

数据

- 1. 季度数据采用: (季度财报) 基本每股收益, 并收集“是否发生差错更正”[IfCorrect] 与“差错更正披露日期”[DeclareDat]数据
- 2. 日度数据采用: (收盘价的报酬率)
- 3. 应计算得所数据:
 - 季度财报估计值 - 季度财报公布值 => 季度财报预估值与真实值之间差
 - 季度财报公布时间 - 季度末时间 => 季度财报滞后公布时间
 - 股票从季度末至公布时间 (滞后时间区间) 中的股票变化 ($\frac{\text{初}-\text{末}}{\text{末}}$?)

论文阅读[季度财报公告时间对股票收益影响的实证研究](#)所得信息:

基于实际季度收益与预测季度收益的比较, 计算了**每个公司每个季度的收益预测误差**

- 数据的获取:
数据应满足以下条件:
 - 1. 公司的每日股价数据应是可获得的
 - 2. 公司的季度财报公布日期需要是已知的
 - 3. 公司的季度收益数据应是可获得的
- 另外, 文中用到的是公告滞后预测模型, 用于预测从季度末到公司*i*在季度*q*的财报公布的天数 (即财报滞后公布天数)

方法

- 总链接: [CRAN - Package midasr \(r-project.org\)](#).
- github-MIDASr包: [mpiktas/midasr: 用于混合频率时间序列数据分析的R包](#)

下一步根据论文[Mixed Frequency Data Sampling Regression Models-The R Package midasr.pdf](#)思考如何进行包的运用