

# 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

[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](#)

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