

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：259期

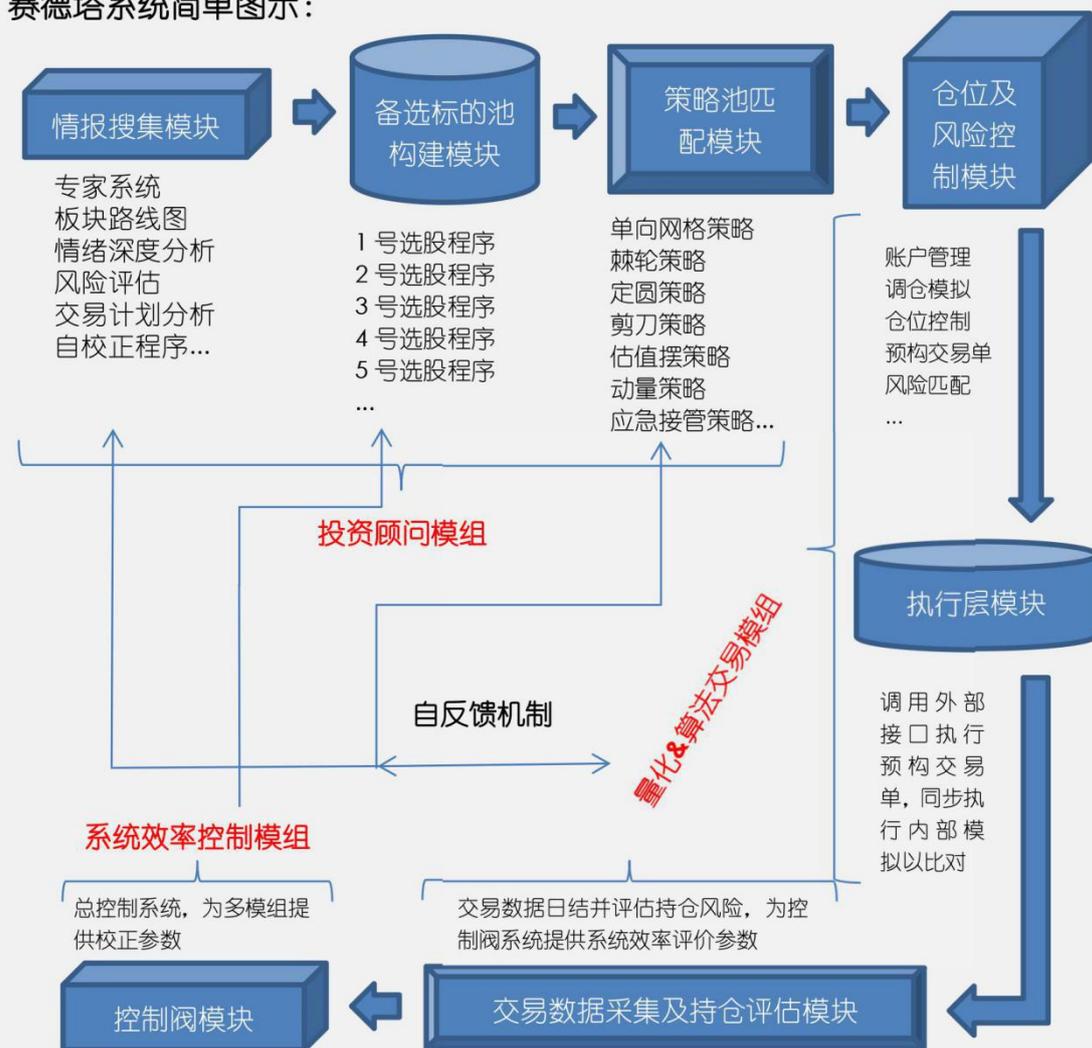
日期：2016/9/19

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:



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!

1.1.4.20160616_base

简报改版说明：

从 258 期开始，《简报》将作以下调整：

- 1、减少非必要塞得塔系统直输内容
- 2、扩充解读部分内容
- 3、保留备选池部分内容，并增加操作策略详解
- 4、将视情况对《简报》内容做进一步调整
- 5、保留塞得塔系统机器观点主导的传统，深蓝超算所有描述、预测、分析及建议均由机器结果自动分析结果展开，尽可能不参杂个人观点，有个人观点部分将特别标识
- 6、从本期开始，每期《简报》将增加核心观点提炼，该部分内容置于每一期最前面
- 7、由于未来《简报》所有内容将全部转化为塞得塔系统自动分析内容解读，从本期开始不再特别强调“解读”
- 8、由于从本期开始所有内容将转变为“解读”内容，本《简报》不再编制目录，但《简报》从本期开始也将严格限制篇幅，尽可能用最少的篇幅展示最多的内容，部分机输内容的展示形式将被保留，但它们将被穿插入解读内容中

