

범주형 시계열 자료분석팀

정희철 김민서 이주형 심수현



01 미래 기상 예측

02 이상치 탐지

03 호우/태풍 이진분류

04 피해액 예측 모델

05 지역별 리스크 분석



2주차 요약 - 최종 분석 흐름

1

각 기상 변수에 대해 상한값 또는 하한값 예측 (worst case scenario) 2

예측된 기상상황으로 호우/태풍이 있는 날과 없는 날 이상치 탐지 3

이상치로 분류된 날짜에 한해 호우/태풍 이진분류 4

분류 후 각 조건에 따라 **피해액 예측** 5

피해액에 따른 지역별 시설 별 리스크 분석

미래 기상 예측



최종 예측에 사용할 기상 데이터



평균 기온, 운량, 총 강수량



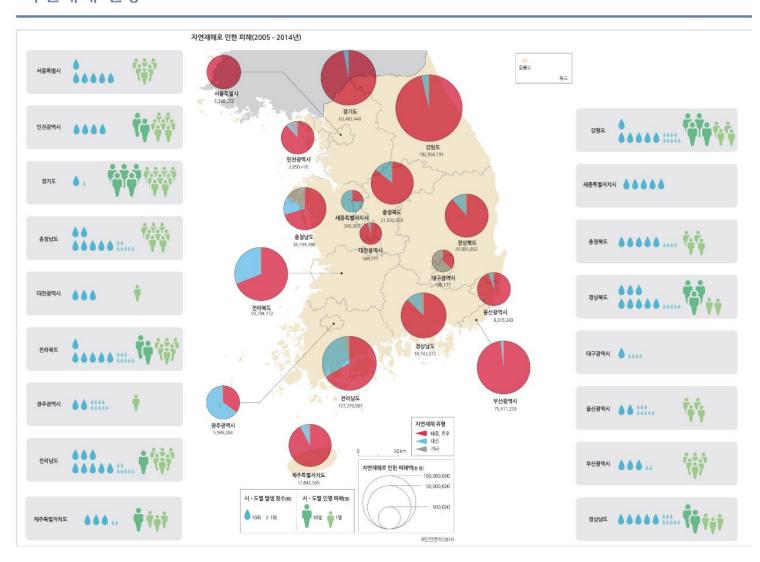
-0.507(합성 풍향) - 0.505(최고 풍속 풍향) - 0.499(최고 순간 풍속 풍향) - 0.489(최다 풍향)



-0.51(평균 풍속) - 0.505(최고 풍속) - 0.497(최고 순간 풍속) - 0.488(합성 풍속)

