

Phụ lục

Phần phụ lục này tập hợp các bài viết độc lập hoặc nối tiếp các ngày trong nội dung chính của eBook. Đây là phần chia sẻ thêm để giúp bạn đọc có nhu cầu thực hành, khám phá thêm các góc nhìn mới về Phân tích dữ liệu nói riêng, AI nói chung.

Các bài viết có thể ở dạng ý tưởng và đang trong giai đoạn khám phá. Vì vậy nếu bạn đọc thấy chưa hoàn thiện thì đó xem như bài tập của các bạn nhé!

Thân ái,

Chỉ số VN INDEX biến động như thế nào từ thứ Hai đến thứ Sáu

Tôi có câu hỏi là nên giao dịch chứng khoán vào thứ mấy trong tuần?

Để trả lời câu hỏi này thì chúng ta cần giải quyết một số vấn đề sau:

- Xem dữ liệu VNIndex giá trị High, Low các ngày trong tuần

Cách lấy dữ liệu VN INDEX

Vào trang web “<https://www.cophieu68.vn/export.php>”, đăng ký tài khoản (miễn phí) bấm vào mục “DỊCH VỤ DỮ LIỆU”, “Tải dữ liệu” để lấy file csv về máy.

	DL lịch sử Metastock & AmiBroker	DL lịch sử Excel (Full)	DL Báo cáo tài chính	DL
ALL DATA (HOSE & HNX)	Download			
VNINDEX	Download	Download		
HNX	Download	Download		
000001.SS	Download	Download	Download	
A32	Download	Download	Download	
AAA	Download	Download	Download	
AAM	Download	Download	Download	

Dùng phần mềm R (<https://cran.r-project.org/>) để xem tổng quan dữ liệu.

Các dòng bắt đầu bằng dấu thăng (#) là chú thích của tôi để giải thích ý nghĩa của lệnh R.

```
# Dùng lệnh file.choose() để mở hộp thoại
# chọn file "excel_vnindex.csv" sau khi download
f = file.choose()
data = read.csv(f)
dim(data)
```

```
[1] 4506    14
```

Kết quả lệnh dim cho thấy có 4506 dòng dữ liệu

14 cột dữ liệu (Xem thêm lệnh head bên dưới)

```
head(data)
```

```
  X.Ticker. X.DYYYYMMDD. X.OpenFixed. X.HighFixed. X.LowFixed. X.CloseFixed.
1  ^VNINDEX      20190426         972.86         979.64         970.73         979.64
2  ^VNINDEX      20190425         976.46         976.46         971.92         974.13
3  ^VNINDEX      20190424         969.66         978.71         969.66         976.92
4  ^VNINDEX      20190423         964.84         970.98         964.35         968.00
5  ^VNINDEX      20190422         963.78         966.69         959.33         965.86
6  ^VNINDEX      20190419         968.27         971.73         965.46         966.21
```

	X.Volume.	X.Open.	X.High.	X.Low.	X.Close.	X.volumeDeal.	X.volumeFB.	X.volumeFS.
1	118539754	972.86	979.64	970.73	979.64	0	6527232	6355132
2	149114784	976.46	976.46	971.92	974.13	0	15370270	16830400
3	134071764	969.66	978.71	969.66	976.92	0	12740050	7683390
4	154887616	964.84	970.98	964.35	968.00	0	11690700	18355300
5	216344286	963.78	966.69	959.33	965.86	0	6673120	6090200
6	106976093	968.27	971.73	965.46	966.21	0	3204780	4536850

Chú ý: Cột ngày “X.DTYYYYMMDD.” được trình bày theo dạng yyyyMMdd – không có dấu cách giữa năm, tháng ngày nên R hiểu đây là số nguyên. Dùng lệnh class để xem kiểu dữ liệu:

```
class(data$X.DTYYYYMMDD.)
```

```
[1] "integer"
```

Chúng ta cần chuyển đổi dữ liệu thời gian này một chút thông qua 2 bước:

Bước 1: Thêm cột strDate bằng cách lấy dữ liệu cột “X.DTYYYYMMDD.” chuyển thành kiểu kí tự (chuỗi).

```
data$strDate = as.character(data$X.DTYYYYMMDD.)
class(data$strDate)
```

```
[1] "character"
```

Bước 2: Thêm cột data bằng cây lấy dữ liệu cột “strDate” vừa thêm chuyển thành kiểu ngày bằng hàm as.Date(strDate, “%Y%m%d”)

```
data$date = as.Date(data$strDate, format = '%Y%m%d')
class(data$date)
```

```
[1] "Date"
```

Chú ý: trong định dạng %Y%d%m thì chữ **d** và **m** là chữ thường.

