

沃顿研究数据中心

Erica Zhang 2018.11.30









WRDS 在中国大陆、香港和台湾的用户

中国大陆

北大光华管理学院

北大汇丰商学院

长江商学院

厦门大学

上海高级金融学院

上海财经大学

清华大学

香港中文大学(深圳校区)

中国人民大学

南方科技大学

西南财经大学

浙江大学

宁波诺丁汉大学

西交利物浦大学

中山大学

武汉大学

上海对外经贸大学

上海交通大学

电子科技大学

南开大学

哈尔滨工业大学

南京大学

对外经贸大学

中国香港

香港浸会大学

香港理工大学

香港科技大学

香港城市大学

香港中文大学

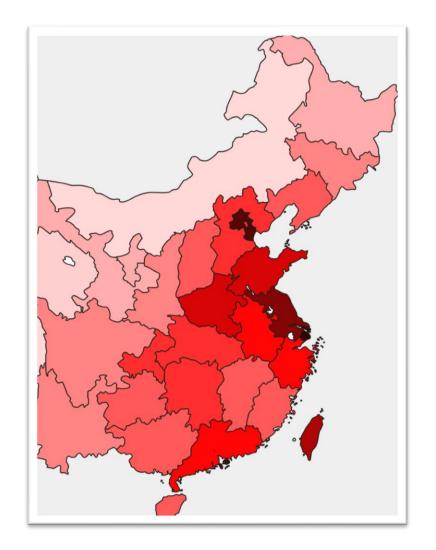
香港大学

恒生管理学院

岭南大学

中国台湾

国立政治大学 国立交通大学 国立台湾大学





WRDS 概述

广泛的数据选择

- 跨学科财经数据: 金融、会计、银行、经济、保险、营销、统计
- 实体管理和数据链接: 例如: CRSP (股票价格) & COMPUSTAT (基本面)

以互联网为基础: 灵活的投递和访问选择

WRDS提供多种访问数据的方式:

- 网络检索界面: 易于使用、即点即得
- WRDS 云存储: Scalable High Performance Computing & Storage
- 通过PC SAS / SAS Studio到SAS访问
- 通过SAS SHARE的MATLAB / Python / R等访问

更多优势

- WRDS分析工具及WRDS课堂应用
- 专业技术及研究支持



海量数据库

一站式数据商场

- 60多家数据供应商
- 600多家整合数据组
- 250多TB字节

数据管理

- 获取和上载
- 保存和验证
- 融合和链接

跨学科数据

- 会计
- 金融
- 经济
- 财务报表分析
- 市场营销和战略
- 国际商务

WRDS数据平台的数据样本

Financial Statements

Bureau van Dijk: Amadeus, Bankscope, ISIS, and OSIRIS

Capital IQ Compustat Fundamental

Capital IQ Compustat North America Annual & Quarterly

Capital IQ Compustat Global Fundamentals

Capital IQ Compustat Segments

Capital IQ Compustat Point-in-Time Fundamental CRSP CRSP Compustat Merged (CCM)

acteet

Factset

Stock Market Data

CRSP Stock Monthly & Daily

Capital IQ Compustat EMDB

Capital IQ Compustat North American Prices

Capital IQ Compustat Global Prices London Share Price Data (LSPD)

NYSE Euronext TAQ

OptionMetrics

Market Factors & Indices

Earnings Forecast & Ratings

Thomson Reuters IBES S&P Ratings Express Zacks

Ownership Data

CRSP Mutual Funds HFR

Thomson Reuters Insiders

Thomson Reuters 13F

Thomson Reuters Mutual Funds

WRDS MFLINKS

Fixed Income & Loan Data

CRSP Treasuries GOVPX Mergent FISD and NAIC Thomson Reuters DealScan TRACE Markit CDS