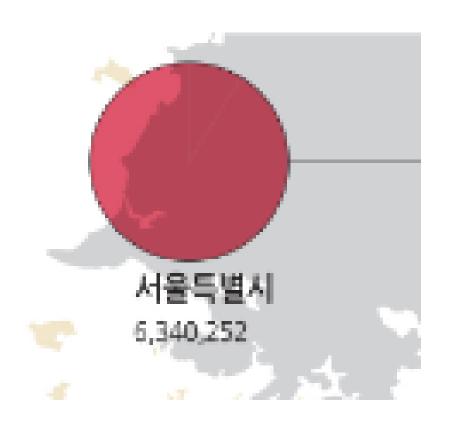
미래 기상 예측 - 지역선정

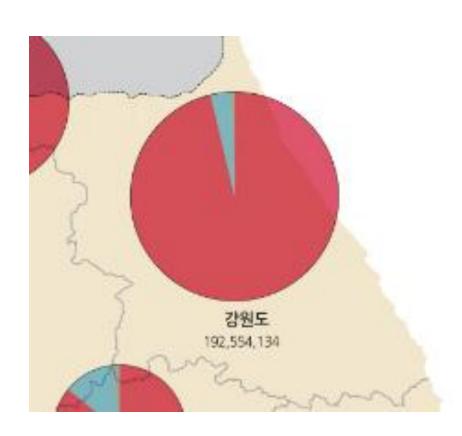
자연재해 현황

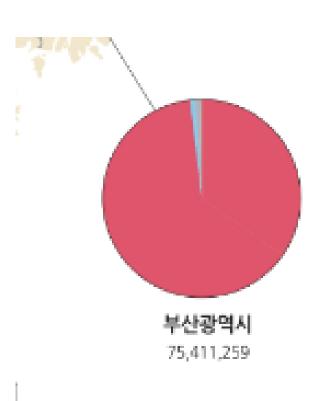


대한민국 국가지도집에 기록된 자연재해 현황을 기준으로 지역 선정

미래 기상 예측 – 지역선정

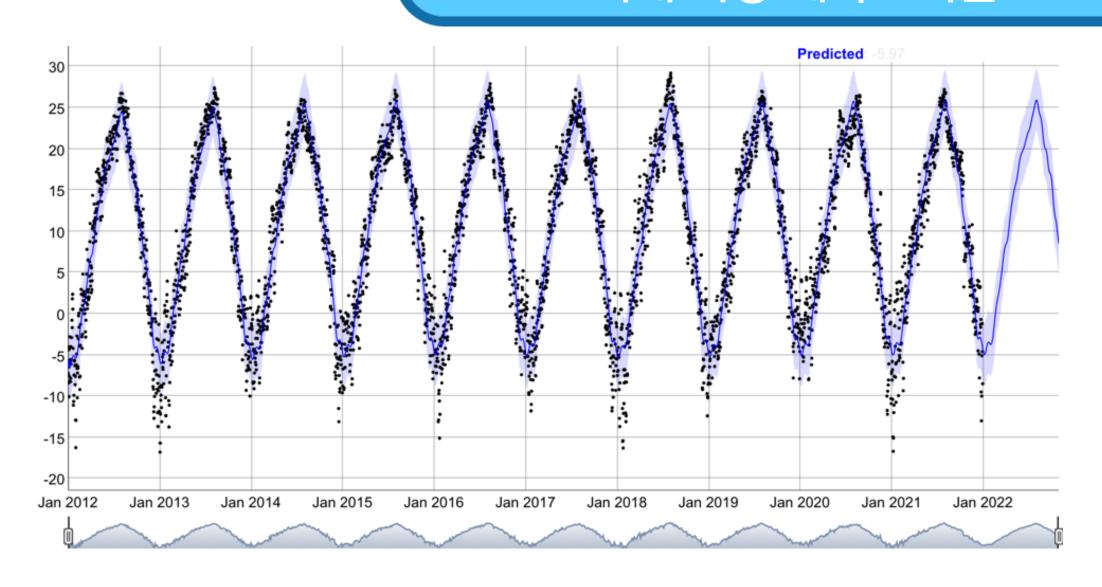






호우 피해가 100%인 서울과 호우 피해의 비중이 매우 높은 강원, 부산으로 기상 예측 지역을 제한

미래 기상 예측 - 기온



changepoint prior scale: 0.5

seasonality prior scale: 15

yearly seasonality: 20

MAE: 2.082

yhat으로 추출

Prophet 모델을 이용하여 grid search 진행 후 모델 예측 -> 추세와 경향성을 비슷하게 따라감을 확인하여 예측 모델로 사용 결정

• 미래 기상 예측 - 풍향, 풍속, 운량 •

퍙

changepoint prior scale: 0.1

seasonality prior scale: 8

yearly seasonality: 20

MAE: 113.16

That lower로 주를

器

changepoint prior scale: 0.5

seasonality prior scale: 15

yearly seasonality: 20

MAE: 1.38

Yhat lower로 주출

운량

changepoint prior scale: 0.5

seasonality prior scale: 8

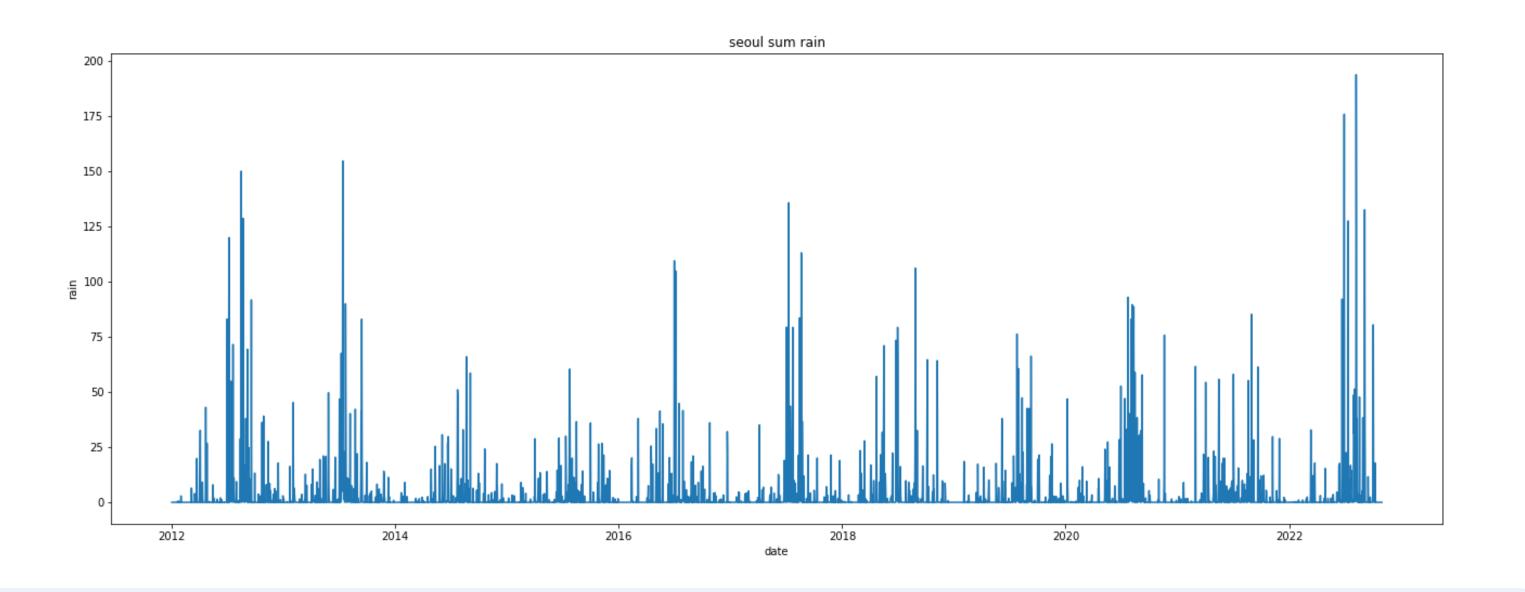
yearly seasonality: 20

MAE: 2.42

That upper로 추출

사용해 본 모델 중 계절성을 가장 잘 반영하는 모습을 보인 Prophet 모델로 grid search 진행 후 각 변수에 대한 미래 값 예측하여 추출

미래 기상 예측 – 총 강수량



총 강수량 변수 그래프 확인 결과 분산이 매우 크고 이분산성도 확인 가능

미래 기상 예측 - 총 강수량



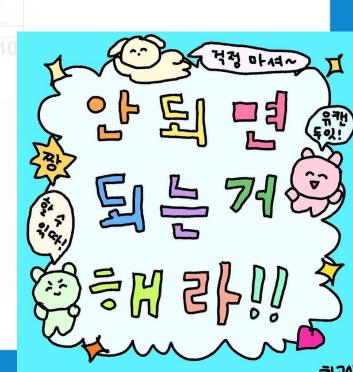


GEV – Types of Distributions

lemperature

강수량의 경우..

- 1. 계절성이 명확하나 매우 큰 분산을 가짐
- 2. 예측 기간을 늘리면 예측값의 불안정성이 증가
 - 3.. 예측 모델의 유의성이 낮아지는 결과 야기
- -> 극단적으로 큰 강수량을 강수 분포의 극값으로 보고 Extreme Value Theory를 적용해보자!



미래 기상 예측 - 총 강수량



Extreme Value Distribution of & Gumbel Distribution? 48



$f(x;\eta,\theta) = \frac{3}{2} \frac{3}{2} \frac{3}{2} \frac{3}{2} \frac{1}{2} \frac{1}{2}$

1. Invariance Property of MLE를 사용

-> location parameter η와 scale parameter θ를 추정

$$E(x) = \eta + \epsilon\theta$$
, Var_2 (추정된 parameter를 이용 $\eta = \epsilon\theta - E(x)$

-> 각 일자에 대하여 Gumbel분포 추출

미래 기상 예측 – 총 강수량



Extreme Value Distribution of & Gumbel Distribution 2 AFB

month		day	12	13	14	15	16	17	18	19	20	21				
1	1	1	0.1436781	1.10568182	0.02247191	0	0	0	0	0	0	0				
2	1	2	0.05862069	0.54772727	0	0	0	0.01724138	0	0	0	0				
3	1	3	0.0459770	0	0	0	0	0	0	0	0	0			\	
4	1	4		0.00113636	2.99157303	0	0	0	0	0	0	0.01590909		_	Δ	
5	1	5	0.0058823	0.00568182	0.00561798	0.22359551	0	3.07613636	0	0	0	0.02784091		가조	_	
6	1	6		0	0	1.43483146	0	0.13522727	0	0	0.4247191	0.24886364				
7	1	7	(0	0	0	0	0.03977273	0	0	50.7966292	0.28295455				
8	1	8		0	0	0	0	1.67159091	0.46516854	0	18.1078652	0		71	<u> </u>	toll CHO
9	1	9		0	0	0	0	0.30454545	0.10337079	0	0.00674157	0		E		_
10	1	10		0	0	0	0.00561798	0	0.03146067	0	0	0				1,5-7
11	1	11		0	0	0.44606742	0	0	0	0	0	0	x-1	η) $\begin{bmatrix} 1 \\ 0 \end{bmatrix}$	7个5	관측지를
12	1	12	(0.13636364	0	0	0	0.0125	0	0.48426966	0	0.11022727		<u> </u>	. , .	- (
13	1	13	(0	0	0	0.03483146	0.02045455	0	0	0	0.00795455	Ω			1 1110 1 7
14	1	14	(0.16477273	0	0	0.00674157	0	0	0	0	0	U		U	HZH2+ 7
15	1	15	(0.03977273	0	0.48764045	0.07078652	0	0.03932584	0.00224719	0	0.42386364				
16	1	16	0.05172414	0.25	0	0.22134831	0.01011236	0	0.09101124	0.0011236	0	0				
17	1	17	0.1494252	5.00795455	0.0011236	0	0.14719101	0	1.0011236	0.0011236	0.82134831	0.01363636				
18	1	18		0	0	1.22022472	0.20674157	0	0	0	2.0258427	1.02840909			2	321 154 =
19	1	19	5.05340909	0	0	0.51685393	0	0	0	0	0.19775281	0				
20	1	20	3.59886364	0	1.59550562	0	0	7.29204545	0	0	0	0				1/.
21	1	21	1.00681818	17.3137931	3.93033708	0.11235955	0	0.03295455	0	0.00674157	0.00561798	1.5625				
22	1	22	0.1647727	5.61724138	0.00561798	3.99662921	0	0.20227273	2.09438202	0	0	0.45340909				
		$\chi) =$	= η -	- Εθ,	Var	(x)		- ,	$\theta =$		π	,	$\eta =$	$\epsilon\theta$	—	E(x)



