INTELIGENCIA DE NEGOCIO

Inteligencia de Negocio

2018 - 2019

- Tema 1. Introducción a la Inteligencia de Negocio
- Tema 2. Minería de Datos. Ciencia de Datos
- Tema 3. Modelos de Predicción: Clasificación, regresión y series temporales
- Tema 4. Preparación de Datos
- Tema 5. Modelos de Agrupamiento o Segmentación
- Tema 6. Modelos de Asociación
- Tema 7. Modelos Avanzados de Minería de Datos.
- Tema 8. Big Data

Modelos de asociación

Objetivos:

- Analizar el descubrimiento de asociaciones y las reglas de asociación
- Describir el algoritmo Apriori y explicar sus fases
- Definir medidas alternativas para el proceso de descubrimiento de asociaciones
- Introducir la extensión al descubrimiento de subgrupos.

Inteligencia de Negocio

TEMA 6. Modelos de Asociación

- 1. Descubrimiento de asociaciones
- 2. Reglas de asociación
- 3. Algoritmo Apriori
- 4. Medidas de interés
- Descubrimiento de Subgrupos: Caracterización de clases mediante asociaciones

1. Descubrimiento de asociaciones

- Búsqueda de patrones frecuentes, asociaciones, correlaciones, o estructuras causales entre conjuntos de artículos u objetos (datos) a partir de bases de datos transaccionales, relacionales y otros conjuntos de datos
- Búsqueda de <u>secuencias</u> o patrones temporales
- Aplicaciones:
 - análisis de cestas de la compra (Market Basket analysis)
 - diseño de catálogos,...
 - ¿Qué hay en la cesta? Libros de Jazz
 - ¿Qué <u>podría</u> haber en la cesta? El último CD de Jazz
 - ¿Cómo <u>motivar al cliente</u> a comprar los artículos que es probable que le gusten?

1. Descubrimiento de asociaciones: Market Basket Analysis

• ¿Qué es el análisis de cestas de la compra?

Análisis de clientes:

 Se utiliza información sobre lo que ha comprado un cliente para ofrecernos una aproximación sobre quién es y por qué hace ciertas compras

Análisis de productos:

 Aporta información sobre qué productos tienden a ser comprados juntos

1. Descubrimiento de asociaciones: Market Basket Analysis

<u>Compra</u>: zumo de naranja, plátanos, detergente para vajillas, limpia cristales, gaseosa, ...

¿Es típico comprar gaseosa y plátanos? ¿Es importante la marca de la gaseosa?

¿Cómo afecta la demografía de la vecindad a la compra de los clientes?

¿Dónde deberían colocarse los detergentes para maximizar sus ventas? ¿Aumenta la compra del limpia cristales cuando se compran a la vez detergente para vajillas y zumo de naranja?

1. Descubrimiento de asociaciones: Market Basket Analysis

Ejemplo: Asociación de Pañales y Cervezas

- Los clientes que compran cerveza también compran patatas
 - ¡Para eso no es necesario el uso de técnicas de Minería de Datos!
- Los viernes por la tarde, con frecuencia, quienes compran pañales, compran también cerveza.
- ✓ ¿Qué significa?
- ✓ ¿A qué se debe?
- ✓ Acciones a realizar



Inteligencia de Negocio

TEMA 6. Modelos de Asociación

- 1. Descubrimiento de asociaciones
- 2. Reglas de asociación
- 3. Algoritmo Apriori
- 4. Medidas de interés
- 5. Descubrimiento de Subgrupos: Caracterización de clases mediante asociaciones

2. Reglas de Asociación

- Se ha desarrollado una gran cantidad de investigación en torno al área de análisis de cestas de la compra, debido a la claridad y utilidad de sus resultados, que se expresan en forma de reglas de asociación
- Objetivo de los algoritmos de extracción de reglas de asociación:
 - Dada una base de datos de transacciones, donde cada transacción es una lista de artículos (comprados por un cliente en la misma visita)
 - Encontrar todas las reglas que co-relacionen la presencia de un conjunto de artículos con otro conjunto de artículos.
 - Ejemplo: 98% de la gente que compra neumáticos y accesorios para el automóvil, también adquiere servicios (cambio de neumáticos, ...)
- La idea es obtener reglas del tipo:
 - "Antecedente => Consecuente [soporte, confianza]"
 - compra(x, "pañales") => compra(x, "cerveza") [0.5%, 60%]

