

深蓝超算每日证券分析简报

Daily Security Analyzing Briefing from Deep Blue Super Computing System

深蓝超算研究中心出品
分析来源：赛德塔系统
内容编辑：深蓝超算

刊：256期

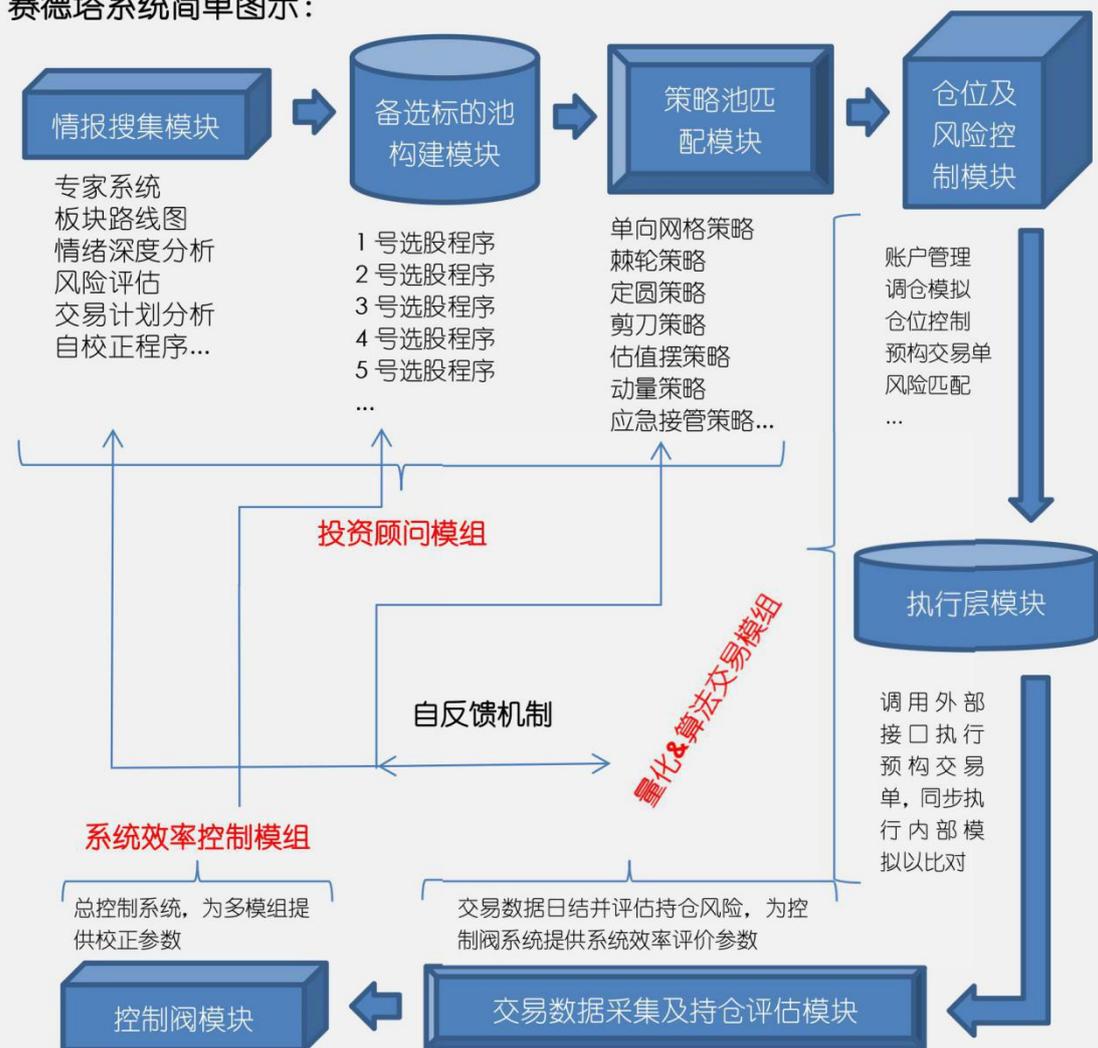
日期：2016/9/14

赛德塔系统 (SAIDATS, 自适应主动防御交易系统):

该系统由深蓝超算个人设计、开发并编写, 内含七个主模块, 分别为: 分析预测模块 (情报搜集模块)、备选标的池构建模块 (操作标的定位模块)、风格策略匹配模块 (策略池匹配模块, 内建7个主策略)、仓位及风险控制模块 (自匹配仓位及预构交易单程序)、执行层模块 (交易模块)、交易数据采集及持仓评估模块 (评估账户风险及潜在收益损失情况)、控制阀模块 (系统自主修正模块)。

该系统尚未完成开发, 本简报仅展示情报搜集模块输出内容, 所输出结果无人为因素干扰, 均由系统模块自主计算分析得出, 本简报属于赛德塔系统临时展示媒介, 当前赛德塔系统开发版本为 1.1.4.20160616_base。

赛德塔系统简单图示:



1.1.4.20160616_base

声明:

- 1、深蓝超算为赛德塔系统唯一开发者, 系统仍处于开发编写阶段, 简报仅为投顾模组部分自动输出内容展示途径, 所展示内容均仅供参考, 据此投资, 请自负风险;
- 2、《简报》发布不以盈利为目的, 所有内容免费提供, 内部算法、程序均严格保密, 请勿索取;
- 3、赛德塔系统仅进行纯量化分析, 不考虑无法量化的各种因素, 系统属模块化设计, 已留有向证券市场之外扩充途径, 正式上线时间未知。

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/DBS_C_ResearchCentre

QQ: 504936733

Weichat:



欢迎留言或联系深蓝超算
交流学习!

