

Paris School of Business (PSB)

**Compréhension et utilisation de 4 packages de R:
evir, evd, R.miner, graphics**

MSc Data Management

Projet : **R**

par :

Thuy AUFRERE, Nina ZOUMANIGUI, Arnaud Bruel YANKO

Sous la direction de :

M. Henri LAUDE

Enseignant

Année académique 2020-2022

♣ Table des matières ♣

1	Introduction	1
2	Installation et chargement d'un package R	2
2.1	Evir et evd	3
2.2	Accéder au contenu d'un package <i>R</i> chargé	4
2.3	Applications	5
3	Package RMiner : Data Mining Classification et Méthode de Regression	26
3.1	Data preparation : CasesSeries, delevels	27
3.2	Modeling : fit, predict	29
3.3	Evaluation : mmetric, mgraph, mining	30
4	Package graphics R	33
4.1	Introduction	33
4.2	Description et installation d'un package graphics <i>R</i>	33
4.3	Applications	35
	Bibliographie	38

1 Introduction

Dans une session R , nous avons accès à un bon nombre de fonctions et de jeux de données. Les objets accessibles sont ceux contenus dans les packages R chargés à l'ouverture de la session. Un package R est simplement un regroupement de fonctions et de données documentées. Ce tutoriel a pour but de vous faire une présentation de certains packages qui ont été choisis à savoir `evir`, `evd`, `R.miner`, `graphics`, packages qui nous permettrons :

- D'explorer le monde de la théorie des valeurs extrêmes ([Cours intéressant sur la Statistique des valeurs extrêmes](#)) en modélisant les risques extrêmes ;
- Travailler d'une manière générale sur la régression.

2 Installation et chargement d'un package R

L'installation d'un package et le chargement d'un package sont deux étapes distinctes.

Certains packages *R* sont installés automatiquement lors de l'installation de *R*.

La fonction `installed.packages` retourne des informations à propos des packages *R* installés sur l'ordinateur local.

Il est simple de charger en *R* des packages supplémentaires à ceux chargés par défaut. Il suffit d'utiliser les commandes comme dans l'exemple suivant :

```
Install.packages("evir")
```

```
library(evir)
```

```
> Arnaud<-installed.packages()
```

```
> head(Arnaud, n=3)
```

Package	LibPath	Version	Priority	Depends	Imports	LinkingTo	Suggests	Enhances
abind	"abind"	"C:/Users/yanko/Documents/R/win-library/3.6"	"1.4-5"					
NA	"R (>= 1.5.0)"							
	"methods, utils"	NA	NA	NA				
actuar	"actuar"	"C:/Users/yanko/Documents/R/win-library/3.6"	"2.3-3"					
NA	"R (>= 3.3.0)"							
	"stats, graphics, expint"	"expint"	"MASS"	NA				
askpass	"askpass"	"C:/Users/yanko/Documents/R/win-library/3.6"	"1.1"					
NA	NA							
	"sys (>= 2.1)"	NA	"testthat"	NA				
License		License_is_FOSS	License_restricts_use	OS_type				
MD5sum	NeedsCompilation	Built						
abind	"LGPL (>= 2)"	NA		NA				
NA	NA	"no"	"3.6.0"					
actuar	"GPL (>= 2)"	NA		NA				
NA	NA	"yes"	"3.6.2"					
askpass	"MIT + file LICENSE"	NA		NA				
NA	NA	"yes"	"3.6.3"					

2.1 Evir et evd

Evir et Evd : Qu'est ce que c'est ?

Evir est un package de *R* utilisé dans la théorie de valeurs extrêmes, qui peuvent être divisées dans les groupes suivants ; analyse exploratoire des données, maxima de bloc, pics au-dessus d'un seuil (univarié et bivarié), processus ponctuels, distributions *gev/gpd*.

Quant-à

Evd elle étend les fonctions de simulation, de distribution, de quantile de valeurs extrêmes paramétriques univariées et multivariées, et fournit d'ajustement qui calculent les estimations du maximum de vraisemblance pour des modèles maxima univariées et bivariées, et pour les modèles à seuil univariées et bivariées.

Les fonctions d'Evir et Evd

Ici nous allons recenser certaines fonctions qui peuvent être utilisées dans ces deux packages, commençant par *Evid*.

Listes des fonctions de Evir

Fonctions	Rôles
<i>dgev</i>	Renvoie la distribution des valeurs extrêmes généralisées
<i>dgpd</i>	Distribution de la <i>Pareto</i> généralisée
<i>emplot</i>	Graphique de la fonction de distribution empirique
<i>findthresh</i>	Permet de trouver le seuil
<i>gev</i>	Permet d'ajuster les valeurs des valeurs extrêmes généralisées
<i>gpd</i>	Permet d'ajuster le modèle <i>Pareto</i> généralisé
<i>gumbel</i>	Permet d'ajuster la distribution de <i>Gumbell</i>
<i>nidd.annual</i>	Les données de la rivière <i>Nidd</i>
<i>pgev</i>	Donne la valeur de la distribution des valeurs extrêmes généralisées
<i>interpret.gpdbiv</i>	Interprétation des résultats de l'ajustement <i>pgd</i> bivarié
<i>rgpd</i>	Distribution de la <i>Pareto</i> généralisée

Listes des fonctions de Evd

2. Installation et chargement d'un package R

Fonctions	Rôles
<i>failure</i>	Temps d'échec
<i>dextreme</i>	Distributions des maxima et es minima
<i>dmvevd</i>	Distributions paramétriques et valeurs extrêmes multivariées
<i>fextreme</i>	Ajustement du maximum de vraisemblance des maxima et des minima
<i>qfrechet</i>	Distribution de <i>Frchet</i>
<i>qnweibull</i>	distribution inverse de <i>weibull</i>
<i>gumbel</i>	Permet d'ajuste la distribution de <i>Gumbell</i>
<i>rorder</i>	Distributions des statistiques d'ordres
<i>confint.evd</i>	Calcule les intervalles de confiance

2.2 Accéder au contenu d'un package R chargé

Une fois un package chargé en R avec la commande `library`, son contenu est accessible dans la session R. Nous avons vu dans des notes précédentes comment fonctionne l'évaluation d'expressions en R. Nous savons donc que le chargement d'un nouveau package ajoute un environnement dans le chemin de recherche de R, juste en dessous de l'environnement de travail. Le chargement de certains packages provoque aussi le chargement de packages dont ils dépendent. Ainsi, parfois plus d'un environnement est ajouté au chemin de recherche de R lors du chargement d'un package. L'environnement d'un package contient les fonctions publiques et les données du package.

Jeux de données

Souvent, les jeux de données inclus dans un package se retrouvent directement dans l'environnement d'un package dans le chemin de recherche. C'est le cas, par exemple, des jeux de données du package `datasets`.

```
head(ls("package:datasets"), n = 8)
```

```
> head(ls("package:datasets"), n=8)
[1] "ability.cov"    "airmiles"      "AirPassengers" "airquality"
"anscombe"       "attenu"        "attitude"     "austres"
```

Dans notre cas espèce seulement les 8 premiers éléments de la liste sont affichés ici, car cette liste compte normalement 104 éléments.

2. Installation et chargement d'un package R

Cependant, les jeux de données sont parfois cachés. Ils sont alors traités différemment des fonctions privées et ne se retrouvent même pas dans l'espace de noms du package.

La fonction `data` est très utile dans ce cas. Cette fonction a en fait plusieurs utilités.

Premièrement, elle permet d'énumérer tous les jeux de données contenus dans un package.

```
data(package = "evir")
```

Dans notre cas espèce, nous allons à partir du packages "evir", afficher le jeux de données *nidd.annual*, ces données représentent les niveaux maximaux annuels de la rivière *Nidd* dans le Yorkshire..

On a :

```
library(evd)
library(evir)
library(actuar)
library(rmutil)
data(nidd.annual)
nidd<-nidd.annual
```

Et on a la sortie suivante :

```
> nidd
[1] 65.08 65.60 75.06 76.22 78.55 81.27 86.93 87.76 88.89
90.28 91.80 91.80 92.82 95.47 100.40 111.54 111.74 115.52 131.82
138.72 148.63 149.30 151.79 153.04 158.01 162.99 172.92 179.12 181.59
189.04 213.70 226.48 251.96 261.82 305.75
```

Nous obtenons en sortir un vecteur numérique contenant 35 observations.

2.3 Applications

Pour application on utilise les données des crues annuelles de la rivière *Nidd*, dans le Yorkshire.

Contexte

La hauteur d'une rivière est modélisée par une variable aléatoire X .

On dispose de $\{X_1, \dots, X_n\}$ un échantillon de hauteurs d'eau annuelles. On note $X_{1,n} \leq$

2. Installation et chargement d'un package R

$X_{2,n} \leq \dots \leq X_{n,n}$ l'échantillon ordonné, avec $n \in \mathbb{N}$.

Deux problèmes complémentaires :

- * Calculer la probabilité p d'une hauteur d'eau h extrême

$$p = \mathbf{P}(X \geq h) \text{ avec } h > X_{n,n}.$$

- * Calculer le niveau d'eau h qui est atteint ou dépassé une seule fois sur $T > n$, i.e. résoudre

$$\frac{1}{T} = \mathbf{P}(X \geq h)$$

Modélisation : Le but ici étant d'écrire un programme permettant de calculer la fonction empirique des excès moyens et de tracer les différents seuils :

Application 1

- (–) On Charge au préalable nos deux packages, les bouts de code suivant permettent de faire ce travail :

```
library(evd)
library(evir)
```

- (–) Nous allons commencer par lire les données du fichier *Nidd* et les classer par ordre décroissant dans un vecteur noté *nidd*. On crée un vecteur *seuil* ordonné par ordre.

```
nidd2 <- sort(nidd, decreasing = TRUE)
nidd2
seuil = seq(70, 300, by = 5)
#seuil <- 70:300
seuil
taille_seuil = length(seuil)
taille_nidd2 = length(nidd2)
```

- (–) Afin de calculer la moyenne des excès pour chaque seuil, on crée une matrice dont le nombre de lignes correspond à la taille du vecteur "*seuil*" et le nombre de colonnes correspond à la taille du vecteur "*nidd*" telle que chaque ligne i correspond aux excès au delà du $seuil[i]$.

