

Initiation à l'analyse factorielle des correspondances

A.B. Dufour & M. Royer & J.R. Lobry

Dans cette fiche, on étudie l'Analyse Factorielle des Correspondances. Cette technique statistique permet de réduire le nombre de variables, afin d'obtenir une représentation graphique des tableaux de contingence. Elle vise à y rassembler la quasi-totalité de l'information initiale, en s'attachant aux correspondances entre les caractères.

Table des matières

| 1 | Exe | emple introductif | 2 |
|-------------------------|-------|--|----|
| | 1.1 | Les données | 2 |
| | 1.2 | Définition d'un score a priori | 3 |
| | 1.3 | Notion de score optimum | |
| | 1.4 | Représentations graphiques | |
| 2 | Tab | ole de Contingence | 5 |
| | 2.1 | Tableau des données | 5 |
| | 2.2 | Tableaux des profils lignes et colonnes | |
| | 2.3 | Lien avec le test du χ^2 d'indépendance | 9 |
| 3 | Cor | npréhension des résultats d'une AFC | 10 |
| | 3.1 | Le tableau analysé | 10 |
| | 3.2 | Les pondérations | 11 |
| | 3.3 | La matrice diagonalisée | |
| | 3.4 | Les coordonnées des lignes | |
| | 3.5 | Les coordonnées des colonnes | 12 |
| | 3.6 | Lien avec le Khi-Deux | 13 |
| | 3.7 | Visualisation finale | 13 |
| 4 | App | plication | 15 |
| \mathbf{R}^{ϵ} | éfére | nces | 15 |





1 Exemple introductif

1.1 Les données

L'exemple porte sur la couleur des yeux et la couleur des cheveux de 592 étudiants. Les données ont été collectées dans le cadre d'un projet de classe par les étudiants d'un cours de statistique élémentaire à l'Université de Delaware [2].

```
snee74 <- read.table("http://pbil.univ-lyon1.fr/R/donnees/snee74.txt",</pre>
header = TRUE)
names(snee74)
[1] "cheveux" "yeux"
                           "sexe"
head(snee74)
  cheveux
             yeux
                      sexe
     Noir Marron
             Bleu Femelle
Bleu Male
    Blond
     Noir
   Marron Marron
                   Femelle
     Roux Marron
                      Male
             Bleu
```

La couleur des cheveux est définie par 4 modalités : blond, marron, noir et roux.

```
cheveux <- snee74$cheveux
summary(cheveux)

Blond Marron Noir Roux
127 286 108 71</pre>
```

La couleur des yeux est définie par 4 modalités : bleu, marron, noisette et vert.

```
yeux <- snee74$yeux
summary(yeux)
Bleu Marron Noisette Vert
```

Le lien entre les deux couleurs s'obtient à l'aide d'un tableau croisé qui ventile la population entre les modalités de ces deux variables qualitatives. C'est une table de contingence.

```
      (couleurs <- table(yeux, cheveux))</th>

      cheveux

      yeux
      Blond Marron Noir Roux

      Bleu
      94
      84
      20
      17

      Marron
      7
      119
      68
      26

      Noisette
      10
      54
      15
      14

      Vert
      16
      29
      5
      14
```

Par commodité, on transforme cet objet en un data.frame :

```
(dfcouleurs <- data.frame(unclass(couleurs)))

Blond Marron Noir Roux
Bleu 94 84 20 17
Marron 7 119 68 26
Noisette 10 54 15 14
Vert 16 29 5 14
```

 $\label{logiciel R version 2.11.1 (2010-05-31) - tdr620.rnw - Page 2/15 - Compilé le 2010-11-15 \\ Maintenance : S. Penel, URL : http://pbil.univ-lyon1.fr/R/pdf/tdr620.pdf$





1.2 Définition d'un score a priori

On va affecter *a priori* un score à chacune des colonnes (*couleur des cheveux*), par exemple (1,-1,-1,1), qui opère une opposition entre cheveux foncés (Marron, Noir) et clairs (Blond, Roux).