2. Reglas de Asociación: Conceptos básicos

Transacción:

```
Formato relacional Formato compacto <Tid, item> <Tid, itemset> <1, item1> <1, {item1,item2}> <1, item3> <2, {item3}>
```

- Item (o artículo): elemento individual
- Itemset (o conjunto): conjunto de items/artículos
- Soporte de un conjunto I: nº de transacciones conteniendo I
- Soporte mínimo m_s: umbral de soporte
- Conjunto frecuente: con soporte ≥ m_s

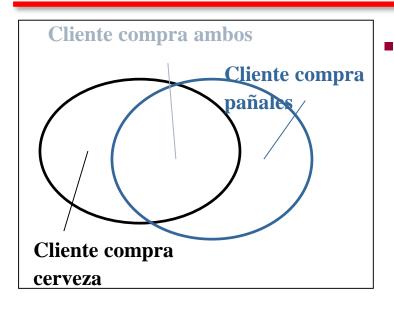
Los conjuntos frecuentes representan conjuntos de artículos que están correlacionados positivamente

Reglas de Asociación: Distintos tipos de reglas de asociación

- Asociaciones <u>Booleanas vs Cuantitativas</u> dependiendo del tipo de los valores que se manejan
 - compra (x, "SQLServer") ^ compra (x, "Libro de MD") → compra (x, "DBMiner") [0.2%, 60%]
 - Edad (x, '30..39') ^ ingresos $(x, '42K..48K') \rightarrow compra <math>(x, 'PC')$ [1%,75%]
- Asociaciones unidimensionales vs multidimensionales

- Análisis con distintos niveles de abstracción:
 - Edad $(x,'30..39') \rightarrow compra (x, cerveza)$
 - Edad $(x,'30...39') \rightarrow compra (x, cerveza alemana)$
- Posibles Extensiones:
 - Correlaciones, análisis de causalidad
 - Asociación no implica necesariamente correlación o causalidad

Reglas de Asociación: Medidas de soporte y confianza



- Encontrar todas las reglas $X \& Y \Rightarrow Z$ con un mínimo de confianza y soporte
 - <u>Soporte</u> (s): probabilidad de que una transacción contenga {X & Y & Z}
 - <u>Confianza</u> (c): probabilidad condicional P(Z|X&Y)

transacción ID	artículos
1	A,B,C
2	A,C
3	A,D
4	B,E,F

Sea el valor mínimo para confianza y soporte 50%:

 $A \Rightarrow C (50\%, 66.6\%)$

 $C \Rightarrow A (50\%, 100\%)$

2. Reglas de Asociación: Proceso de extracción

- Al tratar con bases de datos grandes, el proceso se descompone en dos pasos:
 - Encontrar conjuntos de artículos frecuentes
 - Mayor ocurrencia que el soporte mínimo fijado
 - Generar reglas de asociación "fuerte" a partir de los conjuntos de artículos frecuentes
 - Deben satisfacer el mínimo fijado tanto para soporte como para confianza

2. Reglas de Asociación: Proceso de extracción. Ejemplo

transacción ID	artículos
1	A,B,C
2	A,B,C A,C A,D
3	A,D
4	B,E,F

Min. soporte: 50%

Min. confianza: 50%

	frequent itemset	soporte
	{A}	75%
>	{B}	50%
	{C}	50%
	{A,C}	50%

Para la regla $A \Rightarrow C$:

soporte = soporte(
$$\{ A \& C \}$$
) = 50%
confianza = soporte($\{ A \& C \}$)/soporte($\{ A \}$) = 66.6%

Reglas de Asociación: Proceso de extracción. Ejemplo

Transaction	Items			
t_1	Bread, Jelly, Peanut Butter			
t_2	Bread,PeanutButter			
t_3	Bread,Milk,PeanutButter			
t_4	Beer,Bread			
t_5	Beer,Milk			

