

Table 1: Exemple sur données américaines

Statistiques du cycle américain	
COR(Y,C)	0.770
Volatilite de (Y)	1.600
Volatilite relative de C	0.770
AR (1)	0.850
AR (2)	0.620
AR (3)	0.350
AR (4)	0.120
AR (5)	-0.070

Données HP filtrées.