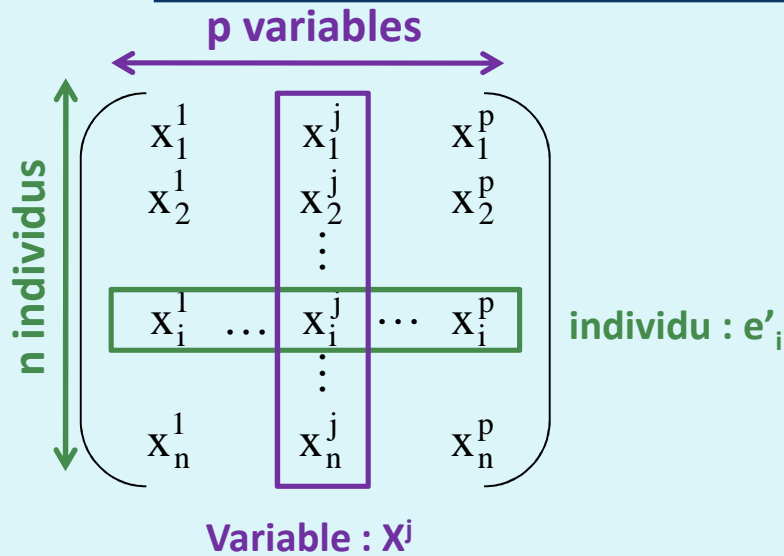


Analyse en composantes principales (A.C.P.)

L'ACP est une méthode descriptive permettant de représenter graphiquement l'essentielle de l'information contenu dans le tableau des données **quantitatives**



VARIABLE = Élément de \mathbb{R}^n

⇒ Visualisation des variables en fonction de leurs corrélations

INDIVIDU = Élément de \mathbb{R}^p

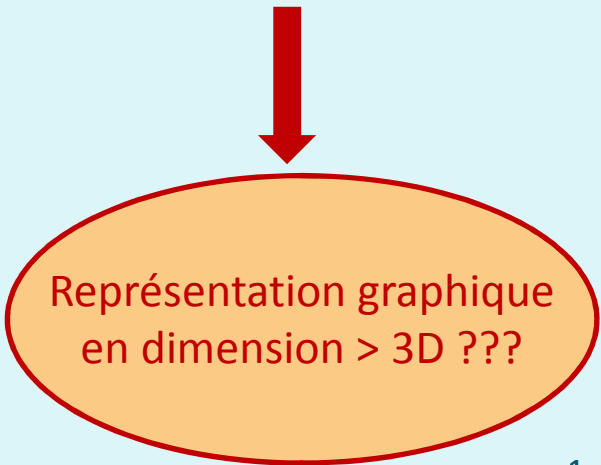
⇒ Visualisation des individus selon une distance appropriée

Perte d'information



Figure J.P. Fenelon

Projections
←
en 2D ou 3D



- ### Comment évaluer les ressemblances entre individus?
- Quels sont les individus qui se ressemblent?
 - Quels sont ceux qui sont différents?
 - Y-a-t'il des groupes homogènes d'individus?
 - Peut-on définir une typologie des individus?

Notion de distance entre individus

$i^{\text{ème}}$ individu : $e_i = (x_i^1, \dots, x_i^p)$
 $j^{\text{ème}}$ individu : $e_j = (x_j^1, \dots, x_j^p)$

distance entre e_i et e_j \rightarrow $\|e_i - e_j\|^2 = \sum_{k=1}^p (x_i^k - x_j^k)^2$

	Pop. (milliers)	Taux nat. (pour mille)	Esp. vie	Nb. enfants
Argentine	41050	16,87	75,87	2,19
Arménie	3099	15,47	74,44	1,77
Australie	21731	12,56	81,99	1,85
Autriche	8407	9,01	80,55	1,40

Problème des unités
(ordre de grandeurs des variables)

↓

Centrage et réduction

$$x_i^k \leftarrow \frac{x_i^k - \bar{x}^k}{S_k}$$

distance entre l'Argentine et l'Arménie

$$(41050-3099)^2 + (16,87-15,47)^2 + (75,87-74,44)^2 + (2,19-1,77)^2 = 1440278405$$

$$(41050-3099)^2 = 1440278401$$

Comment évaluer les liaisons entre variables?

