

Atelier: Technologies des Grosses Data

de Statisticien à *Data Scientist*

Philippe Besse & Brendan Guillouet

Université de Toulouse
INSA – Dpt GMM
Institut de Mathématiques – ESP
UMR CNRS 5219

Comment devenir *data scientist*

- Quelle technologie utiliser avec des Grosses Données ?
- Compétences requises : Maths-Stat-Info-Métier
- Apprendre à s'auto-former aux technologies volatiles

Stratégie

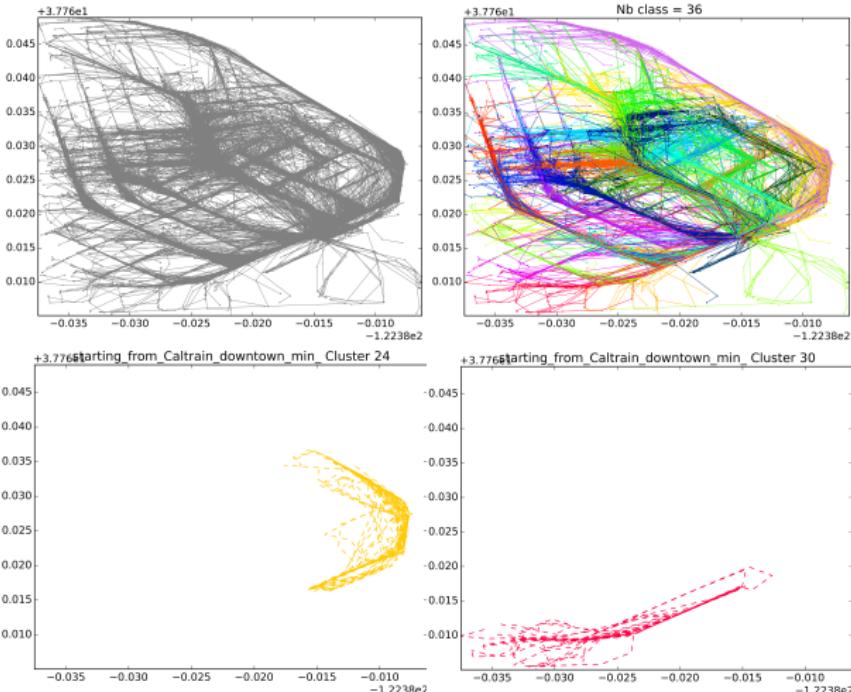
- Atelier pour "statisticien" en semi-autonomie
 - Prototype puis passage à l'échelle du même code
 - Trois cas d'usage : MNIST, MovieLens, Cdiscount
 - Méthodes et algorithmes : préparation, RF, NMF, Logit
 - Trois environnements : R à Python, Python à Spark ?
 - Ressources (tutoriels) sur github.com/wikistat
- [▶ Open Bikes Challenge](#)
- Fiche de *Cloud Computing* avec AWS, ...

Définition des *Grosses Gonnées*

- **Volume** : croissance exponentielle
- **Variété** : signaux, images, graphes
- **Vélocité** : décision séquentielle, optimisation stochastique
- **Validité, Valorisation** —> Prévision —> Apprentissage

Confusion de domaines très variés

- **E-commerce** : recommandations et **Réseaux sociaux**
- **Publique** : administrations, santé et (*open data*)
- **Recherche** Météo, Biologie, Astronomie...
- **Industrie** : défaillance, fraudes, maintenance...



Variété : Classification de trajectoires GPS

Réellement massives ?

- **Seuils** technologiques (RAM, Disque)
- **Préparation** (*munging*) des données (Python)
- Données **distribuées** :
- **Hadoop, MapReduce, scalability**



Ferme de données

Nouvelle (?) Science des Données

- 1995 *Data Mining* : GRC & suites logicielles
- 2010 *Data Science* : Publicité en ligne, *cloud computing*
 - Données **préalables** (fouille), dimensions (omiques) $p \gg n$,
 - Pas de **nouvelles** méthodes, seules celles **échelonnables**
 - **Data** pas toujours *Grosses* mais *datification* du quotidien
 - **Éthique** et virtualisation / transparence de la décision
- "Science" des données : **nouveau** terme d'erreur
 - **Erreur d'optimisation** + Compromis biais / variance
 - **Optimisation** stochastique (Robbins Monro) ;
non différentiable (parcimonie)
 - **Parallélisation** des librairies de calcul

Enjeux sociaux, juridiques, politiques

- ► Les Echos.fr 09-15 :Intelligence artificielle sans danger ?
- ► PredPol 09-14 : type, place, et date du crime
- ► PNAS 01-15 : *Computer based personality judgments*
- ► NorthPointe *Advancing Justice* : Modèle de Cox
- ► MIT NewsRoom 04-15 : *MIT Sloan professor uses machine learning to design crime (recidivism) prediction models*
- ► Justice Prédictive 07-16 Données de jurisprudence
- ► ArsTechnikaUK 02-16 : *The NSA's SKYNET program*
- ► Wall Street Journal 11-15 : *US Government Uses Race Test for \$80 Million in Payments*
- ► france Inter 10-16 : **Assurance** et grosses données

Nouveau modèle économique

- Marges réduites sur matériels (IBM)
- Logiciels sous licence GNU, MIT, Apache... (Microsoft, SAS)
- Vendre du *service* :
 - Enthought ([Canopy](#)), Continuum analytics ([Anaconda](#)),
 - Horton Works, Cloudera ([Hadoop](#), [Spark...](#))
 - Databricks ([Spark](#)), Oxdata ([H2O](#))
 - Revolution Analytics ([RHadoop](#)) – Microsoft
- Nouveau marché du *cloud computing*
 - Platform [aaS](#), Software [aaS](#), Service [aaS...](#)
 - Amazon Web Service
 - Microsoft Azure, Google Cloud Computing
 - IBM Analytics, SAS Advanced Analytics...
- Développement *industriel* vs. Recherche *académique*

