1.定义

1.1 项目概述

项目是针对rosman的历年销售额，进行分析建模以便可以预测未来的销售额。

Rossmann是欧洲的一家连锁药店。 在这个源自Kaggle比赛[Rossmann Store Sales](https://www.kaggle.com/c/rossmann-store-sales)中，我们需要根据Rossmann药妆店的信息（比如促销，竞争对手，节假日）以及在过去的销售情况，来预测Rossmann未来的销售额。

解决该问题涉及回归算法领域，数据集使用的rosman提供的销售数据以及门店信息数据。

1.2 问题陈述

项目选择的数据是来此rosman提供的真实数据，项目的挑战在于需要从众多的特征数据中整理分析出影响预测未开销售数据的重要特征。

问题分为两个部分，第一个部分是数据挖掘分析，第二个部分是模型的学习调参。

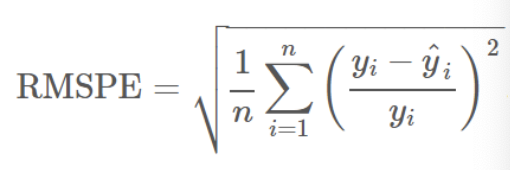
整个问题是一个回归问题，输入的数据由特征数据构成，目标是特征数据的预测销售额。

需要对项目的输入数据进行特征处理，获取相关的数据来训练回归模型。通过最后的模型训练，可以有效的对未来的数据进行预测。

1.3 评价指标

对于回归问题，评价指标是RMSPE，均方根百分比误差（Root Mean Square Percentage Error ）。

RMSPE 更贴近误差的概念。而相比于 MSE 和 RMSE， RMSPE 计算的是一个误差率，这样就避免了真实值之间大小的不同而对误差产生的影响。

。

2.分析

数据可视化

Rosman数据集分为训练数据集，店铺信息数据集，测试数据集。训练数据集中包括了销售相关的外部环境因素特征。比如销售当天的客户数，是否是国定节假日，是否是学校oen日等。

店铺相关数据是代表了销售所在的店铺的相关信息，比如商店销售物品的等级划分，促销的实行情况以及竞争对手距离商店位置的相关信息。

通过这些数据可以有效的进行预测学习。

该训练数据集包括两类，历史销售数据以及每个商店的个体信息，我们可以通过结合这两个数据集来训练预测。

对两类数据合并后有如下的训练特征：

['Store', 'DayOfWeek', 'Date', 'Sales', 'Customers', 'Open', 'Promo',

'StateHoliday', 'SchoolHoliday', 'StoreType', 'Assortment',

'CompetitionDistance', 'CompetitionOpenSinceMonth',

'CompetitionOpenSinceYear', 'Promo2', 'Promo2SinceWeek',

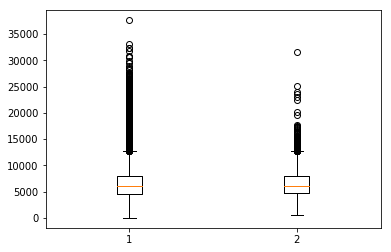
'Promo2SinceYear', 'PromoInterval']

分析异常值：

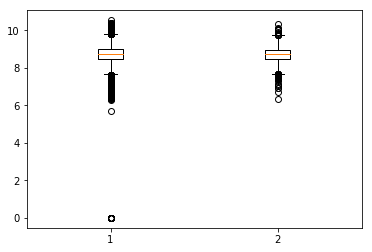
通过对customer，CompetitionDistance存在异常值



我们可以对异常值进行删除，但是考虑到我们这次用的算法是xgboost，所以不需要对异常值做太多的处理

目标数据是Sales特征，对这个特征的盒线图显示，数据存在比较大的异常偏差。

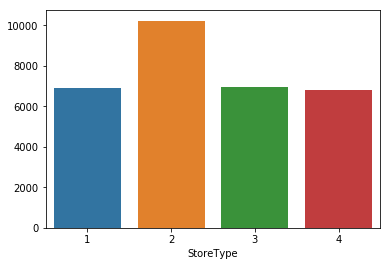
所以对标签数据进行平滑处理，使其服从正态分布。使用log平滑处理。



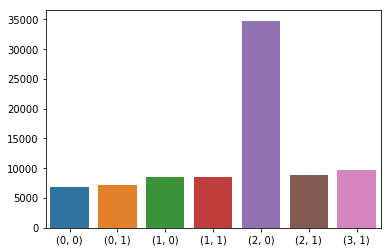
Sales也是这次项目的预测标签，查看下从13年到15年的sales数据趋势



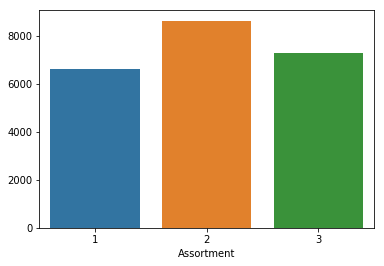
StoreType对于销售额的影响很大，从柱形图就可以看出不同type的平均销售额是有差别的



