

Bayesian forecast combination for inflation using rolling windows : an emerging country case

Borradores de Economía

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

[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](#)

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