I = {Beer, Bread, Jelly, Milk, PeanutButter}Soporte de {Bread, PeanutButter} es 60%

2. Reglas de Asociación: Proceso de extracción. Ejemplo

$X \Rightarrow Y$	s	α
$Bread \Rightarrow PeanutButter$	60%	75%
$PeanutButter \Rightarrow Bread$	60%	100%
$\mathbf{Beer}\Rightarrow\mathbf{Bread}$	20%	50%
$\mathbf{PeanutButter} \Rightarrow \mathbf{Jelly}$	20%	33.3%
$Jelly \Rightarrow PeanutButter$	20%	100%
$ m Jelly \Rightarrow Milk$	0%	0%

Inteligencia de Negocio

TEMA 6. Modelos de Asociación

- 1. Descubrimiento de asociaciones
- 2. Reglas de asociación
- 3. Algoritmo Apriori
- 4. Medidas de interés
- Descubrimiento de Subgrupos: Caracterización de clases mediante asociaciones

- Encuentra las asociaciones más frecuentes
- Itera sobre la base de datos hasta que las asociaciones obtenidas no tienen el soporte mínimo
- Método simple pero robusto
- Salida intuitiva
- Requisitos:
 - No necesita fijar los atributos de los lados derecho (consecuente) e izquierdo (antecedente) de las reglas pues se generan de manera automática
 - Existen variedades para tratar todo tipo de datos
 - Especificar mínimo soporte
 - Especificar máximo número de reglas

- El algoritmo busca iterativamente conjuntos frecuentes con cardinalidad 1 hasta k (k-conjunto), y después
- Usa los conjuntos frecuentes para generar las reglas de asociación
- En el paso clave del descubrimiento de conjuntos frecuentes, se basa en el principio "a priori":
 - Cualquier subconjunto de un conjunto de artículos frecuente debe ser frecuente

Ejemplo: si $\{AB\}$ es un conjunto frecuente, entonces tanto $\{A\}$ como $\{B\}$ deberían ser frecuentes

 Esto permite definir el principio de poda en Apriori: Si existe algún conjunto "infrecuente", entonces no hay necesidad de generar sus superconjuntos

- Unión: C_k es generado uniendo conjuntos de L_{k-1} (se asume orden lexicográfico en las transacciones y que los prefijos son comunes)
- Poda: cualquier (k-1)-conjunto que no es frecuente, no puede ser un subconjunto de un k-conjunto frecuente

Pseudo-código:

```
C_k: conjunto candidato de cardinalidad k

L_k: conjunto frecuente de cardinalidad k

L_1 = {artículos frecuentes};

for (k = 1; L_k != \varnothing; k++) do begin

C_{k+1} = candidatos generados desde L_k;

for each transacción t en la base de datos do

incrementar el contador de todos los candidatos en C_{k+1}

que están contenidos en t

L_{k+1} = candidatos en C_{k+1} con min_support

end

return \bigcup_k L_k;
```

Generación de candidatos

- Suponemos que los ítems de L_k están ordenados
- Paso 1: Unión sobre L_k

```
Insertar todo c en C_{k+1} tal que: c = \{p.item1, p.item2, ..., p.itemk, q.itemk\} donde p \in L_k y q \in L_k son tales que p.item1=q.item1, ..., p.itemk-1=q.itemk-1 \ y p.itemk < q.itemk
```