Puisque certains excès peuvent être négatifs, nous mettons les zéros à la place des termes négatifs :

2. Installation et chargement d'un package R

```
X=matrix(0,nrow=length(seuil),ncol=length(nidd2))
X
#View(X)

for(i in 1:length(seuil))
{for(j in 1:length(nidd2))
  {X[i,j]=max(nidd2[j]-seuil[i],0)}
}
X
```

2. Installation et chargement d'un package R

(–) On calcule pour chaque seuil la moyenne des excès :

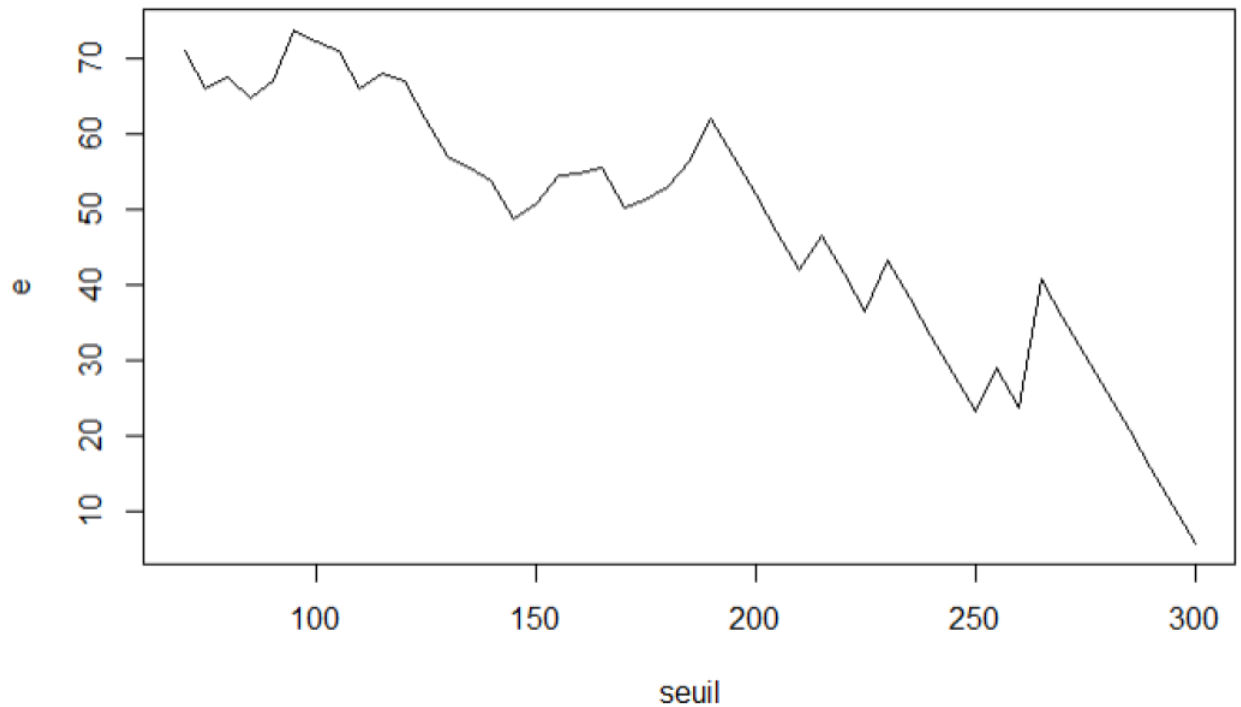
```
somme=rep(0,length(seuil))
somme
Compteur=rep(0,length(seuil))
Compteur
e=c()
e

for(i in 1:length(seuil))
{
  for(j in 1:length(nidd2))
  {
    if ( X[i,j]>0 )
    {
      somme[i]=somme[i]+X[i,j]
      Compteur[i]=Compteur[i]+1
    }
  }
  e[i]=somme[i]/Compteur[i]
}
e
```

(–) La fonction moyenne des excès est une méthode permettant de répondre à l'une des difficultés de la modélisation des sinistres extrêmes qui est la détermination du seuil. Ainsi, graphiquement il est possible de déterminer le seuil le plus adéquat, en prenant la valeur à partir de laquelle la fonction moyenne des excès est linéaire.

Regardons ensemble ce que cela produit :

```
plot(seuil,e,type='l')
```



Dans notre cas, La fonction moyenne des excès est linéaire à partir de la valeur 260.

- (–) Ici on trace sur deux graphiques juxtaposés : la fonction empirique des excès moyens en fonction des statistiques d'ordre $x_{(n-k)}$ et en fonction de k .

Le 1^{er} représente la moyenne des dépassements des crues annuelles de la rivière *Nidd* par rapport à un certain seuil (indépendant de nos données de départ). Le 2^{eme} représente la moyenne des dépassements de la crue annuelle de la rivière *Nidd* d'une année par rapport aux autres.

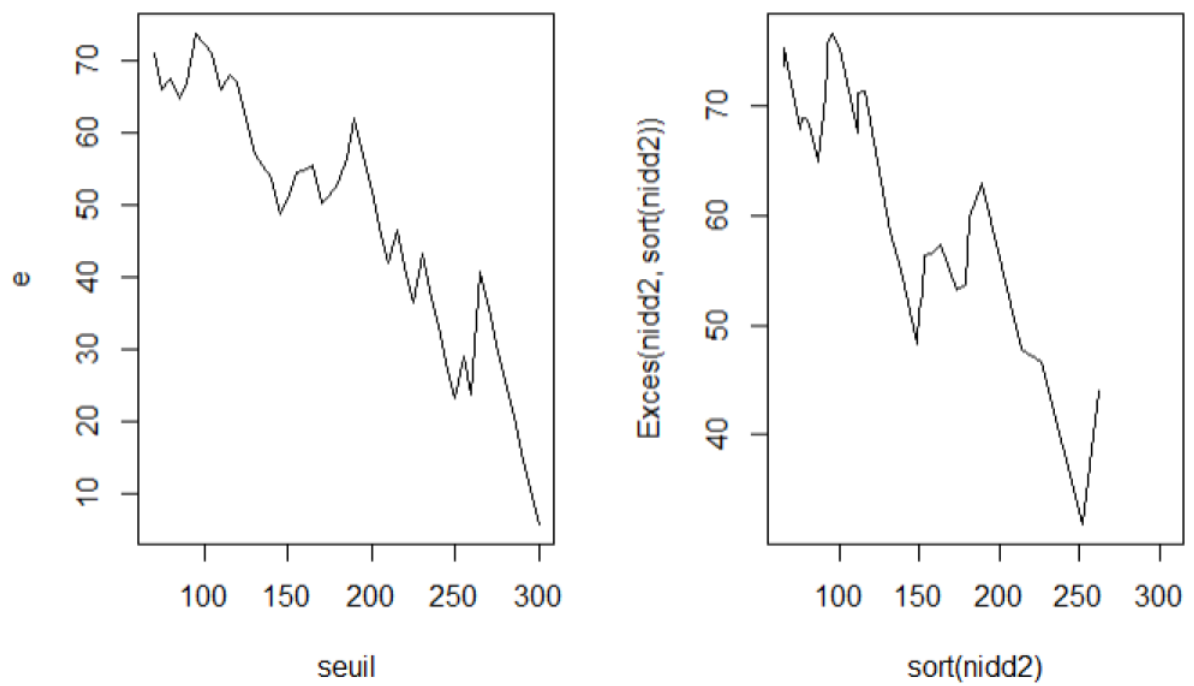
```
Exces=function ( observations , seuil )  
{  
  Exces2=matrix ( 0 , nrow=length ( seuil ) ,  
    ncol=length ( observations ) )  
  Exces2  
  #View (X)  
  
  for ( i in 1:length ( seuil ) )  
  {
```

2. Installation et chargement d'un package R

```
      for(j in 1:length(observations))
      {
          Exces2[i,j]=max(observations[j]-seuil[i],0)
      }
  }
  Exces2
  somme2=rep(0,length(seuil))
  somme2
  Compteur2=rep(0,length(seuil))
  Compteur2
  e2=c()
  e2
  for(i in 1:length(seuil))
  {
      for(j in 1:length(observations))
      {
          if ( Exces2[i,j]>0 )
          {
              somme2[i]=somme2[i]+Exces2[i,j]
              Compteur2[i]=Compteur2[i]+1
          }
      }
      e2[i]=somme2[i]/Compteur2[i]
  }
  e2

  Exces(nidd2 , sort(nidd2))
  par(mfrow=c(1,2))
  plot(seuil ,e ,type='l')
  plot(sort(nidd2) ,Exces(nidd2 , sort(nidd2)) , type='l')
```

2. Installation et chargement d'un package R



Les deux graphique sont la même allure, et la fonction moyenne des excès devient linéaire aux environs de la valeur 260.