Kiểm tra lại vài dòng dữ liệu

```
head(data)
```

	X.Ticker.	X.DTYYYYMMDD.	X.OpenFixed.	X.HighFixed.	X.LowFixed.	X.CloseFixed.	X.Volume.
	X.Open.	X.High.	X.Low.	X.Close.	X.volumeDeal.		
1	^VNINDEX	20190426	972.86	979.64	970.73	979.64	118539754
			972.86	979.64	0		
2	^VNINDEX	20190425	976.46	976.46	971.92	974.13	149114784
			976.46	976.46	971.92	974.13	
3	^VNINDEX	20190424	969.66	978.71	969.66	976.92	134071764
			969.66	978.71	969.66	976.92	
4	^VNINDEX	20190423	964.84	970.98	964.35	968.00	154887616
			964.84	970.98	964.35	968.00	
5	^VNINDEX	20190422	963.78	966.69	959.33	965.86	216344286
			963.78	966.69	959.33	965.86	
6	^VNINDEX	20190419	968.27	971.73	965.46	966.21	106976093
			968.27	971.73	965.46	966.21	
	X.VolumeFB.	X.VolumeFS.	strDate	date			
1	6527232	6355132	20190426	2019-04-26			
2	15370270	16830400	20190425	2019-04-25			
3	12740050	7683390	20190424	2019-04-24			
4	11690700	18355300	20190423	2019-04-23			
5	6673120	6090200	20190422	2019-04-22			
6	3204780	4536850	20190419	2019-04-19			

Lúc này dữ liệu cột date được hiển thị có dấu gạch giữa năm tháng và ngày.

Xem tổng quan dữ liệu bằng lệnh summary:

```
summary(data)
```

X.Ticker.	X.DTYYYYMMDD.	X.OpenFixed.	X.HighFixed.	X.LowFixed.	
X.CloseFixed.	Min. : 20000728	Min. : 100.0	Min. : 100.0	Min. : 100.0	M
AVNINDEX:4506	1st Qu.: 20050926	1st Qu.: 296.5	1st Qu.: 298.9	1st Qu.: 296.3	1
in. : 100.0	Median : 20100412	Median : 487.6	Median : 490.6	Median : 484.0	M
st Qu.: 297.4	Mean : 20098088	Mean : 507.6	Mean : 510.1	Mean : 505.0	M
edian : 486.9	3rd Qu.: 20141019	3rd Qu.: 610.7	3rd Qu.: 614.4	3rd Qu.: 607.8	3
ean : 507.5	Max. : 20190426	Max. : 1207.6	Max. : 1211.3	Max. : 1197.4	M
rd Qu.: 610.6					
ax. : 1204.3					
X.Volume.	X.Open.	X.High.	X.Low.	X.Close.	
X.VolumeDeal.	Min. : 174	Min. : 100.0	Min. : 100.0	Min. : 100.0	
Min. : 0	1st Qu.: 1487382	1st Qu.: 296.5	1st Qu.: 298.9	1st Qu.: 296.3	
1st Qu.: 0	Median : 26702355	Median : 487.6	Median : 490.6	Median : 484.0	
Median : 0	Mean : 53381363	Mean : 507.6	Mean : 510.1	Mean : 505.0	
Mean : 0	3rd Qu.: 93457508	3rd Qu.: 610.7	3rd Qu.: 614.4	3rd Qu.: 607.8	
3rd Qu.: 0	Max. : 445940510	Max. : 1207.6	Max. : 1211.3	Max. : 1197.4	
Max. : 0				Max. : 1204.3	
				NA's : 1	
X.VolumeFB.	X.VolumeFS.	date			
Min. : 0.000e+00	Min. : 0.000e+00	Min. : 2000-07-28			
1st Qu.: 0.000e+00	1st Qu.: 0.000e+00	1st Qu.: 2005-09-26			
Median : 2.540e+06	Median : 2.140e+06	Median : 2010-04-12			
Mean : 1.614e+07	Mean : 1.625e+07	Mean : 2010-04-02			
3rd Qu.: 6.608e+06	3rd Qu.: 5.979e+06	3rd Qu.: 2014-10-19			
Max. : 2.147e+09	Max. : 1.847e+09	Max. : 2019-04-26			

Ghi chú:

- Trong cột ‘date’ cho biết dữ liệu từ ngày 28/7/2000 (dòng **Min.**) đến 26/4/2019 (Dòng **Max.**)

Thêm cột “dayOfWeek” để thể hiện Thứ trong tuần.

```
data$dayOfWeek = weekdays(date)
```

Chuyển dayOfWeek thành Factor để phục vụ cho việc phân tích

```
data$dayOfWeek = as.factor(data$dayOfWeek)
```

Xem lại tổng quan dữ liệu của dayOfWeek bằng lệnh summary bạn sẽ thấy số lượng dữ liệu theo thứ.

```
summary(data$dayOfWeek)
```

Friday	Monday	Thursday	Tuesday	wednesday
938	911	862	854	941

Vẽ biểu đồ với thư viện zoo

Zoo hỗ trợ phân tích dữ liệu theo thời gian.

Cài đặt thư viện zoo:

```
install.packages('zoo')  
install.packages('ggfortify')  
library(zoo)  
library(ggfortify)
```

Tạo dữ liệu x theo thời gian của giá trị thấp nhất và cao nhất của VNIndex

```
z = zoo(x = cbind(X.Low., X.High.), order.by = date)
```