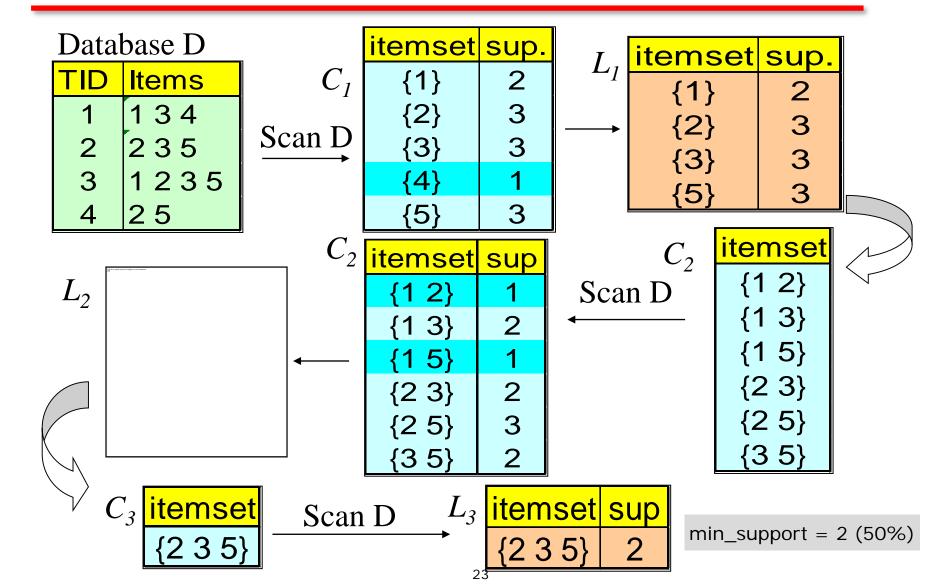
Paso 2: Poda

Para todos los itemsets c de C_{k+1} hacer Para todos los k-subconjuntos s de c hacer $\text{Si } (\text{s} \not\in L_k) \text{ entonces eliminar c de } C_{k+1}$

Ejemplo de generación de candidatos

- $L_3 = \{abc, abd, acd, ace, bcd\}$
- Unión en L_3 : L_3*L_3
 - abcd de ab-c y ab-d
 - acde de ac-d y ac-e
- Poda:
 - acde es eliminado porque ade y cde no están en L₃
 - abcd se conserva porque existen abc, acd y bcd
- $C_4 = \{ abcd \}$

3. El algoritmo APRIORI. Ejemplo



Generación de reglas a partir de conjuntos frecuentes

 Una vez disponemos de los conjuntos frecuentes, basta calcular la confianza y añadir las reglas que cumplan con los umbrales mínimos

Base de datos

TID	Items			
1	1 3 4			
2	235			
3	1235			
4	2 5			

Conjunto frecuente

itemset	sup
{2 3 5}	2

Si los valores mínimos de confianza son 60%:

Parámetros soporte y confianza

Soporte mínimo (s):

```
alto ⇒ pocos conjuntos frecuentes
```

⇒ pocas reglas válidas que ocurren con frecuencia

bajo ⇒ muchas reglas válidas que ocurren raramente

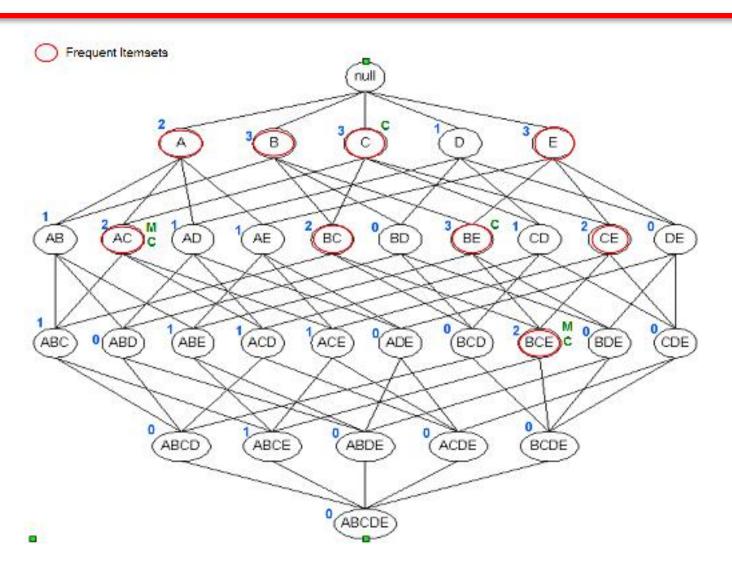
Confianza mínima (c):

alta ⇒ pocas reglas, pero todas "casi ciertas lógicamente"

baja ⇒ muchas reglas, pero muchas de ellas muy inciertas

■ Valores típicos: soporte = 2-10%, confianza = 70-90%

Espacio de búsqueda de reglas



Inteligencia de Negocio

TEMA 6. Modelos de Asociación

- 1. Descubrimiento de asociaciones
- 2. Reglas de asociación
- 3. Algoritmo Apriori
- 4. Medidas de interés
- Descubrimiento de Subgrupos: Caracterización de clases mediante asociaciones