Pour chaque ligne de la table de contingence (couleur des yeux), une fréquence observée correspond à chaque couleur de cheveux. Ainsi, pour la modalité yeux Bleu on obtient :

```
dfcouleurs <- data.frame(unclass(couleurs))
dfcouleurs["Bleu", ]/sum(dfcouleurs["Bleu", ])

Blond Marron Noir Roux
Bleu 0.4372093 0.3906977 0.09302326 0.07906977
```

Il est alors possible de calculer le score moyen pour la modalité yeux Bleu:

```
yeux.bleu <- dfcouleurs["Bleu", ]/sum(dfcouleurs["Bleu", ])
yeux.bleu * scorecheveux

Blond Marron Noir Roux
Bleu 0.4372093 -0.3906977 -0.09302326 0.07906977
sum(yeux.bleu * scorecheveux)

[1] 0.03255814
```

Ce score moyen positif montre que les individus aux yeux Bleu ont des cheveux plutôt clairs.

Ce score moyen peut être calculé pour toutes les couleurs de yeux.

Pour les yeux marrons, on obtient un score moyen égal à -0.7 qui est négatif et indique donc que les cheveux foncés dominent dans cette sous-population.

On pourrait assez bien séparer les 4 couleurs des yeux sur la base du score proposé pour la couleur des cheveux. Cependant, deux questions se posent :

- \star Existe-t-il un score des cheveux qui permet de discriminer encore mieux la couleur des yeux?
- * Lorsqu'on connaît moins bien le sujet, (ici, l'opposition clair/foncé est naturelle), comment définir un score qui permette de mieux comprendre la structure du tableau de données?





1.3 Notion de score optimum

L'Analyse Factorielle des Correspondances (AFC) est la méthode permettant de définir pour une table de contingence un score sur les colonnes tel que les scores moyens des lignes (obtenus en utilisant les fréquences des tableaux de profils) soient les plus séparés possibles, au sens de la variance de ces scores moyens. Et inversement.

Cette méthode choisit comme score optimal pour les colonnes (cheveux) les valeurs :

```
library(ade4)
ac <- dudi.coa(dfcouleurs, scannf = F, nf = 3)
rownames(ac$c1)
[1] "Blond" "Marron" "Noir" "Roux"
ac$c1[, 1]
[1] 1.8282287 -0.3244635 -1.1042772 -0.2834725</pre>
```

On vérifie que les valeurs extrêmes sont obtenues pour les modalités Blond et Noir, ce qui reflète que la structure majeure de ce jeu de données est l'opposition clair/foncé.

Exercice. Retrouver le score moyen des lignes (couleur des yeux) à partir des scores optimaux de la couleur des cheveux obtenus par l'AFC. Réponse :

```
Bleu Marron Noisette Vert
0.5474139 -0.4921577 -0.2125969 0.1617534
```

Il est important de noter que si on cherche d'abord les scores optimaux pour le critère *couleur des yeux* par la méthode AFC (coordonnées des lignes, 1i sous ade4), on obtient le même résultat :

```
[1] "Bleu" "Marron" "Noisette" "Vert" [1] 0.5474139 -0.4921577 -0.2125969 0.1617534
```

Le raisonnement que l'on vient de tenir peut se reproduire dans la recherche de score moyen des couleurs de cheveux à partir des scores optimaux de la couleur des yeux.

```
rownames(ac$co)
[1] "Blond" "Marron" "Noir" "Roux"
ac$co[, 1]
[1] 0.8353478 -0.1482527 -0.5045624 -0.1295233
```

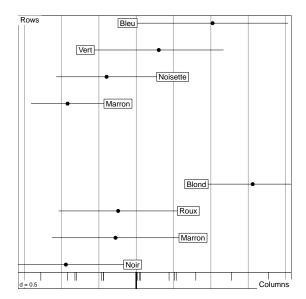
1.4 Représentations graphiques

On peut alors donner une représentation graphique des valeurs obtenues pour les scores des lignes (resp. des colonnes) pour le premier score optimal des colonnes (resp. des lignes).

```
score(ac)
```

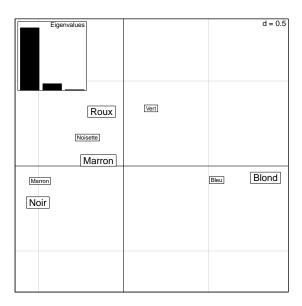






Et pour finir, on donne une représentation graphique des résultats obtenus sur les deux premiers scores optimaux.

scatter(ac)



2 Table de Contingence

2.1 Tableau des données

La table engendrée par le croisement de deux variables qualitatives s'appelle une $table\ de\ contingence$ observée. Il est important de rappeler que :

i) tout individu présente une modalité et une seule de chaque variable;





ii) chaque modalité doit avoir été observée au moins une fois, sinon elle est supprimée.

