

HOW TO DO STATE-OF-ART OR RESEARCH

Downloading and pretreating data

LIU Jia

Xi'an Jiaotong University

2021.3

Downloading data

- 下数据
- -数据下载
- -数据处理
- **(return rate)**
- -数据分析
- **(ADF,similarity)**

● 数据下载

收费数据库（国内）

- 万得Wind
- 国泰安CSMAR

收费数据库（国外）

- Bloomberg彭博
- CEIC

所有宝贝 天猫 二手

所有分类 >

你是不是想找: 数据线 苹果数据线 数据线安卓 数据线三合一 数据恢复 数据线

综合排序 销量 信用 价格 ▾ ¥ - ¥

包邮 赠送退货运费险 新品 公益宝贝 二手 天猫 正品保障 7+5

经济金融数据库

国泰安CSMAR

高权定制 (全库权限)

巨灵金融 统计年鉴
锐思RESSET EPS全球统计
中经网/Emerald金融管理/道琼斯财经资讯

这是一个你想查什么 就查什么的地方 **不限下载**

¥20.00 包邮 71人付款

国泰安CSMAR (全库权限) 锐思RESSET 等经济金融数据库会员及代下

小小雨点2020 上海

掌柜热卖 广告

一对一 可加急

全天制在线

数据分析服务

SPSS Stata Python Amos R Matlab Eviews

硕博团队 正规发票

R语言 AMOS Matlab SPSS

¥100.00 包邮 445人付款

SPSS数据分析服务Stata代做Eviews实证 统计处理R语言Python爬虫取

难能心动、66 广东 广州

掌柜热卖 广告

1, 国际运筹协会

市场数据下载

- Investing.com <https://cn.investing.com/>
- Yahoo Finance <https://finance.yahoo.com/>

市场财务数据

- CCER数据库 <http://www.ccerdata.cn/>

账号: xjtu 密码: xjtu

- FAMA-FRENCH因子数据库

http://mba.tuck.dartmouth.edu/pages/faculty/ken.french/data_library.html#International

宏观数据

- CEIC世界宏观数据库

Macroeconomic data (Domestic)

国家统计局 <http://www.stats.gov.cn/tjsj/>



The header of the National Bureau of Statistics website features the national emblem on the left, followed by the text '国家统计局 National Bureau of Statistics'. To the right is a search bar with a magnifying glass icon and a '检索 | 高级' button. Below the search bar, a row of '热词' (Hot Words) includes GDP, CPI, PPI, PMI, 总人口, and 社会消费品零售总. A navigation bar below contains several categories: '走近统计' (Approach Statistics) with sub-items '国家统计局', '派驻纪检组', and '机构职能'; '统计数据' (Statistical Data) with sub-items '最新发布', '数据查询', and '数据解读'; '统计工作' (Statistical Work) with sub-items '统计动态', '通知公告', and '图片新闻'; '统计知识' (Statistical Knowledge) with sub-items '统计百科', '统计词典', and '常见问题解答'; '统计服务' (Statistical Services) with sub-items '微观数据申请', '曝光台', and '行政处罚信息'; and '信息公开' (Information Disclosure) with sub-items '政策', '公开指南', and '公开制度'.

主要包含：国民经济、人口、对外经济贸易、能源、财政、价格、农业、工业、运输、旅游、教育、科技、卫生等数据，可以按年度、季度、月度查询。
可以免费下载



The banner for 'National data 国家数据' features a 3D cube with numbers 1 through 8 on its faces. The text 'National data 国家数据' and '国家统计局 National Bureau of Statistics' is prominently displayed. Below this is a navigation bar with links: '首页', '月度数据', '季度数据', '年度数据', '普查数据', '地区数据', '部门数据', '国际数据', '可视化产品', '出版物', '我的收藏', and '帮助'. At the bottom, there is a search bar with the text '查数 CHASHU' and an example search query '如：2012年北京 GDP'. To the right of the search bar is a '统计热词' (Statistical Hot Words) section listing 'GDP', 'CPI', '总人口', '社会消费品零售总额', '粮食产量', 'PMI', and 'PPI'.



National data 国家数据

中华人民共和国国家统计局
National Bureau of Statistics of China

[首页](#) | [月度数据](#) | [季度数据](#) | [年度数据](#) | [普查数据](#) | [地区数据](#) | [部门数据](#) | [国际数据](#) | [可视化产品](#) | [出版物](#) | [我的收藏](#) | [帮助](#)

查数 CHASHU

如：2012年 北京 GDP



搜索

统计
热词

[GDP](#) [CPI](#) [总人口](#) [社会消费品零售总额](#)
[粮食产量](#) [PMI](#) [PPI](#)

首页

年度数据

简单查询



简单查询



高级查询



数据地图



经济图表



添加收藏



数据管理



报表管理

- ▶ 建筑业
- ▶ 运输和邮电
- ▶ 社会消费品零售总额
- ▶ 批发和零售业
- ▶ 住宿和餐饮业
- ▼ 旅游业
 - ▶ 旅游业发展情况
 - ▶ 国内旅游情况
 - ▶ 国际旅游(外汇)收入及构成
 - ▶ 按性别、年龄和事由分外国入境
 - ▶ 按国别分外国入境游客
- ▶ 金融业
- ▶ 教育
- ▶ 科技
- ▶ 卫生
- ▶ 社会服务



