

# Modelling autoregressive processes with a shifting mean

Borradores de Economía

**Número:**

420

**Publicado:**

Viernes, 1 Diciembre 2006

**Clasificación JEL:**

C22, C52

**Palabras clave:**

Deterministic shift, nonlinear autoregression, nonstationarity, nonlinear trend

[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](#)

This paper contains a nonlinear, nonstationary autoregressive model whose intercept changes deterministically over time. The intercept is a flexible function of time, and its construction bears some resemblance to neural network models. A modeling techniq