Les données proviennent d'une société d'assurance automobile. Les deux variables retenues pour l'analyse sont :

- 1. le mode de règlement : annuel, mensuel, semestriel ou trimestriel;
- 2. la situation maritale : célibataire, concubin, divorcé, marié ou veuf.

On construit la table de contingence liée à ces variables.

Les informations de base sont le nombre total d'individus (n), le nombre de modalités pour la variable 'mode de règlement' (I) et le nombre de modalités pour la variable 'situation maritale' (J).

```
n <- sum(sitpay)
I <- nrow(sitpay)
J <- ncol(sitpay)</pre>
```

On peut construire le tableau des fréquences relatives où chaque terme est de la forme $f_{ij} = \frac{n_{ij}}{n}$.

On peut obtenir différentes représentations graphiques de la table de contingence. Le principe est d'utiliser des symboles dont la surface est proportionelle aux effectifs :

```
library(gplots)
balloonplot(as.table(sitpay))
```



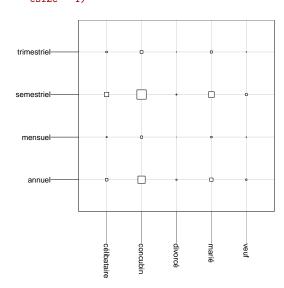


Balloon Plot for x by y. Area is proportional to Freq.

| | x | annuel | mensuel | semestriel | trimestriel | |
|-------------------------|---|--------|---------|------------|-------------|------|
| y célibataire | | 209 | 34 | 535 | 77 | 855 |
| concubin | | 1483 | 151 | 2448 | 245 | 4327 |
| divorcé | | 41 | -1 | 33 | •4 | 79 |
| marié | | 320 | 70 | 897 | 139 | 1426 |
| veuf | | 60 | 10 | 135 | •9 | 214 |
| | - | 2113 | 266 | 4048 | 474 | 6901 |

On retrouve ce principe dans la fonction table.cont du paquet ade4 :

table.cont(sitpay, row.labels = rownames(sitpay), col.labels = colnames(sitpay),
 csize = 1)

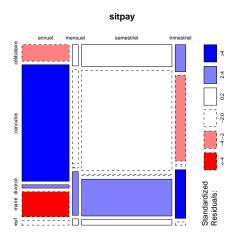


La fonction mosaicplot permet de mettre en évidence les liens les plus importants :

mosaicplot(sitpay, shade = TRUE)







2.2 Tableaux des profils lignes et colonnes

On calcule maintenant les fréquences conditionnelles. Pour ce faire, on note V_1 et V_2 , les deux variables qualitatives étudiées.

Profils lignes

Les fréquences conditionnelles associées aux profils lignes sont notées $f_{i|j}$ et définies par

$$f_{j|i} = P(V_2 = j | V_1 = i) = \frac{P(V_2 = j \cap V_1 = i)}{P(V_1 = i)}$$

$$f_{j|i} = \frac{\frac{n_{ij}}{n}}{\frac{n_{i\bullet}}{n}} = \frac{n_{ij}}{n_{i\bullet}}$$

```
        profLignes
        <- prop.table(sitpay, 1)</th>

        célibataire
        concubin
        divorcé
        marié
        veuf

        annuel
        0.0989115
        0.7018457
        0.019403691
        0.1514434
        0.02839565

        mensuel
        0.1278195
        0.5676692
        0.003759398
        0.2631579
        0.03759398

        semestriel
        0.1321640
        0.6047431
        0.008152174
        0.2215909
        0.03334980

        trimestriel
        0.1624473
        0.5168776
        0.008438819
        0.2932489
        0.01898734
```

On vérifie que les sommes en lignes sont toutes égales à 1.