2. Installation et chargement d'un package R

Pour aller plus loin l'idéal serait d'appliquer cela aux différentes lois usuelles : La loi Pareto, Weibull, Frechet, Gamma, Cauchy, Normal et bien d'autres : ([Les différents lois en Statistique des valeurs extrêmes](#))

(-) Application aux lois usuelles

```
#####loi Normal Centrée reduite#####
Nidd_normal=rnorm(1000,0,1)
Nidd_normal_dec=sort(Nidd_normal, decreasing = TRUE)
seuil_stat_ord=sort(Nidd_normal, decreasing = FALSE)
#Exces(Nidd_normal_dec,seuil_stat_ord)
par(mfrow=c(3,4))
plot(sort(nidd2),Exces(nidd2,sort(nidd2)),type='l',main='Nidd',
xlab = "" , ylab = "")
plot(seuil_stat_ord,Exces(Nidd_normal_dec,seuil_stat_ord),type='l',
main='Normal',xlab = "" , ylab = "")

#####loi weibull#####
Nidd_weibull=rweibull(1000, 1)
Nidd_weibull_dec=sort(Nidd_weibull, decreasing = TRUE)
seuil_stat_ord=sort(Nidd_weibull, decreasing = FALSE)
#Exces(Nidd_weibull_dec,seuil_stat_ord)
#par(mfrow=c(2,2))
#plot(sort(nidd2),Exces(nidd2,sort(nidd2)),type='l')
plot(seuil_stat_ord,Exces(Nidd_weibull_dec,seuil_stat_ord),
type='l',main='weibull',xlab = "" , ylab = "")

#####loi Cauchy#####
Nidd_cauchy=rcauchy(1000, 0, 1)
Nidd_cauchy_dec=sort(Nidd_cauchy, decreasing = TRUE)
seuil_stat_ord=sort(Nidd_cauchy, decreasing = FALSE)
#Exces(Nidd_cauchy_dec,seuil_stat_ord)
#par(mfrow=c(2,2))
#plot(sort(nidd2),Exces(nidd2,sort(nidd2)),type='l')
plot(seuil_stat_ord,Exces(Nidd_cauchy_dec,seuil_stat_ord),
```

2. Installation et chargement d'un package R

```
type='l',main='Cauchy',xlab = "" , ylab = "")

#####loi gumbel#####
Nidd_gumbel=rgumbel(1000,0,1)
Nidd_gumbel_dec=sort(Nidd_gumbel, decreasing = TRUE)
seuil_stat_ord=sort(Nidd_gumbel, decreasing = FALSE)
#Exces(Nidd_gumbel_dec,seuil_stat_ord)
#par(mfrow=c(2,2))
#plot(sort(nidd2),Exces(nidd2,sort(nidd2)),type='l')
plot(seuil_stat_ord,Exces(Nidd_gumbel_dec,seuil_stat_ord),
type='l',main='gumbel',xlab = "" , ylab = "")

#####loi frechet#####
Nidd_frechet=rfrechet(1000, loc=0, scale=1, shape=1)
Nidd_frechet_dec=sort(Nidd_frechet, decreasing = TRUE)
seuil_stat_ord=sort(Nidd_frechet, decreasing = FALSE)
#Exces(Nidd_frechet_dec,seuil_stat_ord)
#par(mfrow=c(2,2))
#plot(sort(nidd2),Exces(nidd2,sort(nidd2)),type='l')
plot(seuil_stat_ord,Exces(Nidd_frechet_dec,seuil_stat_ord),
type='l',main='frechet',xlab = "" , ylab = "")

#####loi expo#####
Nidd_Expo=rexp(1000,1)
Nidd_Expo_dec=sort(Nidd_Expo, decreasing = TRUE)
seuil_stat_ord=sort(Nidd_Expo, decreasing = FALSE)
#Exces(Nidd_Expo_dec,seuil_stat_ord)
#par(mfrow=c(2,2))
#plot(sort(nidd2),Exces(nidd2,sort(nidd2)),type='l')
plot(seuil_stat_ord,Exces(Nidd_Expo_dec,seuil_stat_ord),
type='l',main='Expo',xlab = "" , ylab = "")
```

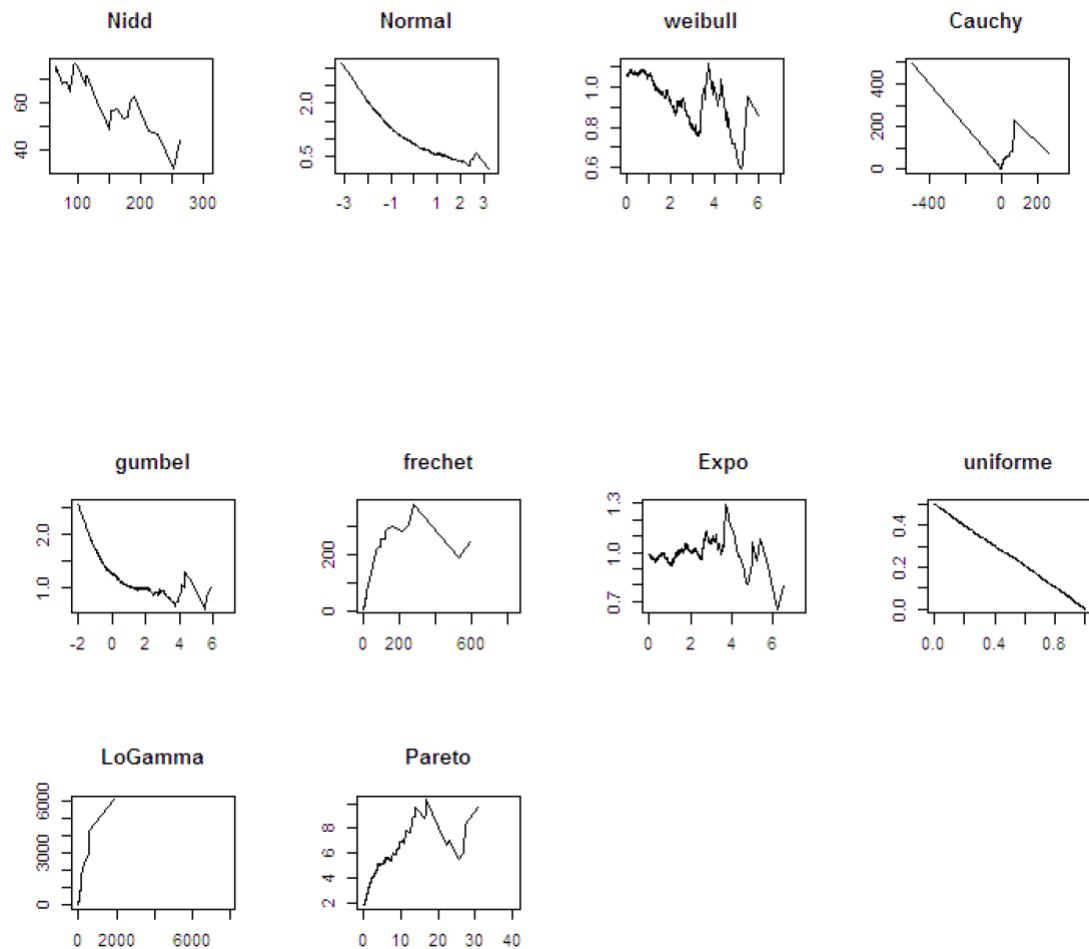
2. Installation et chargement d'un package R

```
##### loi uniforme #####
Nidd_unifo=runif(1000,0,1)
Nidd_unifo_dec=sort(Nidd_unifo , decreasing = TRUE)
seuil_stat_ord=sort(Nidd_unifo , decreasing = FALSE)
#Exces(Nidd_unifo_dec , seuil_stat_ord)
#par(mfrow=c(2,2))
#plot(sort(nidd2),Exces(nidd2 , sort(nidd2)),type='l')
plot(seuil_stat_ord ,Exces(Nidd_unifo_dec , seuil_stat_ord) ,
type='l' ,main='uniforme' ,xlab = "" , ylab = "")

##### loi Gamma #####
Nidd_LoGamma=rlgamma(1000,1,1)
Nidd_LoGamma_dec=sort(Nidd_LoGamma, decreasing = TRUE)
seuil_stat_ord=sort(Nidd_LoGamma, decreasing = FALSE)
#Exces(Nidd_Gamma_dec , seuil_stat_ord)
#par(mfrow=c(2,2))
#plot(sort(nidd2),Exces(nidd2 , sort(nidd2)),type='l')
plot(seuil_stat_ord ,Exces(Nidd_LoGamma_dec , seuil_stat_ord) ,
type='l' ,main='LoGamma' ,xlab = "" , ylab = "")

##### loi Pareto #####
Nidd_Pareto=rpareto(1000,2,2)
Nidd_Pareto_dec=sort(Nidd_Pareto , decreasing = TRUE)
seuil_stat_ord=sort(Nidd_Pareto , decreasing = FALSE)
#Exces(Nidd_Pareto_dec , seuil_stat_ord)
#par(mfrow=c(2,2))
#plot(sort(nidd2),Exces(nidd2 , sort(nidd2)),type='l')
plot(seuil_stat_ord ,Exces(Nidd_Pareto_dec , seuil_stat_ord) ,
type='l' ,main='Pareto' ,xlab = "" , ylab = "")
```