时间：最近10年

| 指标 | 2016年 | 2015年 | 2014年 | 2013年 | 2012年 | 2011年 |
|-----------------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|
| 旅行社数(个) | | 27621 | 26650 | 26054 | 24944 | 23690 |
| 星级饭店总数(个) | | 12327 | 12803 | 13293 | 12807 | 13513 |
| 入境游客(万人次) | 13844.38 | 13382.04 | 12849.83 | 12907.78 | 13240.53 | 13542.35 |
| 外国人入境游客(万人次) | 2815.12 | 2598.54 | 2636.08 | 2629.03 | 2719.16 | 2711.20 |
| 港澳同胞入境游客(万人次) | 10456.26 | 10233.64 | 9677.16 | 9762.50 | 9987.35 | 10304.85 |
| 台湾同胞入境游客(万人次) | 573.00 | 549.86 | 536.59 | 516.25 | 534.02 | 526.30 |
| 入境过夜游客(万人次) | 5926.73 | 5688.57 | 5562.20 | 5568.59 | 5772.49 | 5758.07 |
| 国内居民出境人数(万人次) | 13513.00 | 12786.00 | 11659.32 | 9818.52 | 8318.17 | 7025.00 |
| 国内居民因私出境人数(万人次) | 12850.00 | 12172.00 | 11002.91 | 9197.08 | 7705.51 | 6411.79 |
| 国内游客(万人次) | 444000.00 | 400000.00 | 361100.00 | 326200.00 | 295700.00 | 264100.00 |
| 国际旅游外汇收入(百万美元) | 120000.00 | 113650.00 | 105380.00 | 51664.00 | 50028.00 | 48464.00 |



National data 国家数据

中华人民共和国国家统计局
National Bureau of Statistics of China

另外在国际数据目录下，有“各国数据”

查数 CHASHU

如：2012年北京 GDP



搜索

- 主要国家(地区)月度数据
- 三大经济体月度数据
- 国际市场月度商品价格
- 主要国家(地区)年度数据
- 国际组织网站
- 各国统计网站**

社会消费品零售总额

各国统计网站

亚洲

| | | | | | | |
|-------|------|-------|------|------|--------|-----|
| 阿曼 | 巴基斯坦 | 巴勒斯坦 | 菲律宾 | 格鲁吉亚 | 韩国 | 卡塔尔 |
| 老挝 | 黎巴嫩 | 马尔代夫 | 马来西亚 | 蒙古 | 尼泊尔 | 日本 |
| 沙特阿拉伯 | 斯里兰卡 | 塔吉克斯坦 | 泰国 | 土耳其 | 乌兹别克斯坦 | 新加坡 |
| 叙利亚 | 也门 | 伊朗 | 以色列 | 印度 | 印度尼西亚 | 约旦 |
| 越南 | | | | | | |

非洲

| | | | | | | |
|-------|-------|------|-----|------|------|----|
| 阿尔及利亚 | 埃塞俄比亚 | 博茨瓦纳 | 多哥 | 刚果 | 几内亚 | 加蓬 |
| 喀麦隆 | 马达加斯加 | 马拉维 | 摩洛哥 | 莫桑比克 | 纳米比亚 | 南非 |
| 塞拉利昂 | 塞内加尔 | 塞舌尔 | 乍得 | | | |

欧洲

| | | | | | | |
|-----|------|-----|-----|------|------|-----|
| 爱尔兰 | 爱沙尼亚 | 安道尔 | 奥地利 | 白俄罗斯 | 保加利亚 | 比利时 |
|-----|------|-----|-----|------|------|-----|

Macroeconomic data (International)

世界银行—各国发展数据（focus on developing country）

网址：<https://data.worldbank.org.cn/>

（主要包含：各国相关的发展数据，而且资金等数据有多个维度可以查看。数据可以免费下载



数据

版本: [English](#) [Español](#) [Français](#) [العربية](#) [中文](#)

新来这个网站？[从这里开始](#)

[DataBank](#) [微数据](#) [数据目录](#)



世界银行公开数据

免费并公开获取世界各国的发展数据。

搜索数据,例如GDP,人口,印度尼西亚

浏览 [国家](#) 或 [指标](#)

数据银行 | 世界发展指标 ⓘ

☰ 表格

📊 图表

📍 地图

📄 元数据 (English)

⬇️ 下载选项 ▼

变量 版式 格式 保存 分享 嵌入

数据库 可获得 79 | 已选定 1

数据库预览 开 关 ? 🔍 ▼

- 世界发展指标
- 教育统计
- 健康营养和人口统计
- 营商环境
- 千年发展目标
- 外债联合中心
- 全球经济展望
- 全球治理指标
- Statistical Capacity Indicators
- 社会性别统计
- 贫困和不平等数据库
- 国际开发协会成果衡量体系
- 季度公共部门债务
- 就业
- 非洲发展指标
- 健康营养与人口统计

国家 可获得 264 | 已选定 217

系列 可获得 1434 | 已选定 57

时间 可获得 | 已选定 16

⚙️ Popular Indicators

清除选择 | 添加 国家 (217) 添加 系列 (57) 添加 时间 (16)

| 按消费者价格指数衡量的通货膨胀 (年通胀率) | 2011 | 2012 | 2013 | 2014 | 2015 |
|---|------|------|------|------|------|
| Services, etc., value added (% of GDP) | | | | | |
| 货物和服务出口 (占 GDP 的百分比) | 11.8 | 6.4 | 7.4 | 4.7 | -0.7 |
| 货物和服务进口 (占 GDP 的百分比) | 3.4 | 2.0 | 1.9 | 1.6 | 1.9 |
| 资本形成总额 (占 GDP 的百分比) | 4.5 | 8.9 | 3.3 | 2.9 | 4.8 |
| 收入, 不包括捐赠 (占GDP的比例) | | | | | |
| Cash surplus/deficit (% of GDP) | | | | | |
| 企业注册的启动程序 (数量) | | | | | |
| Market capitalization of listed domestic companies (% of GDP) | .. | .. | .. | .. | .. |
| 军费支出 (占GDP的百分比) | | | | | |
| Mobile cellular subscriptions (per 100 people) | 13.5 | 10.3 | 8.8 | 7.3 | 9.2 |
| Internet users (per 100 people) | | | | | |
| Roads, paved (% of total roads) | 3.5 | 3.4 | 1.1 | 1.1 | 1.0 |
| 高科技出口 (占制成品出口的百分比) | | | | | |
| 商品贸易 (GDP的百分比) | .. | .. | .. | .. | .. |
| 净易货贸易条件指数 (2000年 = 100) | | | | | |
| 外债总额存量 (DOD, 现价美元) | | | | | |
| 偿还债务总量 (占国民总收入 (GNI) 比例) | | | | | |
| 净移民 | | | | | |
| 已付劳工汇款和职工报酬 (按现值美元计) | | | | | |
| 外国直接投资净流入 (BoP, 现价美元) | | | | | |

OECE（世界经济与合作组织）世界宏观数据库

<http://www.oecd.org/>

The Organisation for Economic Co-operation and Development (OECD) is an international organisation that works to build better policies for [better lives](#). Our goal is to shape policies that foster prosperity, equality, opportunity and well-being for all. We draw on [60 years of experience](#) and insights to better prepare the world of tomorrow.

