



JPD FX Weekly Report

빅데이터를 활용한 환율예측 시스템

헤럴드경제데이터연구소
장수진



JPD FX Weekly Report

지능형 빅데이터 환율예측 시스템

1. 빅 데이터

- Redefine Big Data (Pattern-Meaning-Value)
- Dynamic Data Analysis – 초/분/시간/일

2. 지능형 환율 예측

- Big2data
- Big Data Analysis and Methodology (Creative Methodology)

3. 빅데이터 미래예측 방법론

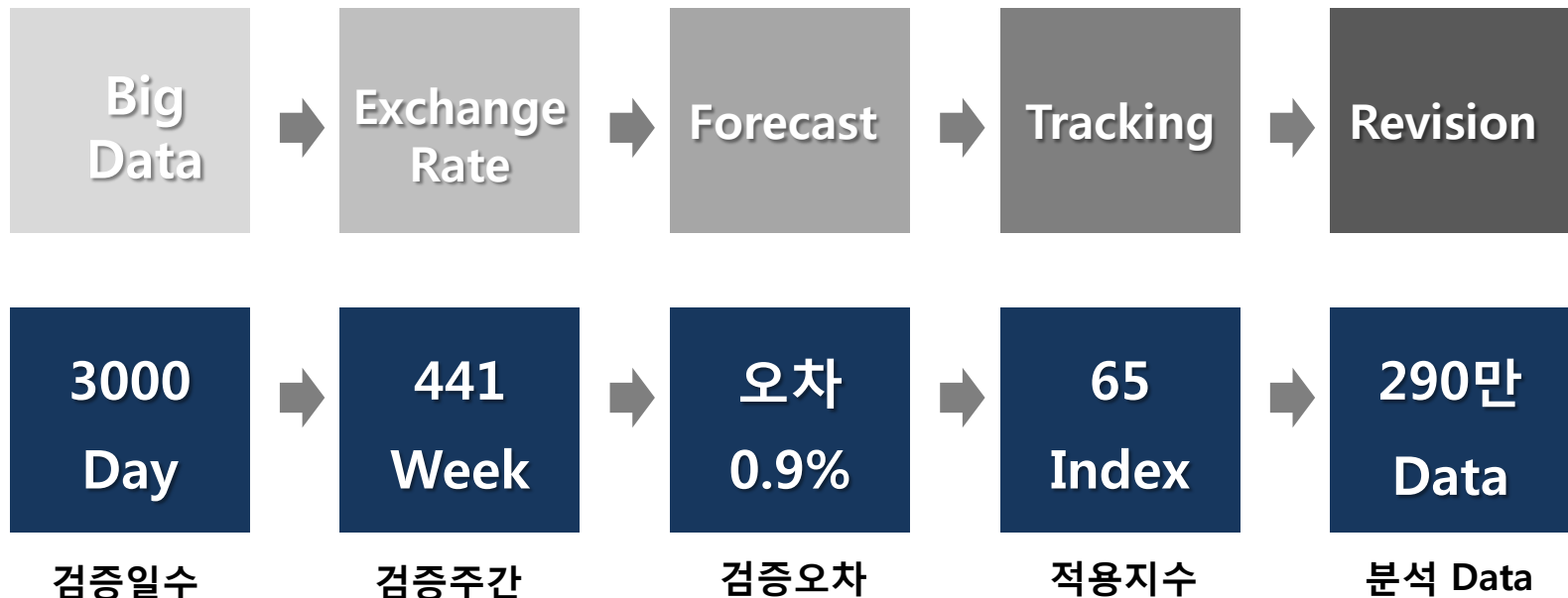
- Big Data prediction Methodology (JPM)



