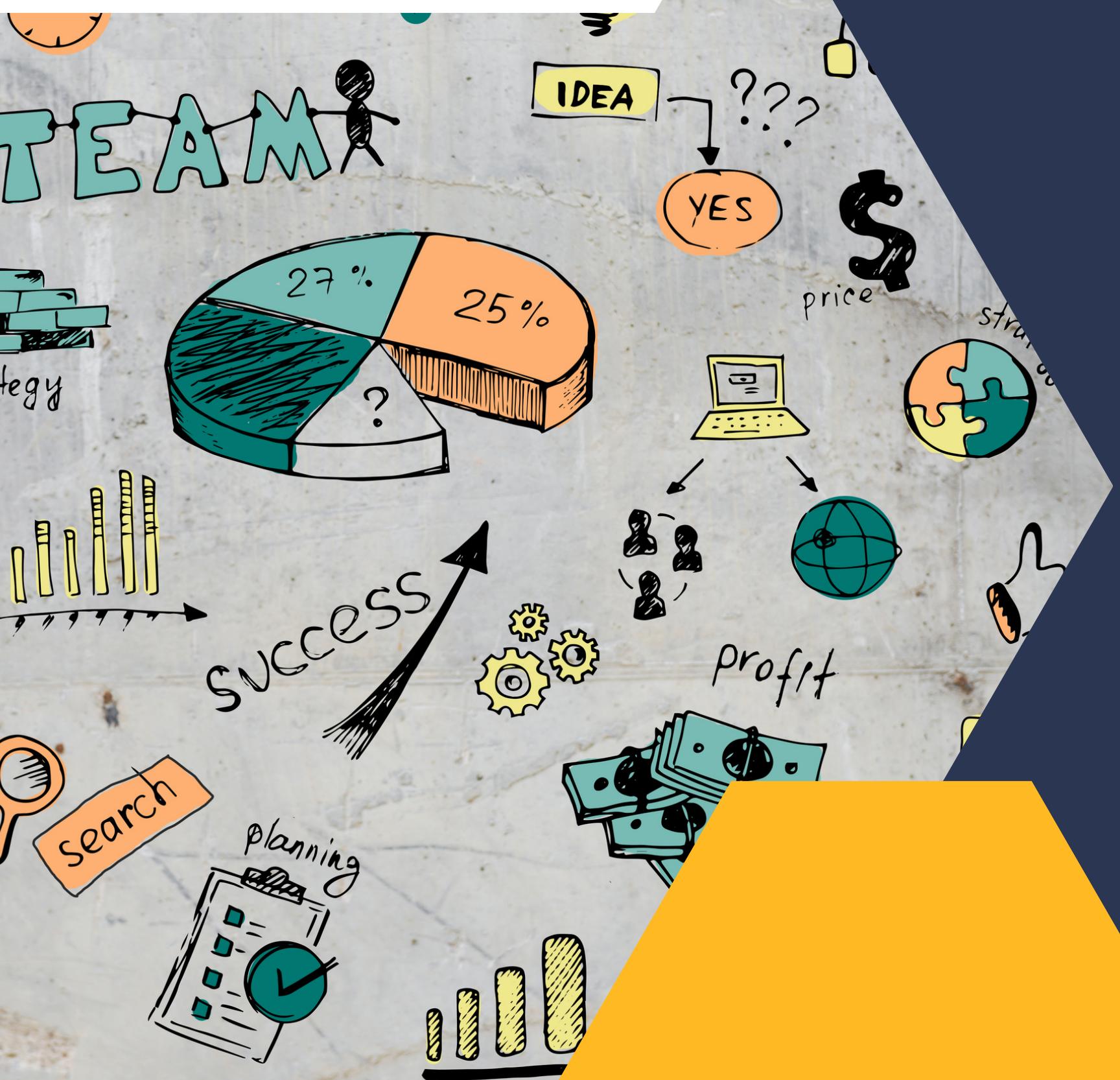




CFA
Montréal

FINANCE
MONTREAL

SR.ai



POLYFINANCES DATATHON

2022



POLYFINANCES

DATATHON 2022

HORAIRE

SAMEDI 5 NOVEMBRE - ATRIUM DU PAVILLON J.-A BOMBARDIER

- 9h00 - Accueil des participants avec viennoiseries et café
- 9h30 - Présentation de la compétition par PolyFinances
- 10h00 - Cours sur le NLP par SR.AI
- 10h30 - Pause
- 10h45 - Cours sur la finance par Banque Nationale
- 11h30 - Rencontre avec les commanditaires
- ~~~ Le reste de la journée se fera en virtuel
- Midi - Début du 48h de compétition + dévoilement des données
- 18h00 - Mini jeu #1
- 22h00 - Mini jeu #2

DIMANCHE 6 NOVEMBRE - VIRTUEL

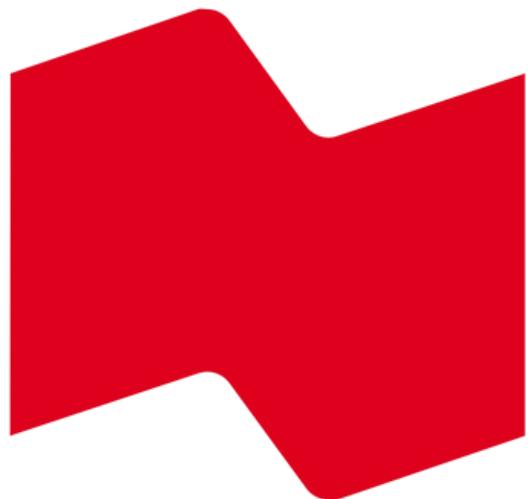
- 10h00 - Période de questions avec Banque Nationale
- 14h00 - Vote de la meilleure visualisation de données + Prix !
- 18h00 - Mini jeu #3

LUNDI 7 NOVEMBRE - VIRTUEL

- 12h00 - Fin de la compétition + remise des projets

VENDREDI 11 NOVEMBRE - POLYTECHNIQUE MONTREAL

- 13h30 - Début des présentations devant jury à la Galerie Rolland
 - Horaire détaillé à venir
 - Remise des PowerPoint jeudi soir au plus tard
- 16h30 - Fin des présentations
- ~~~
- 17h30 - Soirée réseautage à l'Atrium du pavillon Lassonde !
 - Remise des prix
 - 10+ entreprises seront présentes
 - Des boissons seront offertes
- 19h30 - Fin de la soirée réseautage

