

Pronósticos del PIB mediante modelos de factores dinámicos

Juan Carlos Carlo Santos

Resumen

El Instituto Nacional de Estadística de Bolivia publica los datos del Producto Interno Bruto con un retraso de entre tres y cuatro meses, reduciendo así el margen de acción de los responsables de la política económica frente a cambios imprevistos de esta variable. Ante esta necesidad, el presente documento apunta a tener estimaciones tempranas de este agregado macroeconómico mediante el uso de modelos de factores dinámicos propuestos por Stock y Watson (1988). Las series de datos incluidas en el modelo corresponden a variables relacionadas con los sectores financiero, monetario, real, y externo, incluso variables de precios. Los resultados obtenidos muestran que las estimaciones, a través de esta metodología, son más robustas en comparación con los modelos univariados y multivariados en las evaluaciones tanto dentro como fuera de la muestra.

Clasificación JEL: C32, C53, E23

Palabras clave: *Producto Interno Bruto, modelo de factores dinámicos, nowcasting*