Если вы хотите установить у себя экземпляр SQL сервера и базу, то этот процесс детально описан в следующих инструкциях.

Сначала надо установить сервер -- <https://www.microsoft.com/ru-ru/download/details.aspx?id=56840> (Если на вашем компьютере установлена MS Visual Studio, то скорее всего у вас уже есть экземпляр сервера. Можно сразу установить среду разработки, и попробовать подключиться)

Среда разработки - <https://docs.microsoft.com/ru-ru/sql/ssms/download-sql-server-management-studio-ssms?view=sql-server-2017>

Установить базу - <https://docs.microsoft.com/ru-ru/sql/samples/adventureworks-install-configure?view=sql-server-2017>