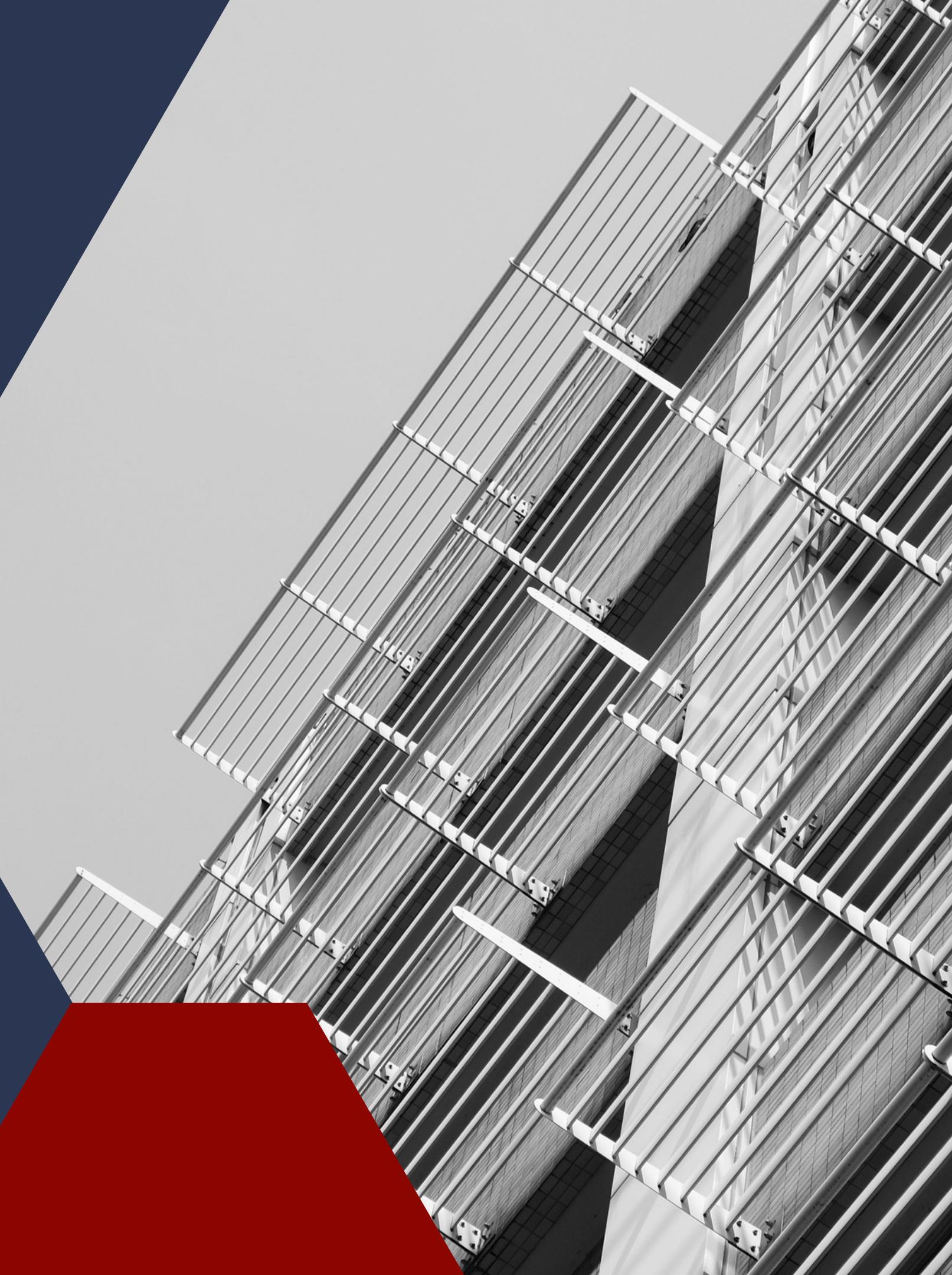




POLYFINANCES

Présentation de la compétition

par PolyFinances





Plan de la présentation

I. PolyFinances

III. Votre défi

II. Mise en contexte de la situation économique

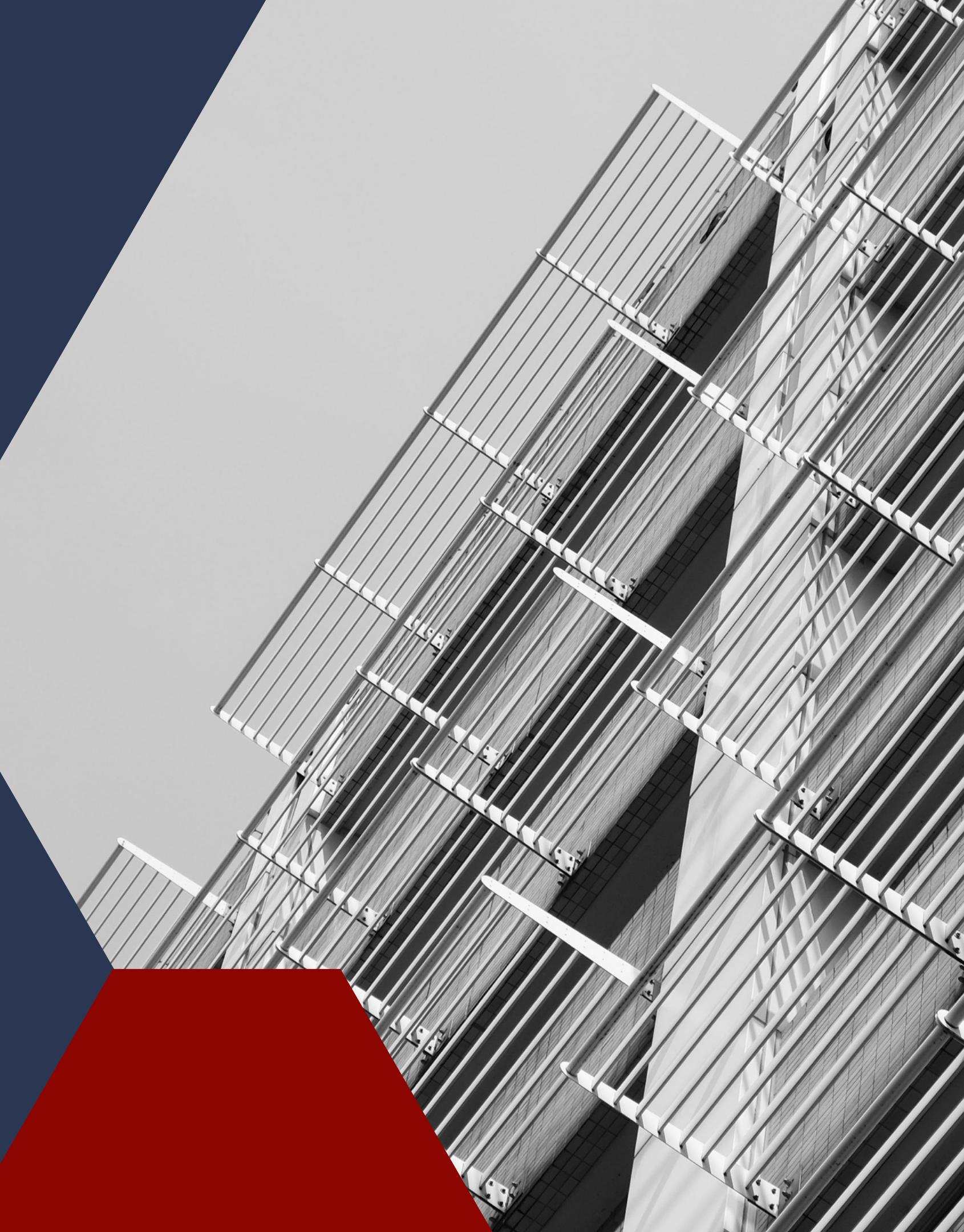
IV. Présentation des résultats



POLYFINANCES

PolyFinances

L'ingénieur au cœur de la finance



PolyFinances

Qui sommes nous ?



Une nouvelle génération d'ingénieurs

- Être doté d'une formation multidisciplinaire
- Comprendre les dynamiques de marchés
- Comprendre les enjeux financiers d'un projet



Des ingénieurs au service de la finance

- Comprendre l'évolution de l'écosystème financier
- Identifier des opportunités de croissance sur le marché