2. Installation et chargement d'un package R

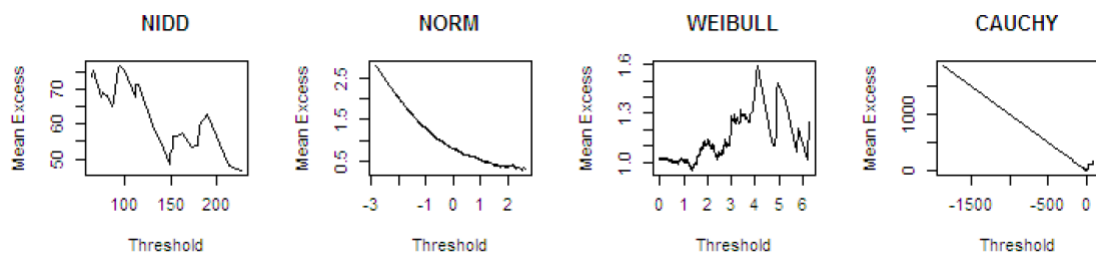


2. Installation et chargement d'un package R

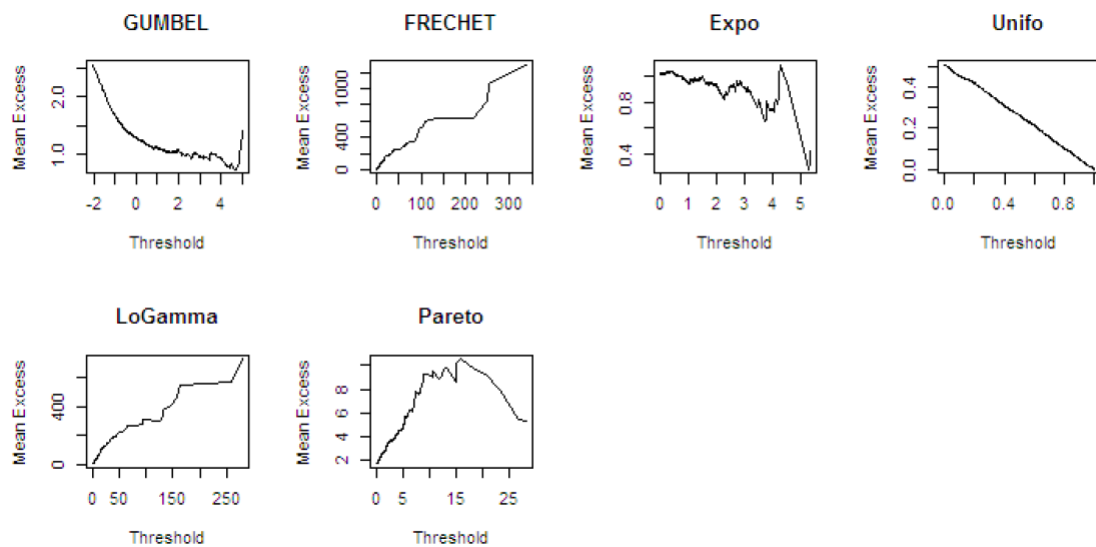
- (–) utilisons la fonction `"meplot"` du package `"evir"` pour tracer la fonction empirique des excès moyens pour différentes lois.

```
Normal = rnorm(1000,0,1)
Weibull = rweibull(1000, 1)
Cauchy = rcauchy(1000, 0, 1)
Gumbel = rgumbel(1000,0,1)
Frechet = rfrechet(1000, loc=0, scale=1, shape=1)
Expo=rexp(1000,1)
Unifo=runif(1000,0,1)
LoGamma=rlgamma(1000,1,1)
Pareto=rpareto(1000,2,2)

close.screen( all = TRUE )
par(mfrow=c(3,4))
meplot(nidd, 3, type="l", main="NIDD")
meplot(Normal, 3, type="l", main="NORM")
meplot(Weibull, 3, type="l", main="WEIBULL")
meplot(Cauchy, 3, type="l", main="CAUCHY")
meplot(Gumbel, 3, type="l", main="GUMBEL")
meplot(Frechet, 3, type="l", main="FRECHET")
meplot(Expo, 3, type="l", main="Expo")
meplot(Unifo, 3, type="l", main="Unifo")
meplot(LoGamma, 3, type="l", main="LoGamma")
meplot(Pareto, 3, type="l", main="Pareto")
```



2. Installation et chargement d'un package R



Application 2 : On termine le seuil avec le Graphique de *HILL*

Le graphique de *Hill* est un estimateur qui est défini uniquement pour $\psi > 0$, c'est-à-dire dans le cas où la distribution des valeurs extrêmes correspond à une distribution de Fréchet. Le seuil, dans ce cas, correspond à la valeur à partir de laquelle la fonction de *Hill* est assimilable à une droite horizontale.

Implémentation

1. Commençons par simuler une *GPD* à l'aide de *rgpd* :

```
GP=rgpd(1000, 0.4, 0.9)
```

```
#GP=rgpd(1000, 0.30)
```

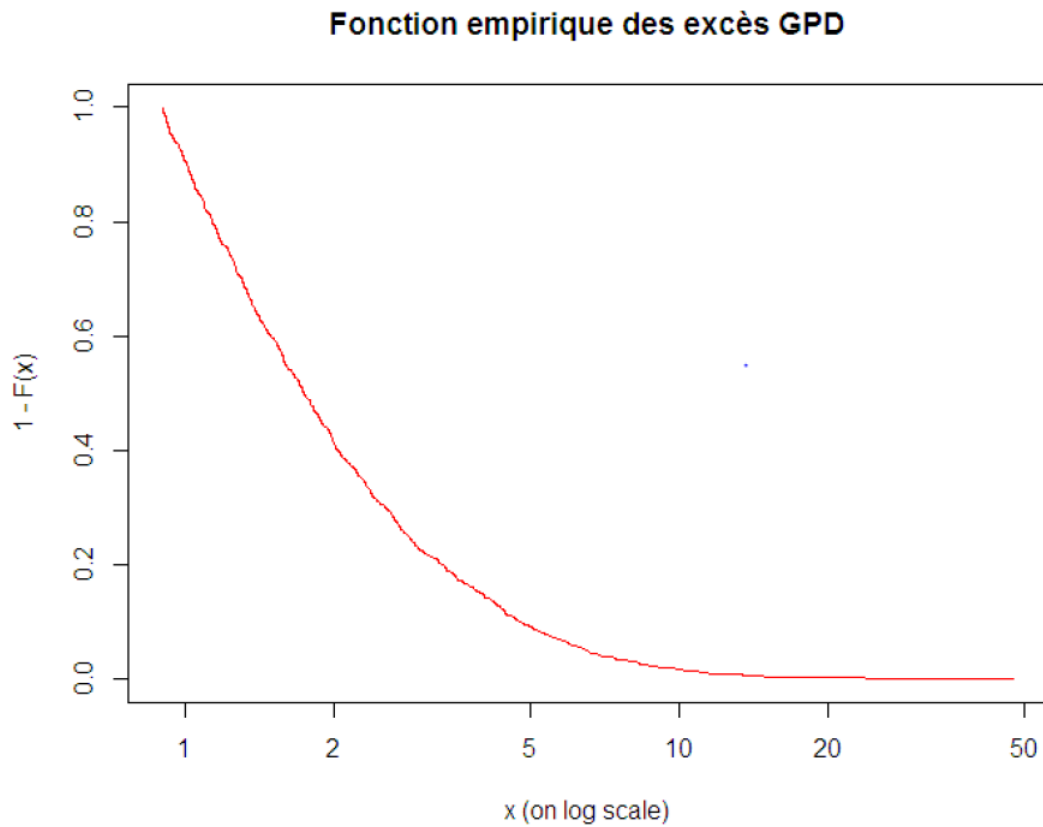
```
#GP=rgpd(500,0.4,0,1)
```

```
GP
```

2. On trace la fonction de survie empirique des excès à l'aide de la fonction *emplot* :

```
emplot(GP, type="l", main="Fonction empirique des excès GPD",  
col="red")
```

Le graphe obtenu est le suivant :



3. On utilise la fonction *gpd* pour calculer les estimateurs de γ et σ :

```
Estim_ml=gpd(GP,0 ,method = "ml")$par.ests  
Estim_pwm=gpd(GP,0 ,method = "pwm")$par.ests  
Estim_ml  
Estim_pwm
```

Par la méthode de maximum de vraisemblance

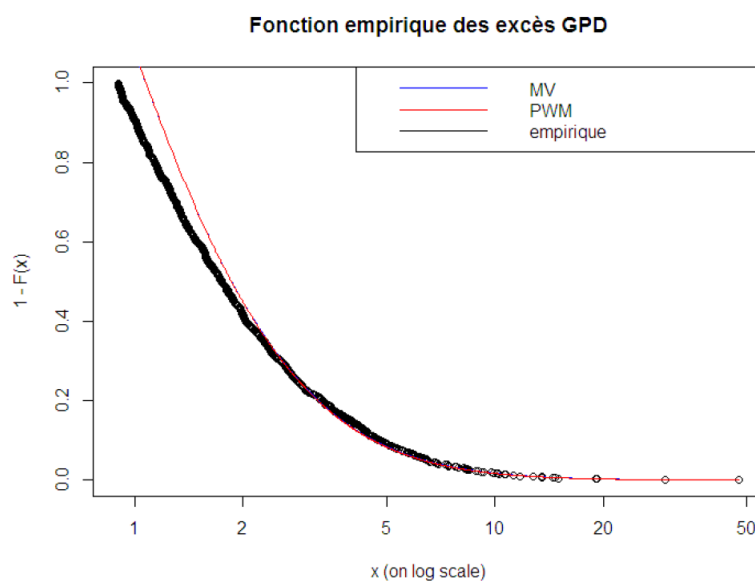
```
> Estim_ml  
xi      beta  
0.03114114 2.39842599  
  
> Estim_pwm  
xi      beta  
-0.5266072 3.7816527
```

2. Installation et chargement d'un package R

4. On trace les fonctions de survie des deux *GPD* estimés sur un même graphe :

```
fgpd=function (loi , x){  
  n=length (loi )  
  
  sigma_ml=gpd (loi , nextremes=n, method="ml")$par.ests [1]  
  gamma_ml=gpd (loi , nextremes=n, method="ml")$par.ests [2]  
  sigma_pwm=gpd (loi , nextremes=n, method="pwm")$par.ests [1]  
  gamma_pwm=gpd (loi , nextremes=n, method="pwm")$par.ests [2]  
  
  emplot (GP, main="Fonction empirique des excès GPD")  
  lines (x,1-pgpd (x ,sigma_ml ,gamma_ml) , col="blue " ,  
  main="Fonction  
de survie " ,type="l ")  
  lines (x,1-pgpd (x ,sigma_pwm ,gamma_pwm) , col="red ")  
  legend (legend=c ("MV" ,"PWM" ," empirique ") , " topright " ,  
  col=c (" blue " ," red " ," black ") , lty=c (1 ,1 ,1))  
}  
x=sort (GP)  
x=seq (x [1] ,x [length (x)] , 0.01)  
fgpd (GP, x)
```