目录

简报解读.....	2
情绪指数构造及数据展示.....	3
多空能量追踪指数展示.....	5
塞得塔专家系统分析.....	6
板块路线图定位结果.....	6
板块路线图延伸分析.....	7
情绪指数深度分析.....	7
赛德塔分析预测自动校准系统.....	8
未展示数据集中图示.....	9
备选标的池展示.....	10
当日备选池补充更新.....	10

简报解读：

昨天说到，根据目前各项指标所指示的多头发展速度计算，目前冲高失败的可能性正在增加，或者根据今日更新数据的分析结果：再次冲高的时间点至少正在向后推移。为什么目前还不能确认本次冲高将失败呢？因为根据近期的中长周期预测结果，塞得塔系统明显看多周级别及月级别的持续指数走高。也就是说，为了保证后面周线收阳和月线收阳，目前大盘正在围绕 3340-3350 构造的宽幅震荡平台是一定无法长时间维持的。而基于该平台目前强大支撑效果，深蓝超算认为该平台要被破坏至少需要比现在卖盘还要强大一到两倍能量。

那么，为什么当日塞得塔系统会认为冲高将被延后呢？首先，目前的问题需要正视，那就是大盘的进攻能量依然显著不足。而根据今日指数跌、情绪指数涨的事实看，深蓝超算从个人持仓盈利大涨就能发现，当日场内题材股活跃度依然异常强大，这就造成权重拖累指数但并不影响中小创题材发挥，这也是塞得塔系统近期主线定位全部向中小创前移的原因。在当前走势下，中小创将差异与主板，成为资金的避险之处，而不是拖累指数的“罪魁祸首”！当然，这里有个前提需要注意一下，要说创业板将就此一帆风顺确实不太现实，接近年底的几个月中创业板第一大股“乐视网”将复牌，创业板遭到打压难以避免，投资者做多一轮获利后应当做一段时间的休整，探明情况再动手！

另外，今日塞得塔系统在有校准结果的情况下降低买入评级至 6 星，而校准程序也作出提示，认为近日（应在 2 个交易日之内）应该会出现一次下探过程，这一点也与情绪指数再次进入空头增压区相互匹配。如以往经验规律，情绪指数进入空头增压区之后两个交易日一定会出现指数回调。深蓝超算只能说刚抵达 45 空头增压区极浅位置的情绪指数应尽快诱发指数回调，明日能做一次调整再好不过。如此说，并非全无根据，观察今日 IEA 指数可以发现，IEA 指数在昨日穿越空翻多节点之后再次出现空头能量集中释放导致指数掉头的情况，这就在短时诱发 IEA 指数重回空头能量控制区，这在未来几个交易日必将影响情绪指数的走低。然而，深蓝超算关心的并不是现在，而是未来。根据塞得塔系统情绪指数匹配程序的预测结果，近期的动荡局面将难以避免地持续下去，而就 IEA 指数速度均衡线的拉平波动情况看，即使 IEA 指数回到空头能量控盘区间，要想长时间维持的可能性也极小。所以，从理论上来说，塞得塔系统校准程序给出的逢低抄底建议并没有问题，而对于已经像深蓝超算一样持仓获得盈利的投资者，近期可选择暂时出局，也可以选择承受一定利润缩水，等待情况好准。但到底做何选择，深蓝超算认为个人仓位水平很重要，所持有标的在压力出现时做何表现也非常重要。再简单一点说，标的的表现至少不能弱于所属板块的平均水平。

谈到板块，当日塞得塔系统路线图子程序定位在死盯创业板不放的同时，昨日所提示的高送转、人工智能、区块链和国产芯片仍在高密度关注中，除此之外，包括石墨烯、稀缺资源之类的标的依然在主线路定位范围内。所以，在死盯创业板的同时，深蓝超算也建议投资者关注一下今日领跌的资源股，在指数再次反攻的时候，这些标的的带头反攻可能性非常高。

最后谈一下操作，如深蓝超算在前面所说的，到明日，本周最后一个交易日如果不发生调整，则这里所预判的调整应发生于下周初。除非，明日大盘放量大涨，顺势改变今日 IEA 指数的局部位置。没错，作为一个鉴别盘面阶段的重要指标，IEA 指数的多空能量水平是累积值，即使当日出现小幅多翻空的情况，只要次日的多头买盘足够强劲，该指数的反映情况可以在次日得到纠正。但这里的前提是，明日要想改变大盘所处阶段必须由异常强大的买盘带来。而就当日分析结果，这种情况发生的可能性微乎其微。所以，深蓝超算认为现在仅需要考虑空头能量控盘区的持续时间即可。由于目前是拉锯格局，深蓝超算预期该情况不会超过 3 个交易日，这一点与上面“调整终于下周初”的预判应该是保持一致的。如此，视自身情况，深蓝超算建议投资者对个人持仓做小幅调整，在大盘震荡平台不被破坏的情况下继续看多。

