

Thème N°2 : Les Bases de Données de Marché des laboratoires d'économie et de gestion à l'Université de Paris X

Section 1 : Les conditions d'accès aux bases « bdm »

Section 2 : La structure d'enregistrement des bases « bdm »

Section 3 : La base de données de marché « Paris 1977-06/1991 »

Section 4 : La base de données de marché « Euronext 1992-2004 »

Section 1 : Les conditions d'accès aux bases de données de marché « bdm » stockées sur le serveur de recherche

A partir du site Internet du centre de ressources informatiques cri.u-paris10.fr, vous demandez

- 1) Un compte de messagerie électronique à l'Université de Paris X - Nanterre
- 2) Un compte utilisateur sur le serveur de recherche
- 3) Un droit d'accès aux bases de données de marché « bdm » stockées sur le serveur de recherche

Section 2 : La structure d'enregistrement de la base de données de marché « bdm »

Périodes	1977- 06/1991	1992-2004	
SUPPORT DES DONNEES	Serveur de recherche « moliere » /base/bdm/	Serveur de recherche « moliere » /base/bdm/	CD-Rom ou DVD
FORMAT DES DONNEES	ASCII	ASCII	SAS

A – La base de données de marché « bdm » sur le serveur de recherche

bdm

amsterdam

bruxelles

lisbonne

londres

paris1977

paris1992

Produits

actionsquot
 actionshoro
 futuresaction
 futuresmarch
 futurestaux
 obligations
 optionsaction
 optionstaux

progactions
 progoptions
 statactions
 statoptions

Produits

actionsquot
 actionshoro
 futuresaction
 futuresmarch
 futurestaux
 obligations
 optionsaction
 optionstaux

progactions
 progoptions
 statactions
 statoptions

Produits

actionsquot
 actionshoro
 futuresaction
 futuresmarch
 futurestaux
 obligations
 optionsaction
 optionstaux

progactions
 progoptions
 statactions
 statoptions

Produits

actionsquot
 actionshoro
 futuresaction
 futuresmarch
 futurestaux
 obligations
 optionsaction
 optionstaux

progactions
 progoptions
 statactions
 statoptions

Produits

actionsquot
 actionshoro
 futuresaction
 futuresmarch
 futurestaux
 obligations
 optionsaction
 optionstaux

progactions
 progoptions
 statactions
 statoptions

Produits

actionsquot
 actionshoro
 futuresaction
 futuresmarch
 futurestaux
 obligations
 optionsaction
 optionstaux