The screenshot displays the OECD.org website interface. At the top left is the OECD logo with the tagline "BETTER POLICIES FOR BETTER LIVES". The main navigation bar includes "Data", "Publications", and "More sites" (with a dropdown arrow). Under "More sites", there are links for "OECD Better Life Index", "OECD iLibrary", and "OECD Observer". A "60 YEARS" anniversary graphic is visible. The featured article is titled "OECD Economic Surveys: China 2019" (Latest Edition), with a sub-headline "China's growth continues to slow, but it is still high by international standards and contributes about a quarter of global growth. The growth model based on capital accumulation has led to misallocation of capital and excess capacity in a number of industries as well as falling investment ...". It includes a "More" link and language options: "English | Also available in: French". At the bottom, there are icons for "Click to access" in PDF and READ formats.

- <https://data.oecd.org/>

Income Statement and Balance Sheet

Customise Export My Queries

Please note that data collection for this dataset is discontinued.

Excel
Text file (CSV)
PC-axis
SDMX (XML)
Related files



Getting Started

- Data by theme Popular queries
- Find in Themes Reset
- All Themes
- General Statistics
 - Agriculture and Fisheries
 - Demography and Population
 - Development
 - Economic Projections
 - Education and Training
 - Environment
 - Finance
 - Bank Profitability Statistics
 - Income Statement and Balance Sheet
 - Central Government Debt
 - Monthly Financial Statistics
 - Insurance Statistics

Income Statement and Balance Sheet

Customise Export My Queries

Please note that data collection for this dataset is discontinued.

| | Country | Bank | Year |
|--|-----------------|------|------|
| | Belgium | | |
| | Korea | | |
| | Luxembourg | | |
| | Mexico | | |
| | Netherlands | | |
| | New Zealand | | |
| | Norway | | |
| | Poland | | |
| | Portugal | | |
| | Slovak Republic | | |
| | Slovenia | | |
| | Spain | | |
| | Sweden | | |
| | Switzerland | | |
| | Turkey | | |
| | United Kingdom | | |
| | United States | | |
| | Russia | | |

| | 2001 | 2002 | 2003 | 2004 |
|----------------------------|-----------|-----------|-----------|--------|
| INCOME STATEMENT | | | | |
| 1. Interest income | 61 352.50 | 59 712.61 | 49 250.50 | 58 051 |
| 2. Interest expenses | 53 476.88 | 51 630.23 | 41 026.01 | 49 574 |
| 3. Net interest income | 7 875.61 | 8 082.38 | 8 224.49 | 8 476 |
| 4. Net non-interest income | 7 473.31 | 5 530.67 | 6 048.27 | 4 724 |

(Focus on well-developed country)



TACKLING CORONAVIRUS (COVID-19): CONTRIBUTING TO A GLOBAL EFFORT

What are countries doing to contain the spread of the coronavirus? How are countries helping people, small businesses and the economy to weather the crisis and beyond? This Country Policy Tracker helps you to navigate the global response.

Select a country: -

A world map with numerous blue dots placed on various countries, representing data points for the Country Policy Tracker. The dots are most densely clustered in Europe and North America.

COUNTRY POLICY TRACKER

CEIC: <https://www.ceicdata.com/zh-hans/products>

- **CEIC:** 涵盖超过195个国家400多万个时间序列的数据源，最完整的一套超过128个国家的经济数据，能够精确查找GDP、CPI、进口、出口、外资直接投资、零售、销售以及国际利率等深度数据。