- Quelles sont les variables liées positivement?
- Quelles sont les variables qui s'opposent?
- Y-a-t'il des groupes de variables liées?
- Peut-on définir une typologie des variables?

Traditionnellement, on utilise le coefficient de corrélation linéaire pour étudier le lien entre deux variables :

$$r(X^k, X^h) = \frac{\text{cov}(X^k, X^h)}{\sqrt{\text{var}(X^k)\text{var}(X^h)}}$$

Pourquoi?

Produit scalaire entre variables

Produit scalaire :	$\langle X^k, X^h \rangle = E[X^k X^h]$	Variables	$\langle X^k, X^h \rangle = \text{cov}(X^k, X^h)$
		➔	
Norme :	$\ X\ ^2 = E[X^2]$	centrées	$\ X\ ^2 = \text{var}(X)$

$$\cos(X^k, X^h) = \frac{\langle X^k, X^h \rangle}{\|X^k\| \|X^h\|} = r(X^k, X^h)$$

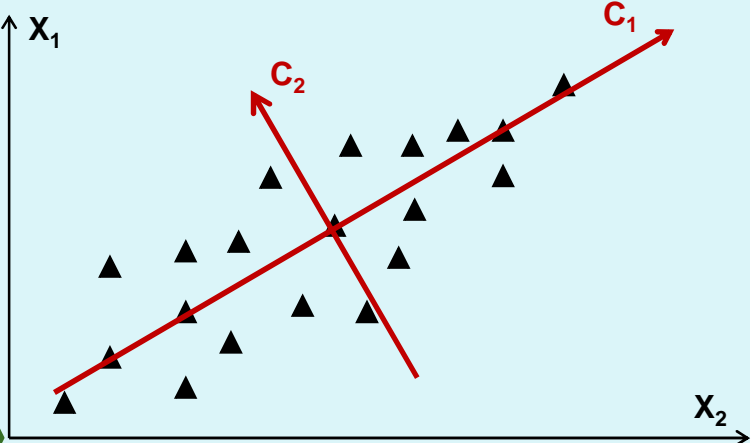
- $|r(X^k, X^h)| = 1 \Leftrightarrow$ les variables colinéaires
 - corrélées positivement si $r(X^k, X^h) = 1$
 - corrélées négativement si $r(X^k, X^h) = -1$
- $r(X^k, X^h) = 0 \Leftrightarrow$ les variables sont orthogonales
 - \Leftrightarrow les variables ne sont pas linéairement corrélées

Le principe de l'ACP est de trouver des espaces de petites dimensions sur lesquels les *projections* des individus minimisent la déformation de la réalité.

On cherche donc un sous-espace F_k de \mathbb{R}^p de dimension k ($k=2,3,..$) sur lequel projeté le nuage de points, c-a-d, on cherche k nouvelles variables combinaisons linéaires des p variables initiales tel que le nuage projeté garde le plus d'**information** possible.

nouvelles variables = composantes principales

- La 1^{ère} composante principale (C_1) doit « capturer » le maximum d'information
 Il reste un résidu d'information non expliquée
- La 2^{ème} composante principale (C_2) est calculée sur ce résidu telle que
 - Elle capture un maximum d'information
 - Elle soit non corrélée linéairement à C_1 (orthogonalité)
- Sur le même principe, calcul de C_3, C_4, \dots, C_p



On stoppe le processus quand résidu d'information négligeable

Nb. composantes principales = Nb. variables initiales

Comment mesurer l'information?

L'inertie est la dispersion du nuage de points

$$I = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n \| e_i - g \|^2$$

où g centre de gravité du nuage

N.B. Si les variables sont centrées-réduites, $I=p$

$$V = \begin{pmatrix} S_1^2 & S_{12} & \cdots & S_{1p} \\ & S_2^2 & \cdots & S_{2p} \\ & & \ddots & \vdots \\ & & & S_p^2 \end{pmatrix}$$

Matrice des
variance-covariances

$$I = \text{tr}(V)$$

Comment perdre le moins d'information possible?