같은 날에 대한 총 10년 간의 x -n) 강수량 관측지를 보고 판단하여 아라와 같이 값 秀

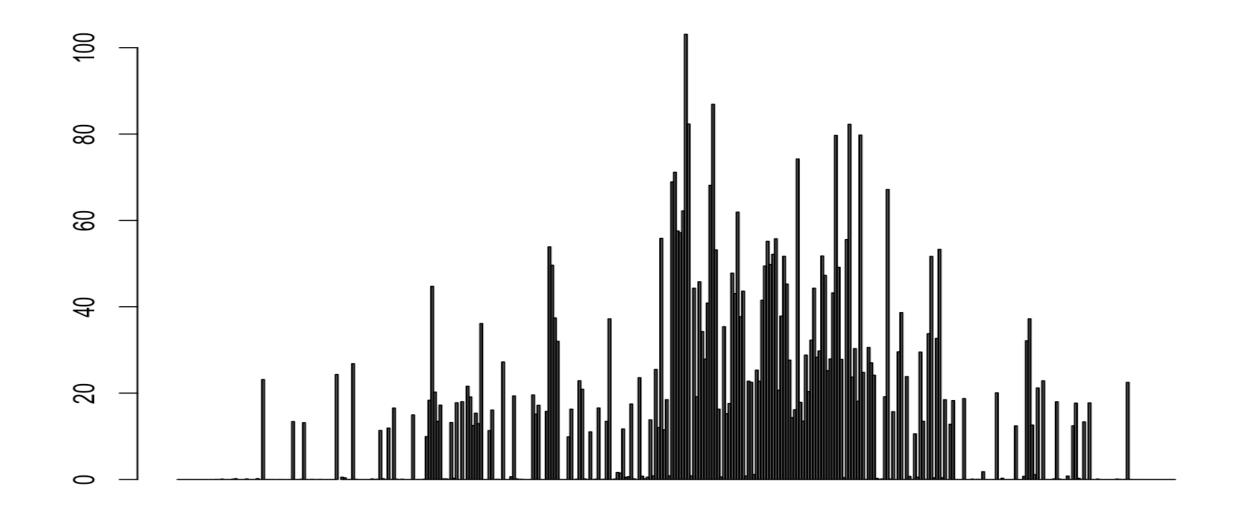


- 만약 10개의 관측치 중 강수량이 4.5 이상인 값이 1개 이하일 경우, 중간값 추출
 - 그 외의 경우, 각 일자에 대하여 Gumbel($\hat{\eta}$, $\hat{\theta}$)의 95-분위수 추출

미래 기상 예측 – 총 강수량



최종 강수량 예측





이상치 탐지

Stray Algorithm Isolation Forest VAR21 7본적인 구조는 시개(열팀 3주차 교안을 참고하다구서)요!

VAR

● 이상치 탐지 – Stray Algorithm



Stray Algorithm

KNN distance with the maximum gap 개념을 사용해이상치 탐지 및 anomalous score까지 제공해 해석력을 갖춘 알고리즘

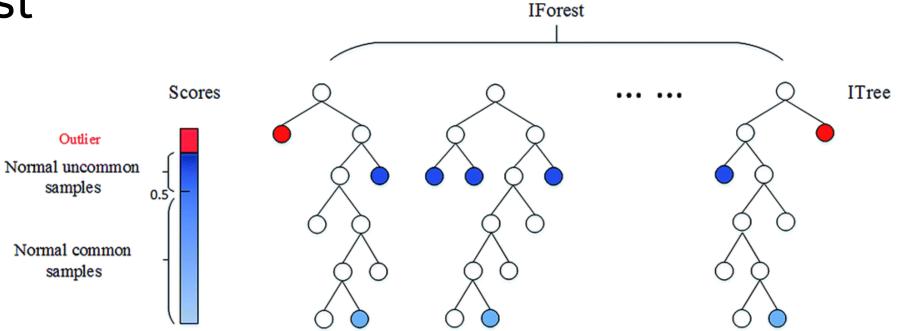




multimodal distribution이나 masking problem에 효과적으로 대응!

이상치 탐지 – Isolation Forest



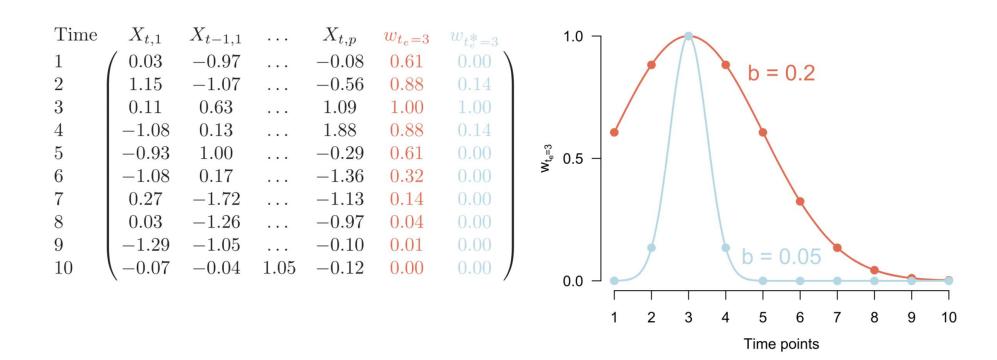


Decision Tree에서 파생된 모델로 비정상 데이터를 Tree의 가장 가까운 깊이에서 고립되게 만드는 모델 특정한 샘플이 고립되는 leaf 노드까지의 거리를 Outlier Score로 정의 Root 노드까지의 평균거리가 짧을수록 Outlier Score가 높아지는 원리

이상치 탐지 – Isolation Forest



VAR Anomaly Detection



VAR 구조를 응용한 이상치 탐지 모델

Squared errors의 평균과 표준편차를 더한 값을 Anomalous Threshold로 설정 예측치의 squared error가 **threshold보다 크거나 같다면 이상치로 분류**

