沃顿研究数据中心入门

对外经贸大学

http://wrds.wharton.upenn.edu

目录

欢迎使用沃顿研究数据中心 3

访问选项 3

如何访问数据 3

基于浏览器的访问 3

命令行访问 3

互动应用 4

服务 4

帐户 4

申请帐户 4

帐户类型 5

WRDS 使用条款 6

订阅数据库 6

WRDS 访问通行证 6

最终用户体验 6

访问通行证的有效期 6

供应商联络信息 7

WRDS 代表 7

WRDS 的管理 7

其他帮助 7

技术和研究支持 7

电子资源 7

更改密码 8

WRDS 支持服务 8

欢迎使用沃顿研究数据中心

沃顿研究数据中心(WRDS)是业界领先的数据研究平台和商业情报工具，供 31 个国家 30000 多名学术界、政府、非营利机构和公司客户使用。WRDS 让用户能从同一个地方获取超过 200 兆兆字节的数据，涵盖金融、营销和经济学等多个领域。WRDS 始于 1993 年，初衷是为了支持宾夕法尼亚大学沃顿商学院教师的研究工作。至今已经发展成为全球研究界的标准工具。我们的用户包括：

斯坦福大学	哈佛大学	芝加哥大学
伦敦商学院	麻省理工学院	等等

WRDS数据是基于不同历史数据的独立来源汇编而成，其中包括资本智商(Capital IQ)、纽约泛欧证券交易所、证券价格研究中心(CRSP)和汤森路透。WRDS平台提供海量数据库的无缝访问，涵盖金融、经济和营销等众多领域。

访问选项

WRDS 平台为承载的不同数据库提供统一访问界面，为您简化数据提取过程，帮助您集中精力从事对您重要的事情——您的研究工作。

WRDS 提供 3 种访问数据的方式：**在我们的网站上**使用网页查询、通过 **UNIX 终端**会话访问数据平台、或使用**您台式电脑上**的 PC-SAS 链接数据。这些方法各有裨益。让我们一一细看。

如何访问数据

基于浏览器的访问

您只要有网络浏览器和上网条件就能查询 WRDS 的数据。这种访问方式无需安装软件，无需学习特定的编程语言。您决定使用哪个数据组后，可以用基于网页的查询表提取数据，并以您选择的格式输出数据。

- **查询简单，功能强大**，只需点击数次。
- 每次查询最多可下载 **2GB 数据**。
- 以您选择的文件格式**导出**（如 txt, csv, xlsx 等）。

WRDS 上的每个数据组网页都包括一段有关每次查询所含内容和页面链接的说明。WRDS 网页版的设计可以兼容任何最新浏览器。

网页查询对 WRDS 中的所有数据库都采用相同的统一格式。几乎在所有情况下，您都只需根据网页指示完成简单的参数输入（如：日期，查询项目等）就可得到相应的网络数据输出。

命令行访问

如果网页查询无法提供您所需要的灵活性或编程功能，您也许可以考虑通过命令行界面(CLI)访问 WRDS。

- **运行定制程序**，一次访问数个来源。
- 您自己的目录有 **750MB 磁盘空间**。
- 最多可使用 **2TB 临时磁盘空间**以处理程序。

使用 Secure Shell Client (SSH)和终端应用程序登录 WRDS。您无需另外获取软件许可，就能安全地使用 SAS、FORTRAN 或 C 程序访问 WRDS 数据和程序。

您检查了帐户能否经由 Unix 访问 WRDS 后，需要用 SSH 登录系统。请务必了解，这种方法需要您掌握基本的 Unix 命令知识，并且懂相应编程语言。

互动应用

命令行不能满足您对计算能力的要求？也许该升级到专用桌面应用。

- **基于桌面**的图形用户界面(GUI)，使用精选编程语言。
- 无需使用命令，就能得到 CLI 的所有**好处**。
- **快速**编辑、调试、记录和输出程序。