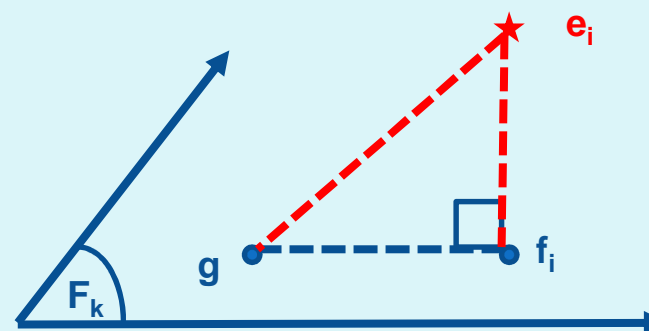
Soit f_i la projection orthogonale de e_i sur F_k .

On cherche F_k tel que la distance entre F_k et les individus soit minimale.

$$\text{minimiser} : \sum_{i=1}^n p_i \| e_i - f_i \|^2$$

D'après Pythagore, cela revient à maximiser l'inertie du nuage projeté

$$\text{maximiser} : \sum_{i=1}^n p_i \| f_i - g \|^2$$



N.B. p_i poids du $i^{\text{ème}}$ individu. En général $p_i=1/n$.

Solution du problème

$$F_k = \text{Vect}(u_1, u_2, \dots, u_k)$$

où u_k est le vecteur propre unitaire de V associé à la $k^{\text{ième}}$ plus grande valeur propre λ_k .

- L'inertie du nuage projeté sur u_k est λ_k
- L'inertie du nuage projeté sur F_k est $\lambda_1 + \dots + \lambda_k$
- L'inertie totale est $I = \lambda_1 + \dots + \lambda_p$

Les vecteurs propres sont appelés les **axes principaux**

- Le premier axe principal u_1 est associé à la plus grande valeur propre λ_1
- Le deuxième axe principal u_2 est associé à la deuxième valeur propre λ_2
- Etc,...

La projection des individus sur un axe principal est une nouvelle variable appelée **composante principale**

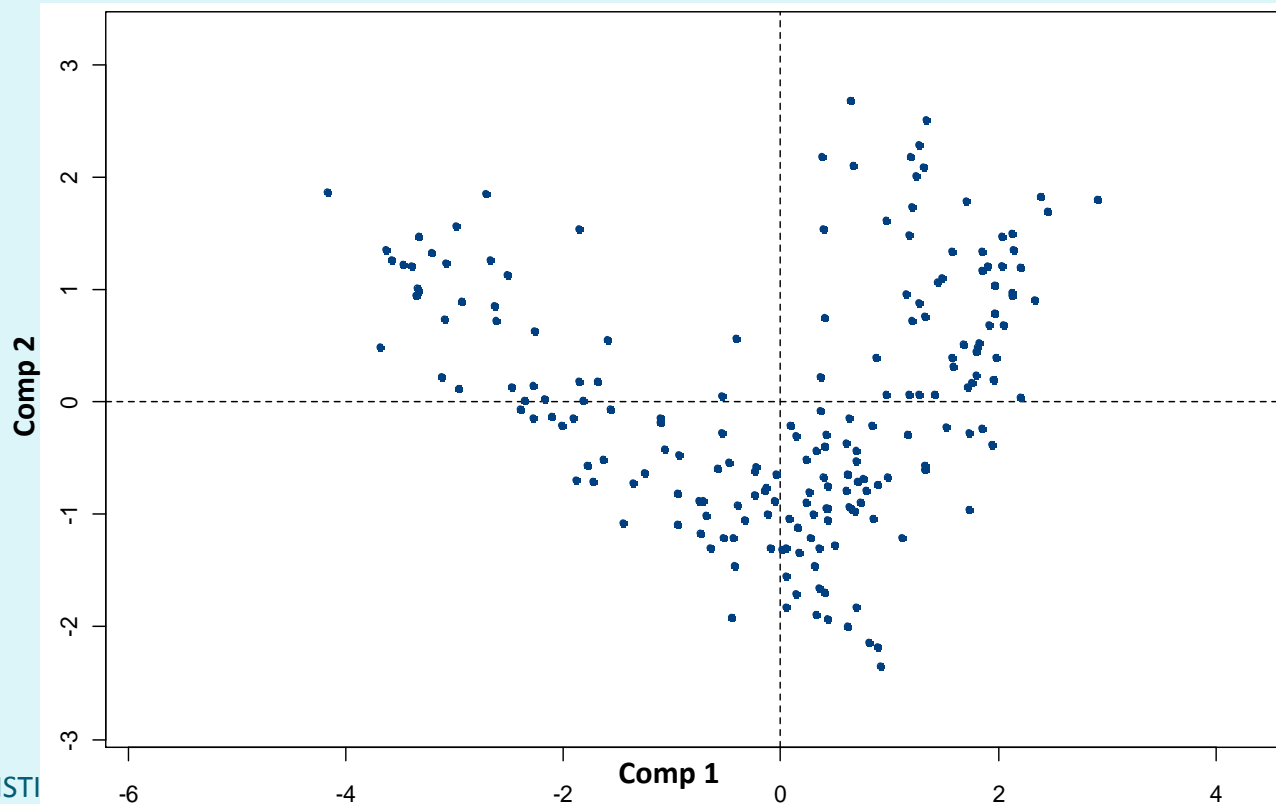
- La première composante c_1 représente les coordonnées des projections des individus sur l'axe u_1
- La deuxième composante c_2 représente les coordonnées des projections des individus sur l'axe u_2
- Etc...