- Développer de la technologie au service de la finance



+85 000 \$

d'actifs sous gestion



3

comités de placement



+ 6

mandats en entreprise



+ 70

revues mensuelles

PolyFinances

Thématique innovation et capital de risque



POLYFINANCES

Mise en contexte

Situation économique



Mise en contexte

Depuis l'année 2020, le monde se trouve dans une situation économique très mouvementée.

La COVID-19, puis la guerre en Ukraine, nous placent dans un contexte macroéconomique instable marqué par la hausse des taux ainsi que de l'inflation.

Dans un tel contexte, les modèles de prévision de change classiques deviennent moins performants. Par conséquent, les analystes s'accordent pour dire que les anticipations sur les politiques monétaires des banques centrales ont un impact grandissant sur les marchés et sur l'évolution des devises.

Sachant cela, un gestionnaire de fonds, qui voit la performance de son modèle baisser, vous mandate pour développer une stratégie d'investissement qui lui permettra de déterminer dans quelle devise il devrait investir son argent sur une période donnée (CAD vs USD).



POLYFINANCES

Votre défi

Datathon 2022

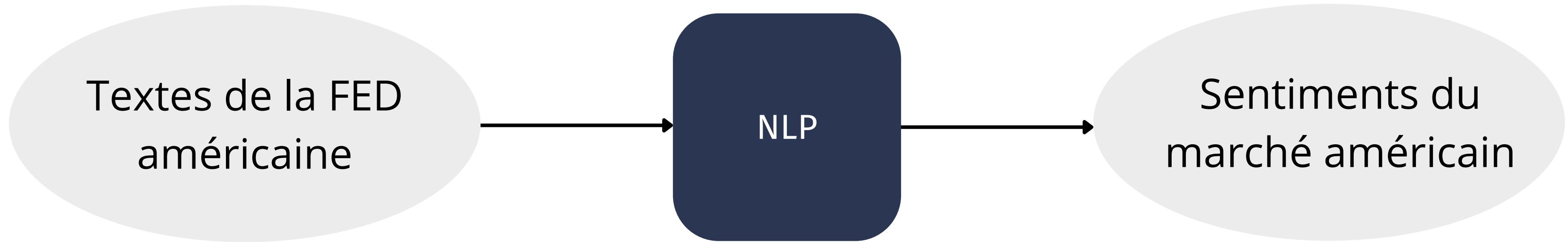


Votre défi... en 3 étapes

- 1.Extraire les sentiments des textes de la FED américaine.**
- 2.Extraire les sentiments des textes de la Banque du Canada.**
- 3.Effectuer une prédiction sur le taux de conversion des devises des deux pays sur un intervalle de deux semaines.**