WRDS SEC Analytics Suite

WRDS SEC Filing WRDS CIK Linking Tables WRDS Filing Exhibits WRDS 8-K Items

Corporate Governance

Capital IQ Compustat Execucomp Corporate Library RiskMetrics KLD

Other Databases

Global Insight Economics Global Insight Commodities Global Insight Market Indices Call Reports Bank Holding Company Reports



部分合作数据商

















(即将上线)

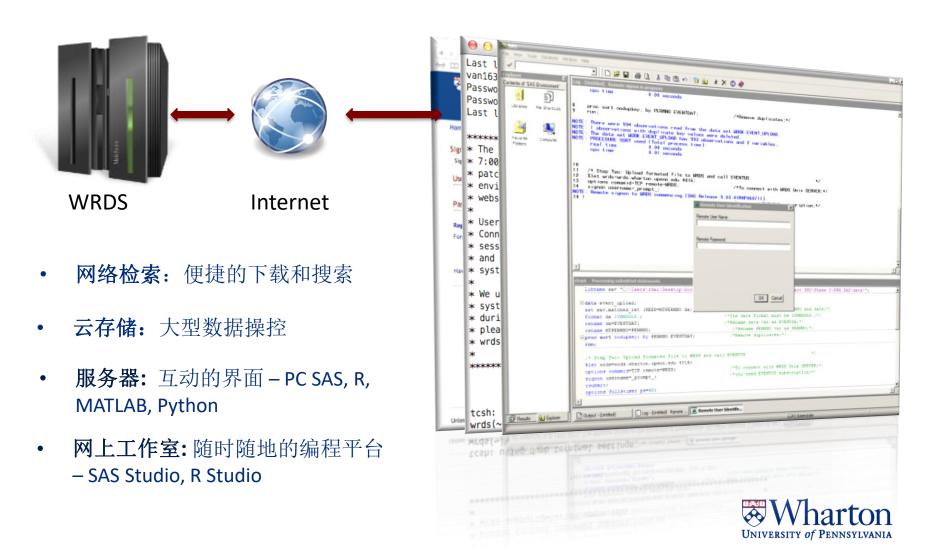


现有数据库 - 清华大学

- Compustat (标普资本智商):全面的财务数据库,收录公司的营运及财务状况信息。数据库覆盖130个国家,超过92,000个上市/退市公司;超过113,343个证券,几乎涵盖超过97%的市值。财务数据回溯到1950年
- CRSP(美国芝加哥大学证券价格研究中心): 最全面的汇聚了纽约证券交易所、 美国证券交易所及纳斯达克股市证券价格、回报和成交量系列数据。最早可回溯到 1926年
- **ETF**: ETF基金
- Option Metrics (IvyDB US): 包含1996年以来所有美国交易所上市和纳斯达克 股票和市场指数以及所有在美国上市的指数和股票期权的数据
- Factset Revere: 公司网络关系信息,包括供应链关系和地理收入风险
- **BvD**系列数据库: Orbis Bank Focus, Osiris
- TAQ:包含NYSE, AMEX, NMS和SmallCap上市的所有证券的日内交易数据
- Thomson Reuters (汤森路透): 13f, Dealscan, IBES, Ownership