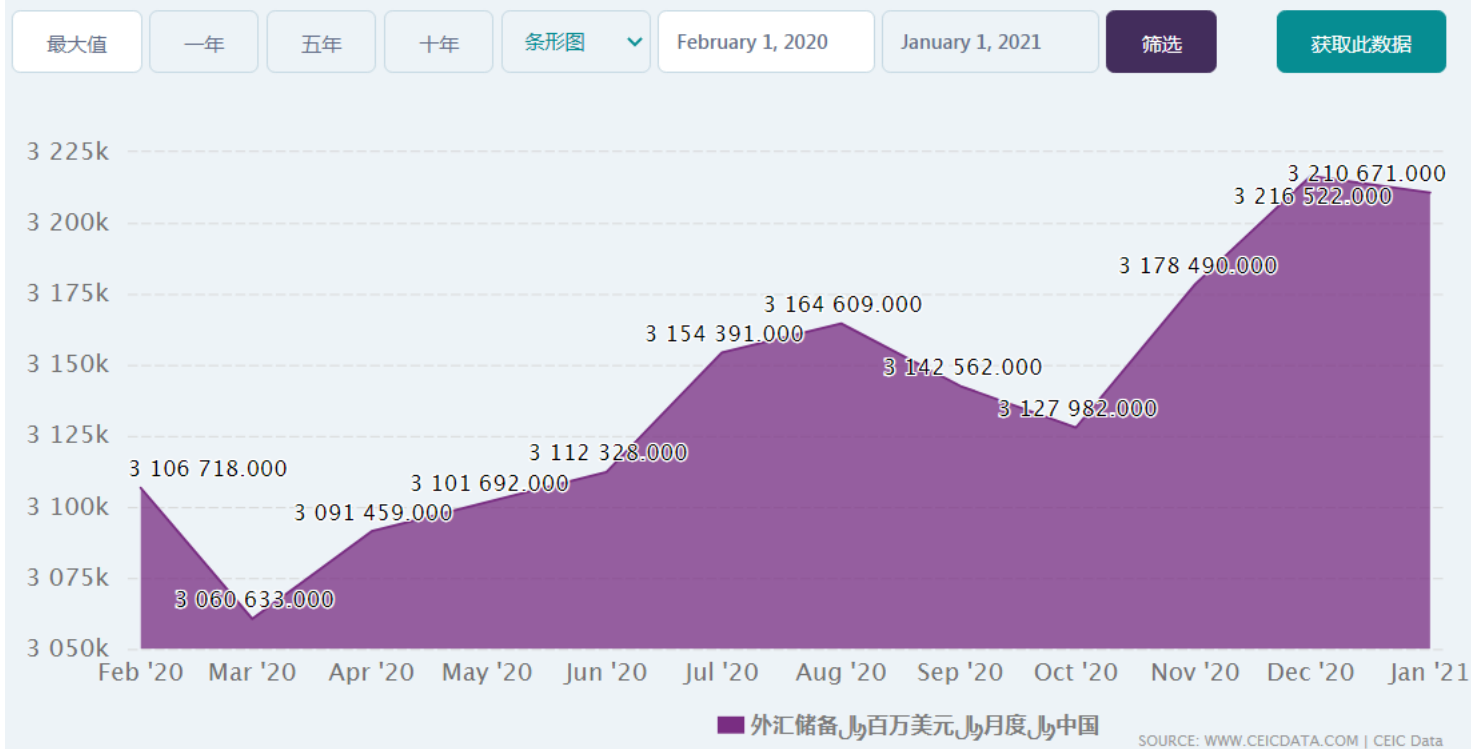
The image shows a screenshot of the CEIC website. At the top left is the CEIC logo. Navigation links include '国家' (Country), '指标' (Indicator), '产品' (Product), '博客' (Blog), and '关于' (About). A search bar contains the text '搜索数据, 比如"中国国民生产总值"' (Search data, such as 'China's GDP'). On the right, there is a flag for 'CHN' and user icons. Below the navigation is a dark blue banner with the title '可信赖的数据源' (Reliable Data Source). The banner text reads: 'CEIC通过最前沿的操作平台CDMNext帮助您将超过200+个国家的550多万条时间序列数据集成到您自己的工作平台上。我们的数据库可以让您轻松掌握全球市场动态, 以及对新兴市场经济数据有最深刻的认识。' (CEIC uses the most advanced operation platform CDMNext to help you integrate over 5.5 million time series data from over 200+ countries onto your own work platform. Our database can help you easily grasp global market dynamics, and have the deepest understanding of emerging market economic data.) At the bottom of the banner is a search bar with the same text as the top one and a '提交' (Submit) button.

中国 外汇储备

1989 - 2021 | 月 | 百万美元 | CEIC DATA

中国的外汇储备在01-01-2021达3,210,671.0百万美元，相较于12-01-2020的3,216,522.0百万美元有所下降。中国外汇储备数据按月更新，01-01-1989至01-01-2021期间平均值为623,646.0百万美元，共385份观测结果。该数据的历史最高值出现于06-01-2014，达3,993,212.7百万美元，而历史最低值则出现于01-01-1989，为3,728.0百万美元。CEIC提供的中国外汇储备数据处于定期更新的状态，数据来源于CEIC Data，数据归类于世界趋势数据库的全球经济数据 - 表：外汇储备：美元：亚洲。

查看图表中 1989-01 到2021-01 期间的中国 外汇储备



外汇储备 各个国家比较

购买所选数据

CEIC整理标准化的外汇储备，涵盖115个经济体。即时访问excel中的完整历史记录数据。

立即购买 \$99

| 国家/地区 | 数值 | 频率 | 范围 |
|-------------|------------------------|----|---------------------|
| 阿尔巴尼亚(百万美元) | ▲ 4,367.1 Dec 2020 | 月 | Dec 1993 - Dec 2020 |
| 阿尔及利亚(百万美元) | ▼ 45,521.7 Jan 2021 | 月 | Jan 1968 - Jan 2021 |
| 阿根廷(百万美元) | ▲ 34,067.4 Jan 2021 | 月 | Dec 1956 - Jan 2021 |
| 亚美尼亚(百万美元) | ▼ 2,394.0 Jan 2021 | 月 | Dec 1993 - Jan 2021 |
| 澳大利亚(百万美元) | ▼ 31,778.9 Jan 2021 | 月 | Jul 1969 - Jan 2021 |

| 外贸 | 数值 | 频率 | 范围 |
|--------------|------------------------|----|---------------------|
| 预测：商品出口增长(%) | ▼ 3.829 2025 | 年 | 1998 - 2025 |
| 贸易差额(百万美元) | ▲ 78,173.8 Dec 2020 | 月 | Jan 1981 - Dec 2020 |

Securities market data

YAHOO Finance (US based)

https://finance.yahoo.com/

type the stock name here and select

The screenshot shows the Yahoo Finance website with a search bar containing 'XLU'. A dropdown menu is open, displaying a list of symbols and their descriptions. The first item is 'XLU Utilities Select Sector ... ETF - PCX'. Other items include 'XLUS.L Invesco Utilities S&P U...', 'XLU210115... XLU Jan 2021 70.000 c...', 'XLU20030... XLU Mar 2020 65.000...', 'XLU20061... XLU Jun 2020 64.000 ...', and 'XLU20041... XLU Apr 2020 62.000 ...'. The 'News' section is partially visible at the bottom of the dropdown.