WRDS 兼容 PC-SAS、R、Matlab 和 STATA。这些都是供用户访问、管理、分析和呈现数据的独立应用程序。结合 WRDS 上的数据，它使用户能利用功能强大的专业程序，承担研究密集型任务。

服务

WRDS 为各种数据库提供统一的访问界面，简化数据提取，提高工作效率，并且：

- 由**博士学者、数据专家及技术专家团队**通过 WRDS 支持服务为您提供在线支持。
- 在线学习。点播视频馆涉及众多主题，均由我们的研究专家播讲。
- 及时更新。经验丰富的 IT 专家转换并安装数据更新，提供迅即访问。
- **学习环境** WRDS 使教师可以用实际的公司数据取代假设的例子，在真实世界中示范理论的运用。
- **数据验证、完整性和一致性。**我们与多个供应商合作，提供最广泛的数据和最强大的计算基础设施，使用户能以最高每秒 400MB 的速度分析复杂的信息。我们提供可靠的基础设施，由专业人员管理先进系统上的数据上传和更新流程。

帐户

凡订阅院校的全职教职员工和学生都有资格通过网页访问 WRDS。是否提供允许 SSH 访问的个人（教职员、博士生、职工、访客及研究助理）帐户，则由相关院校的 WRDS 代表自主决定。凡是目前不在贵组织工作或注册的校友、研究同行及其他人员，均无资格获取帐户。

我们的 WRDS 政策禁止本科生/硕士生在两个学期之间的长假期间访问 WRDS。一旦新学期开始，这些学生就能再次访问其 WRDS 帐户。如有疑问，请联络 WRDS 支持服务。

申请帐户

第 1 步：把网络浏览器指向 http://wrds.wharton.upenn.edu

第 2 步：单击“Register for a WRDS Account”（注册 WRDS 帐户）链接。

第 3 步：填表。

第 4 步：单击“Submit”（提交）。

相关院校机构的 WRDS 代表将审核您的请求，并在受理后通知您。您当地的 WRDS 代表是：

Hui Li; uibelh@uibe.edu.cn

Di Gong; d.gong@uibe.edu.cn

Shuang Zhai: zhaishuang@uibe.edu.cn

帐户类型

教师：教师帐户面向成员院校的所有在职教师。标准帐户允许经由网页、SSH 和/或 FTP 渠道的无限访问，而且在“主目录/项目目录”有 750MB 储存空间。教师用自己的账户及密码；该密码必须保密，*不能与任何其他个人分享*。

职员：只有成员院校的后勤人员，如图书管理员、IT 支持人员或其他职员，才能申请职员帐户。（请注意，虽然许多 WRDS 代表有这类帐户，但这类帐户并不自动带有 WRDS 代表特权。WRDS 代表的管理功能与帐户的指定是分开分派的。）职员帐户允许经由网页、SSH 和/或 FTP 渠道的无限访问，而且“主目录/项目目录”有 750MB 储存空间。职员用自己的密码访问帐户；该密码必须保密，*不能与任何其他个人分享*。

博士生：博士生帐户面向成员院校的所有在读博士生。（接受了另一所院校教职的博士生可以继续使用其 WRDS 帐户，直至论文答辩。答辩后，WRDS 代表就会禁用帐户。）标准帐户允许经由网页、SSH 和/或 FTP 无限访问，而且“主目录/项目目录”有 750MB 储存空间。博士生用自己的密码访问帐户；该密码必须保密，*不能与任何其他个人分享*。

硕士生：硕士帐户面向成员院校的所有全日制硕士生。这些帐户可以经由 WRDS 网站无限访问。硕士生用自己的账户和密码进行访问。这些帐户没有磁盘存储空间。该密码必须保密，*不能与任何其他个人分享。请注意：*我们的 WRDS 政策禁止本科生/硕士生在两个学期之间的长假期间访问 WRDS。一旦新学期开始后，学生就能再次访问其 WRDS 帐户。如果您对这类访问有任何疑问，请联络 WRDS。