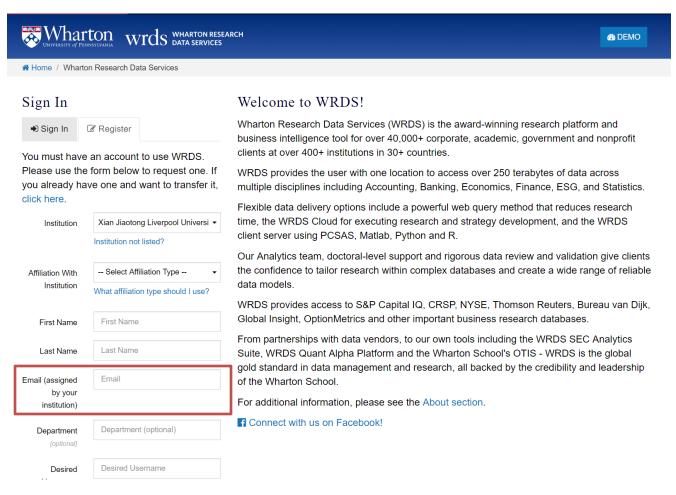
多种访问形式



更多访问选择

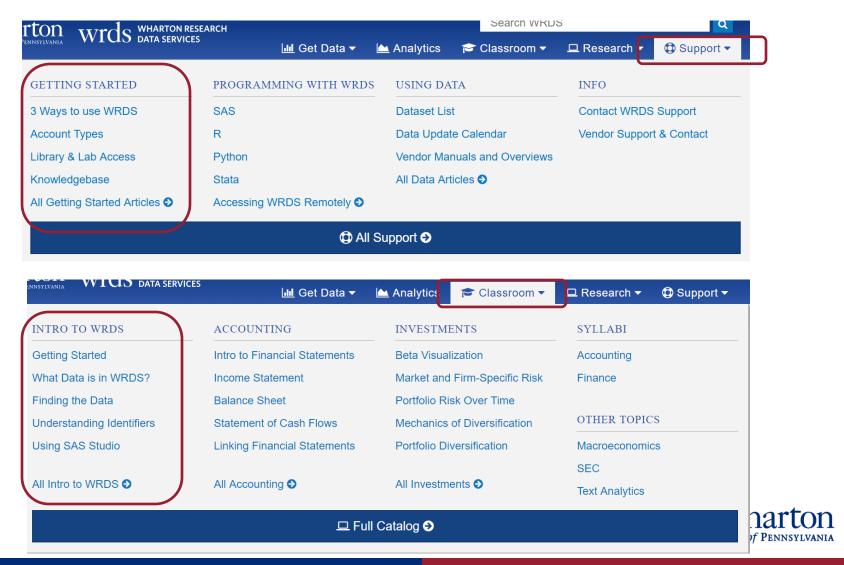


账号注册

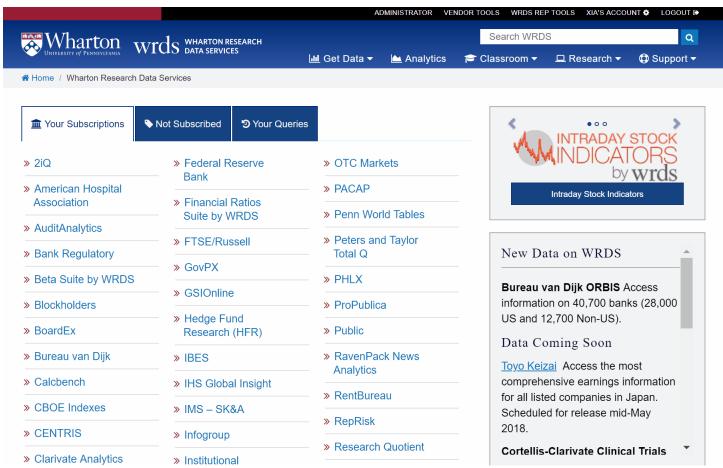




初始帮助

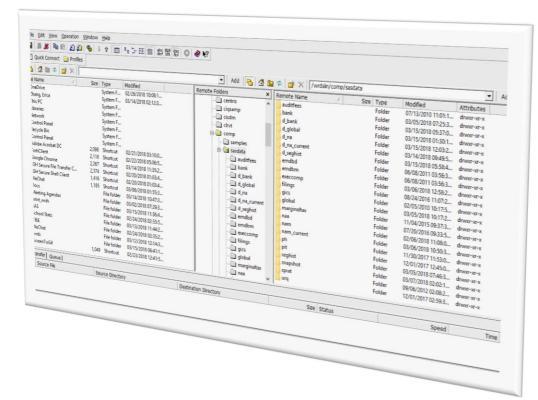


网页检索



SSH/SFTP

- · 任意的SSH/SFTP的用户端
 - Server: wrdscloud.Wharton.upenn.edu
 - Username: 网页登陆用户名
 - Password: 网页登陆密码
- 用途
 - 。 上传和下载任何格式的文档
 - 。 删除和建立文件和目录



https://wrds-

web.wharton.upenn.edu/wrds/support/Accessing%20and%20Manipulating%20the%20Data/ 002 Unix%20Access/



