



## Seminario Aleatorio

*Sesión 277*

### *Nowcasting* del PIB Trimestral de México: Uso de Modelos de Estado Espacio, Modelos de Factores y Modelos Puente

Oscar de J. Gálvez-Soriano

*Banco de México*

#### Resumen

Se presenta un método de estimación oportuna del PIB trimestral de México, basado en la literatura de *Nowcasting*. Se analiza un periodo reciente para el cual se cuenta con información mensual y trimestral de los indicadores de interés. Se evalúa un Modelo de Estado-Espacio (*State Space Model*; SSM) comparándolo con dos Modelos de Ecuaciones Puente (*Bridge Equations*; BE) y dos Modelos de Factores. Los principales hallazgos de esta investigación sugieren que los Modelos de Ecuaciones Puente producen mejores pronósticos que el SSM y que los Modelos de Factores. Aun considerando la media o la mediana de todos los modelos, se prefiere el uso de las BE por su precisión, de acuerdo a la prueba de precisión de pronósticos de Diebold-Mariano (1995).

**Viernes 14 de agosto 2015, 13:00 hrs.**  
**Sala de videos 2, segundo piso,**  
**Biblioteca Raúl Baillères.**  
**Plantel Río Hondo**

En la red: <http://estadistica.itam.mx/es/51/contenido/seminario-aleatorio-de-estadistica>