progactions
 progoptions
 statactions
 statoptions

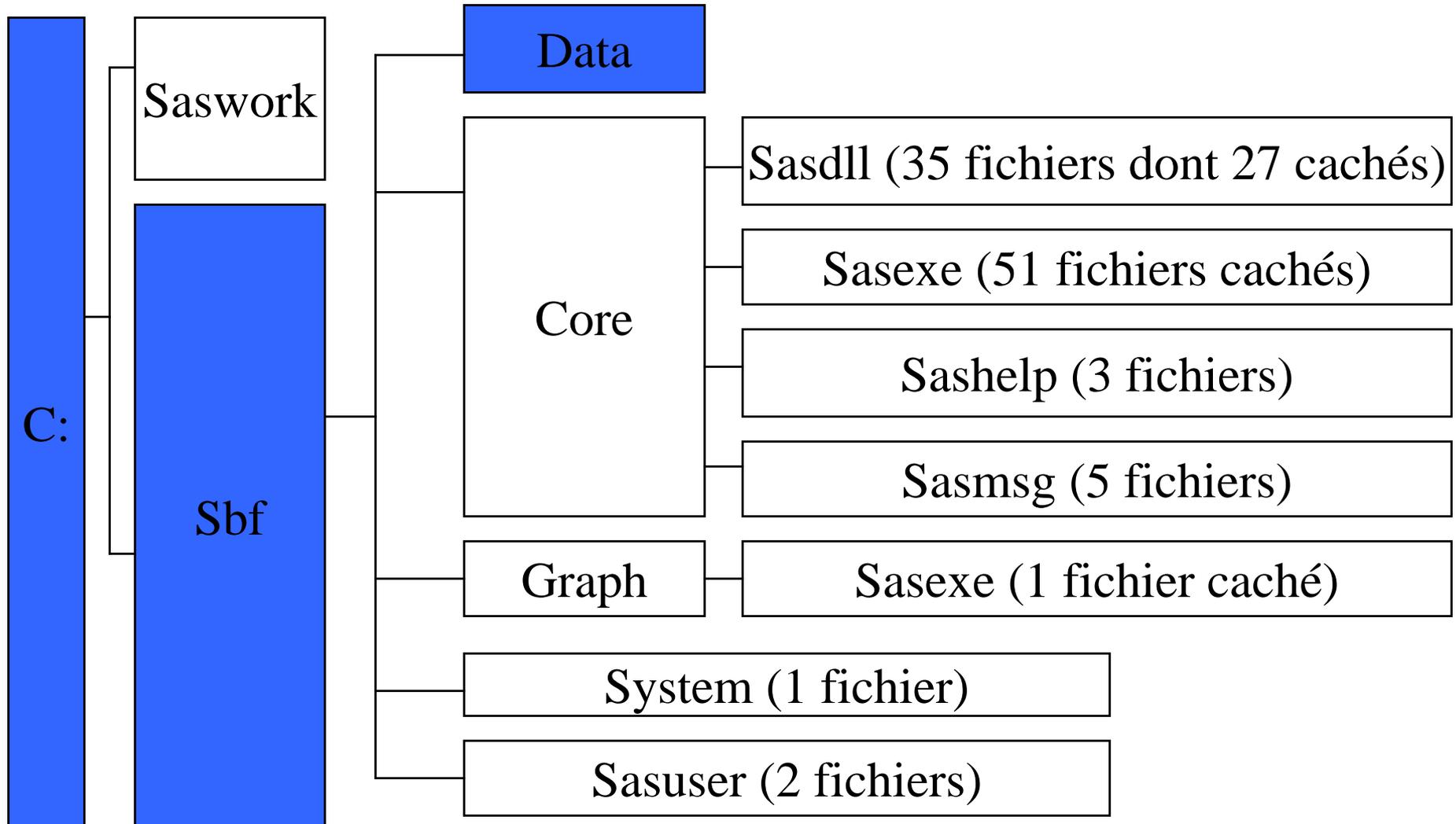
Les données de marché « bdm »

Périodes	1977-06/1991 (en ascii seulement sur le serveur de recherche)			1992-2004 (en ascii ou en sas)	
TYPE DE TITRES	Actions 01/01/1977 28/06/1991	Actions 05/04/1988 28/06/1991	Options 03/11/1987 31/12/1990	Actions 01/01/1992 31/12/2004	Options 01/01/1996 31/12/2004
COURS	Quotidiens	Horodatés	Horodatés et quotidiens	Horodatés et quotidiens	Horodatés

Les programmes associés aux bases de données de marché « bdm » sur le serveur de recherche

Période	1977 - 06/1991			1992-2004	
TYPE DE TITRES	Actions 01/01/1977 28/06/1991	Actions 05/04/1988 28/06/1991	Options 03/11/1987 31/12/1990	Actions 01/01/1992 31/12/2004	Options 01/01/1996 31/12/2004
Programmes	Fortran et SAS	SAS	Fortran Et SAS	SAS	SAS

B – La base de données de marché « bdm » sur CD-Rom ou DVD



C - La documentation commune aux bases de données de marché « bdm »

Documentation accessible à partir de mes pages libres sur le site Internet www.u-paris10.fr

- Sous forme de cahiers ([J.F.Gueugnon](#))
- Sur Internet ([J.F.Gueugnon](#)).
- Sous forme d'ouvrage (prochainement)

Section 3 : La base de données de marché « /base/bdm/paris1977/ » sur le serveur de recherche

- Les données actions (*.txt) du 01/01/1977 au 30/06/1991
- Les programmes Fortran et Sas-Unix (*.sas)
- Les résultats des programmes

**A - Les fichiers du répertoire des actions quotidiennes
« actionsquot » sur le serveur de recherche**

NOM DES FICHIERS	CONTENU DES FICHIERS
actquot.txt	Cours quotidiens
boursac.txt	Calendrier
indquot.txt	Cours quotidiens d'indices de marché
listnomac.txt	Liste des actions et indices rangés par nom croissant
listaffiac.txt	Liste des actions et indices rangés par code affi croissant
osac.txt	Opérations sur actions

**Les programmes Fortran du répertoire
« progactions » associés aux actions quotidiennes**

NOM DU PROGRAMME	FONCTION DU PROGRAMME
acost	Programme d'Analyse et de Contrôle de la Structure de la banque de données Affi-Sbf
pacopa	Programme d'Analyse du Comportement Périodique des Actions sur une base quotidienne

