



DEPARTAMENTO DE ESTATÍSTICA

03 junho 2023

## **Entrega 6**

Prof. Dr. George von Borries

Análise Multivariada 1

Aluno: Bruno Gondim Toledo | Matrícula: 15/0167636

## Questão 43

### Ex. 9.1 | Johnson & Wichern

Show that the covariance matrix

$$\rho = \begin{bmatrix} 1 & .63 & .45 \\ .63 & 1 & .35 \\ .45 & .35 & 1 \end{bmatrix}$$

for the  $p = 3$  standardized random variables  $Z_1, Z_2$ , and  $Z_3$  can be generated by  $m = 1$  factor model

$$Z_1 = .9F_1 + \epsilon_1, Z_2 = .7F_1 + \epsilon_2, Z_3 = .5F_1 + \epsilon_3$$

where  $Var(F_1) = 1, Cov(\epsilon, F_1) = 0$ , and

$$\Psi = Cov(\epsilon) = \begin{bmatrix} .19 & 0 & 0 \\ 0 & .51 & 0 \\ 0 & 0 & .75 \end{bmatrix}$$

That is, write  $\rho$  in the form of  $\rho = \mathbf{L}\mathbf{L}^T + \Psi$ .

#### Solução:

Do modelo geral,  $\mathbf{X} = \mu + \mathbf{L}\mathbf{F} + \epsilon$ , temos que  $\mathbf{L} = [ .9 \ .7 \ .5 ]$ , logo,

$$\mathbf{L}^T = \begin{bmatrix} .9 \\ .7 \\ .5 \end{bmatrix}$$

Multiplicando as matrizes  $\mathbf{L}$  e  $\mathbf{L}^T$ , obtemos

$$\mathbf{L}\mathbf{L}^T = \begin{bmatrix} .81 & .63 & .45 \\ .63 & .49 & .35 \\ .45 & .35 & .25 \end{bmatrix}$$

Somando essa matriz a matriz  $\Psi$ , obtemos

$$\mathbf{L}\mathbf{L}^T + \Psi = \begin{bmatrix} 1 & .63 & .45 \\ .63 & 1 & .35 \\ .45 & .35 & 1 \end{bmatrix}$$

Que é precisamente a matriz  $\rho$ , o que demonstra o resultado  $\square$

## Questão 44

### Ex. 9.2 | Johnson & Wichern

Use the information in Exercise 9.1.

- Calculate communalities  $h_i^2, i = 1, 2, 3$  and interpret these quantities.
- Calculate  $Corr(Z_i, F_1)$  for  $i = 1, 2, 3$ . Which variable might carry the greatest weight in “naming” the common factor? Why?

### Soluções:

a) As comunalidades são dadas por:  $\sum_{j=1}^n l_{ij}^2 = h_i^2$ . Para a matriz  $\mathbf{L} = [.9 \ .7 \ .5]$ , temos que as comunalidades são:

$$\begin{aligned}h_1^2 &= .81 \\h_2^2 &= .49 \\h_3^2 &= .25.\end{aligned}$$

Como as comunalidades são quantidades de variâncias de cada variável explicada pelos fatores, quanto maior for a comunalidade, maior será o poder de explicação daquela variável pelo fator. A comunalidade  $h_i^2$  assume valores no intervalo  $[0,1]$ . Desejamos, em geral, valores acima de 0.5. Neste caso, temos que  $h_1^2 > 0.5$ , enquanto  $h_2^2, h_3^2 < 0.5$ . Entretanto  $h_2^2 \approx 0.5$ , temos que  $h_2^2$  também pode ser utilizada.

b) Como  $Cov(\mathbf{X}, \mathbf{F} = \mathbf{L})$ , e  $Cov(\mathbf{X}_i, \mathbf{F}_j) = \ell_{ij}$ , sabemos que  $Cor(\mathbf{Z}_i, \mathbf{F}_1)$ , para  $i = 1, 2, 3$  será  $\ell_{i1} = [.9 \ .7 \ .5] = \mathbf{L}$ . Isso indica que a variável  $Z_1$  carrega a maior carga fatorial, dado seu maior valor absoluto (comparando também com o último resultado encontrado sobre comunalidade).

## Questão 45

### Ex. 9.3 | Johnson & Wichern

The eigenvalues and eigenvectors of the correlation matrix  $\rho$  in Exercise 9.1 are

$$\begin{aligned}\lambda_1 &= 1.96, & e'_1 &= [.625, .594, .507] \\ \lambda_2 &= .68, & e'_2 &= [-.219, -.491, .843] \\ \lambda_3 &= .36, & e'_3 &= [.749, -.638, -.177]\end{aligned}$$

(a) Assuming an  $m = 1$  factor model, calculate the loading matrix  $\mathbf{L}$  and matrix of specific variances  $\Psi$  using the principal component solution method. Compare the results with those in Exercise 9.1.

