**FAVAR 모형 변수, 요인**

여러가지 변수들-> 단위근 검정, 그레인저 인과관계 -> VAR 모형

인과관계 검정에서 유의했던 변수

거래량 추가해야함-> 어디에?

Gold\_price, Bond\_yield, USD\_exchange\_rate, BTC\_circulation 제외?

거시경제요인: -> 일별데이터가 없고, 변동성이 적어서 제외됨…?

앞선 인과관계 검정에서 유의하지 않게 나올거임 아마

금융요인: KOSPI, S&P,

금융변동성요인: VKOSPI, VIX

주가요인: Nvidia, AMD, MA, PYPL, SQ, vident

감성지수

거래량, 감성변수 같은 크게 영향을 미친느 지표만 그대로 넣고, 나머지는 금융요인, 금융변동성요인, 주가요인 등 block,으로 해서 pca진해행해서 factor로 넣음.