

# Bayesian model averaging: an application to forecast inflation in Colombia

---

Borradores de Economía

**Número:**

604

**Publicado:**

Sábado, 1 Mayo 2010

**Clasificación JEL:**

C11, C15, C52, C53

**Palabras clave:**

Bayesian model averaging, forecast combination, Inflation, Information theoretical model averaging.

[Descargar documento](#)

## Lo más reciente

[Educación e inclusión financieras en América Latina y el Caribe: programas de los bancos centrales y las superintendencias financieras](#)

María José Roa-García, Gloria Amparo Alonso Masmela, Nidia García Bohórquez, Diego A. Rodríguez-Pinilla

[Deuda Pública, Expectativas sobre el Déficit Fiscal y su Transmisión al Componente Cíclico de las Tasas de Interés de Largo Plazo](#)

José Vicente Romero-Chamorro, Hernando Vargas-Herrera

[Borradores de Economía - Corto vs mediano plazo: movimientos del tipo de cambio, inversión y la composición por monedas de las hojas de balance](#)

Juan Camilo Medellín-Martínez, Sergio Restrepo Ángel

[Otras Publicaciones](#)

An application of Bayesian Model Averaging, BMA, is implemented to construct combined forecasts for the colombian inflation for the short and medium run. A model selection algorithm is applied over a set of linear models with a large dataset of potencial