JPD FX Weekly Report

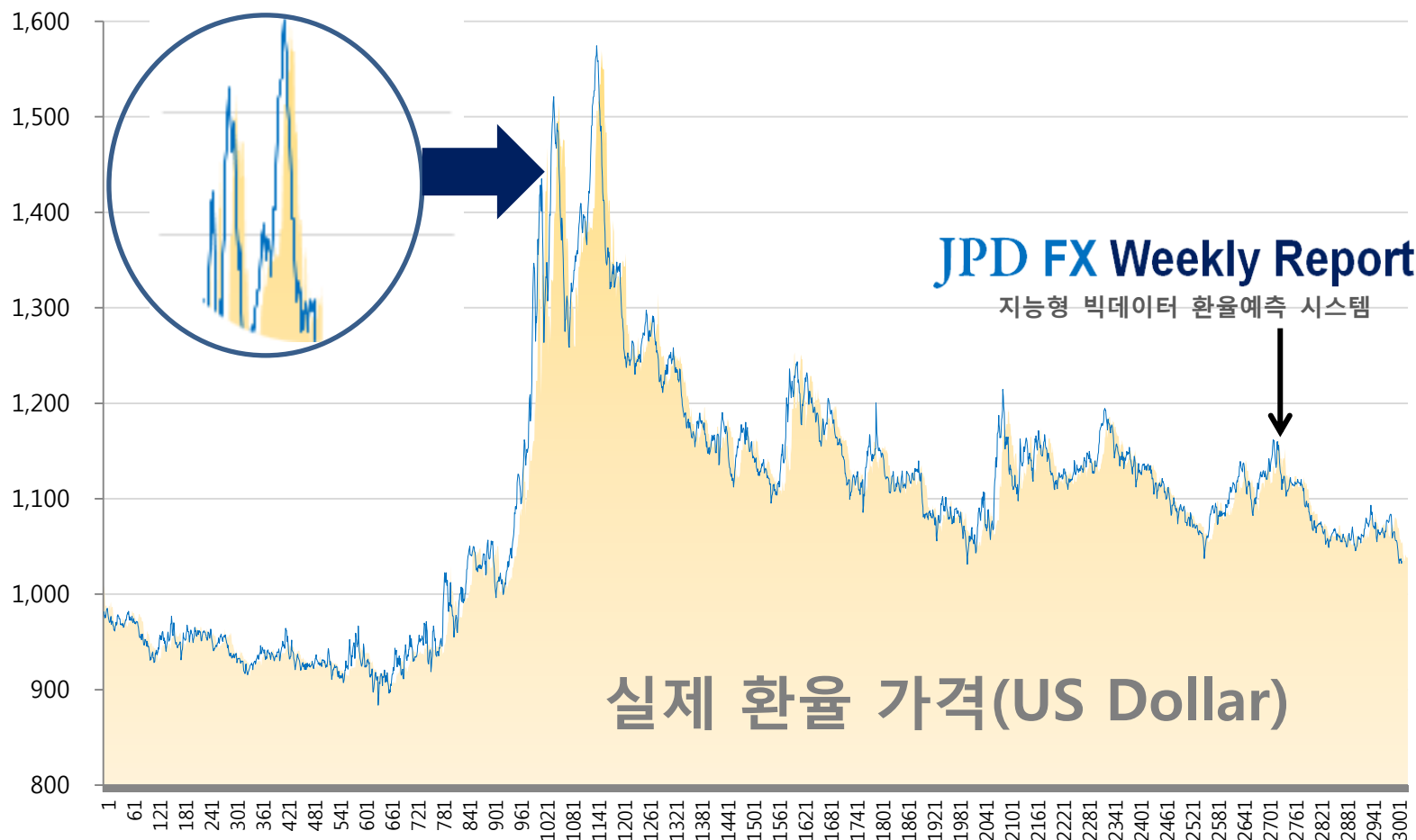
지능형 빅데이터 환율예측 시스템

JPD Fx System

