**Soft**

mfbvar Package

Ankargren S., Yang Y. (2019) Mixed-Frequency Bayesian VAR Models in R: The mfbvar Package

nmecsys/nowcasting: R package for Dynamic Factor ... –

GitHubhttps://github.com/nmecsys/nowcasting

Пакет для **наукастинга** **(«прогнозирования текущей погоды»)** содержит полезные инструменты для использования динамических факторных моделей. В этой версии пакета мы представляем три метода, основанные на статьях Giannone et al. 2008 г. и Банбура и др. 2011 . Кроме того, пакет предлагает вспомогательные функции для обработки переменных, построения винтажей, визуализации результатов и т. д.

[**Nowcasting-Python**](https://github.com/MajesticKhan/Nowcasting-Python#nowcasting-python)

Репозиторий содержит код Python, который транслируется из кода Matlab, который создает динамическую факторную модель. Код Matlab и модель принадлежат [Федеральному резервному банку Нью-Йорка](https://github.com/FRBNY-TimeSeriesAnalysis/Nowcasting), [разработан Эриком Цянь (Eric Qian)](https://github.com/eric-qian) и [Брэндином Боком (Brandyn Bok](https://github.com/brandynbok)). Пожалуйста, посетите их [репозиторий](https://github.com/FRBNY-TimeSeriesAnalysis/Nowcasting) для получения дополнительной информации.

Переводимый код Matlab реализует концепцию nowcasting, описанную в статье Брэндина Бока (Brandyn [Bok](https://www.newyorkfed.org/research/staff_reports/sr830.html)), Даниэле Карателли (Daniele Caratelli), Доменико Джанноне (Domenico Giannone), Арджиа М. Сбордоне (Argia M. Sbordone) и Андреа Тамбалотти (Andrea Tambalotti), *Staff Reports 830*, Federal Reserve Bank of New York (подготовлена для 10-го тома *Annual Review of Economics*)

<https://github.com/sapphire921/midas_pro>

[**Midas\_pro**](https://github.com/sapphire921/midas_pro#midas_pro)

Python-версия регрессии смешанной выборки данных (MIDAS) (позволяет использовать многомерный MIDAS)

Этот пакет разработан на основе Midaspy. Эту версию можно использовать для регрессии MIDAS и многомерной регрессии MIDAS.

**Краткое введение в модель MIDAS:**

Модель выборки смешанных данных (MIDAS) — это инструмент прямого прогнозирования, который может связывать будущие низкочастотные данные с текущими и запаздывающими высокочастотными индикаторами и создавать различные модели прогнозирования для каждого горизонта прогнозирования. Он может гибко работать с данными, отобранными с разной частотой, и обеспечивать прямой прогноз низкочастотной переменной. Он включает в регрессию каждые отдельные высокочастотные данные, что решает проблемы потери потенциально полезной информации и неправильной спецификации.

Модель MIDAS может иметь более одного высокочастотного индикатора одновременно, что приводит к модели Multivariate-MIDAS (Multi-MIDAS). Рассматриваемые высокочастотные индикаторы могут иметь разные тета-параметры, разную частоту дискретизации и разную длину лага.

**MIDASpy**

**Overview**

**MIDASpy** is a Python package for multiply imputing missing data using deep learning methods. The **MIDASpy** algorithm offers significant accuracy and efficiency advantages over other multiple imputation strategies, particularly when applied to large datasets with complex features. In addition to implementing the algorithm, the package contains functions for processing data before and after model training, running imputation model diagnostics, generating multiple completed datasets, and estimating regression models on these datasets.

For an implementation in R, see our **rMIDAS** repository [here](https://github.com/MIDASverse/rMIDAS).

**Background and suggested citations**

For more information on MIDAS, the method underlying the software, see:

Lall, Ranjit, and Thomas Robinson. 2022. "The MIDAS Touch: Accurate and Scalable Missing-Data Imputation with Deep Learning." *Political Analysis* 30, no. 2: 179-196. doi:10.1017/pan.2020.49. [Published version](https://ranjitlall.github.io/assets/pdf/Lall%20and%20Robinson%202022%20PA.pdf). [Accepted version](http://eprints.lse.ac.uk/108170/1/Lall_Robinson_PA_Forthcoming.pdf).

Lall, Ranjit, and Thomas Robinson. 2023. "Efficient Multiple Imputation for Diverse Data in Python and R: MIDASpy and rMIDAS." *Journal of Statistical Software* 107, no. 9: 1-38. doi:10.18637/jss.v107.i09. [Accepted version](https://ranjitlall.github.io/assets/pdf/jss4379.pdf).

<https://www.cambridge.org/core/journals/political-analysis/article/abs/midas-touch-accurate-and-scalable-missingdata-imputation-with-deep-learning/5007854F57E88AF16D69BCCA4C5AF1FF>