Représentation graphique des individus

Exemple de la démographie mondiale avec les variables : TNAT, TMORT, EV, T65

	eigenvalue	percentage of variance	cumulative % of variance
comp 1	2.66302177	66.5755442	66.57554
comp 2	1.19799267	29.9498168	96.52536
comp 3	0.12720887	3.1802217	99.70558
comp 4	0.01177669	0.2944172	100.00000

4 variables
 \Leftrightarrow
 4 composantes principales

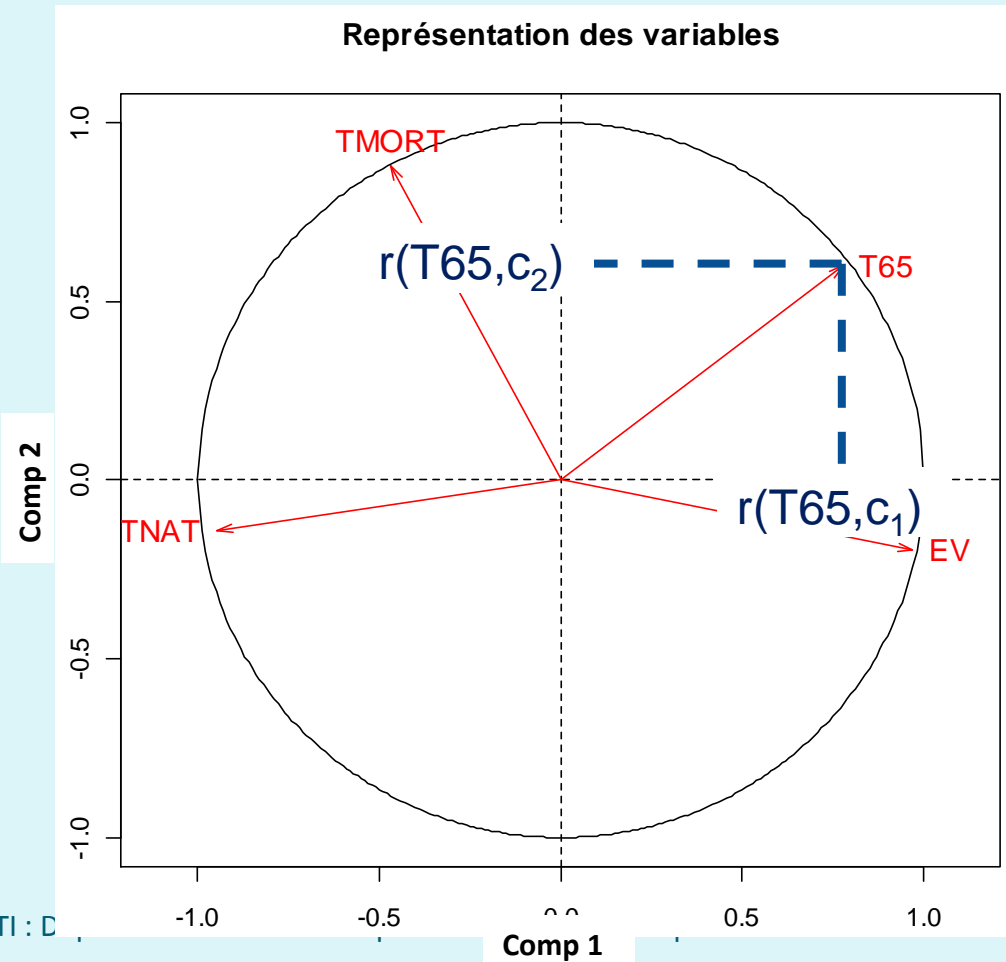


Représentation des individus (pays) sur les 2^{èmes} composantes principales

Comment interpréter ce graphique?