Visualisation

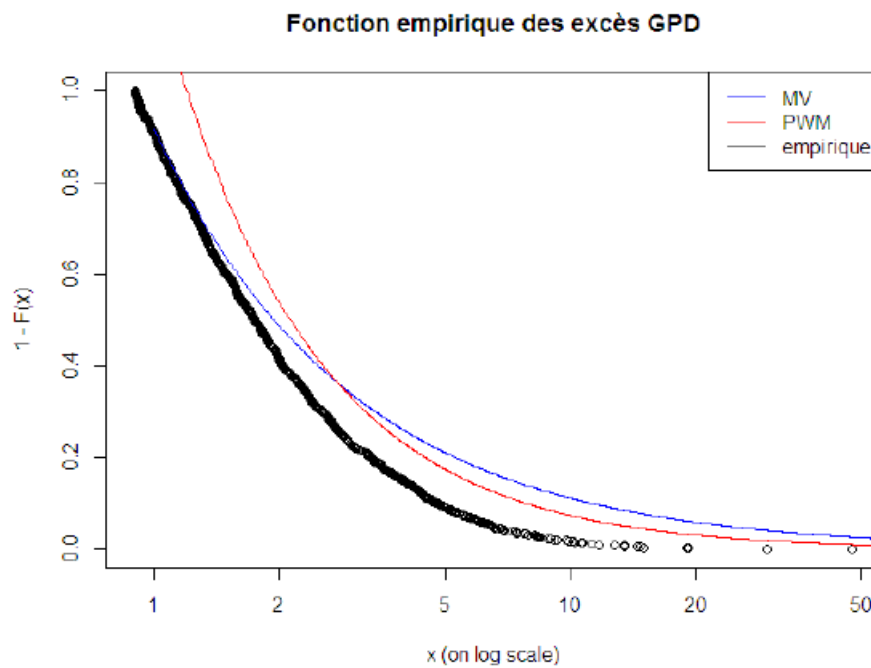


2. Installation et chargement d'un package R

5. Appliquons ceci à d'autres lois usuelles

Loi LogGamma :

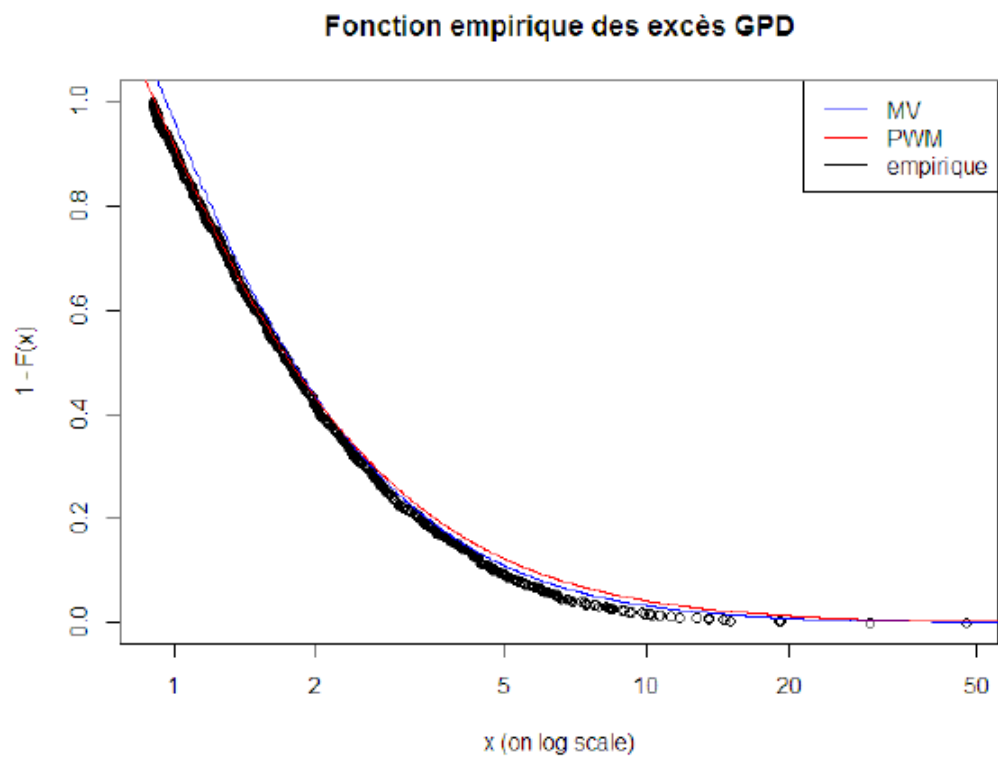
```
loggamma=rlgamma(1000,1,1)
x=sort(loggamma)
x=seq(x[1],x[length(x)], 0.01)
fgpd(loggamma,x)
```



2. Installation et chargement d'un package R

Loi Pareto :

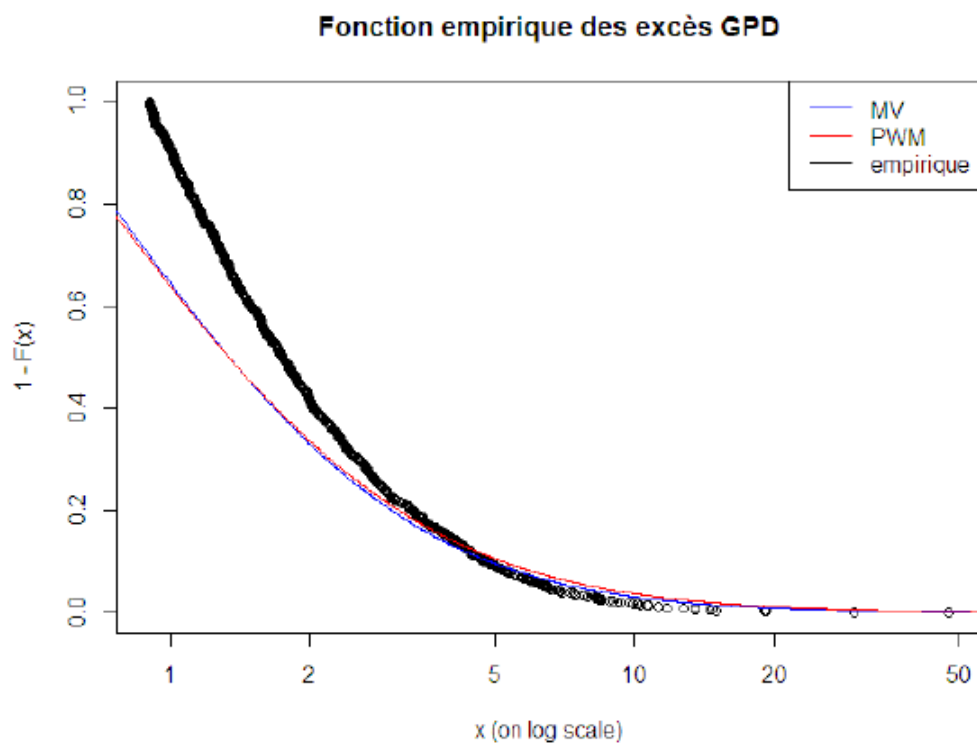
```
Pareto=rpareto(1000,2,2)
x=sort(Pareto)
x=seq(x[1],x[length(x)], 0.01)
fgpd(Pareto,x)
```



2. Installation et chargement d'un package R

Loi bur :

```
bur=rburrr(1000,1,1,2)
x=sort(bur)
x=seq(x[1],x[length(x)], 0.01)
fgpd(bur,x)
```