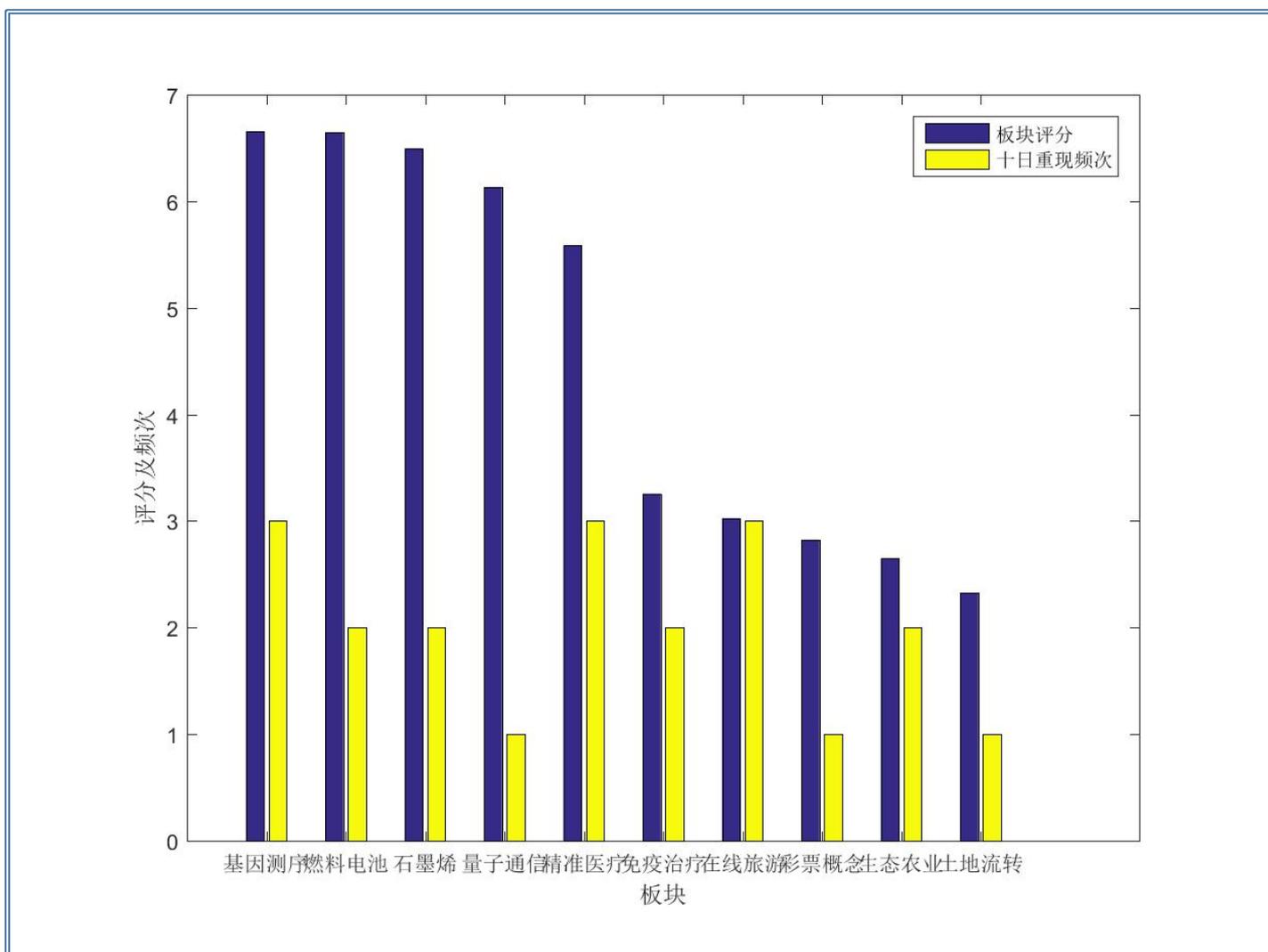
深蓝超算近期重点都在塞得塔系统完整数据库系统的设计中，介于数据的时滞及爬虫限制问题，目前建立与塞得塔系统连接在一起的数据库非常重要。在进一步的分析及操作程序设计之前，完成新的数据更新机制是深蓝超算当前工作的重中之重。而在此之前，如深蓝超算说过的，近期简报的表现形式将做一次修改，具体更改时间暂时未定。

今日简报就到这里，近期投资者要格外注意大盘平台支撑强度问题，祝各位好运！

情绪指数构造及数据展示:

当日分析板块及排位信息（该流程已实现自动化）：

排位	当日分析板块重排	当日板块自动评分	十日统计频次	较昨日变动
1	基因测序	6.6571	3	重现
2	燃料电池	6.6460	2	新进
3	石墨烯	6.4967	2	新进
4	量子通信	6.1335	1	新进
5	精准医疗	5.5845	3	新进
6	免疫治疗	3.2557	2	新进
7	在线旅游	3.0261	3	新进
8	彩票概念	2.8236	1	新进
9	生态农业	2.6506	2	重现
10	土地流转序	2.3253	1	新进