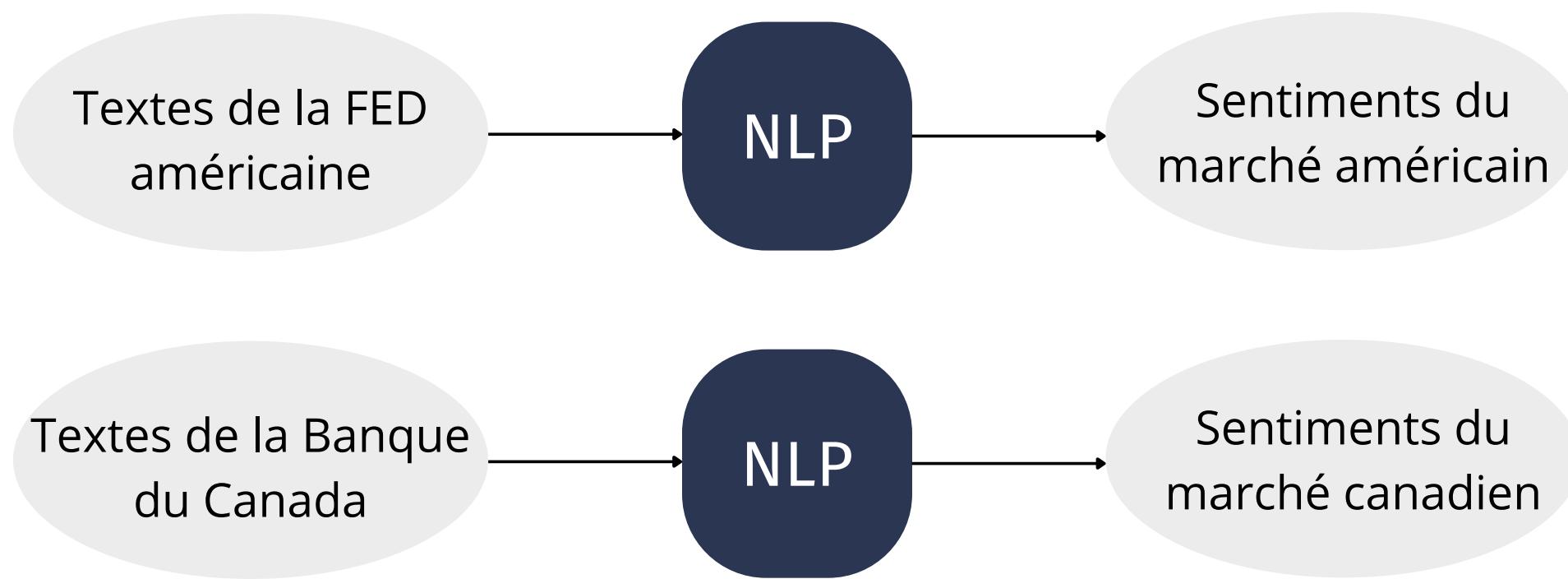
Votre défi... en 3 étapes

1. Extraire les sentiments des textes de la FED américaine



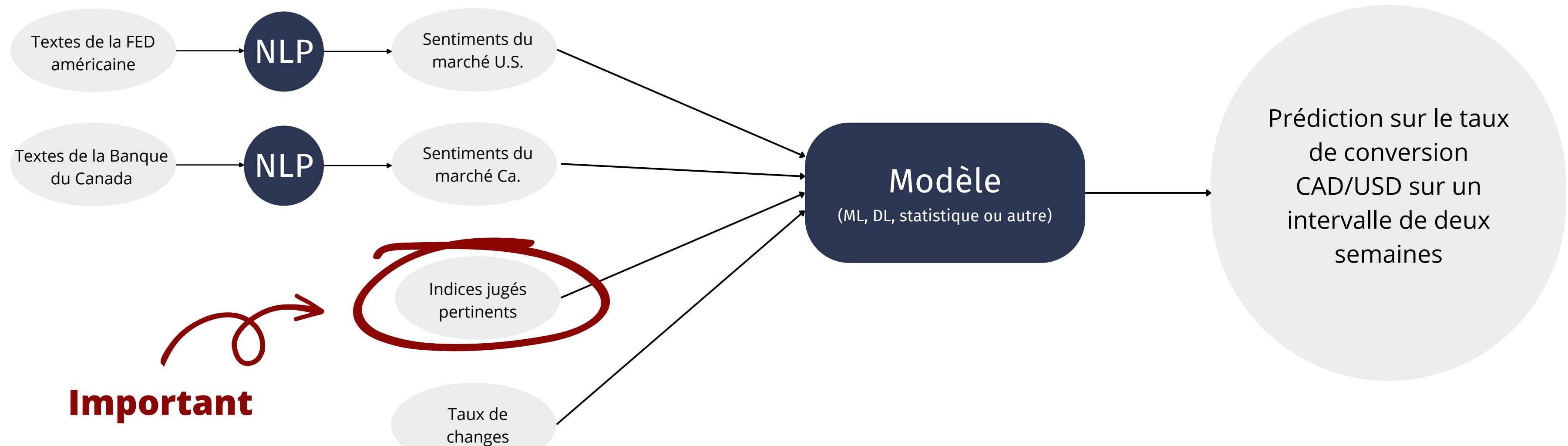
Votre défi... en 3 étapes

2. Extraire les sentiments des textes de la Banque du Canada.



Votre défi... en 3 étapes

2. Extraire les sentiments des textes de la Banque du Canada.





POLYFINANCES

Votre présentation

Devant jury



Présentation

Barème d'évaluation

Qualité de la présentation et d'expression 20%

Contenu de la présentation 60%

- Votre approche au problème
- Présentation des modèles
- Présentation des résultats
- Ce que vous avez appris

Résultats des modèles 20%

Les résultats et vos modèles

Données d'entraînement

- Du début des temps au 1er mai 2022

Données de test

- Les 6 derniers mois
- Présenter seulement ces données
- Prévision «out of sample» :
Vos modèles ne doivent jamais
