

МАТРИЦА ФАКТОРНЫХ НАГРУЗОК (факторная матрица) - способ представления результатов анализа факторного (см.) и метода главных компонент (см.). Строки М.Ф.Н. соответствуют исходным переменным, столбцы - факторам (или главным компонентам). На пересечении строки и столбца указывается значение нагрузки, которая представляет собой коэффициент корреляции между измеряемой переменной и латентным фактором. Нагрузки используются для интерпретации факторов; в методе главных компонент они могут также использоваться в качестве коэффициентов при регрессионном шкалировании.

Сумма квадратов факторных нагрузок по строке М.Ф.Н. называется общностью измеряемой переменной и интерпретируется как доля информации переменной, сохраненной в факторной структуре.

Сумма квадратов нагрузок по столбцу представляет собой дисперсию фактора и служит мерой его информативности. Отношение дисперсии фактора к суммарной дисперсии стандартизированных исходных переменных (численно равной их количеству) позволяет судить об относительной информативности фактора. В методе главных компонент дисперсия главных компонент равна собственным значениям матрицы корреляций исходных переменных.

О.В. Терещенко