 1, 2
- [GR12] John Gantz and David Reinsel. The digital universe in 2020: Big data , bigger digital shadows, and biggest growth in the far east. *IDC iView*, 2012. 30
- [HGS17] Jakob Huber, Alexander Gossmann, and Heiner Stuckenschmidt. Cluster-based hierarchical demand forecasting for perishable goods. *Expert Systems with Applications*, 76:140 – 151, 2017. 14

- [HH08] Frederick S. Hillier and Mark S. Hillier. *Métodos cuantitativos para administración*. Tercera edition, 2008. 7, 8, 9, 10, 11, 13, 14
- [Ho98] Tin Kam Ho. The random subspace method for constructing decision forests. *IEEE Transactions on Pattern Analysis and Machine Intelligence*, 20(8):832–844, 1998. 41
- [Hol93] R.C. Holte. Very simple classification rules perform well on most commonly used datasets. *Machine Learning*, 11:63–91, 1993. 42
- [HSD01] Geoff Hulten, Laurie Spencer, and Pedro Domingos. Mining time-changing data streams. In *ACM SIGKDD Intl. Conf. on Knowledge Discovery and Data Mining*, pages 97–106. ACM Press, 2001. 42
- [HT98] Trevor Hastie and Robert Tibshirani. Classification by pairwise coupling. In Michael I. Jordan, Michael J. Kearns, and Sara A. Solla, editors, *Advances in Neural Information Processing Systems*, volume 10. MIT Press, 1998. 40
- [htt] <http://weka.sourceforge.net/doc.dev/weka/classifiers/Classifier.html>. Interface classifier. 40
- [Inm92] W.H. Inmon. *Building the datawarehouse*. QED Press, 1992. 20
- [JC10] Jordi Conesa Josep Curto. *Introducción al Business Intelligence*. Editorial UOC, 2010. 15, 17, 20, 21, 22
- [JL95] George H. John and Pat Langley. Estimating continuous distributions in bayesian classifiers. In *Eleventh Conference on Uncertainty in Artificial Intelligence*, pages 338–345, San Mateo, 1995. Morgan Kaufmann. 40
- [JLF12] P. Fraser Johnson, Michiel R. Leenders, and Anna E. Flynn. *Administración de compras y abastecimientos*. McGRAW-HILL / INTERAMERICANA EDITORES, S.A. DE C.V, 2012. 1, 5, 7, 9, 14
- [KH03] D.M. Kroenke and A.E.G. Hernández. *Procesamiento de bases de datos: fundamentos, diseño e implementación*. Pearson Educación, 2003. 21
- [KHDM98] J. Kittler, M. Hatef, Robert P.W. Duin, and J. Matas. On combining classifiers. *IEEE Transactions on Pattern Analysis and Machine Intelligence*, 20(3):226–239, 1998. 41
- [Kim92] Ralph Kimball. *The datawarehouse Toolkit*. John Wiley & Sons, Inc, 1992. 18, 20, 48, 50
- [Koh95a] R. Kohavi. *Wrappers for Performance Enhancement and Oblivious Decision Graphs*. PhD thesis, Stanford University, Department of Computer Science, Stanford University, 1995. 41

