

# DÉSAISONNALISER UNE SÉRIE TEMPORELLE



## 1 - Rapide introduction à R

ALAIN QUARTIER-LA-TENTE



R : Logiciel statistique

RStudio : IDE le plus connu

CRAN : Plateforme centralisant un ensemble de packages R sous un format normalisé permettant une installation facile

GitHub : Plateforme de partage de code où l'on retrouve de nombreux packages en développement

# Aide

---

- Si vous ne connaissez pas les fonctions, Google/ChatGPT est votre ami
- Sinon `help(ma_fonction)` ou `?ma_fonction` pour chercher l'aide associée à `ma_fonction`. Voir aussi vignettes (documentation long format). Exemple :

```
# Pour voir l'ensemble des vignettes du package grid  
vignette(package = "grid")  
# Pour afficher une vignette en utilisant son nom  
vignette("moline", package = "grid")
```

- Cran Task Views (<https://cran.r-project.org/web/views/>) regroupement de packages selon des thèmes particuliers. Exemple pour ce cours : <https://cran.r-project.org/web/views/TimeSeries.html>

## Quelques conseils

---

- Éviter les chemins absous en utilisant les projets RStudio
- En cas d'erreur, prenez le temps de lire ce que le logiciel vous indique et cherchez à avoir un exemple minimal reproductible.

# Sommaire

---

## 1. Les types de base

1.1 Les vecteurs

1.2 Les matrices

1.3 Les listes

1.4 Le data.frame et tibble

## 2. Importation des données

## 3. Les séries temporelles

# Les vecteurs (1)

Les vecteurs sont les objets les plus simples : créés avec fonction `c()` et leurs éléments peuvent être manipulés avec l'opérateur `[`

```
v1 <- c(1, 2, 3); v2 <- c("a", "b")  
v1
```

```
[1] 1 2 3
```

```
v2
```

```
[1] "a" "b"
```

```
# v1 peut aussi se créer de façon équivalente avec :
```

```
1:3
```

```
[1] 1 2 3
```

```
# Pour concaténer deux vecteurs, notez le changement de type
```

```
v3 <- c(v1, v2)
```

```
v3
```

## Les vecteurs (2)

```
[1] "1" "2" "3" "a" "b"
```

```
v3[c(4, 1)] # 4e puis 1er élément
```

```
[1] "a" "1"
```

```
v3[-c(4, 1)] # on enlève 1er et 4e éléments
```

```
[1] "2" "3" "b"
```

```
# Les éléments peuvent également être nommés
```

```
v4 <- c(elem1 = 1, elem2 = 2, 4)
```

```
v4
```

elem1	elem2
-------	-------

1	2	4
---	---	---

```
names(v4)
```

```
[1] "elem1" "elem2" ""
```

## Les vecteurs (3)

```
names(v4)[1] <- "toto"  
v4
```

```
toto elem2  
1      2      4
```

```
v4[c("toto", "elem2")]
```

```
toto elem2  
1      2
```

# Les matrices (1)

Matrices : vecteurs à deux dimensions créés avec fonction `matrix()`

```
m1 <- matrix(1:12, ncol = 3); m2 <- matrix(1:12, nrow = 3)  
m1; t(m1); m1 * 2
```

```
[,1] [,2] [,3]  
[1,]    1    5    9  
[2,]    2    6   10  
[3,]    3    7   11  
[4,]    4    8   12
```

```
[,1] [,2] [,3] [,4]  
[1,]    1    2    3    4  
[2,]    5    6    7    8  
[3,]    9   10   11   12
```

## Les matrices (2)

```
[,1] [,2] [,3]  
[1,]    2    10   18  
[2,]    4    12   20  
[3,]    6    14   22  
[4,]    8    16   24
```

```
m1 %*% m2 # multiplication matricielle
```

```
[,1] [,2] [,3] [,4]  
[1,]  38   83  128  173  
[2,]  44   98  152  206  
[3,]  50  113  176  239  
[4,]  56  128  200  272
```

```
m1[, 1] # 1ere colonne : c'est un vecteur
```

```
[1] 1 2 3 4
```

## Les matrices (3)

```
m1[-2, ] # Tout sauf 2ème ligne
```

```
[,1] [,2] [,3]  
[1,]    1    5    9  
[2,]    3    7   11  
[3,]    4    8   12
```

```
# Nombre de lignes et de colonnes :  
nrow(m1); ncol(m1); dim(m1)
```

```
[1] 4
```

```
[1] 3
```

```
[1] 4 3
```

## Les matrices (4)

```
# De la même façon que pour les vecteurs on peut nommer lignes/  
colnames(m1) <- paste0("col", 1:ncol(m1))  
rownames(m1) <- paste0("row", 1:nrow(m1))  
m1
```

	col1	col2	col3
row1	1	5	9
row2	2	6	10
row3	3	7	11
row4	4	8	12

```
m1[, "col2"]
```

	row1	row2	row3	row4
	5	6	7	8

```
# Pour combiner des matrices, on peut utiliser cbind et rbind:  
cbind(m1, 1:4)
```

## Les matrices (5)

```
    col1 col2 col3  
row1    1    5    9 1  
row2    2    6   10 2  
row3    3    7   11 3  
row4    4    8   12 4
```

```
rbind(m1, m1)
```

```
    col1 col2 col3  
row1    1    5    9  
row2    2    6   10  
row3    3    7   11  
row4    4    8   12  
row1    1    5    9  
row2    2    6   10  
row3    3    7   11  
row4    4    8   12
```

