

Détectez des faux billets avec R ou Python

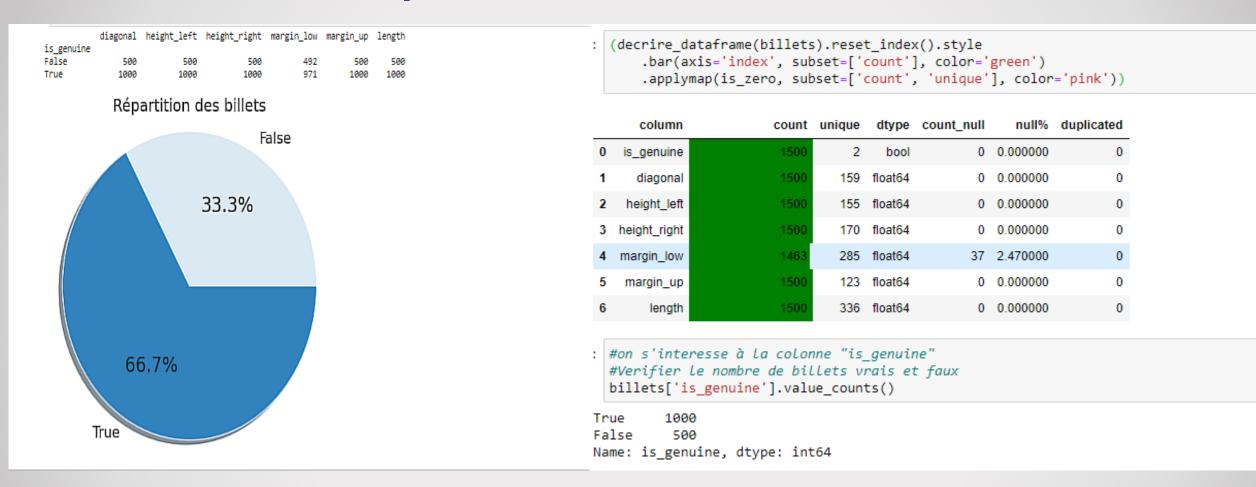
### SOMMAIRE

- Présentation du projet
- Exploration des données
- Corrélation entre les variables
- Comparaison de la distribution des variables
- Imputation des valeurs manquantes: Régression linéaire multiple
- Évaluation du modèle de régression linéaire multiple("Analyse des résidus")
- Vérification de la cohérence des résultats obtenus
- Modélisations: test des modèles de classifications
- > ACP
- Méthode des K-Means (clustering non supervisé)
- Régression logistique (classification supervisé)
- Méthode du K-NN (le plus proche voisin)
- Méthode de Randomforest
- Comparaison des performances des modèles
- Application finale

# Présentation du projet

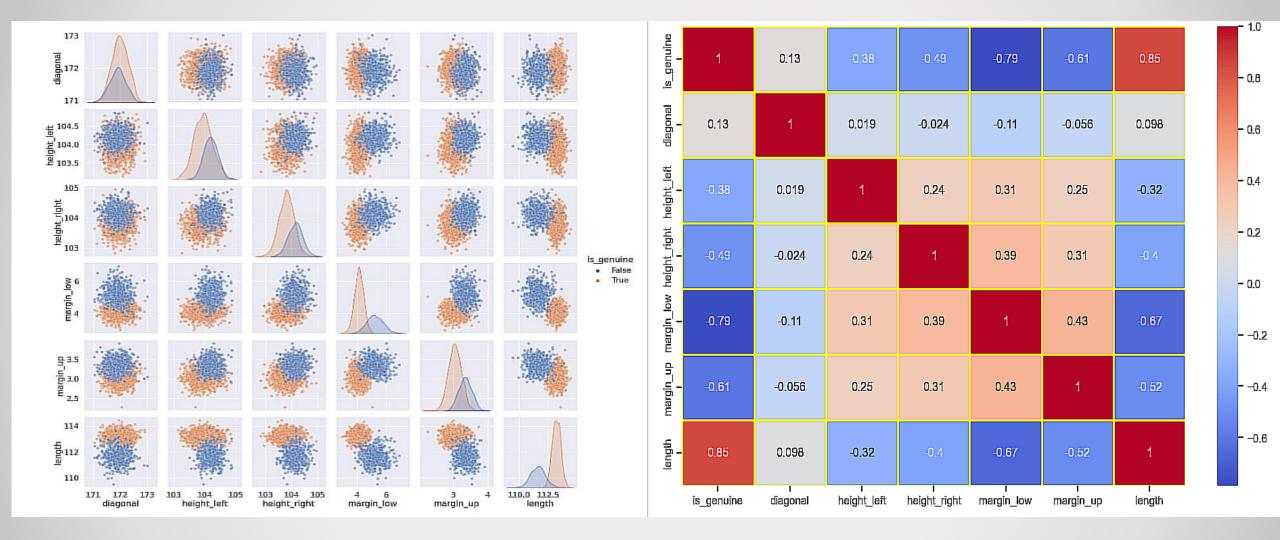
- ONCFM souhaite mettre en place un algorithme qui soit capable de différencier automatiquement les vrais des faux billets.
- Le projet consiste à développer un modèle analytique pour l'ONCFM permettant de distinguer les vrais billets d'euros des faux, en se basant sur des caractéristiques quantifiables des billets.