(b) What proportion of the total population variance is explained by the first common factor?

### Soluções

a)

b) A proporção da variância explicada pelo primeiro fator comum é  $\frac{\lambda_1}{\sum_{i=1}^3 \lambda_i} = \frac{1.96}{1.96+0.68+0.36} = \frac{1.96}{3} \approx 0.65$ .

## Questão 51

### Ex. 9.19 | Johnson & Wichern

A firm is attempting to evaluate the quality of its sales staff and is trying to find an examination or series of test that may reveal the potential for good performance in sales. The firm has selected a random sample of 50 sales people and has evaluated each on 3 measures of performance: growth of sales, profitability of sales, and new-account sales. These measures have been converted to a scale, on which 100 indicates “average” performance. Each of the 50 individuals took each 4 test, which purported to measure creativity, mechanical reasoning, abstract reasoning, and mathematical ability, respectively. The  $n = 50$  observations on  $p = 7$  variables are listed in Table 9.12.

- (a) Assume an orthogonal factor model for the standardized variables  $Z_i = \frac{(X_i - \mu_i)}{\sqrt{\sigma_{ii}}}$ ,  $i = 1, 2, \dots, 7$ . Obtain either the principal component solution or the maximum likelihood solution for  $m = 2$  and  $m = 3$  common factors.
- (b) Given your solution in (a), obtain the rotated loadings for  $m = 2$  and  $m = 3$ . Compare the two sets of rotated loadings. Interpret the  $m = 2$  and  $m = 3$  factor solutions.

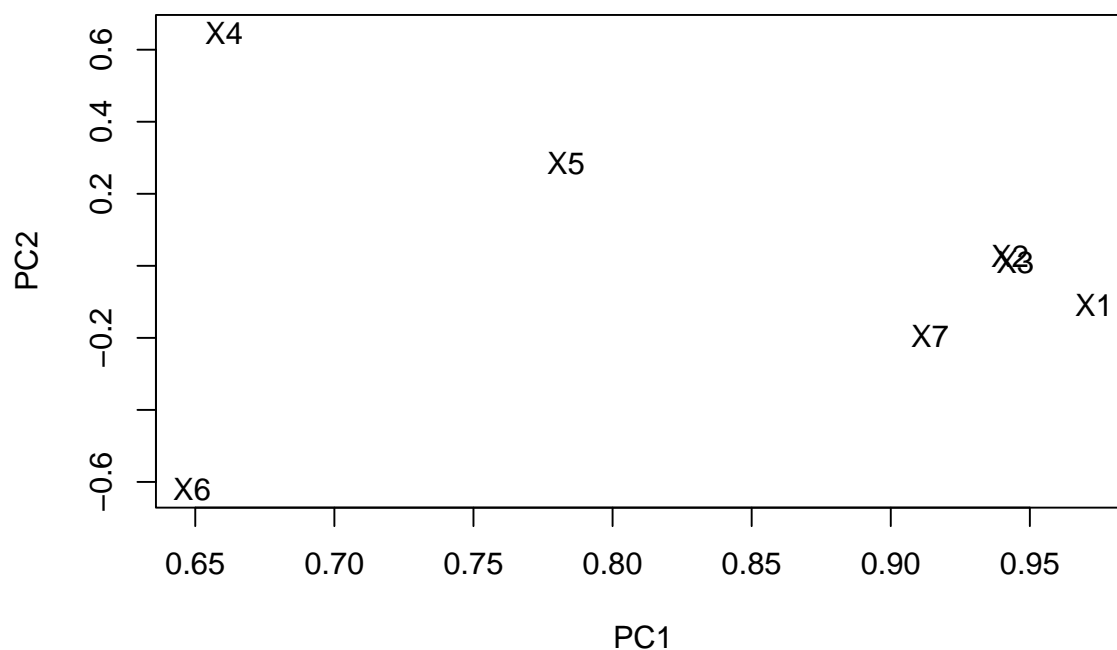
- (c) List the estimated communalities, specific variances, and  $\hat{\mathbf{L}}\hat{\mathbf{L}}^T + \hat{\mathbf{\Psi}}$  for the  $m = 2$  and  $m = 3$  solutions. Compare the results. Which choice of  $m$  do you prefer at this point? Why?
- (d) Conduct a test of  $H_0 : \mathbf{\Sigma} = \mathbf{L}\mathbf{L}' + \mathbf{\Psi}$  versus  $H_1 : \mathbf{\Sigma} \neq \mathbf{L}\mathbf{L}' + \mathbf{\Psi}$  for both  $m = 2$  and  $m = 3$  at the  $\alpha = .01$  level. With these results and those in Parts b and c, which choice of  $m$  appears to be the best?
- (e) Suppose a new salesperson, selected at random, obtains the test scores  $\mathbf{x}' = [x_1, x_2, \dots, x_7] = [110, 98, 105, 15, 18, 12, 35]$ . Calculate the salesperson's factor score using the weighted least squares method and the regression method.

