

统计软件与金融数据

第六章 WIND API

罗智超 (*ROKIA.ORG*)

Contents

通过本章你将学会	2
安装 Wind	2
windR 函数	2
获取数据	2
计算股票收益率	4
获取经济数据	4
应用举例	4
股票代码开头	4

通过本章你将学会

- 通过 WIND API 获取金融、经济数据

安装 Wind

- 安装 Wind
- 安装 windR 包

windR 函数

类型	函数名	函数功能
数据	wsd/wss	获取日间基本面数据、行情数据、技术指标等
	wsi	获取分钟行情数据、支持技术指标变参
	wst	获取日内买卖十档盘口快照、成交数据
	wsq	获取订阅实时行情数据
	wset	获取变长数据集数据：指数成分、分红、ST股票等
功能	weqs	与终端证券筛选交互
	wpf/wupf	组合管理报表下载/组合持仓数据直接上传
日期	tdays/dayoffset	获取日期时间序列/获取前推后推日期
	tdayscount	计算日期间距
交易	tlogin/tlogout	交易登陆/退出
	torder/tcancel	交易下单/撤单
	tquery	资金/委托/成交/持仓查询
回测	bktstart/bktend	开始回测/结束回测
	bktorder/bktquery	回测进行中的下单/查询
	bktsummary	回测结果查询

Figure 1: windR 函数一览

获取数据

```
library(windR)
w.start()
w.menu()
w.isconnected()
# 获取历史交易数据 (日)
data<-w.wsd("600000.SH","close,amt",
            "2013-04-30",Sys.Date()-1)
w.menu("wsd")# 调入向导
```

```

# 获取分钟数据
data<-w.wsi("600000.SH","close,amt",
            "2013-05-30 9:00:00")
# 取浦发银行分钟收盘价等 信息

# 获取日内 tick 级别数据

data<-w.wst("600000.SH","open",
            Sys.time()-2*3600,
            Sys.time())
# 取浦发银行 tick 数据信息

# 获历史截面数据
data<-w.wss("600000.SH,000001.SZ",
            "eps_ttm,orps,surpluscapitalps",
            "rptDate=20121231")

# 取浦发银行等财务数据信息

# 获取板块、指数等成分数据（命令用来获取数据集信息，
# 包括板块成分、指数成分、ETF 申赎成分信息、
# 分级基金明细、融资标的、融券标的、融资融券担保品、
# 回购担保品、停牌股票、复牌股票、分红送转）

data<-w.wset("SectorConstituent",
            "date=20130608;
            sector= 全部 A 股")
# 取全部 A 股股票代码、名称信息 # 取沪深 300 指数中股票代码和权重

data<-w.wset("IndexConstituent",
            "date=20130608;
            windcode=000300.SH;
            field=wind_code,i_weight")

# 取停牌信息
w.wset("TradeSuspend",
        "startdate=20130508;
        enddate=20130608;
        field=wind_code,
        sec_name,suspend_type,susp_end_reason")
# 取 ST 股票等风险警示股票信息
data<-w.wset("SectorConstituent",
            "date=20130608;
            sector= 风险警示股票;
            field=wind_code,sec_name")

# 获取条件选股结果
# 事先已经创建了“七日新低”这个条件选股。
（可以在终端上输入 eqs 创建）
w.weqs(' 七日新低')

# 获取资产管理、组合管理数据
data<-w.wpf(" 组合管理演示",

```

```
"PMS.PortfolioDaily",
"startdate=20160509;
enddate=20160609;
reportcurrency=CNY;
owner=")
```

计算股票收益率

```
# 自选一只你最喜欢的股票，下载日数据
#(date open close high low volume money )
# 方法一：从股票数据浏览器中下载
# 方法二：使用 WINDR 接口
w_wsd_data<-w.wsd("600519.SH",
                  "pre_close,open,
                  high,low,close,
                  volume,amt,dealnum,adjfactor",
                  "2010-01-01",
                  "2017-06-29")
ds<-w_wsd_data$Data

options(digits = 3)
# 方法一：存在昨收盘价
ds$ret1<-(ds$CLOSE-ds$PRE_CLOSE)/ds$PRE_CLOSE

# 方法二：不存在昨收盘价
```

获取经济数据

```
#EDB wizard

codelist<-c("M0000001")
w_edb_data<-w.edb(codelist,
                  '2016-01-01','2016-06-18',
                  'Fill=Previous')
```

应用举例

```
demo(wsd_quant_demo)
demo(wsi_demo)
demo(wst_demo)
demo(wsq_demo)
```

股票代码开头

```
# 创业板：创业板的代码是 300 打头的股票代码；
# 沪市 A 股：沪市 A 股的代码是以 600 或 601 打头；
# 沪市 B 股：沪市 B 股的代码是以 900 打头；
```

深市 A 股：深市 A 股的代码是以 000 打头；
中小板：中小板的代码是 002 打头；
深圳 B 股：深圳 B 股的代码是以 200 打头；
沪市新股申购：沪市新股申购的代码是以 730 打头；
深市新股申购：深市新股申购的代码与深市股票买卖代码一样。
配股代码：沪市以 700 打头，深市以 080 打头。