# Exploration des données



- Ces données contiennent les informations de 1500 billets de banque, dont 1000 sont authentiques(True) et 500 billets sont faux (False).
- 37 valeurs manquantes sur la variable margin\_low.
- L'objectif est de compléter ces valeurs manquantes

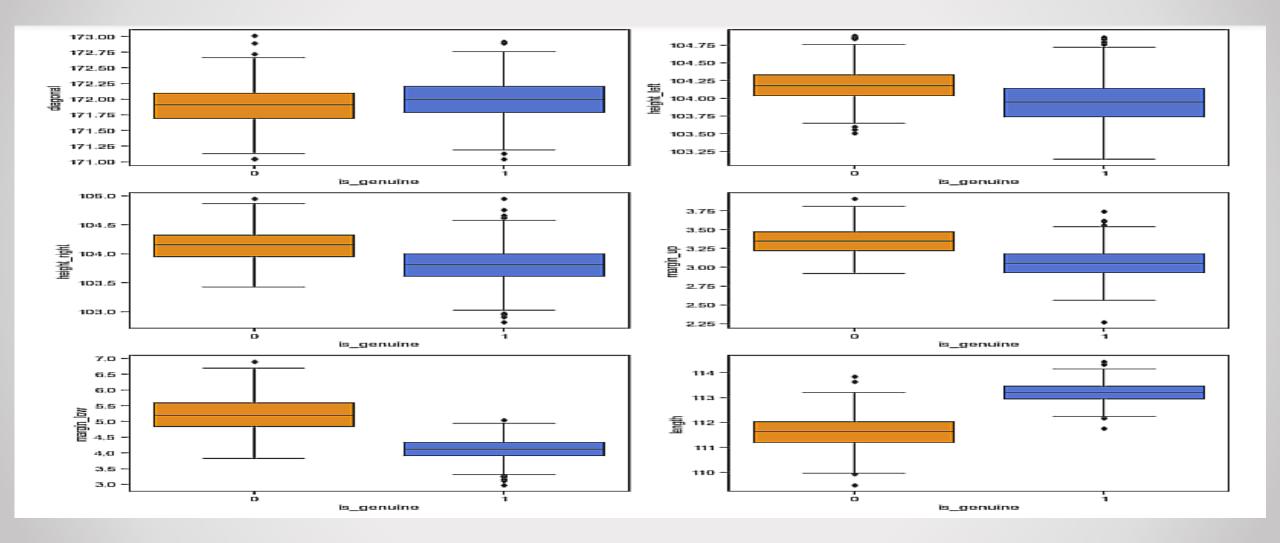
### Corrélation entre les variables



La heatmap nous montre que "Margin\_low" est bien corrélée négativement avec "is\_genuine" (-0,79) et positivement avec "margin\_up", "height\_right" et "height\_left".

- La variable la plus corrélée est "lenght" et "is\_genuine« (coeff =0,85).
- Pour rappel, plus la corrélation est marquée, plus le résultat du coefficient de corrélation tend vers 1 ou -1. Plus il tend vers 0, moins les variables sont corrélées.

# Comparaison de la distribution des variables



Les boxplots montrent que les vrais billets ont des dimensions généralement plus grandes et des marges inférieures plus petites par rapport aux faux billets. Ces caractéristiques peuvent être clés pour distinguer l'authenticité des billets.

# Imputation des valeurs manquantes: Régression linéaire multiple

### Définition

- La régression linéaire multiple est une technique statistique qui permet d'examiner la relation entre une variable dépendante et deux ou plusieurs variables indépendantes (ou explicatives).
- On a constaté durant l'exploration des données que nous avions des valeurs manquantes dans la colonne "Margin\_low".
- Nous souhaitons pouvoir "prédire" ces données à l'aide d'un model de Machine Learning.
- le modèle de régression linéaire multiple pour imputer les valeurs manquantes de margin\_low.

### Préparation des données

- Appliquons la régression linéaire multiple à l'échantillon "billets". Modélisons 'margin\_low' en fonction de toutes les autres variables
- On commence par séparer les individus qui ont une valeur manquante dans "Margin\_low". Cela correspond à 37 individus

```
# On crée un Dataset avec les individus qui ont un margin_low = NaN
 billets_nan = billets.loc[billets["margin_low"].isna()]
 # On créé un nouveau Dataset sans les valeurs manquantes
 billets sans nan =billets.dropna()
 billets sans nan.info()
<class 'pandas.core.frame.DataFrame'>
Int64Index: 1463 entries, 0 to 1499
Data columns (total 7 columns):
    Column
                  Non-Null Count Dtype
    is genuine
                  1463 non-null int64
    diagonal
                  1463 non-null
                                float64
    height left
                 1463 non-null
                                 float64
    height right 1463 non-null
                                 float64
    margin_low
                  1463 non-null float64
                                 float64
    margin up
                  1463 non-null
    length
                  1463 non-null
                                 float64
dtypes: float64(6), int64(1)
memory usage: 91.4 KB
```