- [Koh95b] Ron Kohavi. The power of decision tables. In *8th European Conference on Machine Learning*, pages 174–189. Springer, 1995. 41
- [KSBM01] S.S. Keerthi, S.K. Shevade, C. Bhattacharyya, and K.R.K. Murthy. Improvements to platt’s smo algorithm for svm classifier design. *Neural Computation*, 13(3):637–649, 2001. 40
- [Kun04] Ludmila I. Kuncheva. *Combining Pattern Classifiers: Methods and Algorithms*. John Wiley and Sons, Inc., 2004. 41
- [lCvH92] S. le Cessie and J.C. van Houwelingen. Ridge estimators in logistic regression. *Applied Statistics*, 41(1):191–201, 1992. 40
- [LHF05] Niels Landwehr, Mark Hall, and Eibe Frank. Logistic model trees. 95(1-2):161–205, 2005. 40, 42
- [MA03] L.T. Moss and S. Atre. *Business Intelligence Roadmap: The Complete Project Lifecycle for Decision-support Applications*. Addison-Wesley information technology series. Addison-Wesley, 2003. 15
- [McC59] John McCarthy. Programs with common sense. *Computer Science Department - Stanford University*, 1959. 29
- [Min74] Marvin Minsky. A framework for representing knowledge. *MIT-AI Laboratory Memo 306*, 1974. 29
- [MN98] Andrew McCallum and Kamal Nigam. A comparison of event models for naive bayes text classification. In *AAAI-98 Workshop on ‘Learning for Text Categorization’*, 1998. 40
- [MP87] Marvin Minsky and Seymour A. Papert. *Perceptrons: An Introduction to Computational Geometry, Expanded Edition*. The MIT Press, 1987. 29
- [Pla98] J. Platt. Fast training of support vector machines using sequential minimal optimization. In B. Schoelkopf, C. Burges, and A. Smola, editors, *Advances in Kernel Methods - Support Vector Learning*. MIT Press, 1998. 40
- [PMAR07] Arley Pérez, Alberto Medina, Pavel Alonso, and Nguyen Ramírez. Métodos y técnicas para la previsión de la demanda. *Universidad de Matanzas Camilo Cienfuegos - Facultad Industrial-Economía*, 2007. 6, 9
- [Pug16] Jean Francois Puget. What is machine learning?, May 2016. 31
- [Qui93] Ross Quinlan. *C4.5: Programs for Machine Learning*. Morgan Kaufmann Publishers, San Mateo, CA, 1993. 42

- [RGS02] N.H. Rasmussen, P.S. Goldy, and P.O. Solli. *Financial Business Intelligence: Trends, Technology, Software Selection, and Implementation*. Wiley, 2002. 25
- [RN04] Stuart Russell and Peter Norvig. *Inteligencia Artificial. Un Enfoque Moderno. Segunda Edición*. PEARSON EDUCACIÓN, S.A., 2004. 28, 31, 32
- [Sam59] Arthur Samuel. Some studies in machine learning using the game of checker. *IBM Journal* 3, 211-229, 1959. 31
- [SB98] Richard S. Sutton and Andrew G. Barto. *Reinforcement Learning: An Introduction*. A Bradford Book. MIT Press, Cambridge, Massachusetts., 1998. 33
- [SBO98] D. Sipper, R.L. Bulfin, and M.G. Osuna. *Planeación y control de la producción*. McGraw-Hill, 1998. 2, 5
- [Sch08] Swain Scheps. *Business Intelligence For Dummies*. For Dummies, 2008. 15
- [SFH05] Marc Sumner, Eibe Frank, and Mark Hall. Speeding up logistic model tree induction. In *9th European Conference on Principles and Practice of Knowledge Discovery in Databases*, pages 675–683. Springer, 2005. 40, 42
- [SS17] Ergun Sevgi and Sahin Suleyman. Literature survey about demand forecasting in industry. *Ulakbilge: Sosyal Bilimler Dergisi, Vol 5, Iss 10, Pp 469-487 (2017)*, (10):469, 2017. 14
- [SV08] Alex Smola and S.V.N. Vishwanathan. *Introduction to Machine Learning*. The Press Syndicate of The University of Cambridge, 2008. 29, 38
- [Tur50] Alan Turing. Computing machinery and intelligence. *Mind* 49: 433-460, 1950. 28
- [VAH11] Naim Caba Villalobos, Oswaldo Chamorro Altahona, and Tomás José Fontalvo Herrera. *Gestión de la Producción y Operaciones*. 2011. 7, 14
- [Wat06] Hugh James Watson. Recent developments in datawarehousing: A tutorial. 2006. 20
- [WFH11] Ian H. Witten, Eibe Frank, and Mark A. Hall. *Data Mining - Practical Machine Learning Tools and Techniques - Third Edition*. Copyright © 2017 Elsevier Inc. All rights reserved, tercera edición, 2011. 38, 43, 44
- [WFHP16] Ian H. Witten, Eibe Frank, Mark A. Hall, and Christopher J. Pal. *Data Mining - Practical Machine Learning Tools and Techniques - Fourth Edition*. Cuarta edición, 2016. 40
- [Wol92] David H. Wolpert. Stacked generalization. *Neural Networks*, 5:241–259, 1992. 41

- [Wre06] R. Wrembel. *Data Warehouses and OLAP: Concepts, Architectures and Solutions: Concepts, Architectures and Solutions*. Gale virtual reference library. IRM Press, 2006. 22