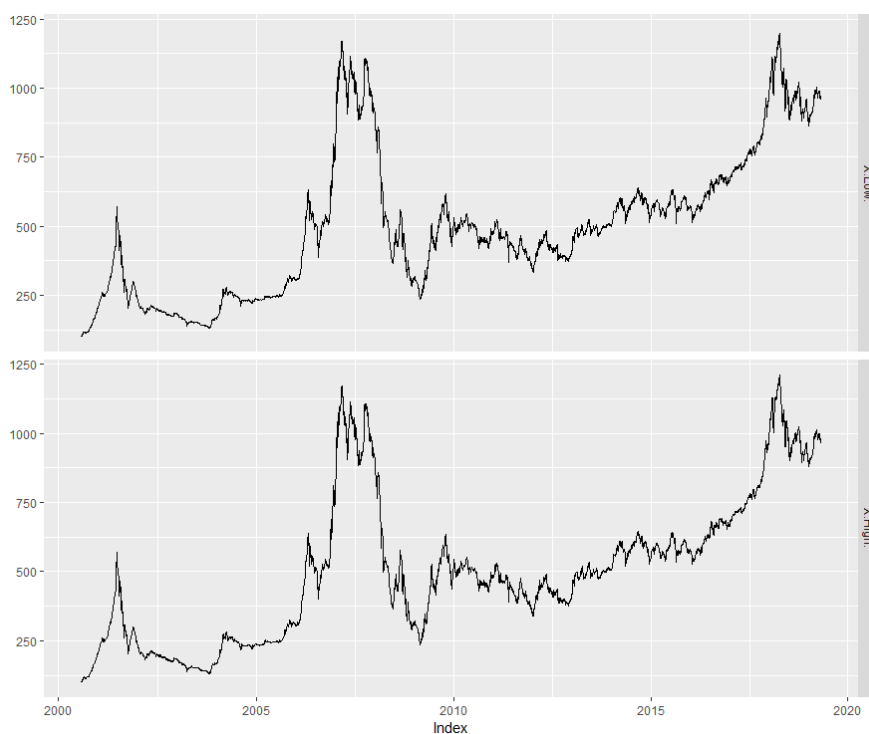
Nhìn qua dữ liệu của biến z theo thời gian

```
head(z)
```

	X.Low.	X.High.
2000-07-28	100.00	100.00
2000-07-31	101.55	101.55
2000-08-02	103.38	103.38
2000-08-04	105.20	105.20
2000-08-07	106.92	106.92
2000-08-09	108.64	108.64

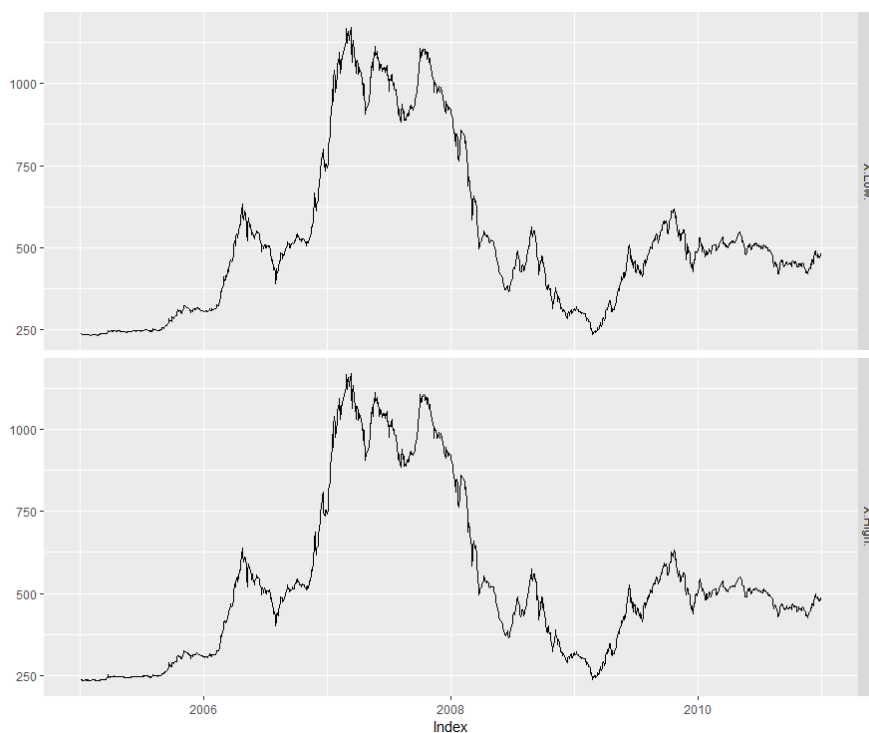
Vẽ biểu đồ VNIndex thấp nhất và cao nhất theo ngày

```
autoplot(z)
```



Nhìn vào dữ liệu giữa năm 2005 và 2010 thì có núi bất thường? Để xem chi tiết dữ liệu từ năm 2005 đến 2010 thì dùng lệnh window và vẽ biểu đồ:

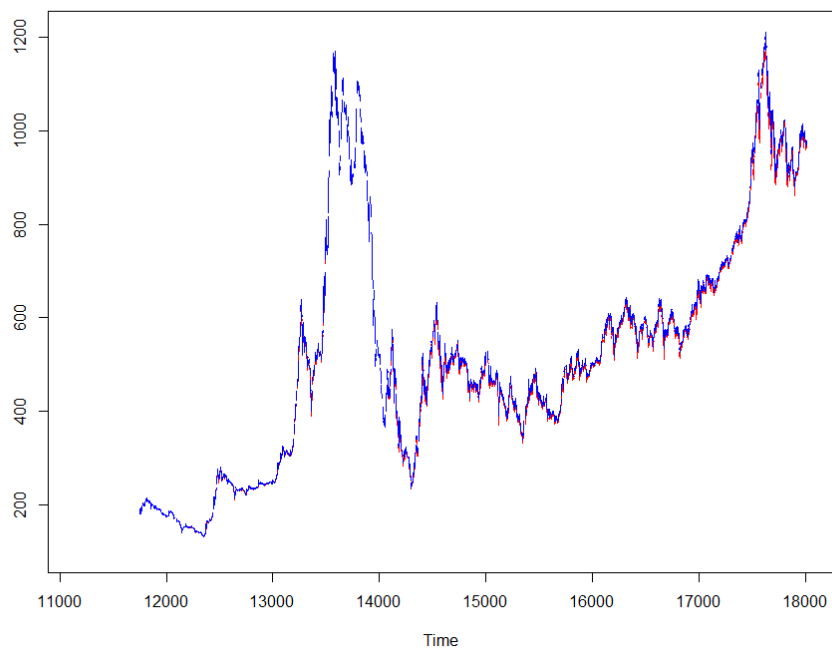
```
z1 = window(z, start = as.Date('2005/1/1'), end =
as.Date('2010/12/31'))
autoplot(z1)
```