### Régression linéaire multiple

\*Avec Statmodels: "Méthode Backward Régression"

```
# On utilise la fonction my backward selected afin de trouver les varibles descriptives les plus pertinentes
columns = ['margin low','diagonal','is genuine','height left','height right','margin up','length']
reg_backward = my_backward_selected(billets_sans_nan[columns], 'margin_low')
                           OLS Regression Results
Dep. Variable:
                          margin low
                                      R-squared:
Model:
                                     Adj. R-squared:
                                                                      0.616
                    Least Squares F-statistic:
Method:
                                                                      1174.
                    Fri, 10 Nov 2023
                                      Prob (F-statistic):
                                                                   1.24e-304
Date:
Time:
                            12:47:15
                                      Log-Likelihood:
                                                                     -774.73
No. Observations:
                                1463
                                                                       1555.
Df Residuals:
                                1460
                                      BIC:
                                                                       1571.
Df Model:
Covariance Type:
                           nonrobust
Intercept
             5.9263
                          0.198
                                 30.003
                                                           5.539
                                                                      6.314
margin up
           -0.2119 0.059 -3.612
                                               0.000
                                                          -0.327
                                                                      -0.097
                          0.029 -40.477
is_genuine
            -1.1632
                                                          -1.220
                                                                      -1.107
Omnibus:
                              22.365
                                      Durbin-Watson:
                                                                      2.041
Prob(Omnibus):
                              0.000
                                      Jarque-Bera (JB):
                                                                      39.106
Skew:
                               0.057
                                      Prob(JB):
                                                                    3.22e-09
                               3.793
                                      Cond. No.
Kurtosis:
```

- Les variables descriptives intéressantes sont : "is\_genuine" "margin\_up"
- On peut donc utiliser ce modèle (avec les variables "is\_genuine"et"margin\_up") à des fins de prévision de la variable 'margin\_low'!
- Le *R*2 vaut environ 0.617, et le *R*2 ajusté est d'environ 0.616 et une p\_value <0,05 ce qui suggère que les résultats sont statistiquement significatifs, et donc que 'margin\_up' et 'is\_genuine' sont des prédicteurs significatifs de 'margin\_low'.

- \*Avec Train\_test\_split : "Fonction de scikit-learn utilisée pour diviser les données en ensembles d'entraînement et de test "
- "y" présente les valeurs de ma variable à prédire(margin\_low)
- "X" présente l'ensemble de mes variables explicatives, à partir desquelles je vais pouvoir prédire y.
- > Je sépare mes données en un groupe d'entrainement et un groupe de test, ensuite j'instancie notre modèle, je l'entraine et enfin on peut prédire les valeurs de y\_pred.

```
X_train, X_test, y_train, y_test = train_test_split(X, y, test_size=0.2, random_state=0)
  # Entraîner notre modèle de régression linéaire sur les données d'entrainement
  model_01 = sm.OLS(y_train, X_train)
  resultat = model_01.fit()
  #Prediction
  y_test = resultat.predict(X_test)
  print(resultat.summary())
                          OLS Regression Results
Dep. Variable:
                                     R-squared:
Model:
                                     Adj. R-squared:
                                                                   0.617
Method:
                   Least Squares
                                    F-statistic:
                                                                   942.0
           Sat, 11 Nov 2023
Date:
                                    Prob (F-statistic):
                                                               2.89e-244
Time:
                          09:49:48
                                    Log-Likelihood:
                                                                 -606.17
No. Observations:
Df Residuals:
                              1170
                                     AIC:
                                                                   1218.
                              1167
                                                                   1234.
Df Model:
            5.6622 0.220 25.769
                         0.032 -35.354
                                                       -1.200
is genuine
            -1.1373
                                                                  -1.074
          -0.1337 0.065 -2.051
                                             0.040 -0.262
margin_up
                          21.780 Durbin-Watson:
                                                                 841.200
Prob(Omnibus):
                            0.000 Jarque-Bera (JB):
                                                                1.13e-09
Skew:
                             0.034 Prob(JB):
Kurtosis:
                             3.917 Cond. No.
```

### Évaluation du modèle

Avant de valider l'utilisation de la régression linéaire, nous devons confirmer la validité de plusieurs hypothèses afin de s'assurer que nous pouvons appliquer cette régression. Voici les hypothèses à vérifier :

- Normalité: Pour satisfaire cette condition, les erreurs résiduelles de notre modèle devraient idéalement se conformer à une distribution normale, centrée autour de zéro. En d'autres termes, les résidus devraient être distribués normalement avec une moyenne égale à zéro.
- ➤ Ici, l'hypothèse de normalité est remise en cause (p-value = 6.2e-06 < 0.05).
- <u>Homoscédasticité</u>: L'homoscédasticité signifie que la variance des erreurs résiduelles est constante à tous les niveaux de la variable prédite. Cela implique que la variance des erreurs devrait rester uniforme à tous les niveaux de la variable explicative.
- Dans notre cas le test de "Breusch Pagan" indique une p-valeur inférieure à 5 %, on rejette l'hypothèse *H*0 selon laquelle les variances sont constantes.
- La variance des erreurs n'est pas constante, ce qui est un problème pour la régression linéaire, affectant la fiabilité de vos résultats.
- <u>Multi colinéarité</u>: Cette hypothèse concerne la relation entre les variables explicatives dans notre modèle de régression. Elle stipule qu'il ne devrait pas y avoir de forte corrélation linéaire entre les variables indépendantes.
- Les valeurs de Facteur d'Inflation de la Variance (VIF) pour 'is\_genuine' et 'margin\_up' sont environ 1.6, ce qui est bien en dessous du seuil commun de 10 ce qui suggère une absence de multi colinéarité significative.

```
: #Testez la normalité des résidus

from scipy.stats import shapiro

statistic, p_value = shapiro(residuals)

if p_value > 0.05:
    print("Les résidus semblent suivre une distribution normale (hypothèse non rejetée).")
    print("P-value :",p_value)

else:
    print("Les résidus ne suivent pas une distribution normale (hypothèse rejetée).")
    print("P-value :",p_value)

Les résidus ne suivent pas une distribution normale (hypothèse rejetée).
P-value : 7.613264642714057e-06
```