PC SAS

- 通过在本地安装的SAS程序实现与WRDS的互动式程序设计和检索。实现远端主机 处理、集合、保存资料
- 操作步骤:

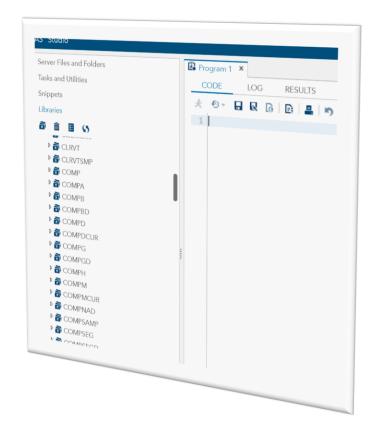
```
    链接:
        %let wrds = wrds.wharton.upenn.edu 4016;
        options comamid = TCP remote = WRDS;
        signon username = _prompt_;
    运行:
        rsubmit;
        {Program}
        endrsubmit;
    退出:
        signoff;
```

https://wrds-

web.wharton.upenn.edu/wrds/support/Accessing%20and%20Manipulating%20the%20Data/_003PCSAS%20Connect/Using%20PC %20SAS%20CONNECT%20--%20Secure%20Port%20Configuration.cfm

SAS Studio

- 无需购买安装PC-SAS也可以实现WRDS的互动 式程序设计和检索
- 硬件需求:任何配备全面功能浏览器的设备 (PC、MAC、lpad)
- https://wrdscloud.wharton.upenn.edu/SASStudio/





