Introducción
Detección de minería ilegal usando imágenes satelitales
Minería de datos médicos
Mercadeo basado en datos
Aterrizaje: Predicción del crimen
Aterrizaje: Minería de texto
Políticas Públicas

# Un Tour en Helicóptero por las Matemáticas Aplicadas a la Industria en Colombia (con dos aterrizajes)

Alvaro J. Riascos Villegas University of los Andes y Quantil

Septiembre 27, 2017



Detección de minería ilegal usando imágenes satelitales Minería de datos médicos Mercadeo basado en datos Aterrizaje: Predicción del crimen Aterrizaje: Minería de texto Políticas Públicas

### **Contents**

- 1 Introducción
- Detección de minería ilegal usando imágenes satelitales
- Minería de datos médicos
- Mercadeo basado en datos
- 5 Aterrizaje: Predicción del crimen
- 6 Aterrizaje: Minería de texto
- Políticas Públicas



- Presento los ejemplos más significativos de aplicaciones exitosas de las Matemáticas Aplicadas en la acedemía e industría: una visión muy personal como profesor de UNIANDES y co-Director de Quantil.
- Estas son aplicaciones a:
  - 1 Detección de minería ilegal.
  - 2 Minería de datos médicos.
  - Mercadeo basado en datos.
  - Predicción del crimen.
  - 6 Mineria de texto.
  - Operation of the property o



- Presento los ejemplos más significativos de aplicaciones exitosas de las Matemáticas Aplicadas en la acedemía e industría: una visión muy personal como profesor de UNIANDES y co-Director de Quantil.
- Estas son aplicaciones a:
  - Detección de minería ilegal.
  - 2 Minería de datos médicos.
  - Mercadeo basado en datos.
  - Predicción del crimen.
  - 6 Mineria de texto.
  - O Políticas públicas.



- Presento los ejemplos más significativos de aplicaciones exitosas de las Matemáticas Aplicadas en la acedemía e industría: una visión muy personal como profesor de UNIANDES y co-Director de Quantil.
- Estas son aplicaciones a:
  - 1 Detección de minería ilegal.
  - 2 Minería de datos médicos.
  - Mercadeo basado en datos.
  - Predicción del crimen.
  - 6 Mineria de texto.
  - O Políticas públicas.



- Presento los ejemplos más significativos de aplicaciones exitosas de las Matemáticas Aplicadas en la acedemía e industría: una visión muy personal como profesor de UNIANDES y co-Director de Quantil.
- Estas son aplicaciones a:
  - Detección de minería ilegal.
  - 2 Minería de datos médicos.
  - Mercadeo basado en datos.
  - Predicción del crimen.
  - 6 Mineria de texto.
  - O Políticas públicas.



- Presento los ejemplos más significativos de aplicaciones exitosas de las Matemáticas Aplicadas en la acedemía e industría: una visión muy personal como profesor de UNIANDES y co-Director de Quantil.
- Estas son aplicaciones a:
  - Detección de minería ilegal.
  - 2 Minería de datos médicos.
  - Mercadeo basado en datos.
  - Predicción del crimen.
  - 6 Mineria de texto.
  - O Políticas públicas.



- Presento los ejemplos más significativos de aplicaciones exitosas de las Matemáticas Aplicadas en la acedemía e industría: una visión muy personal como profesor de UNIANDES y co-Director de Quantil.
- Estas son aplicaciones a:
  - 1 Detección de minería ilegal.
  - 2 Minería de datos médicos.
  - Mercadeo basado en datos.
  - Predicción del crimen.
  - Mineria de texto.
  - 6 Políticas públicas.



- Presento los ejemplos más significativos de aplicaciones exitosas de las Matemáticas Aplicadas en la acedemía e industría: una visión muy personal como profesor de UNIANDES y co-Director de Quantil.
- Estas son aplicaciones a:
  - Detección de minería ilegal.
  - 2 Minería de datos médicos.
  - Mercadeo basado en datos.
  - Predicción del crimen.
  - Mineria de texto.
  - O Políticas públicas.



