

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

[Evaluación de los efectos de las recientes normas de provisiones sobre la asignación del crédito de consumo en Colombia](#)

Diego Fernando Cuesta-Mora, Fredy Alejandro Gamboa-Estrada, Camilo Eduardo Sánchez-Quinto

[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

[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