

Pape Tidiane GUEYE



Personal information

Pape Tidiane GUEYE

papetidianegueye199@gmail.com

+33781757794

Colombes, France
92700 Colombes

linkedin.com/in/ptgueye

Compétences

| | |
|---|-----------|
| Validation de modèles | ● ● ● ● ● |
| Machine Learning | ● ● ● ● ● |
| Modélisation IFRS9 | ● ● ● ● ● |
| Econométrie | ● ● ● ● ● |
| Traitement de données (Outliers, Missing Data, Data transformation, etc) | ● ● ● ● ● |
| CSPRO/ODK Collect (Enquête) | ● ● ● ● ● |
| Python | ● ● ● ● ● |
| R | ● ● ● ● ● |
| SAS | ● ● ● ● ● |
| Microsoft Excel | ● ● ● ● ● |
| Power BI | ● ● ● ● ● |
| Qlick Sense | ● ● ● ● ● |

Education

- Data Scientist - Finance et Risk Management** de 2021 à 2023
National School for Statistics and Data Analysis, Rennes, France
- Statistics Project Engineer** de 2017 à 2021
National School for Statistics and Economy Analysis, Dakar, Sénégal
- Scientific Baccalaureate** de 2014 à 2017
Ahmadou Ndack Seck High School (LANS), Thiès, Sénégal

Professional Experience

- Banking Risk Management Model Controller - Permanent Contract** de déc. 2023 à ce jour
Confédération Nationale du Crédit Mutuel, Paris
- Validation de modèles de probabilité de défaut (PD Forward Looking) des contreparties dans le cadre IFRS9 (Validation initiale) :**
- Cadrage de la mission avec identification des points d'attention particuliers
 - Vérification de la qualité des données de modélisation et de la documentation
 - Vérification et challenge des hypothèses statistiques et méthodologiques
 - Vérification de l'adéquation de la méthodologie aux objectifs finaux du modèle
 - Investigation des faiblesses identifiées
 - Proposition de modèles et protocoles alternatifs plus robustes
 - Production d'un rapport avec les remarques et les recommandations émises
- Monitoring de modèle Bâlois (Validation pérenne des modèles de probabilité de défaut, de perte en cas de défaut et du facteur de conversion de crédit) :**
- Vérification des hypothèses de construction du modèle sur les nouvelles données
 - Analyse de robustesse/conservatisme du modèle en vigueur par rapport aux nouvelles données observées
 - Proposition d'une méthodologie de test d'homogénéité des classes de risque avec prise en compte du poids en cours (EAD) des différentes poches hétérogènes
 - Production de rapports présentant les faiblesses identifiées et challenges effectués
 - Automatisation et production des maquettes de validation destinées à la BCE
- Traitements des obligations BCE :**
- Cadrage des demandes de la BCE
 - Identification des faiblesses des réponses apporter par les équipes modélisatrices
 - Proposition de réponses alternatives (avec une instance particulière sur la réglementation bâloise)
 - Rédaction d'un rapport synthétique destiné à la BCE
- Missions diverses :**
- Encadrement de stagiaire sur le suivi du modèle PD sur le périmètre des Grandes Entreprises et Banques
 - Référent IA au sein de la Direction de Conformité et de Contrôle Permanent
- Stage - Contrôleur Risque** de avr. 2023 à oct. 2023
Confédération Nationale du Crédit Mutuel, Paris
- Automatisation du monitoring du modèle sur les "Facteurs de conversion de Crédit" (CCF)
 - Challenge du modèle CCF avec des modèles de Machine Learning (GAM, XBoost, Random Forest)
 - Monitoring du modèle de probabilité de défaut des contreparties Banques et Grandes Entreprises

Langues

| | |
|----------|-----------|
| Anglais | ● ● ● ● ● |
| Français | ● ● ● ● ● |

Centres d'intérêt

- Lecture
- Basketball
- Football
- Voyage
- Volontariat

Stage - Data Analyste Marketing

de juin 2022 à août 2022

Orange France - Direction de la Voix du Client, Paris

- Profiling des clients du parc PRO/PME dans le but de mettre en évidence les drivers de la recommandations client (Modèle Régression Linéaire, CART, Random Forest, Valeur de Shapley)
- Création de Dashboard destinée à la visualisation des données d'analyse de la concurrence (Qlick Sense)

Stage - Assistant de Recherche

de avr. 2021 à juil. 2021

IFPRI (International Food Policy Research Institute), Dakar

Etude de la dose optimale de prise de complément lipidique (SQ-LNS) pour la prévention contre la malnutrition infantile au Burkina :

- Analyse de la qualité des données et structure des cohortes de l'étude
- Revue méthodologique sur les techniques de mesure d'impact sur des données de panels en présence de facteurs de confusion
- Analyse statistique des données expérimentales à l'aide de logiciels spécialisés (Stata)
- Application des Propensity Score Weighting pour rééquilibrer les cohortes de l'analyse
- Identification de l'impact du programme avec un modèle de Cox (Proportional Hazard Model)

Stage - Analyste de données

de juil. 2019 à sept. 2019

ANSD (Agence Nationale de la Statistique et de la Démographie), Dakar

- Analyse des usages et usagers de la statistique publique
- Analyse des KPIs sur le traitement des demandes de données
- Automatisation du processus d'enregistrement des demandes

Projets académiques

Production d'un API sur python

de oct. 2021 à févr. 2022

Production d'une application permettant de faire des commandes (comme la plateforme Uber eats)

Intégration du risque climatique (risque physique) dans les modèles de PD - Portefeuille de contrepartie Américaine

de avr. 2022 à mai 2022

Proposition de technique permettant d'inclure les facteurs de risque physique dans la modélisation de Probabilité de défaut

Modélisation du risque de transition sur les TPE/PME

de 2022 à 2023

Proposition de méthodologie d'estimation de l'empreinte carbone sur les TPE/PME

Production de question d'enquête d'agricole (Nataal Mbay)

de août 2020 à sept. 2020

Mise en place de questionnaire de suivi d'un réseaux de producteurs agricole

Engagements associatifs

Membre du comité d'accueil des nouveaux étudiants étrangers de l'ENSAI

Président de l'Association des Elèves et Stagiaires de l'ENSAE Dakar

Chargé à l'organisation à l'Association des Elèves et Stagiaires de l'ENSAE Dakar