核心观点提炼：

当前塞得塔系统对短期市场趋势判断为抵抗震荡，近日将出现偏多震荡或长阳突破走法。指数再次冲高时间窗口或已大幅迫近。目前专家系统在有修正的前提下以 60% 的概率看涨，中长周期预测维持看涨预测。板块主线定位锁定创业板及指数拉升型板块，注意埋伏低调型创业板题材标的，在 3350 平台不被确认跌穿之前，不建议随意出清手中筹码。

在昨天的简报中，塞得塔系统作出了比较具体地继续看调整判断，而情绪指数更是以极高的准确率匹配了今日的情绪指数波动，应该说今日盘中跌穿 3350 的走法是在系统预期之中的。在正式开始今日简报之前，深蓝超算希望做一个简单的说明。如昨日长篇幅的简报应该会比较少地出现，因为之前已经说过，深蓝超算在撰写的时候将注意篇幅的控制，毕竟深蓝超算设计开发塞得塔系统的目的就是简化股市投资，谁有空花太长时间来看深蓝超算写的简报呢？所以，深蓝超算在以后的简报中，如考虑无必要，将不会展示如上期所展示的全部系统输出图像，更多内容将以深蓝超算的描述展开。说到底，深蓝超算每天如果只需要几分钟来了解次日的走势和近期看点，实在是没有理由花十几分钟细讲。

闲话就不多说了，在今日简报开头，我们先明确一个问题：那就是今日的调整是良性的，因为昨天深蓝超算就说过类似的话，如果今日情绪指数随指数调整，回到多头增压区的话，那么已经处于空头能量控制区的 IEA 指数就可以在不回到多头能量控制区的情况下完成情绪指数与 IEA 指数进攻时间窗口的同步。这一点，在塞得塔自动分析体系中是非常关键的问题，因为只有两个关键指数趋于同步，才会有大涨或大跌的可能。在这里，深蓝超算管这种现象叫情绪能量同步自强化作用，即拿大涨为例，如果情绪指数低到了多头增压区足够诱发买盘动力的前提下，IEA 指数如果抵达了同步空头卖盘的衰竭点，那么无论是从哪一方面看，近期大笔资金进入及场内投资者买盘动能都会同步增强，这种消除阻碍的上涨将会存在较强的动能，且在短期内都存在自我增强的倾向。

需要注意的是，今日塞得塔系统专家系统中只有决策分析认可大盘将在次日反转，而即使大盘不再次日反转，仅有情绪指数处于过深的多头增压区也能知道，进一步调整深入将触发报复性反弹。所以，今日校准系统给出了下面的判断：

专家系统自校准意见：确定性弱，修正判断为抵抗状态震荡

操作建议校准：近日盘面偏多震荡格局或将出现长阳突破，震荡中可适当布局拉指数标的，看多做多

进一步，从今日输出的情绪指数数据可以看到，今日指数的压力是由主力和散户的同步卖盘增强导致的。而从历史数据匹配数据看，类似位置曾出现过 42 点左右的波动，从向上波动方向计算，目前突破 3400 压力正好差的也就只有 40 余点，该数据也佐证了近期波动应至少诱发一次向 3400 的冲高过程。尽管目前数据尚无法确认此次冲高是否成功（如成功，大盘将以长阳刺穿 3400，并收在 3400，留出一定空间），但此次冲高过程应得到投资者的特别注意，因为无论如何，类似空间的涨幅扩大是需要普涨行情出现的。对于已经有一部分盈利，但如对深蓝超算一样保持观望持仓状态的投资者来说，冲高出现将意味着短期盈利将迎来了结点（或者，如长阳抵达 3400 上方较高位置，可以做减仓处理，而不需要全面清仓）。