Représentation graphique des variables

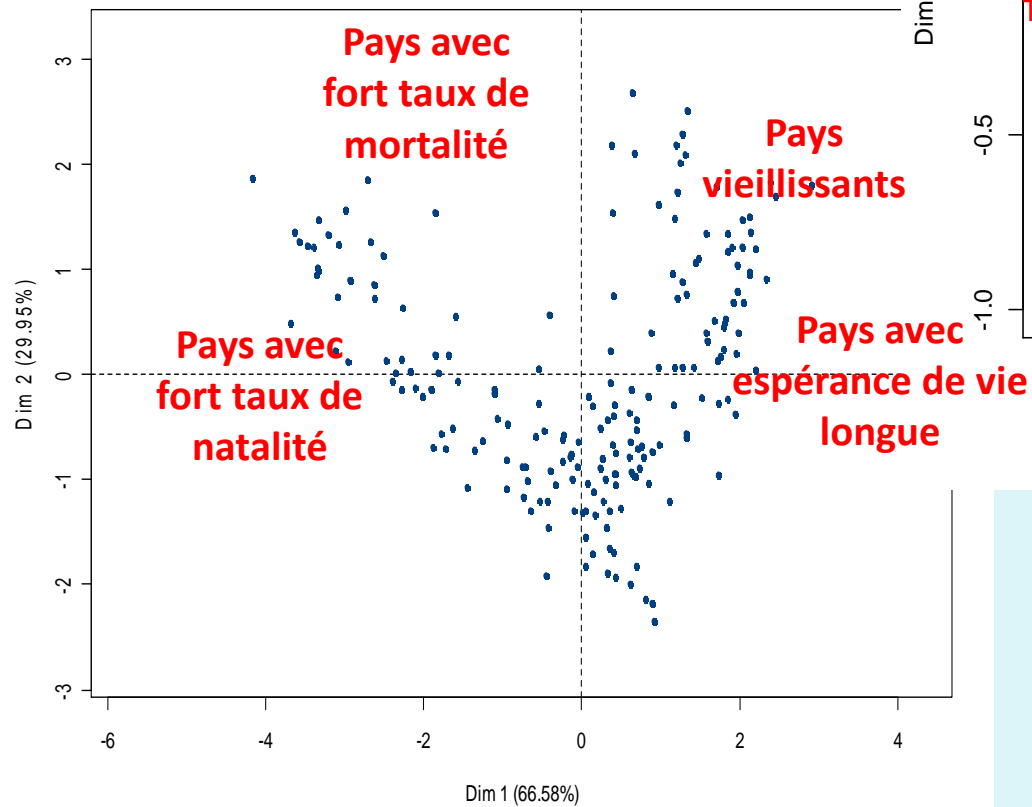
- \$cor = coordonnée=corrélation
- \$cos2= répartition de la variable sur les 4 axes principaux
La variable TNAT est représentée à 89.82% sur C₁ et 1.98% sur C₂ etc..
- \$contrib = contribution de la variable à la construction de l'axe
La variable TMORT ne contribue pas (8%) à la construction de c₁.