이상치 탐지 - 성능비교



✓ F1 score 비교

Stray Algorithm

VAR

부산: 0.866

Isolation Forest

서울: 0.988

강원: 0.985

부산: 0.988

<u>압도적인 성능을 보인서울</u>: 0.875

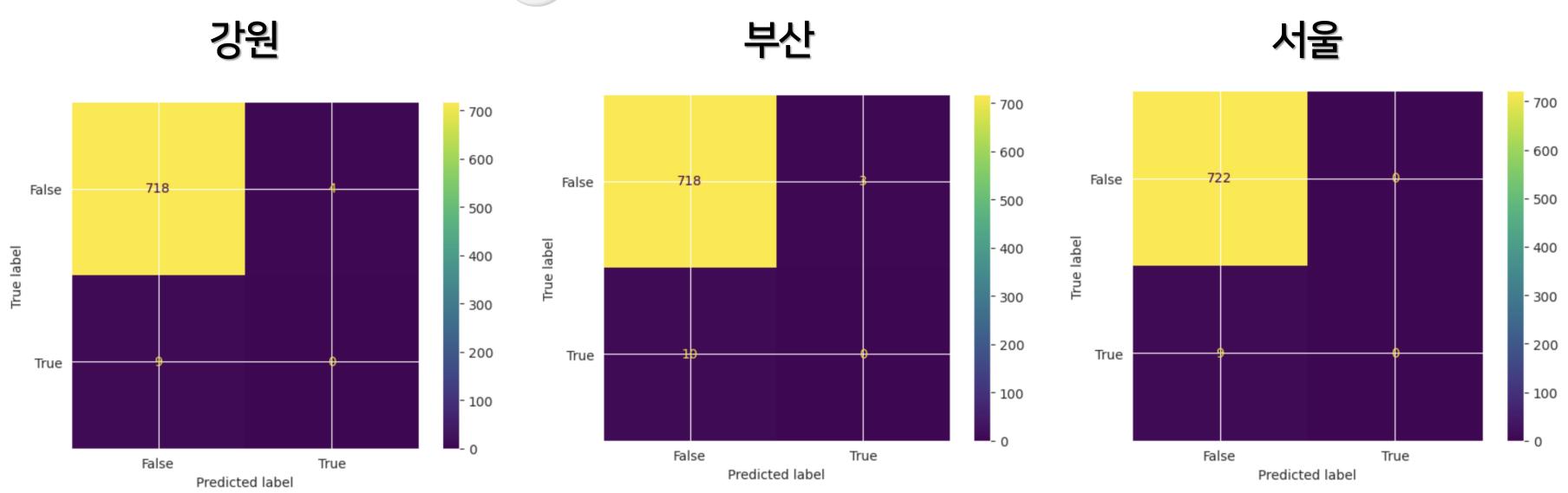
분류해 의미 없음 lation Forest를

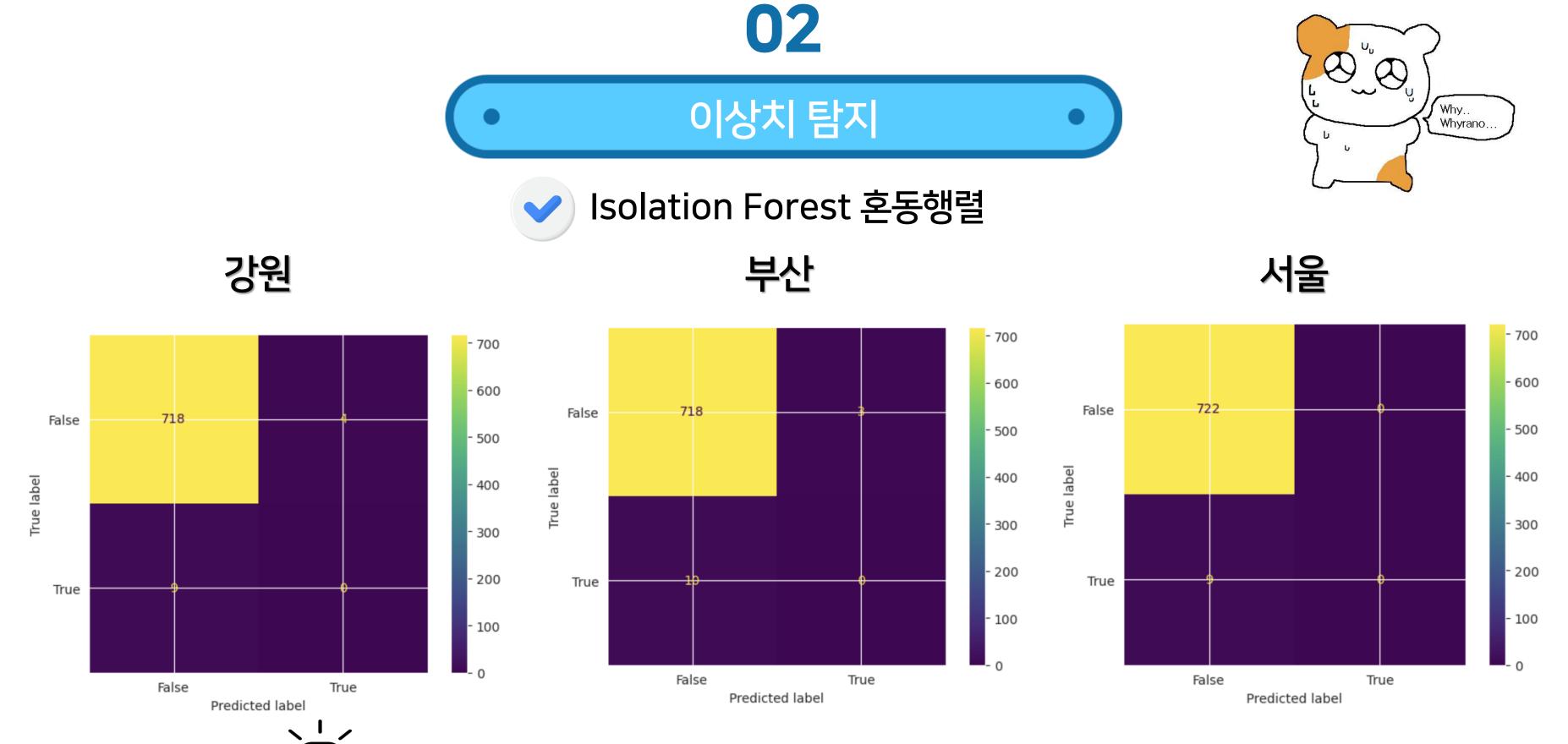
이상치 탐지에 사용하기로 결정!



이상치 탐지



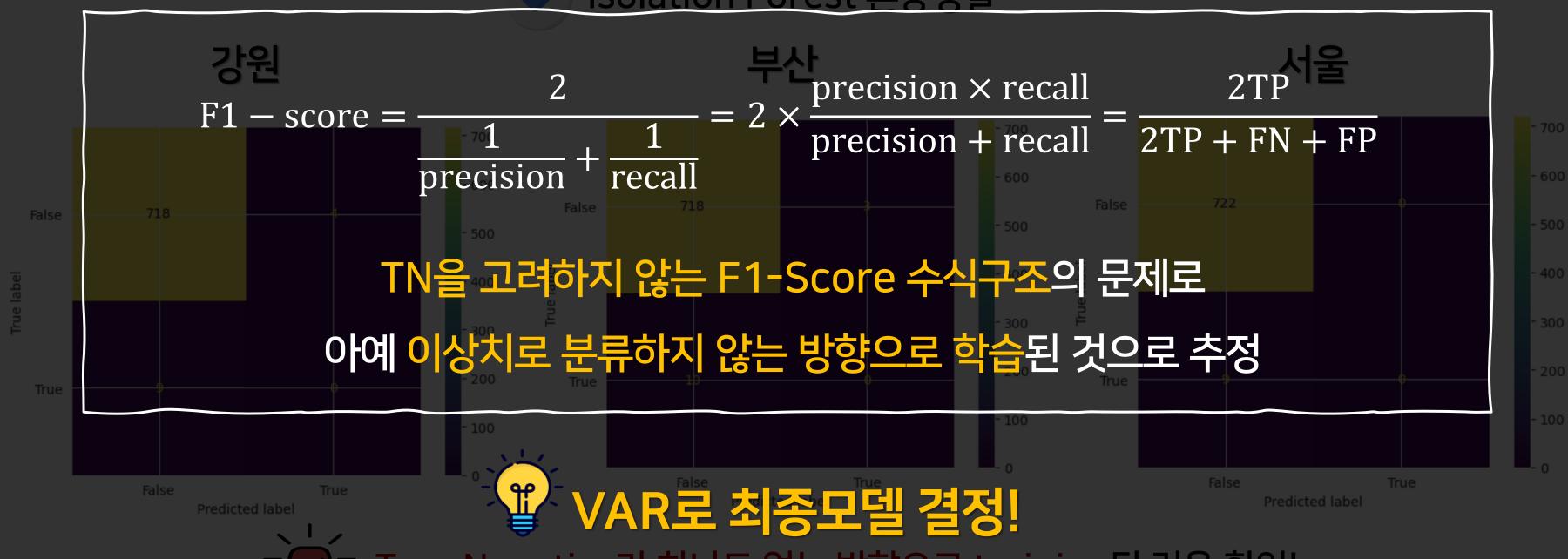




True Negative가 하나도 없는 방향으로 training된 것을 확인!

사 F1-Score의 함정 (배신..?)





True Negative가 하나도 없는 방향으로 training된 것을 확인!

