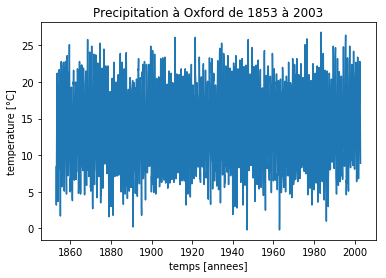
Projet d’estimation robuste :

Moindres Carrés et Ransac

Mannaïg L’Harridon et Iris de Gelis

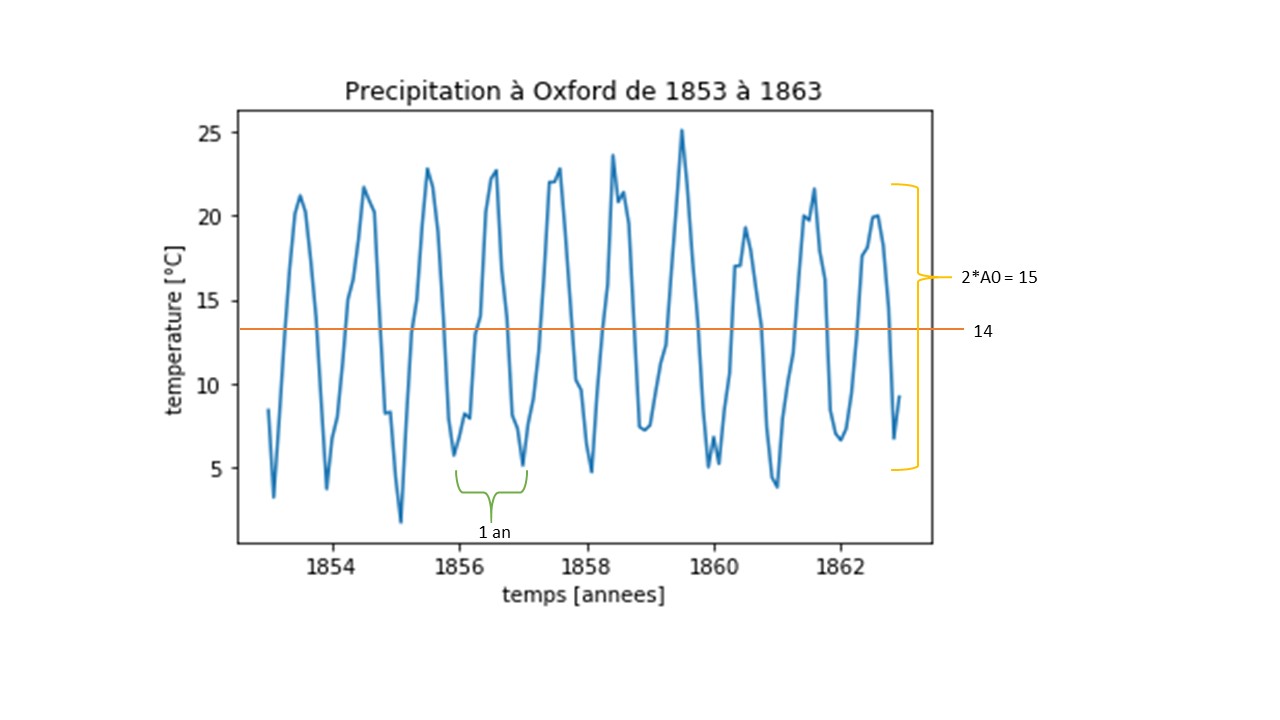
1. Présentation des données
2. Les données



1. Le modèle
2. Conditions initiales

Pour le modèle choisi les conditions initiales ont été choisies en regardant les tracés des observations. En effet, pour une simple sinusoïde, il est facile d’approximer l’amplitude, la période, et la constante. En regardant, les données sur 10 ans, on peut avoir un a priori sur les valeurs de l’amplitude, de la période et de la constante. D’après la figure ci-dessous, on a pris :

* **Amplitude** : 2\*A0 = 15 => A0 = 7.5 par lecture
* **Omega** : La période des oscillations à priori est d’un an, donc T = 1 an. Or ω = 2\*π/T. Ainsi on a pris ω = 2\* π
* **Constante** : 14 par lecture graphique

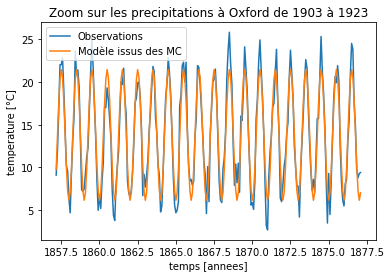


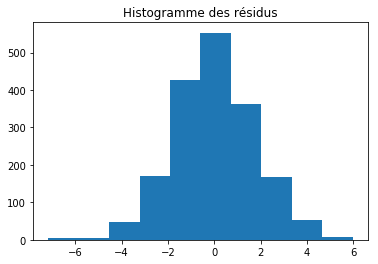
Pour la phase, nous avons testé avec une condition initiale de 0.

1. Moindres Carrés
2. Basique

Une première estimation par moindres carrés a été faite. Le paragraphe ci-dessous présente les résultats.

Paramètres obtenus





Sigma0\_2

Test chi2

Var covar paramètre

1. Elimination des points

Explication.

Paramètres obtenus

IMAGE MODELE

HISTOGRAMME

Sigma0\_2

Test chi2

Var covar paramètre

Amelioration par rapport MC normal

1. RANSAC
2. La méthode RANSAC et ses paramètres

La méthode d’optimisation Random sample consensus (RANSAC) est une méthode d’optimisation se basant sur la méthode des moindres carrés appliqués à un ensemble de points tiré aléatoirement. Ensuite, on évalue ce modèle en fonction du nombre de points de l’ensemble total correspondant à ce modèle à un seuil près. Le modèle correspondant au plus de points possibles est alors sélectionné.

Paramètres :

* **Nombre de points de l’échantillon test :** Le nombre de points dans l’échantillon test est choisi par rapport au théorème de Shannon. En effet, le théorème de Shannon, précise que la représentation discrète d'un signal exige des échantillons régulièrement espacés à une fréquence d'échantillonnage supérieure au double de la fréquence maximale présente dans ce signal. Or ici fréquence est d’environ 1/12, si on compte la période en mois. Donc la fréquence d’échantillonnage doit être supérieur à 2/12, soit 1/6. Ainsi au minimum, il faut prendre un point tous les 6 mois. Sachant qu’il n’y a pas de données manquantes, le théorème de Shannon nous indique de prendre 150\*12/6 = 300 points.
* **Nombre d’itération K :** Pour avoir le plus de chance de tomber sur le meilleur modèle, nous avons décidé d’itérer la méthode de RANSAC sur un assez grand nombre de fois. K = 100
* **Seuil de sélection d’un point considéré comme valide au modèle t :** C’est au regard des résidus, que le seuil t a été choisi. Le seuil t a été fixé à 2°C car cela signifie qu’environ 90% des observations sont sélectionnées. De plus par logique c’est normal d’avoir des fluctuations de quelques degrés d’une année sur l’autre.
* **Seuil T :** Ce seuil est fixé à 98% du nombre donné pour validé automatique un tirage qui serait très bon pour générer un modèle le plus proches des données.

1. Résultats

IMAGE MODELE

HISTOGRAMME

Sigma0\_2

Test chi2

Var covar paramètre

1. Conclusion