

# 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

[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](#)

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