### Contents

- Introducción
- 2 Detección de minería ilegal usando imágenes satelitales
- 3 Minería de datos médicos
- Mercadeo basado en datos
- 5 Aterrizaje: Predicción del crimen
- 6 Aterrizaje: Minería de texto
- Políticas Públicas



# Detección de minería ilegal usando imágenes satelitales

Cortesía de Santiago Saavedra (Universidad del Rosario)



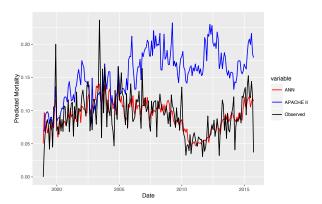
### Contents

- 1 Introducción
- Detección de minería ilegal usando imágenes satelitales
- 3 Minería de datos médicos
- 4 Mercadeo basado en datos
- 5 Aterrizaje: Predicción del crimen
- 6 Aterrizaje: Minería de texto
- Políticas Públicas



### Minería de datos médicos

• Cortesía Fundación Valle del Lili (FVL).



## **I**mágenes

#### Gráfica: Cortesía de Johns Hopkins University

(a) Spinal Cord

(b) Spinal Cord Injury



Detección de signos vitales sin contacto: Uniandes, Harvard,

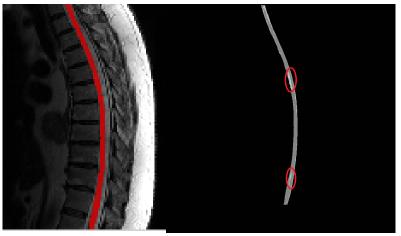
## **Imágenes**

Gráfica: Cortesía de Johns Hopkins University

(a) Spinal Cord

(b) Spinal Cord Injury

200



• Detección de signos vitales sin contacto: Uniandes, Harvard,

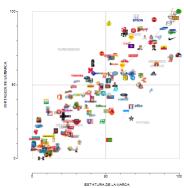
### Contents

- 1 Introducción
- Detección de minería ilegal usando imágenes satelitales
- Minería de datos médicos
- 4 Mercadeo basado en datos
- 5 Aterrizaje: Predicción del crimen
- 6 Aterrizaje: Minería de texto
- Políticas Públicas



### Mercadeo basado en datos

- Cortesía: Barbara & Frick y Young & Rubican.
- Minería de redes sociales (twitter).



### **Contents**

- Introducción
- Detección de minería ilegal usando imágenes satelitales
- 3 Minería de datos médicos
- Mercadeo basado en datos
- 5 Aterrizaje: Predicción del crimen
- 6 Aterrizaje: Minería de texto
- Políticas Públicas



# Modelo Espacio - Temporal

- Este es un modelo basado en la clasificación de los eventos como antecedentes y réplicas.
- Es el estado del arte en modelos de predicción del crimen.
- Está motivado por teorías de contagio espacial y réplicas temporales.

# Modelo Espacio - Temporal: Motivación



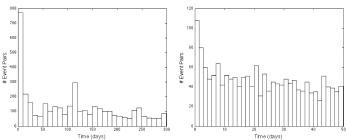


Figure 1. On the left, histogram of times (less than 300 days) between Southern California earthquake events of magnitude 3.0 or greater separated by 110 kilometers or less. On the right, histogram of times (less than 50 days) between burglary events separated by 200 meters or less.

101

# Modelo Espacio - Temporal: Motivación

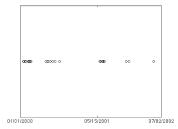


Figure 2. Times of violent crimes between two rivalry gangs in Los Angeles.

