

深蓝超算每日证券分析简报

刊：0155 期
日期：20170421
作者：深蓝
采集数据截至：2017/04/21

About this Report

深蓝超算每日证券分析简报（原完整报告已大幅简化）以个人自主开发的模型对各主体金融市场进行研究，目前研究对象暂时局限于中国 A 股市场。因为采用纯量化模型，所有分析内容不包含对消息及事件的影响，坚持所有信息已包含于数据之内的基本假设。另外，笔者所采用分析模型及框架均坚持操作导向型，而非纯学术模型，通过大数据方式及内部模型，笔者试图寻找有助于提高投资成功率的数据模式，并不断优化，以开发一套有助于大幅提高投资收益的算法交易系统。

笔者出于交流学习的目的，今日起将以研究报告的形式 逐日推出针对 A 股市场的算法分析结果，并根据数据分析结果提出投资建议，为投资者股票投资提供有价值的参考。笔者不对所提供内容负任何责任，所公布内容仅供参考，据此投资，后果自负！

声明

深蓝超算不以盈利为目的；
深蓝超算提供全部内容均由个人完成；
深蓝超算不对所撰写投资内容负任何责任，据此投资后果自负；
深蓝超算只进行纯量化研究，不考虑任何消息因素，请注意风险；
深蓝超算研究范围仍在扩大中，目前研究报告内容只涵盖中国 A 股市场；
深蓝超算所有内部算法、程序均保密，请勿向笔者索取。

联系我（请注明“深蓝超算”字样）

e-mail : 504936733@qq.com
Telephone : 13870916570
深蓝超算对外站点：
<https://xueqiu.com/6869744147>
<http://t.qq.com/willli6am>
<http://weibo.com/u/6012225612/home>

Weichat :



每日数据简析：

和昨日预测保持一致，新版本分析预测系统已经连续发出强下行趋势的基本判断，目前不宜建仓，买点也较差，操作主要以防御为主，不可过于激进。当前模块尚未整理完毕，剩下分析报告自动生成程序尚未完成编写，相关内容较复杂，最晚下月初上线新版本简报。但是，在此之前，深蓝超算也会在简报中提供塞得塔系统分析预测模块的分析结果。

系统：

从基于 TCGS3.2.1 临时调整版本系统（暂未进一步调试）的分析可以看到，当前情绪追踪指数修复再次劣化，指数惯性下跌趋势明显，多头控制区或许持续时间比预想更短，深蓝超算强烈建议投资者尽早清仓。

基于 IEA1.0 系统，深蓝超算观察多空能量指标，发现该指标强呈现继续修复的基本走势，但当前速度线再次下降也印证了之前深蓝超算所说的等待短期速度均线修复的基本观点。指数尚未发泄完毕，下周随时都有可能再次快速回撤，投资者应该做好对应准备。而仔细分析细节可以看到，如指数维持当前速度下降，指数将很快再次回到空头能量占优区域，建议维持尽可能轻的仓位。或者，有能力的投资者也可以采用类似深蓝超算棘轮策略的主动防御操作模式，以低于指数快速回撤。

主线：

根据今日数据，深蓝超算注意到，今日榜单差异不大，除了超级品牌一类白马股有所表现，以及共享经济热点继续偶发性强势之外，大量前期强势概念都处于逐步强度衰减的过程中。然而，这种衰减是与指数回撤同步进行的，投资者可以考虑这部分强势概念的持续关注，注意底部支撑是否能够抄底。

操作：

最后，操作观点维持，即“交易维持仓位，等待冲高机会撤出资金；再者是暂时不去抄底，等待下周盘面变化”。关注重点板块仍应维持“一带一路”及“雄安新区”，但出于下月初峰会召开的考虑，建议优先考虑“一带一路”概念个股。近期尽可能减少操作，安全位置应看低至年线！

接下来，报告一下塞得塔系统分析结果，系统预测次日点位为 3173.26，判断强下行趋向，点位误差区间为[3173.2626, 3177.4925]，不推荐买入，维持清仓观点，预测趋势反转时间大于 3.46 天。即使下周指数冲高，投资者也不应该过于乐观，还是那句话：应以半年线作为评判标准，介于半年线、5 日均线压力渐重，深蓝超算十分怀疑指数能否成功站上。理想的选择仍应是指数返回年线做底，同时降低半年线高度，再行考虑冲上半年线压力。否则指数上方层层压力仍有可能打压指数进攻势头，近期操作不建议超过五成仓位，防御为主，不要去捕捉微小的上行趋势！不要去追涨！

