

第1章 本书金融数据介绍

清华大学经管学院 朱世武

Zhushw@sem.tsinghua.edu.cn

Resdat样本数据： **www.resset.cn**

SAS论坛： **www.resset.cn**

The Power to Know.

ResDat.为本书样本数据库，包括股票、固定收益等相关数据集。

创建SAS逻辑库ResDat

目录ResDat下为本书的全部样本数据。

运行本书程序前，需要创建以本书样本数据库（ResDat）为物理地址的SAS逻辑库ResDat。

股票类样本数据

表名	中文全称	内容简介
Lstkinfo	最新股票信息	本表每一个股票为一个观测，内容包括股票的最新基本信息，如股票代码、股票类型及货币类型、最新股票名称和上市状态、股票所属公司的基本信息及对应的可转债基本信息等。本表没有时间变量，显示的是股票最新的信息，是计算股票市场许多统计量指标的基础数据集。
Ex	汇率	本表按日期排序，记录人民币、港币和美元之间的汇率值。变量包括日期、美元对人民币汇率和港币对人民币汇率。由于有一段时期，港币对人民币没有直接汇率，因而需要通过人民币对美元汇率和港币对美元汇率进行换算。
Commntax	佣金与印花税	本表按时间排序，记录每日的佣金率和印花税信息，可用于计算交易费用。
Iissulst	首次发行与上市	记录每只股票在发行和上市时的情况，发行信息包括发行日、发行市盈率，发行面值，发行股份数量，募集金额，发行费用和配售等；上市信息包括股票首次上市日及职工股上市日等。对于B股，发行价格，募集资金总额和发行费用等均分别用外币和换算后的人民币表示，可适用于不同的研究需要。

Dist	分配	记录上市公司对股东进行的一系列分配活动。包括股票分割，送红股，转增，配股，增发和现金分红等数量或比例，而且对于B股，其红利，配股价格和增发价格等均同时用外币和换算后的人民币来表示。这些事件不仅影响总股本，也影响流通股本。本表是最重要的股票数据集之一，是计算股票市场许多统计量指标、各种指数等的基础数据集。 注：增发有时没有除权处理。所以，本表中，增发新股作除权处理时，除息除权日Exdt有值，不作除权处理时为空值。
Shrhis	股本变动历史	记录每只股票的总股本，流通股本，非流通股本，国有股和法人股等观测的历史。在下一个观测日或摘牌日之前上一个股本观测值都是有效的。本表是最重要的股票数据集之一，是计算股票市场许多统计量指标、各种指数等的基础数据集。
DistDivshr	股权分置分配	记录各公司进行股权分置改革时的分配情况，包括股改的起始日，结束日，以及送股比例，派息比例等各种对价支付的基本信息，是对股改情况的基本描述。
delinfo	退市信息	记录已退市股票的相关信息，包括股票代码，最新股票名称，上市日期，退市日期、股票类型等。
Qttdist	行情与分配	本表由行情、股本、日历和分配表等合并形成的数据集，便于校验、各种收益指标和指数的计算。
Dret	个股日收益	根据交易数据、除权（息）情况和股权分置改革情况计算得出的个股日收益率。
Wkret	个股周收益	根据交易数据、除权（息）情况和股权分置改革情况计算得出的个股周收益率。

Monret	个股月收益	根据交易数据、除权（息）情况和股权分置改革情况计算得出的个股月收益率。
Qtrret	个股季收益	根据交易数据、除权（息）情况和股权分置改革情况计算得出的个股季收益率。
Yrret	个股年收益	根据交易数据、除权（息）情况和股权分置改革情况计算得出的个股年收益率。
Dretm	市场日收益	不同交易市场中A股、B股按不同加权方法计算得到的市场日收益率。
Wkretm	市场周收益	不同交易市场中A股、B股按不同加权方法计算得到的市场周收益率。
Monretm	市场月收益	不同交易市场中A股、B股按不同加权方法计算得到的市场月收益率。
Qtrretm	市场季收益	不同交易市场中A股、B股按不同加权方法计算得到的市场季收益率。
Yrretm	市场年收益	不同交易市场中A股、B股按不同加权方法计算得到的市场年收益率。
Idxqtn	指数行情	主要股票指数行情。

固定收益类样本数据

表名	中文全称	内容简介
Bankir	银行存款利率	本表提供3个月到8年整存整取银行存款利率数据。可作为基准利率使用。数据自1988年9月1日至当前日。其中，d8y-八年及以上整存整取利率数据到1996年5月1日截止。
BchmkIr	基准利率	本表提供回购利率日平均价、同业拆借市场利率日平均价利率数据、银行间市场基准利率参考指标。本表数据可用于浮动利率债券的票面利率、无风险利率等。
DRfRet	日无风险收益率	本表提供用于研究的日无风险收益数据。数据选择标准：1998年7月1日前用一年期银行存款利率加10%为基准利率，1998年7月1日后使用七日回购利率两周指数加权平均为基准利率B2W。本表已将年度化的基准利率转化为以日为单位计量的收益数据，研究时可直接引用。
MonRfRet	月无风险收益率	本表提供用于研究的月无风险收益数据。数据选择标准：1998年7月1日前用一年期银行存款利率加10%为基准利率，1998年7月1日后使用七日回购利率两周指数加权平均为基准利率B2W。本表数据已作过月度化处理，即将年度化的基准利率转化为月度数据，研究时可直接引用。

The Power to Know.

