

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												
변수	표준편차	상대적 표준편차	GDP와의 시차상관계수									
			-4	-3	-2	-1	0= γ_0	+1	+2	+3	+4	
GDP	2.19	1.00	0.20	0.33	0.51	0.68	1.00	0.68	0.51	0.33	0.20	
소비	1.01	0.46	0.01	0.16	0.30	0.50	0.70	0.66	0.59	0.41	0.27	
투자	8.01	3.65	0.12	0.33	0.53	0.67	0.70	0.62	0.51	0.40	0.20	
수출	7.17	3.27	0.27	0.37	0.44	0.43	0.35	0.24	0.06	-0.11	-0.25	
수입	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	
자본소득	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

> (ccfyek<-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

> (ccfyik<-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 ()