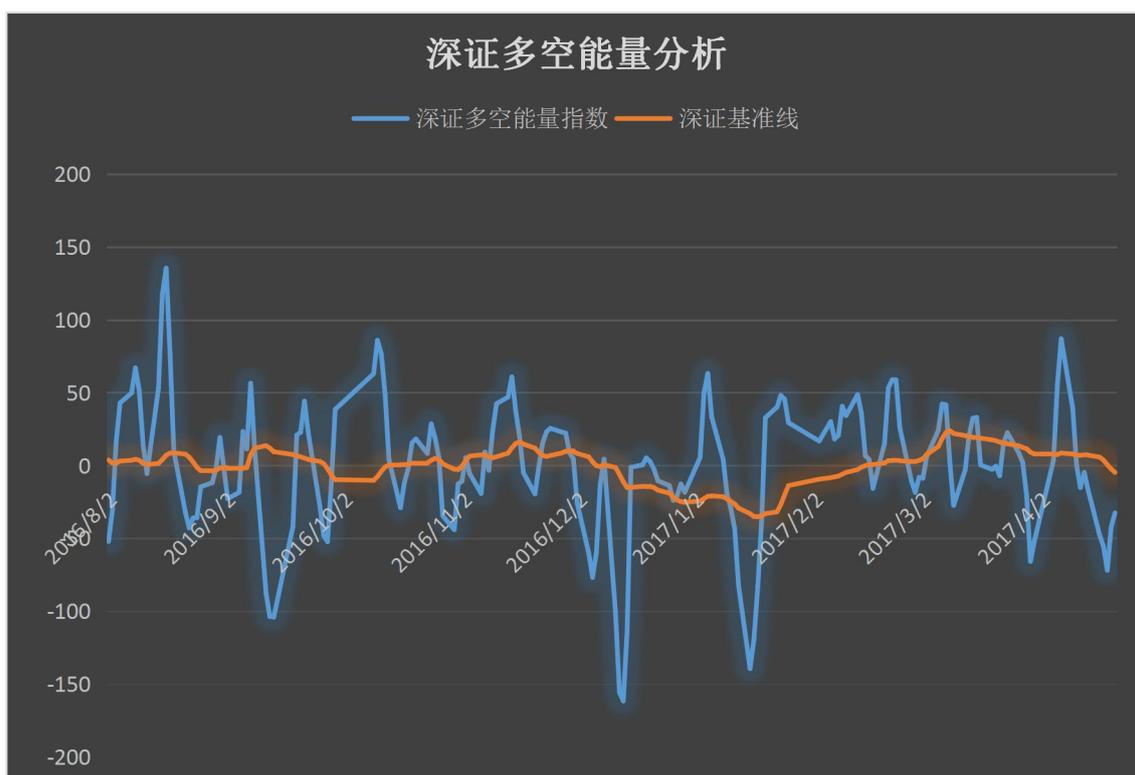
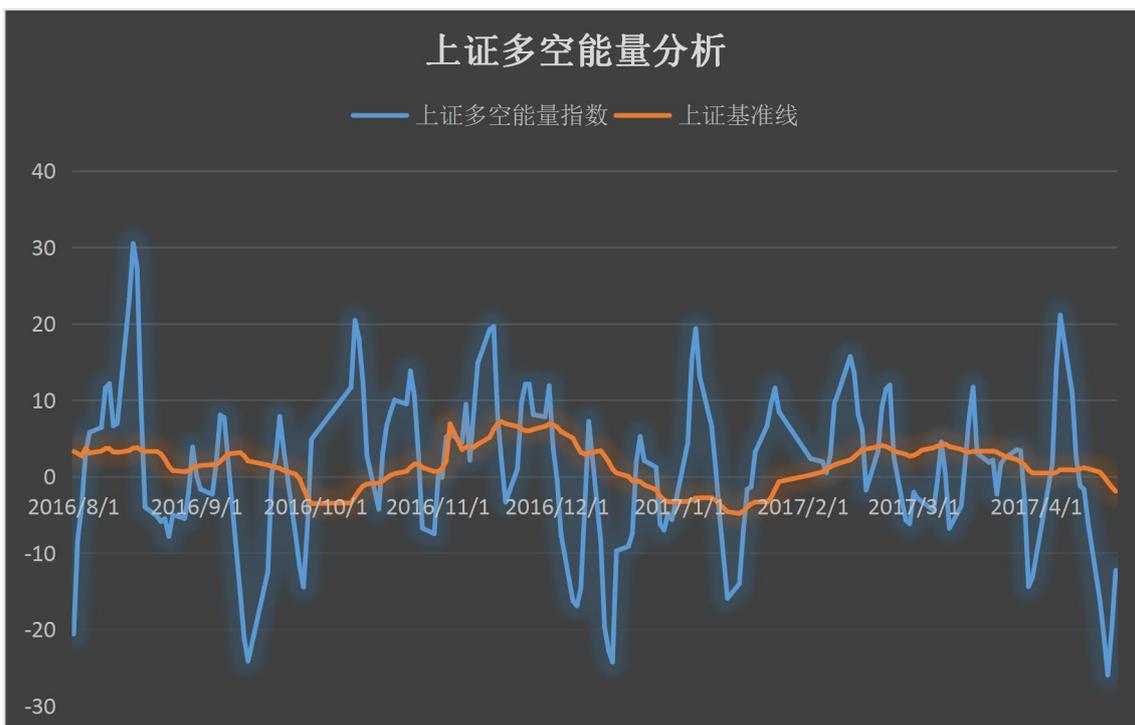
塞得塔分析预测模块主程序完成后，其他工作略有滞后，完整系统上线使用仍需时间，深蓝超算希望最终使该系统得以自动无干预运行，并自动向指定邮箱发送简报（以后，投资者可以向深蓝超算提供邮箱，由系统自动发送报告）。还是那句话，最迟，该系统第一模块将在下月初上线！敬请等待！