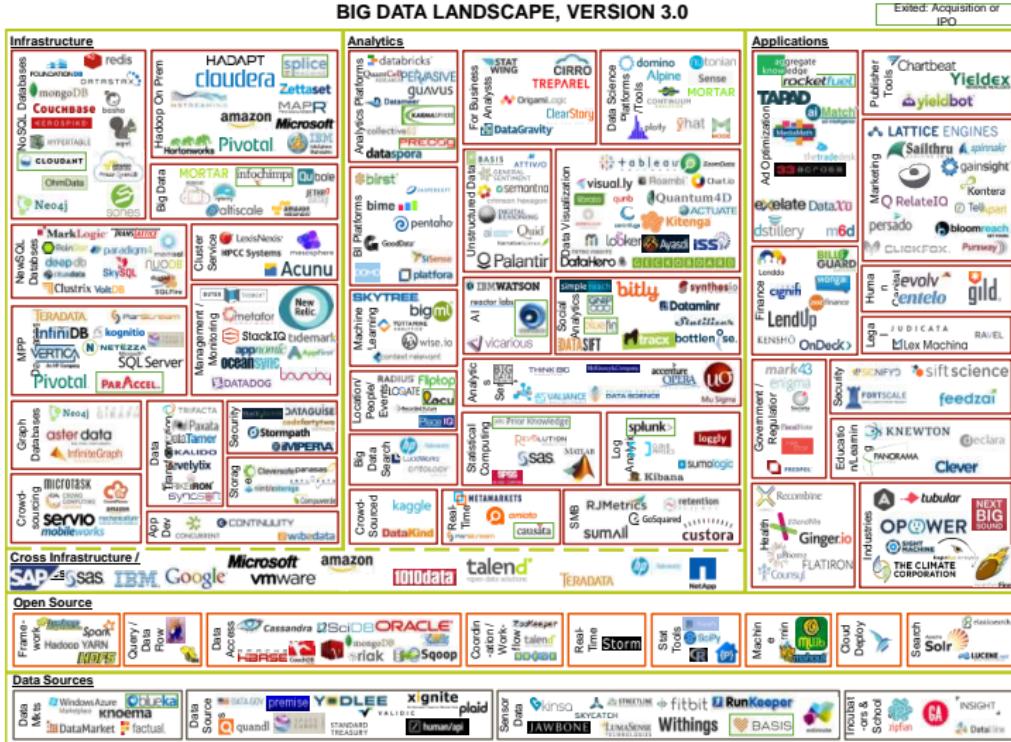
En résumé

- Exemple d'*Amazon Web Service Machine Learning*
 - Utiliser une technologie d'apprentissage-machine puissante sans avoir besoin de maîtriser les algorithmes et techniques de l'apprentissage-machine (*sic !*)
 - Cloud mais qu'avec modèle linéaire ou logistic
 - Pas d'optimisation automatique (pénalisation L_1)
- "Acceptable" en *marketing* (GRC) ?
- Pas en Santé publique, recherche, industrie
- Science des données = Nouveau *packaging*
- Data Scientist : Statisticien confronté à des
 - nouveaux enjeux
 - nouvelles technologies

Introduction

Écosystème Hadoop, MapReduce MapReduce pour les nuls Spark

BIG DATA LANDSCAPE, VERSION 3.0

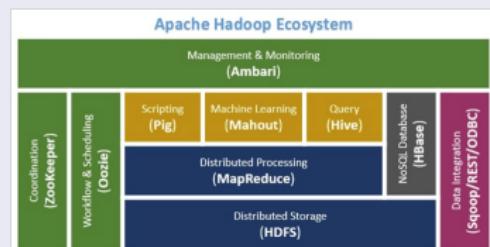


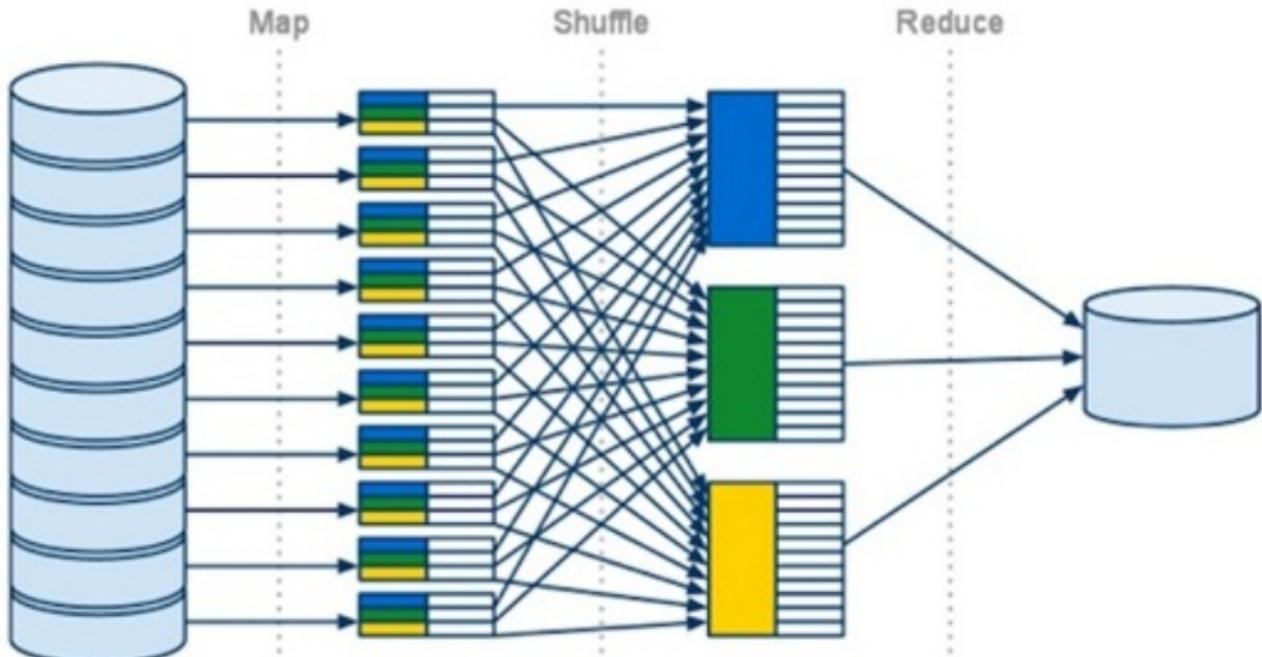
© Matt Turck (@mattturck), Sutian Dong (@sutiantong), & FirstMark Capital (@firstmarkcap)

Écosystème des données massives (Turck, 2014)

Hadoop, MapReduce

- Environnement : *Google* puis *Apache* (2009)
- *Hadoop Distributed File System* (HDFS)
- Données hétérogènes **distribuées**
- Tolérance aux pannes matérielles
- Scalabilité (multiplier les nœuds)
- **Parallélisation** : *Map Reduce*
- Communication par (**clef, valeur**)
- Déplacer les algorithmes, pas les données
- Données *immuables*
- Lecture unique ou *streaming*

