

資料分析 習題二、股市主力籌碼分析

2022/10/4

技術分析的源頭就是資料。股票或者是金融市場裡面的技術分析，主要依據是金融商品的成交金額與交易量，甚至於是主力進出的量價來決定接下來的走勢。台灣證券交易所「買賣日報表查詢系統」<https://bsr.twse.com.tw/bshtm/> 每天下午四點左右，會新公布當天所有的證券商，在全國各地不同的分點當天，所有股票，在怎樣的價位，買進多少單，賣出多少單。這樣，針對某一支股票，我們可以在不同的證券商買、賣超的狀況，按技術分析的講法，這樣就可以判斷主力操作的動向。(註，買超的意義是買的總股數減掉賣的總股數的淨成交股數，如果是負的就是賣超)。不管你相不相信，統計當天哪個證券商呼風喚雨，也是挺有趣的。

如以下圖表是『A 大(kewei)個人研究觀察記錄篇(鴻海投資篇)』
<https://stockresearchsociety.blogspot.com/>，10月3日主力籌碼分析：

「鴻海主力籌碼分析，今天買超第一名的是美林，買了1370張，第二名的是美商高盛，買了512張，第三名的是國泰綜合，買了481張，買第四名的是中國信託，買了135張，第五名是國泰敦南，買了126張，今天賣超賣第一名的瑞銀，賣了1705張，賣第二名的是台灣摩根，賣了1582張，賣第三名的是摩根大通，賣了987張，賣第四名是凱基台北，賣了441張，賣第五名的是富邦，賣了366張。」

10月3日													
券商名稱	買進	賣出	買超	均買價	均賣價	損益(萬)	券商名稱	買進	賣出	買超	均買價	均賣價	損益(萬)
美林	3006	1636	1370	101.49	101.07	-114.6	瑞銀	515	2220	-1705	101.22	101.3	-0.8
美商高盛	1569	1057	512	101.47	101.1	-87.7	台灣摩根	384	1966	-1582	101.29	101.1	-3.4
國泰綜合	481	0	481	101.18	101.5	0	摩根大通	427	1414	-987	101.24	101.03	-11.8
中國信託	140	5	135	101.2	101.4	0.1	凱基台北	129	570	-441	101.09	101.25	1.5
國泰敦南	142	16	126	101.24	101.2	-0.1	富邦	43	410	-366	101.66	101.25	-2
宏遠	201	102	99	100.75	101.49	7	凱基	10	240	-230	101.4	101	-0.7
元富西松	101	5	96	101	101	-0.1	港商法興	10	218	-208	101.5	101.43	-0.3
永豐金	96	7	89	101.46	100.93	-0.3	永豐竹科	7	202	-195	101.26	101.24	0
凱基復興	88	0	88	101.02	0	0	法銀巴黎	0	139	-139	0	101.03	0
美好富順	106	20	86	101.5	101	-1.6	永豐中和	819	934	-115	100.93	101.12	-1.7
第一路竹	72	2	70	101.35	101.5	0	日盛三重	3	100	-97	101.17	101	-0.1
凱基新豐	63	2	61	101.48	100.5	-0.2	亞東	1	92	-91	100.71	100.51	0
元大四維	56	0	56	101.37	101.5	0	元大六合	615	702	-87	101.2	101.23	-14.3
永豐北高	61	6	55	101.5	100.5	-0.8	國泰台中	46	129	-83	101.04	101.39	0.8
新光新竹	60	6	54	101.06	101.25	0	大和國泰	0	78	-78	0	101.28	0
凱基高美	58	4	53	100.99	101.14	0	玉山大里	1	78	-77	101.89	100.58	-0.1
元大大統	58	5	53	101.5	100.9	-0.4	花旗環球	235	306	-71	101.19	101.11	-8
兆豐	76	25	51	101.39	101	-0.8	台新	59	110	-51	101.32	101.23	-0.9
永豐屏東	53	2	51	101.49	101.5	0	元大屏東	14	57	-43	101.06	101	-0.5
國票博愛	50	0	50	101.5	0	0	臺銀臺中	8	50	-42	101.14	101	-0.3

出處：<https://stockresearchsociety.blogspot.com/>

延續之前，讓同學「填 code」的練習精神，助教會提供八成品的程式碼。其中，我們會先教大家怎麼樣從台灣證券交易所，下載你所選定股票當日在各分點，在哪些價位買進賣出多少數量的股數的原始資料。把同一家證券商在不同分點的買

