

Вес доказательства (Weight of evidence)

Синонимы: Коэффициент WoE, Coefficient WoE

Разделы: [Метрики](#)

Коэффициент WoE-анализа используется для формирования конечных классов, где каждому наблюдению, содержащему набор признаков, ставится в соответствие бинарная выходная переменная (*Событие* или *Не-событие*, в зависимости от логики решения задачи).

Затем производится разбиение всего диапазона изменения того или иного признака на несколько начальных классов, для каждого из которых вычисляется коэффициент WoE:

$$WoE_i = \ln \frac{F^-}{F^+},$$

где

i — индекс начального класса; F^- — относительная частота появления *Не-событий* в классе; F^+ — относительная частота появления *Событий* в классе.

На основе коэффициентов WoE вычисляется величина, определяющая значимость признака в модели бинарной классификации, называемая информационным индексом (IV).

Коэффициенты WoE и вычисленные на их основе значения IV являются критерием для формирования конечных классов оптимальным образом:

- максимизируя значимость признака в бинарной классификационной модели;
- максимизируя равномерность заполнения интервалов, что обеспечивает наилучшую репрезентативность результатов;
- используя компромисс между этими вариантами.

В Logitom существует специализированный обработчик конечные классы и визуализатор конечные классы (визуализатор), предназначенные для преобразования непрерывных и дискретных входных полей, используемых для построения моделей бинарной классификации, путем квантования на основе метода совокупности доказательств или WoE-анализа.