Les programmes Sas du répertoire « progactions » assurant la lecture des actions quotidiennes

NOM DU PROGRAMME	OBJET DU PROGRAMME SAS
boursac.sas	Lecture du calendrier de la bourse
statac.sas	Lecture des statistiques des actions quotidiennes
lectind.sas	Lecture des indices de marché
evolind.sas	Lecture et retraitement des indices de marché
rentind.sas	Lecture et retraitement des indices de marché; calcul des taux de rentabilité quotidiens; détermination des statistiques associés à la distribution des taux de rentabilité quotidiens
rentac.sas	Calcul des taux de rentabilité quotidiens sur la base du résultat du programme « pacopa »
jfg.sas	Lecture des actions quotidiennes

Les fichiers du répertoire « stactions » sur le serveur de recherche

NOM DES FICHIERS	CONTENU DES FICHIERS
stacac.txt	Comportement des actions, titre par titre, sur toute la période d'analyse
staccdm.txt	Derniers cours et dernières opérations, titre par titre
stacnom.txt	Changements de dénomination des sociétés cotées
stacosa.txt	Dernières opérations sur actions, titre par titre
stacsea.txt	Comportement du marché des actions, séance par séance

**B - Les fichiers du répertoire des actions horodatés
« actionshoro » sur le serveur de recherche**

NOMS DES FICHIERS	CONTENU DES FICHIERS
acthoro.txt	Cours et volumes horodatés des actions et indices-actions (hors indices Cac40 et AFFI; du 05/04/1988 au 28/06/1991)
boursac.txt	Calendrier pluriannuel
cac40horo.txt	Niveaux horodatés de l'indice CAC40 (du 01/09/1988 au 28/06/1991)
limhoro.txt	Meilleures limites et volumes horodatés (du 28/02/1990 au 28/06/1991)
listaffiac.txt	Liste des titres classés par code AFFI croissant
listnomac.txt	Liste des titres classés par ordre alphabétique
osac.txt	Opérations sur actions

C - Les fichiers du répertoire « obligations » sur le serveur de recherche

NOM DES FICHIERS	CONTENU DES FICHIERS
boursob.txt	Calendrier pluriannuel
obquot1.txt	Cours et volumes quotidiens des obligations
obquot2.txt	Cours et volumes quotidiens des obligations
listaffiob.txt	Liste des titres classés par code AFFI croissant
listnomob.txt	Liste des titres classés par ordre alphabétique
osob.txt	Opérations sur actions

D - Les fichiers du répertoire « optionsaction » sur le serveur de recherche

NOM DES FICHIERS	CONTENU DES FICHIERS
boursop.txt	Calendrier pluriannuel
listaffiop.txt	Liste des titres classés par code AFFI croissant
listnomop.txt	Liste des titres classés par ordre alphabétique
monep.txt	Options sur actions et sur indices-actions (du 28/02/1987 au 28/12/1990)

**Les programmes Fortran et Sas associés au
répertoire « progoptions »
associés aux options sur actions**

PROGRAMMES	FONCTION DES PROGRAMMES FORTRAN
acost	Analyse des structures d'enregistrement des données - dans les fichiers de données « actions » - dans les fichiers de données « obligations » - dans les fichiers de données « options sur actions »
pandeo	Analyse des options négociables sur actions

PROGRAMMES	FONCTION DU PROGRAMME SAS
jfg.sas	Lecture des options négociables sur actions