호우/태풍 이진분류



```
Call:
glm(formula = typhoon_yn ~ ., family = "binomial", data = train)
Deviance Residuals:
   Min
             1Q Median
                                      Max
-1.9785 -0.6591 -0.5159 -0.2866 2.7084
Coefficients:
             Estimate Std. Error z value Pr(>|z|)
(Intercept) -2.9733953 1.0121706 -2.938 0.003307 **
            0.1316279 0.0613527 2.145 0.031918 *
           0.0633460 0.0356022 1.779 0.075196 .
avg_ta
         -0.0134085 0.0038073 -3.522 0.000429 ***
sum_rn
           0.0056088 0.0008843 6.342 2.26e-10 ***
comp_wd
           -0.1456985   0.0265563   -5.486   4.10e-08 ***
comp_ws
Signif. codes: 0 (***, 0.001 (**, 0.05 (., 0.1 ( , 1
(Dispersion parameter for binomial family taken to be 1)
   Null deviance: 617.73 on 566 degrees of freedom
Residual deviance: 526.12 on 561 degrees of freedom
AIC: 538.12
```

모델 성능

Accuracy: 0.7919

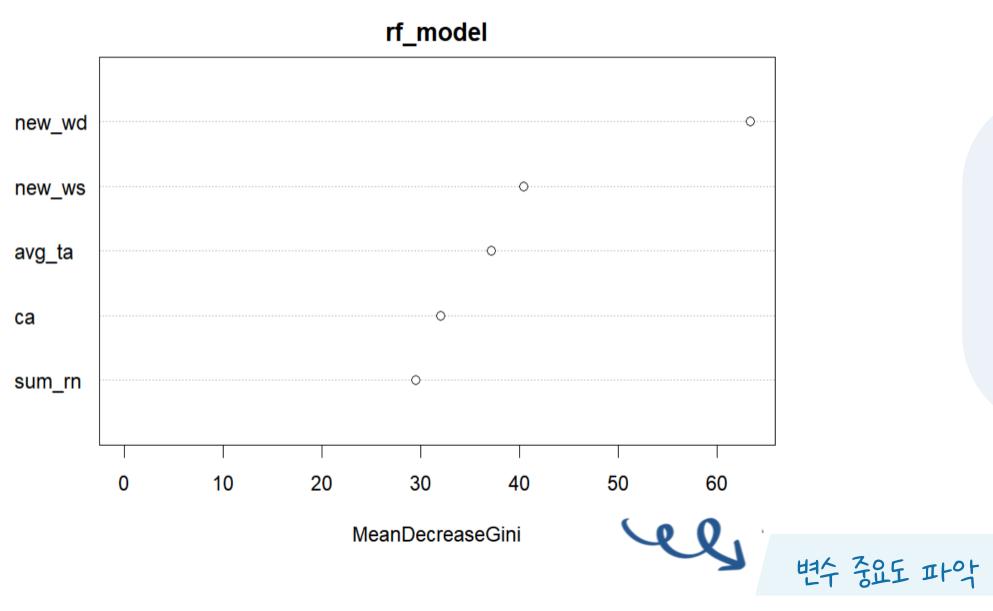
F1-score: 0.8782



호우/태풍 이진분류



2 Random Forest



모델 성능

Accuracy: 0.8777

F1-score: 0.9258

호우/태풍 이진분류





피해액 예측 모델



Avg _ta	са	sum _rn	WS	wd	typhoon_ yn	damage _conv
1.8	4.88	0.61	-0.75	-1.13	0	131745
4.3	7.6	0.75	1.25	-1.14	1	303244
÷	÷	:	÷	÷	÷	÷
7.72	4.3	0.3	1.38	-0.64	1	306982

Avg _ta	са	sum _rn	WS	wd	typhoon_ yn	damage _conv
1.8	4.88	0.61	-0.75	-1.13	0	6.42
4.3	7.6	0.75	1.25	-1.14	1	7.11
÷	:	:	:	÷	:	÷
7.72	4.3	0.3	1.38	-0.64	1	7.84

damage_conv 변수 로그화

피해액 예측 모델



Avg _ta	са	sum _rn	WS	wd	typhoon_yn	damage _conv
1.8	4.88	0.61	-0.75	-1.13	0	6.42
4.3	7.6	0.75	1.25	-1.14	1	7.11
:	:	÷	÷	÷	:	÷
7.72	4.3	0.3	1.38	-0.64	1	7.84

Avg _ta	са	sum _rn	WS	wd	typhoon_yn	damage _conv
0.20	-0.78	-0.85	-0.28	-0.76	0	6.42
-0.84	-0.23	0.64	0.54	-0.27	1	7.11
÷	:	÷	÷	÷	÷	÷
-0.70	0.16	-0.32	-0.48	0.67	1	7.84

설명변수(avg_ta, ca, sum_rn, ws, wd) scaling

 \rightarrow

피해액 예측 모델



avg_ta	са	sum_rn	wd	WS	damage _conv	Typhoon _yn
0.17	0.72	1.28	-1.137	-0.571	6.43	0
0.29	0.79	0.05	-0.641	1.389	7.12	1
:	:	÷	:	:	:	÷
0.01	0.33	2.53	2.312	0.510	9.65	1

avg_ta	са	sum_rn	wd	WS	damage _conv	Typhoon _yn
0.24	0.79	1.38	-1.023	-0.498	8.04	0
0.36	0.86	0.11	-0.543	1.463	10.7	0
:	:	:	:	:	:	:
0.51	0.95	-0.34	-0.049	1.301	6.43	1

Trian set (2440, 7)

Test set (616, 7)

8:2 비율로 train, test set 생성

피해액 예측 모델



Avg_ta	 damage _conv	Typhoon _yn
0.17	6.43	1
0.29	 7.12	1
:	:	÷
0.01	9.65	1

Avg_ta	 damage _conv	Typhoon _yn
0.15	5.58	0
0.54	 9.65	0
:	:	÷
0.03	4.27	0

Avg_ta	 damage _conv	Typhoon _yn
0.24	8.04	1
0.36	 10.7	1
:	:	÷
0.51	6.43	1

Avg_ta	 damage _conv	Typhoon _yn
0.27	5.02	0
0.28	 2.37	0
:	:	:
0.30	9.41	0

Train1 (646, 7)

Train2 (1794, 7)

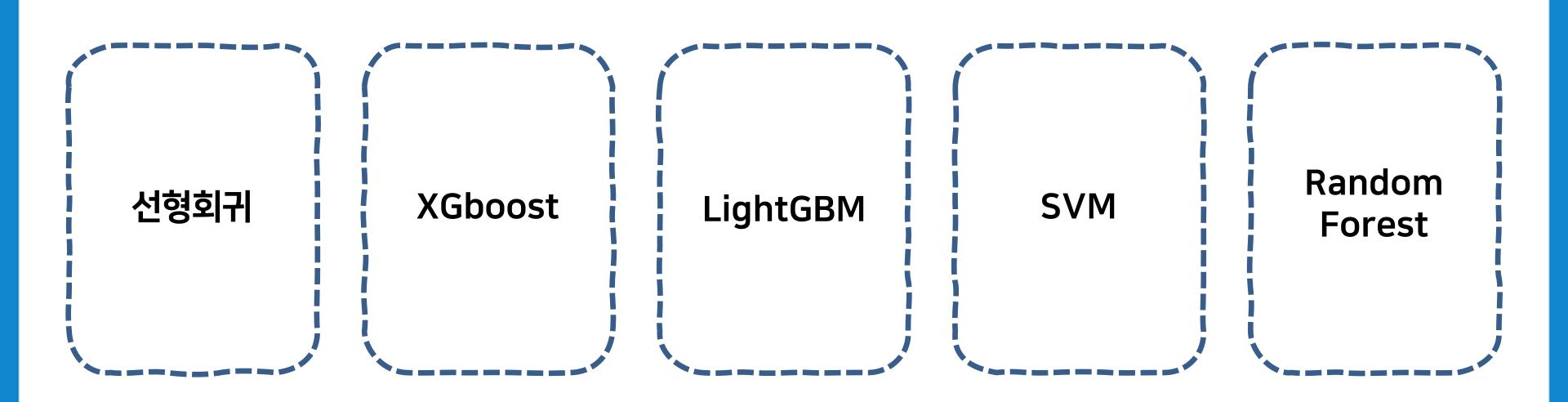
Test1 (164, 7)

Test2 (452, 7)

Train set, test set에서 태풍이 있는 행과 없는 행으로 분리



피해액 예측 모델



5가지 방법으로 예측을 진행한 후 가장 성능이 좋은 모델 선택

피해액 예측 모델 - 태풍 O



5가지 모델 비교

모델	MSE
Linear Regression	7.95868
XGboost	5.109841
LightGBM	5.398116
SVM	5.06428
Random Forest	4.869128