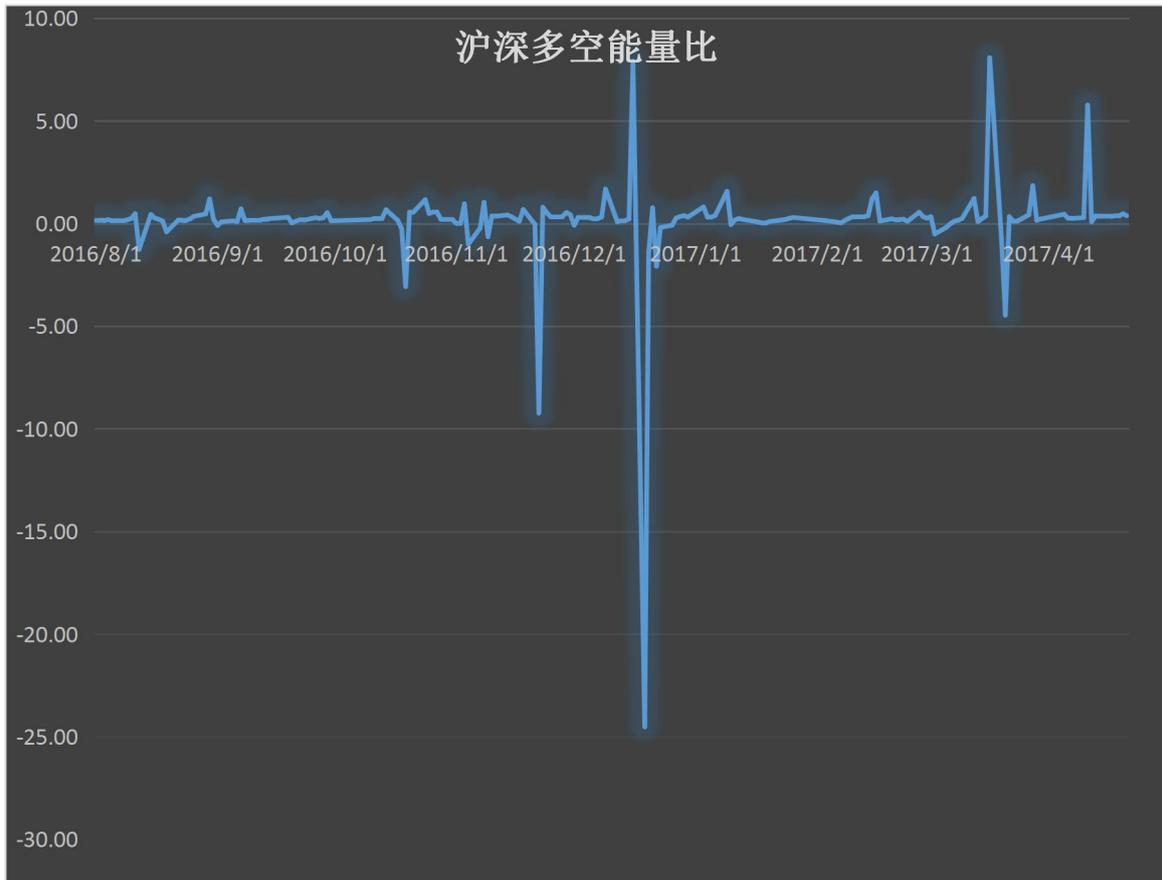
深蓝超算研究中心
2017/4/21

基于 TCGS 系统的预测及分析：

排序	板块	加权总评分	十日频次	二十日频次	Trending
1	大金融	6.27	1	3	新上榜
2	食品安全	4.02	1	1	新上榜
3	OLED	3.91	4	5	↑1
4	民营医院	3.81	4	5	↓1
5	虚拟现实	3.04	2	2	新上榜
6	央视 50_	2.50	2	3	新上榜
7	AB 股	2.43	1	1	新上榜
8	生命人寿	2.27	2	2	新上榜
9	油价相关	1.75	1	1	新上榜
10	参股保险	1.61	2	2	新上榜
