

Bayesian forecast combination for

inflation using rolling windows : an emerging country case

Número:

705

Publicado:

Domingo, 1 Abril 2012

Clasificación JEL:

C22, C53, C11, E31

Palabras clave:

forecast combination, Shrinkage, Expert forecasts, Rolling window estimation

[Descargar documento](#)

Lo más reciente

[Borradores de Economía - ¿Los desastres naturales y los anuncios de eventos ENSO tienen un impacto en las medidas de expectativas de inflación basadas en el mercado?](#)

Luis Fernando Melo-Velandia, Daniel Parra-Amado, Juan Pablo Bermúdez-Cespedes

[Riesgo de balance en los bancos centrales: el papel del capital y las estrategias para preservarlo](#)

Lina Fernanda Torres-Gutierrez, Gonzalo Ossa-Stipcianos, Edwin Mauricio Parra-Rodriguez, Egberto Alexander Riveros, Alvaro José Martínez-Monroy, Julián Andrés Gómez-Durán, Juan Sebastián Rojas-Moreno

[De la calamidad a la oportunidad: mejoras en la calidad habitacional en Colombia durante el Fenómeno de la Niña 2010 - 2011](#)

Andrés Mauricio Sánchez-Jabba

[Otras Publicaciones](#)

Typically, when forecasting inflation rates, there are a variety of individual models and a combination of several of these models. We implement a Bayesian shrinkage combination methodology to include information that is not captured by the individual mod