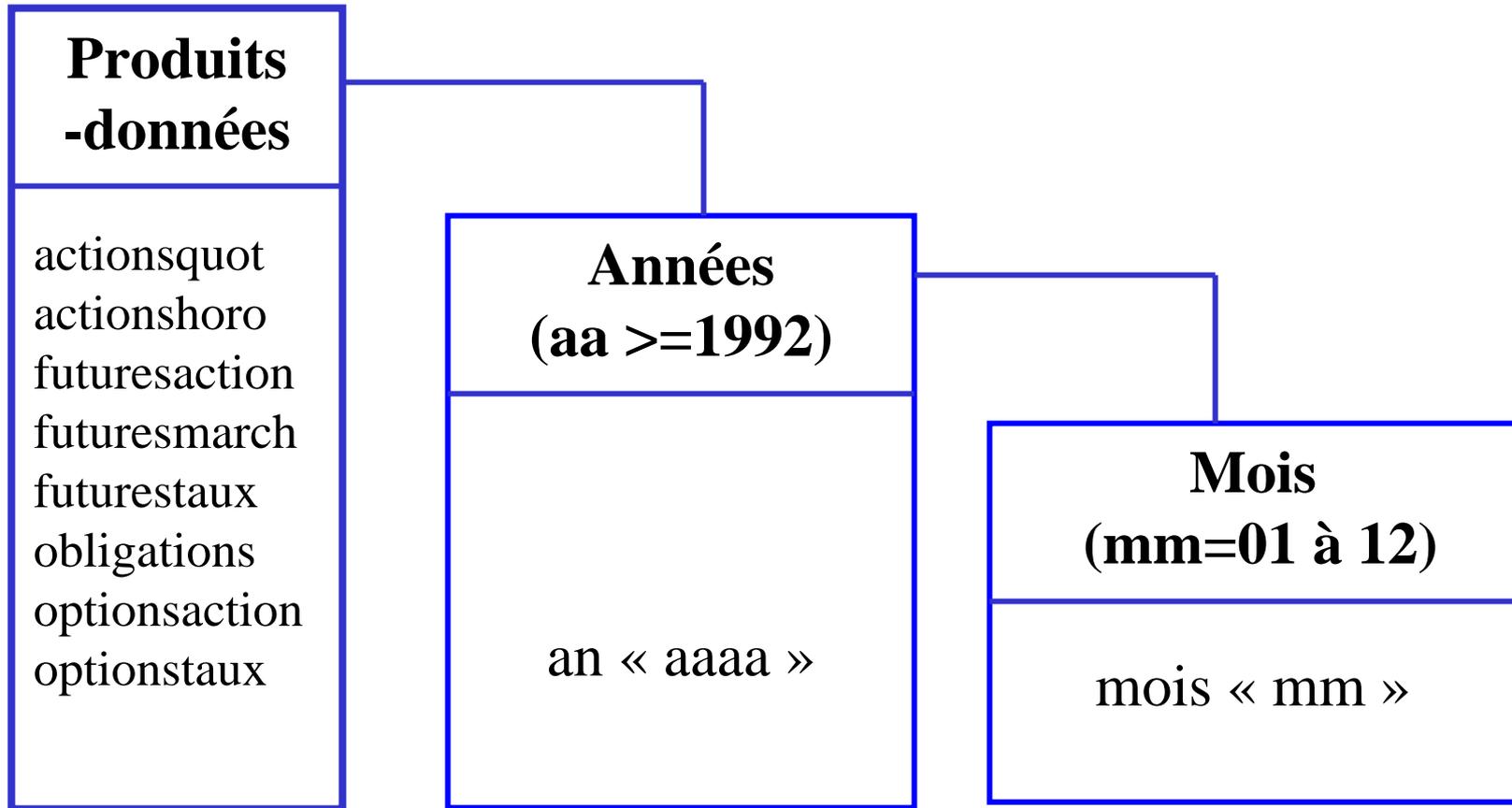
**Les fichiers du répertoire
« statoptions »
sur le serveur de recherche**

NOM DES FICHIERS	CONTENU DES FICHIERS
stopclas.txt	Résultats statistiques par classe d'options
stoptot.txt	Résultats statistiques pour toutes les classes d'options
stopser.txt	Résultats statistiques par série d'options

Section 4 : La base de données de marché « /base/bdm/paris1992/ »

- Les données (*.txt) du 01/01/1992 au 31/12/2004
- Les programmes Fortran et Sas-Unix (*.sas)
- Les résultats des programmes

Structure des données depuis 1/1992



A - Les données horodatées et les programmes Sas de lecture des actions du premier marché et du second marché

Données sur CD-Rom	Données sur serveur (actionsshoro)	Programmes de lecture	Données lues par le programme Sas
bdc1d2.sd2	bdc1d2.TXT.gz	bdc1d2.sas	Calendrier annuel
bdccd2.sd2	bdccd2.TXT.gz	bdccd2.sas	Caractéristiques de cotation
bdcpd2.sd2	bdcpd2.TXT.gz	bdcpd2.sas	Dividendes
bdesd2.sd2	bdesd2.TXT.gz	bdesd2.sas	Secteur économique de l'émetteur
bdfmd2.sd2	bdfmd2.TXT.gz	bdfmd2.sas	Fourchettes moyennes pondérées
bdidd2.sd2	bdidd2.TXT.gz	bdidd2.sas	Codes externes
bdkad2.sd2	bdkad2.TXT.gz	bdkad2.sas	Coefficient d'ajustement
bdm1d2.sd2	bdm1d2.TXT.gz	bdm1d2.sas	Transactions
bdm2d2.sd2	bdm2d2.TXT.gz	bdm2d2.sas	Meilleures limites
bdm3d2.sd2	bdm3d2.TXT.gz	bdm3d2.sas	Evénements de cotation
bdm5d2.sd2	bdm5d2.TXT.gz	bdm5d2.sas	Niveaux instantanés des indices
bdm8d2.sd2	bdm8d2.TXT.gz	bdm8d2.sas	Ordres de marché
bdnhd2.sd2	bdnhd2.TXT.gz	bdnhd2.sas	Opérations hors marché
bdsed2.sd2	bdsed2.TXT.gz	bdsed2.sas	Secteurs économiques
bdtad2.sd2	bdtad2.TXT.gz	bdtad2.sas	Nombre de titres inscrits
bdvad2.sd2	bdvad2.TXT.gz	bdvad2.sas	Type de valeur