Năm 2008 là năm khủng hoảng kinh tế nên chứng khoán lao dốc.

Xem giá trị Cao nhất và Thấp nhất trong cùng 1 biểu đồ

```
ts.plot(z, col = c("red", "blue"))
```



Sử dụng PerformanceAnalytics

```
install.packages('PerformanceAnalytics')  
library('PerformanceAnalytics')  
PerformanceAnalytics::chart.TimeSeries(z)
```



Gom dữ liệu theo tuần

Chúng ta cần bảng số liệu sau VNIndex High như sau:

	Mon	Tue	Wed	Thu	Fri
W1					
W2					
W3					

Sử dụng R để vẽ biểu đồ

Để xem được số liệu và biểu đồ liên quan đến chỉ số VN Index trước và sau lễ 30/4 thì cần lọc dữ liệu trước và sau ngày 30 tháng 4. Dữ liệu trong Bảng 1 ở trên có thể download tại:

“https://drive.google.com/open?id=1S3sf6YRT3Jt6a7U0n_I4mCCzKq6dqGkw”

Trong bài này dùng thư viện “ggplot2” để vẽ biểu đồ.

Trong R, dùng lệnh `install.packages(...)` để cài thư viện.

```
install.packages('ggplot2')
```

Các lệnh R sau đây sẽ xử lý một chút dữ liệu từ file csv và vẽ một số biểu đồ:

```
# Chọn file csv sau khi download
f = file.choose()
```



```
data = read.csv(f)

data$strDate = as.character(data$DTYYYYMMDD)
data$date = as.Date(data$strDate, format = '%Y%m%d')
# Xóa cột strDate
data$strDate = NULL
data$year = as.numeric(format(data$date, "%Y"))
data$month = as.factor(format(data$date, "%m"))
data$yyyymm = as.factor(format(data$date, "%Y-%m"))
data$m = as.numeric(format(data$date, "%m"))

library(ggplot2)
attach(data)
p = ggplot(data, aes(x = yyyymm, y = Close, fill = month))

p1 = p + geom_bar(stat="identity") + xlab("Ngày giao dịch trước và sau  
Lễ 30/4") + ylab("Giá đóng cửa")
p1 = p1 + theme(axis.text.x = element_text(angle = 90))
p1 = p1 + ggtitle("Giá đóng cửa chỉ số VN Index trước và sau lễ 30/4  
trong 10 năm")
p1 = p1 + labs(fill = "Tháng")

plot(p1)

# Giá mở cửa
p = ggplot(data, aes(x = yyyymm, y = Open, fill = month))

p1 = p + geom_bar(stat="identity") + xlab("Ngày giao dịch trước và sau  
Lễ 30/4") + ylab("Giá mở cửa")
p1 = p1 + theme(axis.text.x = element_text(angle = 90))
p1 = p1 + ggtitle("Giá mở cửa chỉ số VN Index trước và sau lễ 30/4  
trong 10 năm")
p1 = p1 + labs(fill = "Tháng")

plot(p1)

# Giá cho nhất
p = ggplot(data, aes(x = yyyymm, y = High, fill = month))
```

```
p1 = p + geom_bar(stat="identity") + xlab("Ngày giao dịch trước và sau  
Lễ 30/4") + ylab("Giá cao nhất")  
p1 = p1 + theme(axis.text.x = element_text(angle = 90))  
p1 = p1 + ggtitle("Giá cao nhất chỉ số VN Index trước và sau lễ 30/4  
trong 10 năm")  
p1 = p1 + labs(fill = "Tháng")  
  
plot(p1)
```

Tham khảo

<https://cran.r-project.org/web/packages/timeSeries/vignettes/timeSeriesPlot.pdf>

Tp.HCM, ngày 1/5/2019

Quan sát giao dịch cổ phiếu VNM (Vinamilk)

Đọc dữ liệu

Lấy dữ liệu tôi dùng phần mềm để sưu tầm giao dịch theo lô của cổ phiếu VNM từ trang cafe.vn và lưu trên link https://thachln.github.io/datasets/VNM_20200710.zip. Dữ liệu từ ngày 10/27/2014 đến 10/7/2020.

```
import pandas as pd

df =
pd.read_csv('https://thachln.github.io/datasets/VNM_20200710.zip')
```