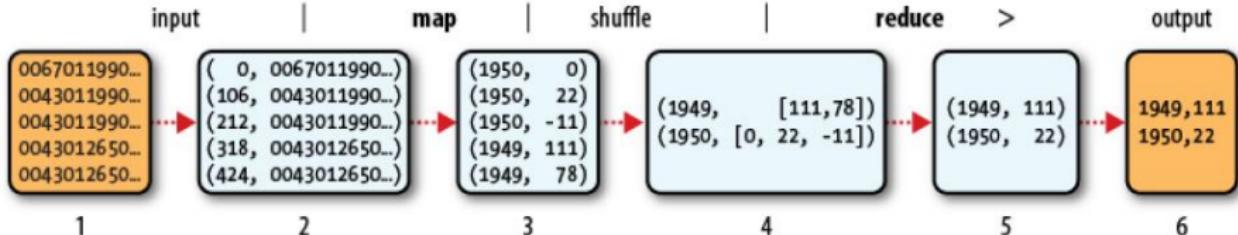




Hadoop Distributed File System (HDFS) & MapReduce

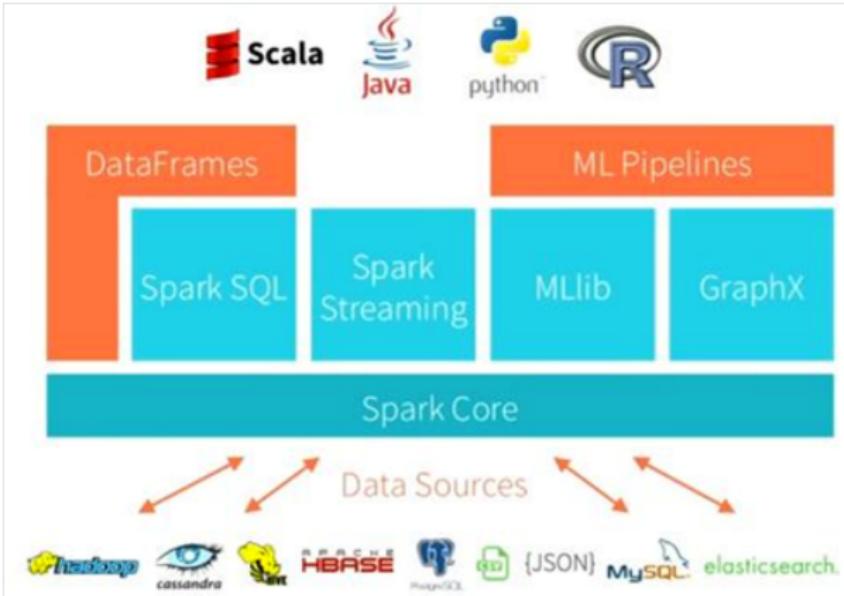
MapReduce

- ① Input \Rightarrow list (k1, v1)
- ② Map () \Rightarrow list (k2, v2)
- ③ *Shuffle, Combine* \Rightarrow (k2, list(v2))
 - Implicite
 - Clefs identiques vers même nœud réducteur
- ④ Reduce () \Rightarrow list (k3, v3)



Classification par centres mobiles ($\approx k\text{-means}$)

- Définition d'une **distance** euclidienne
- Algorithme de **Forgy** (1965)
 - Initialisation des k centres
 - Itération des étapes **MapReduce**
 - **Map** : Affectation de chaque individu (**valeur**) au centre (**clef**) le plus proche
 - **Reduce** : Calcul des **centres** des individus de même **clef**
 - Mise à jour des centres
- **Problème** : accès disques à chaque itération
- **Solution actuelle de Spark** : *Resilient Distributed Dataset*,
(Zaharia *et al.*, 2012)



La technologie **Spark** et son écosystème

Librairie MLlib

- **Spark** 1.6 à 2.0
- **MLlib** (Resilient Distributed Dataset) : *k-means*, SVD, NMF (ALS), Régression linéaire et logistique (l_1 et l_2), SVM linéaires, Classifieur Bayésien Naïf, Arbre, Forêt Aléatoire, Boosting
- Évolution de **SparkML** : *DataFrame*, *pipeline*
- Peu de méthodes mais passage à l'échelle "Volume"

Progression "pédagogique"

- Statistique de petites données avec R
- Traitement et stat de données plus grosses : Python
- Traitement et stat de données distribuées : PySpark

Matériels

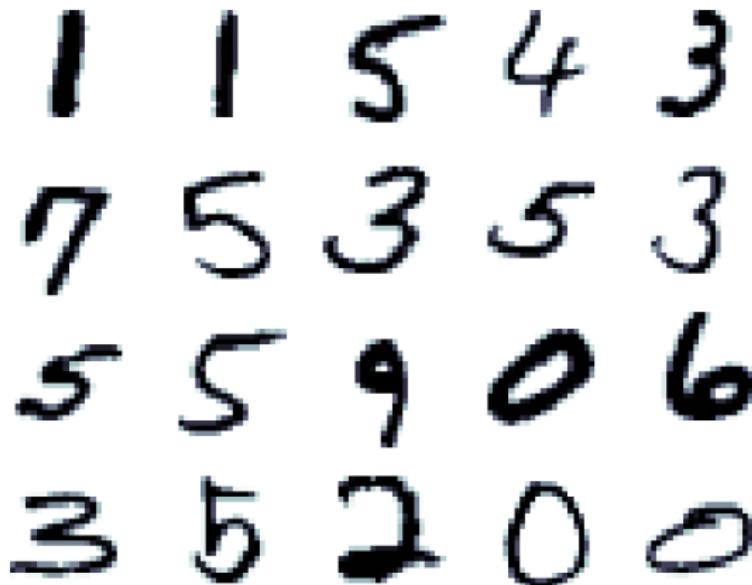
- Ordinateurs personnels avec R, Python 2.7 (Anaconda)
- CSN : R, Python 2.7 (Canopy), Spark 1.6 (Hadoop virtuel)
- Plateforme ([► Hupi.fr](#), Linux Spark 1.6), 1 maître (*driver*), 8 exéuteurs (*workers*) de chacun 7Go de RAM
- Autres : Amazon Web Services, Google cloud ?