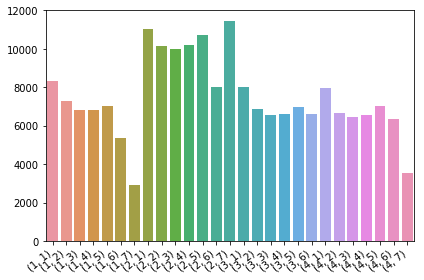
发现在不同的节假日的情况下，学校的开关也对销售额有很大的影响



从直觉上来说Assortment也会影响销售额



DayOfWeek对于销售额也影响



通过绘制图获取的feature特征包括

['DayOfWeek', 'Sales', 'Promo', 'StateHoliday', 'SchoolHoliday',

'StoreType', 'Assortment', 'CompetitionDistance',

'CompetitionOpenSinceMonth', 'CompetitionOpenSinceYear', 'Promo2',

'Promo2SinceWeek', ‘Promo2SinceYear']

在数据集中有很多标签数据，统一进行label encode

mappings = {'0':0, 'a':1, 'b':2, 'c':3, 'd':4}

data.StoreType.replace(mappings, inplace=True)

data.Assortment.replace(mappings, inplace=True)

data.StateHoliday.replace(mappings, inplace=True)

使其适合模型的训练运算

算法和技术

算法：

回归算法

根据前面的分析可知，销售额预测本质上是一个回归问题。对于回归的算法有很多，比如线性回归，多项式回归，支持向量机， CART回归树等。这些算法都是机器学习的算法。 通过将所需要训练的数据特征转化为特征向量，输出的是预测的最终销售数据。

线性回归顾名思义是求得线性预测的算发，然而对于有这么多特征的数据来说线性划分并不可靠，容易欠拟合。

多项式回归能够对于多特征进行有效的拟合预测，可以有效的对特征数据进行分割，模拟。

CART是一种二分递归分割的技术，分割方法采用基于最小距离的基尼指数估计函数，将当前的样本集分为两个子样本集，使得生成的的每个非叶子节点都有两个分支。因此，CART算法生成的决策树是结构简洁的二叉树。回归树是针对目标变量是连续性的变量，通过选取最优分割特征的某个值，然后数据根据大于或者小于这个值进行划分进行树分裂最终生成回归树。

增强算法

处理具体问题时，单一的回归树肯定是不够用的。可以利用集成学习中的boosting框架，对回归树进行改良升级，得到的新模型就是提升树（Boosting Decision Tree），在进一步，可以得到梯度提升树（Gradient Boosting Decision Tree，GBDT），再进一步可以升级到XGBoost。

提升方法（Boosting），是一种可以用来减小[监督式学习](https://zh.wikipedia.org/wiki/%E7%9B%A3%E7%9D%A3%E5%BC%8F%E5%AD%B8%E7%BF%92)中[偏差](https://zh.wikipedia.org/wiki/%E5%81%8F%E5%B7%AE)的[机器学习](https://zh.wikipedia.org/wiki/%E6%9C%BA%E5%99%A8%E5%AD%A6%E4%B9%A0)算法。面对的问题是迈可·肯斯（Michael Kearns）提出的：一组“弱学习者”的集合能否生成一个“强学习者”？弱学习者一般是指一个分类器，它的结果只比随机分类好一点点；强学习者指分类器的结果非常接近真值。

大多数提升算法包括由迭代使用弱学习分类器组成，并将其结果加入一个最终的成强学习分类器。加入的过程中，通常根据它们的分类准确率给予不同的权重。加和弱学习者之后，数据通常会被重新加权，来强化对之前分类错误数据点的分类。

一个经典的提升算法例子是[AdaBoost](https://zh.wikipedia.org/wiki/AdaBoost)。一些最近的例子包括[LPBoost](https://zh.wikipedia.org/w/index.php?title=LPBoost&action=edit&redlink=1)、[TotalBoost](https://zh.wikipedia.org/w/index.php?title=TotalBoost&action=edit&redlink=1" \o "TotalBoost（页面不存在）)、[BrownBoost](https://zh.wikipedia.org/w/index.php?title=BrownBoost&action=edit&redlink=1" \o "BrownBoost（页面不存在）)、[MadaBoost](https://zh.wikipedia.org/w/index.php?title=MadaBoost&action=edit&redlink=1" \o "MadaBoost（页面不存在）)及[LogitBoost](https://zh.wikipedia.org/w/index.php?title=LogitBoost&action=edit&redlink=1" \o "LogitBoost（页面不存在）)。许多提升方法可以在[AnyBoost](https://zh.wikipedia.org/w/index.php?title=AnyBoost&action=edit&redlink=1)框架下解释为在[函数空间](https://zh.wikipedia.org/wiki/%E5%87%BD%E6%95%B0%E7%A9%BA%E9%97%B4)利用一个凸的误差函数作[梯度下降](https://zh.wikipedia.org/wiki/%E6%A2%AF%E5%BA%A6%E4%B8%8B%E9%99%8D)。