## Modelo Espacio - Temporal: especificación

 Se considera un modelo de la intensidad espacio temporal del crimen de la forma:

$$\lambda(t, x, y) = \mu(t, x, y) + \sum_{k: t_k < t} g(t - t_k, x - x_k, y - y_k)$$
 (1)

• Sea  $\mu(t,x,y) = \nu(t)\mu(x,y)$ 

## Modelo Espacio - Temporal: especificación

 Suponiendo que el modelo es correcto la probablidad de que un evento i sea un evento antecedente es:

$$\pi_{ii} = \frac{\nu(t_i)\mu(x_i, y_i)}{\lambda(t_i, x_i, y_i)} \tag{2}$$

 La probabilidad de que el evento j cause el evento i (evento réplica) es:

$$\pi_{ji} = \frac{g(t_i - t_j, x_i - x_j, y_i - y_j)}{\lambda(t_i, x_i, y_i)}$$
(3)

## Modelo Espacio - Temporal: estimación

- Sea P la matriz de probabilidades  $(p_{ji})$  (obsérvese que la suma de columnas da 1).
- Elija una probabilidad inicial  $P_0$ .
- Muestrear de  $P_0$  puntos de transfondo y réplica:  $(t_k, x_k, y_k, p_{kk})_{k=1,...N}$  y  $(t_i t_j, x_i x_j, y_i y_j, p_{ji})_{i>j}$  y usando esta muestra hacer una estimación inicial de:
  - $\mathbf{0}$   $\mu_1$  de  $\mu$ .
  - Q  $g_1$  de g.
  - $\bullet$   $\nu_1$  de  $\nu$

usando KDE con ancho de banda variable.

• Estimar inicalmente  $\lambda_1$  usando que las columnas de P suman 1.



## Modelo Espacio - Temporal: estimación

• En cada iteración n, ajustamos simulados con  $P_n$  los datos  $g_n(t_i - t_j, x_i - x_j, y_i - y_j, p_{ji})$  de g. Ahora ajustamos una un kernel del siguiente tipo:

$$g_n(t, x, y) = \frac{1}{N} \sum_{i=1}^{N_0} \frac{1}{\sigma_x \sigma_y \sigma_t (2\pi)^{\frac{3}{2}} D_i^3} \times exp(-\frac{(x - x_i)^2)}{2\sigma_x^2 D_i^2} - \frac{(y - y_i)^2)}{2\sigma_y^2 D_i^2} - \frac{(t - t_i)^2)}{2\sigma_t^2 D_i^2})$$

• Usamos un procedimiento similar para estimar  $\nu$  y  $\mu$ . En el primer caso un Kernel Gausssiano univariado y el segundo caso un Kernel Gaussiano bivariado.



## Modelo Espacio - Temporal: estimación

- Actualizar P<sub>1</sub>.
- Repetir los pasos anteriores hasta que la matriz P no cambie mucho.
- El número de probabilidades a estimar en cada iteración es del orden de  $N^2$ .
- Esto es computacionalmente constoso (típicamente N del orden de 1,000 o 30,000 Bogota en un año).

• Utilizamos el Precision Accuracy Index

$$\mathsf{PAI} = \frac{\mathsf{Hit \ Rate}}{\mathsf{Percentage \ of \ Area}}$$
 
$$\mathsf{Hit \ Rate} = \frac{\mathsf{Crimes \ predicted \ in \ Hotspots}}{\mathsf{Total \ Crimes}}$$
 
$$\mathsf{Percentage \ Area} = \frac{\mathsf{Area \ of \ Hotspots}}{\mathsf{Total \ Area}}$$

 Sin embargo en modelos muy granulares no es una buena medida.