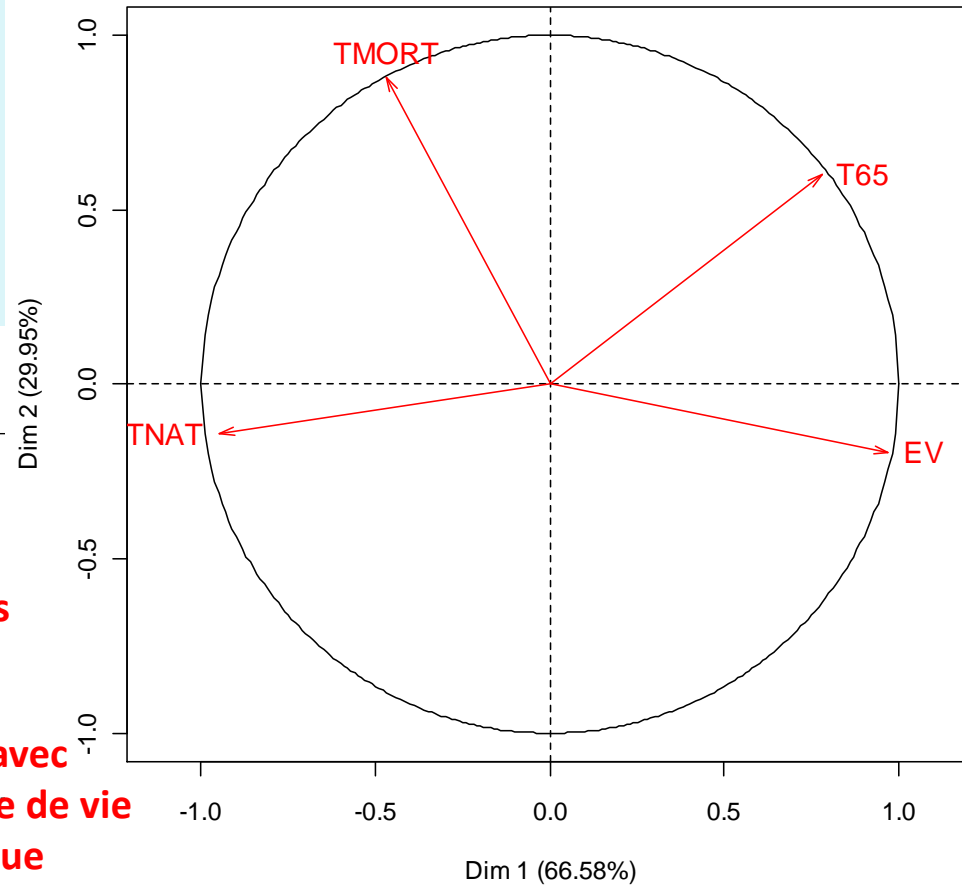
<u>\$cor</u>	Dim.1	Dim.2	Dim.3	Dim.4
TNAT	-0.9477642	-0.1409135	...	
TMORT	-0.4674138	0.8814408		
EV	0.9692397	-0.1966503		
T65	0.7790144	0.6021020		
<u>\$cos2</u>	Dim.1	Dim.2		
TNAT	0.8982571	0.01985663		
TMORT	0.2184757	0.77693792		
EV	0.9394256	0.03867136		
T65	0.6068634	0.36252677		
<u>\$contrib</u>	Dim.1	Dim.2		
TNAT	33.73074	1.657492		
TMORT	8.20405	64.853311		
EV	35.27668	3.228013		
T65	22.78853	30.261184		

Interprétation

Représentation des individus



Représentation des variables



- TNAT et EV sont corrélés négativement
les pays avec un fort taux de natalité ont une espérance de vie courte
- TMORT et T65 sont non corrélés

- La projection perd le moins d'information possible

⇒ *vérifier le % d'inertie expliquée par l'axe*

⇒ *conserver le nombre d'axes nécessaire pour avoir une inertie expliquée correcte*

Exemple démographique :

66,6% d'inertie expliquée par l'axe c_1 ⇒ 96,5% d'inertie expliquée par le plan (c_1, c_2)

29,9% d'inertie expliquée par l'axe c_2

Autre utilisation de l'ACP = réduire la dimension d'un problème

- Les variables sont bien représentées si elles sont proches du cercle. A contrario celles qui sont proches de l'origine sont peu corrélées avec les axes

⇒ *pas d'interprétation possible pour ces variables*

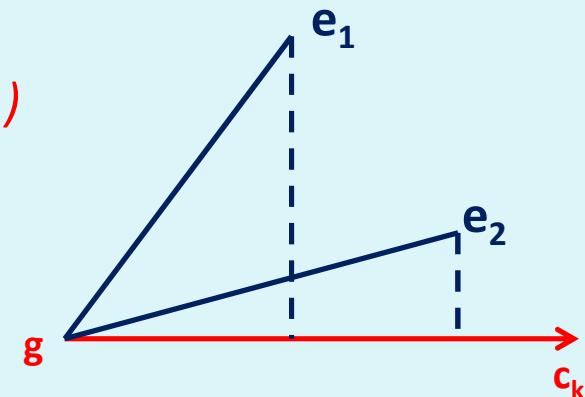
- Les individus sont bien représentés s'ils ne sont pas trop éloignés de l'axe sur lequel on les projette