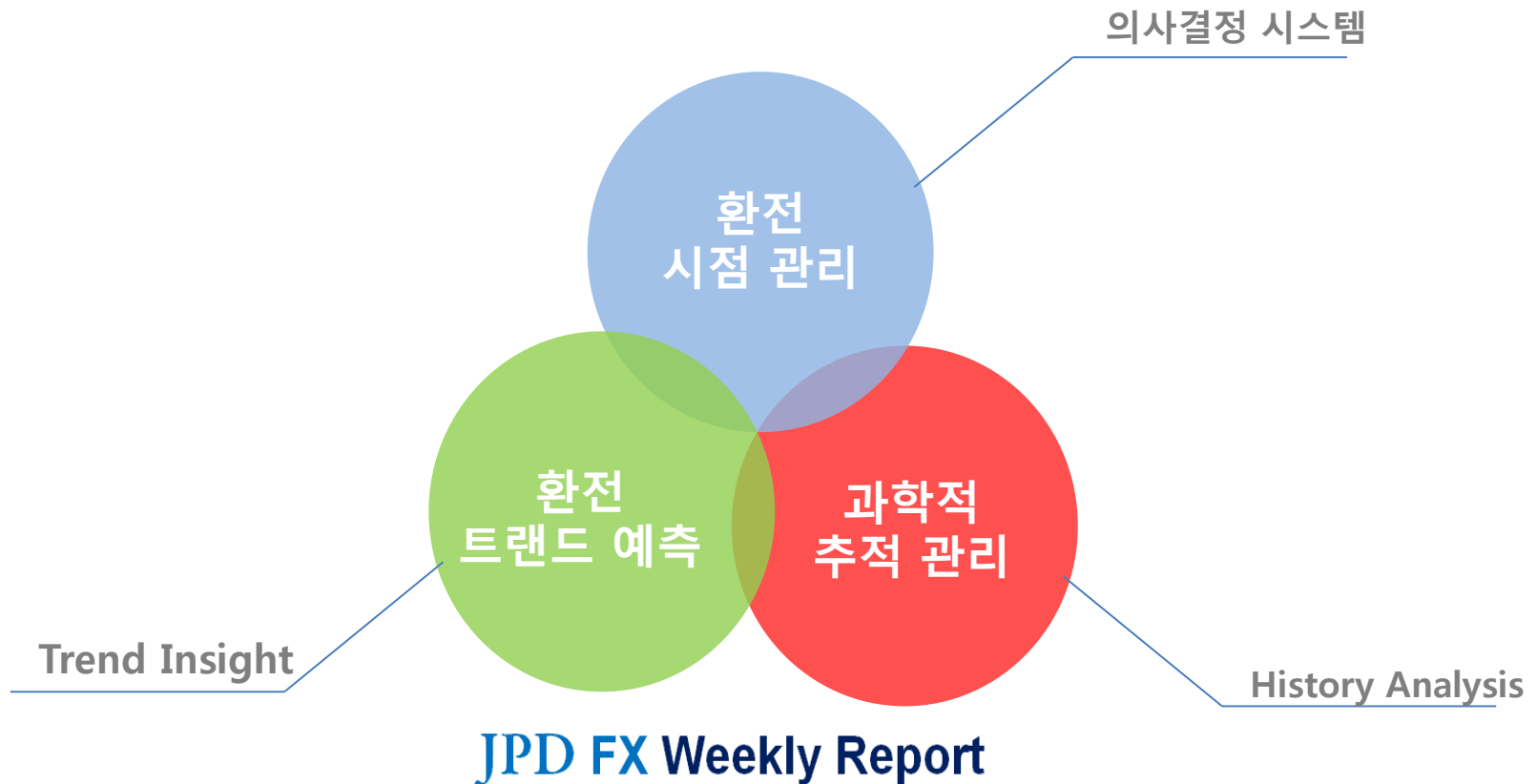


환율예측 시스템의 환율 추적 검증

분석기간 : 2006.01.02 ~ 2014.04.17



What is in it for your company ?