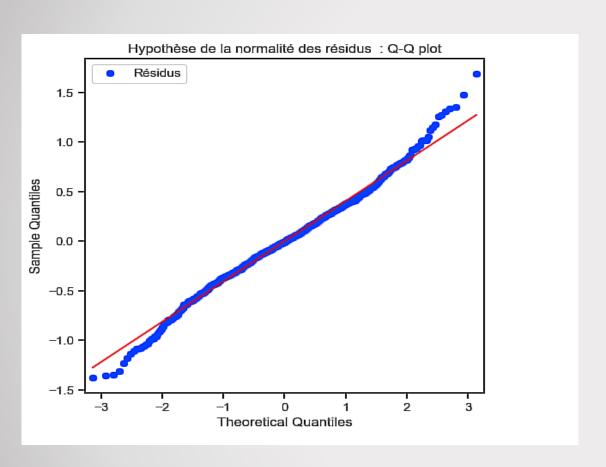
```
import statsmodels.api as sm
import statsmodels.stats.diagnostic as smd

# Testez l'homoscédasticité (c'est-à-dire la constance de la variance) des résidus :
_, pval, __, f_pval = smd.het_breuschpagan(resultat.resid, X_train)
print('p value test Breusch Pagan:', pval)

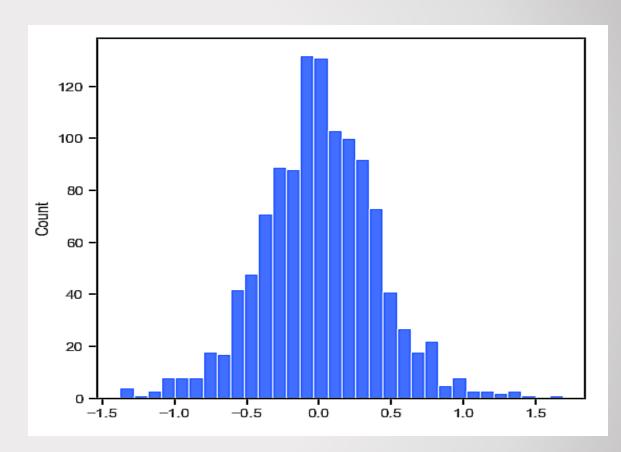
p value test Breusch Pagan: 1.6223530361976033e-27
```

```
Variance Inflation Factor (VIF):
Variable VIF
Const 341.438603
is_genuine 1.617936
margin_up 1.617936
```

# Régression linéaire multiple



Le diagramme Quantile-Quantile est un outil graphique permettant d'évaluer la pertinence de l'ajustement d'une distribution donnée à un modèle théorique. Ce diagramme représente la normalité des résidus.



L'analyse des résidus montre qu'ils s'alignent approximativement avec une distribution symétrique et, compte tenu de la taille de l'échantillon qui excède 30, on peut conclure que les prédictions du modèle linéaire gaussien sont plausibles, même en l'absence d'une normalité parfaite des résidus.

### Vérification de la cohérence des résultats obtenus

Sans la prédiction du modèle de Régression Linéaire

| margin_low  |
|-------------|
| 1463.000000 |
| 4.485967    |
| 0.663813    |
| 2.980000    |
| 4.015000    |
| 4.310000    |
| 4.870000    |
| 6.900000    |
|             |

Avec la prédiction du modèle de Régression Linéaire

|       | margin_low  |
|-------|-------------|
| count | 1500.000000 |
| mean  | 4.482809    |
| std   | 0.659780    |
| min   | 2.980000    |
| 25%   | 4.030000    |
| 50%   | 4.310000    |
| 75%   | 4.870000    |
| max   | 6.900000    |

- On crée le modèle de régression linéaire avec une prédiction qui permettra de remplacer les valeurs manquantes.
- Sur le deuxième tableau, le count nous montre que toutes nos valeurs ont bien été remplacées : nous n'avons plus de valeurs manquante dans le dataset.

### Modélisations: test des modèles de classifications

#### > Prédiction de l'authenticité des billets

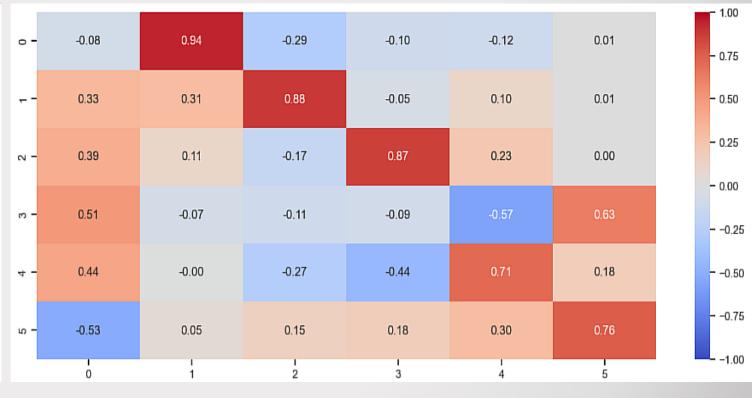
Pour la mise en pace d'un modèle capable de prédire au mieux si un billet et vrai ou faux, nous allons tester plusieurs méthodes : K-Means, LogisticRegression, KNN, RandomForest.