Profils colonnes

Les fréquences conditionnelles associées aux profils colonnes sont notées $f_{i|j}$ et définies par

$$f_{i|j} = P(V_1 = i | V_2 = j) = \frac{P(V_1 = i \cap V_2 = j)}{P(V_2 = j)}$$



$$f_{i|j} = \frac{\frac{n_{ij}}{n}}{\frac{n_{\bullet j}}{n}} = \frac{n_{ij}}{n_{\bullet j}}$$

```
profColonnes <- prop.table(sitpay, 2)
profColonnes</pre>
```

```
        célibataire
        concubin
        divorcé
        marié
        veuf

        annuel
        0.24444444
        0.34273168
        0.51898734
        0.22440393
        0.28037383

        mensuel
        0.03976608
        0.03489716
        0.01265823
        0.04908836
        0.04672897

        semestriel
        0.62573099
        0.56574994
        0.41772152
        0.62903226
        0.63084112

        trimestriel
        0.09005848
        0.05662122
        0.05063291
        0.09747546
        0.04205607
```

On vérifie également que les sommes en colonnes sont toutes égales à 1.

```
    colSums(profColonnes)

    célibataire concubin divorcé marié veuf

    1
    1
    1
    1
```

2.3 Lien avec le test du χ^2 d'indépendance

Le test du Khi-Deux d'indépendance entre deux variables est caractérisé par les deux hypothèses :

- \star H_0 : les deux variables sont indépendantes
- $\star H_1$: les deux variables sont liées.

Sous l'hypothèse nulle H_0 , $P(V_2=j\cap V_1=i)=P(V_1=i)\times P(V_2=j)$. Ainsi, sous H_0 , la fréquence théorique est égale à $\frac{n_{i\bullet}}{n}\times \frac{n_{\bullet j}}{n}$.

On en déduit la table des **effectifs théoriques** (qui serait observée sous H_0), en conservant les effectifs marginaux observés.

$$\frac{n_{i\bullet} \times n_{\bullet j}}{n}$$

```
reschi <- chisq.test(sitpay)
reschi$expected</pre>
```

```
célibataire concubin divorcé marié veuf annuel 261.79032 1324.8734 24.188813 436.62339 65.52413 mensuel 32.95609 166.7848 3.045066 54.96537 8.24866 semestriel 501.52731 2538.1388 46.339951 836.46544 125.52847 trimestriel 58.72627 297.2030 5.426170 97.94580 14.69874
```

La statistique du test est la suivante :

$$\chi^2 = \sum_{i=1}^{I} \sum_{j=1}^{J} \frac{(n_{ij} - \frac{n_{i \bullet} n_{\bullet j}}{n})^2}{\frac{n_{i \bullet} n_{\bullet j}}{n}}$$

Elle tend vers une loi du χ^2 à $(I-1)\times (J-1)$ degrés de liberté. Dans l'étude de la relation entre le mode de payement de l'assurance automobile et la situation maritale, le résultat au test du Khi-Deux est





Comme la p-value est très faible, on rejette l'hypothèse nulle. Les variables sont liées. Il est alors intéressant d'explorer la structure de cette relation.

Définition

On appelle **lien** entre la modalité i de la variable V_1 et la modalité j de la variable V_2 la quantité :

$$\frac{1}{n} \frac{\left(n_{ij} - \frac{n_{i\bullet}n_{\bullet j}}{n}\right)^2}{\frac{n_{i\bullet}n_{\bullet j}}{n}}$$

Les couples de modalités (i, j) qui correspondent aux liens les plus importants sont les plus responsables de la dépendance entre la variable V_1 et la variable V_2 .

Conclusion. Que la liaison entre les 2 variables soit statistiquement significative ou non, on peut explorer la structure du tableau plus en détail. Lorsque les variables présentent de nombreuses modalités, il est difficile d'extraire une information pertinente si on se contente d'observer le tableau de données. La technique de l'Analyse Factorielle des Correspondances (AFC) est là pour pallier cette déficience.