Home Mail News Finance Sports Entertainment Search Mobile More...

yahoo! finance

Finance Home Watchlists Personal Finance

S&P 500
3,055.51
-74.61 (-2.38%)

| Symbols | ↑↓ Screener for stocks & more |
|--------------|---------------------------------------|
| XLU | Utilities Select Sector ... ETF - PCX |
| XLUS.L | Invesco Utilities S&P U... ETF - LSE |
| XLU210115... | XLU Jan 2021 70.000 c... Option - OPR |
| XLU20030... | XLU Mar 2020 65.000... Option - OPR |
| XLU20061... | XLU Jun 2020 64.000 ... Option - OPR |
| XLU20041... | XLU Apr 2020 62.000 ... Option - OPR |

News



Utilities Select Sector SPDR Fund (XLU)

NYSEArca - Nasdaq Real Time Price. Currency in USD

☆ Add to watchlist

67.60 -1.12 (-1.63%)

As of 9:40AM EST. Market open.

Buy

Sell

Summary

Chart

Conversations

Historical Data

Profile

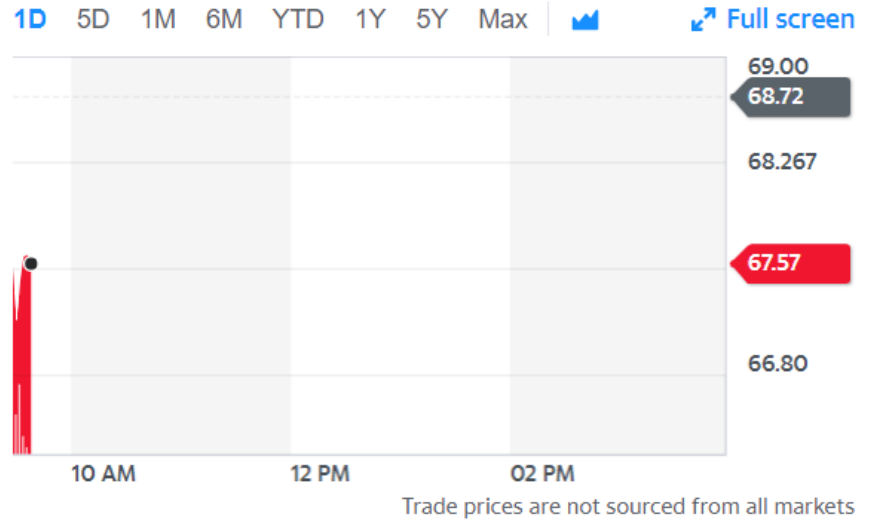
Options

Holdings

Performance

Risk

| | | | |
|----------------|----------------------|------------------------|-------------------|
| Previous Close | 68.72 | Net Assets | 11.18B |
| Open | 65.89 | NAV | 68.76 |
| Bid | 67.63 x 900 | PE Ratio (TTM) | 11.13 |
| Ask | 67.76 x 1200 | Yield | 3.07% |
| Day's Range | 67.16 - 67.66 | YTD Daily Total Return | 6.29% |
| 52 Week Range | 56.66 - 71.10 | Beta (5Y Monthly) | 0.35 |
| Volume | 2,089,352 | Expense Ratio (net) | 0.13% |
| Avg. Volume | 17,601,526 | Inception Date | 1998-12-16 |



Utilities Select Sector SPDR Fund (XLU)

NYSEArca - Nasdaq Real Time Price. Currency in USD

☆ Add to watchlist

67.70 -1.02 (-1.48%)

As of 9:43AM EST. Market open.

Buy

Sell

- Summary
- Chart
- Conversations
- Historical Data**
- Profile
- Options
- Holdings
- Performance
- Risk

Advertisement for jGlobe.jp, featuring a shopping bag and the text "Purchase from Japan".

Time Period: Mar 05, 2019 - Mar 05, 2020 Show: Historical Prices Frequency: Weekly Apply

Currency in USD

Download Data

| Date | Open | High | Low | Close* | Adj Close** | Volume |
|-----------------------------|------|-------|-------|--------|-------------|-----------|
| corecardresearch.com 的响应... | | 67.66 | 67.16 | 67.58 | 67.58 | 2,157,093 |



INVESTING <https://cn.investing.com/>

无广告版本。即刻订阅，更快速、无干扰追踪市场最新动向。 [马上升级](#)

英为财经 investing.com 600019 登录 / 免费注册

行情 所有品种类型 资讯 更多

600019 宝钢股份 股票 - 上海

600019历史数据

时间范围: 每日 下载数据

概况 图表 资讯和分析 财务状况 技术 论坛

概览 简介 **历史数据** 所属股指

600019概览

5 15 30 1H 5H 1D 1W 1M

宝钢股份 7.52 -0.23 (-2.97%)

| 日期 | 收盘 | 开盘 | 高 | 低 |
|------------|------|------|------|------|
| 2021年2月26日 | 7.52 | 7.47 | 7.72 | 7.39 |
| 2021年2月25日 | 7.75 | 7.67 | 7.90 | 7.66 |
| 2021年2月24日 | 7.54 | 7.91 | 7.96 | 7.48 |
| 2021年2月23日 | 7.94 | 8.09 | 8.16 | 7.84 |
| 2021年2月22日 | 8.00 | 7.45 | 8.01 | 7.38 |
| 2021年2月19日 | 7.28 | 7.08 | 7.28 | 7.05 |
| 2021年2月18日 | 7.15 | 7.00 | 7.24 | 6.99 |
| 2021年2月10日 | 6.81 | 6.91 | 6.92 | 6.72 |
| 2021年2月9日 | 6.93 | 6.80 | 6.97 | 6.75 |
| 2021年2月8日 | 6.84 | 6.68 | 6.85 | 6.62 |
| 2021年2月5日 | 6.67 | 6.64 | 6.82 | 6.59 |
| 2021年2月4日 | 6.65 | 6.59 | 6.68 | 6.39 |
| 2021年2月3日 | 6.65 | 6.47 | 6.72 | 6.39 |
| 2021年2月2日 | 6.51 | 6.54 | 6.59 | 6.36 |
| 2021年2月1日 | 6.58 | 6.54 | 6.64 | 6.45 |
| 2021年1月29日 | 6.56 | 6.80 | 6.86 | 6.50 |
| 2021年1月28日 | 6.79 | 6.90 | 6.99 | 6.75 |