2. Installation et chargement d'un package R

6. On trace sur un même graphique les 3 estimateurs γ : *PWM*, *EMV*, *Hill*

```
f_hill=function(loi,n){
  ml=gpd(loi, nextremes=n, method="ml")$par.ests[1]
  pwm=gpd(loi, nextremes=n, method="pwm")$par.ests[1]
  #plot(ml)
  hill(loi, "xi", xlim=c(15,n))
  abline(h=ml, col="blue")
  abline(h=pwm, col="green")
  #dev.off()
  legend(legend=c("Hill", "MV", "Pwm"), "topright",
  col=c("black", "blue", "green"), lty=c(1,1,1))
  #legend(legend=c("MV", "PWM", "empirique"),
  "topright", col=c("red", "blue", "black"), lty=c(1,1,1))
}

#####Loi de Frechet #####
frechet=rfrechet(1000, loc=0, scale=1, shape=1)
f_hill(frechet,1000)

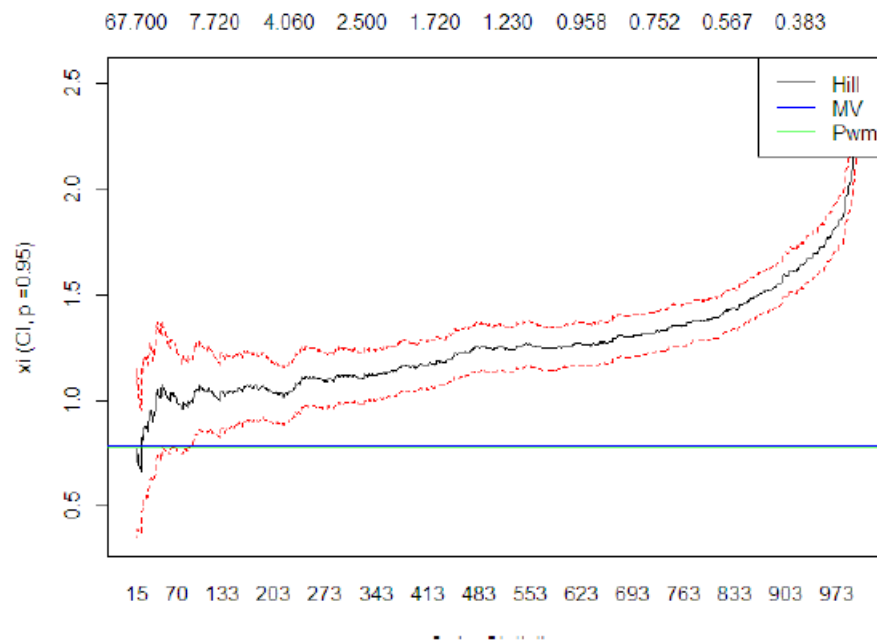
##### Loi log-gamma #####
loi=rlgamma(1000,55,5)
f_hill(loi,1000)

#####Loi pareto #####
Pareto=rpareto(1000,10,15)
f_hill(Pareto,1000)

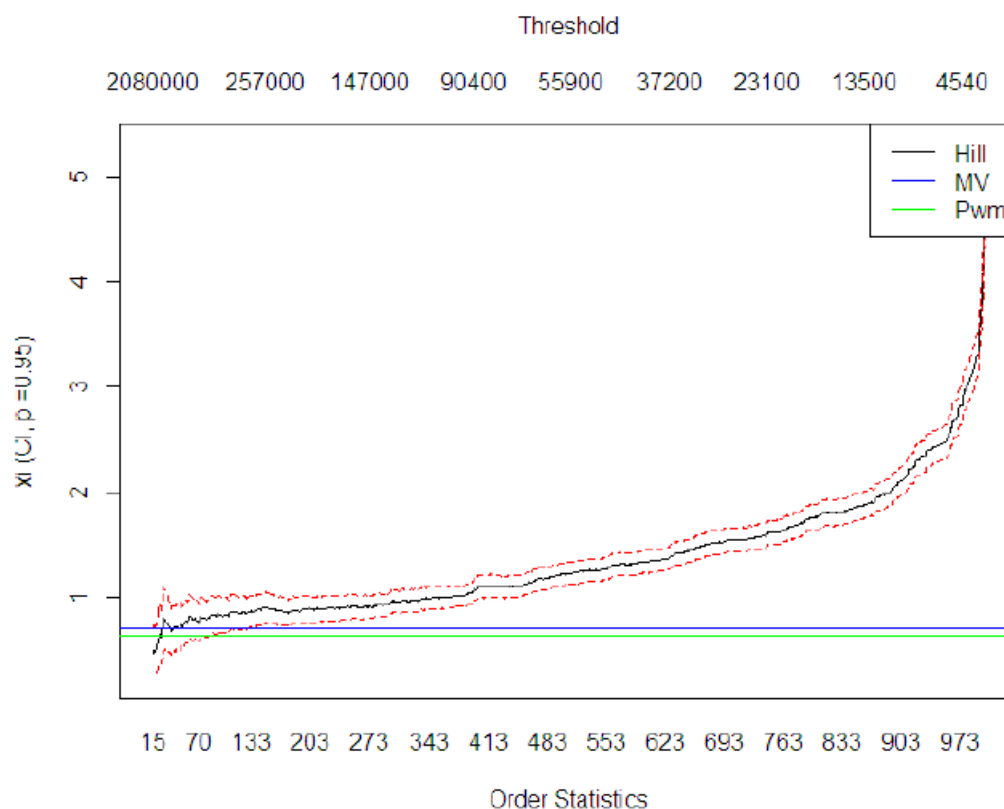
##### loi de Burr #####
bur=rburr(1000,1,1,2)
f_hill(bur,1000)

f_hill(nidd, length(nidd))
```

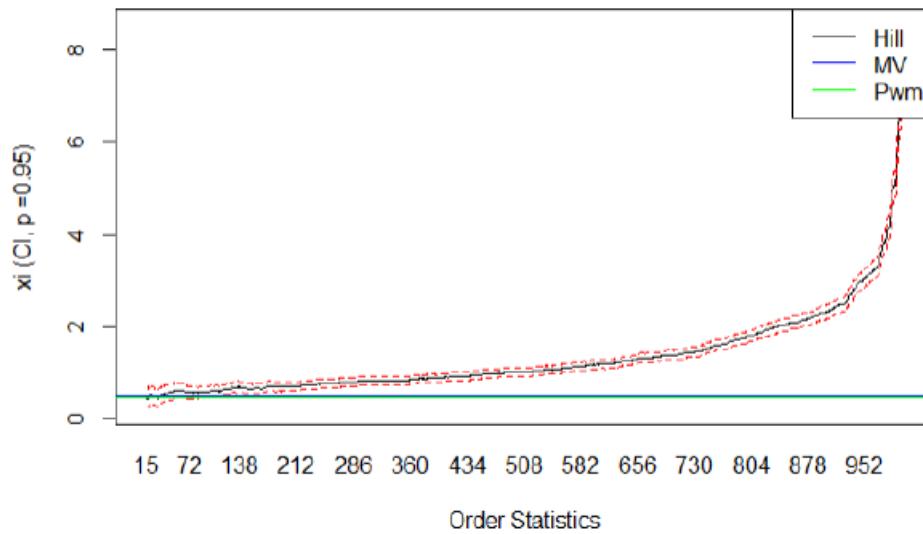
Loi Frechet :



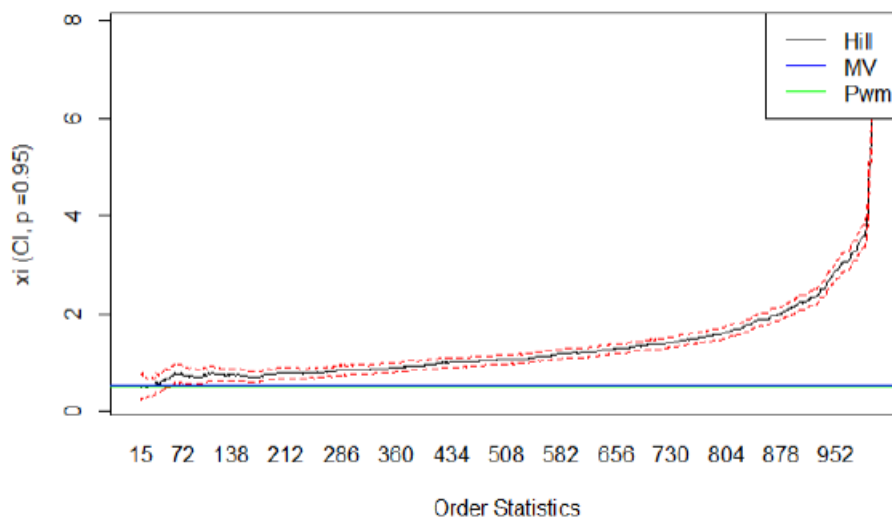
Loi log-gamma



Loi pareto



Loi bur



En conclusion, à partir des graphes obtenus précédemment, pour les lois considérées, la fonction *Hill* devient une droite horizontale aux environs de la valeur 260, est l'estimateur de *Hill* est proche de *EMV* et *PWM*. On peut donc considérer que le domaine d'attraction de la distribution des crues est *Frechet*.

3 Package RMiner : Data Mining Classification et Méthode de Regression

Rminer : kesako ?

Le package Rminer aide à la manipulation des données algorithmiques pour le data mining concernant la classification et la régression (incluant la prévision de series temporelles). Pour utiliser le package Rminer et ses fonctions :

- vérifier si le package est installé dans R ;
- sinon installer le package puis l'appeler avec la library

```
Install.packages(« rminer »)
```

```
Library(rminer)
```

Les fonctions de Rminer

Ci-dessous la liste des fonctions du package Rminer. Nous n'allons vous présenter que les fonctions qui nous semblent les plus pertinentes dans ce tutoriat.

Si vous souhaitez approfondir votre connaissance sur les autres fonctions, nous vous invitons à aller sur la documentation *R* du package : [Lien](#) Si vous souhaitez consulter l'aide, taper dans la commande *R* `(help(package=rminer))`

Liste des fonctions de Rminer

<i>CaseSeries</i>
<i>crossvaldata</i>
<i>delevels</i>
<i>holdout</i>
<i>Importance</i>
<i>imputation</i>
<i>lforecast</i>
<i>mgraph</i>
<i>mining</i>
<i>mmetric</i>
<i>mparheuristic</i>
<i>predict.fit</i>
<i>savemining</i>
<i>safri1</i>
<i>sin1reg</i>
<i>vecplot</i>

Ce tutoriat se concentra sur les fonctions suivantes du package Rminer qui peuvent être réparties dans 3 phases dans l'analyse des données :

- Data preparation : CasesSeries, delevels, imputation,
- Modeling : fit, predict, mining,
- Evaluation : mmetric, mgraph, mining

3.1 Data preparation : CasesSeries, delevels

CasesSeries : créer un data frame d'une série temporelle en utilisant la fenêtre glissante. Fenêtre glissante : (« sliding window ») : Fenêtre temporelle utilisée dans l'exploration des flots de données (« Data stream mining ») pour en extraire des motifs. Les fenêtres peuvent avoir une taille W fixe et la fouille de données s'effectue sur les W dernières transactions, ou sur les

3. Package RMiner : Data Mining Classification et Méthode de Regression

W dernières unités de temps, elles peuvent aussi avoir une taille variable, dans la détection de la dérive conceptuelle.