### > ACP : Algorithme de réduction de dimensionnalité

#### Création de l'éboulis des valeurs propres

# Eboulis des valeurs propres Cumul de variance expliquée 43.210967 60.167944 73.188609 85.014429

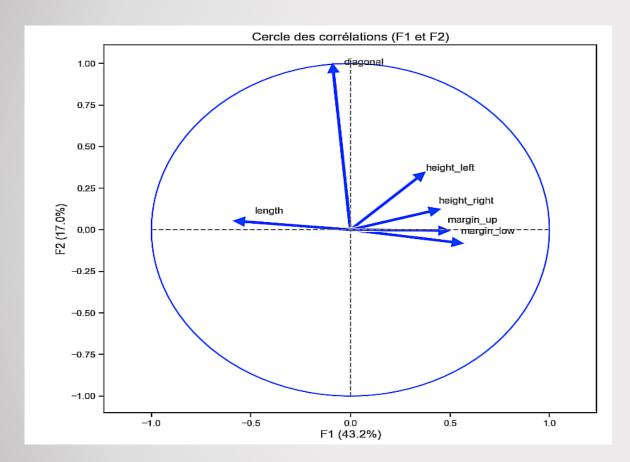
### Heatmap

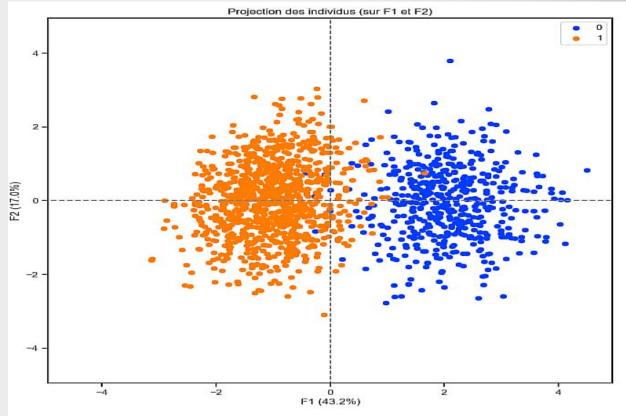


Nous analysons donc seulement les variables F1 et F2 qui représentent 60,2% de l'inertie totale (variance).

Je choisis 2 composantes principales, car les 2 premières dimensions représentent 60% des informations importantes.

# Cercle des corrélations et projection des individus sur le plan factoriel





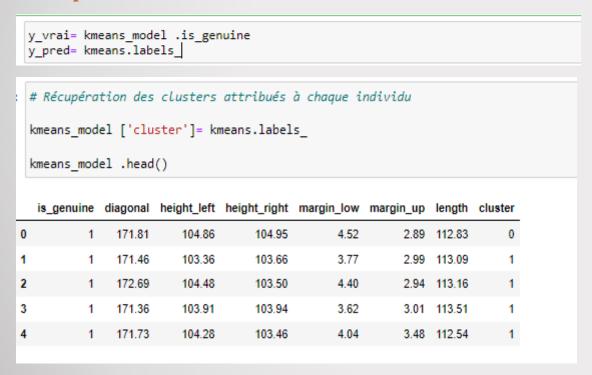
➤ le cercle des corrélations indique que les variables les plus liées à la première composante F1 sont length, margin\_low, et aussi margin\_up, height\_right et height\_left. En revanche, la variable diagonal ne semble pas avoir de relation significative.

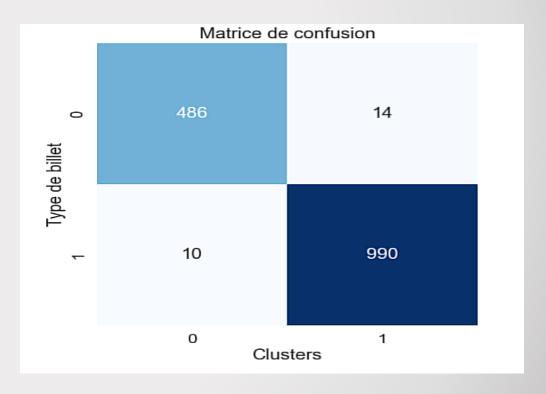
- ➤ Il est apparent que c'est uniquement la première composante qui permet une séparation efficace entre les vrais et les faux billet
- > Il sera intéressant d'analyser les clusters et leur centroïde pour mieux comprendre sur quoi nos deux ensembles varient.

