

# Forecasting with many predictors: an empirical comparison

**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

[Documentos de Trabajo sobre Economía Regional y Urbana - El impacto de las tiendas de descuento en los mercados laborales locales: Evidencia de Colombia](#)

Lukas Delgado-Prieto, Andrea Sofía Otero-Cortés, Andrés Calderón

[Documentos de Trabajo sobre Economía Regional y Urbana - Desastres naturales, declaratoria de emergencia y corrupción](#)

Jhorland Ayala-García

[Borradores de Economía - Impuestos a la deuda durante las crisis, ¿bendición encubierta?](#)

Julián Andrés Parra-Polanía, Carmiña Ofelia Vargas-Riaño

[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