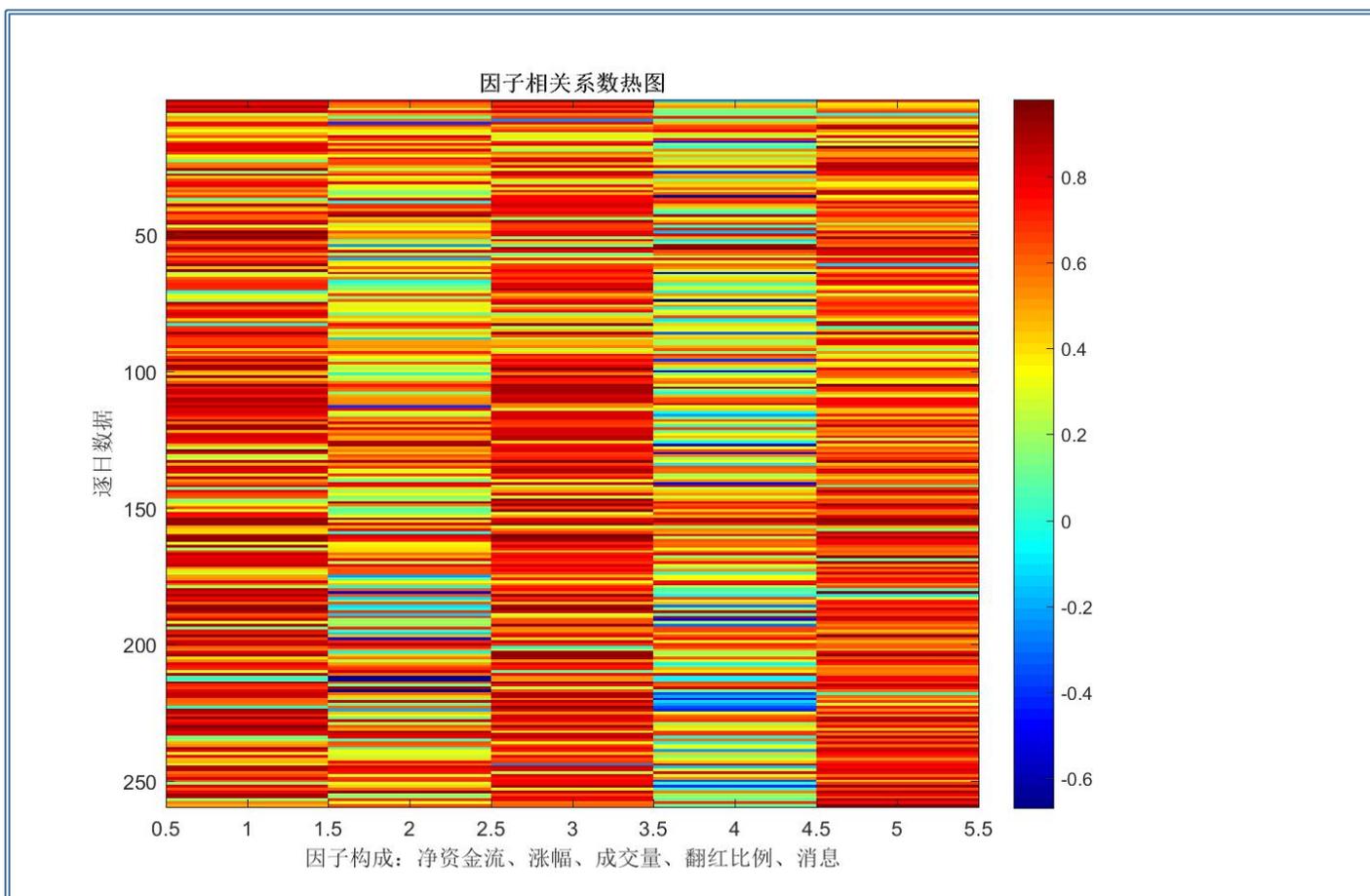
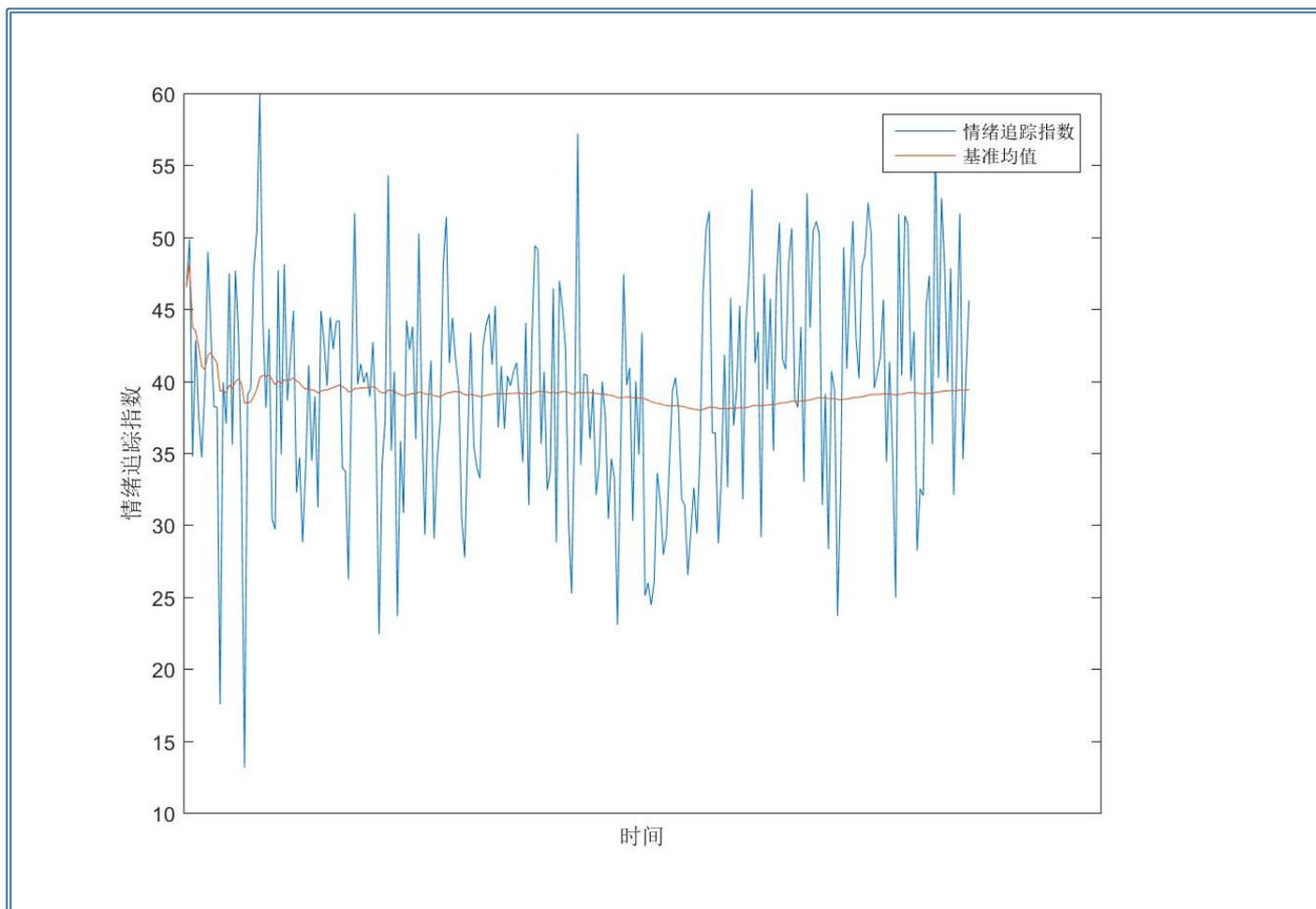


