

Pregunta 1

Diego Uriarte

28 de junio de 2018

Cargamos el archivo

```
file_location <- "../Eviews/tabla_latex_1980q1_2005q3.csv"
data <- read_csv(file_location, skip = 1, locale = locale(encoding = 'Windows-1252'))
```

```
## Warning: Missing column names filled in: 'X2' [2]
```

```
colnames(data)[2] <- ""
colnames(data)[1] <- ""
head(data)
```

Generamos la tabla que replica la tabla 7 del paper

Actualizamos los hechos estilizados tomando toda la data disponible

```
file_location <- "../Eviews/tabla_latex_1980q1_2018q1.csv"
data <- read_csv(file_location, skip = 1, locale = locale(encoding = 'Windows-1252'))
```

```
## Warning: Missing column names filled in: 'X2' [2]
```

```
colnames(data)[2] <- ""
colnames(data)[1] <- ""
head(data)
```

Ahora solo desde 1994:

```
## Warning: Missing column names filled in: 'X2' [2]
```

Table 1: Comportamiento de los componentes del ciclo: 1980.I - 2005.III

| Variables | Volatilidad Relativa | Correlaciones cruzadas del PBI real con | | | | | | | | | | |
|------------------------|----------------------|---|--------|--------|--------|--------|-------|--------|--------|--------|--------|--------|
| | | x(t-5) | x(t-4) | x(t-3) | x(t-2) | x(t-1) | x(t) | x(t+1) | x(t+2) | x(t+3) | x(t+4) | x(t+5) |
| Producto Bruto Interno | 1.00 | 0.05 | 0.11 | 0.31 | 0.61 | 0.89 | 1.00 | 0.89 | 0.61 | 0.31 | 0.11 | 0.05 |
| Consumo Privado | 1.17 | 0.13 | 0.16 | 0.29 | 0.53 | 0.80 | 0.94 | 0.87 | 0.62 | 0.31 | 0.07 | -0.03 |
| Inversion Privada | 2.76 | 0.00 | 0.05 | 0.19 | 0.43 | 0.68 | 0.84 | 0.80 | 0.60 | 0.34 | 0.12 | 0.04 |
| Consumo Público | 1.53 | 0.05 | 0.03 | 0.16 | 0.42 | 0.68 | 0.79 | 0.68 | 0.43 | 0.19 | 0.07 | 0.08 |
| Inversión Pública | 2.73 | -0.21 | -0.08 | 0.16 | 0.40 | 0.50 | 0.41 | 0.19 | -0.03 | -0.17 | -0.18 | -0.11 |
| Exportaciones | 0.89 | -0.05 | 0.03 | 0.15 | 0.20 | 0.11 | -0.09 | -0.27 | -0.34 | -0.26 | -0.12 | -0.01 |
| Importaciones | 2.07 | -0.03 | -0.03 | 0.07 | 0.30 | 0.59 | 0.78 | 0.77 | 0.56 | 0.27 | 0.04 | -0.05 |
| Exportaciones netas | 0.40 | -0.02 | 0.02 | -0.01 | -0.19 | -0.45 | -0.67 | -0.72 | -0.57 | -0.32 | -0.09 | 0.02 |

Table 2: Comportamiento de los componentes del ciclo: 1980.I - 2018.I

| Variables | Volatilidad Relativa | Correlaciones cruzadas del PBI real con | | | | | | | | | | |
|------------------------|----------------------|---|--------|--------|--------|--------|-------|--------|--------|--------|--------|--------|
| | | x(t-5) | x(t-4) | x(t-3) | x(t-2) | x(t-1) | x(t) | x(t+1) | x(t+2) | x(t+3) | x(t+4) | x(t+5) |
| Producto Bruto Interno | 1.00 | 0.04 | 0.11 | 0.31 | 0.61 | 0.89 | 1.00 | 0.89 | 0.61 | 0.31 | 0.11 | 0.04 |
| Consumo Privado | 1.15 | 0.12 | 0.16 | 0.29 | 0.54 | 0.79 | 0.93 | 0.87 | 0.62 | 0.31 | 0.07 | -0.03 |
| Inversion Privada | 2.87 | 0.00 | 0.05 | 0.20 | 0.44 | 0.69 | 0.84 | 0.80 | 0.60 | 0.33 | 0.12 | 0.03 |
| Consumo Público | 1.52 | 0.07 | 0.04 | 0.16 | 0.40 | 0.63 | 0.73 | 0.63 | 0.40 | 0.18 | 0.07 | 0.09 |
| Inversión Pública | 3.01 | -0.19 | -0.08 | 0.14 | 0.35 | 0.45 | 0.38 | 0.19 | -0.01 | -0.13 | -0.13 | -0.04 |
| Exportaciones | 1.02 | -0.04 | 0.03 | 0.15 | 0.20 | 0.13 | -0.03 | -0.19 | -0.27 | -0.22 | -0.12 | -0.03 |
| Importaciones | 2.26 | -0.03 | -0.02 | 0.09 | 0.33 | 0.60 | 0.77 | 0.75 | 0.54 | 0.25 | 0.02 | -0.07 |
| Exportaciones netas | 0.46 | 0.00 | 0.02 | -0.04 | -0.21 | -0.45 | -0.64 | -0.68 | -0.53 | -0.29 | -0.07 | 0.03 |

Table 3: Comportamiento de los componentes del ciclo: 1994.I - 2018.I

| Variables | Volatilidad Relativa | Correlaciones cruzadas del PBI real con | | | | | | | | | | |
|------------------------|----------------------|---|--------|--------|--------|--------|-------|--------|--------|--------|--------|--------|
| | | x(t-5) | x(t-4) | x(t-3) | x(t-2) | x(t-1) | x(t) | x(t+1) | x(t+2) | x(t+3) | x(t+4) | x(t+5) |
| Producto Bruto Interno | 1.00 | -0.20 | -0.07 | 0.21 | 0.57 | 0.87 | 1.00 | 0.87 | 0.57 | 0.21 | -0.07 | -0.20 |
| Consumo Privado | 0.96 | 0.08 | 0.20 | 0.33 | 0.48 | 0.61 | 0.70 | 0.68 | 0.56 | 0.37 | 0.16 | 0.00 |
| Inversion Privada | 4.18 | -0.03 | 0.02 | 0.20 | 0.46 | 0.70 | 0.84 | 0.82 | 0.67 | 0.43 | 0.20 | 0.03 |
| Consumo Público | 1.27 | 0.12 | 0.04 | -0.01 | 0.00 | 0.02 | 0.03 | 0.00 | -0.03 | -0.02 | 0.06 | 0.20 |
| Inversión Pública | 6.21 | -0.25 | -0.19 | -0.05 | 0.13 | 0.27 | 0.32 | 0.29 | 0.21 | 0.16 | 0.21 | 0.35 |
| Exportaciones | 1.98 | 0.08 | 0.17 | 0.21 | 0.21 | 0.18 | 0.13 | 0.05 | -0.03 | -0.07 | -0.07 | -0.06 |
| Importaciones | 3.96 | 0.00 | 0.03 | 0.17 | 0.40 | 0.62 | 0.76 | 0.75 | 0.59 | 0.33 | 0.06 | -0.15 |
| Exportaciones netas | 1.01 | 0.07 | 0.07 | -0.06 | -0.28 | -0.51 | -0.67 | -0.69 | -0.56 | -0.33 | -0.08 | 0.12 |