

Extremos

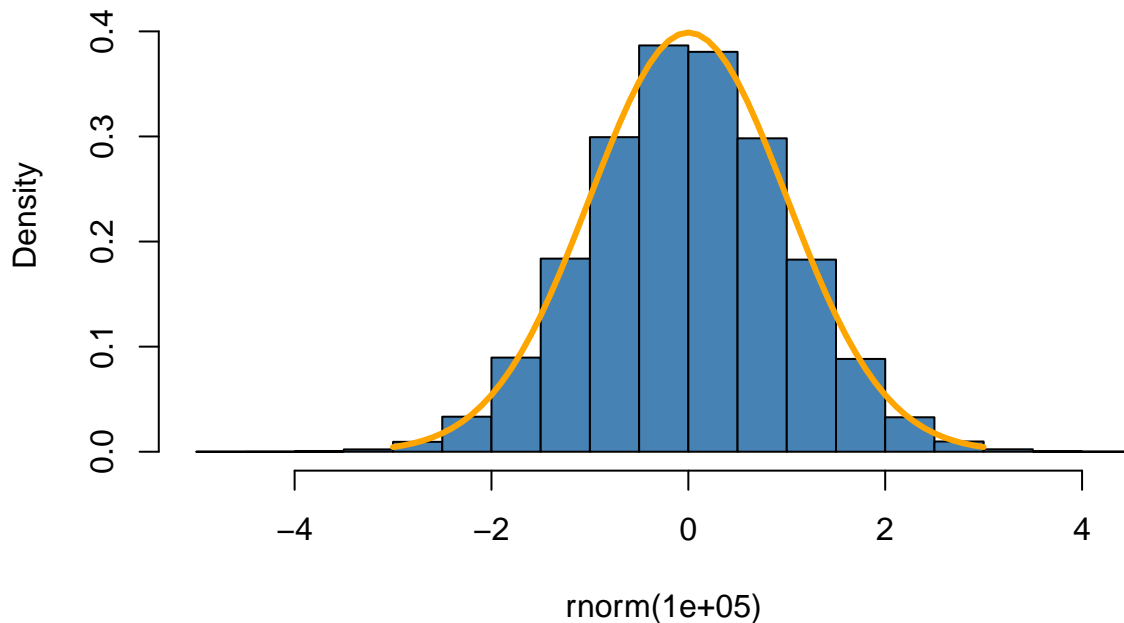
26/08/2020

Intuición de distribución del máximo.

Sabemos que la forma de un histograma se aproxima a la función de densidad $f(x)$ a partir de la cual se generaron los datos x_1, x_2, \dots, x_n , asumiendo que son **realizaciones** de variables aleatorias X_1, X_2, \dots, X_n iid con $X_1 \sim f$

```
gridx <- seq(-3,3, 0.1)
hist(rnorm(1e5), prob=T, ylim=c(0,0.45), col='steelblue', main="Histograma de Datos ~ N(0,1)")
lines(gridx, dnorm(gridx), lwd=3, col='orange')
```

Histograma de Datos ~ N(0,1)



En el problema de modelado de máximos, queremos encontrar una función $g(x)$ a partir de la cual se generaron los datos $\hat{x}_1, \hat{x}_2, \dots, \hat{x}_m$, asumiendo que son **realizaciones** de variables aleatorias $\hat{X}_1, \hat{X}_2, \dots, \hat{X}_m$ iid con $\hat{X}_1 \sim g$

Siendo concretos, los datos que queremos modelar son:

- Los máximos en un período (bloque) dado
 - ej: “teniendo x_i diarios, quiero el mayor x_i de cada año”
- Los que sobrepasan algún umbral
 - ej: “ x_i mayores a 30”, “ x_i mayores al 95 percentil”

Llamamos \hat{x}_i a los x_i que cumplen su condición de “**extremo**” en cualquiera de los casos.

En otras palabras, sólo estamos interesados en **la cola de la distribución**.

Antes de pasar al siguiente ejercicio:

¿Podés imaginar cómo resultaría un histograma de los **valores máximos** \hat{x}_i que se encuentran **en la cola** de una Normal(0,1) como la anterior?

¿Podés ver por qué esto es así? Qué sucede “alrededor” del umbral? ¿Por qué?

Ejercicio 1.

Realice un **histograma del percentil 90** como umbral de una muestra **Normal estándar** de **1e5** elementos.

Agregue una curva de densidad estimada \hat{g} utilizando la función **density** sobre los **datos del histograma**.

Introducción

En esta guía veremos cómo modelar una serie de datos observados usando:

1. **Máximos por Períodos** y el *Teorema de Generalized Extreme Values (GEV)*
2. **Excesos sobre Umbral** y el *Teorema de Generalized Pareto Distribution (GPD)*

Los datos se corresponden al dataset **Algiers**, que contiene las temperaturas máximas y mínimas diarias en el período 1961-2005. El mismo se puede descargar usando el paquete **heatwaveR**. En particular, nos vamos a concentrar en el uso de las primeras.

Nivel de Retorno - GEV

Como los datos sobre los que vamos a trabajar son de temperaturas máximas, sabemos que estos datos se van a ajustar bajo la metodología de GEV, particularmente con la **Familia Gumbel**.