Hiểu một chút về dữ liệu

Dùng hàm `info()`

```
df.info()
```

```
<class 'pandas.core.frame.DataFrame'>
RangeIndex: 674488 entries, 0 to 674487
Data columns (total 4 columns):
#   Column      Non-Null Count  Dtype
---  ---
0   symbol      674488 non-null object
1   time         674488 non-null object
2   price        674488 non-null float64
3   volume       674488 non-null int64
dtypes: float64(1), int64(1), object(2)
```

Kết quả `info` cho thấy cột `time` có kiểu dữ liệu `object` chứ không phải là thời gian (`datetime`). Để chuyển kiểu cột `time` cho đúng kiểu thời gian thì sử dụng tiếp lệnh sau:

```
df['time'] = pd.to_datetime(df['time'])
```

Chạy lại lệnh `info` ở trên sẽ cho ra kết quả như sau:

```
<class 'pandas.core.frame.DataFrame'>
RangeIndex: 674488 entries, 0 to 674487
Data columns (total 4 columns):
#   Column      Non-Null Count  Dtype
---  ---
0   symbol      674488 non-null object
1   time         674488 non-null datetime64[ns]
2   price        674488 non-null float64
3   volume       674488 non-null int64
dtypes: datetime64[ns](1), float64(1), int64(1), object(1)
```

Hàm `info()` cho thấy dataframe gồm 4 cột dữ liệu:

Cột	Ý nghĩa
symbol	là mã cổ phiếu. Trong dữ liệu này chỉ có cổ phiếu VNM
time	thời gian giao dịch. Kiểu dữ liệu là <code>datetime64[ns]</code>
price	giá giao dịch

volume	số lượng cổ phiếu được giao dịch
---------------	----------------------------------

Dùng hàm *describe()* và thuộc tính *shape*

Xem vài thông tin thống kê về dữ liệu bằng hàm `describe()`:

```
df.describe()
```

	price	volume
count	674488.000000	6.744880e+05
mean	137.262721	1.565956e+03
std	28.859136	2.549325e+04
min	83.700000	1.000000e+00
25%	117.800000	8.000000e+01
50%	132.000000	3.200000e+02
75%	151.400000	1.040000e+03
max	215.000000	1.887654e+07

Xem thêm thuộc tính `shape`:

```
df.shape
```

```
(674488, 4)
```

Như vậy có thể tóm tắt vài chỉ số thống kê như sau:

- Dữ liệu có 674488 dòng, mỗi dòng là mỗi giao dịch.
- Giá trị mean (trung bình) cho thấy giá trung bình của cổ phiếu VNM là 138 nghìn đồng. Trung bình mỗi giao dịch $1.62 \times 10^3 = 1620$ cổ phiếu.
- Độ lệch chuẩn của giá cổ phiếu là 30. Chú ý giá cổ phiếu ở đây tính bằng đơn vị là **Nghìn** đồng. Điều này nói lên điều gì? Nó phản ánh sự khác biệt về giá trong các lần giao dịch. Các mức giá giao dịch có sự khác biệt nhau tầm 30 nghìn đồng xung quanh giá trung bình.

Ở đây phải chú ý là chúng ta không có dữ liệu về các lần chia tách cổ phiếu. Mỗi lần chia tách thì giá cổ phiếu được điều chỉnh lại. Tạm thời bỏ qua yếu tố này để cho “bài tập thể dục” đơn giản.

- Tương tự, bạn có thể nhìn qua các chỉ số min; max; bách phân vị 25%, 50%, 75% của giá.

Xem vài dòng dữ liệu

```
df.head()
```

	symbol	time	price	volume
0	VNM	2020-07-10 14:47:03	115.3	16660
1	VNM	2020-07-10 14:30:03	115.4	1000
2	VNM	2020-07-10 14:30:01	115.4	450
3	VNM	2020-07-10 14:29:45	115.4	660
4	VNM	2020-07-10 14:29:35	115.4	200

Thêm cột ngày

Hiện tại cột `time` chứa thời gian giao dịch đến mức giây. Các phân tích tiếp theo của chúng ta là tính theo ngày nên cần phải thêm cột `date` để chứa ngày tháng năm.

```
df['date'] = df['time'].dt.date
df.head()
```

	symbol	time	price	volume	date
0	VNM	2020-07-10 14:47:03	115.3	16660	2020-07-10
1	VNM	2020-07-10 14:30:03	115.4	1000	2020-07-10
2	VNM	2020-07-10 14:30:01	115.4	450	2020-07-10
3	VNM	2020-07-10 14:29:45	115.4	660	2020-07-10
4	VNM	2020-07-10 14:29:35	115.4	200	2020-07-10

Tính tổng giá trị giao dịch

```
df['trade_value'] = df['price'] * df['volume']
df.head()
```

	symbol	time	price	volume	date	trade_value
0	VNM	2020-07-10 14:47:03	115.3	16660	2020-07-10	1920898.0
1	VNM	2020-07-10 14:30:03	115.4	1000	2020-07-10	115400.0
2	VNM	2020-07-10 14:30:01	115.4	450	2020-07-10	51930.0
3	VNM	2020-07-10 14:29:45	115.4	660	2020-07-10	76164.0
4	VNM	2020-07-10 14:29:35	115.4	200	2020-07-10	23080.0