- Medidas objetivas (dos de las más populares):
 - soporte y
 - confianza
- Medidas subjetivas:

Una regla (patrón) es interesante si es

- inesperada (sorprendente para el usuario) y/o
- útil (el usuario puede hacer algo con ella)

Críticas a Confianza

	basketball	not basketball	sum(row)
cereal	2000	1750	3750
not cereal	1000	250	1250
sum(col.)	3000	2000	5000

Ejemplo 1:

- Entre 5000 estudiantes
 - 3000 juegan al baloncesto (60%)
 - 3750 comen cereales (75%), 1250 no comen cereales (25%)
 - 2000 juegan al baloncesto y comen cereales (40%)
- juega baloncesto ⇒ come cereales [40%, 66.7%] no aporta nada porque el % global de alumnos que comen cereales es 75%, que es mayor que 66.7%
- juega baloncesto ⇒ no come cereales [20%, 33.3%] sí aporta interés porque la confianza de la regla es 1.3333 (lift) veces mayor que solo la del consecuente

Críticas a Confianza

X	~	~	1	~	0	0	0	0
Y	~	~	0	0	0	0	0	0
Z	0	1	1	1	1	1	1	1

Regla	Soporte	Confianza
X=>Y	25%	50%
X=>Z	37.50%	75%

- Ejemplo 2:
 - X & Y: más correlacionadas
 - X & Z: menos correlacionadas
 - Sin embargo, confianza de X ⇒ Z domina
- El problema está en que la confianza se calcula sólo sobre el subconjunto de datos implicados en la regla, no se tiene en cuenta el total de datos. Se necesita una medida de dependencia o sucesos correlacionados
- P(B|A)/P(B) se conoce como el **empuje** (*lift*) de la regla $A \Rightarrow B$

- Interés (correlación, empuje)
 - $\operatorname{lift}(A \rightarrow B) = P(B|A)/P(B) = P(A y B)/(P(A) \cdot P(B))$
 - Toma P(A) y P(B) en consideración
 - $P(A y B) = P(A) \cdot P(B)$ si A y B son independientes (*lift* = 1)
 - A y B negativamente correlacionadas si lift es menor que 1;
 A y B positivamente correlacionadas si lift es mayor que 1

X	1	1	1	1	0	0	0	0
Y	Υ-	Υ-	0	0	0	0	0	0
Z	0	1	1	1	1	1	1	1

Regla	Soporte	Lift
X→Y	25%	2
X→Z	37.50%	0.9
Y→Z	12.50%	0.57

Otros algoritmos

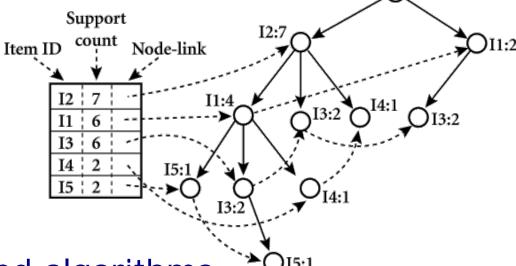
- FP-Growth (modelo basado en FP-tree): descubre

frequent itemset sin generar los itemset candidatos

Paso 1: Construir una estructura compacta llamada FP-tree mediante dos pasadas al *dataset*

Paso 2: Extraer los frequent itemsets directamente

del FP-tree



null{}

- OPUS search based algorithms
- Negative association rules
- Quantitative association rules (QAR)

Inteligencia de Negocio

TEMA 6. Modelos de Asociación

- 1. Descubrimiento de asociaciones
- 2. Reglas de asociación
- 3. Algoritmo A priori
- 4. Medidas de interés
- 5. Descubrimiento de Subgrupos: Caracterización de clases mediante asociaciones

5. Descubrimiento de subgrupos

Supervised vs. unsupervised learning: A rule learning perspective

- Supervised learning: Rules are induced from labeled instances (training examples with class assignment) usually used in predictive induction
- Unsupervised learning: Rules are induced from unlabeled instances (training examples with no class assignment) - usually used in descriptive induction

Exception: Subgroup discovery

Discovers individual rules describing interesting regularities in the data induced from labeled examples

5. Descubrimiento de subgrupos

Subgroup discovery is a process to identify relations between a dependent variable (target variable) and usually many explaining, independent variables.