市场情绪指数	37.12	情绪前值	65.86	反转时间	-0.25
基准值	44.26	基准前值	44.31	指数预测	3172.18
长期波动率	10.76	波动前值	10.78	预判正确率	40.00%
速度方向预测	看空	趋势方向预测	看多	次日方向预测	震荡

基于多空能量追踪指数的预测与分析:



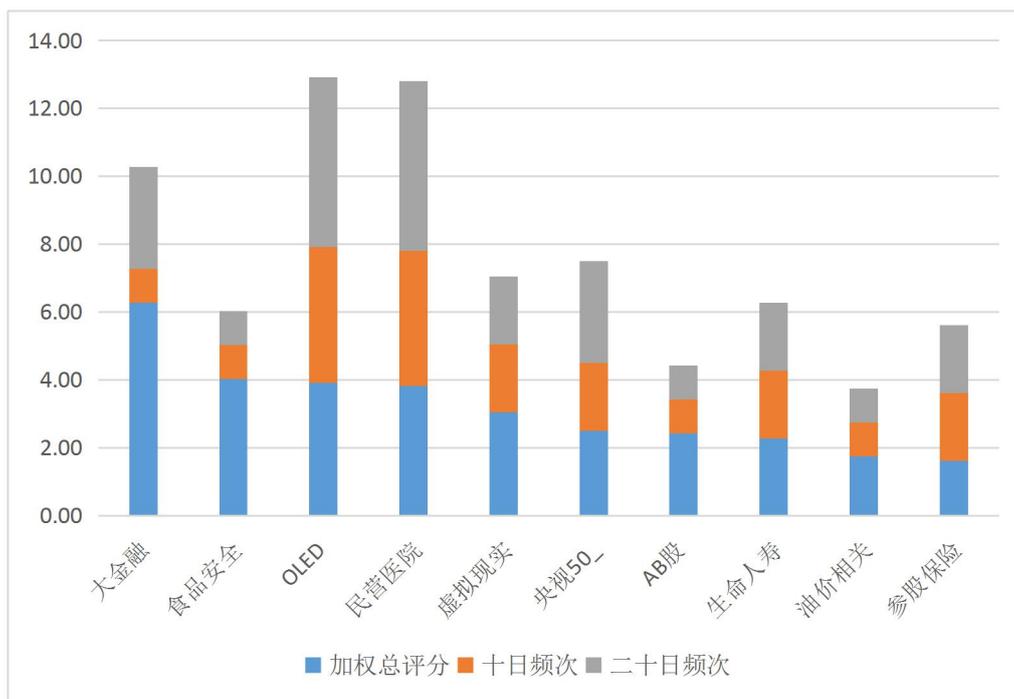


短期方向	修复	长期方向	偏空
短期理由	沪深能量线回撤区掉头，近似控制区顶点已出现，但不确定性依然较大	长期理由	基准线再次掉头
投资风格	逢高减仓	投资风格	成长价值+绩优标的