⇒ *vérifier le cosinus entre l'individu et l'axe (proche de 1)*

⇒ *valable si l'individu loin du centre de gravité*

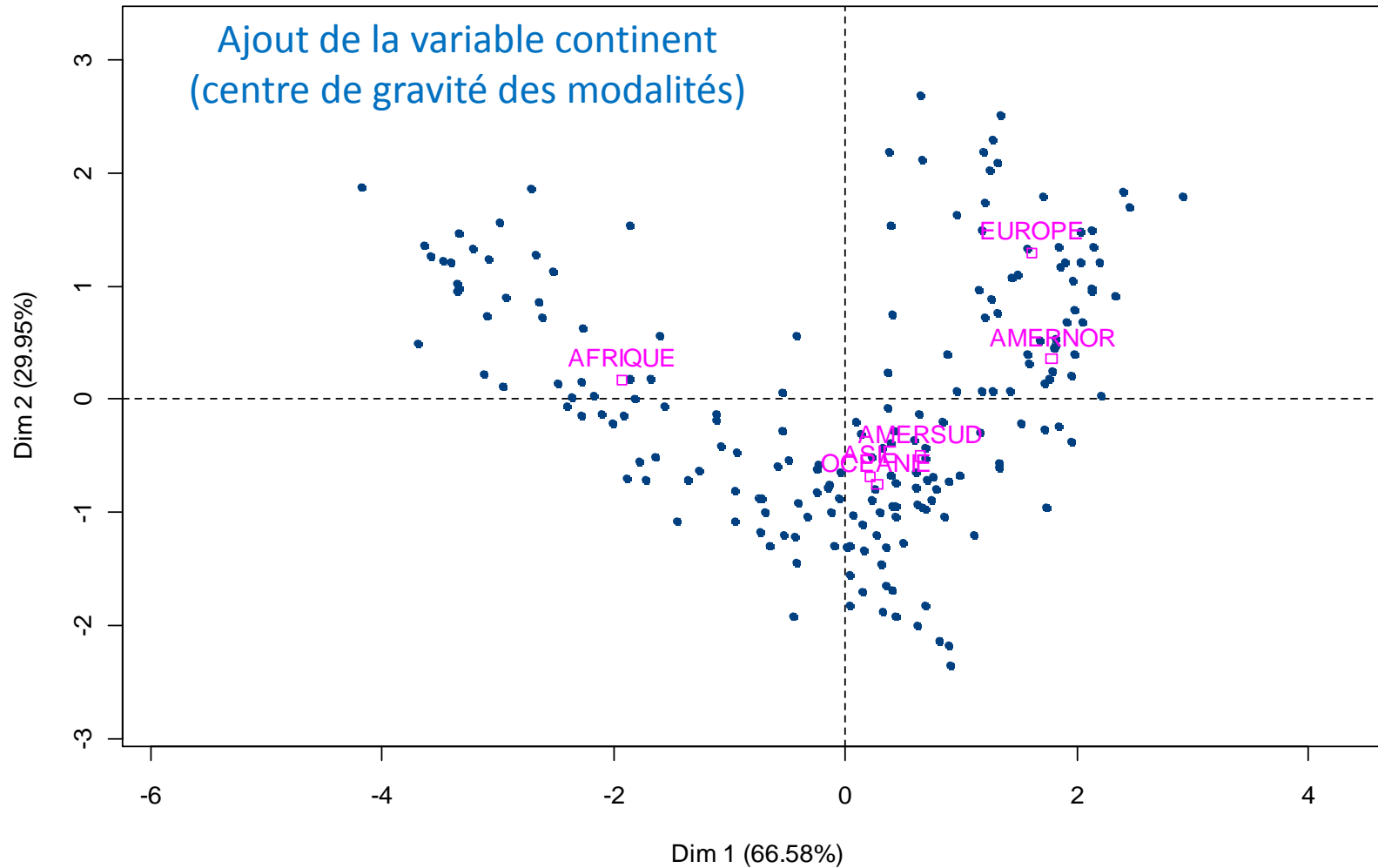
- Eliminer les individus ayant une contribution trop importante dans la construction de l'axe