# Modelo Espacio - Temporal: Validación



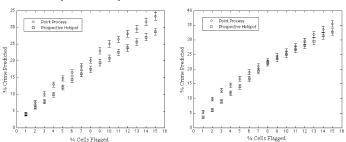


Figure 6. Forecasting strategy comparison. Average daily percentage of crimes predicted plotted against percentage of cells flagged for 2005 burglary using 200 m by 200 m cells. Error bars correspond to the standard error. Prospective hostpot cutoff parameters are 400 meters and 8 weeks (left) and optimal parameters (right) are 200 meters and 39 weeks. Spatial background intensity  $\mu(x, y)$  smoothing bandwidth for the point process is 300 meters (left) selected by cross validation and 130 meters (right) selected to optimize the number of crimes predicted.

105

- Se cuenta con datos de crímenes en Bogot del 16 de abril al 30 de junio de 2017: 16.402 datos.
- Para esta validación se usaron datos de la localidad de Santa Fé, delimitada por latitudes entre [4.571, 4.629] y longitudes > -74.091.

- Se cuenta con datos de crímenes en Bogot del 16 de abril al 30 de junio de 2017: 16.402 datos.
- Para esta validación se usaron datos de la localidad de Santa Fé, delimitada por latitudes entre [4.571, 4.629] y longitudes > -74.091.

- 1.676 (  $\approx 10\%$  ) crímenes en la localidad de Santa Fé en el período tratado.
- Se entrenó el modelo de crimen con datos entre 1 y 7 semanas y se validó con las 3 semanas posteriores al entrenamiento, en todos los casos, del 10 al 30 de junio de 2017 (407 crímenes).

- 1.676 ( $\approx$  10%) crímenes en la localidad de Santa Fé en el período tratado.
- Se entrenó el modelo de crimen con datos entre 1 y 7 semanas y se validó con las 3 semanas posteriores al entrenamiento, en todos los casos, del 10 al 30 de junio de 2017 (407 crímenes).

- Se divide Bogot (1.547km $^2$ ) en 10,946 celdas de  $\approx$  145m $^2$  cada una; 1.019 celdas en la localidad de Santa F.
- Se entrena el modelo con el correspondiente número de semanas y se predicen los puntos calientes para cada turno de 8 horas, definidos como el 10% de las celdas con mayor probabilidad de crimen.
- Se investigan cuántos crímenes de los datos de validación ocurrieron en los puntos calientes predichos por el modelo

- Se divide Bogot (1.547km $^2$ ) en 10,946 celdas de  $\approx$  145m $^2$  cada una; 1.019 celdas en la localidad de Santa F.
- Se entrena el modelo con el correspondiente número de semanas y se predicen los puntos calientes para cada turno de 8 horas, definidos como el 10% de las celdas con mayor probabilidad de crimen.
- Se investigan cuántos crímenes de los datos de validación ocurrieron en los puntos calientes predichos por el modelo

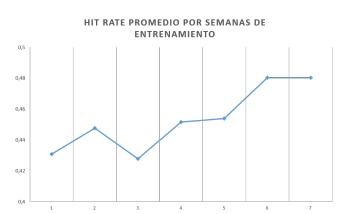
- Se divide Bogot (1.547km $^2$ ) en 10,946 celdas de  $\approx$  145m $^2$  cada una; 1.019 celdas en la localidad de Santa F.
- Se entrena el modelo con el correspondiente número de semanas y se predicen los puntos calientes para cada turno de 8 horas, definidos como el 10% de las celdas con mayor probabilidad de crimen.
- Se investigan cuántos crímenes de los datos de validación ocurrieron en los puntos calientes predichos por el modelo.