Exemple

```
> t=1:20
```

```
> d=CasesSeries(1:10,c(1,3,4))
```

```
> print(d)
```

```
[1] lag4 lag3 lag1 y
1    1    2    4  5
2    2    3    5  6
3    3    4    6  7
4    4    5    7  8
5    5    6    8  9
6    6    7    9 10
```

```
> d=CasesSeries(1:10,c(1,2,3))
```

```
> print(d)
```

```
[1] lag3 lag2 lag1 y
1    1    2    3  4
2    2    3    4  5
3    3    4    5  6
4    4    5    6  7
5    5    6    7  8
6    6    7    8  9
7    7    8    9 10
```

==> la fonction retourne un data frame où y est cible de l'output et les inputs sont le temps de latence

Delevels : réduire, remplacer ou transformer les niveaux du data frame et la variable du facteur.

```
> f=factor(c("A","A","B","B","C","D","E"))
```

```
> print(table(f))
```

```
[1] f
```

```
A B C D E
```

```
2 2 1 1 1
```

```
# remplacer "A" en "a":
```

```
> f1=delevels(f,"A","a")
```

```
> print(table(f1))
```

```
[1] f1
```

```
a B C D E
```

```
2 2 1 1 1
```

```
# combiner c("C","D","E") en "CDE":
```

```
> f2=delevels(f,c("C","D","E"),"CDE")
```

```
> print(table(f2))
```

```
[1] f2
```

```
A   B CDE
```

```
2   2   3
```

```
# combiner c("B","C","D","E") en _OTHER:
```

```
> f3=delevels(f,c("B","C","D","E"))
```

```
> print(table(f3))
```

```
[1] f3
```

```
A _OTHER
```

```
2       5
```

3.2 Modeling : fit, predict

Rminer comprend 14 méthodes de classification et 15 méthodes de régression, tout directement disponible à travers les facteurs *fit*, *predict*, *mining* .

Fit : la fonction ajuste un modèle sélectionné de jeux de données et peut automatiquement ajuster les hyperparamètres. Les hyperparamètres sont des paramètres réglables qui vous permettent de contrôler le processus d'entraînement du modèle.

Predict : la fonction donne un modèle ajusté et calcule les prédictions pour un jeu de données.

Les fonctions *fit* et *predict* proposent plusieurs modèles tels que :

- *rpart* (arbre de décision)

- randomForest
- lm (régression linéaire ou multiple)
- cv.glmnet : modèle linéaire généralisé.

Par défaut, le type du modèle Rminer (classification ou régression) dépend du type d'output.

- Si c'est un facteur (discret) alors c'est une probabilité de classification
- Si c'est numérique (int, num) alors c'est une régression qui est exécutée.

Voir tous les modèles de `fit` et `predict` : [lien fit](#) et [lien predict](#)

```
# Exemple qui montre comment la transformation fonctionne avec 'fit '  
et 'predict ':
```

```
M = fit(y~., data=sa_ssin, model="mr") # régression linéaire  
P = predict(M, data.frame(x1=-1000, x2=0, x3=0, x4=0, y=NA)) # P devrait  
être négatif  
print(P)  
[1] -0.4144042  
M = fit(y~., data=sa_ssin, model="mr", transform="positive")  
P = predict(M, data.frame(x1=-1000, x2=0, x3=0, x4=0, y=NA)) # P n'est  
pas négatif  
print(P)  
[1] 0
```

3.3 Evaluation : mmetric, mgraph, mining

Rminer comprend une large sélection de métriques d'évaluation et de graphes qui peut être utilisée pour évaluer la qualité des modèles ajustés et extraire les données apprises du modèle data-driven.

`Mmetric` : fonction qui calcule les erreurs métriques de classification ou régression. Ci-dessous les quelques mesures de mmetric :

- ALL : sort toutes les mesures de *mmetric*
- F1 score, [0 – 100%]

3. Package RMiner : Data Mining Classification et Méthode de Regression

- TPR (true positive rate) : c'est la sensibilité, correspondant au taux de vrais positifs, $[0 - 100\%]$
- PRECISION : la précision, c'est-à-dire le nombre de documents pertinents retrouvés rapporté au nombre de documents total proposé pour une requête donnée
- ACC : taux d'exactitude de classification, $[0 - 100\%]$
- ACCLASS : taux d'exactitude de classification par classe, $[0 - 100\%]$
- TPR (true positive rate) : c'est la sensibilité, correspondant au taux de vrais positifs, $[0 - 100\%]$.

Voir tous les modèles de `mmetric` : [lien](#)

Exemple

```
> y=factor(c("a","a","a","a","b","b","b","b"))
> x=factor(c("a","a","b","a","b","a","b","a"))
> print(mmetric(y,x,"CONF")$conf)
[1]  pred
target a b
a 3 1
b 2 2
> print(mmetric(y,x,metric=c("ACC","TPR","ACCLASS"))
[1] ACC      TPR1      TPR2 ACCLASS1 ACCLASS2
62.5      75.0      50.0      62.5      62.5
> print(mmetric(y,x,"ALL"))
[1]  ACC      CE      BER      KAPPA    CRAMERV  ACCLASS1
ACCLASS2  BAL_ACC1
62.5000000 37.5000000 37.5000000 25.0000000 0.0000000 62.5000000
62.5000000 62.5000000
BAL_ACC2      TPR1      TPR2      TNR1      TNR2 PRECISION1
PRECISION2      F11
62.5000000 75.0000000 50.0000000 50.0000000 75.0000000 60.0000000
66.6666667 66.6666667
F12      MCC1      MCC2
57.1428571 0.5163978 0.5163978
```

3. Package RMiner : Data Mining Classification et Méthode de Regression

Sin1reg : un simple jeu de données avec 1000 points où $y = 0.7 * \sin(\pi * x1/2000) + 0.3 * \sin(\pi * x2/2000)$

Mgraph : fonction graphique

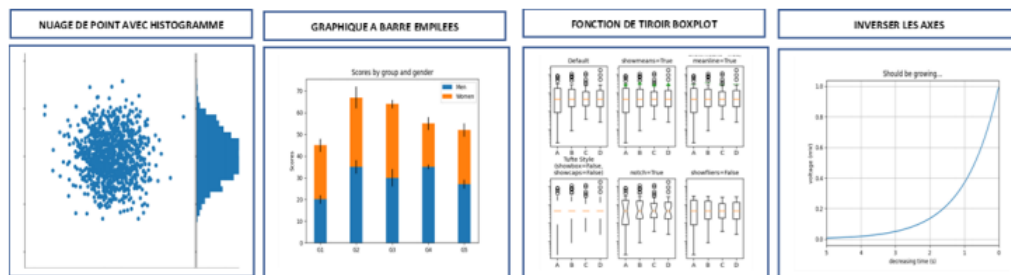
Mining : la fonction réalise plusieurs exécutions ajustées et de prédictions, selon une méthode de validation et donne un nombre d'exécutions.

```
# Exemple de régression avec les fonctions sin1reg , mgraph et mining
data(sin1reg)
M1=mining(y~., sin1reg[,c(1,2,4)], model="mr", Runs=5)
M2=mining(y~., sin1reg[,c(1,2,4)], model="mlpe", nr=3, maxit=50, size=4,
Runs=5, feature="simp")
L=vector("list",2); L[[1]]=M2; L[[2]]=M1
mgraph(L, graph="REC", xval=0.1, leg=c("mlpe", "mr"), main="REC curve")
mgraph(L, graph="DLC", metric="TOLERANCE", xval=0.01,
leg=c("mlpe", "mr"), main="DLC: TOLERANCE plot")
mgraph(M2, graph="IMP", xval=0.01, leg=c("x1", "x2"),
main="sin1reg Input importance", axis=1)
mgraph(M2, graph="VEC", xval=1, main="sin1reg 1-D VEC curve for x1")
mgraph(M2, graph="VEC", xval=1,
main="sin1reg Courbe et histogramme pour x1", data=sin1reg)
```

4 Package graphics R

4.1 Introduction

Le logiciel *R* est l'un des logiciels incontestablement reconnus pour ses graphiques tels que les bandes linéaires, les bandes en pointillé ou même les bandes de nuages, ...



R a intégré des bibliothèques qui offrent un excellent support graphique. L'installation *R* contient trois packages importants :

1. les graphiques
2. les treillis
3. la grille

Ces packages fournissent des outils pour dessiner une grande variété de tracés et de formes. De plus, de nombreux packages externes tels que `ggplot2` peuvent être téléchargés dans *R*.

QU'EST-CE QUE LE BUT D'UN GRAPHIQUE

- Mieux comprendre le problème
- Mieux expliquer un phénomène
- Le but est de nous aider à rendre une situation abstraite en information convaincante.

Pour faire ces graphiques, le logiciel "*R*" a mis à disposition un package à cet effet qui, de par ces multiples commandes met en exécution une fonction de tracé.

Nous allons donner une brève description de ces trois packages en mettant un accent particulier sur la commande "*PLOT*" ci-dessous.

4.2 Description et installation d'un package graphics *R*

La bibliothèque graphique est le package graphique de base standard fourni avec l'installation *R*. Cette bibliothèque a été développée à l'origine pour *R*. De nombreux tracés standard

4. Package graphics R

tels que des tracés de base de points et de lignes, des histogrammes, des graphiques à barres, des camemberts, des bplots, etc. peuvent être dessinés avec cette bibliothèque.

À toutes fins pratiques, la bibliothèque graphique est suffisamment silencieuse pour créer des tracés et des graphiques d'excellente qualité que nous utilisons généralement pour l'analyse des données et des statistiques.

Ce package est fourni avec l'installation de *R*.

Le paquet de grille

Le système graphique de grille a ensuite été développé par Paul Murrel et ajouté à *R*. Il s'agit d'un système graphique de bas niveau qui permet de dessiner et d'organiser des formes géométriques de base telles que des polygones, des courbes, des images raster, etc. Le paquet de grille contient des fonctions pour accéder au canevas et permet la création de plusieurs régions appelées fenêtres sur une seule toile.