Résultats attendus

- **Performance** à l'[Open Bikes Challenge](#)
- [Tutoriel](#), fiche :
 - Implémentation d'une technologie
 - Déroulement d'un atelier dans le [cloud](#)

Rappel de l'objectif principal

[Apprendre à s'auto-former à des technologies
en perpétuelle \(r\)évolution](#)



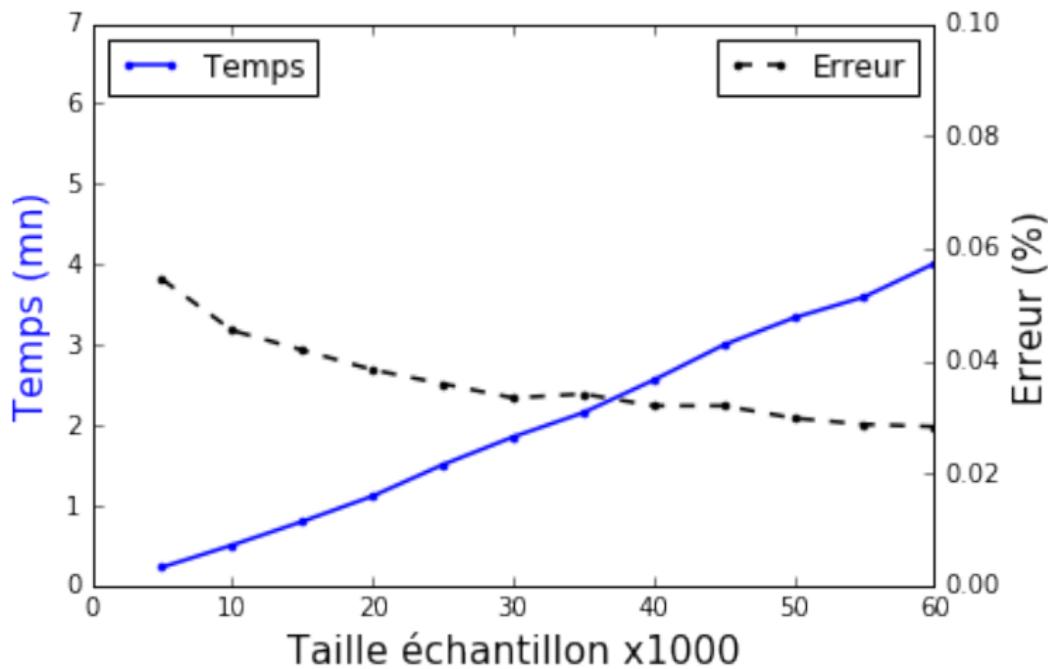
MNIST : quelques exemples d'images de caractères

MNIST : État de l'art

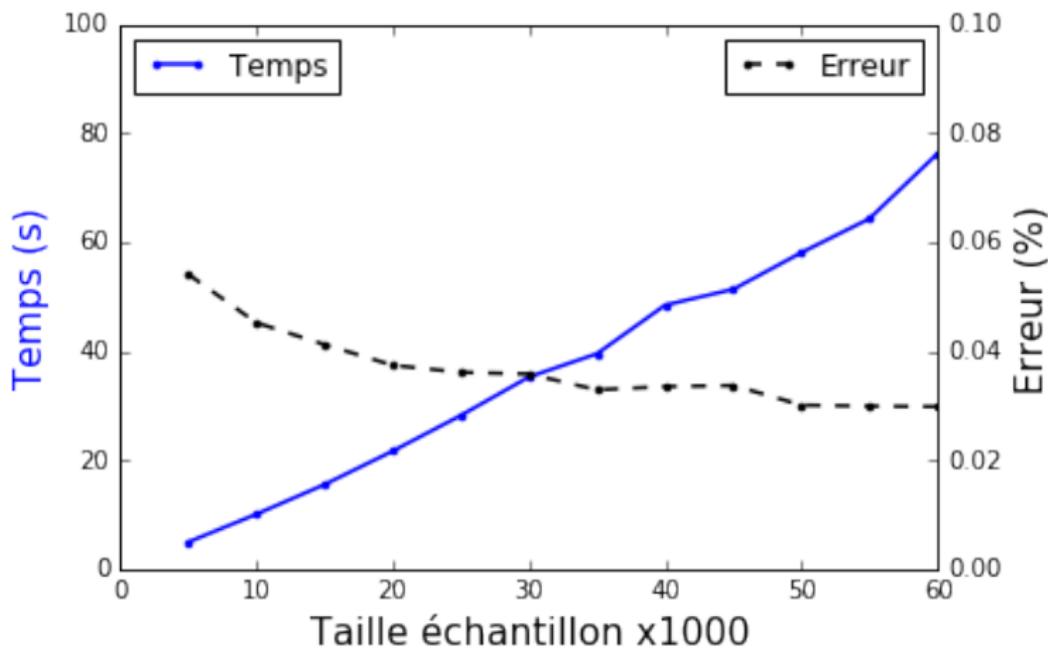
- Site de Yann le Cun
- 60 000 caractères, $28 \times 28 = 784$ pixels
- Test : 10 000 images
- Méthodes classiques (*k*-nn, RF)
- Prétraitement de normalisation des images
- Distance spécifique (tangentielle) avec propriétés d'invariance
- Ondelettes et *scattering* (Stéphane Mallat)
- Apprentissage Profond : *TensorFlow*, *Lasagne*, *Keras*
- ...
- Comparer l'usage des méthodes classiques

Implémentations de Random Forest

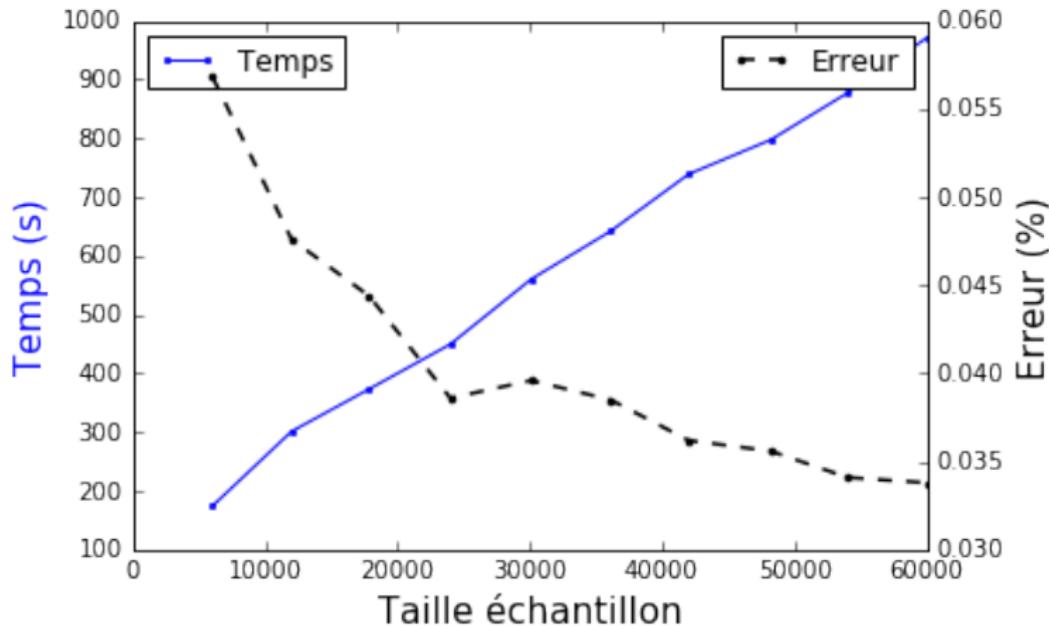
- R : randomForest, ranger
- Python : Scikit-learn
- MLLib : arbres du projet Google PLANET
 - Élagage d'un arbre
 - maxBins = 32
 - maxDepth et problèmes de mémoire
- *Bootstrap* sans remise ?