피해액 예측 모델 - 태풍 X



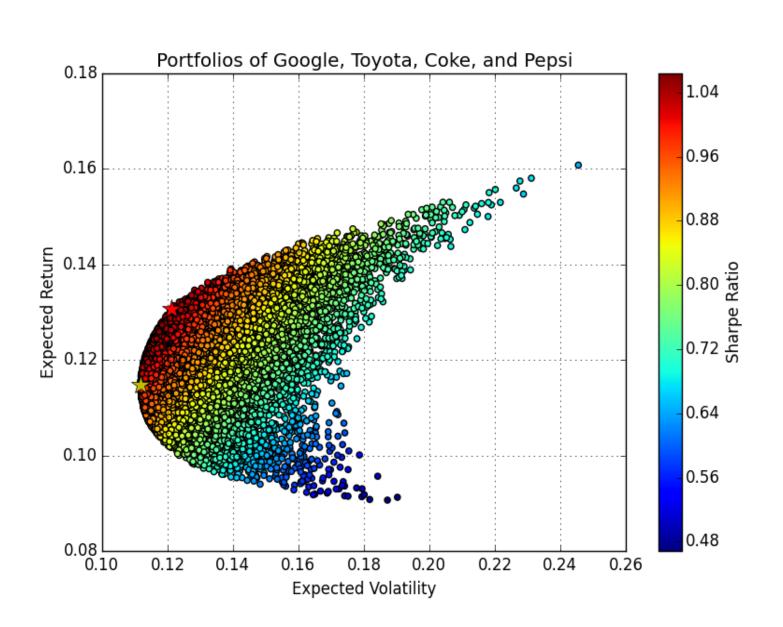
5가지 모델 비교

모델	MSE	
Linear Regression	7.283894	
XGboost	6.525093	
LightGBM	6.590601	
SVM	6.63209	
Random Forest	6.260416	

지역별 리스크 분석



포트폴리오 최적화



각 시설을 주식종목, 피해액을 기대 주식수익으로 간주

기대 주식수익(피해액)이 극대화되었을 때의 각 주식종목(시설)이 차지하는 수익 비율(피해액 비율) 산출

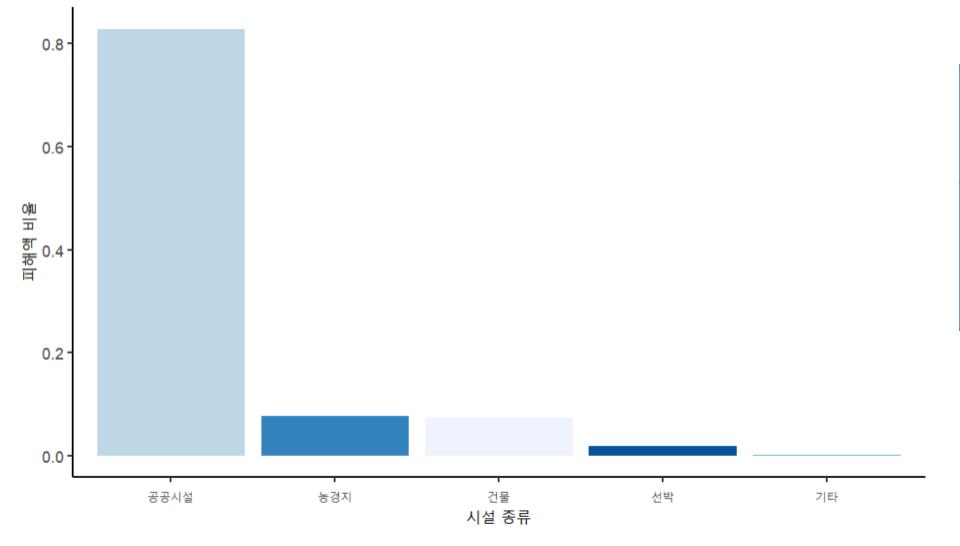
예측된 피해액을 각 시도의 포트폴리오에 대입하여 시설 별 피해액(리스크) 산출

● 지역별 리스크 분석- 최적화 결과 ●



시설 별 피해액 비율: 서울 - 호우 0 태풍 0 인 경우





축대,당장/가축/축사,당사/

수산증양식/아망,어구/비닐하우스 등

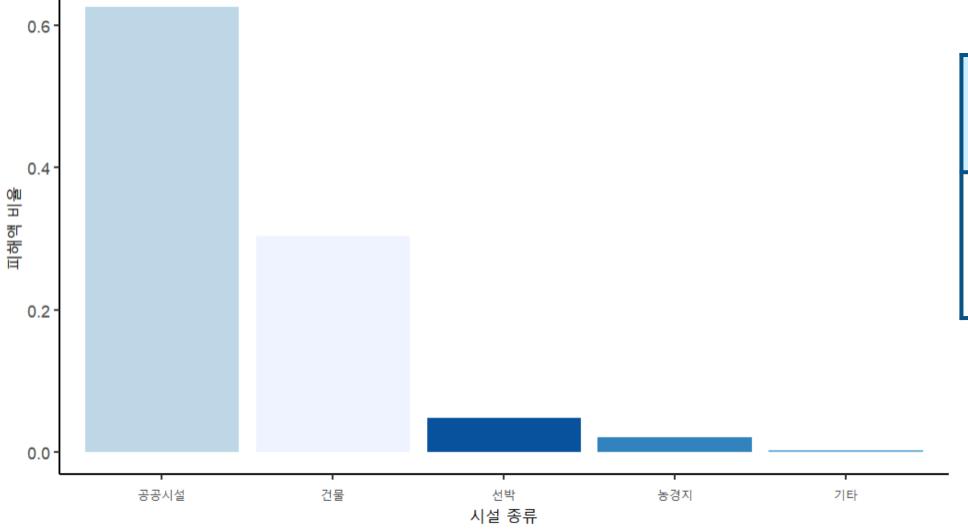
건물	선박	선박 농경지		기타	
0.073	0.018	0.076	0.828	0.002	