访客：访客帐户适用于访问学者（非永久职位或兼职职位）。这些帐户将受到额外审查，而且在访问结束后不得使用。WRDS 代表将决定是否批准此人为访客。要获得“访客”帐户，访客个人与院校必须有正式的关系，即其在院校是有报酬的，或有不带薪职位的正式任命书（系主任出具）。这通常排除了合著者和博士生以及无薪研究人员。用户在访问前必须接受其他《使用条款》。标准帐户允许经由网页、SSH 和/或 FTP 无限访问，而且“主目录/项目目录”有 750MB 储存空间。该密码必须保密，*不能与任何其他个人分享。*

研究助理：研究帐户面向为教师做研究的研究生和本科生。研究帐户允许经由网页、SSH 和/或 FTP 访问，而且“主目录/项目目录”有 750MB 储存空间。在职教师可有一个研究助理帐户。研究助理用自己的密码访问帐户；该密码必须保密，*不能与任何其他个人分享*。

班级：成员院校的在职教师可以申请班级帐户，用于访问 WRDS 网页界面。这些帐户主要供特定班级的学生使用，班上的所有学生共享同一密码。最多可有 15 名用户同时使用同一个帐户和密码。这些帐户只能访问网页，没有磁盘存储空间。学期结束后就会失效。*不能与班级外部的任何其他个人分享该密码。*

图书馆/实验室：图书馆/实验室帐户通过 IP 验证访问 WRDS。登录 WRDS 后，用户必须输入有效的电子邮件帐户。这不是需要当地 WRDS 代表批准的登录名，而只是有效的电子邮件帐户。然后用户需要输入带有所在院校域名的电子邮件帐户。然后 WRDS 会向该电子邮件帐户发送一封电子邮件，验证该帐户是有效的。这封电子邮件将包括“访问通行证”链接。用户单击该链接，即可直接访问 WRDS。

WRDS 使用条款

所有用户必须同意我们网站上的 WRDS 使用条款，其内容见 WRDS 网站的 About（关于）选项卡。

订阅数据库

虽然用户可以通过 WRDS 平台访问各种数据库，但用户只能访问所在院校机构已经订阅的数据库。如果您尝试访问所在院校机构并未订阅的数据库，您将收到以下错误信息：

“User does not have appropriate authorization level for file.”（用户没有获取文件的适当授权等级。）

您的访问权限取决于所在院校机构的许可证。如需数据访问和许可的更多信息，请查看我们网站上 MyWRDS 部分的“Products”（产品）链接。

可在这里查看每个数据库的说明。

WRDS 访问通行证

可以在贵院校机构的图书馆或电脑实验室提供由 IP 验证的工作站。只有贵院校机构的有效用户（而非普通公众）能访问这些工作站。

登录 WRDS 时，用户需要输入带有贵院校机构域名的电子邮件帐户。然后 WRDS 会向该电子邮件帐户发送一封电子邮件，验证该帐户是有效的。这封电子邮件将包括“访问通行证”链接。用户单击该链接，即可直接访问 WRDS。

对无法经由班级帐户访问 WRDS 和没有资格申请个人帐户的本科生而言，这是使用该系统的理想方式。请注意，通过这种方法访问 WRDS 平台无法获得磁盘存储空间，也无法访问 WRDS 计算云。

供 IP 访问的 WRDS 网站 URL 是：http://wrds-web.wharton.upenn.edu/wrds/connect

最终用户体验

每家院校机构的图书管理员将洽询 WRDS，并收到用于一系列 IP 验证电脑的链接。用户将打开网页浏览器会话，并遵照初始步骤，获取访问通行证。WRDS 服务器将验证电子邮件帐户是相关院校的有效帐户（不是 gmail 或 hotmail 等）。一旦通过验证，用户将收到带有访问通行证链接的电子邮件。

