

1. 进行表格整理

混频方法整理

模型	思想	缺点/优点	论文
聚合	通常取存量高频变量在一个低频周期内的平均值以及流量的综合，来代表低频周期 或 假设高频期的信息反映在最新值中，取较高频变量的最新的值作为存量和流量的变量，代表整个低频期		
插值	对低频变量进行插值:将高频变量视为缺失低频观测值的变量，比如用Chow Line和Sargan Drettakis等方法对低频观测值进行估计，将估计结果插入低频数据集中	很少使用，预测具有高偏差与高方差	Missing Observations：A Simultaneous Approach versus Interpolation by Related Series
桥式方程	桥式方程式将高频变量和低频变量连接起来的线性回归方程，桥式方程可以将多个相同频率的高频数据聚合成一个综合指标作为线性回归的回归量，从而用于低频数据的预测	只适用于短期预测，且最多只能提前一两个季度；计算量有负担	SHORT-TERM FORECASTS OF EURO AREA REAL GDP GROWTH AN ASSESSMENT OF REAL-TIME PERFORMANCE BASED ON VINTAGE DATA

模型	思想	缺点/优点	论文
MIDAS 混合数据 数据采样	对分布式滞后模型改进，使用精简的分布多项式滞后模型，每一步对高频数据采样后作为滞后模型中的滞后因子用于模型中；但由于估算步骤相关，每步MIDAS需重新用高频数据进行低频数据的滞后回归，重新进行估计(以通货膨胀证章与GDP为例：MIDAS是用月数据与季度数据抽样后用混合频率数据回归预测GDP，而不是将通货膨胀序列聚和到季度数据后回归预测GDP)	与典型的集合所有序列到最低频率抽样的方法相比，预测更有效	The MIDAS Touch: Mixed Data Sampling Regression Models
AR-MIDAS 模型	与MIDAS模型类似，加上了滞后因变量与AR dynamics		Forecasting US output growth using leading indicators: An appraisal using MIDAS models
无限制的 MIDAS 模型	不求助于函数分布式滞后多项式，在一般线性动态框架中导出不受限制的MIDAS (U-MIDAS)回归		Real-Time Nowcasting with Large Bridging Equations with Time-Varying Volatility

这篇文章中主要介绍的混频模型就这些，但要进一步理解MIDAS模型还得看：The MIDAS Touch: Mixed Data Sampling Regression Models

2. 精读论文《A SURVEY OF ECONOMETRIC METHODS FOR MIXED-FREQUENCY DATA》基本完成了，已经整理几乎所有可用信息，似乎已经从中不再能找出更多对混频数据思路的启发。
3. 阅读《The MIDAS Touch: Mixed Data Sampling Regression Models》和《Mixed data sampling (MIDAS) regression models》，对MIDAS还存在不理解的地方，表格也会在阅读更多论文之后进一步完善。