## Soluções

a)

### Solução por componentes principais para $m = 2$ :

```
## Principal Components Analysis
## Call: principal(r = dados, nfactors = 2, rotate = "none", covar = FALSE)
## Standardized loadings (pattern matrix) based upon correlation matrix
##      PC1    PC2    h2    u2 com
## X1 0.97 -0.11 0.96 0.041 1.0
## X2 0.94  0.03 0.89 0.110 1.0
## X3 0.94  0.01 0.89 0.107 1.0
## X4 0.66  0.65 0.85 0.147 2.0
## X5 0.78  0.28 0.69 0.305 1.3
## X6 0.65 -0.62 0.81 0.194 2.0
## X7 0.91 -0.19 0.87 0.127 1.1
##
##
##      PC1    PC2
## SS loadings      5.03 0.93
## Proportion Var    0.72 0.13
## Cumulative Var    0.72 0.85
## Proportion Explained 0.84 0.16
## Cumulative Proportion 0.84 1.00
##
## Mean item complexity = 1.3
## Test of the hypothesis that 2 components are sufficient.
##
## The root mean square of the residuals (RMSR) is 0.08
## with the empirical chi square 11.93 with prob < 0.15
##
## Fit based upon off diagonal values = 0.99
```



Solução por máxima verossimilhança para  $m = 3$ :

```
##
## Call:
## factanal(factors = 3, covmat = cor(dados), rotation = "none")
##
## Uniquenesses:
##   X1   X2   X3   X4   X5   X6   X7
## 0.039 0.034 0.088 0.005 0.447 0.005 0.038
##
## Loadings:
##   Factor1 Factor2 Factor3
## X1  0.901   0.381
## X2  0.775   0.600
## X3  0.931   0.202
## X4  0.733  -0.118   0.666
## X5  0.689   0.225   0.169
## X6  0.757  -0.132  -0.636
## X7  0.762   0.608  -0.110
##
##               Factor1 Factor2 Factor3
## SS loadings      4.445   0.998   0.901
## Proportion Var    0.635   0.143   0.129
## Cumulative Var    0.635   0.778   0.906
##
## The degrees of freedom for the model is 3 and the fit was 1.4186
```

b)

Rotação varimax na solução por componentes principais para  $m = 2$ :

```
## Principal Components Analysis
## Call: principal(r = dados, nfactors = 2, rotate = "varimax", covar = FALSE)
## Standardized loadings (pattern matrix) based upon correlation matrix
##      RC1   RC2   h2    u2 com
## X1 0.79  0.58 0.96 0.041 1.8
## X2 0.67  0.66 0.89 0.110 2.0
## X3 0.68  0.65 0.89 0.107 2.0
## X4 0.04  0.92 0.85 0.147 1.0
## X5 0.38  0.74 0.69 0.305 1.5
## X6 0.90 -0.01 0.81 0.194 1.0
## X7 0.80  0.48 0.87 0.127 1.6
##
##
##      RC1   RC2
## SS loadings      3.13 2.84
## Proportion Var    0.45 0.41
## Cumulative Var    0.45 0.85
## Proportion Explained 0.52 0.48
## Cumulative Proportion 0.52 1.00
##
## Mean item complexity = 1.6
## Test of the hypothesis that 2 components are sufficient.
##
## The root mean square of the residuals (RMSR) is 0.08
## with the empirical chi square 11.93 with prob < 0.15
##
## Fit based upon off diagonal values = 0.99
```

**Rotação quartimax na solução por máxima verossimilhança para  $m = 3$ :**

```
##
## Call:
## factanal(factors = 3, covmat = cor(dados), rotation = "quartimax")
##
## Uniquenesses:
##      X1      X2      X3      X4      X5      X6      X7
## 0.039 0.034 0.088 0.005 0.447 0.005 0.038
##
## Loadings:
##      Factor1 Factor2 Factor3
## X1 0.964          0.160
## X2 0.976          -0.114
## X3 0.891 0.281 0.196
## X4 0.544 0.830
## X5 0.698 0.256
## X6 0.572 -0.102 0.811
## X7 0.971 -0.139
##
##
##      Factor1 Factor2 Factor3
## SS loadings      4.731 0.869 0.745
## Proportion Var    0.676 0.124 0.106
## Cumulative Var    0.676 0.800 0.906
##
## The degrees of freedom for the model is 3 and the fit was 1.4186
```

**Interpretação:** No caso da solução para  $m = 2$ , foi utilizada a rotação varimax que busca explicitar a relação entre os fatores, enquanto na solução para  $m = 3$  optei por utilizar a rotação quartimax, que busca minimizar o número de fatores necessários para explicar a variável. Em ambos os casos, notamos que a variância acumulada na primeira carga aumenta, em especial para a rotação quartimax para  $m = 3$ .

