

Soufiane SABRI



Issue d'une formation purement statistique et économétrique, avec une forte compétence sur les problématiques liées à la gestion des risques financiers. Je suis intéressé par les sujets de **crédit Scoring**, **modélisation**, **validation** et **backtesting** des paramètres bâlois et IFRS9 (**PD**, **LGD**, **CCF**), ainsi que par les sujets réglementaires de **stress test**.

Coordonnées

- 0769003336
- sabrisoufiane0@gmail.com
- <https://www.linkedin.com/in/soufiane-s-018933170>

Compétences

- Modélisation économétrique
- Analyse et traitement des données
- Méthodes de Scoring
- Machine Learning
- Règlementation prudentielle bancaire

Informatiques

Python (>500h)

Numpy / Pandas / Matplotlib / Seaborn / Scikit-learn



SAS (>300h)

Base / Macro / SQL / IML



R/R Studio (>200h)

Shiny / Markdown / Caret / Tydiverse



Certifications

SAS

- [SAS Base](#)
- [SAS Regression and Modeling](#)

Dataiku

- [Core Designer](#)
- [ML Practitioner](#)

University of Michigan

- [Getting Started with Python \(19h\)](#)
- [Python Data Structures \(19h\)](#)
- [Using Python to Access Web Data \(19h\)](#)
- [Retrieving, Processing, and Visualizing Data with Python \(9h\)](#)
- [Inferential Statistical Analysis with Python \(18h\)](#)
- [Applied plotting, charting, data presentation in python \(24h\)](#)

Amazon Web Service (AWS)

- [Introduction to Machine Learning on AWS \(6h\)](#)

University of London

- [Machine Learning for All \(21h\)](#)

John Hopkins University

- [Statistical Inference \(54h\)](#)

Duke University

- [Introduction to Machine Learning \(12h\)](#)

The Hong Kong University of Science and Technology

- [Python and Statistics for Financial Analysis \(12h\)](#)

Sungkyunkwan University

- [Machine Learning Basics \(14h\)](#)

Udemy

- [Credit Risk Modeling in Python \(7h\)](#)

Formations

2022 - 2024

Master Économétrie et Statistique Appliquée

Université d'Orléans
Mention assez bien / [lien maquette](#)

2020 - 2021

Licence 3 Économie et Gestion Parcours Économétrie

Université d'Orléans - Mention bien

2018 - 2020

Licence 1 & 2 Economie et Gestion

Université Sorbonne Paris Nord
Classement (**3/239**) - Mention Bien

Expériences Professionnelles

Stagiaire Analyste Quantitatif Risque Crédit

Société Générale, Paris La Défense

Avril 2024 - Septembre 2024

Développement d'une méthodologie alternative d'estimation de la perte en cas de défaut (LGD) en utilisant les différentes méthodes statistiques et d'apprentissage automatique.

Projets Universitaires

ML interprétable pour Credit Scoring

En partenariat avec **Ernst & Young**, ce projet consiste à élaborer un modèle de score en utilisant la régression logistique et en exploitant des techniques de Machine Learning, en mettant l'accent sur l'approche SVM et XGBoost. Ensuite, une comparaison de la performance de toutes les approches est réalisée. Enfin, nous mettrons en place une méthodologie permettant de garantir que tous les modèles développés sont interprétables du point de vue métier.

L'intégration des DPE dans la modélisation de la LGD des prêts immobiliers

En partenariat avec **LCL Banque**. L'objectif est de créer une segmentation de la perte en cas de défaut (Loss Given Default ou LGD) à partir des caractéristiques des emprunteurs, et d'étudier l'intérêt de l'intégration des diagnostics de performance énergétique (DPE) des biens immobiliers dans la modélisation de la perte en cas de défaut pour les crédits immobiliers de la banque.

Modélisation du risque financier et de transition

En partenariat avec **Deloitte Conseil**, développement d'un modèle économétrique de panel visant à analyser la création et la défaillance des entreprises. Le projet se déroulera en deux étapes : la première étape se concentrera sur l'analyse des variables macroéconomiques telles que le PIB, le taux de chômage et l'inflation. La deuxième étape examinera les variables liées aux risques ESG, incluant les catastrophes naturelles et la localisation géographique des entreprises.

Langues

- Français : Courant
- Anglais : Opérationnel