

SOUFIANE SABRI

Analyste Quantitatif / Data Scientist



PROFIL

Issu 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 testing**.

CONTACT

- 📞 0769003336
- ✉️ sabrisoufiane0@gmail.com
- 📍 Paris, France

FORMATIONS

Master Économétrie et Statistique Appliquée

Université d'Orléans | 2022 - 2024

Mention assez bien / [Lien Maquette](#)

Licence 3 Économie et Gestion - Économétrie

Université d'Orléans | 2020 - 2021

Mention bien

Licence 1 & 2 Economie et Gestion

Université Sorbonne Paris Nord | 2018 - 2020

Classement (3/239) - Mention Bien

PROJETS

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.

INFORMATIQUE

- Python (>500h): Numpy / Pandas / Matplotlib / Seaborn / Scikit-learn / Statsmodel
- SAS (>300h): Base / Macro / SQL / IML
- R/R Studio (>200h): Shiny / Markdown / Caret / Tidyverse

EXPÉRIENCES

Consultant Analyste Quantitatif Risque Crédit

Société Générale, Paris La Défense

Oct 2024 - Présent

- Participation à la revue d'un modèle CCF portant sur le Segment non-retail.

Enseignant vacataire

Université Paris-Dauphine-PSL

Janv 2025 - Présent

Stagiaire Analyste Quantitatif Risque Crédit

Société Générale, Paris La Défense

Avr 2024 - Sep 2024

- Développement d'une approche alternative d'estimation de la perte en cas de Défaut (LGD) à partir d'un modèle de probabilité de retour en situation saine, incluant les phases Risk Differentiation et Risk Quantification en utilisant une diversité de méthodes statistiques et d'apprentissage automatique.

CERTIFICATIONS

SAS

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

DATAIKU

- [Core Designer](#)
- [ML Practitioner](#)
- [Advanced Designer](#)
- [Developer](#)
- [MLOps Practitioner](#)
- [Generative AI 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 & JOHN HOPKINS UNIVERSITY & DUKE UNIVERSITY

- [Machine Learning for All \(21h\)](#)
- [Statistical Inference \(54h\)](#)
- [Introduction to Machine Learning \(24h\)](#)

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 \(7h\)](#)

LANGUES

- Français : Courant

- Anglais : Opérationnel