수출 & 수입 업체별 Fx 전략 수립

수출 업체

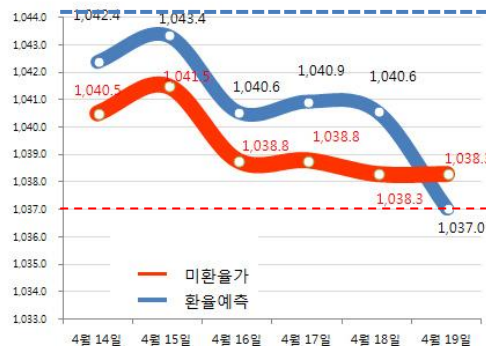
환전
시점 관리

최고가 매도

JPD FX Weekly Report



2014년 4월 3주차



매도
전략

매수
전략

수입 업체

환전
시점 관리

최저가 매수

전문 기관의 환율 예측

2014.4.28 환율예측

- ▶ A 은행
 - 환율: 1036원~1044원
- ▶ B 선물
 - 환율: 1030원~1050원
- ▶ C증권
 - 환율: 1035원~1050원
- ▶ 평균 20~30원 오차예측
 - 주간예측이 광범위

기존 환율 예측

재무 & CEO



경험의 판단

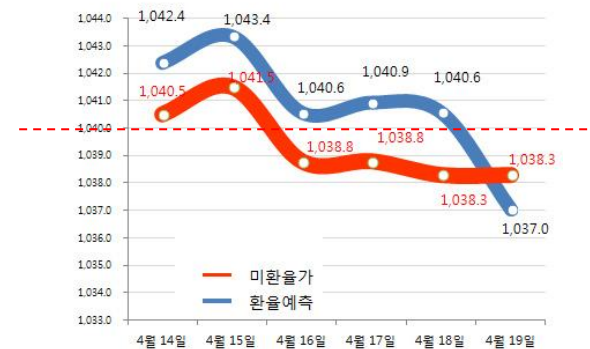
지능형 빅데이터 환율 예측

평균 주간 환율

1035.8

1033.8 ~ 1039.8

2014년 4월 3주차

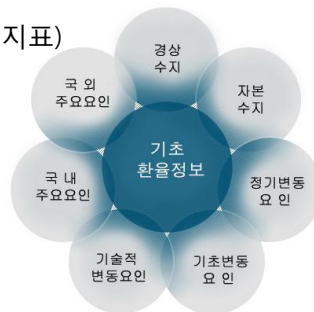


전 통 적 방 법

빅 데이터 방법론

환율 예측 변동 요인 및 구성

1. 기초 환율 정보 : 월 외환보유액, 월별 증감율
2. 경상 수지 : 월별 수출 및 수입 실적, 누적 수지, 증감율
3. 자본 수지 : 연간/월간 누적액, 일별 외국 투자 실적 (코스피/코스닥/선물)
4. 정기 변동 요인 : 계절 변수, 월말 변수, 연휴 내외 변수
5. 기초 변동 요인 : 분기/연간 경제성장률, 채권 및 금리, 물가 상승률(국가별)
6. 기술적 요인 : 국가별 금융 정책 변수 (미국, 한국, 일본, 유럽) - 양국 정책
7. 국내 주요 요인 : KOEPI 경기지표외 3, KOSPI / KOSPI 200
8. 해외 금융 요인 : S & P Dow Jones Indices 3 Group
 - Dow Jones Averages 1 Group (3개 지표)
 - Dow Jones Strategy 2 Group (3개 지표)
 - Dow Jones Asset Class 3 Group (1개 지표)