### Validación: Hit Rate

 La siguiente tabla registra el Hit Rate del modelo al ser entrenado con datos entre 1 y 7 semanas. El Hit Rate se calcul para cada uno de los 21 turnos de 8 horas dentro de cada semana.

| Entrenamiento | 1    | 2    | 3    | 4    | 5    | 6    | 7    |
|---------------|------|------|------|------|------|------|------|
| Semana 1      | 0,49 | 0,47 | 0,44 | 0,44 | 0,46 | 0,44 | 0,44 |
| Semana 2      | 0,41 | 0,40 | 0,40 |      | 0,43 | 0,46 | 0,46 |
| Semana 3      | 0,39 | 0,48 | 0,44 | 0,49 | 0,48 | 0,54 | 0,54 |
| Promedio      | 0,43 | 0,45 | 0,43 | 0,45 | 0,45 | 0,48 | 0,48 |

### Validación: Hit Rate



### Validación: PAI

Al evaluar la eficiencia del modelo entrenado con 7 semanas, se encontró:

| Cobertura                        | I    |      |      |      |      |
|----------------------------------|------|------|------|------|------|
| Semana 1                         | 1,53 | 5,04 | 4,4  | 4,21 | 3,92 |
| Semana 2                         | 4,33 | 6,14 | 4,62 | 3,98 | 3,64 |
| Semana 1<br>Semana 2<br>Semana 3 | 10,4 | 6,92 | 5,43 | 4,37 | 3,7  |
| Promedio                         | 5,33 | 6,02 | 4,8  | 4,19 | 3,75 |

# PAI PROMEDIO SEGÚN PORCENTAJE DE COBERTURA



- Se puede apreciar que entre mayor sea el número de datos de entrenamiento, el modelo tiene mayor capacidad predictiva.
- Este método de validación se puede utilizar también para calibrar otros parámetros del modelo: tipo de kernel y anchos de banda, pesos otorgados a los datos de entrenamiento, entre otros.

- Se puede apreciar que entre mayor sea el número de datos de entrenamiento, el modelo tiene mayor capacidad predictiva.
- Este método de validación se puede utilizar también para calibrar otros parámetros del modelo: tipo de kernel y anchos de banda, pesos otorgados a los datos de entrenamiento, entre otros.

Hit Rate con 7 semanas de entrenamiento y 10% de cobertura de puntos calientes:

| Prediccin | bw fijo | bw variable |
|-----------|---------|-------------|
| Semana 1  | 0,44    | 0,57        |
| Semana 2  | 0,46    | 0,59        |
| Semana 3  | 0,54    | 0,62        |
| Promedio  | 0,48    | 0,59        |

Hit Rate con 7 semanas de entrenamiento y 10% de cobertura de puntos calientes:

| Prediccin | bw fijo | bw variable | KDE  |
|-----------|---------|-------------|------|
| Semana 1  | 0,44    | 0,57        | 0,42 |
| Semana 2  | 0,46    | 0,59        | 0,44 |
| Semana 3  | 0,54    | 0,62        | 0,53 |
| Promedio  | 0,48    | 0,59        | 0,46 |

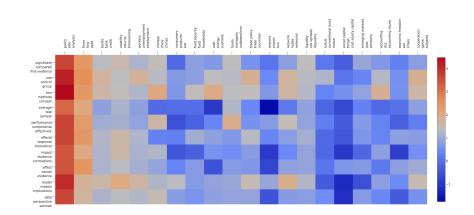
#### **Contents**

- Introducción
- Detección de minería ilegal usando imágenes satelitales
- 3 Minería de datos médicos
- 4 Mercadeo basado en datos
- 5 Aterrizaje: Predicción del crimen
- 6 Aterrizaje: Minería de texto
- Políticas Públicas



Introducción
Detección de minería ilegal usando imágenes satelitales
Minería de datos médicos
Mercadeo basado en datos
Aterrizaje: Predicción del crimen
Aterrizaje: Minería de texto

### **GAP MAPS**



### GAP MAPS: Modelo documentos

#### **Definition**

Un vocabulario V es una sucesión finita de elementos diferentes  $(v_1, \ldots, v_n)$ . n es llamado el tamaño del vocabulario V.  $v_1, \ldots, v_n$  son llamados los términos del vocabulario V.

#### Definition

Un documento sobre un vocabulario V es una sucesión  $d:=(w_1,\ldots,w_n)$  con  $w_i\in V,\,\forall i\in\{1,\ldots,n\}.$  n es llamado la longitud del documento d.