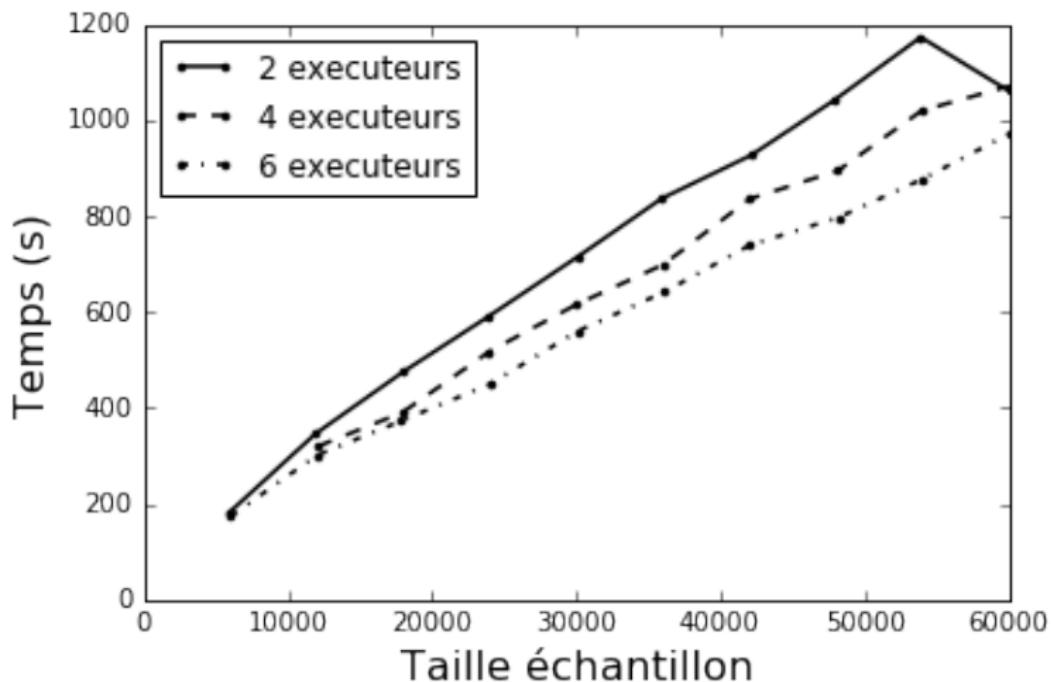
MNIST : forêts aléatoires avec R (`ranger pas randomForest`)



MNIST : forêts aléatoires avec Python (Scikit-learn)



MNIST : forêts aléatoires avec Spark (MLlib); maxdepth=15



MNIST : Forêts aléatoires (Spark) avec 2, 4 ou 6 exécuteurs

MNIST : discussion

- R ranger (sauf Windows) ou Python Scikit-learn
- Spark : problèmes de mémoire limitent maxDepth, nb arbres
- Spark : *scalability* pas vérifiée
- Plateau de l'erreur fonction de la taille de l'apprentissage
- Architecture intégrée préférable à distribuée

Recommandation par filtrage collaboratif

- Matrices clients \times produits très **creuses**
- Nombre d'achats ou de clics **vs.** appréciation ou note
- Valeur nulle **vs.** valeur manquante
- Méthodes de voisinages orientées clients **vs.** produits
- **Modèle à facteurs latents par factorisation**
- Factorisation **vs.** CompléTION (Candes et Tao, 2010)
$$\min_{\mathbf{M}} (\|\mathbf{P}_{\Omega}(\mathbf{X} - \mathbf{M})\|_2^2 + \lambda \|\mathbf{M}\|_*)$$
 où $P_{\Omega}(\mathbf{X})$: "projection" de la matrice \mathbf{X}
- Évaluation difficile d'une recommandation : **RMSE**
- Initialisation : **cold start**

CompléTION de matrice

- Netflix ou MovieLens : problème de **compléTION**
- Sujet à la bibliographie explosive
- Deux méthodes facilement accessibles (R et Spark)
 - Librairie R **softImpute** : Algorithme hybride associant SVDs seuillées et moindres carrés alternés (Hastie et al. 2015)

$$\min_{\mathbf{A}_{n \times r}, \mathbf{B}_{p \times r}} \|P_\Omega(\mathbf{X} - \mathbf{AB}^T)\|_2^2 + \lambda (\|\mathbf{A}\|_2^2 + \|\mathbf{B}\|_2^2),$$

- Librairie Spark **MLlib** : CompléTION par *Non negative Matrix Factorisation* (NMF)

Non negative Matrix Factorisation

$$\min_{\mathbf{W}, \mathbf{H} \geq 0} [c(\mathbf{X}, \mathbf{WH}) + P(\mathbf{W}, \mathbf{H})]$$

