

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 |