• 지역별 리스크 분석- 최적화 결과 •



시설 별 피해액 비율: 서울 - 호우 O 태풍 X 인 경우

서울 호우 피해액

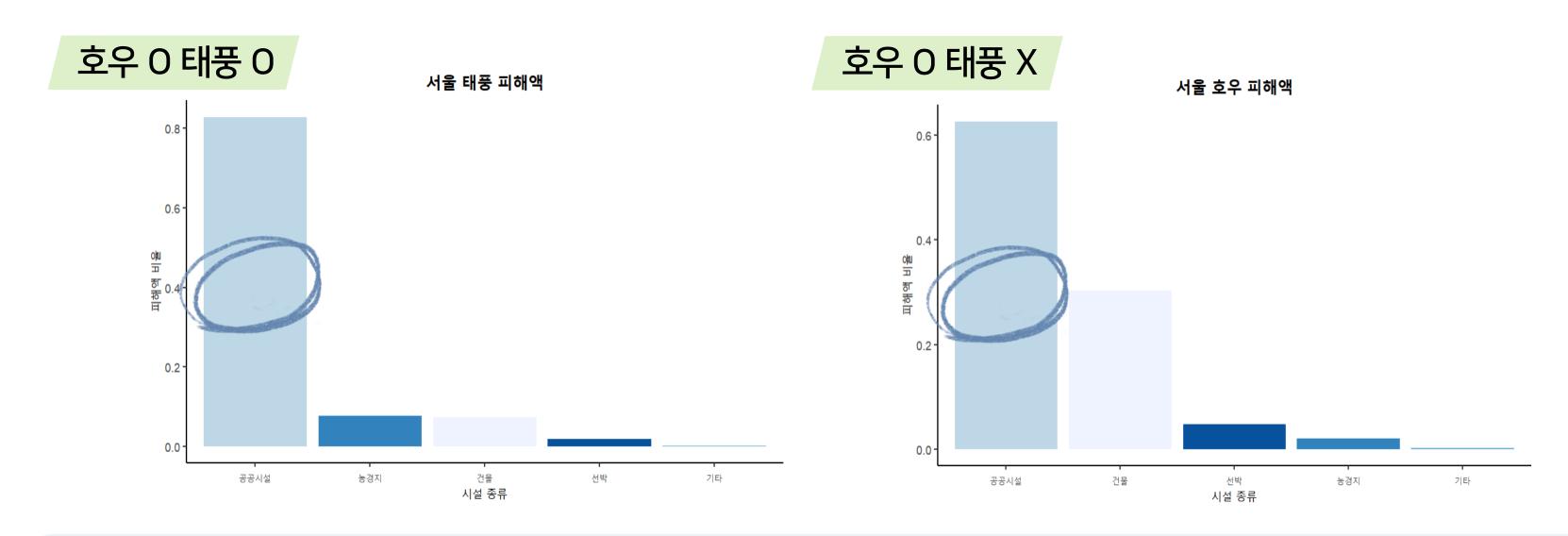


건물	선박	농경지	공공시설	기타	
0.303	0.047	0.021	0.625	0.002	





지역별 리스크 분석- 제언



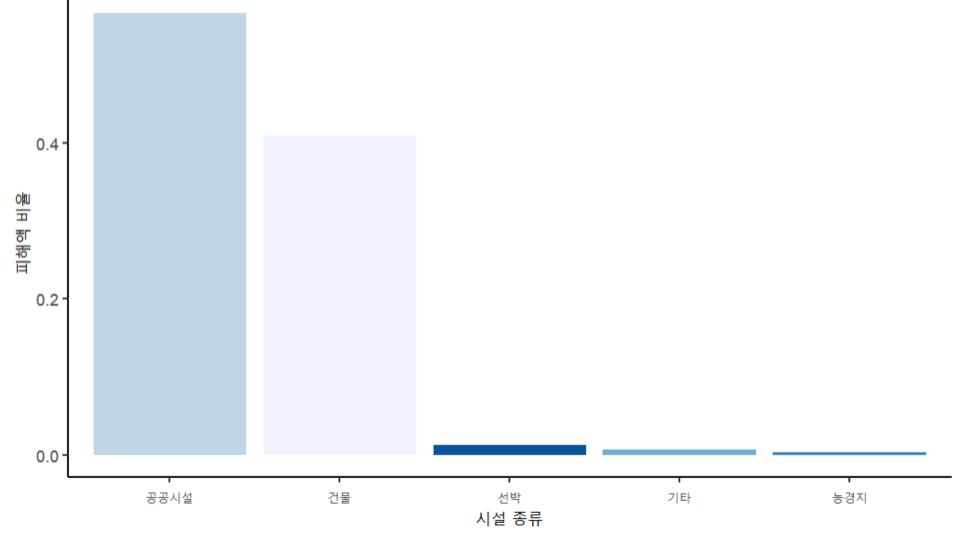
서울의 경우, 태풍의 유무와 관련없이 <mark>공공시설</mark>의 피해액 비율이 가장 높기 때문에 추후 **공공시설을 중심으로 재난 복구 비용을 투자**해야 한다고 판단됨

• 지역별 리스크 분석- 최적화 결과 •



시설 별 피해액 비율: 부산 - 호우 0 태풍 0 인 경우

부산 태풍 피해액



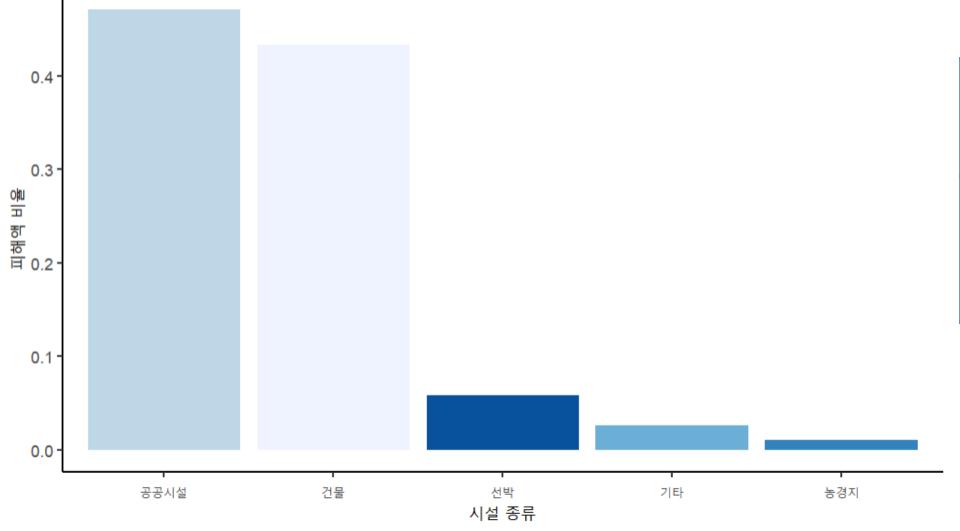
건물	선박	농경지	공공 시설	기타	
0.408	0.013	0.003	0.566	0.007	