For example, consider the subgroup described by "smoker=true AND family history=positive" for the target variable coronary heart disease=true.

Subgroup discovery does not necessarily focus on finding complete relations; instead partial relations, i.e., (small) subgroups with "interesting" characteristics can be sufficient.

5. Descubrimiento de subgrupos

W. Klösgen , 1996:

"Given a population of individuals and a property of those individuals we are interested in, find population subgroups that are statistically 'most interesting', e.g., are as large as possible and have the most unusual statistical charasteristics with respect to the property of interest".

W. Klösgen, Explora: A multipattern and multistrategy discovery assistant, Advance in Knowledge Discovery and Data Mining, MIT Press, 249-271, 1996.

Find subgroups of members of a population that exhibit interesting deviations from overall population behavior

Interestingness criteria:

- As large as possible
- Class distribution as different as possible from the distribution in the entire data set
- Significant
- Surprising to the user
- Non-redundant
- Simple
- Useful actionable

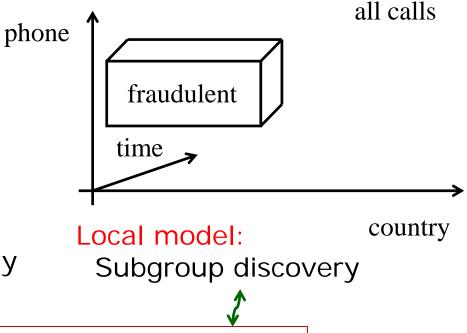
 Assume 100 % of all calls made to Australia from a mobile phone at night are fraudulent (total of 0.01% of all calls)

but fraudulence does not otherwise depend on country, phone or time

not fraudulent

Global model: decision tree Constructed with C4.5

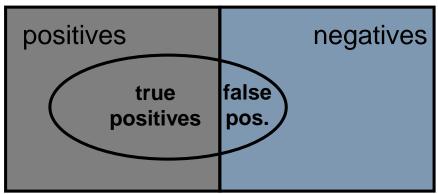
(Simply always answers majority class!)



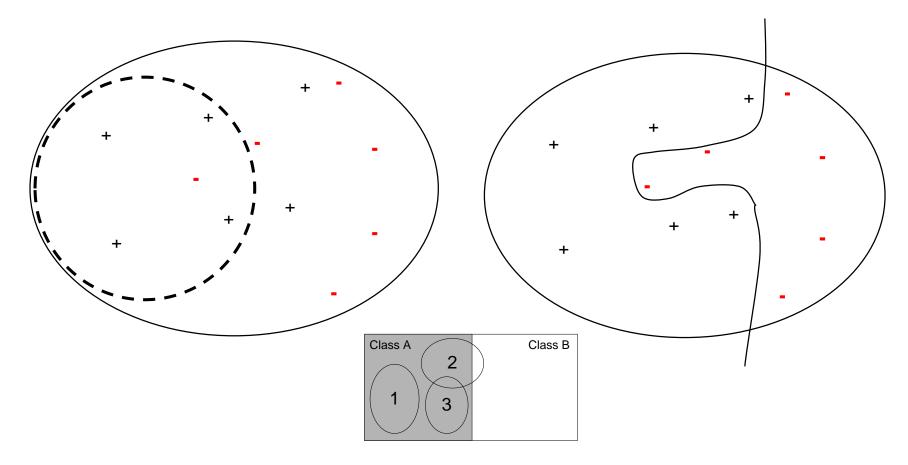
How to find *comprehensible* subgroups in large amounts of data for fraudulent class?