65 Index

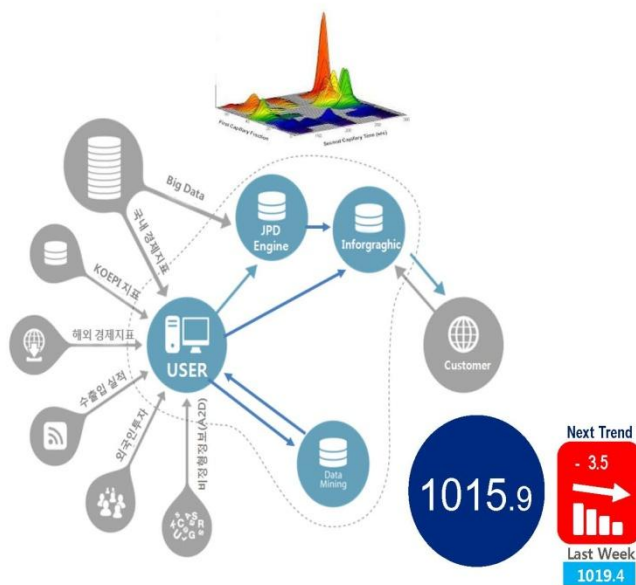


CEO Fx Primium Report

원-달러 환율 예측 분석 서비스

JBIG
JPD 외환예측연구소

JPD FX Weekly Report



JPD FX Weekly Report

JBIG

JPD 외환예측연구소

원-달러 환율 특보 (다음주)

국내 요인



맑음 → 흐림
1015.9
Forecast Average

글로벌 요인



Next Trend

- 3.5



This Week

1019.4

직접영향-1 : 월말 결제 네고물량

직접영향-2 : 국제 정세, 지정학적 리스크 완화

원-달러 주간 예측 (다음주)

08.25 ~ 08.29

FOREIGN EXCHANGE Forecast



Next Trend

- 3.5



This Week

1019.4

원-달러 주간 분석 (다음주)

FOREIGN EXCHANGE Forecast

Average	Week Trend	Fx Max	Fx Min	Range
1015.9	-3.5	1017.8	1015.1	2.7

JPD Foreign Exchange Prediction Analysis System



JPD FX Weekly Report

JBIG

주요 외환시장 동향

원-달러 환율 변동요인 평가 분석 (다음주)

국내 및 국외요인의 종합점수가 높으면 환율강세를 의미함.

국내 요인



JPD FX Weekly Report

국내 요인 (원화 강세요인)

경제심리 (VAF)	경제지표 (KOEPI)	월말 내고 물량	한국은행 금리	외국 자본 수지	수출 성장 수지	이머징 마켓 변수	ECB 유입 중 양은행	한국은행 경제 성장률	기타
10.0	10.0	9.0	10.0	11.0	10.0	10.0	10.0	10.0	10.0

Next Week

하락 요인



국외 요인



해외 요인 (달러 강세요인)

외국인 투자심리 (VAF)	우크라이나 내전	이라크 내전	아르헨티나 디폴트 위기	포르투갈 금융위기	FOMC 미연방 공개위원회 (Fed-연준)	미연방 준비제도 (Fed-연준)	중국 경제성장	대북정세	기타
10.0	10.0	10.0	10.0	10.0	10.0	10.0	10.0	10.0	9.0

W

JPD FX Weekly Report

국내 요인 (원화 강세요인)

경제심리 (VAF)	경제지표 (KOEPI)	월말 내고 물량	한국은행 금리	외국 자본 수지	수출 성장 수지	이머징 마켓 변수	ECB 유입 중 양은행	한국은행 경제 성장률	기타
10.0	10.0	9.0	10.0	11.0	10.0	10.0	10.0	10.0	10.0

\$

해외 요인 (달러 강세요인)

외국인 투자심리 (VAF)	우크라이나 내전	이라크 내전	아르헨티나 디폴트 위기	포르투갈 금융위기	FOMC 미연방 공개위원회	미연방 준비제도 (Fed-연준)	중국 경제성장	대북정세	기타
10.0	10.0	10.0	10.0	10.0	10.0	10.0	10.0	10.0	9.0



JPD FX Weekly Report

JBIG

주요 외환시장 동향

원-달러 환율 증장기 예보



원-달러 환율 정책 요인 이슈 분석

한국은행 0.4%	금융통화 위원회 "0.25% 금리인하" - 기준금리 2.5%에서 2.25% 인하 - 향후 장기적인 부동산, 소비진작을 위한 정책의 완화 조치	8월 14일
IMF 발표 15억\$	아르헨티나 디폴트 사태 15억불 채무상환 - RUFO(Right Upon Future Offer) 조약에 의한 채무 상환의 어려움 - 예정된 시리, 예정된 금융준안	8월 01일
미 상무부 4.0%	미국 2/4 분기 GDP 성장률 - 미국 상무부는 지난 2분기 성장률 증경치가 4.0%를 기록했다고 발표 - 기존 예상치 3.0%를 크게 밑바친 수준	7월 30일
IMF 발표 90.9%	미국 소비자신뢰지수 7년만의 최고치 90.7 - 미국 민간 시장조사업체 컨퍼런스보드 결과 지수 - 전문가 예상치 85.3을 크게 상회	7월 30일