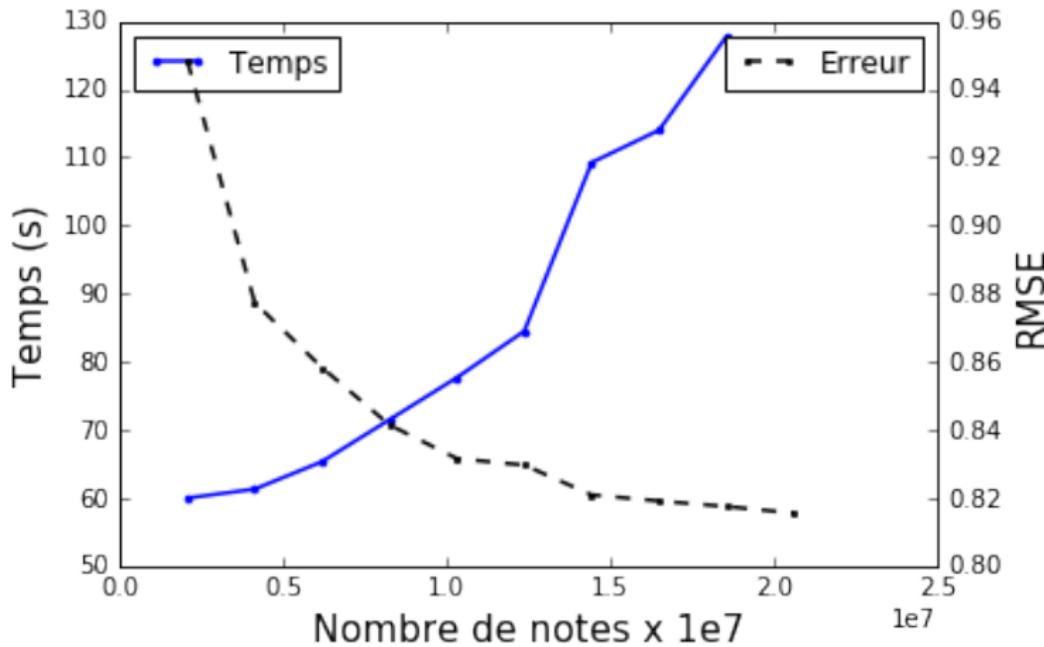
- Similaire à la SVD mais avec contrainte de rang sur \mathbf{W}, \mathbf{H}
- c : moindres carrés ou Kulback Leibler
- P : régularisation
- Nombreux algorithmes dont **ALS**
- Convergence locale
- Nombreuses initialisations disponibles
- Optimiser le **rang** de \mathbf{W} et \mathbf{H}
- Optimiser le coefficient de **régularisation**
- **MLlib** : deux options factorisation ou complémentation : $P_\Omega(\mathbf{X})$

Données MovieLens

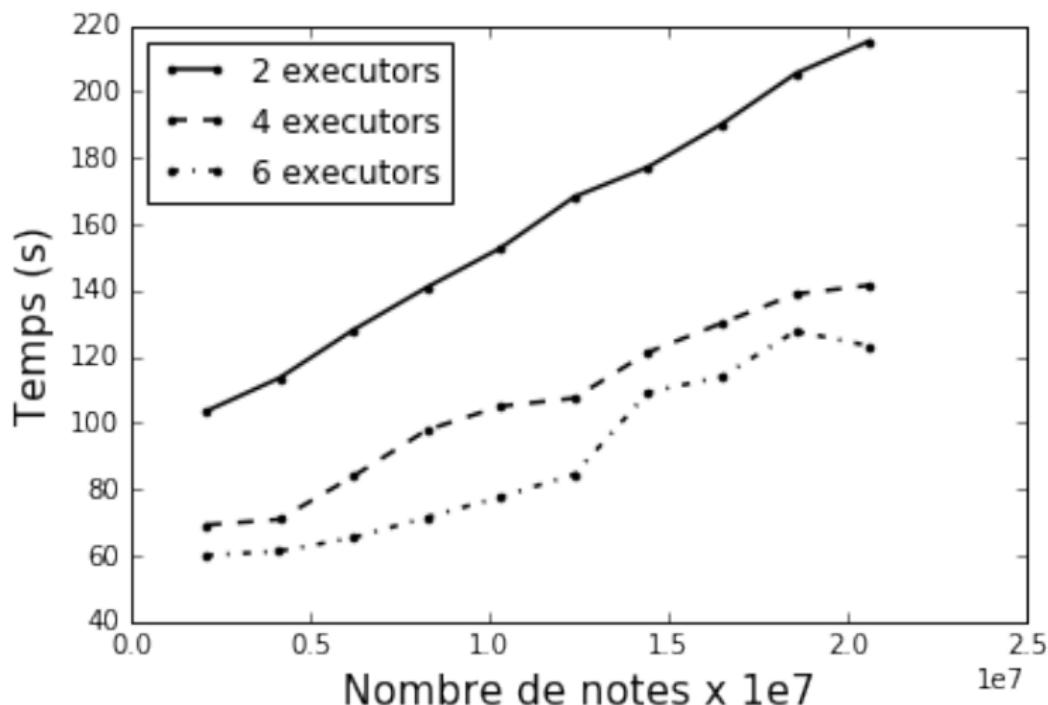
- 100k** 100 000 évaluations de 1000 utilisateurs de 1700 films.
- 1M** Un million d'évaluations par 6000 utilisateurs sur 4000 films.
- 10M** Dix millions d'évaluations par 72 000 utilisateurs sur 10 000 films.
- 20M** Vingt deux millions d'évaluations par 138 000 utilisateurs sur 27 000 films.

Rang Max	λ	Temps	RMSE
4	1	5.6	1.07
10	10	12.6	1.020
10	20	12.2	1.033
15	10	19.4	1.016
20	1	26.9	1.020
20	10	26.1	1.016
20	15	24.4	1.018
20	20	27.0	1.016
30	20	40.1	1.020

MovieLens : Optimisation du rang et de la régularisation de softImpute (ALS)



MovieLens : compléction par NMF (MLlib)



MovieLens : compléTION par NMF (MLlib)

MovieLens : discussion

- NMF mais pas de compléTION dans Scikit-learn
- Moins bon RMSE de *softImpute* : pas de contrainte ?
- MLlib : pas tout à fait *scalable*
- Architecture **distribuée** adaptée aux matrices creuses

Catégorisation de produits (Cdiscount)

- Préparation ou *data munging*
 - Nettoyages (ponctuation, erreurs de code, casse...)
 - Suppression des mots "vides" (*stopwords*)
 - Racinisation (*stemming*) : $\text{card}(\text{Dictionnaire}) = N$
- Vectorisation de (grosses ?) données
 - Hashage (*hashing trick*) : $n_hash < N$

$$i = h(j) \quad h : \{1, \dots, N\} \longmapsto \{1, \dots, n_hash\}$$

- Xgram : *h* appliquée à un mot ou couple (bigram) ou...
- TF-IDF
- Apprentissage

