

Análisis Factorial

Ignacio Aguilera Martos

7 de enero de 2019

Estadística Multivariante

Link: [Documentos LaTeX en GitHub](#)

1. Explicación teórica del modelo
2. Explicación del ejemplo en R

Explicación teórica del modelo

Idea de AF

El objetivo de este modelo es, dada una matriz de covarianzas o de correlación, ser capaz de explicar esta matriz a partir de factores no observados llamados factores comunes, de forma que se pueda explicar la matriz con un número menor de variables que en un punto inicial.

De esta forma matricialmente si tenemos n observaciones de dimensión p

tendríamos una matriz $F = \begin{pmatrix} F_{11} & \dots & F_{1n} \\ \dots & \dots & \dots \\ F_{k1} & \dots & F_{kn} \end{pmatrix}$ de factores y

$L = \begin{pmatrix} l_{11} & \dots & l_{1k} \\ \dots & \dots & \dots \\ l_{p1} & \dots & l_{pk} \end{pmatrix}$ una matriz de coeficientes de forma que

$x - \mu = LF + \epsilon$ donde ϵ es un vector de errores.

Tipos

- EFA (Exploratory Factor Analysis): se usa para identificar relaciones complejas entre conceptos o grupos de conceptos.
- CFA (Confirmatory Factor Analysis): está dirigida a la confirmación de factores que ya se presuponen importantes para explicar la matriz de correlación o covarianza.

Procesos de ajuste

- Máxima verosimilitud: es una buena opción cuando los datos se distribuyen según una normal. Se intenta que el modelo de los factores obtenidos tenga máxima verosimilitud.
- Factorización en el eje principal: la intención es ir obteniendo factores de forma que el primero tenga la varianza lo más próxima al objetivo, el segundo factor la segunda varianza más próxima a la varianza objetivo, etc. Maximiza la fórmula del modelo.

La rotación de factores se emplea para obtener la estructura de factores más simple escogiendo una orientación de los mismos.

Rotación de factores

- Ortogonal: implica que los factores estén incorrelados y busca la estructura más simple.
- Oblicua: permite que los factores estén correlados y busca la estructura más simple.

No sólo tenemos que estudiar la generación de los factores, si no también cuántos factores debemos escoger.

Métodos para escoger el número de factores

- Regla de Kaiser: tomamos los valores propios de la matriz de entrada y comprobamos cuántos de ellos son mayores que 1. Este es el número de factores a tomar. En caso de no haberlo se toma un factor.
- Criterio de la gráfica de Cattell's: obtenemos los valores propios de la matriz de entrada y los pintamos de mayor a menor. Analizamos el cambio entre los valores propios y donde se produzca el último cambio brusco contamos el número de valores propios hasta él. Este es el número de factores. Es un método subjetivo y ampliamente criticado.

Métodos para escoger el número de factores

- VSS (Very Simple Structure): este procedimiento toma un modelo simplificado del problema e intenta ver para qué número de factores los valores obtenidos se acercan más a los que deberían ser.
- Comparación de modelos: intentan obtener una medida de cómo de bueno y complejo es el modelo creado con un número de factores dado, de forma que se intenta maximizar el resultado y minimizar la complejidad.
- OC (Optimal Coordinate): intenta eliminar la subjetividad del método de Cattell. Se calculan los gradientes en la misma gráfica de dicho método y se comprueba dónde hay un cambio más abrupto. Esto delimita el número de factores.
- AF (Acceleration Factor): persigue el mismo objetivo que el método anterior, salvo que en este caso se realiza el cálculo con la pendiente de la curva asociada.

Métodos para escoger el número de factores

- MAP (Minimum Average Partial) test: se realiza, desde $k=1$ hasta el número de variables menos 1 un análisis PCA del modelo con k número de factores. Se estudia cómo se comporta dicho modelo con k factores y se toma el valor de k para el cual se ha obtenido el mejor resultado.
- PA (Parallel Analysis): tomamos la misma gráfica que en el método de Cattell y generamos aleatoriamente un conjunto de valores. Estos valores representan los valores medios de los valores propios de matrices aleatorias con el mismo número de variables y datos que la original. Hallamos la media para estos valores y tomamos como número de factores el de los que superen este valor medio. Se puede ver como un refinamiento de la regla de Kaiser ajustando la cota.