賣價量資訊合併在一起，就可計算出這個證券商的淨買、賣的股數，與平均成本。

為了讓同學了解程式碼中處理這些資料的各個步驟，請各位同學，到上列網址的台灣證券交易所，先手動任選一隻股票，如鴻海 2317，下載當天或前一天各個分點的買賣資訊的 csv 檔，我們就要將長得像這樣的資料合併成如上圖所看到的主力籌碼分析表。大家先觀察一下拿下來的表格長得像什麼樣子：他是雙欄的，他是按同一家證券商在不同分行依序排列，在每一個分點在不同價位的買賣價錢以及交易量。習題二的工作就是要先把同一家的證券商在不同分點的交易價量整合起來。然後，計算哪一家每一家證券商的買賣超數量與平均價錢，然後取買最多的還有賣最多的主力。先想想你要怎麼做，然後再和助教提供的部份程式。

習題二中，我們也教大家一個破解人機辨識碼的方法，也就是下圖左邊要輸入 TYZZF 的那一塊。這原本是一些網頁不讓人寫程式爬文所設下的障礙，但我們提供網上別人提供的程式碼可讓程式自動驗證。有興趣的同學可以參考 <https://github.com/sml2h3/ddddocr>。之後大家遇到類似的路障就會非常的方便。



TAIWAN

STOCK EXCHANGE

臺灣證券交易所

流通證券・活絡經濟

<<買賣日報表查詢系統>>

☒ 一般交易

證券代號: 2317

☐ 鉅額交易

TYZZF

輸入圖形中5碼文數字:

查詢

重設

下載 2317.CSV

此資料不得逕自散布或販售，
並請詳閱「使用條款」

使用條款

隱私權保護說明

交易日期	2022/10/03			股票代號	2317 鴻海				
成交筆數	9,539	成交金額	2,131,529,886		成交股數	21,063,821			
開盤價	101.00	最高價	102.00		最低價	100.50	收盤價	101.00	
序	證券商	成交單價	買進股數	賣出股數	序	證券商	成交單價	買進股數	賣出股數
1	1020 合庫	101.00	4,000	1,000	2	1020	101.50	10	1,000
3	1021 合庫台中	100.50	1,000	0	4	1021	101.00	8,000	4,000
5	1021	101.50	15,590	5,350	6	1022 合庫台南	101.00	8,000	0
7	1022	101.50	2,450	1,000	8	1023 合庫高雄	101.00	5,000	1,100
9	1023	101.50	7,300	200	10	1024 合庫嘉義	101.00	1,000	0
11	1024	101.50	1,010	0	12	1025 合庫基隆	100.50	1,000	0
13	1025	101.00	1,000	0	14	1028 合庫彰化	101.00	3,020	1,000
15	1028	101.50	1,000	1,000	16	1029 合庫鳳山	100.50	2,000	0
17	1029	101.00	1,000	7,000	18	1029	101.50	1,000	0
19	102A 合庫新竹	101.00	11,000	0	20	102A	101.50	1,000	0
21	102C 合庫自強	101.00	2,000	0	22	102C	101.50	40	1,000
23	102E 合庫桃園	100.50	2,000	0	24	102E	101.00	8,050	0
25	102E	101.50	4,000	1,000	26	102F 合庫西台	101.00	4,000	21,500
27	102F	101.50	1,000	0	28	102F	102.00	2,000	0
29	102G 合庫三重	101.00	1,000	0	30	102G	101.50	60	0
31	1030 土銀	100.50	2,000	0	32	1030	101.00	3,000	0
33	1030	101.50	330	0	34	1030	102.00	1,000	0
35	1031 土銀台中	101.00	1,000	0	36	1031	101.50	6,000	0
37	1032 土銀台南	101.00	1,000	0	38	1033 土銀高雄	101.00	1,000	0

補充

csv 檔開啟時可能會呈現亂碼，請參考以下網站教學：

<https://officeguide.cc/excel-import-csv-file-with-utf8-big5-encoding-tutorial-examples/>

如何交作業？

習題二是試著複製如圖一的統計表格，其中損益(萬) 的那欄，不用實現。因為我也不知道他怎麼算的 ☺。我們還是提供部分的程式碼，讓各位同學補足中間的程式碼。

為了要方便同學們繳交作業，請同學在指定時間內執行爬蟲程式，助教也會在相同時間內爬蟲，當作答案的比對。如果遲交的同學我們會另外再訂一天的時間。

繳交日期：10/22 ~ 10/24 (三天擇一)

繳交內容：完成八成品的程式碼，並將期輸出之券商分點資料表(result.csv)上傳至 moodle

證券代號：2317(鴻海)

檔案名稱：爬蟲日期_學號_姓名