Será de interés estimar sus parámetros característicos, y obtener un nivel de retorno para algún z_p

Explorando el comando **gum.fit** hallá los parámetros $\hat{\sigma}$ y $\hat{\mu}$

```
#install.packages('evd')
#install.packages('ismev')
library(heatwaveR)
library(evd)
library(ismev)
```

```
## Loading required package: mgcv
```

```
## Loading required package: nlme
```

```
## This is mgcv 1.8-31. For overview type 'help("mgcv-package")'.
```

Guardá los datos máximos diarios de la librería **heatwaveR** y filtrá del dataset **Algiers** los máximos de cada año (notá que los datos de Algiers son diarios)

```
1 .
```

Explore el comando **gum.fit** de la librería **ismev** usando los datos del ejercicio.

¿Qué valores se corresponden a las estimaciones de máxima verosimilitud? ¿Qué representa `$se`?

Nivel de Retorno

- Recordá que el nivel de retorno z_p es el valor que puede ser superado por el máximo anual en cualquier año, con probabilidad p

Reemplazá los valores estimados en la función de nivel de retorno z_p

Definí una función `estim_zp` que tome como input el nivel p y las estimaciones de μ y σ , y devuelva el nivel de retorno z_p

Computá el valor de z_p para las estimaciones del problema anterior usando su definición (ver pag 56 “Inference for Return Levels”)

- Usando la función del problema anterior, graficá z_p en función de $\log(y_p)$ para una grilla de valores entre 0.01 y 0.99, usando los parámetros estimados en el ejercicio 1.

Varianza del estimador e Intervalos de Confianza

Por el Método Delta, sabemos que:

$$\text{Var}(\hat{z}_p) \approx \nabla z_p^T V \nabla z_p$$

Donde

V es la matriz de varianzas-covarianzas de μ y σ

y

$$\nabla z_p^T = \left[\frac{\partial z_p}{\partial \mu}, \frac{\partial z_p}{\partial \sigma} \right]$$

Derivando el nivel de retorno z_p con respecto a cada una de sus variables, obtenemos

$$\frac{\partial z_p}{\partial \mu} = 1$$

$$\frac{\partial z_p}{\partial \sigma} = -\log\{-\log(1-p)\}$$

(ver pag. 81-82 “4.3.3 Return Levels”)

- Repetí lo mismo que en el ejercicio 3 pero agregando el intervalo de confianza de la estimación \hat{z}_p

Agregá la desviación estándar en el gráfico (por encima y debajo de la curva), multiplicándola por el percentil $s_{1-\frac{\alpha}{2}}$ de una distribución Normal estándar, para un nivel de confianza del 95 (con $\alpha = 0.025$).

Notar que $z_{1-\frac{\alpha}{2}}$ no es lo mismo que s_p , donde el primero es el **nivel de retorno**, y el segundo el **percentil de una Normal estándar**)

Intervalo de confianza del estimador de nivel de retorno \hat{z}_p :

$$(\hat{z}_p - s_{1-\frac{\alpha}{2}} \widehat{\text{SE}}, \hat{z}_p + s_{1-\frac{\alpha}{2}} \widehat{\text{SE}})$$

Para ello, utilizá la estimación de la matriz de covarianza `$cov` que devuelve `gum.fit` junto con los gradientes del estimador \hat{z}_p del nivel de retorno, en el producto de matrices mencionado arriba para obtener la varianza del estimador $\text{Var}(\hat{z}_p)$

TIP: Usá el operador `%*` para computar el producto entre matrices, `t()` para trasponer, y el comando `matrix(c(1, ds))` para generar una matriz de un array de datos.

Bootstrap

Otra forma de obtener la desviación estándar del estimador es mediante bootstrap:

1. Sample aleatorio con reposición de mi bolsa de datos
2. Estimo el nivel de retorno para esta muestra
3. Repito 1 y 2 una gran cantidad de veces (ej: Nboot=1000)
4. Calculo la desviación estándar sobre el total de niveles de retornos obtenidos en cada iteración

Bonus Track

Repetí los mismos ejercicios anteriores pero considerando la distribución de Pareto.

¿Notás alguna diferencia en las estimaciones e intervalos de confianza entre Pareto y Gumbel? ¿En qué casos habría diferencias más grandes?

Nivel de Retorno - Pareto

Es conveniente usar escalas anuales para calcular el nivel de retorno, de forma tener una interpretación simple:

El nivel de retorno anual N , es el valor que se espera superar 1 sola vez cada N años

Partiendo de que queremos calcular el área a derecha de un umbral, de una función de densidad que aproximamos con una de la **Familia Pareto Generalizada**

$$P(X > x | X > u) = \left[1 + \xi \left(\frac{x - u}{\sigma} \right) \right]^{-1/\xi}$$

usando definición de probabilidad condicional e igualando a $\frac{1}{n}$, obtenemos para el caso $\xi = 0$

$$z_n = u + \sigma \log(N - n_y P(X > u))$$

(página 81 en Coles & Trener)

Estimar los parámetros usando la función `gpd` de la librería `evir` (o alguna equivalente).