Les données horodatées et les programmes Sas de lecture des actions du nouveau marché

Données sur CD-Rom	Données sur serveur	Programme	Données lues par le programme Sas
bdc1d2.sd2	bdc1d2.TXT.gz	bdc1d2.sas	Calendrier annuel
nmr1d2.sd2	nmr1d2.TXT.gz	nmr1d2.sas	Caractéristiques de cotation
nmcpd2.sd2	nmcpd2.TXT.gz	nmcpd2.sas	Dividendes
nmesd2.sd2	nmesd2.TXT.gz	nmesd2.sas	Secteur économique de l'émetteur
nmidd2.sd2	nmidd2.TXT.gz	nmidd2.sas	Codes externes
nmkad2.sd2	nmkad2.TXT.gz	nmkad2.sas	Coefficient d'ajustement
nmm1d2.sd2	nmm1d2.TXT.gz	nmm1d2.sas	Transactions
nmm2d2.sd2	nmm2d2.TXT.gz	nmm2d2.sas	Meilleures limites
nmm3d2.sd2	nmm3d2.TXT.gz	nmm3d2.sas	Evénements de cotation
nmm8d2.sd2	nmm8d2.TXT.gz	nmm8d2.sas	Ordres de marché
nmnhd2.sd2	nmnhd2.TXT.gz	nmnhd2.sas	Opérations hors marché
bdsed2.sd2	bdsed2.TXT.gz	bdsed2.sas	Secteurs économiques
nmr1d2.sd2	nmr1d2.TXT.gz	nmr1d2.sas	Nombre de titres inscrits
nmr1d2.sd2	nmr1d2.TXT.gz	nmr1d2.sas	Type de valeur
nmppd2.sd2	nmppd2.TXT.gz	nmppd2.sas	Publicités de prix

B - Les données horodatées et les programmes Sas de lecture des options sur actions

Données sur CD-Rom	Données sur serveur (optionsaction)	Programmes de lecture	Données lues par le programme Sas
bdc1d2.sd2	bdc1d2.TXT.gz	bdc1d2.sas	Calendrier annuel
mocl.sd2	mocl.TXT.gz	mocl.sas	Classes d'options sur actions
mone.sd2	mone.TXT.gz	mone.sas	Négociations des options sur actions
mose.sd2	mose.TXT.gz	mose.sas	Séries d'options sur actions

C - La documentation relative aux actions et aux options sur actions d'Euronext-Paris

- La documentation relative aux actions ([J.F.Gueugnon](#)).
- La documentation relative aux options sur actions ([J.F.Gueugnon](#)).

Quelques fichiers d'actions quotidiennes sur le serveur de recherche

Le nom « nomf » d'un fichier de données est composé de l'un des indicateurs de marché « imar » recensés dans le tableau ci-dessous , de l'année recherchée (4 chiffres) puis du mois désiré (2 chiffres) suffixés « .txt ». On a donc : nomf =« imar+ yyyy+mm ».txt

Ainsi, les données du marché au comptant de janvier 1995 figurent dans le fichier « cp199501.txt »

imar	ACTIONS COTEES SUR
rm	le marché au règlement mensuel de 01/1991 à 09/2000
cp	le marché au comptant de 01/1991 à 09/2000
sm	le second marché de 01/1991 à 12/2000
nm	le nouveau marché depuis 01/2000
pm	le premier marché disponibles à partir de 09/2000
ind	indices de marché et indices sectoriels disponibles depuis 01/2000

Conclusion : la bourse de Tunis et les indices mondiaux

- La bourse de Tunis
- Les indices du monde