更多软件支持,如R、Python、Stata、Matlab等

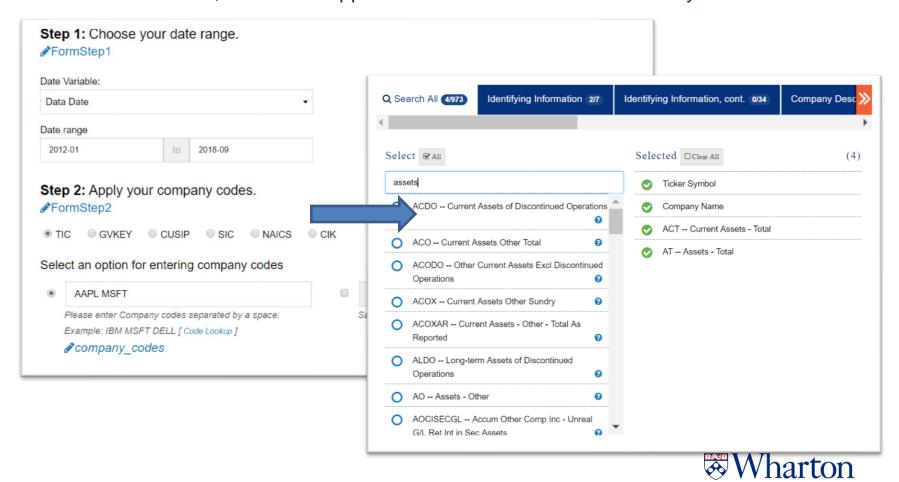




Compustat: 示例 – 网络检索

Live Demo

Get Current Assets, Assets for Apple and Microsoft after 2012 January

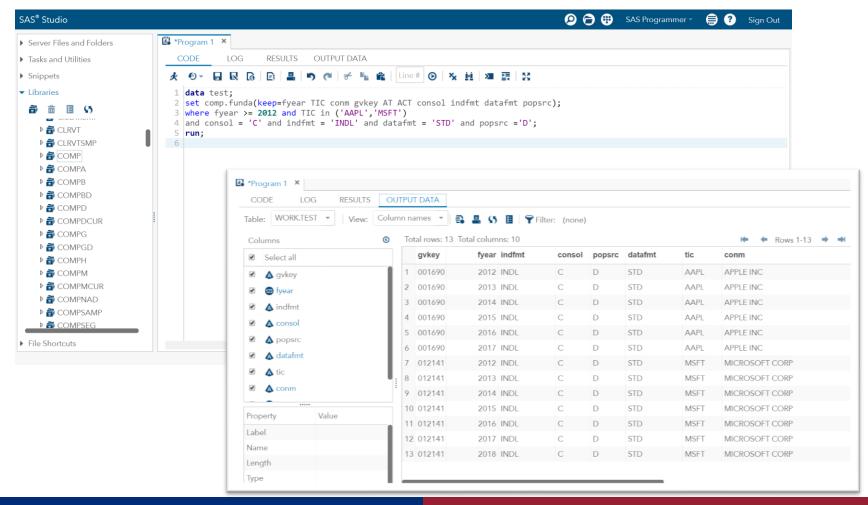


University of Pennsylvania

Compustat: 示例 – SAS Studio

Live Demo

Get Current Assets, Assets for Apple and Microsoft after 2012 January



WRDS科研工具(WRDS Analytics)

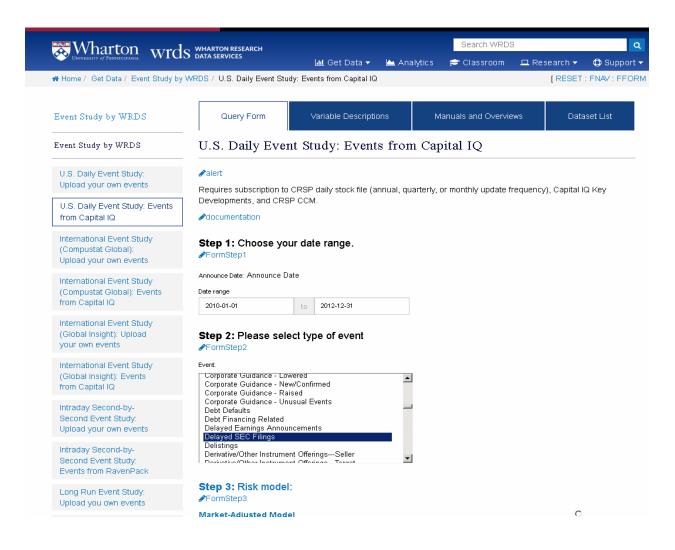
WRDS Products

- » Beta Suite by WRDS
 » Efficient Frontier by WRDS
 » Event Study by WRDS
 » Financial Ratios Suite by WRDS
- Intraday Indicators by WRDS
 Linking Suite by WRDS
 Option Suite by WRDS
 World Indices by WRDS
- » WRDS Bond Returns
- » WRDS SEC Analytics Suite

- 事件研究
- 日内交易数据库
- 公司财务比率
- 债券收益
- 贝塔计算
- 美国证监会审批文件
- 跨数据库的链接与配对



WRDS科研工具示例1:事件研究





WRDS科研工具示例2: 财务比率

- 超过70个提前预算的财务比率
 - 盈利能力
 - 偿债能力
 - 营运能力
 - 估值分析
- 公司层面 & 行业层面比率
- 数据来源: Compustat/CRSP/IBES
- 大量使用于公司金融和资本定价实证 研究



Financial Ratios: Firm Level

With the Financial Ratios: Firm Level tool you can access over 70 pre-calculated financial ratios for all U.S. companies across eight different categories.

- Calculates ratios most commonly used in accounting and finance research
- Monthly time series of financial ratios per company



Financial Ratios: Industry Level

This tool enables you to access over 70 pre-calculated financial ratios at industry or sector-level aggregation.

