

以微秒级速度访问当前美国市场的股票

查看所有交易和报价活动的精细详情

- ▲ 验证最佳执行 ▲ 制定盈利的培训策略
- ▲ 对总体市场进行深入研究

为什么选择每日TAQ？

- 全面的交易与报价报告：以微秒为时间戳的NBBO数据
- 分析：将CRSP和TAQ观测数据的功用对应起来
- 精细数据：所有美国市场历史的详细记录

为什么通过WRDS访问TAQ数据？

商业研究数据组的规模正在迅猛增长，而WRDS Cloud是旨在适应这种增长的一款灵活而强大解决方案，便于提高利用率和数据吞吐量。

快速访问：

系统便于客户访问所有存储资源

强劲性能：

支持每秒10GB

可靠：

在获奖平台上管理海量每日TAQ数据

数据管理：

立即访问数据，而不是像单个机构那样需要数月时间来更新板载数据

- ▲ 涵盖1993年以来的数据

希望访问每月TAQ数据（非微秒级）的学术机构、企业或政府机构必须购买每日TAQ数据。



用TAQ数据取得的研究成果

已经发表的一些文章有：*Statistical Modeling of High Frequency Financial Data: Facts, Models and Challenges*, Rama Cont（伦敦帝国学院）、*A Simple Approximation of Intraday Spreads Using Daily Data*, Kee H. Chunga（纽约州立大学布法罗分校）、Hao Zhang（罗切斯特理工学院）。

研究项目包括：

有效使用TAQ数据

提供高效的SAS编程方法

SAS DOW Loop 法

实施DOW Loop——一个能高效筛选、合并和分析大型数据组的SAS编程概念

Lee和Ready(1991)算法

推断交易方向，买方发起或卖方发起

用SAS视图得出NBBO

计算全国最佳买价和卖价（内部报价）

详解将PROC SQL用于WRDS上的TAQ数据

关于在检索TAQ数据时使用PROC SQL的详尽指南

关于纽约证券交易所

纽约证券交易所为需要下一代性能和专长来提供任务关键型和增值型客户服务的买方、卖方和交易所社区提供全面的交易服务、数据服务、基础设施服务和管理式解决方案

关于 WRDS

沃顿研究数据中心(WRDS)是领先的数据研究平台和商业情报工具，为来自33个国家350多个机构的30,000多名企业、学术界、政府和非营利机构客户提供服务。WRDS让用户能从同一个地方获取200兆字节的数据，涵盖会计、银行业、经济学、金融、保险、营销和统计学等多个领域。灵活的数据交付选项包括能缩短研究时间的强大网络查询方法、用于执行研究和策略发展的WRDS云端，以及使用PCAS、Matlab、Python和R的WRDS客户端服务器。我们的分析团队、博士学位拥有者提供的支持服务和严密的数据审查和验证，都让客户有信心在复杂的数据库内进行量身定制的研究工作，并建立各种可靠的数据模型。

从我们与数据供应商的合作，到我们自己的工具，包括WRDS SEC Analytics Suite和WRDS都是数据管理和研究领域的全球黄金标准，而所有这一切都以沃顿商学院的可靠信誉和领导地位为后盾。

关于沃顿商学院

宾夕法尼亚大学的沃顿商学院建立于1881年，是美国第一家学院化的商学院，在商学教育的各个主要领域都以知识领先和持续创新享誉全球。凭借广泛的全球社区和著述颇丰的商学院师资，沃顿在世界各地创造经济社会价值。该院有5,000名本科生、MBA学生、高管MBA学生和博士生；每年有9,000多名学员参加高管教育课程，更有一个由93,000名毕业生组成的强大校友网络。

请联络我们了解订阅信息

WRDS | www.whartonwrds.com | wrds@wharton.upenn.edu | +1 877-438-9737

纽约证券交易所 | www.nyx.com | Sales-PDP@theice.com | +1 212-656-5955