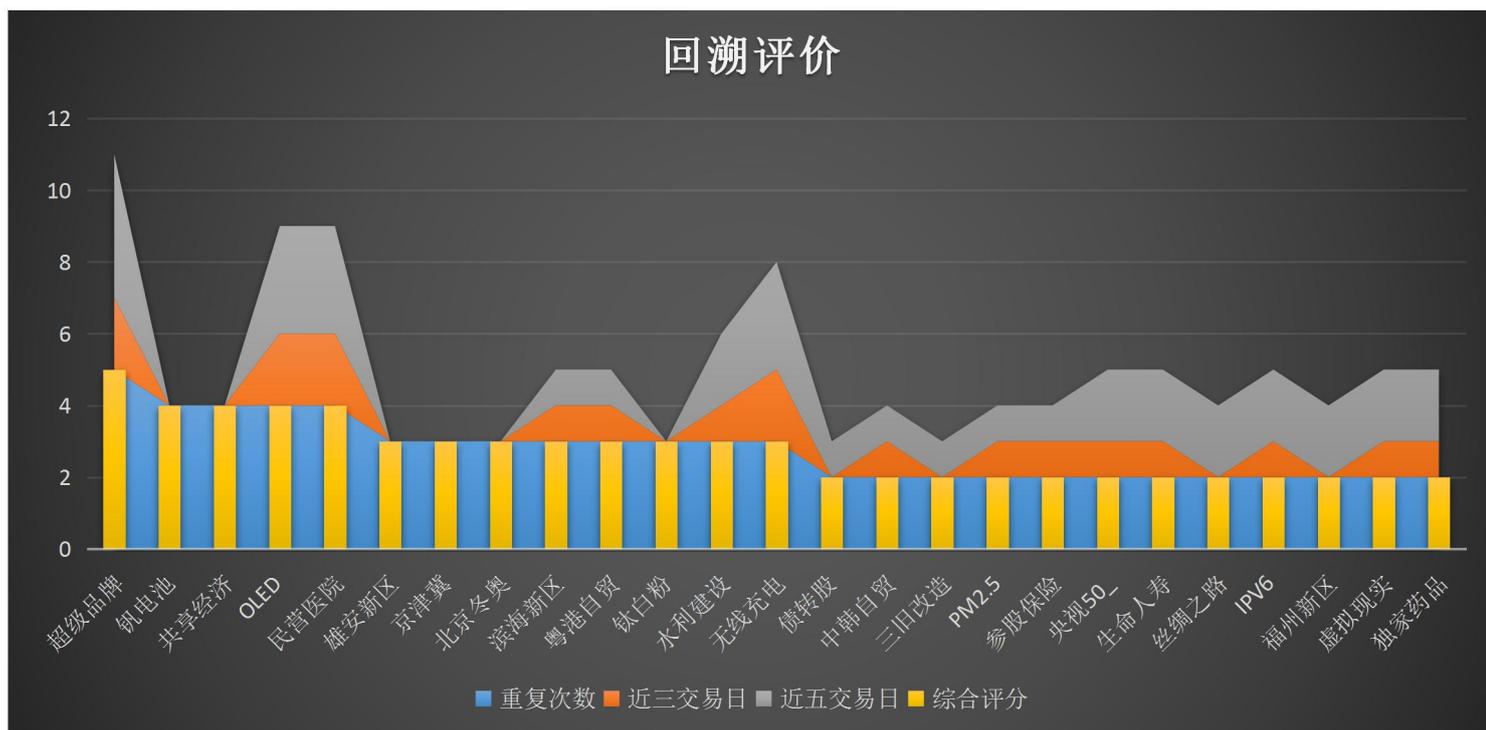
沪深对比	沪强深弱
	回归均值

沪深预测	深强沪弱
	偏离均值

板块评分构成图：

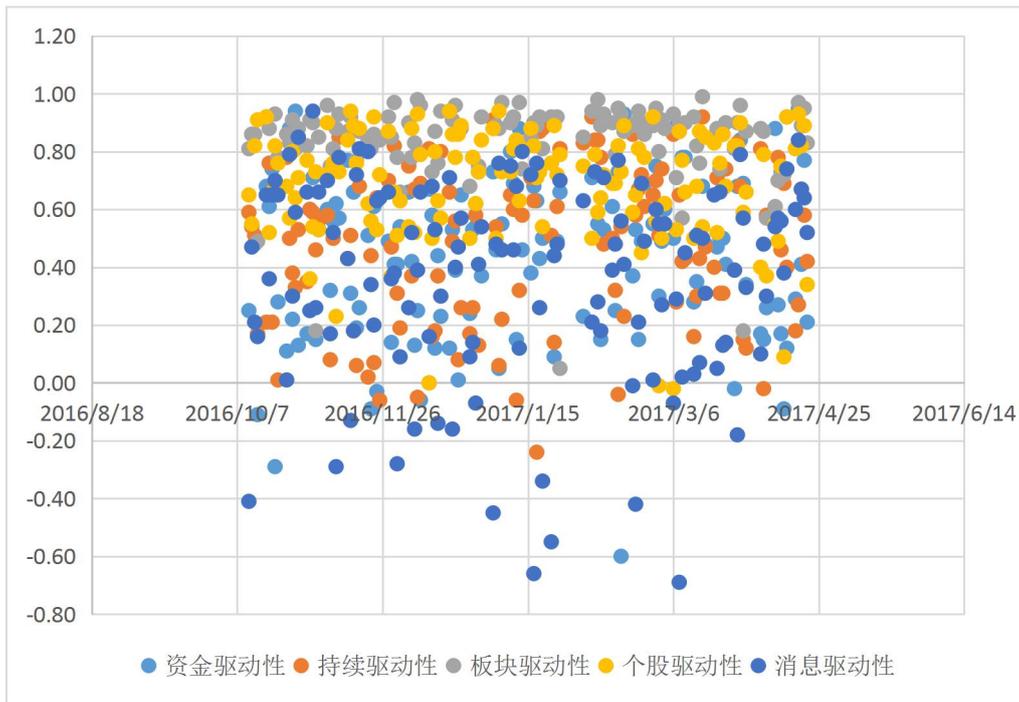


板块跨期统计（算法已简化）：

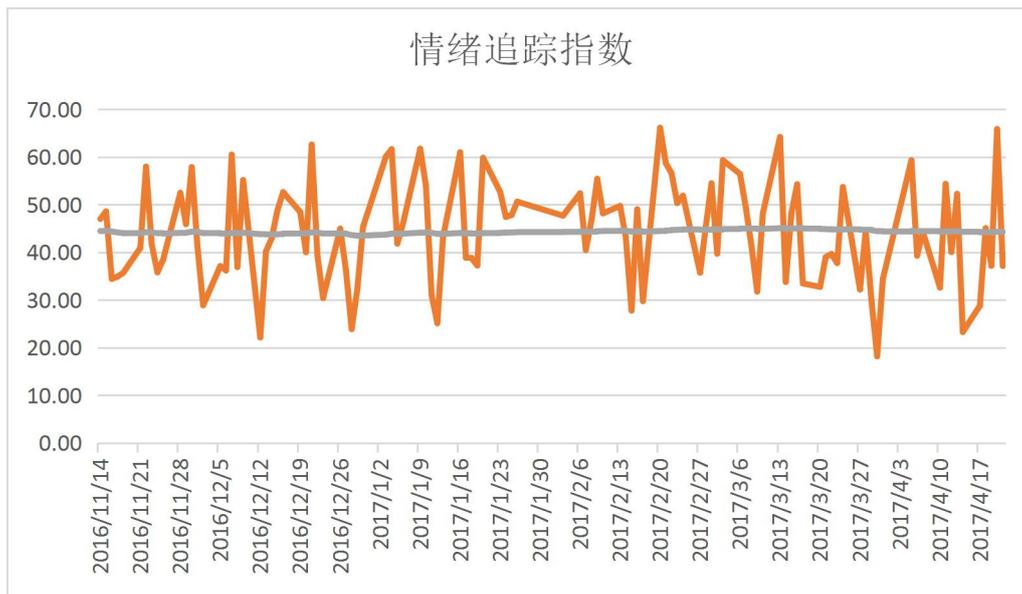


榜前概念	超级品牌	钒电池	共享经济	OLED	民营医院
榜后概念	独家药品	虚拟现实	福州新区	IPV6	丝绸之路
新增概念	参股保险	央视 50_	生命人寿	虚拟现实	