#### Definition

Sea V un vocabulario,  $v_i$  un término y  $d = (w_i, \dots, w_n)$  un documento sobre este vocabulario.

$$c_i(d) := \sum_{i=1}^n \mathbb{I}(v_i = w_j)$$

es la función frecuencia del término vi



### GAP MAPS: Modelo documentos

#### **Definition**

El vector de frecuencia de términos de un documento d sobre un vocabulario V es el vector

$$f(d) := (c_1(d), \ldots, c_n(d))$$

#### Definition

Un Corpus  $C = (d_1, \dots, d_n)$  es una sucesión de documentos sobre un vocabulario V. n es llamado el tamaño del Corpus.

#### Definition

Dado un Corpus  $C = (d_1, \dots, d_m)$  sobre un vocabulario  $V = (v_1, \dots, v_n)$  se define la matriz de términos y documentos

$$[M_{ii}] = f(d_i)_i, \quad 1 < i < n, \quad 1 < j < m$$

Esto quiere decir que la entrada en la posición i, j corresponde a la frecuencia con que ocurre el término  $v_i$  dentro del documento  $d_i$ .

- LDA es un modelo probabilístico generativo de un corpus.
- La idea es que los documentos son representados como mezclas aleatorias sobre tópicos latentes, donde cada tópico es caracterizado como una distribución sobre palabras.

- LDA asume el siguiente proceso generativo para cada documento en un corpus :
  - **1** Escoja  $N \sim \text{Poisson}(\xi)$ .
  - **2** Escoja  $\theta \sim \text{Dirichlet}(\alpha)$ .
  - 3 Para cada una de las N palabras  $w_n$ :
    - Escoja un tópico  $z_n \sim \text{Multinomial}(\theta)$ .
    - Escoja una palabra  $w_n$  de  $p(w_n | z_n, \beta)$ , una distribución de probabilidad multinomial condicionada en el tópico  $z_n$ .

• Las probabilidades de cada palabra estan parametrizadas por una matrix  $\beta$  de dimensiones  $k \times V$ , donde  $\beta_{ij} = p(w^j = 1 \mid z^i = 1)$ . Estos son unos valores fijos a ser estimados.

• Dados los parámetros  $\alpha$  y  $\beta$ , la función de probabilidad conjunta de una mezcla de tópicos  $\theta$ , un conjunto de N tópicos , y un conjunto de N palabras está dado por:

$$p(\theta, z, w \mid \alpha, \beta) = p(\theta \mid \alpha) \prod_{n=1}^{N} p(z_n \mid \theta) p(w_n \mid z_n, \beta), \quad (4)$$

donde  $p(z_n \mid \theta)$  es  $\theta_i$  para el único i tal que  $z_n^i = 1$ .

• Integrando sobre  $\theta$  y sumando sobre z, obtenemos la distribución marginal de un documento:

$$p(w \mid \alpha, \beta) = \int p(\theta \mid \alpha) \left( \prod_{n=1}^{N} \sum_{z_n} p(z_n \mid \theta) p(w_n \mid z_n, \beta) \right) d\theta.$$
(5)

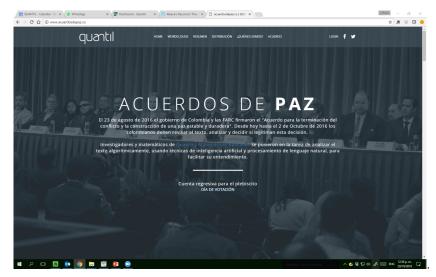
 Por último, tomando el producto de las probabilidades marginales de los documentos, obtenemos la probabilidad de un corpus:

$$p(c \mid \alpha, \beta) = \prod_{d=1}^{M} \int p(\theta_d \mid \alpha) \left( \prod_{n=1}^{N_d} \sum_{z_{dn}} p(z_{dn} \mid \theta_d) p(w_{dn} \mid z_{dn}, \beta) \right) d\theta$$

 Esta distribución es intractable, en general. A pesar de esto diferentes algoritmos de inferencia aproximada pueden ser considerados para LDA, como Variational Approximation y Markov Chain Monte Carlo.