Tính giá trị trung bình của cổ phiếu

Giá trị trung bình trong ngày bằng cách tính tổng các giá trị giao dịch trong ngày. Sau đó chia cho tổng lượng giao dịch trong ngày. Kết quả lưu trong dataframe mới `df_avg_price`.

```
df_avg_price = df.groupby(['date'])['volume', 'trade_value'].sum()
df_avg_price['avg_price'] = df_avg_price['trade_value'] /
df_avg_price['volume']

df_avg_price.head()
```

date	volume	trade_value	avg_price
2014-10-27	68880	7223620.0	104.872532
2014-10-29	27810	2892260.0	104.000719
2014-10-30	49530	5197670.0	104.939834
2014-11-03	20410	2155160.0	105.593337
2014-11-05	125160	13045320.0	104.229147

Xem thông tin của dataframe `df_avg_price`:

```
df_avg_price.info()
```

```
<class 'pandas.core.frame.DataFrame'>
Index: 1318 entries, 2014-10-27 to 2020-07-10
Data columns (total 3 columns):
#   Column      Non-Null Count  Dtype
---  -
0   volume      1318 non-null   int64
```

```
1 trade_value 1318 non-null float64
2 avg_price 1318 non-null float64
dtypes: float64(2), int64(1)
```

Bạn để ý thì thấy dataframe `df_avg_price` không có cột `date`.

Thêm cột gom nhóm vào dataframe

Để thêm cột làm tiêu chí gộp nhóm (cột `date`) vào dataframe thì dùng hàm `reset_index()`:

```
df_avg_price = df_avg_price.reset_index()
```

Xem lại thông tin của dataframe `df_avg_price`:

```
df_avg_price.info()
```

```
<class 'pandas.core.frame.DataFrame'>
RangeIndex: 1318 entries, 0 to 1317
Data columns (total 4 columns):
#   Column      Non-Null Count  Dtype
---  -
0   date        1318 non-null   object
1   volume      1318 non-null   int64
2   trade_value 1318 non-null   float64
3   avg_price   1318 non-null   float64
dtypes: float64(2), int64(1), object(1)
```

Một điểm chú ý là cột `date` có kiểu dữ liệu là `object`.

Chuyển kiểu object sang dạng date

Để chuyển cột `date` đang là `object` sang kiểu thời gian thì dùng hàm `pd.to_datetime(...)`:

```
df_avg_price['date'] = pd.to_datetime(df_avg_price['date'])
```

Xem lại thông tin:

```
df_avg_price.info()
```

```
<class 'pandas.core.frame.DataFrame'>
RangeIndex: 1318 entries, 0 to 1317
Data columns (total 4 columns):
#   Column      Non-Null Count  Dtype
---  -
0   date        1318 non-null   datetime64[ns]
1   volume      1318 non-null   int64
2   trade_value 1318 non-null   float64
3   avg_price   1318 non-null   float64
dtypes: datetime64[ns](1), float64(2), int64(1)
```

Xem vài dòng dữ liệu:

```
df_avg_price.head()
```

```
   date      volume  trade_value  avg_price
0 2014-10-27   68880    7223620.0  104.872532
1 2014-10-29   27810    2892260.0  104.000719
```

```
2 2014-10-30 49530 5197670.0 104.939834
3 2014-11-03 20410 2155160.0 105.593337
4 2014-11-05 125160 13045320.0 104.229147
```

Sắp xếp lại dataframe theo ngày giảm dần

```
df_avg_price = df_avg_price.sort_values(by = ['date'],
ascending=False)
df_avg_price.head()
```

	date	volume	trade_value	avg_price
1317	2020-07-10	677180	78415689.0	115.797408
1316	2020-07-09	1560410	181141529.0	116.085855
1315	2020-07-08	551310	63805697.0	115.734699
1314	2020-07-07	1024960	119346196.0	116.439857
1313	2020-07-06	1319980	152240966.0	115.335813

Xem vài thông tin mô tả dataframe mới

```
df_avg_price.describe()
```

	volume	trade_value	avg_price
count	1.318000e+03	1.318000e+03	1318.000000
mean	8.013798e+05	1.112912e+08	136.770054
std	8.625206e+05	1.238176e+08	26.715244
min	2.913000e+03	3.612120e+05	84.764400
25%	3.382375e+05	4.410212e+07	119.588663
50%	6.499100e+05	8.893423e+07	133.040233
75%	1.060290e+06	1.503052e+08	148.547710
max	1.907396e+07	2.733192e+09	214.305513

Hãy quan sát vài chỉ số của cột bên trái đối với giá trung bình của cổ phiếu (cột avg_price)!

Tính chênh lệch giá giữa 2 ngày liền kề

```
df_avg_price['delta'] = df_avg_price['avg_price'].diff(periods = -1)
df_avg_price.head()
```

	volume	trade_value	avg_price	delta
date				
2020-07-10	677180	78415689.0	115.797408	-0.288447
2020-07-09	1560410	181141529.0	116.085855	0.351156
2020-07-08	551310	63805697.0	115.734699	-0.705158
2020-07-07	1024960	119346196.0	116.439857	1.104045
2020-07-06	1319980	152240966.0	115.335813	1.370475

Thêm cột kí hiệu giá tăng hay giảm

Thêm cột pn (Positive or Negative) để ghi chú giá trung bình của cổ phiếu là tăng (1) hay giảm (-1) hay bằng (0) so với ngày hôm trước.