Ce package est fourni avec l'installation *R*. Nous devons charger la bibliothèque de grille dans *R* avant de l'utiliser. (Le package graphique se charge automatiquement lorsque nous démarrons *R*).

Pour charger la bibliothèque de grille dans *R*, tapez

```
bibliothèque("grille")
```

Le paquet lattice

Le treillis, développé par Deepayan Sarkar, est un système de visualisation de haut niveau basé sur une méthode appelée graphique en treillis. Ce package gère très efficacement les données multivariées.

Le package lattice se compose de fonctions de haut niveau pour chaque tâche. Ces fonctions renvoient des objets qui peuvent être convertis en graphiques par les fonctions `plot()` du package *R* de base. Ce package est basé sur le moteur graphique de grille mentionné ci-dessus.

Ce package est également fourni avec l'installation de *R* et nécessite le chargement du package `grDevices`.

Pour charger la bibliothèque `grDevices` dans *R*, tapez

```
bibliothèque("grDevices")
```

Le paquet ggplot2

Le `ggplot2` est une bibliothèque graphique pour *R*, créée par Hadley Wiskham. Il est mentionné dans sa page d'accueil que "`ggplot2` est un système de traçage pour *R*, basé sur la grammaire des graphiques, qui essaie de prendre les bonnes parties des graphiques de base et de treillis et aucune des mauvaises parties". (Le *Grammar of Graphics* mentionné ici est un livre classique sur les méthodes graphiques pour la visualisation de données scientifiques écrit par Leyland Wilkinson).

Nous pouvons créer des parcelles très élégantes avec cette bibliothèque.

Le `ggplot2` est un package externe qui doit être téléchargé de l'intérieur *R*. Pour installer ce package en ligne à partir de l'invite *R*, tapez

```
install.packages("ggplot2")
```

4.3 Applications

R avec `plot()`, `points()`, `lines()`, `polygon`

La fonction `plot()` trace les points et les lignes.

Les tracés de points et de lignes peuvent être produits en utilisant la fonction `terrain()`, qui prend les points x et y sous forme de vecteurs ou de nombre unique avec de nombreux autres paramètres. Les paramètres x et y sont nécessaires. Pour d'autres, la valeur par défaut sera utilisée en l'absence de la valeur. Dans les lignes de commande ci-dessous, nous créons d'abord une paire de séquences x et y et les passons en paramètres à la fonction `terrain()`.

4. Package graphics R

Commande d'exécution de plot avec un graphique en nuage de point

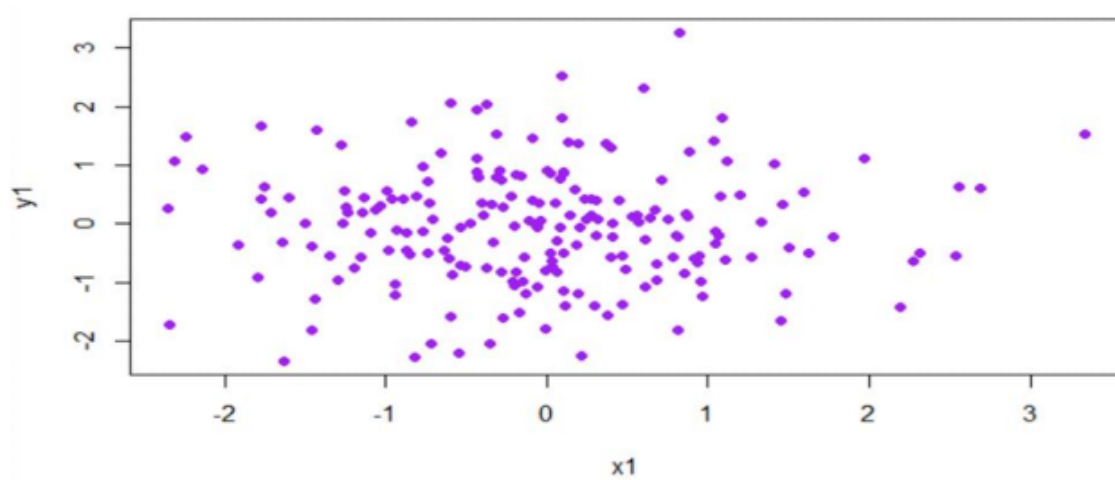
#Comment représenter graphiquement la commande plot avec des nuages de points

```
x1<-rnorm(200,mean = 0, sd=1)
```

```
y1<-rnorm(200,0,1)
```

```
plot(x1,y1,pch=16,col="purple")
```

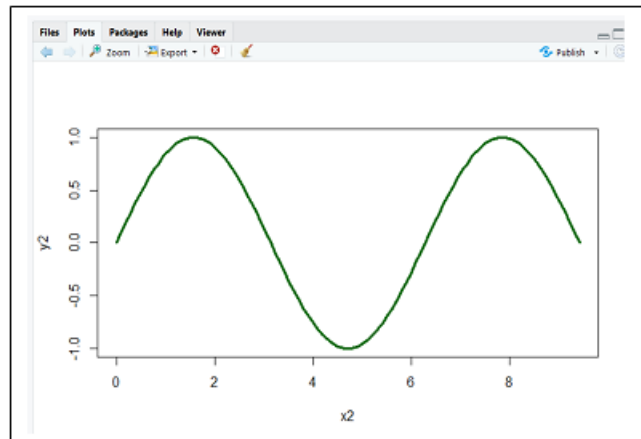
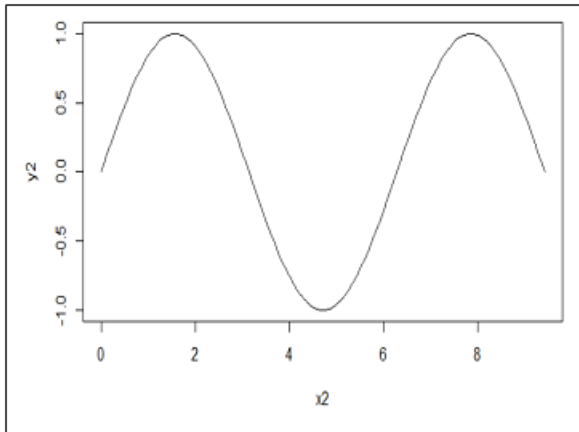
Résultat de l'application avec plot (Graphique nuage de point)



4. Package graphics R

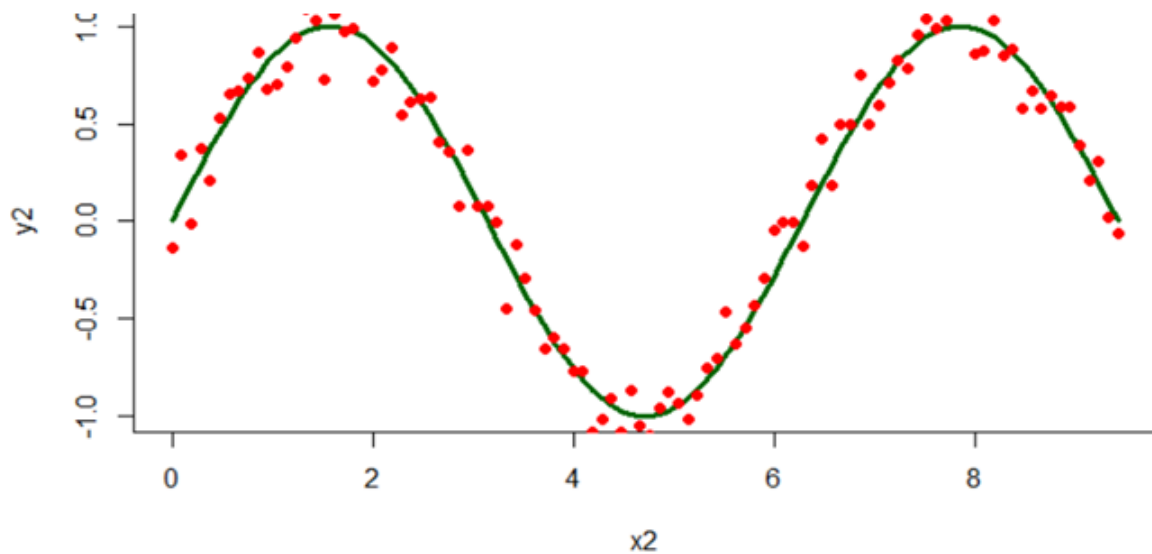
Commande d'exécution de plot avec un graphique en ligne

```
x2<-seq(0,3*pi,len=100)
y2<-sin(x2)
plot(x2,y2,type="l")
plot(x2,y2,type="l",lwd=3,col="darkgreen")
```



Exemple de graphique en pointillé pris aléatoirement

```
y2.rand<-y2+rnorm(100,0,0.1)
points(x2,y2.rand,pch=16,col="red")
```



♣ Bibliographie ♣

- [1] Site le CRAN *https://cran.r-project.org/web/packages/available_packages_by_name.html*
available-packages-E
- [2] *<https://cran.r-project.org/web/packages/>*
- [3] Sidney I. Resnick *Extreme Values, Regular Variation and Point Processes*
- [4] Stuart Coles *An Introduction to Statistical Modeling of Extreme Values*
- [5] Laurens de Haan *Extreme value theory*
- [6] *Documentation R sur Rminer*
- [7] Cortez, P. (2010). *Data Mining with Neural Networks and Support Vector Machines using the R/rminer Tool*. In Perner, P., editor, *Advances in Data Mining Applications and Theoretical Aspects, 10th Industrial Conference on Data Mining*, pages 572583, Berlin, Germany. LNAI 6171, Springer.
- [8] *Wikipedia*