最高: 8.16 最低: 6.36 差价: 1.80 平均

CCER (Focus on Domestic market)

<http://www.ccerdata.cn/>



[首页](#) [标准数据](#) [特供数据](#) [一带一路](#) [数据定制](#) [合作产品](#) [帮助与动态](#)

标准数据库，涵盖资本市场、货币市场、行业经济、国内外宏观经济数据，涉及主流经济学和金融学实证研究所需的绝大部分数据需求。该数据库结构由15个版块组成，数据主要来自各官方网站、书籍、报刊等，从源头上保证数据准确性。

最新公告

上市公司一致行动人数据库上线通知 [2021]

上市公司供应链数据库上线通知 [2020]

新冠疫情数据库上线通知 [2020]

关于机构用户在疫情期间使用CCER经济金融数据库的说明 [2020]

新版A股上市公司财务数据库上线通知 [2019]

已购买

接

交易数据

股票价格收益

- 日度

价格、收益及风险信息

股本及市值信息

投资组合信息

股票估值

+ 周度

+ 月度

[回到旧版面](#) 日度 / 价格、收益及风险信息

[数据查询](#) [预览数据](#) [指标说明](#) [数据库说明](#)

总数:11151066 起始:19901219 结束:20210111 数据缺失定义

日期：

起始: 2021-01-04

结束: 2021-01-11

股票代码：

全部代码

代码输入:

代码筛选:

代码上传:

数据指标：

T0:价格、收益及风险信息表

[全选](#)

[反选](#)

日期

股票代码

股票简称

开盘价

最高价

最低价

收盘价

复权价

复权价(不考虑分红)

保存类型: Excel 2007-(*.xlsx) v

TXT分隔符: 无 v

压缩格式: zip v

读取脚本: 无 v



- 关联查询
- 扩展查询
- 数据预览
- 数据下载

数据预览 OK Cancel

| 日期 | 股票代码 | 股票简称 | 开盘价 | 最高价 | 最低价 | 收盘价 | 复权价 | 复权价(不考虑分红) | 成交量 | 成交额 | 换手率 |
|----------|--------|------|---------|---------|---------|---------|-----------|------------|-----------|-----------------|--------|
| 20210104 | 000001 | 平安银行 | 19.1000 | 19.1000 | 18.4400 | 18.6000 | 2053.8496 | 1782.4256 | 155421643 | 2891682312.0000 | 0.0080 |
| 20210104 | 000002 | 万科A | 28.4000 | 28.4000 | 27.5200 | 27.7800 | 2107.5036 | 1800.5515 | 146844133 | 4079416859.0000 | 0.0151 |
| 20210104 | 000004 | 国华网安 | 20.6900 | 21.1900 | 20.5200 | 21.0200 | 94.2326 | 92.0315 | 2739801 | 57262550.0000 | 0.0326 |
| 20210104 | 000005 | 世纪星源 | 2.5300 | 2.5300 | 2.5100 | 2.5200 | 28.5186 | 28.4082 | 4896339 | 12316350.0000 | 0.0046 |
| 20210104 | 000006 | 深振业A | 5.6400 | 5.6400 | 5.5000 | 5.5200 | 194.8413 | 175.6800 | 8132668 | 45029731.0000 | 0.0060 |
| 20210104 | 000007 | 全新好 | 6.2700 | 6.2700 | 6.2700 | 6.2700 | 59.3293 | 58.6912 | 850900 | 5335143.0000 | 0.0028 |
| 20210104 | 000008 | 神州高铁 | 2.5400 | 2.5500 | 2.5100 | 2.5200 | 45.5319 | 45.0718 | 13795696 | 34796287.0000 | 0.0052 |
| 20210104 | 000009 | 中国宝安 | 7.5200 | 7.9300 | 7.4700 | 7.7900 | 75.9659 | 71.5750 | 81454236 | 633654156.0000 | 0.0319 |
| 20210104 | 000010 | 美丽生态 | 4.1500 | 4.3000 | 4.0000 | 4.0500 | 43.0875 | 42.6529 | 18829709 | 77250217.0000 | 0.0361 |
| 20210104 | 000011 | 深物业A | 12.2000 | 12.2500 | 11.8200 | 12.0000 | 28.5377 | 26.7959 | 7027182 | 84060920.0000 | 0.0118 |

上新

A股市场

新三板市场

基金市场

债券市场

港股市场

沪股通数据

深港通数据

宏观数据

货币市场

行业数据

基础表

聚合表

A股基础信息

最新基础信息

基础信息变更

财务数据

财务报表

财务报表衍生数据

财务分析

财务附注数据

经济增加值EVA

旧版财务

交易数据

股票价格收益

证券市场指数

指数行情

行业数据

期货数据

海外上市

央企高管

银行理财与保险

权证数据

新冠疫情专题

重大事件

首次公开发行

回到旧版面

发行认购情况

数据查询

预览数据

指标说明

数据库说明

发行认购情况

中介机构情况

二级市场表现

总数:4313 起始:19901210 结束:20210301 数据缺失定义

上市日期：

股票代码：

数据库简介

该数据库（A股）收集了在上交所和深交所A股上市公司公布的招股说明书、上市公告书、发行结果公告、股份变动公告及上市首日市场表现等数据，包含从招股、认购到上市整个发行过程中各个环节的信息。