当日情绪指数：45.599；昨日情绪指数：40.4286

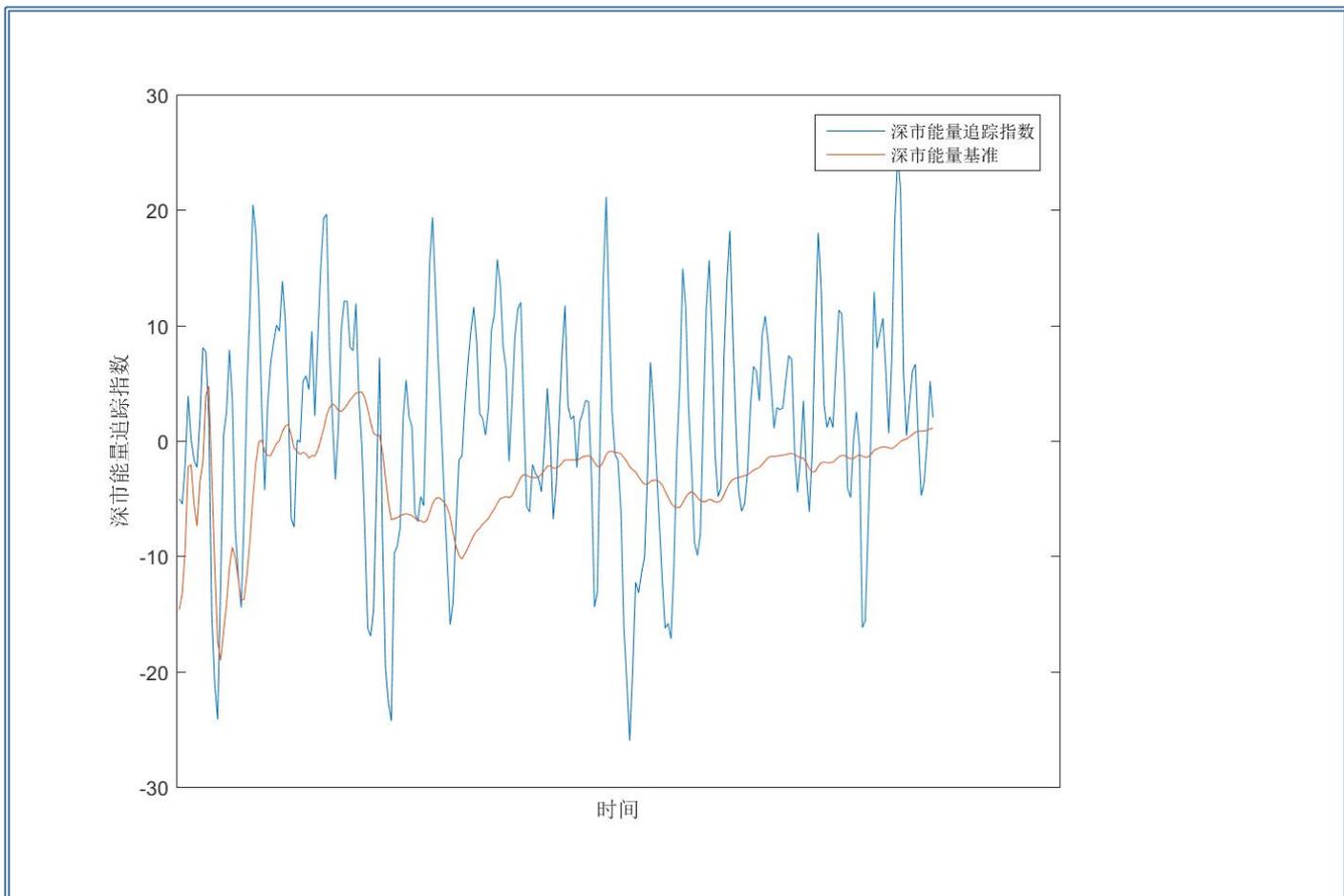
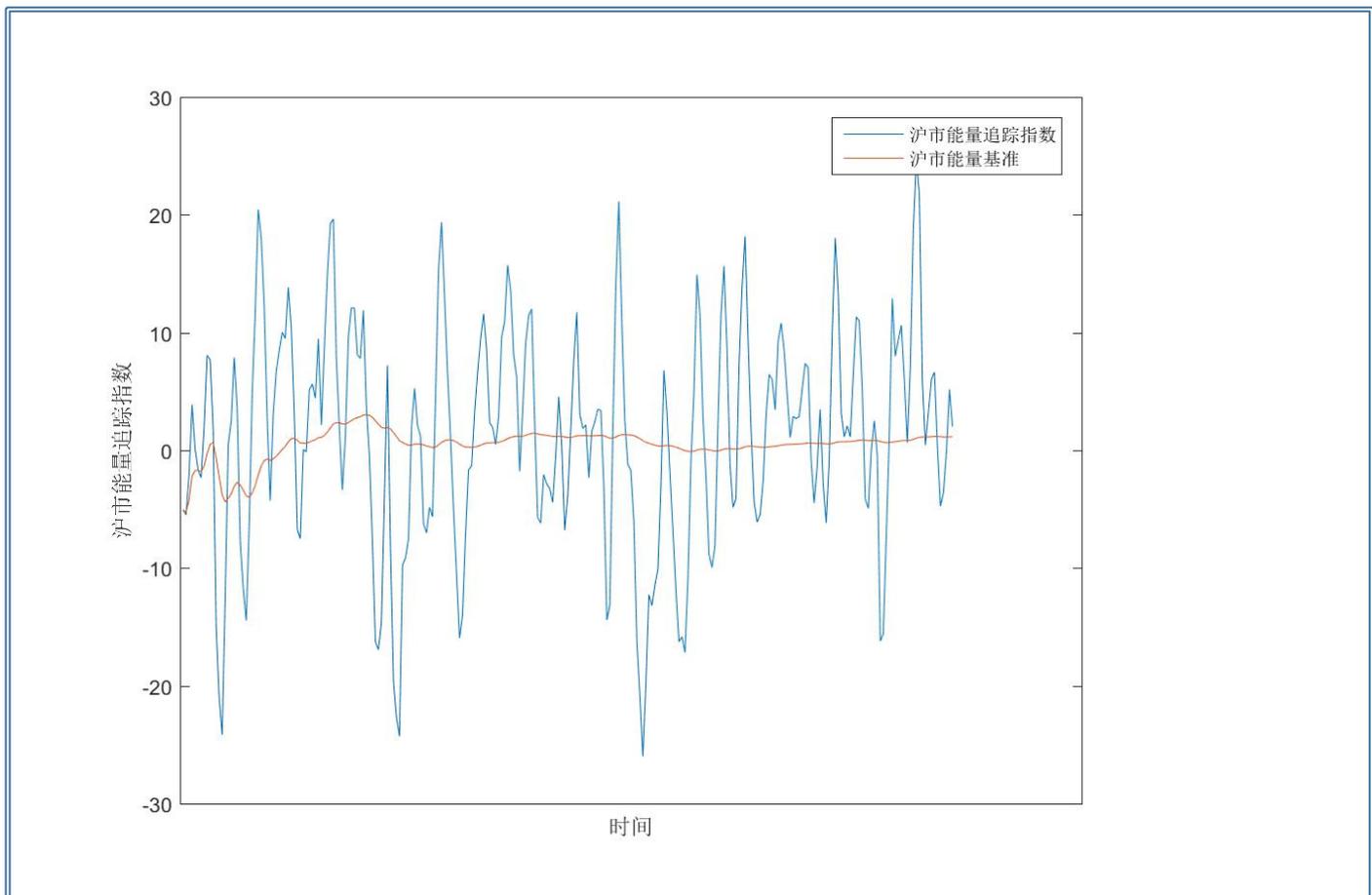
当日主力情绪指数：43.1544