• 지역별 리스크 분석- 최적화 결과 •



시설 별 피해액 비율: 부산 - 호우 O 태풍 X 인 경우

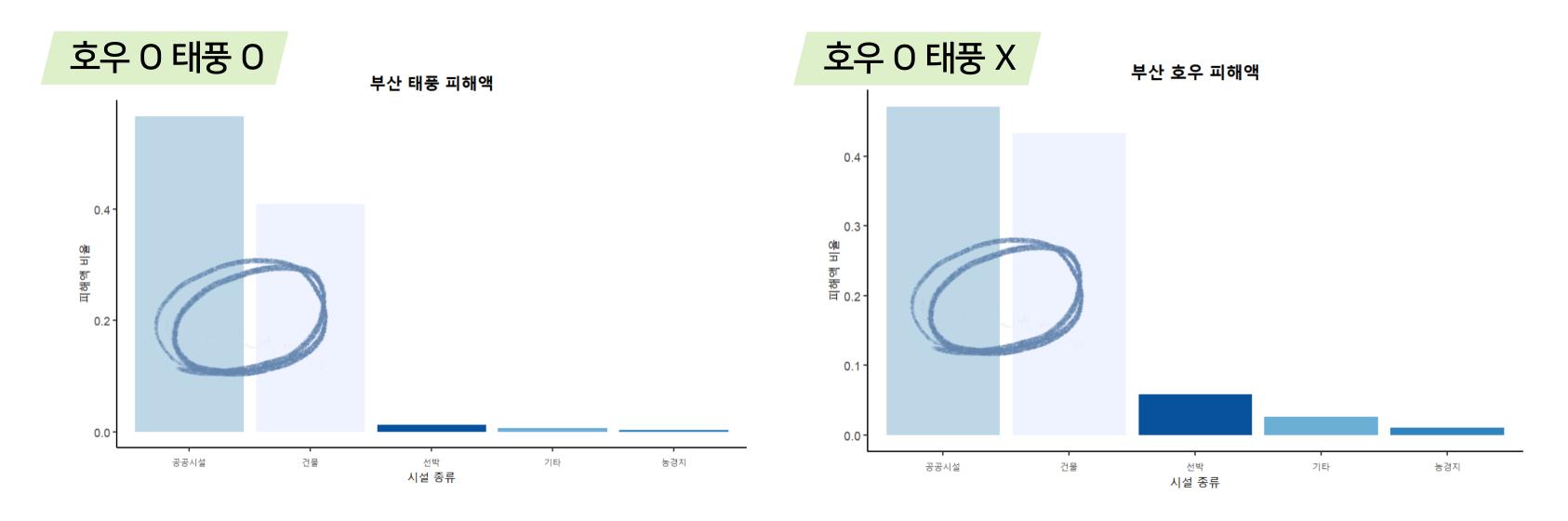
부산 호우 피해액



건물	선박	농경지	공공시설	기타	
0.432	0.058	0.011	0.471	0.026	



지역별 리스크 분석- 제언



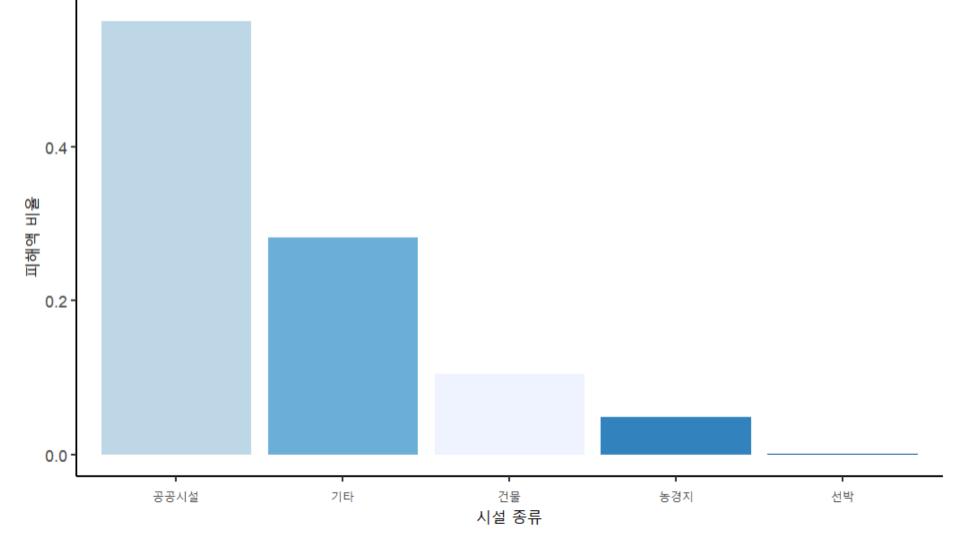
부산의 경우, 태풍의 유무와 관련없이 <mark>공공시설과 건물</mark>의 피해액 비율이 가장 높기 때문에 추후 **공공시설과 건물을 중심으로 재난 복구 비용을 투자**해야 한다고 판단됨

• 지역별 리스크 분석- 최적화 결과 •



시설 별 피해액 비율: 강원 - 호우 0 태풍 0 인 경우

강원 태풍 피해액



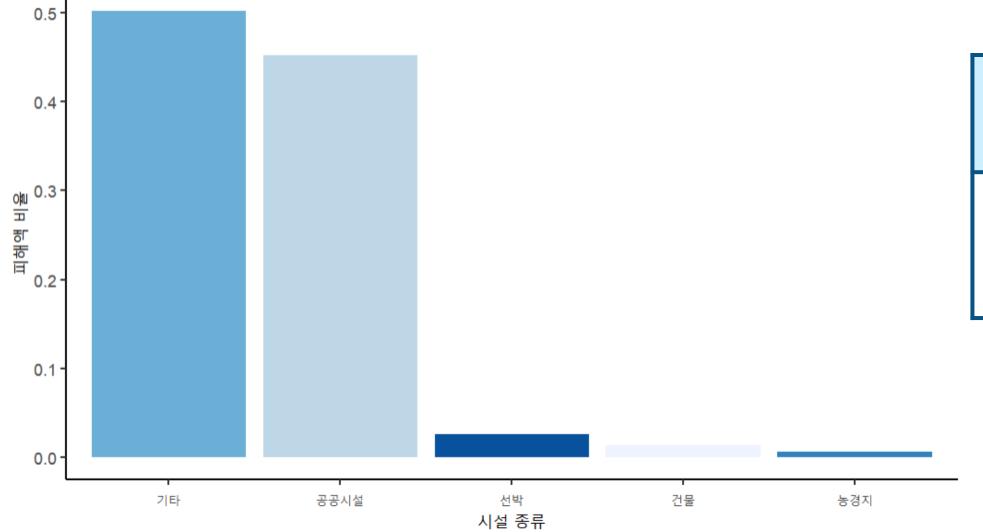
건물	선박	농경지	공공시설	기타	
0.104	0.001	0.048	0.563	0.281	

• 지역별 리스크 분석- 최적화 결과 •



시설 별 피해액 비율: 강원 - 호우 O 태풍 X 인 경우

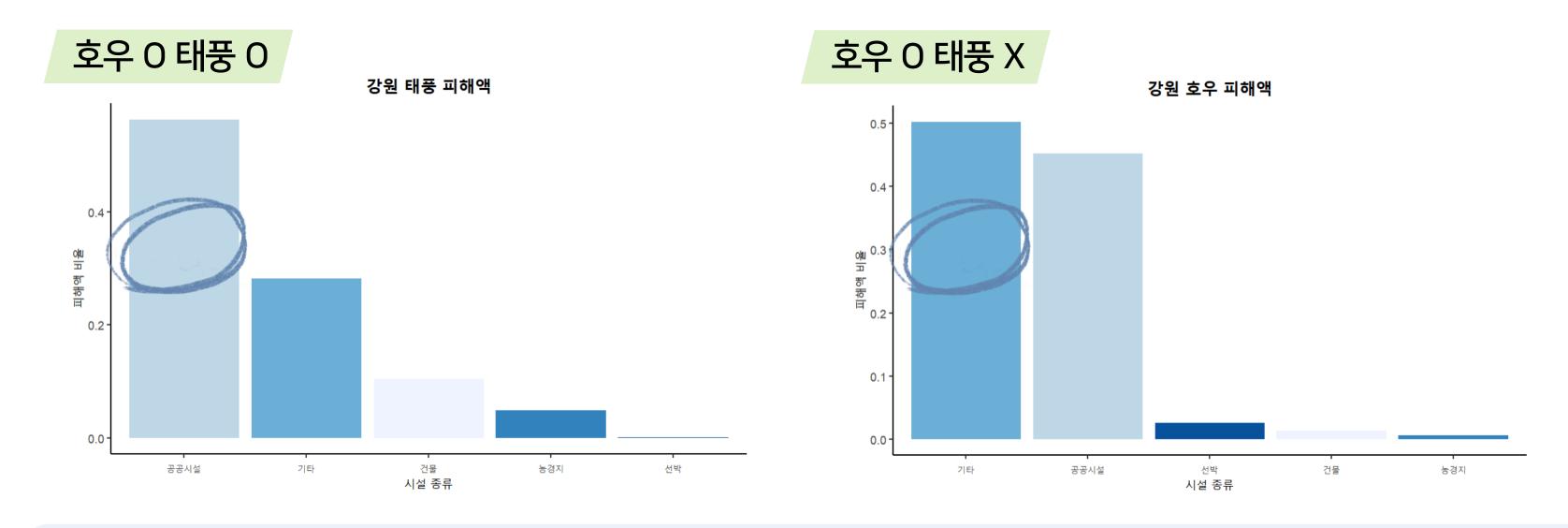
강원 호우 피해액



건물	선박	농경지	공공시설	기타	
0.013	0.025	0.006	0.451	0.502	



지역별 리스크 분석- 제언



강원의 경우, **태풍이 있을 때는 공공시설이**, **호우만 있을 때는 기타 시설**의 피해 비율이 가장 높음 따라서 태풍이 올 때에는 **공공시설의 피해를 예상하고 추가적으로 재난 복구 비용 투자를 늘려야 할 것**으로 보임

• 지역별 리스크 분석- 데이터 적용 •



최종 리스크 분석 결과

Avg_ta	ca	Sum_rn		Damage_pred	건물_pred	선박_pred	농경지_pred	공공시설_pred	기타_pred
-2.177	-0.062	0.122	•••	64427.74	27856	3780.75	704.79	30360.18	1726.01
-2.704	0.098	0.773		83579.27	36136.36	4904.6	914.29	39384.93	2239.08
÷	:	÷	÷	÷	ŧ	÷	÷	:	:
-0.2534	0.355	2.325	•••	537539.89	219800.69	7186.61	2142.25	304544.82	3865.41



서울/부산/강원 세 지역에서 각각 **최악의 기상상황**일 때의 **총 피해액 및 구체적인 시설 별 피해액** 예측 완료!