

ÉCOLE NATIONALE DE LA STATISTIQUE
ET DE L'ANALYSE DE L'INFORMATION



PROJECT TITLE

Project Description

TITLE

rédigé par
Allemand Instable

22 Mai 2022

Résumé

Lorem ipsum dolor sit amet. Ut expedita sunt est delectus quia ad nostrum delectus eum magni dolor. Eos nemo minima sit deleniti porro et necessitatibus minima ab quia necessitatibus in beatae autem et voluptas labore.

Lorem ipsum dolor sit amet. Ut expedita sunt est delectus quia ad nostrum delectus eum magni dolor. Eos nemo minima sit deleniti porro et necessitatibus minima ab quia necessitatibus in beatae autem et voluptas labore.

contribution

si jamais vous apercevez des fautes dans le polycopié, merci de rédiger une *issue* sur Github à l'adresse :

correctif



LaTeX-Template/issues

contact



mail DEV : redacted@gmail.com

Notation	Signification
Category A	
Category B	

Table des matières

1	Chapter 1	1
1.1	1
1.2	1
1.3	1
1.4	1
1.5	1
2	Chapter 2	2
2.1	2
2.2	2
2.3	2
2.4	2
2.5	2
3	Chapter 3	3
3.1	3
3.2	3
3.3	3
3.4	3
3.5	3
A	Some Appendix	i
A.1	with subsection	i
A.2	and another one	i
B	Code Examples	ii

Table des figures

List of Algorithms

Chapitre 1

Chapter 1

Contents

1.1	1
1.2	1
1.3	1
1.4	1
1.5	1

1.1

1.2

1.3

1.4

1.5

Chapitre 2

Chapter 2

Contents

2.1	2
2.2	2
2.3	2
2.4	2
2.5	2

2.1

2.2

2.3

2.4

2.5

Chapitre 3

Chapter 3

Contents

3.1	3
3.2	3
3.3	3
3.4	3
3.5	3

3.1

3.2

3.3

3.4

3.5

Annexe A

Some Appendix

Contents

A.1	with subsection	i
A.2	and another one	i

A.1 with subsection

A.2 and another one

Annexe B

Code Examples

```
1 # --- install --- #
2 install.packages(c("fda", "fda.usc"))
3 # --- general packages --- #
4 library(data.table)
5 # --- FDA packages --- #
6 library(fda)
7 library(fda.usc)
```

```
1 # |      date      |  $X_1$  |  $X_2$  |  $\dots$  |  $X_p$  |
2 # | Jan 1st 12:00 |  $\vdots$  |  $\vdots$  |      |  $\vdots$  |
3 data <- fread("data.csv")
4
5
6 # un individu = une ligne
7 # donc pour une série temporelle, il faut transposer les observations et avoir la
  ↳ suite des données disposées sur une ligne.
8 fdata_standard_index <- fda.usc::fdata(
9   mdata = t(X),
10   argvals = to_unit_interval(
11     #           ↑
12     # on doit ramener les dates dans l'intervalle [0,1]
13     data[, .(date)]
14   )
15 )
```

```
1 nb_points <- ncol(fdata)
2 nb_ts <- nrow(fdata)
3
4 fda_optim_basis <- fda.usc::optim.basis(
5   fdataobj = select_representative_observations_for_mean_function_fdata(fdata_ts
6     ↳ = fdata, is_iid = is_iid),
7   type.CV = fda.usc::GCV.S,
8   W = NULL,
9   lambda = lambda_CV_look_list,
```

```

9     numbasis = num_basis__seq,
10    type.basis = "bspline",
11    verbose = TRUE
12 )

```

```

1 fda_optimal_basis <- ...
2 fdata_obj_temp <- fda_optimal_basis[["fdata.est"]]
3 fdata_obj <- fda.usc::fdata2fd(fdata_obj_temp)
4 fpca_result <- fda::pca.fd(
5     fdoj = fdata_obj,
6     nharm = 3,
7     # centrer les données
8     centerfns = TRUE
9 )

```

Regardons désormais à quoi ressemble la sortie :

$$\text{fpca_result}\$scores = \begin{matrix} & \xrightarrow{[\phi_k]} \\ \downarrow [X_i] & \begin{bmatrix} \ddots & \dots & \vdots \\ \vdots & \xi_i^{[k]} = \langle X_i - \mu | \phi_k \rangle & \vdots \\ \dots & \dots & \ddots \end{bmatrix} \end{matrix}$$

```

1 list(
2     fpca_result = fpca_result,
3     scores = fpca_result$scores,
4     eigenfunctions = fpca_result$harmonics,
5     explained_variance = fpca_result$varprop
6 )

```

Bibliographie

- (1) A. Monfort C. Gourieroux and A. Trognon. Pseudo maximum likelihood methods : Theory. *The Econometric Society*, 52(3), 1984. pages 681-700. DOI : <https://doi.org/10.2307/1913471>.