发行认购情况表

【股票代码】，【股票简称】，【上市日期】，【股票交易所】，【招股说明书签订日期】，【招股开始日期】，【招股结束日期】，【发行价格】，【发行方式】，【本次股票实际发行数量】，【本次股票可流通数量】，【社会公众实际发行数量】，【员工实际发行数量】，【基金实际认购数量】，【战略投资者实际认购数量】，【中签率】，【本次发行总共募集资金】，【本次发行实际募集资金】，【本次发行总费用】，【平均每股发行费用】，【发行市盈率】，【招股说明书中提到的风险因素个数】，【发行前每股净资产】，【发行后每股净资产】，【询价价格下限】，【询价价格上限】，【网下发行量】，【网下有效申购量】，【网下中签率】，【网下配售家数】，【网下冻结资金数量】，【网上冻结资金数量】

1990-

日度

Standard portfolio management data set

- **The OLPS Platform**

- <https://www.jmlr.org/papers/volume17/15-317/15-317.pdf>

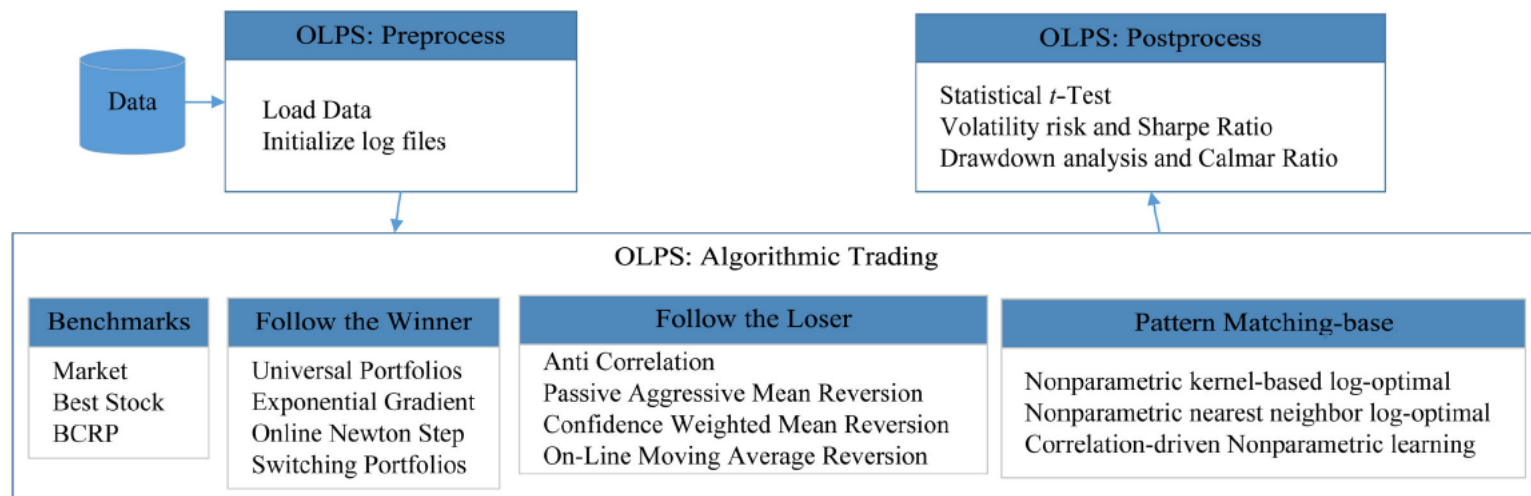


Figure 1: Structure of the OLPS toolbox.

Li B, Sahoo D, Hoi SC. OLPS: a toolbox for on-line portfolio selection. The Journal of Machine Learning Research. 2016 Jan 1;17(1):1242-6.

| Datasets | Markets | Regions | Time Frames | # Periods | # Assets | File Names (.mat) |
|----------|---------|---------|-------------------------|-----------|----------|-------------------|
| NYSE (O) | Stock | US | 07/03/1962 - 12/31/1962 | 5651 | 36 | nyse-o |
| NYSE (N) | Stock | US | 01/01/1985 - 06/30/2010 | 6431 | 23 | nyse-n |
| TSE | Stock | CA | 01/04/1994 - 12/31/1998 | 1259 | 88 | tse |
| SP500 | Stock | US | 01/02/1998 - 01/31/2003 | 1276 | 25 | sp500 |
| MSCI | Index | Global | 04/01/2006 - 03/31/2010 | 1043 | 24 | msci |
| DJIA | Stock | US | 01/14/2001 - 01/14/2003 | 507 | 30 | djia |

Table 1: Summary of the six datasets from real markets.

Pretreating data

Pretreating data

- -数据处理
- (return rate)

1.1.1 单期算术收益率

P_t 是资产在t时刻的价格，那么从t-1时刻到t时刻持有该资产的算术收益率为：

$$r_t = \frac{p_t - p_{t-1}}{p_{t-1}} = \frac{p_t}{p_{t-1}} - 1$$

1.2.1 对数收益率（即连续复利情况下的收益率）

即连续复利下，其净值会变为 本金* e^r ，即 $p_t = p_{t-1} \times e^{r_t}$ 。

$$\text{则 } r_t = \ln\left(\frac{p_t}{p_{t-1}}\right)$$

Pretreating data

- 1.1.2 多期算术收益率



从t-k时刻到t时刻持有该资产的k期收益率为：

$$r_t[k] = \frac{p_t}{p_{t-k}} - 1$$

$$= \frac{p_t}{p_{t-1}} \times \frac{p_{t-1}}{p_{t-2}} \times \dots \times \frac{p_{t-k+1}}{p_{t-k}} - 1$$

$$= (1 + r_t) \times (1 + r_{t-1}) \times \dots \times (1 + r_{t-k+1}) - 1$$

$$= \prod_{i=0}^{k-1} (1 + r_{t-i}) - 1$$

Pretreating data

1.2.2 多期对数收益率

$$\begin{aligned} r_t[k] &= \ln\left(\frac{p_t}{p_{t-k}}\right) = \ln\left(\frac{p_t}{p_{t-1}} \times \frac{p_{t-1}}{p_{t-2}} \times \dots \times \frac{p_{t-k+1}}{p_{t-k}}\right) \\ &= r_t + r_{t-1} + \dots + r_{t-k+1} \end{aligned}$$