Subgroups vs. classifiers

- Classification rules aim at pure subgroups
 - A set of rules forms a domain model high prediction algorithm
- Each rule is an independent chunk of knowledge
 - Subgroups aim at significantly higher (or different) proportion of positives



Subgroups vs. classifiers



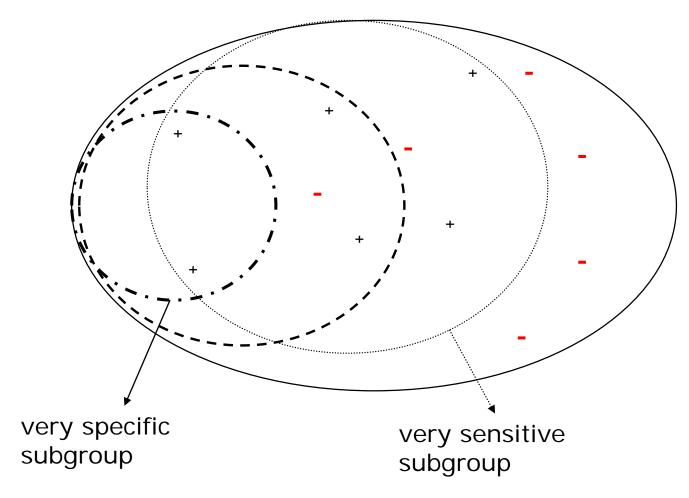
Subgroups vs. classifiers

Classification

- predictive induction
- constructing sets of classification rules
- aimed at learning a model for classification or prediction
- rules are dependent

Subgroup Discovery

- descriptive induction
- constructing individual subgroup-describing rules
- aimed at finding interesting patterns in target class examples



generality – the main parameter of the subgroup induction process

Probabilistic distribution and model extraction

Each *rule returns a probability* distribution, instead of class distribution in terms of the number of examples covered.

Weighted Relative Accuracy: Weighted WRAcc Search Heuristic, with added example weights

Balance between coverage of the rule and accuracy gain

Probabilistic distribution and model extraction Weighted Relative Accuracy

WRAcc(Class←Condition)
= p(Condition)[p(Class | Condition) – p(Class)]

$$WRAcc(Cond \rightarrow Class) = \frac{n'(Cond)}{N'} \cdot \left(\frac{n'(Cond, Class)}{n'(Cond)} - \frac{n'(Class)}{N'}\right)$$

increased coverage, decreased # of rules

Balance between coverage of the rule and accuracy gain

N': sum of weights of examples

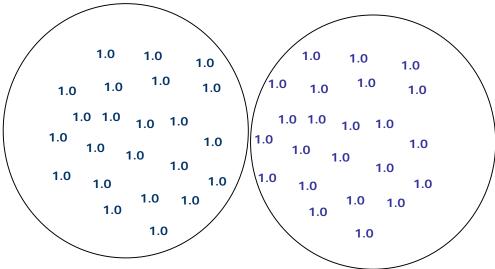
n'(Cond): sum of weights of all covered examples

n'(Cl.Cond): sum of weights of all correctly covered examples

Weighted covering algorithm for rule set construction

Disease patients

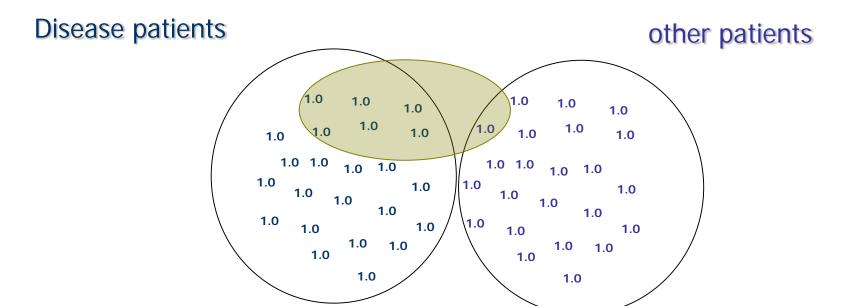
other patients



For learning a set of subgroup describing rules, SD implements an iterative weigthed covering algorithm.

Quality of a rule is measured by trading-off coverage and precision.

