

$$\begin{pmatrix} \mathbf{X} \\ n\text{行}p\text{列} \end{pmatrix} \doteq \begin{matrix} \text{スコア} & \text{ローディング} \\ \begin{pmatrix} n \\ \text{行} \\ k \\ \text{列} \end{pmatrix} & \begin{pmatrix} k \\ \text{行} \\ p \\ \text{列} \end{pmatrix} \end{matrix}$$

図5.16 行列の分解

主成分分析は特異値分解と呼ばれる手法に基づいている。