

Macro : %DIAGNOSTICS

But : éditer les statistiques de qualité d'un modèle de discrimination binaire les plus courantes.

Applications : évaluation de modèles de scoring

Paramètre	Valeur	Obligatoire	Valeur par défaut
Tables	Table(s) SAS à lire : données incluant la variable à prédire et un score	OUI	
VarScore	Variable contenant la probabilité prédite par le modèle (score)	OUI	
VarTarget	Variable à prédire (Y)	OUI	
NbCoeffs	Nombre de coefficients du modèle testé (une seule valeur) pour calcul des critères de Schwarz et d'Akaike	NON	
Out	Table SAS en sortie contenant les statistiques	NON	
Event	Valeur de la variable Y qui est modélisée (évènement)	NON	1

Table SAS	Effectif	-2 log L	% mal classés (seuil=0,5)	Score de Brier	AIC (Akaike)	SC (Schwarz)
#1 WORK.REG_1TRAIN	58927497.65		34,84%	0.22256	7507.65	7541.06
#2 WORK.REG_2VALID	44085479.27		33,78%	0.21570	5489.27	5521.22
#3 WORK.REG_3TEST	43965534.09		35,08%	0.21928	5544.09	5576.03

Table SAS	AUC (c de Pregibon)	Gini (D de Somers)	Gamma	Tau-alpha	Kolmogorov Smirnov
#1 WORK.REG_1TRAIN	0.691	0.381	0.386	0.191	0.305
#2 WORK.REG_2VALID	0.714	0.429	0.434	0.214	0.327
#3 WORK.REG_3TEST	0.702	0.405	0.410	0.202	0.310