3 Compréhension des résultats d'une AFC

Les résultats de l'AFC de la table de contingence permettant d'étudier le lien entre le mode de payement et la situation maritale.

```
dfsitpay <- as.data.frame(sitpay)
afc <- dudi.coa(dfsitpay, scannf = F, nf = 3)
names(afc)
[1] "tab" "cw" "lw" "eig" "rank" "nf" "l1" "co" "li" "c1" "call"
[12] "N"</pre>
```

3.1 Le tableau analysé

Le tableau analysé est :

afc\$tab

```
        célibataire
        concubin
        divorcé
        marié
        veuf

        annuel
        -0.20165115
        0.11935227
        0.6949984
        -0.26710293
        -0.08430676

        mensuel
        0.03167568
        -0.09464179
        -0.6715999
        0.27352919
        0.21231818

        semestriel
        0.06674150
        -0.03551375
        -0.2878715
        0.07236947
        0.07545321

        trimestriel
        0.31116786
        -0.17564766
        -0.2628318
        0.41915215
        -0.38770259
```

C'est le lien entre les effectifs théoriques et les effectifs observés.

(dfsitpay - reschi\$expected)/reschi\$expected

```
        annuel
        célibataire
        concubin divorcé
        marié
        veuf

        annuel
        -0.20165115
        0.11935227
        0.6949984
        -0.26710293
        -0.08430676

        mensuel
        0.03167568
        -0.09464179
        -0.6715999
        0.27352919
        0.21231818

        semestriel
        0.06674150
        -0.03551375
        -0.2878715
        0.07236947
        0.07545321

        trimestriel
        0.31116786
        -0.17564766
        -0.2628318
        0.41915215
        -0.38770259
```





3.2 Les pondérations

Les pondérations des lignes et des colonnes sont les fréquences marginales de la table de contingence observée.

```
afc$cw

célibataire concubin divorcé marié veuf
0.12389509 0.62701058 0.01144762 0.20663672 0.03101000

apply(dfsitpay, 2, function(x) sum(x)/n)

célibataire concubin divorcé marié veuf
0.12389509 0.62701058 0.01144762 0.20663672 0.03101000

afc$lw

annuel mensuel semestriel trimestriel
0.30618751 0.03854514 0.58658165 0.06868570

apply(dfsitpay, 1, function(x) sum(x)/n)

annuel mensuel semestriel trimestriel
0.30618751 0.03854514 0.58658165 0.06868570
```

3.3 La matrice diagonalisée

La matrice diagonalisée est **H**.

```
matZ <- as.matrix(afc$tab)
DI <- diag(afc$lw)
DrJ <- diag(sqrt(afc$cw))
matH <- DrJ %*% t(matZ) %*% DI %*% matZ %*% DrJ</pre>
```

Le rang de la matrice analysée est donné par min(I-1, J-1) soit

```
min(I - 1, J - 1)
[1] 3
afc$rank
[1] 3
```

Les valeurs propres et les vecteurs propres issus de cette diagonalisation sont :

On retrouve bien les valeurs propres de l'analyse.

```
reseigen$values
[1] 1.765310e-02 9.560696e-04 1.158312e-04 -1.528047e-18 -2.520770e-18
afc$eig
[1] 0.0176531021 0.0009560696 0.0001158312
```



3.4 Les coordonnées des lignes

Les coordonnées des lignes dites axes principaux s'obtiennent par $\mathbf{ZD}_J^{1/2}\mathbf{U}$ (cf cours¹). Elles sont centrées, de variances λ et de covariances nulles.

```
matZ %*% DrJ %*% reseigen$vectors[, 1:3]
[,1] [,2] [,3]
annuel -0.18496237 -0.01556050 -0.002942584
mensuel 0.15341763 0.04117812 -0.050292921
semestriel 0.05693235 0.01681398 0.005110564
trimestriel 0.25222413 -0.09733548 -0.002303726
 afc$li
Axis1 Axis2 Axis3
annuel 0.18496237 0.01556050 -0.002942584
mensuel -0.15341763 -0.04117812 -0.050292921
semestriel -0.05693235 -0.01681398 0.005110564
trimestriel -0.25222413 0.09733548 -0.002303726
 sum(afc$li$Axis1 * afc$lw)
[1] -2.688821e-17
  sum(afc$li$Axis2 * afc$lw)
[1] 4.336809e-18
 sum(afc$li$Axis1 * afc$li$Axis1 * afc$lw)
[1] 0.01765310
 afc$eig[1]
[1] 0.01765310
 sum(afc$li$Axis2 * afc$li$Axis2 * afc$lw)
[1] 0.0009560696
 afc$eig[2]
[1] 0.0009560696
 sum(afc$li$Axis1 * afc$li$Axis2 * afc$lw)
[1] 4.065758e-19
```

3.5 Les coordonnées des colonnes

Les coordonnées des colonnes dites composantes principales s'obtiennent par $\mathbf{D}_J^{-1/2}\mathbf{U}\mathbf{\Lambda}^{1/2}$ (cf cours). Elles sont centrées, de variances λ et de covariances nulles.