**1**3

# Méthode des KMeans (clustering non-supervisé)

- L'algorithme kmeans est un algorithme itératif qui minimise la somme des distances entre chaque individu et le centroïde du cluster ; c'est la variabilité intra cluster. Attribuer un cluster à chaque objet (ou sujet, ou point), de façon aléatoire.
- Préparation des données et matrice de confusion





La matrice de confusion montre les résultats d'une classification par l'algorithme K-mean

### **KMeans**

### Évaluation du modèle avec les scores

```
# Calculons nos scores de performance :
kmeans_accuracy = accuracy_score(y_vrai,y_pred).round(4)
print("Accuracy :",kmeans_accuracy)

kmeans_precision = precision_score(y_vrai,y_pred).round(4)
print("Precision :",kmeans_precision)

kmeans_recall = recall_score(y_vrai,y_pred).round(4)
print("Recall :",kmeans_recall)
```

Accuracy : 0.984 Precision : 0.9861

Recall : 0.99

### **Classification report**

|              | <pre>from sklearn.metrics import classification_report print(classification_report(y_vrai,y_pred, ))</pre> |        |          |         |  |  |
|--------------|--|--------|----------|---------|--|--|
|              | precision  | recall | f1-score | support |  |  |
| 0            | 0.98   | 0.97   | 0.98     | 500     |  |  |
| 1            | 0.99   | 0.99   | 0.99     | 1000    |  |  |
| accuracy     |  |        | 0.98     | 1500    |  |  |
| macro avg    | 0.98   | 0.98   | 0.98     | 1500    |  |  |
| weighted avg | 0.98   | 0.98   | 0.98     | 1500    |  |  |

- **Exactitude(Accuracy):** mesure la globalité des prédictions correctes.
- ➤ La précision(Precision): se concentre sur la qualité des prédictions positives
- ➤ Le rappel(Recall): se concentre sur la capacité du modèle à trouver tous les exemples positifs
- ➤ Notre modèle présente une performance de 98% (taux de prédiction correcte sur toutes les données de test)
- > Une précision de 98% pour le modèle de K-means est généralement considérée comme très élevée, ce qui suggère que le modèle a réussi à bien classifier les données dans les clusters appropriés.

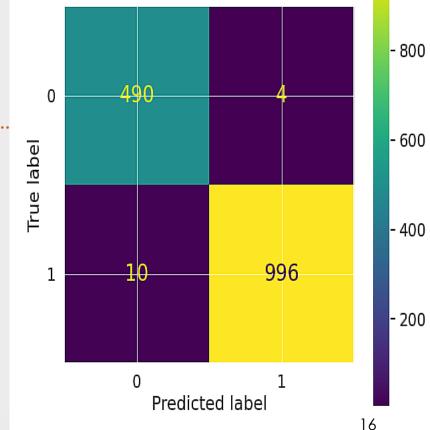
# Régression logistique (classification supervisé)

- La régression logistique est une technique d'apprentissage supervisé utilisée pour prédire la probabilité d'une variable cible catégorielle, souvent binaire, en fonction d'une ou plusieurs variables indépendantes. Ce modèle permet d'étudier les relations entre un ensembles de variables prédictives (explicatives) et une variable à prédire y.
- Préparation des données et matrice de confusion
- 1. Fractionnement des données en un groupe d'entrainement et un groupe de test
- 2. Initialisation et entraînement du modèle
- 3. Prédiction(utilisation du modèle)
- 4. Calcul du score et évaluation du modèle(matrice de confusion, courbe AUC ROC, Score F1, Validation croisée...

```
# Séparons nos données en un groupe d'entrainement et un groupe de test.
x_train, x_test, y_train, y_test = train_test_split(x, y, test_size = 0.2, random_state =5)

: #Initialisation et entraînement du modèle
rl_model = LogisticRegression()
rl_model.fit(x_train, y_train)

LogisticRegression()
```



# Prédiction sur l'ensemble de test
y pred log= rl model.predict(x test)

### Régression logistique

- **Évaluation du modèle de régression logistique**
- 1. L'AUC ROC: La zone sous la courbe (AUC : Area Under the Curve) est une mesure de la performance du modèle. Une AUC de 1.0 indique une performance parfaite, où le modèle a un taux de vrais positifs de 1 et un taux de faux positifs de 0.
  - Dans notre cas, la valeur A.U.C est de 1, ce qui confirme que le modèle a une excellente capacité à distinguer les billets authentiques des faux.
- 2. Score F1: est une mesure harmonique de la précision et du rappel d'un modèle de classification.

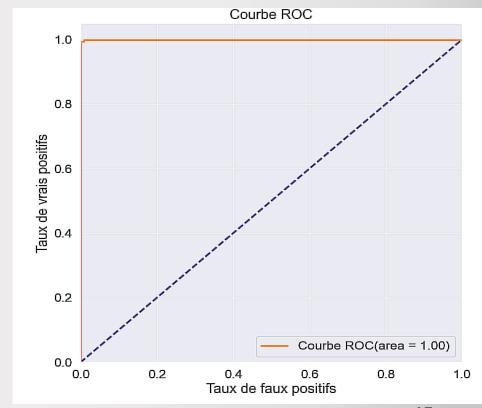
```
from sklearn.metrics import f1_score
f1_log =f1_score(y_test,y_pred_log)
f1_log.round(4)
0.9974
```

Score F1 =0.9974, ce qui indique une excellente combinaison de précision et de rappel modèle très performant.

