

МЕТОД ГЛАВНЫХ КОМПОНЕНТ - один из методов исследования структуры и снижения размерности (см.) пространства переменных (см.). Предназначен для линейного преобразования большого количества исходных переменных, коррелирующих между собой, в несколько агрегированных некоррелированных показателей, что облегчает дальнейший анализ данных и позволяет решить проблему мультиколлинеарности. М.Г.К. может также использоваться для исследования структуры связей между исходными переменными. М.Г.К. применяется в тех же целях, что и анализ факторный (см.), и использует аналогичное представление результатов в виде матрицы факторных нагрузок (см.), но, тем не менее является вполне самостоятельным. Часто используется в факторном анализе для первоначального выделения факторов.

О.В. Терещенко