当日散户情绪指数：45.593

主散情绪指数分析提示：买盘过于分散，情绪异常，注意风险



多空能量追踪指数展示:



塞得塔专家系统分析:

各专家分析结果:

方向预测: 上涨; 基于情绪回归的次日点位预测: 3373.5958
 方向预测: 震荡; 基于能量强度回归的次日点位预测: 3372.5725
 基于系统指标决策树的次日指数方向预测: 上涨
 基于 TCGS 短期均衡位置的指数倾向预测: 触底回升
 基于 IEA 系统的动量指数理论倾向预测: 下跌
 基于 IEA 系统预判次日沪深市场同步性: 同步
 基于 IEA 动能分析的理论趋势反转时间: 0.82682 天
 基于 IEA 匹配动能分析的理论次日点位: 3377.1614

专家投票及分析:

专家系统投票结果: 偏多震荡
 情绪回归分析: 盘面处于情绪惯性中; 操作建议: 惯性上涨, 适度追多。
 能量回归分析: 能量惯性无效; 操作建议: 优势买点。
 博弈决策分析: 决策树保持正常工作; 操作建议: 维持当前操作逻辑。
 相对趋势分析: 趋势正常; 操作建议: 适度加仓。
 动量匹配分析: 动量背离; 操作建议: 尽快卖出。
 买入评级: 6 星 (满星为 10 颗星, 低于 5 星不推荐开仓、加仓)
 系统推算次日收盘点位: 3377.1614
 系统点位预测误差区间: [3372.5725,3377.1614]

中长周期 IEA 决策分析系统结果:

周级别中长周期系统决策树预测: 上涨
 月级别大周期系统决策树预测: 上涨
 当前中短期盘面预判描述: 大周期上行趋势, 局部无调整可能, 维持惯性上涨;战略布局建议: 看多做多, 适度追高

板块路线图定位结果:

当日分析样本	历史匹配定位 (高符合样本)	路线图优先级及短期 (5) 预测
基因测序 燃料电池 石墨烯 量子通信 精准医疗 免疫治疗 在线旅游 彩票概念 生态农业 土地流转	无最佳匹配	次级路线图: 移动支付 石墨烯 智能电视 王亚伟系 蓝宝石 智能家居 氟化工 超级电容 人工智能

路线图板块是否匹配分析板块 弱匹配	路线图板块历史重现次数（5个交易日） 2
----------------------	-------------------------