访问通行证的有效期

访问通行证可设置为每位用户 1 至 3 天，默认设置是 1 天。如有疑问，请联络 WRDS 代表。

WRDS 将如何使用这些联络信息？

WRDS 将储存联络信息并记录会话期间的每次数据查询，如同对待有自己帐户的所有 WRDS 用户一样，数据安全的保护程度也不会低于普通 WRDS 用户。我们的隐私政策确保 WRDS 不会与任何其他机构分享个人身份信息。但是，WRDS 保留的信息可以在司法程序中披露。

供应商联络信息

如需数据供应商的技术支持，请联络提供各组数据的供应商。您将在我们的网站上供应商支持和联络方式的 Support（支持）选项卡链接下查到所有供应商的联络人及电子邮件地址。

如需订阅下列数据库，请联络您的 WRDS 代表。他们的联络方式可在下方以及 WRDS 网站的 MyWRDS 选项卡上查到。

WRDS 代表

Hui Li; uibelh@uibe.edu.cn

Di Gong; d.gong@uibe.edu.cn

Shuang Zhai: zhaishuang@uibe.edu.cn

WRDS 代表负责以下事项：

1. 担任所在院校机构 WRDS 学生、教职员工之间的联络人。他们会向您发送有关系统升级、增添新供应商、定期维护等通知。
2. 监测帐户申请，核实申请人是大学的在职教师、博士生或硕士生、授权研究人员或行政管理人员。
3. 酌情对离开大学但无需转移帐户的人员关闭帐户。视需要延长博士生、研究助理和其他帐户的失效日期。
4. 将 WRDS 行政变动（比如 WRDS 收费结构、程序的变动）通知院系负责人/领导。

WRDS 的管理

如需有关订阅、服务计划升级详情或未来数据提供商谈判更新的信息，请发送电子邮件至：wrds@wharton.upenn.edu，或致电 215-898-9065 与我们联络。

其他帮助

技术和研究支持

可以经由 WRDS 支持服务联络我们的技术人员和研究专员。如果您在数据库访问、数据查询以及 SAS 或 R 编程方面遇到困难，他们会随时协助您。如果您无法成功执行特定程序，需要相关支持，为加快得到答复的速度，**请将程序拷贝在电子邮件正文中**。这有助于勘察程序中的任何错误。

电子资源

从 WRDS 的任何网页，单击屏幕顶部的“**support**”（支持）选项卡，可以获得更多资源。您将看到数个列表：

WRDS FAQ（常见问答）：此资源包含有关使用我们服务的最详尽信息，
包括系统概览、数据内容和访问以及有关使用 SAS 和其他数据提取程序的广泛帮助。

SAS FAQ：由技术专家编写，是 SAS 初学者的好资源。

Online Manuals（在线指南）：供应商（如 CRSP）发布的所有的数据说明指南都可在此链接下获取。如果您没有找到您感兴趣的某份指南，请直接联络供应商索取手册（见 2.1 节“供应商联络信息”）。

您可以通过网站上现有的选项卡，查看经过强化的支持页面、研究和点播在线学习视频。

WRDS 社区：加入 WRDS 社区，这是一个支持协作式学习的论坛

- 与其他 WRDS 用户互动，建立非正式的同侪网络。
- 张贴有关研究、编程或搜索功能的问题或回答这些方面的问题。
- 分享 SAS 程序和样板脚本。
- 讨论商务和金融研究领域的当前趋势和挑战。

更改密码

访问 Password Problems（密码问题）页面，按说明操作。

WRDS 支持服务

可以经由WRDS支持服务联络我们的技术人员和研究专员。

如果您在数据库访问、数据查询以及SAS、R和其他程序的编程方面遇到困难，他们会随时协助您。

如果您无法成功执行特定程序，为加快得到答复的时间，请将程序文本拷贝在电子邮件正文中。这有助于发现程序中的任何错误。

我们希望您访问WRDS愉快。我们相信您将发现方便的访问、丰富的数据以及独特的系统功能会对您的研究和教学工作大有裨益。