

# 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

[Documentos de Trabajo Sobre Economía Regional y Urbana - Impacto de los cierres en la vía al llano sobre los precios de los alimentos en Colombia](#)

Jhorland Ayala-García, Yesica Tatiana Lara-Silva, Alejandro Alberto Vargas-Villamil, Lina Romero-Chaparro

[Impacto macroeconómico y fiscal del cambio demográfico](#)

Jesús Alonso Botero-García, Ligia Alba Melo-Becerra, Cristian Castrillón Gaviria, Daniela Gallo

[Uncertainty and monetary policy: the case of the Central Bank of Colombia](#)

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