

広島統計談話会  
Hiroshima Statistics Study Group

第 287 回談話会を下記のように開催致しますので  
御参集下さいますようご案内申し上げます。

You are cordially invited to the 287<sup>th</sup> meeting as scheduled below.

日 時 : 2014 年 11 月 28 日 (金) 15:00 –  
Date : November 28th, 2014 (Fri) 15:00 –  
場 所 : 放射線影響研究所 比治山ホール  
Place : RERF Hijiyama Hall  
演 者 : 山田 宏 博士 (広島大学 社会科学研究科 社会経済システム専攻 教授)  
Speaker : Hiroshi Yamada, Ph.D.  
Professor  
Department of Economics, Hiroshima University  
演 題 : 「I1 トレンド・フィルターの調整パラメータ選択」  
Title : “Selecting the Tuning Parameter of the I1 Trend Filter”

要 約 :

**Summary:**

The I1 trend filter, which is similar to the popular Hodrick-Prescott (HP) filter, seems to be quite promising because it enables us to estimate a piecewise linear trend without specifying the location and number of kink points a priori. Such a trend may be regarded as a result of occasional permanent shocks to the growth rate. Similarly to the HP filter, the value of the tuning parameter needs to be selected in applying this filter. In this talk we propose a method for selecting the tuning parameter of the I1 trend filter and its generalization.