TF-IDF

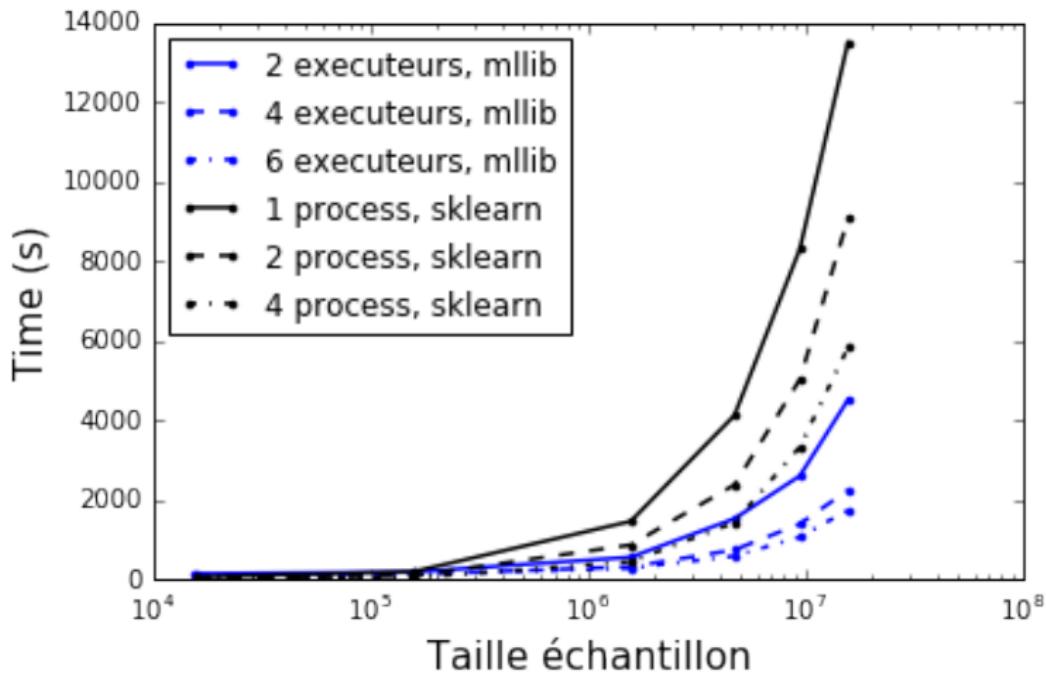
- Importance relative de chaque mot (ou xgram) dans un document par rapport à l'ensemble des documents.
- D : nombre de documents
- $TF(m, d)$: nombre d'occurrences du mot m dans le document d
- $f(m)$: nombre de documents contenant le mot m
- $IDF(m) = \log \frac{D+1}{f(m)+1}$ (version smooth)
- TF-IDF : nouvelles variables ou *features* par pondération des effectifs conjoints :

$$V_m(d) = TF(m, d) \times IDF(m)$$

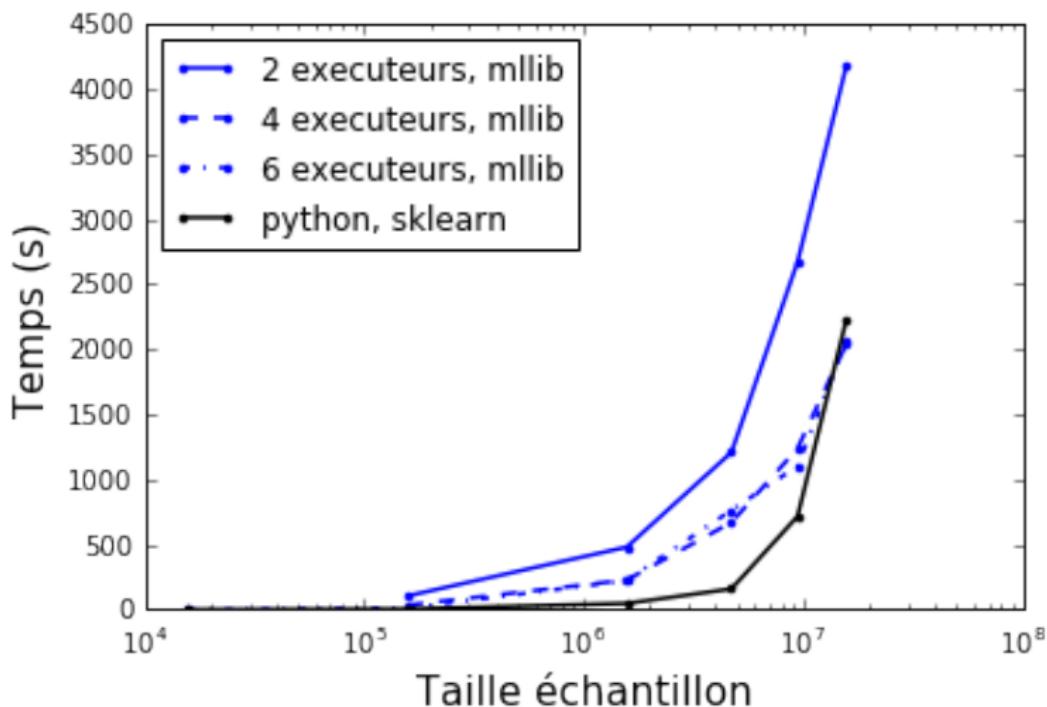
- Même vectorisation (hashage, TF-IDF) sur le test

Cdiscount

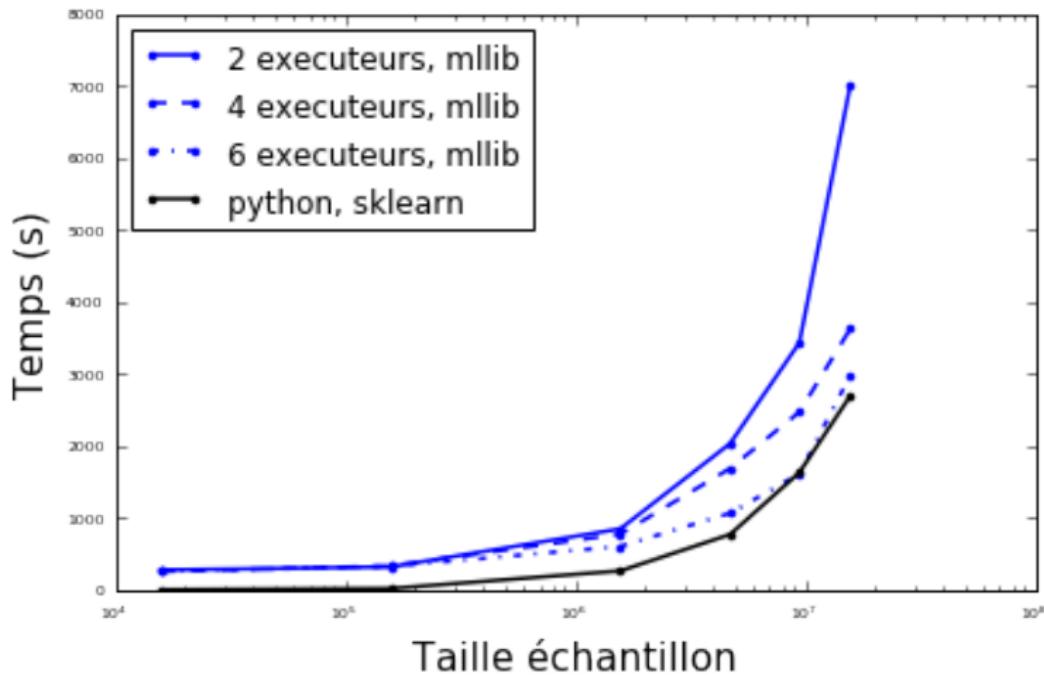
- Données publiques du concours [datascience.net](#)
- **15M** de produits (3.5 Go), 3 niveaux : 5789 classes
- Classes **déséquilibrées**
- **Solution gagnante** (Goutorbe et al. 2016)
- **Pyramide** (Python) de régressions logistiques
- Simplifier : prévoir le **1er niveau** : 47 classes
- Comparaison de Python Scikit-learn **vs.** SparkML
- **Trois phases** : Nettoyage, Vectorisation, Apprentissage