Como assumimos a ortogonalidade do modelo ao início do problema, optamos por essas duas rotações ortogonais. Como sabemos, a rotação da base serve para encontrar a posição de maior variância explicada pela elipsoide projetada no plano; não alterando portanto a informação contida nos dados.

c)

**Solução:** Para permitir a comparabilidade, o ideal agora é solucionar pelo mesmo método. Irei optar por componentes principais em ambos os casos. Para  $m = 2$ , temos as communalidades  $h_i^2 \approx [.95 .88 .89 .85 .69 .80 .87]$ , variância específica  $[.04 .11 .10 .14 .30 .19 .12]$  e  $\hat{\mathbf{L}}\hat{\mathbf{L}} + \hat{\mathbf{\Psi}} =$

##		X1	X2	X3	X4	X5	X6	X7
##	X1	1.0000000	0.9144237	0.9183475	0.57280177	0.7314249	0.69837236	0.9104147
##	X2	0.9144237	1.0000000	0.8910297	0.64086858	0.7466052	0.59420052	0.8564286
##	X3	0.9183475	0.8910297	1.0000000	0.62957641	0.7425467	0.60746435	0.8619032
##	X4	0.5728018	0.6408686	0.6295764	1.0000000	0.7012578	0.02760441	0.4785904
##	X5	0.7314249	0.7466052	0.7425467	0.70125775	1.0000000	0.33135247	0.6608599
##	X6	0.6983724	0.5942005	0.6074644	0.02760441	0.3313525	1.0000000	0.7132694
##	X7	0.9104147	0.8564286	0.8619032	0.47859044	0.6608599	0.71326939	1.0000000

Enquanto para  $m = 3$  temos as communalidades  $h_i^2 = [.96 .98 .91 .95 .69 .98 .96]$ , variância específica  $[.03 .01 .08 .04 .30 .01 .03]$  e  $\hat{\mathbf{L}}\hat{\mathbf{L}} + \hat{\mathbf{\Psi}} =$

##		X1	X2	X3	X4	X5	X6	X7
##	X1	1.0000000	0.9310552	0.9106726	0.5558314	0.7312023	0.6756780	0.9267290
##	X2	0.9310552	1.0000000	0.8460429	0.5413962	0.7453005	0.4611764	0.9520558
##	X3	0.9106726	0.8460429	1.0000000	0.6754796	0.7431488	0.6688506	0.8177744
##	X4	0.5558314	0.5413962	0.6754796	1.0000000	0.7025890	0.1633383	0.3810153
##	X5	0.7312023	0.7453005	0.7431488	0.7025890	1.0000000	0.3331328	0.6595801
##	X6	0.6756780	0.4611764	0.6688506	0.1633383	0.3331328	1.0000000	0.5827824
##	X7	0.9267290	0.9520558	0.8177744	0.3810153	0.6595801	0.5827824	1.0000000

Se compararmos com a matriz  $\rho$  de variância-covariância:

##		X1	X2	X3	X4	X5	X6	X7
##	X1	1.0000000	0.9260758	0.8840023	0.5720363	0.7080738	0.6744073	0.9273116
##	X2	0.9260758	1.0000000	0.8425232	0.5415080	0.7459097	0.4653880	0.9442960
##	X3	0.8840023	0.8425232	1.0000000	0.7003630	0.6374712	0.6410886	0.8525682
##	X4	0.5720363	0.5415080	0.7003630	1.0000000	0.5907360	0.1469074	0.4126395
##	X5	0.7080738	0.7459097	0.6374712	0.5907360	1.0000000	0.3859502	0.5745533
##	X6	0.6744073	0.4653880	0.6410886	0.1469074	0.3859502	1.0000000	0.5663721
##	X7	0.9273116	0.9442960	0.8525682	0.4126395	0.5745533	0.5663721	1.0000000

Neste caso, notamos que com  $m = 2$  já é possível obter  $\approx 85\%$  da variância, o que me parece ser um valor bem razoável pelo tamanho da redução. Portanto, eu optaria pela solução com  $m = 2$  para problemas não tão conservadores, em que é satisfatório este valor. Talvez se fosse um estudo muito crítico e com necessidade de ser conservador, pudesse ser considerada a solução para  $m = 3$ .

d)

e)