### 3. Accuracy/Precision/Recall:

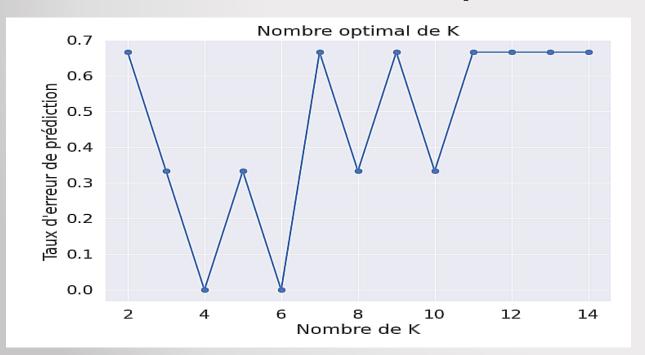
```
Cross-Validated Predictions:
[0 1 1 ... 0 0 0]
Accuracy : 0.99066666666667
Precision : 0.9900596421471173
Recall : 0.996
Confusion Matrix:
[[490 10]
[ 4 996]]
```

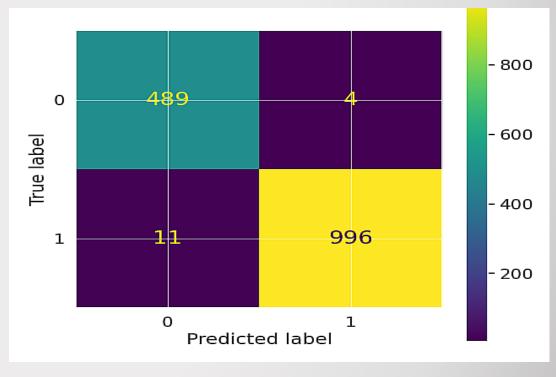
Grâce à une validation croisée, nous avons évalué la performance de notre modèle de classification. Les métriques de performance révèlent que le modèle est extrêmement performant, avec une matrice de confusion démontrant un nombre très réduit de faux positifs (10).



# Méthode K-NN (le plus proche voisin)

- Le KNN, ou "k-plus proches voisins", est une méthode simple utilisée en machine Learning pour prédire la catégorie d'un nouvel élément en se basant sur les catégories des k éléments les plus proches de lui dans l'ensemble de données.
- Préparation des données et matrice de confusion
- 1. Fractionnement des données en un groupe d'entrainement et un groupe de test
- 2. Choisir le nombre optimal de K (le meilleur "k« est celui qui donne le taux d'erreur le plus bas sur un ensemble de validation)
- 3. Instanciation du modèle avec le meilleur k
- 4. Entrainement du modèle sur nos données train
- 5. Prédiction(utilisation du modèle)
- 6. Évaluation du modèle (matrice de confusion, les scores de performances, courbe ROC,...).





La matrice de confusion nous donne de très bon résultats indiquant très peu de faux positifs (4) par rapport aux vrais positifs (996) et vrais négatifs (489).

### Méthode K-NN

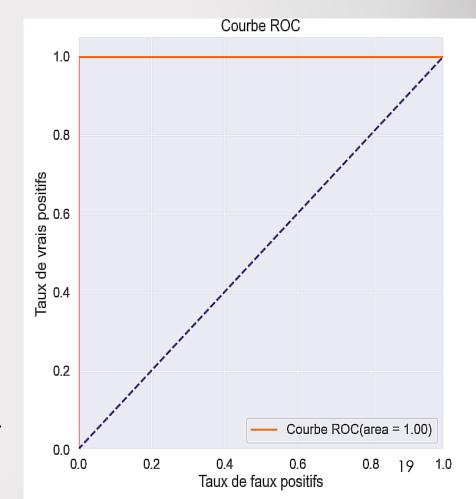
- **Évaluation du modèle de régression logistique**
- 1. L'AUC ROC: dans notre cas, la valeur A.U.C est égale à 1, ce qui confirme que le modèle a une excellente capacité à distinguer les billets authentiques des faux.
- 1. Score F1 : f1 = 1 ce qui indique une excellente combinaison de précision et de rappel = modèle très performant.

```
: f1_knn =f1_score(y_test,y_pred_knn)
f1_knn.round(4)
1.0
```

### 2. Accuracy/Precision/Recall:

```
Cross-Validated Predictions:
[0 1 1 ... 0 0 0]
Accuracy : 0.99
Precision : 0.9890764647467726
Recall : 0.996
Confusion Matrix:
[[489 11]
[ 4 996]]
```

Notre modèle K-NN fait très peu d'erreur de prédiction, donc il est excellent, il présente une fiabilité de 99%.