avoir vu ces données

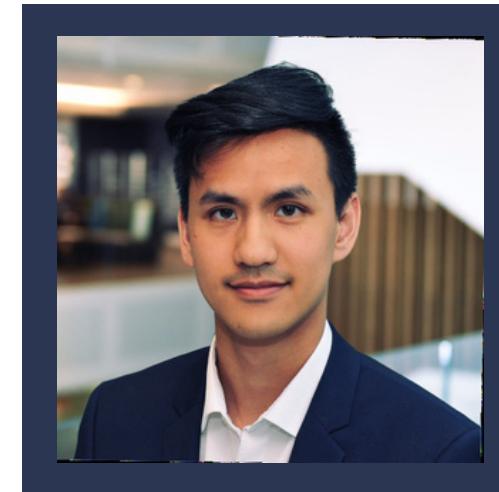


Votre jury



Julien Crowe

Directeur senior AI
factory
@ Banque Nationale



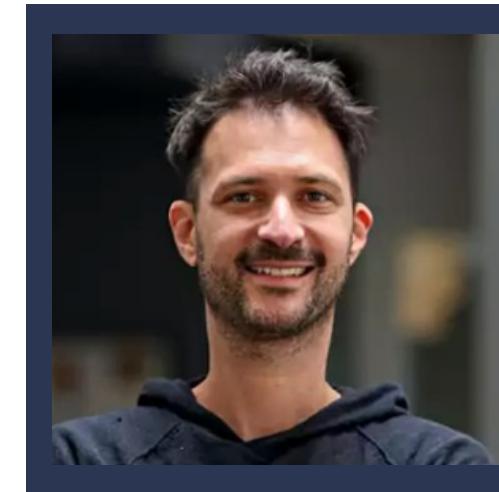
Paul Daigle

Lead data scientist
@ SR.AI



Jeremy Moreau

Directeur analytique
avancée et
technologies de
l'information @
Ivanhoé Cambridge



David Ardia

Professeur - Chercheur
en Méthodes
quantitatives pour la
finance



Robert Normand

Chercheur
Directeur de projets
@ Cirano

Les prix à gagner !

1ÈRE PLACE

→ 2000\$

2ÈME PLACE
→ 1000\$

3ÈME PLACE
→ 500\$

PRIX DE PARTICIPATION
→ Meilleure visualisation

PRIX DE PARTICIPATION
→ Meilleure innovation

PRIX DE PARTICIPATION
→ Mini-jeux

Nos conseils

Assistez aux présentations et aux ateliers!

Regardez la littérature sur le sujet !

Posez des questions !

Répartissez-vous les tâches selon vos forces !

Soyez méthodiques !

Bon datathon !