## Les matrices (6)

On peut utiliser la fonction `apply` pour appliquer une fonction à toutes les lignes ou toutes les colonnes. Exemple :

```
apply(m1, 1, sum) # somme sur toutes les lignes (dimension 1)
```

```
row1 row2 row3 row4  
15    18    21    24
```

```
apply(m1, 2, sum) # somme sur toutes les colonnes (dimension 2)
```

```
col1 col2 col3  
10    26    42
```

# Les listes (1)

Une liste peut contenir tout type d'objet

```
11 <- list(v1, m1, v4); 11
```

```
[[1]]
```

```
[1] 1 2 3
```

```
[[2]]
```

	col1	col2	col3
row1	1	5	9
row2	2	6	10
row3	3	7	11
row4	4	8	12

```
[[3]]
```

```
toto elem2
```

```
1      2      4
```

## Les listes (2)

```
length(l1) # nombre d'éléments d'une liste
```

```
[1] 3
```

```
# On peut encore nommer les éléments de la liste :
```

```
names(l1) <- c("vect1", "mat", "vect2")
```

```
l1
```

```
$vect1
```

```
[1] 1 2 3
```

```
$mat
```

	col1	col2	col3
row1	1	5	9
row2	2	6	10
row3	3	7	11
row4	4	8	12

## Les listes (3)

```
$vect2  
toto elem2  
1      2      4
```

```
# Pour accéder à un élément d'une liste utiliser [[,  
# autrement on a encore une liste  
11[1] # liste d'un seul élément : v1
```

```
$vect1  
[1] 1 2 3
```

```
11[[1]] # premier élément de la liste
```

```
[1] 1 2 3
```

```
# On concatène deux listes avec fonction c:  
c(11, 11[-2])
```

## Les listes (4)

```
$vect1
```

```
[1] 1 2 3
```

```
$mat
```

	col1	col2	col3
row1	1	5	9
row2	2	6	10
row3	3	7	11
row4	4	8	12

```
$vect2
```

```
toto elem2
```

```
1 2 4
```

```
$vect1
```

```
[1] 1 2 3
```

# Les listes (5)

---

```
$vect2  
toto elem2  
1      2      4
```

# Le data.frame (1)

Entre les listes et matrices : comme un tableur, souvent utilisé pour stocker des données

```
d1 <- data.frame(col1 = c("a", "b", "c"), col2 = 1:3)  
d1
```

	col1	col2
1	a	1
2	b	2
3	c	3

# Le tibble (1)

tibble : comme un data.frame réinventé, plus permissif

```
library(tibble)
t1 <- tibble(col1 = c("a", "b", "c"), col2 = 1:3)
t1 # ou as.tibble(d1)
```

```
# A tibble: 3 x 2
  col1   col2
  <chr> <int>
1 a         1
2 b         2
3 c         3
```

## Le tibble (2)

```
# On peut aussi les définir ligne par ligne :  
tribble(  
  ~col1, ~col2,  
  "a", 1,  
  "b", 2,  
  "c", 3  
)
```

```
# A tibble: 3 x 2  
  col1   col2  
  <chr> <dbl>  
1 a         1  
2 b         2  
3 c         3
```

# Sommaire

---

**1. Les types de base**

**2. Importation des données**

**3. Les séries temporelles**

# Importer des données

---

Soyez fainéants et commencez par utiliser l'interface de RStudio (Environnement > Import Dataset).

# Sommaire

---

1. Les types de base

2. Importation des données

3. Les séries temporelles

## ts()

---

Il existe de nombreux formats pour gérer les séries temporelles. Les deux principales sont :

- `ts()` : format de base R simple à utiliser mais des difficultés à gérer les fréquences non-entières (journalières, hebdomadaires, etc.)
- `tsibble()` : inspiré du `tidyverse` (`tidyverts` <https://tidyverts.org>) mais pour la gestion des séries temporelles (non compatible avec les packages liés à JDemetra+)

## ts() (1)

On peut créer un objet avec la fonction `ts(data = ., start = ., frequency = .)`

```
x = ts(c(1:12), start = 2020, frequency = 4)
x; class(x)
```

	Qtr1	Qtr2	Qtr3	Qtr4
2020	1	2	3	4
2021	5	6	7	8
2022	9	10	11	12

```
[1] "ts"
```

```
mts <- ts(matrix(rnorm(30), 10, 3), start = c(1961, 1),
            frequency = 12)
mts; class(mts)
```

## ts() (2)

```
          Series 1      Series 2      Series 3
Jan 1961 -0.6264538  1.51178117  0.91897737
Feb 1961  0.1836433  0.38984324  0.78213630
Mar 1961 -0.8356286 -0.62124058  0.07456498
Apr 1961  1.5952808 -2.21469989 -1.98935170
May 1961  0.3295078  1.12493092  0.61982575
Jun 1961 -0.8204684 -0.04493361 -0.05612874
Jul 1961  0.4874291 -0.01619026 -0.15579551
Aug 1961  0.7383247  0.94383621 -1.47075238
Sep 1961  0.5757814  0.82122120 -0.47815006
Oct 1961 -0.3053884  0.59390132  0.41794156
```

```
[1] "mts"     "ts"       "matrix"   "array"
```

Pour manipulations : voir TP