

Forecasting with many predictors: an empirical comparison

Borradores de Economía

Número:

643

Publicado:

Martes, 1 Febrero 2011

Clasificación JEL:

C11, C15, C52, C53

Palabras clave:

Partial least squares, Principal components, Ridge regression.

[Descargar documento](#)

Lo más reciente

[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

[Oportunidades negadas: radiografía de la exclusión y el trabajo precario para la juventud en Cartagena](#)

Andrea Sofía Otero-Cortés, Karina Acosta, Jhorland Ayala-García, Oriana Álvarez Vos, Sara Rojas

[Otras Publicaciones](#)

Three methodologies of estimation of models with many predictors are implemented to forecast Colombian inflation. Two factor models, based on principal components, and partial least squares, as well as a Bayesian regression, known as Ridge regression are