### Automatic summarization

• Cortesía Quantil (proyecto interno).



#### **Contents**

- Introducción
- Detección de minería ilegal usando imágenes satelitales
- Minería de datos médicos
- Mercadeo basado en datos
- 5 Aterrizaje: Predicción del crimen
- 6 Aterrizaje: Minería de texto
- Políticas Públicas



- Colombia has a mandatory competitive health insurance system.
- Payments are determined using information provided by HMOs
- Health records: 400 million data items per year, 20 million individuals.
- Potential problems: Risk adjustment, solvency, fraud, data manipulation, misreport, errors, etc.

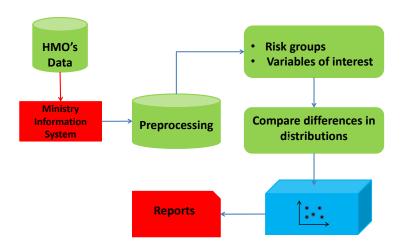
- Colombia has a mandatory competitive health insurance system.
- Payments are determined using information provided by HMOs.
- Health records: 400 million data items per year, 20 million individuals.
- Potential problems: Risk adjustment, solvency, fraud, data manipulation, misreport, errors, etc.

- Colombia has a mandatory competitive health insurance system.
- Payments are determined using information provided by HMOs.
- Health records: 400 million data items per year, 20 million individuals.
- Potential problems: Risk adjustment, solvency, fraud, data manipulation, misreport, errors, etc.

- Colombia has a mandatory competitive health insurance system.
- Payments are determined using information provided by HMOs.
- Health records: 400 million data items per year, 20 million individuals.
- Potential problems: Risk adjustment, solvency, fraud, data manipulation, misreport, errors, etc.

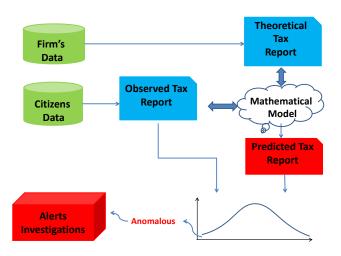
### Health Records: Anomaly detection

• Courtesy of Ministry of Health and Social Protection.



### Tax Evasion

• Problems: Detect likely cases of tax evasion.



# Money Laundry

- Problem: Detect anomalous transactions that may be suspicious of money laundry.
- Confidentiality agreements forbids me of explaining further details.

# Money Laundry

- Problem: Detect anomalous transactions that may be suspicious of money laundry.
- Confidentiality agreements forbids me of explaining further details.

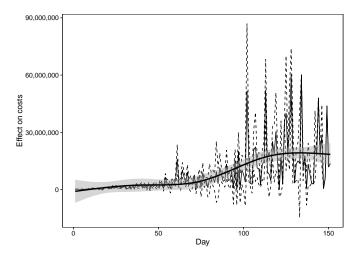
### Lawsuits Against the State

 Courtesy of National Agency for Judicial State Defence (ANDJE).



# Predicting unnecessary hospitalizations

• Courtesy of Ministry of Health and Social Protection.



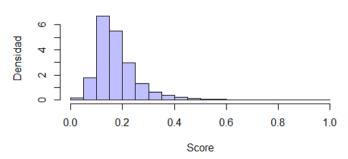
# Risk Adjustment

• Courtesy of Ministry of Health and Social Protection.

# Subjective Poverty

• Courtesy of National Department of Statistics (DANE).

#### Histograma Pobreza Subjetiva 2016-1



### Gracias!

ariascos@uniandes.edu.co