⇒ *vérifier la contribution des individus*



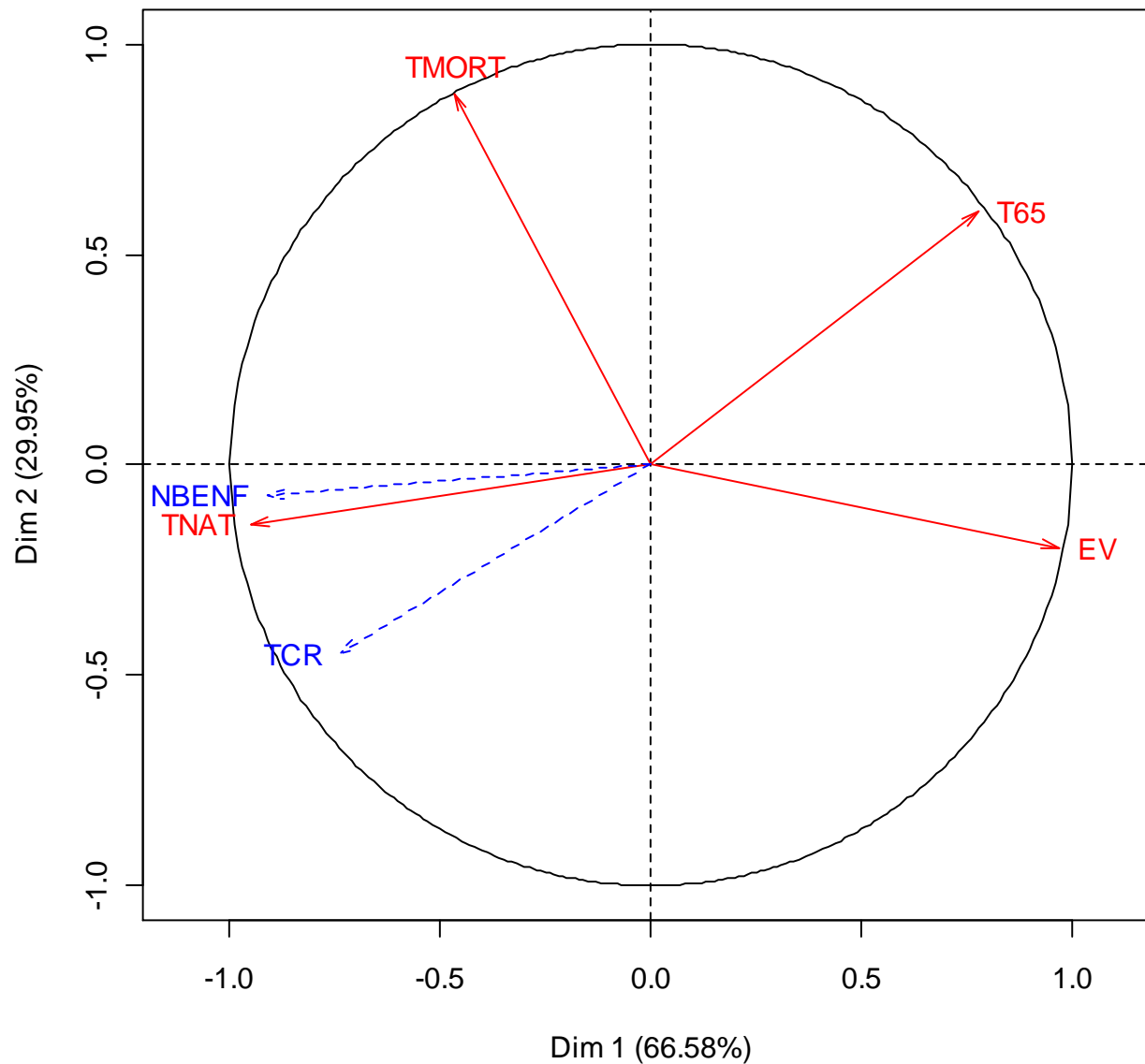
Ajout de variables ou individus

Il est possible d'ajouter des individus ou des variables aux représentations graphiques.
Ceux-ci ne participent pas à la construction des axes



Ajout de variables ou individus

Représentation des variables



Ajout des variables
nombre d'enfants
par femme et taux
de croissance