板块路线图延伸分析：

定位近 5 个交易日定位概念板块并显示它们预测出现：

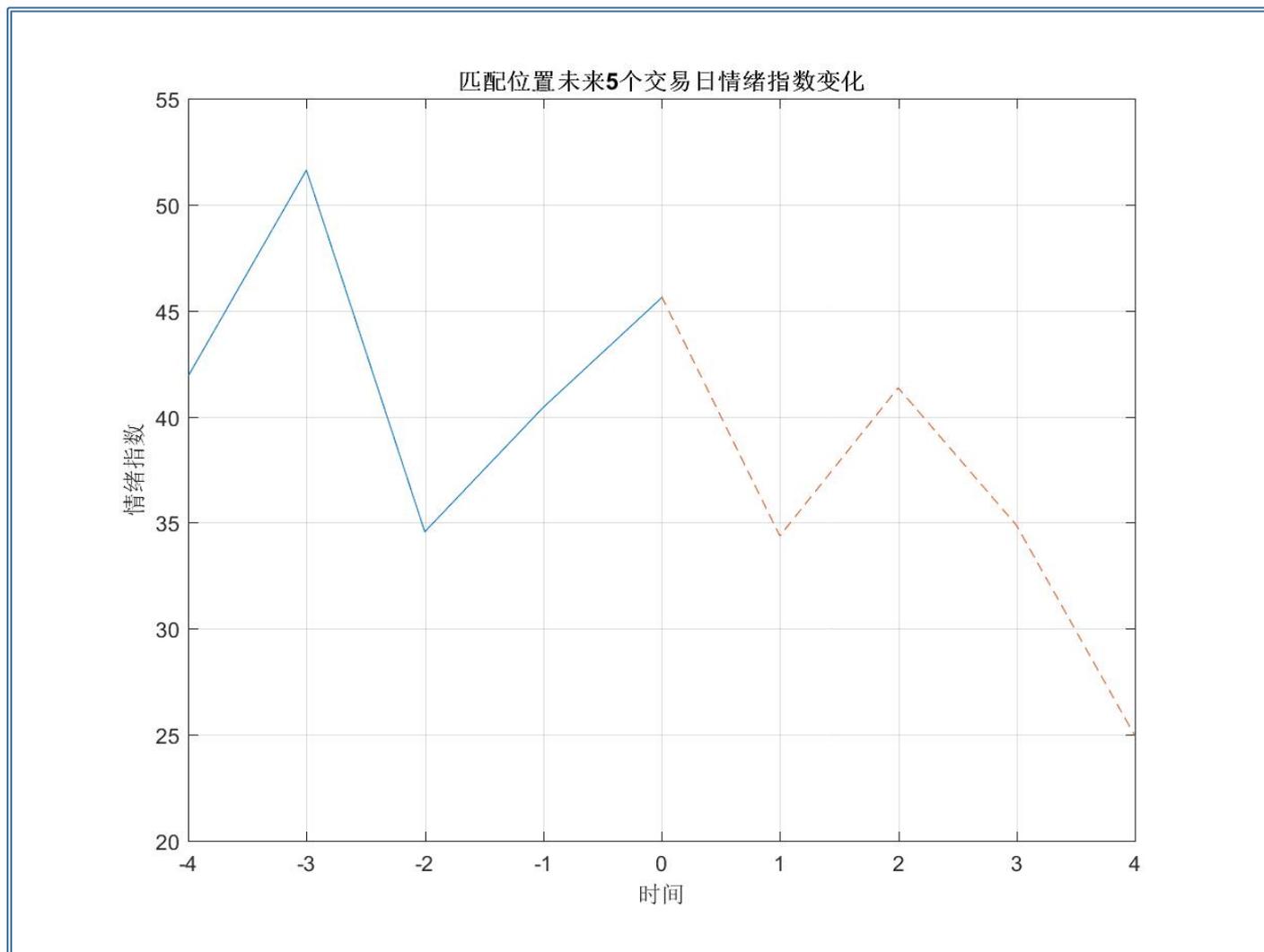
近 5 个交易日预测定位的概念板块	预测频次
稀缺资源	1
移动支付	1
锂电池	1
稀土永磁	1
CDM 项目	1
食品安全	1
石墨烯	1
北斗导航	1
特斯拉	1
智能电视	1
王亚伟系	1
蓝宝石	1
智能家居	1
氟化工	1
国产软件	1
超级电容	1
高送转	3
人工智能	2
养老金	1
区块链	2
国产芯片	2
生物识别	1

情绪指数深度分析（新增内容，使用类似于板块路线图程序类似的定位算法，根据历史数据寻找最类似情况进行分析、比对）：

情绪指数历史匹配定位及分析：

情绪指数定位结果：相对位置方向匹配
历史匹配位置 5 个交易日指数波幅：73.33
历史匹配位置 5 个交易日指数涨跌比例：-0.021626
历史匹配位置 5 个交易日指数波动率：30.5789
情绪指数是否处于增压区：处于空头增压区
参照点指数反转 2%所需时间：16 个交易日