技术：

在这个项目中主要运用的是xgboost算法。xgboost一直在竞赛江湖里被传为神器，比如时不时某个kaggle/天池比赛中，某人用xgboost于千军万马中斩获冠军。

因为这个问题是回归问题，xgboost内部使用的CART tree，这种结构可以处理分类回归问题。而且xgboost的特点是它能够自动利用CPU的多线程进行并行，同时在算法上加以改进提高了精度。也是一种集成方法。集成方法的有点就是采用很多弱学习器最后合并成强学习器，效果会比较好。

Xgboost在学习的过程中， 或不断的通过上一次学习的模型的残差进一步学习，最终将损失缩小。

基准指标：

对于项目，rosman规定使用RMSPE进行指标评估，根据Kaggle竞赛的分数排名，RMSPE的得分在0.11左右是比较好的成绩。

具体方法

数据预处理

考虑到数据集中存在很多的label标签，不利于算法的运行，所以需要对其进行labelEncoding。

mappings = {'0':0, 'a':1, 'b':2, 'c':3, 'd':4}

data.StoreType.replace(mappings, inplace=True)

data.Assortment.replace(mappings, inplace=True)

data.StateHoliday.replace(mappings, inplace=True)

目标数据存在很大的离群值，所以需要进行平滑处理。让目标数据的分布比较平衡。能够更好的学习模型。

训练集经过随机的打乱，一部分用于交叉验证，即在训练中衡量模型的预测性能。

对于该项目，将所销售训练集和store的信息数据集合并在一起，1.2%作为验证数据，剩余的作为训练数据。最终训练集（834259样本），验证集（10133样本）。

执行过程

对于时间序列数据，如果考虑到时间因素，应该会对模型带来提升，所以讲时间数据加入特征集

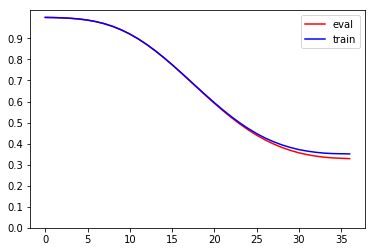
# data['Year'] = data.Date.dt.year

# data['Month'] = data.Date.dt.month

# data['Day'] = data.Date.dt.day

初始版本对所有的特征进行向量化之后，传入xgboost。随机设置分类数的深度学习率等参数，

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 初始版本 | 训练集 | 验证集 |  |
| "eta": 0.1,  "max\_depth": 5,  "min\_child\_weight":1,  "gamma":0,  "subsample": 0.7,  "colsample\_bytree": 0.7, | 0.351623 | 0.352851 |  |



[85] eval-rmse:0.301548 train-rmse:0.300529 eval-rmspe:0.324166 train-rmspe:0.358648

[86] eval-rmse:0.301375 train-rmse:0.300338 eval-rmspe:0.323935 train-rmspe:0.358438

Stopping. Best iteration:

[36] eval-rmse:0.374072 train-rmse:0.373598 eval-rmspe:0.328553 train-rmspe:0.35109

Train use time: 130.53800010681152

数据训练到86次迭代的时候停止了，并且通过cv返回的数据得知目前只需要36棵决策树的数目

完善

模型没有进行过任何改进，结果明显不够好，训练的拟合度不够。

进行参数调优，首先对max\_depth 和 min\_weight 参数调优，因为它们对最终结果有很大的影响。首先，我们先大范围地粗调参数，然后再小范围地微调。使用栅格搜索(grid search)对参数进行调优。

在训练过程中，结果都不是特别好都在0.17-0.18左右，这是后尝试加入时间信息，结果提升很多，从最后的feature important上也能看到，时间序列确实很重要。



模型的评价与验证

使用CV验证，调试参数，获取最终的模型，结果在0.11605.

选取最终的模型根据train 和valid数据的RMSPE的值结果选择。偏差和方差都比较合理。



总体来说，现在这个模型表现还是比基准模型好很多。

结论

Rosman项目通过分析数据，可视化，对数据进一步获取了解，然后运用回归处理技术。有很多回归技术可以用，但是xgboost是目前最为流行的，速度快强大，容易使用上手。

目前这个模型的得分在kaggle上排名：1809.

效果不是特别理想，应该还有更有效的时间特征可以提取。

引用：

<https://zhuanlan.zhihu.com/p/54334329>

https://www.kaggle.com/c/rossmann-store-sales/discussion/18024