Logiciel R version 2.11.1 (2010-05-31) - tdr620.rnw - Page 12/15 - Compilé le 2010-11-15 Maintenance : S. Penel, URL : http://pbil.univ-lyon1.fr/R/pdf/tdr620.pdf

http://pbil.univ-lyon1.fr/R/pdf/add2.pdf.





```
afc$eig[1]
[1] 0.01765310
sum(afc$co$Comp2 * afc$co$Comp2 * afc$cw)
[1] 0.0009560696
afc$eig[2]
[1] 0.0009560696
sum(afc$co$Comp1 * afc$co$Comp2 * afc$cw)
[1] -2.913793e-19
```

3.6 Lien avec le Khi-Deux

Lien entre l'inertie totale et la valeur de la statistique du Khi-Deux :

$$I_T = \frac{\chi^2}{n}$$

```
reschi$statistic

X-squared
129.2212
reschi$statistic/sum(sitpay)

X-squared
0.01872500
sum(afc$eig)

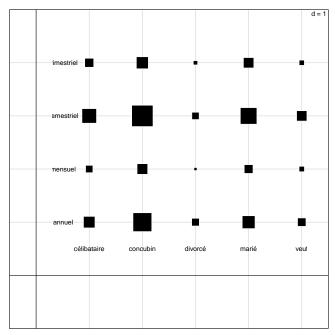
[1] 0.01872500
```

3.7 Visualisation finale

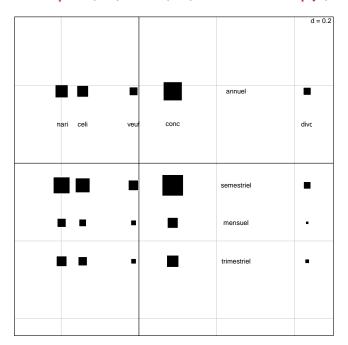
La représentation des modalités de la table de contingence :







La représentation des modalités suite à l'analyse :







4 Application

La recherche scientifique ne soulève que peu de controverse ou de résistance de la part du grand public. Dans quelques cas, rares, le débat entre science, morale et religion resurgit. C'est le cas de la recherche sur les embryons humains.

L'analyse que nous nous proposons de réaliser est adaptée de l'article Attitudes towards Embryo research, worldviews and the moral status of the Embryo Frame [1]. Les données ont été recueillies au près du grand public dans 9 pays européens et elles concernent le statut accordé à l'embryon.

A human embryo that is a few days old . . . (1) "is a mere cluster of cells, and it makes no sense to discuss its moral condition"; (2) "has a moral condition halfway between that of a cluster of cells and that of a human being"; (3) "is closer in its moral condition to a human being than to a mere cluster of cells"; (4) "has the same moral condition as a human being."

Les données sont rangées dans la table de contingence ci-dessous. Répondre à la question "Peut-on faire une typologie des pays?".

| Pays | (1) | (2) | (3) | (4) | non réponses |
|-------------|-----|-----|-----|-----|--------------|
| Autriche | 64 | 223 | 243 | 326 | 144 |
| Danemark | 373 | 234 | 112 | 219 | 62 |
| France | 227 | 224 | 166 | 282 | 100 |
| Allemagne | 88 | 218 | 259 | 289 | 146 |
| Italie | 203 | 157 | 137 | 373 | 130 |
| Pays.Bas | 207 | 329 | 154 | 223 | 88 |
| Pologne | 138 | 154 | 98 | 382 | 229 |
| Royaume.Uni | 255 | 168 | 117 | 236 | 224 |
| Espagne | 215 | 188 | 125 | 298 | 174 |

Pour entrer les données, utilisez :

```
res <- data.frame()
fix(res)</pre>
```

Références

- [1] R Pardo and F. Calvo. Attitudes towards embryo research, worldviews and the moral status of the embryo frame. *Science Communication*, 30, 1:8–47, 2008.
- [2] R.D. Snee. Graphical display of two-way contingency tables. *The American Statistician*, 28:9–12, 1974.