Métodos para escoger el número de factores

- Comparación de datos: se realiza una comparación entre modelos con una separación en factores ya conocida como correcta comparando los valores propios de la matriz y los factores escogidos en cada caso. Se toma el número de factores del modelo cuyos valores propios se parezcan más a los del caso que estamos analizando.
- Convergencia de múltiples tests: esta estrategia busca de forma empírica el mejor número de factores analizando la convergencia del modelo.

El objetivo de CFA es, dada una hipótesis sobre el número de factores, si los factores están o no correlacionados y qué variables se relacionan con cada factor. Es por esto que EFA y CFA se usan en contextos muy diferentes aún siendo los dos tipos del mismo método.

Métodos para evaluar la hipótesis

- Ajuste absoluto: consiste en obtener una medida absoluta de cómo de ajusta el modelo hipotético a los valores proporcionados.
- Ajuste relativo: obtiene una medida comparativa de cómo funciona con respecto a un modelo llamado base. Este modelo es fijo y nos sirve para obtener una valoración absoluta del mismo muy mala, de forma que con el ajuste relativo obtenemos una medida de cuánto se acerca la medida de nuestra hipótesis a la de este modelo con mal ajuste.

Medidas de ajuste absoluto

- Test chi-cuadrado: nos da la diferencia entre la matriz de covarianza observada y predicha con el modelo hipotético. Cuanto más cercano sea el valor a cero mejor es el ajuste.
- Aproximación según la raíz cuadrada del error: se obtiene un valor entre 0 y 1 que mide el error del modelo con respecto a la observación. Cuanto más cercano sea el valor a 0 mejor es el ajuste.
- Raíz cuadrada de la media de los residuos al cuadrado y raíz cuadrada de la media de los residuos estandarizados al cuadrado: no sólo estudiamos los residuos si no que además estandarizamos las variables para que los valores obtenidos sean comparables. El rango de valores está entre 0 y 1 siendo 0 la mejor medida. Normalmente cuando tenemos una puntuación de menos de 0.08 decimos que el modelo es robusto

Medidas de ajuste absoluto

- Índice de bondad del ajuste e índice de bondad del ajuste equilibrado: son medidas del ajuste del modelo y la matriz de covarianza observada. El índice equilibrado pondera el valor de ajuste en la matriz de covarianza para cada factor en función de cuántas variables explique. Los valores que arroja están entre 0 y 1 siendo a partir de 0.9 un buen modelo.

Medidas de ajuste relativo

- Índice de ajuste normado e índice de ajuste no normado: el índice normado analiza las discrepancias entre el valor de la chi-cuadrado con los del modelo y los del modelo base. El problema de este índice es que no es insesgado, lo cual es corregido por el índice de ajuste no normado el cual se mueve entre 0 y 1, siendo valores mayores o iguales a 0.95 indicativos de un buen modelo.
- Índice de ajuste comparativo: el anterior índice normado tiene una alta sensibilidad a la dimensión de la muestra tomada, de forma que este índice se plante extender la idea sin este problema- Compara el ajuste del modelo con un modelo base independiente. Los valores de este índice están ente 0 y 1 siendo necesarios valores mayores o iguales a 0.9 para considerar a la hipótesis un buen modelo.

¿Cuál es la diferencia entonces con PCA?

Diferencia entre PCA y AF

- PCA no es más que un posible método de extracción en la primera fase de EFA en la que extraemos los factores. Tras esto viene la fase de rotación de los mismos para escoger una orientación.
- Precisamente, por la carencia de la rotación, PCA no obtiene unos factores únicos, mientras que EFA sí.
- AF es en general un método mucho más genérico y abierto que PCA.

Explicación del ejemplo en R

Paquetes a instalar

- `install.packages("psych")`: implementa Análisis Factorial Exploratorio
- `install.packages("GPArotation")`: implementa la Rotación de Factores
- `install.packages("cfa")`: implementa Análisis Factorial Confirmatorio

Importa los paquetes

- `library(psych)`
- `library(GPArotation)`

Funciones a usar

- `fa`: función del paquete `psych` que implementa Análisis Factorial Exploratorio.
- `factanal`: función del paquete `stats` que implementa Análisis Factorial Exploratorio con máxima verosimilitud.
- `prcomp`: función del paquete `stats` que implementa PCA.
- `principal`: función del paquete `psych` que implementa PCA devolviendo siempre los mejores factores.
- `cfa`: función del paquete `cfa` que implementa el análisis confirmatorio de factores.

¿Preguntas?

