

# 《金融数据库》目录

## 第 1 章 金融数据库概论

- 1.1 金融数据库的起源
- 1.2 金融数据库的作用
- 1.3 金融数据库的类别
- 1.4 中外金融数据库概况
  - 1.4.1 CRSP
  - 1.4.2 COMPUSTAT
  - 1.4.3 PACAP
  - 1.4.4 DATASTREAM
  - 1.4.5 NYSE TAQ
  - 1.4.6 IBES
  - 1.4.7 SDC
  - 1.4.8 GOVPX
  - 1.4.9 REUTER
  - 1.4.10 BLOOMBERG
  - 1.4.11 聚源
  - 1.4.12 世华
  - 1.4.13 万得
  - 1.4.14 锐思数据
  - 1.4.15 国泰安
- 1.5 金融数据库的选择标准
- 1.6 选择合适的数据库

## 第 2 章 股票

- 2.1 标识
  - 2.1.1 数据内容
  - 2.1.2 数据查询及应用
- 2.2 事件
  - 2.2.1 数据内容
  - 2.2.2 数据展示及应用
- 2.3 行情与分配
  - 2.3.1 数据内容

### 2.3.2 数据展示及应用

## 2.4 指数

### 2.4.1 数据内容

### 2.4.2 数据展示及应用

## 2.5 收益

### 2.5.1 数据内容

### 2.5.2 数据展示及应用

## 2.6 风险因子与三因子模型

### 2.6.1 数据内容

### 2.6.2 数据展示及应用

## 2.7 权证

### 2.7.1 数据内容

### 2.7.2 数据展示及应用

## 2.8 港股

### 2.8.1 数据内容

### 2.8.2 数据展示及应用

## **第 3 章 上市公司财务**

### 3.1 财务报表

#### 3.1.1 数据内容

#### 3.1.2 数据查询及运用

### 3.2 财务比率

#### 3.2.1 数据内容

#### 3.2.2 数据查询及运用

### 3.3 股东权益和资产减值准备

#### 3.3.1 数据内容

#### 3.3.2 数据查询及运用

### 3.4 公司治理

#### 3.4.1 数据内容

#### 3.4.2 数据查询及运用

### 3.5 公司重大事项

#### 3.5.1 数据内容

#### 3.5.2 数据查询与使用

## **第 4 章 基金**

- 4.1 标识与信息
  - 4.1.1 数据内容
  - 4.1.2 数据查询及应用
- 4.2 事件
  - 4.2.1 数据内容
  - 4.2.2 数据查询及运用
- 4.3 行情与净值
  - 4.3.1 数据内容
  - 4.3.2 数据展示及应用
- 4.4 投资组合
  - 4.4.1 数据内容
  - 4.4.2 数据展示及应用
- 4.5 财务指标
  - 4.5.1 数据内容
  - 4.5.2 数据展示及应用

## **第 5 章 固定收益**

- 5.1 银行存款利率
  - 5.1.1 数据内容
  - 5.1.2 数据查询及应用
- 5.2 基准利率
  - 5.2.1 数据内容
  - 5.2.2 数据展现与应用
- 5.3 标识与信息
  - 5.3.1 数据内容
  - 5.3.2 数据展现与应用
- 5.4 事件
  - 5.4.1 数据内容
  - 5.4.2 数据展现与应用
- 5.5 交易所交易数据
  - 5.5.1 数据内容
  - 5.5.2 数据展现与应用
- 5.6 银行间交易数据
  - 5.6.1 数据内容

5.6.2 数据展现与应用

5.7 债券指数

5.7.1 数据内容

5.7.2 数据展现与应用

## 第 6 章 宏观与行业

6.1 编码对照

6.1.1 数据内容

6.1.2 数据查询及应用

6.2 国民经济核算

6.2.1 数据内容

6.2.2 数据查询及应用

6.3 人口

6.3.1 数据内容

6.3.2 数据查询及应用

6.4 宏观金融统计

6.4.1 数据内容

6.4.2 数据查询及应用

6.5 主要产品产量和价格数据统计

6.5.1 数据内容

6.5.2 数据查询及应用

6.6 农业数据统计

6.6.1 数据内容

6.6.2 数据查询及应用

## 第 7 章 CRSP

7.1 日数据

7.1.1 数据内容

7.1.2 数据查询及应用

7.2 月数据

7.2.1 数据内容

7.2.2 累积收益与持有期收益之间的差别

7.2.3 没有交易时成交量却不为零的情况

7.3 事件数据

7.3.1 数据内容

- 7.3.2 数据查询及应用
- 7.4 最新文件（HEADER FILES）
  - 7.4.1 数据内容
- 7.5 CRSP 指数数据
  - 7.5.1 数据内容
  - 7.5.2 数据查询与应用
- 7.6 债券，国库券和通货膨胀
  - 7.6.1 数据内容
  - 7.6.2 数据查询及应用
- 7.7 CRSP 共同基金
  - 7.7.1 数据内容
  - 7.7.2 数据查询及应用
- 7.8 如何从 CRSP 获取数据
- 7.9 系统偏差和初步筛选
  - 7.9.1 系统偏差
  - 7.9.2 退市收益相关偏误
  - 7.9.3 股票分配价格调整相关偏误
  - 7.9.4 从日收益计算月收益
  - 7.9.5 如何获取标准普尔 500（S&P500）数据集
  - 7.9.6 数据筛选基础
  - 7.9.7 处理缺失值（缺损值）

## **第 8 章 COMPUSTAT**

- 8.1 工业年数据（COMPANN）
  - 8.1.1 数据内容
  - 8.1.2 数据查询及应用
- 8.2 分类数据
  - 8.2.1 数据内容
  - 8.2.2 数据查询及应用
- 8.3 管理层薪酬数据库（EXECCOMP）
  - 8.3.1 数据内容
  - 8.3.2 数据查询及应用
- 8.4 COMPUSTAT 当时数据（POINT-IN-TIME）
  - 8.4.1 数据内容

**第 9 章 IBES**

- 9.1 基本介绍和与 IBES 相关的研究主题
  - 9.1.1 市场有效性理论 vs.搜集公司信息的用处
  - 9.1.2 利益的冲突
  - 9.1.3 声望的影响
  - 9.1.4 意见的分散度是一种风险
  - 9.1.5 意见的分散度不是一种风险
  - 9.1.6 公共信息 vs.私人信息
  - 9.1.7 IBES vs. TAQ 数据
  - 9.1.8 预测准确性 vs.好的推荐
  - 9.1.9 基本介绍
- 9.2 详细历史数据
  - 9.2.1 数据内容
  - 9.2.2 数据查询及应用
- 9.3 概要历史数据
- 9.4 推荐数据集
- 9.5 停止数据集
- 9.6 除外文件
- 9.7 将 IBES 与 CRSP 或 COMPUSTAT 合并
- 9.8 其他
- 9.9 附录

**第 10 章 NYSE TAQ (高频数据)**

- 10.1 综合报价数据库集 (CONSOLIDATED QUOTE)
- 10.2 综合交易数据库集 (CONSOLIDATED TRADES)
- 10.3 TAQ 名称数据集 (TAQ NAMES)
- 10.4 主文件 (MASTER) 和红利文件 (DIVIDEND)
- 10.5 将 TAQ 和 CRSP 中的信息相匹配
- 10.6 如何得到区间交易数据
- 附录一 RESSET/DB 数据查询操作练习
- 附录 2 通过 ODBC 连接访问 RESSETDB
- 附录三 RESSET/DB 数据表名称对照表
- 附录 4 金融数据处理综合练习题