

原始数据来源说明表					
类别		来源	样本区间	原始变量名称	样本数量
交易面特征	月股票综合数据	锐思数据库	2010年1月至2024年12月中国A股市场所有上市公司为研究样本，数据为月度频率。	股票代码_Stkcd 日期_Date 月收益率_Monret 收盘价(元)_CIPr 成交量(股)_Trdvol 每股收益(摊薄)(元/股)_EPS 净资产收益率(摊薄)(%)_ROE 每股营业利润(元/股)_OpPrfPS 每股营业收入(元/股)_IncomePS 成交金额(元)_Trdsum 总股数月换手率(%)_MonFulTurnR 流通股月换手率(%)_MonTrdTurnR 总股数平均日换手率()_AvgDFulTurnR 流通股平均日换手率()_AvgDtrdTurnR 市盈率_PE 市净率_PB 市现率_PCF 市销率_PS	685634
财务面特征	利润表	锐思数据库	2010年1月至2024年12月中国A股市场所有上市公司为研究样本，数据为月度频率。	A股股票代码_A_StkCd 信息发布日期_InfoPubDt 营业总收入()_TotOpRev 营业总成本()_TotOpCost 营业利润()_OpProf 利润总额()_TotProf 净利润()_NetProf 基本每股收益()_BasicEPS 稀释每股收益()_DilutEPS	375220
	资产负债表	锐思数据库	2010年1月至2024年12月中国A股市场所有上市公司为研究样本，数据为月度频率。	A股股票代码_A_StkCd 信息发布日期_InfoPubDt 流动资产合计(元)_TotCurrAss 非流动资产合计(元)_TotNCurrAss 资产总计(元)_TotAss 流动负债合计(元)_TotCurLia 非流动负债合计(元)_TotNCurLia 负债合计(元)_TotLiab 实收资本（或股本）(元)_PaidCap 所有者权益（或股东权益）合计(元)_TotShareEquit	
	现金流量表	锐思数据库	2010年1月至2024年12月中国A股市场所有上市公司为研究样本，数据为月度频率。	A股股票代码_A_StkCd 信息发布日期_InfoPubDt 经营活动产生的现金流量净额()_NetOpCashFl	
文本特征	激励计划	锐思数据库	2010年1月至2024年12月中国A股市场所有上市公司为研究样本	股票代码_StkCd 激励计划事项编码_IncPlanCd 首次授予确定公告日_FistDeterDt 首次授予日_FistDt 方案说明_ProjSta 激励计划授予数量(股)_IncPlanAwardVol 激励计划授予数量占总股本比例(%)_PCTTotShr 激励计划授予价格(元)_AwardPrice	6179
	业绩预测	锐思数据库	2010年1月至2024年12月中国A股市场所有上市公司为研究样本	观测序号_nobs A股股票代码_A_StkCd 截止日期_EndDt 业绩预测结果说明_ResStat 业绩预测内容描述_FrcstCon	49667
	上市公司定期报告	上海证券交易所官网	2010年1月至2020年12月，所有上交所公司		60029
Fama-French五因子特征		中央财经大学金融学院官网	2010年1月至2020年12月	trdmn mkt_rf hml smb rmw cma rf	375