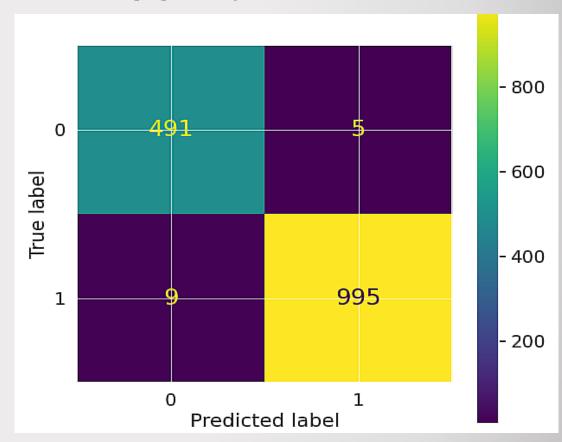
### Méthode de Randomforest

- La forêt aléatoire est une technique d'apprentissage automatique qui construit de nombreux arbres de décision pour améliorer la robustesse et la précision des prédictions.
- Chaque arbre donne une prédiction et le résultat final est obtenu en combinant les prédictions de tous les arbres.
- Elle est particulièrement efficace pour gérer des ensembles de données complexes, tant pour la classification que pour la régression.
- Préparation des données et matrice de confusion
- 1. Séparation des données en un groupe d'entrainement et un groupe de test
- 2. Entrainement du modèle sur nos données train
- 3. Prédiction sur l'ensemble de test

```
# Séparons nos données en un groupe d'entrainement et un groupe de test.
x_train, x_test, y_train, y_test = train_test_split(x, y, test_size=0.2, random_state=5)
```

```
# Initialisation et entraînement du modèle
rf_model= RandomForestClassifier(random_state=5)
rf_model.fit(x_train, y_train)
```

```
# Prédiction sur l'ensemble de test
y_pred_rf = rf_model.predict(x_test)
```



La matrice de confusion de notre modèle Random Forest nous donne également de très bon résultats indiquant très peu de faux positifs (5) par rapport aux vrais positifs (995) et vrais négatifs (491). • 20

### Randomforest

- **Évaluation du modèle de régression logistique**
- 1. L'AUC ROC : dans notre cas, la valeur A.U.C est égale à 1, ce qui suggère que le modèle a correctement classifié tous les billets.
- 2. Score F1: f1\_score = 0.9949, ce qui indique une excellente combinaison de précision et de rappel

```
: f1_rf =f1_score(y_test,y_pred_rf) f1_rf.round(4) 0.9949
```

1. Accuracy/Precision/Recall:

```
Cross-Validated Predictions:
[0 1 1 ... 0 0 0]
Accuracy : 0.99066666666667
Precision : 0.9910358565737052
Recall : 0.995
Confusion Matrix:
[[491 9]
[ 5 995]]
```

Les métriques de performance révèlent que le modèle est extrêmement performant, avec une matrice de confusion démontrant un nombre très réduit de faux positifs (9).

# Comparaison des performances des modèles

tableau de performance

|           | kmeans | Regression_Logistique | kNN | Randomforest |
|-----------|--------|-----------------------|-----|--------------|
| Accuracy  | 0.9840 | 0.9967                | 1.0 | 0.9933       |
| Precision | 0.9861 | 1.0000                | 1.0 | 0.9949       |
| Rappel    | 0.9900 | 0.9949                | 1.0 | 0.9949       |

Évaluation de Modèles Classificateurs(Validation Croisée)

|           | Regression_Logistique | kNN      | Randomforest |
|-----------|-----------------------|----------|--------------|
| Accuracy  | 0.990000              | 0.990667 | 0.992000     |
| Precision | 0.989999              | 0.990674 | 0.992011     |
| Recall    | 0.990000              | 0.990667 | 0.992000     |
|           |                       |          |              |

- > Ce tableau montre les métriques de performance pour nos modèles de classifications:
- KMeans, Régression Logistique, kNN (k-Nearest Neighbors), et Random Forest. Les métriques fournies sont l'Accuracy (Exactitude), la Precision (Précision), et le Recall (Rappel).
- > Tous les modèles semblent bien performer sur l'ensemble de données, avec kNN et Régression Logistique en tête.

- Ce tableau présente les métriques de performance obtenues par validation croisée pour trois modèles : Régression Logistique, kNN, et Random Forest.
- La validation croisée est un bon indicateur que la Régression Logistique pourrait être le modèle le plus robuste et le plus généralisable parmi ceux évalués ici.
- Nous allons donc utiliser ce modèle pour notre application finale afin de prédire
- l' authenticité ou pas de nouveaux billets.

### **Application finale**

```
detection faux billets('billets production(1).csv',rl model)
     diagonal height_left height_right margin_low margin_up length Authenticite Probabilite_authenticite
 id
A_1
       171.76
                   104.01
                               103.54
                                              5.21
                                                         3.30 111.42
                                                                             Faux
                                                                                                 0.002983
A_2
       171.87
                   104.17
                               104.13
                                              6.00
                                                         3.31 112.09
                                                                             Faux
                                                                                                 0.000777
A_3
       172.00
                  104.58
                               104.29
                                                         3.39 111.57
                                                                             Faux
                                                                                                 0.001405
                                              4.99
A 4
       172.49
                   104.55
                               104.34
                                                         3.03 113.20
                                                                                                 0.946759
                                              4.44
                                                                              Vrai
A_5
       171.65
                   103.63
                               103.56
                                              3.77
                                                         3.16 113.33
                                                                              Vrai
                                                                                                 0.999508
```

Les trois premiers billets sont classés comme faux avec des probabilités d'authenticité très faibles, tandis que les deux derniers sont classés comme vrais avec des probabilités élevées, suggérant que le modèle est confiant dans ses prédictions.

Le modèle prédit correctement la présence de billets vrais et faux, identifiant trois comme faux et deux comme vrais, ce qui indique une bonne séparation des classes et démontre la performance du modèle.

### **MERCI**