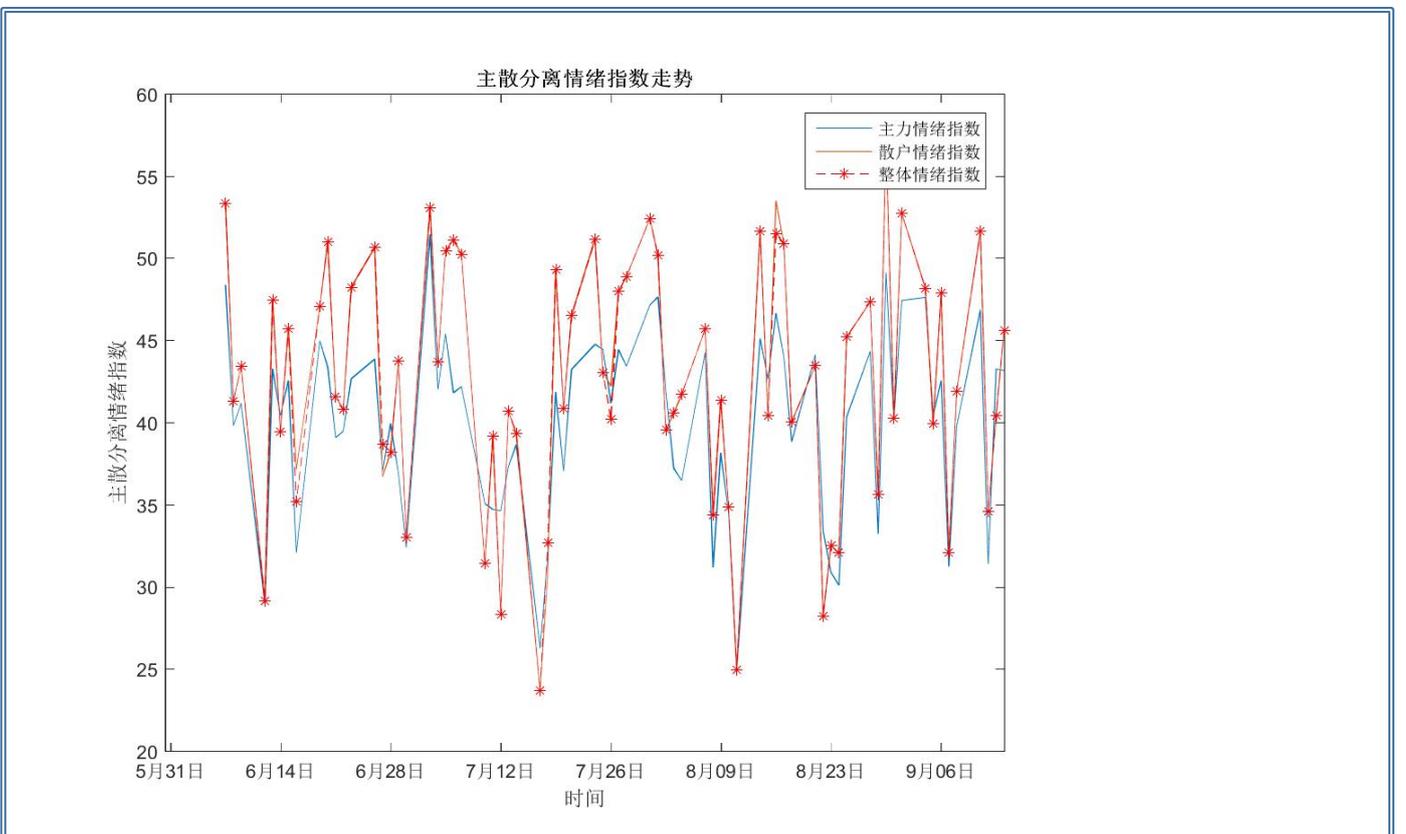
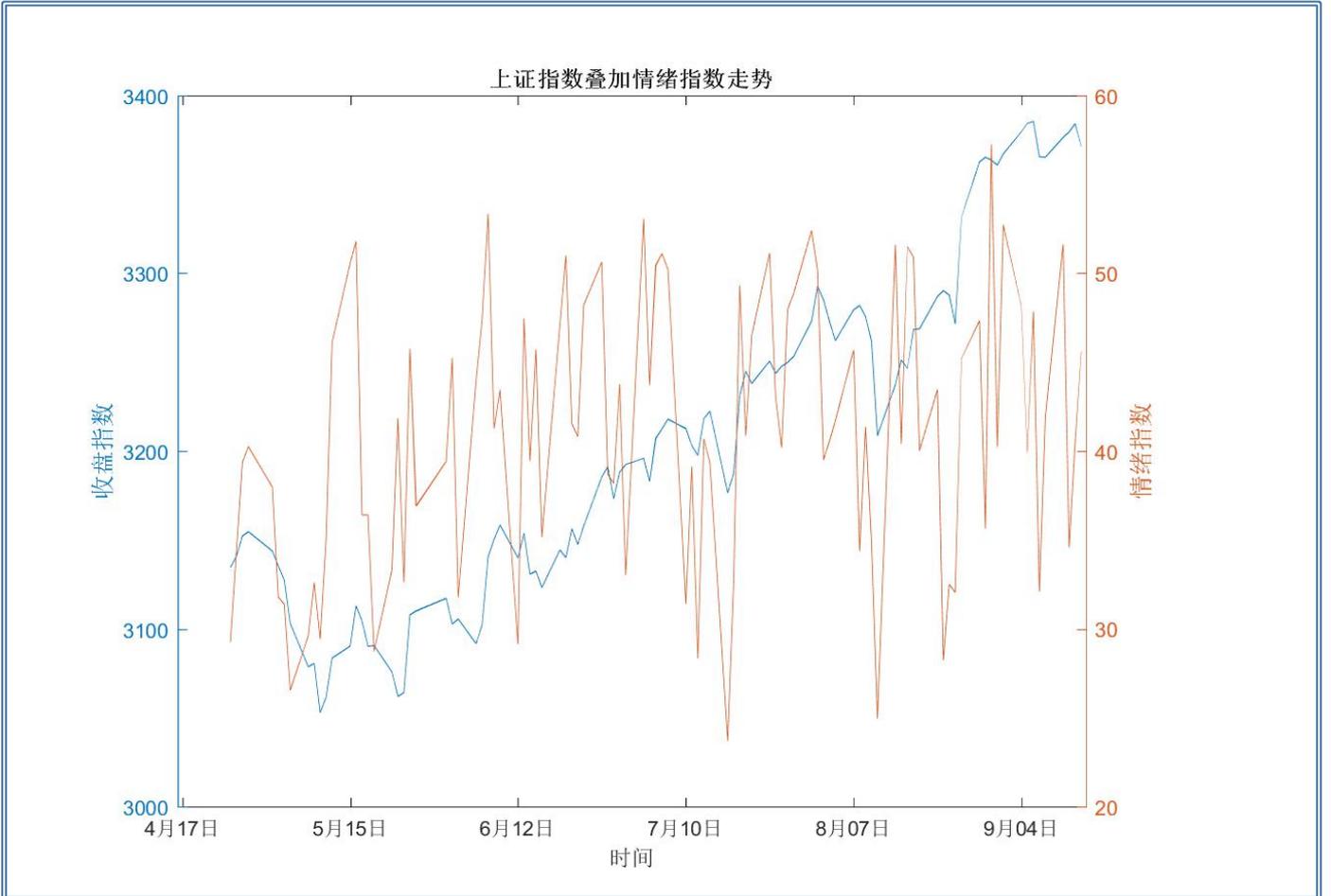
5个交易日内的情绪指数期望变化（实际近5个交易日情绪指数用实线标出）：



赛德塔分析预测自动校准系统：

专家系统自校准意见：专家系统需校准，大盘存在空头增压调整需要
操作建议校准：近日大盘有至少一次调整需要，大盘风险程度较小，不宜错过最佳反向布局时机，下探优先买入

未展示数据集中图示（相关数据展示将择机增加）：



备选标的池展示（完整标的池只在周五展示，其他时间请对照上周五标的池）：

当日备选池补充更新（注意！其中所有标的均由计算机自动筛选，无人工干扰）：

备选池类型	更新加入标的
底部类型	无
中继类型	百达精工、维格娜丝、昆仑万维、铁龙物流、世龙实业、拓尔思、康达尔、云南铜业、东方银星、青岛金王……
进攻类型	新黄浦、天能重工、中南建设、万科 A、海航创新、仟源医药、宁波海运、凯普生物、西藏药业、菲达环保……

*今日中继类型（15 个）和进攻类型（25 个）筛选标的的较多，将优选涨幅前十的标的展示，全部标的已假如当天展示备选池

*当日全标的展示如上周五，调整后的备选池已加入更新标的，部分池可能直接剔除当天加入标的。