Tirage des valeurs avec une analyse en composantes principales

Une fois la matrice M construite, on fait une analyse en composantes principales de cette matrice

Cette ACP est réalisée ligne 407 (DSYEV). Le résultat de cette ACP donne le vecteur W des valeurs propres et la matrice M2 des vecteurs propre.

Finalement le vecteur des valeurs propres se retrouve dans SIGMA et les vecteurs propres dans P

Ensuite, en fait, il ne faut pas supprimer les lignes/colonnes des valeurs propres négatives (comme je l’avais dit), il faut faire comme suit :

* Mettre à 0 dans SIGMA les valeurs propres négatives
* Calculer **P\*racine(diag(SIGMA))** (donc sur toutes les lignes et colonnes) = **P2**
* calculer **P\*SIGMA\*P’** =**P3**

Pour les tirages ensuite on tire u dans une loi normale, puis

* Calculer u=P2\*u
* Et calculer T(i)=u(i)\*u(i)/P3(i,i)

Et voila