

# 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

[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](#)

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