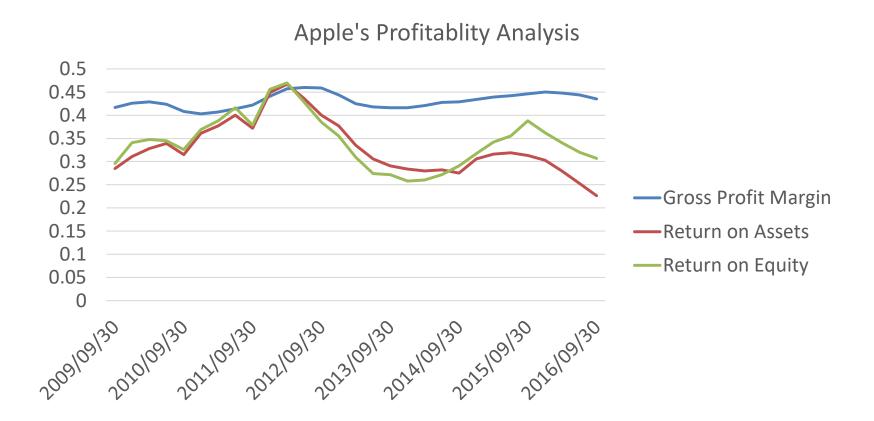
- Choose between universe of CRSP Common Stock or S&P 500 Index Constituents
- Use GICS Sectors or Fama-French Industries Classification

More →

More →



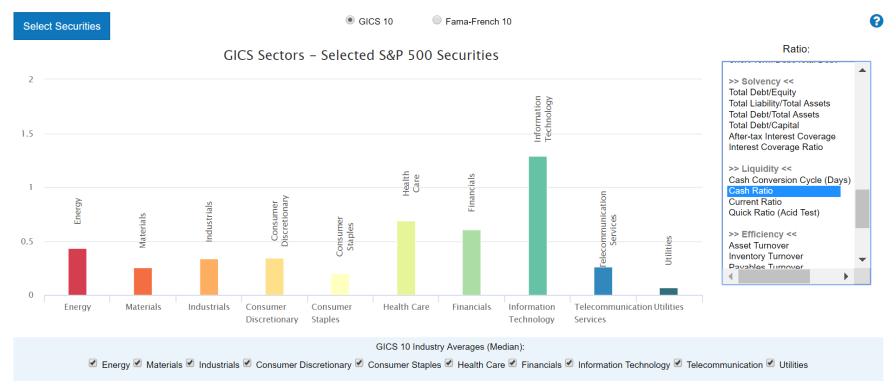
WRDS科研工具示例2:财务比率 - 公司层面





WRDS科研工具示例2: 财务比率 – 行业层面

Financial Ratios



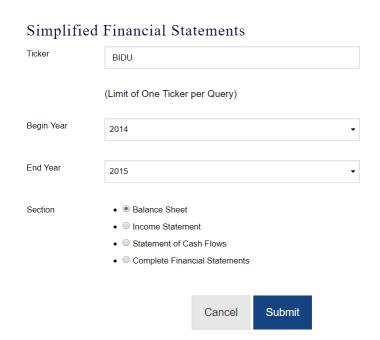


WRDS课堂应用(WRDS Classroom)