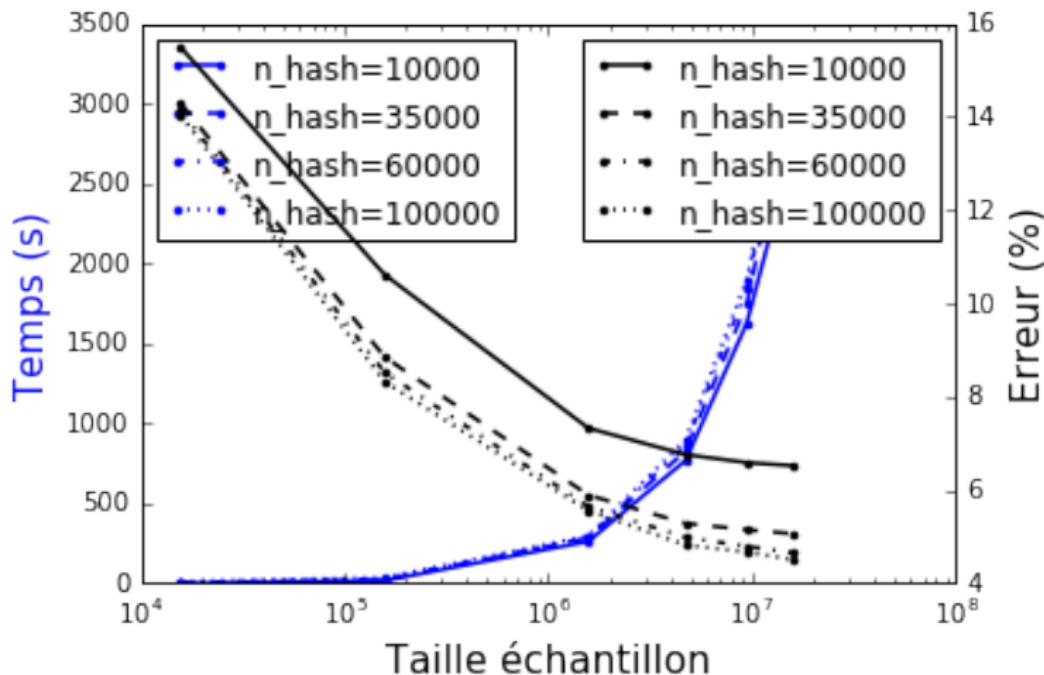
Cdiscount : nettoyage des données



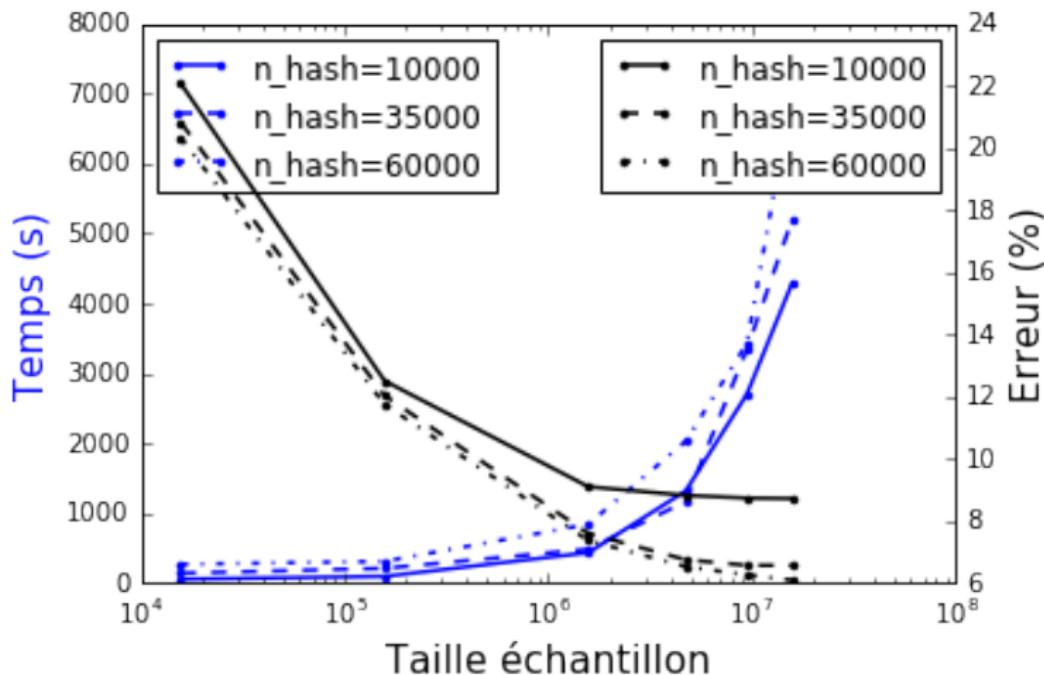
Cdiscount : vectorisation avec `n_hash = 60 000`



Cdiscount : apprentissage avec Spark, Python (Scikit-learn) et n_hash = 60 000



Cdiscount : Apprentissage avec Python Scikit-learn



Cdiscount : Apprentissage avec Spark MLlib

Conclusion

- Comparaison entre architectures distribuée *vs.* intégrée
- Problème de maturation des technologies
- Trois étapes :
 - *Data munging, streaming* : Spark, SparkSQL
 - *Vectorisation* : Python, Scikit-learn, Lucene...
 - *Apprentissage* : grosses data et gros modèles
- R *vs.* Python Scikit-learn *vs.* SparkSQL, SparkML
- Nettoyage et Apprentissage *en ligne* ?
- Cdiscount, Critéo, Deepky, Tinyclues, Hupi (ppml)...
- Ne pas oublier : fiabilité, représentativité des données