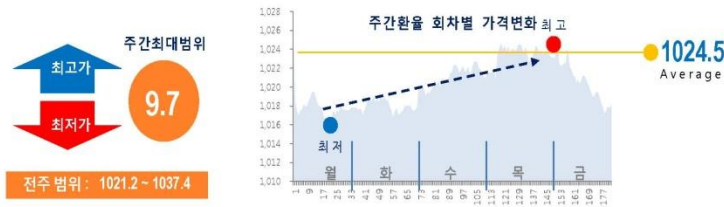
JPB FX Weekly Report

JBIG
JPB 빅데이터연구소

원-달러 환율 예측 검증 (전주 실적)



원-달러 환율 일일 변동가 분석



일자	08월 18일	08월 19일	08월 20일	08월 21일	08월 22일
일일 환율분석	최고가 1024.9 최저가 1015.8 등락폭 9.1	최고가 1019.0 최저가 1016.7 등락폭 2.3	최고가 1022.7 최저가 1018.0 등락폭 4.7	최고가 1025.5 최저가 1020.9 등락폭 4.6	최고가 1023.9 최저가 1017.1 등락폭 6.8
외환매감	1,017.5	1,017.5	1,021.5	1,022.5	1,018.0



● 일별 환전 시점의 변동에 따른 기업 가격 경쟁력 분석 (1억불 환전시)



JPB FX Weekly Report

JBIG
JPB 빅데이터연구소

원-달러 주간 환율 쇼크 분석 (금주 실적)



100~107	108~112	113~120	121~130	131~140	141~
매우안정	다소안정	다소불안정	불안정	우려상황	심각수준

Daily Shock Power의 약자이며, JPB 빅데이터 연구소에서 개발한 일일 환율 쇼크 지수이다. 일일 환율 변동성이 전일과 동일할 때를 100으로 기준하고, 환율 변동 폭의 크기를 에너지의 수치로 변환하여 일일 환율 변동 크기를 다양하게 비교 분석하기 위하여 개발된 지표임.

금주 환율 쇼크 지수



분석의견

다소 안정

원-달러 환율의 국내 거래량 분석

일일 환율 거래량

- 일일 환율 거래량 분석은 국내 환율과 관련된 금융 거래 총량의 규모를 확인함으로써, 일일 환율 변동에 대한 의구심과 불안한 심리적 영향을 명확한 거래 데이터 분석을 통하여 의사결정자에게 인사이트를 제공하기 위하여 분석 정보임



2013년				2014년	
(단위: 억 달러)					
1분기	2분기	3분기	4분기	1분기	2분기
492.1	491.4	434.0	423.0	450.9	491.4
	-0.1%	-11.7%	-2.5%	6.6%	9.0%

외환 거래액(일)

구분	1분기	2분기
현물환	179.6	198.6
외환상품	271.3	292.8
계	450.9	491.4



구분	1분기	2분기
은행	211.9	249.4
비거주자	150.8	156.4
대고객	88.2	85.6
계	450.9	491.4

미래
예측



JPD Global BIGDATA Service

LME : 철금속/미철금속 가격 예측

- ▶ Gold
- ▶ Copper
- ▶ Iron Ore

CBOT : 농산물 국제 가격

- ▶ wheal
- ▶ Cone
- ▶ Soybeen
- ▶ Pork

NYMEX : 에너지 및 금속

- ▶ WTI
- ▶ Natual Gas
- ▶ Coal

JPD 미래 예측 방법론

JPD Prediction Methodology (JPM)