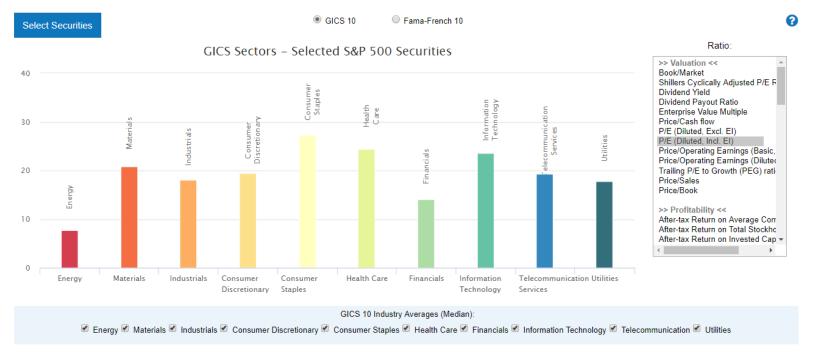
WRDS教学工具示例1:财务报表入门



Financial Statement for: BAIDU INC Fiscal Years: 2014 to 2015 Numbers in millions USE		
	14dilibero il 1	TIIIIIOTIO GGB
BALANCE SHEET		
	2014	2015
ASSETS		
Cash and Short-Term Investments	9,361.405	10,501.277
Cash	2,232.654	1,537.549
Short-Term Investments	7,128.751	8,963.728
Receivables	701.661	990.025
Receivables - Trade	590.602	606.264
Income Tax Refund	0.000	0.000
Current Receivables - Other	111.059	383.761
Inventories - Total	0.000	0.000
Inventories - Raw Materials	0.000	0.000
Inventories - Work in Process	0.000	0.000
Inventories - Finished Goods	0.000	0.000
Inventories - Other	0.000	0.000
Current Assets - Other	548.520	585.894
Prepaid Expense	317.477	354.450
Other Curr.Asst, Excl.Ppd.Exp.	231.043	231.444

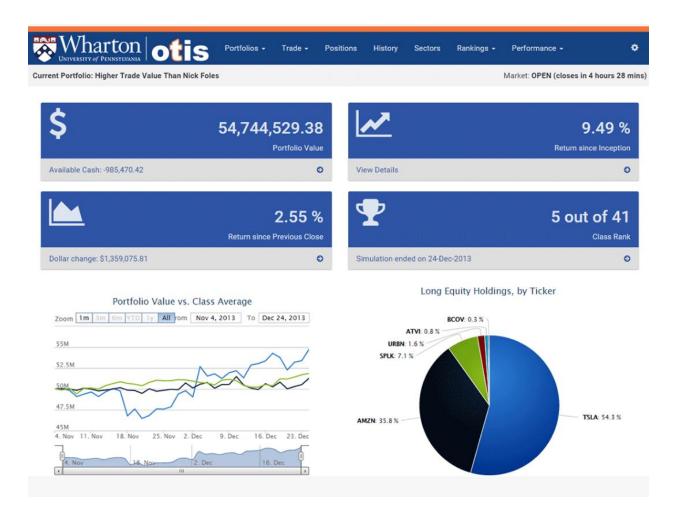
WRDS教学工具示例2: 财务比率可视化

Financial Ratios





WRDS教学工具示例3: otis实时模拟交易平台



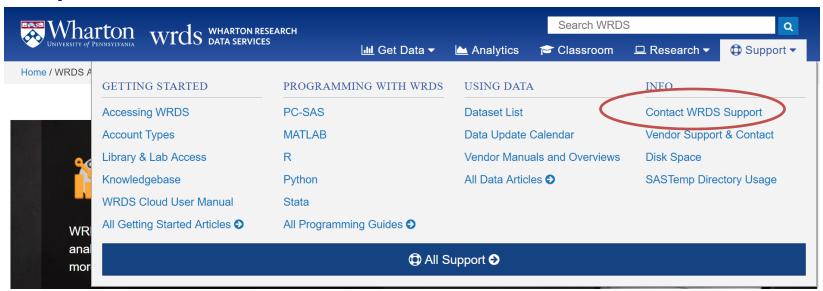






联系我们

http://www.whartonwrds.com



 通过 <u>Contact WRDS Support</u> 或发邮件至wrdssupport@wharton.upenn.edu



联系WRDS

- 张霞 Erica
- 亚太地区客户拓展副总监
- 电话/微信: 18817669767
- 电子邮件: <u>xiazhan@wharton.upenn.edu</u>
- St. Leonard's Court Suite 300
- 3819 Chestnut Street
- Philadelphia, PA 19104
- 主页: <u>http://whartonwrds.com</u>

