

퀴즈 : 15주차 1차시 (이름 :)

☞ 다음 표는 우리나라의 주요 거시변수의 통계량을 나타낸 것이다. 이를 이용하여 다음 물음에 답하라.
 ○대상기간 : 1970: I ~1997: III (111분기)

주요변수의 변동폭 및 시차상관계수

| 변 수 | 표준편차 | 상대적 표준편차 | GDP와의 시차상관계수 | | | | | | | | | |
|-------|------|----------|--------------|------|------|------|---------------|------|-------|-------|-------|--|
| | | | -4 | -3 | -2 | -1 | 0= γ_0 | +1 | +2 | +3 | +4 | |
| G D P | 2.19 | 1.00 | 0.20 | 0.33 | 0.51 | 0.68 | 1.00 | 0.68 | 0.51 | 0.33 | 0.20 | |
| 소 비 | 1.01 | 0.46 | 0.01 | 0.16 | 0.30 | 0.50 | 0.70 | 0.66 | 0.59 | 0.41 | 0.27 | |
| 투 자 | 8.01 | 3.65 | 0.12 | 0.33 | 0.53 | 0.67 | 0.70 | 0.62 | 0.51 | 0.40 | 0.20 | |
| 수 출 | 7.17 | 3.27 | 0.27 | 0.37 | 0.44 | 0.43 | 0.35 | 0.24 | 0.06 | -0.11 | -0.25 | |
| 수 입 | 5.97 | 2.72 | -0.02 | 0.18 | 0.44 | 0.65 | 0.66 | 0.58 | 0.51 | 0.29 | 0.22 | |
| 무역수지 | 2.83 | 1.29 | 0.40 | 0.37 | 0.31 | 0.19 | 0.12 | 0.00 | -0.13 | -0.22 | -0.37 | |
| 자본스톡 | 0.88 | 0.40 | 0.15 | 0.20 | 0.16 | 0.15 | 0.09 | 0.05 | 0.02 | -0.02 | -0.05 | |
| 노동투입 | 1.59 | 0.72 | 0.14 | 0.17 | 0.23 | 0.29 | 0.35 | 0.30 | 0.27 | 0.15 | 0.00 | |
| 교역조건 | 5.61 | 2.56 | 0.36 | 0.41 | 0.50 | 0.52 | 0.48 | 0.36 | 0.25 | 0.08 | -0.03 | |

1. 모든 비교의 기준이 되는 변수는 무엇인가? ()
2. 경기순응하는 변수 중 변동성이 가장 큰 변수는 무엇인가? ()
3. 경기선행하는 변수 중 변동성이 가장 작은 변수는 무엇인가? ()

☞ 다음은 2007년 1/4분기부터 2019년 3/4분기까지 한국 주요 거시변수의 교차 및 시차상관계수를 분석한 결과이다. 이를 이용하여 다음 물음에 답하라. 단 실질총생산(korea.ts[,1]), 민간소비(korea[,2]), 고정투자(korea.ts[,3]), 건설투자(korea.ts[,4]), 수출(korea.ts[,5]), 수입(korea.ts[,6])을 타나낸다.

```
> (ccfyy<-ccf(korea.ts[,1], korea.ts[,1],lag.max=8))
Autocorrelations of series 'x', by lag
-2.00 -1.75 -1.50 -1.25 -1.00 -0.75 -0.50 -0.25 0.00 0.25 0.50 0.75 1.00 1.25 1.50 1.75 2.00
-0.083 -0.062 -0.011 -0.018 -0.038 0.302 0.176 0.026 1.000 0.026 0.176 0.302 -0.038 -0.018 -0.011 -0.062 -0.083

> (ccfyp<-ccf(korea.ts[,1], korea.ts[,2],lag.max=8))
Autocorrelations of series 'x', by lag
-2.00 -1.75 -1.50 -1.25 -1.00 -0.75 -0.50 -0.25 0.00 0.25 0.50 0.75 1.00 1.25 1.50 1.75 2.00
-0.163 0.104 -0.053 -0.010 0.036 -0.025 0.093 0.089 0.279 0.392 -0.129 0.343 0.070 0.029 -0.050 0.072 -0.094

> (ccfyf<-ccf(korea.ts[,1], korea.ts[,3],lag.max=8))
Autocorrelations of series 'x', by lag
-2.00 -1.75 -1.50 -1.25 -1.00 -0.75 -0.50 -0.25 0.00 0.25 0.50 0.75 1.00 1.25 1.50 1.75 2.00
0.012 0.061 -0.134 0.024 0.074 0.035 0.051 0.237 0.374 0.233 -0.131 0.262 -0.244 -0.035 -0.124 0.017 0.033

> (ccfyc<-ccf(korea.ts[,1], korea.ts[,4],lag.max=8))
Autocorrelations of series 'x', by lag
-2.00 -1.75 -1.50 -1.25 -1.00 -0.75 -0.50 -0.25 0.00 0.25 0.50 0.75 1.00 1.25 1.50 1.75 2.00
-0.192 -0.057 -0.230 0.064 -0.238 -0.315 -0.033 -0.306 -0.099 0.036 0.164 -0.081 0.138 0.010 0.068 -0.071 0.114

> (ccfyx<-ccf(korea.ts[,1], korea.ts[,5],lag.max=8))
Autocorrelations of series 'x', by lag
-2.00 -1.75 -1.50 -1.25 -1.00 -0.75 -0.50 -0.25 0.00 0.25 0.50 0.75 1.00 1.25 1.50 1.75 2.00
0.033 0.026 0.300 0.053 0.234 0.511 -0.091 0.284 0.494 -0.149 0.227 0.067 -0.063 -0.016 -0.117 -0.023 -0.080

> (ccfyi<-ccf(korea.ts[,1], korea.ts[,6],lag.max=8))
Autocorrelations of series 'x', by lag
-2.00 -1.75 -1.50 -1.25 -1.00 -0.75 -0.50 -0.25 0.00 0.25 0.50 0.75 1.00 1.25 1.50 1.75 2.00
-0.155 0.252 0.098 0.069 0.276 0.278 0.015 0.153 0.653 0.087 0.013 0.242 -0.081 -0.096 -0.099 -0.004 -0.094
```

4. 경기동행 변수를 모두 써 넣어라 ()
5. 경기선행 변수를 모두 써 넣어라 ()
6. 경기후행 변수를 모두 써 넣어라 ()