Giả định nếu giá tăng chưa tới 1 đồng thì xem như không tăng. Code bên dưới sẽ thêm cột pn với giá trị là 0 (xem như giá cổ phiếu không tăng so với ngày hôm trước. Sau đó thiết lập lại giá trị nếu tăng trên 0.009 nghìn thì thiết lập cột pn là 1. Ngược lại nếu giảm hơn 0.009 nghìn thì thiết lập cột pn là -1.

```
df_avg_price['pn'] = 0
```

```
df_avg_price.loc[df_avg_price['delta'] > 0.009, 'pn'] = 1
df_avg_price.loc[df_avg_price['delta'] < -0.009, 'pn'] = -1
```

Xem thử kết quả

```
df_avg_price.head()
```

date	volume	trade_value	avg_price	delta	pn
2020-07-10	677180	78415689.0	115.797408	-0.288447	-1
2020-07-09	1560410	181141529.0	116.085855	0.351156	1
2020-07-08	551310	63805697.0	115.734699	-0.705158	-1
2020-07-07	1024960	119346196.0	116.439857	1.104045	1
2020-07-06	1319980	152240966.0	115.335813	1.370475	1

Đến đây thì trong tay của bạn đã có dữ liệu giá trung bình cổ phiếu VNM mỗi ngày và cột delta, pn cho biết sự chênh lệch giá giữa hai ngày liên tiếp, cụ thể là tăng so với ngày hôm trước (cột pn có giá trị 1) hoặc giảm so với ngày hôm trước (cột pn có giá trị -1).

Xem lại các chỉ số thống kê của dataframe df_avg_price:

```
df_avg_price.describe()
```

	volume	trade_value	avg_price	delta	pn
count	1.318000e+03	1.318000e+03	1318.000000	1317.000000	1318.000000
mean	8.013798e+05	1.112912e+08	136.770054	0.008295	-0.015175
std	8.625206e+05	1.238176e+08	26.715244	2.653074	0.997223
min	2.913000e+03	3.612120e+05	84.764400	-29.834159	-1.000000
25%	3.382375e+05	4.410212e+07	119.588663	-0.871813	-1.000000
50%	6.499100e+05	8.893423e+07	133.040233	-0.020519	-1.000000
75%	1.060290e+06	1.503052e+08	148.547710	1.052080	1.000000
max	1.907396e+07	2.733192e+09	214.305513	21.134308	1.000000

Thống kê thử số ngày tăng, số ngày giảm

Thống kê thử số ngày tăng, số ngày giảm bằng hàm crosstab (...):

```
pn_count = pd.crosstab(index=df_avg_price['pn'], columns='count')
print(pn_count)
```

col_0	count
pn	
-1	665
0	8
1	645

Số ngày tăng (645) không khác biệt lắm so với số ngày giảm (665).

Thêm cột ngày trong tuần

Thêm cột day cho 2 dataframe df và df_avg_price:

```
df['day'] = df['time'].dt.dayofweek
df_avg_price['day'] = df_avg_price['date'].dt.dayofweek
```


Xem dữ liệu của dataframe df:

```
df.head()
```

	symbol	time	price	volume	date	day	trade_value
0	VNM	2020-07-10 14:47:03	115.3	16660	2020-07-10	4	1920898.0
1	VNM	2020-07-10 14:30:03	115.4	1000	2020-07-10	4	115400.0
2	VNM	2020-07-10 14:30:01	115.4	450	2020-07-10	4	51930.0
3	VNM	2020-07-10 14:29:45	115.4	660	2020-07-10	4	76164.0
4	VNM	2020-07-10 14:29:35	115.4	200	2020-07-10	4	23080.0

Xem dữ liệu của dataframe df_avg_price:

```
df_avg_price.head()
```

	date	volume	trade_value	avg_price	delta	pn	day
1317	2020-07-10	677180	78415689.0	115.797408	-0.288447	-1	4
1316	2020-07-09	1560410	181141529.0	116.085855	0.351156	1	3
1315	2020-07-08	551310	63805697.0	115.734699	-0.705158	-1	2
1314	2020-07-07	1024960	119346196.0	116.439857	1.104045	1	1
1313	2020-07-06	1319980	152240966.0	115.335813	1.370475	1	0

Đếm số lượng các thứ trong tuần

Sử dụng hàm `crosstab()`:

```
pd.crosstab(index=df['day'], columns='count')
```

col_0	count
day	
0	134510
1	138445
2	135880
3	128702
4	136951

Tra lịch ngày 10/7/2020 là thứ Sáu, thuộc tính `dayofweek` của cột `date` cho giá trị là 4 (cột `day`)

July 2020						
Su	Mo	Tu	We	Th	Fr	Sa
28	29	30	1	2	3	4
5	6	7	8	9	10	11

Hàm `crosstab(...)` ở trên cho thấy thứ trong tuần được đánh số từ 0 tới 4 tương ứng với Thứ Hai đến Thứ Sáu.