reallocated among the n risky assets. Let $u_{t-1} = [u_{t-1}^1, \dots, u_{t-1}^n]^T$ be the vector of cash amounts invested in risky assets at the beginning of period t , and let w_t be the total wealth at the end of period t . Then $-w_t$ can be viewed as the possible loss at period t . We assume that the whole investment process is self-financing; hence, we have

$$e^T u_{t-1} = w_{t-1}, \quad t = 1, \dots, T. \quad r_t^T u_{t-1} = w_t, \quad t = 1, \dots, T.$$

$$X_{t+1} = r_f(s_t)X_t + u(s_t)'R^e(s_t), \quad t = 0, 1, \dots, T-1.$$

Pretreating data

- -数据分析
- 时间序列数据的平稳性对于我们采用什么样的分析方式、选择什么样的模型有着至关重要的影响。
- 假如一个时间序列的波动趋势从来没有稳定过，那么它每个时期的波动对于之后一段时期的影响都是无法预测的，因为它随时可能“变脸”。而当一个时间序列的特征维持稳定，比如它的均值和方差是稳定的，那么我们认为在之后的一段时间里，它的数据分布跟历史的数据分布大概率是保持一致的，这时，我们就可以基于历史数据对未来的走势做一个预测，这能帮助我们找到更大概率成功的决策。

Pretreating data

- -平稳性分为强平稳和弱平稳。

强平稳： 要求非常严格，它要求两组数据之间的任何统计性质都不会随着时间改变。过于严苛，理论上很难证明、实际中难以检验。

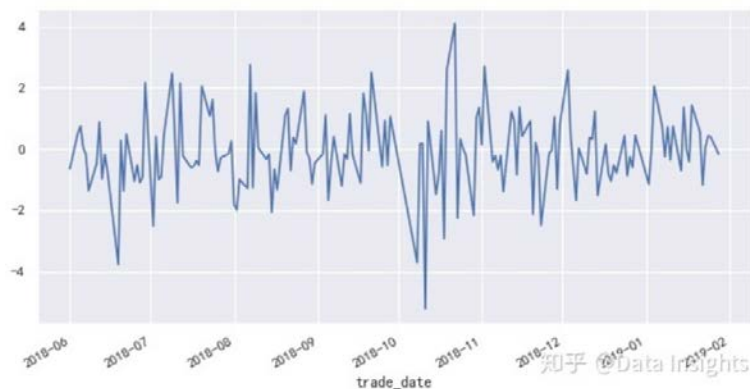
弱平稳： 一组时间序列数据的均值恒定、方差始终存在、自协方差不随时间波动，即可认定其为弱平稳序列。

与强平稳对应的是弱平稳，其应用比较广泛，它有三个要求： - 对于任意时期的时间序列 X_t ，有 $E(X_t) = \mu$ ，即序列均值为常数； - 对任意时期的时间序列 X_t ，其二阶矩存在（二阶矩即方差）； - 对任意时期的时间序列 X_t 、任意的整数 h 、任意的阶数 l ，都有 $\gamma_l(X_t) = \gamma_l(X_{t+h})$ ，也就是说，当指定了两个时间点的距离 h 后，两组数据的 l 阶自协方差不会随着时间波动，仅与阶数有关。

Pretreating data

平稳性的检验

- 时序图
- 自相关图和偏自相关图
- 单位根检验
- (DF检、ADF检验和PP检验)



Pretreating data

Augmented Dickey Fuller Test

- **The null hypothesis for this test is that there is a unit root.**
- **The DF test statistic: T-statistics**

$$DF_{\tau} = \frac{\hat{\gamma}}{SE(\hat{\gamma})}$$

Table 1: Statistics of return rates in the in-sample period and out-of-sample period and Augmented Dickey-Fuller tests on the stationariness of the in-sample return rate series

| node | AAPL | MSFT | AMZN | COG | DD | DIS | F | HSY | ADBE | TCEHY |
|--|----------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|
| In-sample period (Jan. 4, 2010 - July 17, 2019) | | | | | | | | | | |
| Mean ($\times 10^{-2}$) | 0.0851 | 0.0721 | 0.1123 | 0.0318 | 0.0391 | 0.0674 | 0.0157 | 0.0681 | 0.0887 | 0.0983 |
| Std. ($\times 10^{-2}$) | 1.6307 | 1.4429 | 1.9736 | 2.3165 | 1.8509 | 1.3215 | 1.7579 | 1.1449 | 1.7850 | 2.1186 |
| ADF T statistic* | -54.8455 | -60.0336 | -53.6150 | -54.4804 | -53.6896 | -56.9154 | -50.1353 | -59.8608 | -60.0178 | -53.8878 |
| P-value** | <1.0e-03 | <1.0e-03 | <1.0e-03 | <1.0e-03 | <1.0e-03 | <1.0e-03 | <1.0e-03 | <1.0e-03 | <1.0e-03 | <1.0e-03 |
| Out-of-sample period (July 18, 2019 - Oct. 30, 2020) | | | | | | | | | | |
| Mean ($\times 10^{-2}$) | 0.2395 | 0.1256 | 0.1289 | -0.0619 | -0.0610 | -0.0477 | -0.0740 | -0.0098 | 0.1126 | 0.1559 |
| Std. ($\times 10^{-2}$) | 2.6582 | 2.4750 | 2.1481 | 3.0544 | 2.9592 | 2.5841 | 3.1250 | 2.1744 | 2.6947 | 2.2558 |

*: 5% critical value of ADF test is -1.9416 .

** : P-values smaller than 0.05 indicate the rejection of the unit-root null in favor of the alternative model.