BdId	债券标识	本表提供每只债券的标识编码，以及在不同市场的交易代码。鉴于同一只债券可以在不同的市场上市交易，交易代码也各不相同，本表设定了唯一的标识码Bdid以识别每只债券。本表给出已发行债券的债券标识、上市标识和债券代码之间的对应关系。当某只债券在多个市场交易时，一个Bdid会对应多个交易代码Bdcd。若某只债券不在某个市场交易，则相应的债券代码为空值。
BdInfo	债券信息	本表记录已发行债券的一些基本属性，如债券名称、票面利率、计息方式、票息类型、债券类型、年付息频率、回售标识、赎回标识、可转换标识等数据。用于计算债券的到期收益率、未来现金流、久期、凸性指标，同时本表数据也是许多计算与建模的基础数据，如债券指数计算、利率期限结构建模等。
ConverProv	可转债转股条款	本表记录所有可转债的相关转股条款，包括可转债对应的股票代码、最新股票名称、转股价格、转股价格比例、转股类型、修正条款等数据。
Converinfo	可转债转股信息	本表记录所有可转债的转股信息，包括可转债总额、累计转股金额、累计转股数量、可转债剩余金额、转股后总股本、本次转股金额、本次转股数量等数据。每只可转债可能会涉及到多次转股。
BdIsslst	债券发行与上市	本表给出与债券发行、上市相关的一些信息。发行信息包含债券发行公告日期、发行量、承销方式、发行相关机构等。债券上市交易的基本状况包含上市日期、停止上市日期、交易市场等。在研究中本表信息用到的较少，因此从债券基本信息表分离出来单列为一个表。本表可以通过债券代码与基本信息等联系起来。

CoupRtHist	票面利率变动历史	由于部分债券（主要是浮动利率债券和累进利率债券）的票面利率是不确定的，本表给出这些债券票面利率的变动情况（如浮动利率债券票面利率随基准利率的变化而变化，累进利率债券票面利率随债券的待偿期限变化而变化）。本表包括计息开始与结束日期、付息序号、基准利率代码、本期年利率、利率变动类型等数据。
ExchQtn	交易所债券行情	本表记录交易所市场每个交易日债券交易的价格、应计利息、成交量、开盘全价、开盘净价、收盘全价、收盘净价、交易量和交易金额等时序数据，以及由此计算得到的收益率、久期、凸性等分析指标。
IboPubBid	银行间信用拆借公开报价	本表记录信用拆借市场的公开报价高频数据，包含交易品种、利率、金额、交易期限、清算期限、起息日、还款日、占款天数等数据。本表可以用于信用拆借市场流动性等方面的研究。
CBDDualBid	银行间现券买卖双边报价	本表记录现券买卖双边报价相关数据，即经中国人民银行批准的银行间做市商在进行现券买卖报价时，在中国人民银行核定的债券买卖价差范围内连续报出该券种的买卖实价，并同时报出该券种的买卖数量、清算速度等交易要素。本表中包括卖出净价、卖出应计利息、卖出全价、卖出券面总额、卖出已交易金额、卖出净价金额、卖出全价金额、卖出清算期限、卖出交割日、卖出到期收益率、卖出债券结算方式，以及买入的相关数据。
		<i>The Power to Know.</i>

CBDDeal	银行间现券买卖成交	本表记录现券买卖成交的高频数据，即记录每一笔成交数据。包括成交状态、前承报价类型、净价、应计利息、全价、债券面值、净价金额、全价金额、交易期限、交割日、到期收益率、债券结算方式等数据。
CBDqtn	银行间现券买卖行情	本表包括现券买卖的日行情，包括开盘价、收盘价、最新价、成交量，以及凸性久期等数据。给出的价格包含了全价和净价。
Bidxquot	债券指数行情	本表提供一组变量，用于记录债券指数每日的价格和交易量等数据，如开盘价、收盘价、最高价、最低价、交易量和交易金额等。
Ibidxquot	银行间债券指数行情	记录银行间债券指数每日的指数值、久期、凸性、派息率等
Sampbdinfo	样本债券信息	记录拟合利率期限结构模型用到的样本债券信息，包括债券种类、债券标识、债券代码、锐思债券标识、债券价格、债券面值、计息方式、票面利率、年付息频率、起息日、到期日、到期期限、修正久期、剩余期限。每天对每种类型的债券给出一组债券信息。