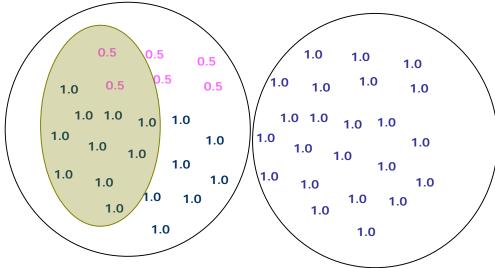
Weighted covering algorithm for rule set construction



Weighted covering algorithm for rule set construction

Disease patients

other patients



In contrast with classification rule learning algorithms (e.g. CN2), the covered positive examples are not deleted from the training set in the next rule learning iteration; they are re-weighted, and a next 'best' rule is learned.

Rule extraction and Post-process: Rule subset selection by a weighted covering approach

- Create a set of rules
- Take the best rule w.r.t. WRAcc
- Decrease the weights of covered examples
- Reorder the remaining rules and repeat until stopping
 - criterion is satisfied
 - significance threshold
 - WRAcc threshold

Interestingness criteria:

- As large as possible
- Class distribution as different as possible from the distribution in the entire data set
- Significant
- Surprising to the user
- Non-redundant
- Simple
- Useful



Fig. 1. Pseudocode of Apriori-SD algorithm

- algorithm APRIORI SD(Examples, Classes, minSup, minConf, k)
- Ruleset= APRIORI C(Examples, Classes, minSup, minConf) set all example weights of Examples to 1)
- Majority= the majority class in Examples
- Resultset= {}
- Repeat
 - BestRule= rule with the highest weighted relative accuracy in Ruleset.
 - 7. Resultset= Resultset | BestRule
 - Ruleset= Ruleset \ decrease the weights of examples covered by BestRule remove from Examples the examples covered more than k-times
- until Examples={} or Ruleset={}
- return Resultset = Resultset ∪ true → Majority

parameter k
determines the
threshold for covered
example elimination in
rule post-processing
ensuring the
convergence of the
algorithm

Kavsek, B., Lavrac, N., APRIORI-SD: Adapting association rule learning to subgroup discovery. Applied Artificial Intelligence, 20(7) (2006) 543-583.

Association Rule Learning for Subgroup Discovery: Advantages

- May be used to create rules of the form
 Class Conditions
- Each rule is an independent "chunk" of knowledge, with
 - high support and coverage (p(Class.Cond) > MinSup, p(Cond) > MinSup)
 - high confidence p(Class|Cond) > MinConf
 - all interesting rules found (complete search)
- Building small and easy-to-understand classifiers
- Appropriate for unbalanced class distributions

Ejemplo de Aplicación:

Bank business. Applications for a loan from the bank

A mortgage loan is a very common type of debt instrument, used by many individuals to purchase housing.

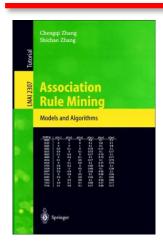


Quality data control can provide direct services to customer.

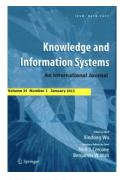
IF "bank account for the payroll" = YES and Base SALARY >= 2500 and Profession = "teacher" and Variable-salary <= 300 THEN low risk (run automatic credit process)

IF Variable-salary >= 1000 and Profession ="working-class without qualification" THEN high risk (no run automatic credit process)

Bibliografía



Chengqi Zhang, Shichao Zhang. **Association** rule mining: models and algorithms. Springer, 2002.







F. Herrera, C.J. Carmona, P. González and M.J. del Jesus, **An overview on Subgroup Discovery: Foundations and Applications** . *Knowledge and Information Systems* 29:3 (2011) 495-525, <u>doi:</u> 10.1007/s10115-010-0356-2.

M. Atzmueller. **Subgroup discovery.** WIREs Data Mining Knowl Discov 2015, 5:35–49

INTELIGENCIA DE NEGOCIO

Inteligencia de Negocio

2018 - 2019

- Tema 1. Introducción a la Inteligencia de Negocio
- Tema 2. Minería de Datos. Ciencia de Datos
- Tema 3. Modelos de Predicción: Clasificación, regresión y series temporales
- Tema 4. Preparación de Datos
- Tema 5. Modelos de Agrupamiento o Segmentación
- Tema 6. Modelos de Asociación
- Tema 7. Modelos Avanzados de Minería de Datos
- Tema 8. Big Data