离榜概念	美丽中国	黄金概念	通用航空		
推荐概念	超级品牌	共享经济			

评分因子历史散点图:



情绪追踪指数:



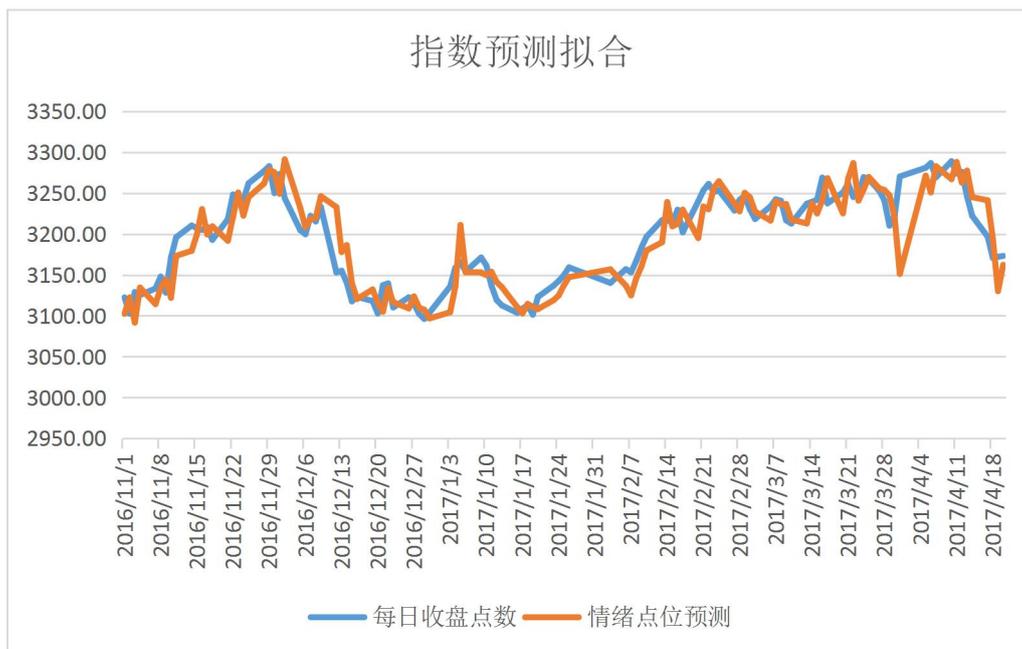
长期波动率分析：



历史反转预测对照数据：



指数预测拟合（逐日校正）：



操作点评：

时间	操作点评	风格定位	推荐仓位
2017/4/17	沪深能量线回撤区间加速依然较快，暂不确认何时达到极值，预计调整时间顺延一个交易日，观察三天！	维持仓位	<=60%
2017/4/18	沪深能量线回撤区间加速减缓，极值应在两个交易日内出现，调整时间暂定两天，继续观察、减仓	逢高减仓	<=40%
2017/4/19	沪深能量线回撤区间再次换挡加速，极值应顺延在两个交易日内出现，调整时间维持两天，继续观察、减仓	逢高减仓	<=20%
2017/4/20	沪深能量线回撤区间明显减速，空头顶点近似出现，极值应在明日出现，调整剩余一个交易日，暂停卖出	停止卖出	<=20%
2017/4/21	沪深能量线触底迹象已经出现，空头顶点近似出现，但均线尚未修复导致不确定性较大，防御为主，轻仓操作	逢高卖出	<=0%

持仓分析：当前月组合收益率：-13.70%