Thống kê số ngày tăng/giảm/không đổi theo thứ trong tuần

```
df_day_pn = pd.crosstab(df_avg_price['day'], df_avg_price['pn'])
df_day_pn
```

pn	-1	0	1
day			
0	138	2	118

1	137	3	120
2	121	1	143
3	126	1	140
4	143	1	124

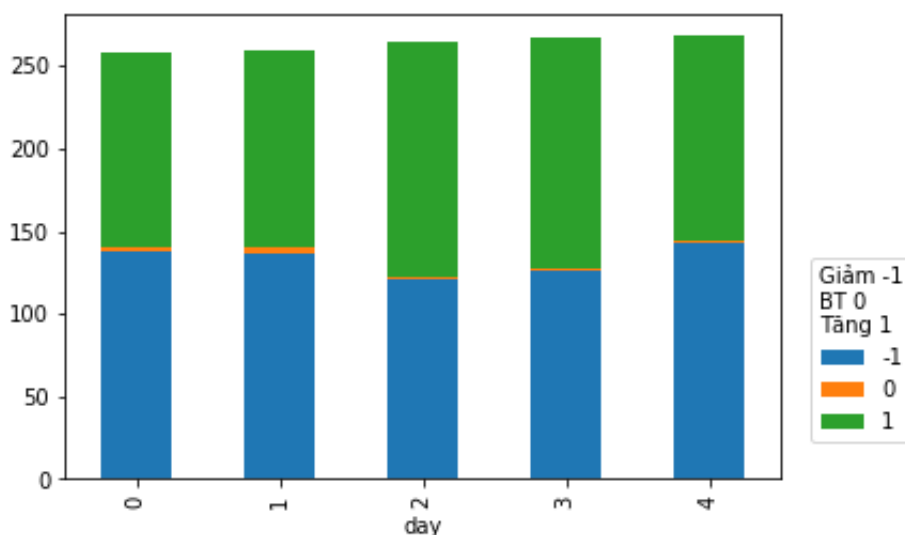
Kết quả cho thấy vài thông tin:

- Trong Thứ 2, số ngày giảm là 138, số ngày tăng là 118. Chú ý khái niệm Tăng/Giảm ở đây là so với ngày giao dịch trước đó (ở đây là Thứ Sáu tuần trước).
- Trong Thứ 3, số ngày giảm là 137, số ngày tăng là 120.
- Trong Thứ 4, số ngày giảm là 121, **số ngày tăng là 143**.
- Trong Thứ 5, số ngày giảm là 126, số ngày tăng là 140.
- Trong Thứ 6, **số ngày giảm là 143**, số ngày tăng là 124.

Theo số liệu thì Thứ 4 và Thứ 6 có vẻ ngược nhau. Thứ 4 thì tăng nhiều hơn so với giảm. Thứ 6 thì giảm nhiều hơn là tăng.

Vẽ biểu đồ

```
import matplotlib.pyplot as plt
df_day_pn.plot.bar(stacked=True)
plt.legend(title='Giảm -1\nBT 0\nTăng 1', bbox_to_anchor=(1.2, 0.5))
plt.show()
```



Câu hỏi đặt ra ở đây là số ngày tăng hoặc giảm trong một thứ nào đó có ý nghĩa thống kê hay không?

Ví dụ nhìn biểu đồ thì có vẻ ngày thứ 4 là tỉ số Tăng/Giảm nhiều nhất.

Xem lại dữ liệu ngày Thứ 4 (cột `day = 2`)

df_day_pn

pn	-1	0	1
day			
0	138	2	118
1	137	3	120
2	121	1	143
3	126	1	140
4	143	1	124

Trong bộ dữ liệu có $121 + 1 + 143 = 265$ ngày thứ Tư. Trong đó có 121 ngày giảm (chiếm $121/265 = 45.66\%$) và 143 ngày tăng, chiếm $143/265 = 53.96\%$

Thử tính chỉ số ztest và p-value (Xem lại kiến thức [Ngày 3, Bài 14: So sánh 2 tỉ lệ](#))

```
import numpy as np
from statsmodels.stats.proportion import proportions_ztest

# Count là số ngày tăng và số ngày giảm trong thứ 4
count = np.array([143, 121])
nobs = np.array([265, 265])
zstat, pval = proportions_ztest(count, nobs)
print('Tỉ số ztest:', zstat)
print('Trị số p:', pval)
```

```
Tỉ số ztest: 1.9112514762620285
Trị số p: 0.05597227155191926
```

Chỉ số ztest là 1.9, **gần 2 lần**. Chúng ta có thể có sự khác biệt giữa số ngày tăng và số ngày giảm của cổ phiếu VNM trong Thứ 4. Đồng thời trị số $p = 0.056$, hơi lớn hơn 0.05. Về lý thuyết diễn giải theo trị số p là không có ý nghĩa thống kê.

Tuy nhiên, giá trị ztest và trị số p đang rất sát ngưỡng “có ý nghĩa thống kê”. Kết quả này rất đáng xem xét giả thuyết: **Vào ngày thứ 4 thì cổ phiếu VNM thường là tăng**. Nhìn vào biểu đồ sẽ suy đoán là ngày Thứ 5 đa số sẽ tăng. Sau đó đến ngày Thứ 6 thì đa số sẽ giảm.

Phản kiểm chứng giả thuyết trên thì nhường lại cho các chuyên gia về cổ phiếu nhé!

Nhìn bảng số liệu theo %

Thống kê theo % bằng cách sử dụng hàm `pd.crosstab(...)` với tham số `normalize`:

```
df_day_pn_percentage = pd.crosstab(df_avg_price['day'],
df_avg_price['pn'], normalize='index').round(4)*100
print('%Tăng/Giảm theo thứ:\n', df_day_pn_percentage)
```

%Tăng/Giảm theo thứ:			
pn	-1	0	1
day			
0	53.49	0.78	45.74
1	52.69	1.15	46.15
2	45.66	0.38	53.96
3	47.19	0.37	52.43
4	53.36	0.37	46.27