

# VAR 모델

---

## ○ VAR

**예측뿐만 아니라 어떤 변수의 일시적인 충격에 대한 효과분석을 위하여  
연립방정식 체계로 구성된 모형**

---

- 첫째, 충격반응분석(impulse response analysis)을 통하여 어떠한 한 변수의 변화가 내생변수에 미치는 동태적 반응을 파악 가능
  - 둘째, 분산분해(variance decomposition)를 통해 각 내생변수의 변동이 전체변동에 기여한 부분의 상대적 크기 분석 가능
  - 셋째, 경제이론 보다는 실제 자료에서 도출된 결과를 분석 가능
-

# VAR 모델

## ○ 변수 선정

**KOSPI 200**  
**VIX, 환율, 금**

## ○ 시계열 확인