当日情绪指数：30.1503；昨日情绪指数：44.193

当日主力情绪指数：28.6016

当日散户情绪指数：30.1613

主散情绪指数分析提示：主力退场居多，散户全力接盘

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：42.9

历史匹配位置 5 个交易日指数涨跌比例：-0.0071328

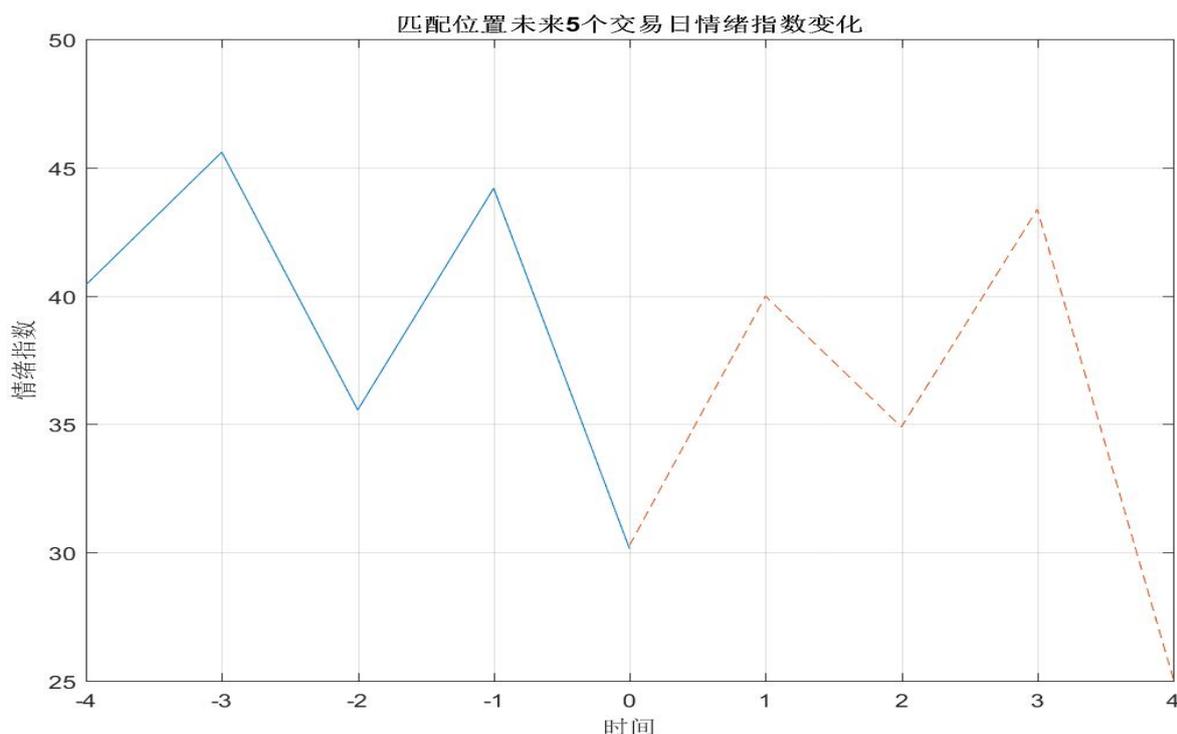
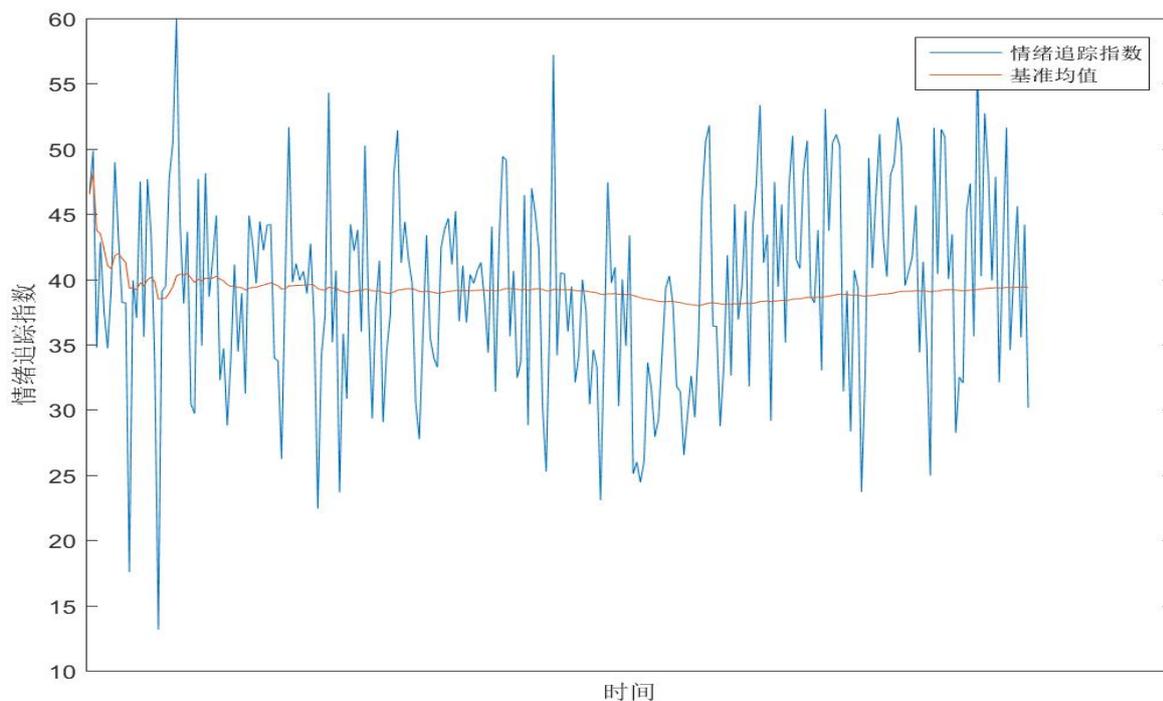
深蓝超算研究中心出品

历史匹配位置 5 个交易日指数波动率: 15.6485

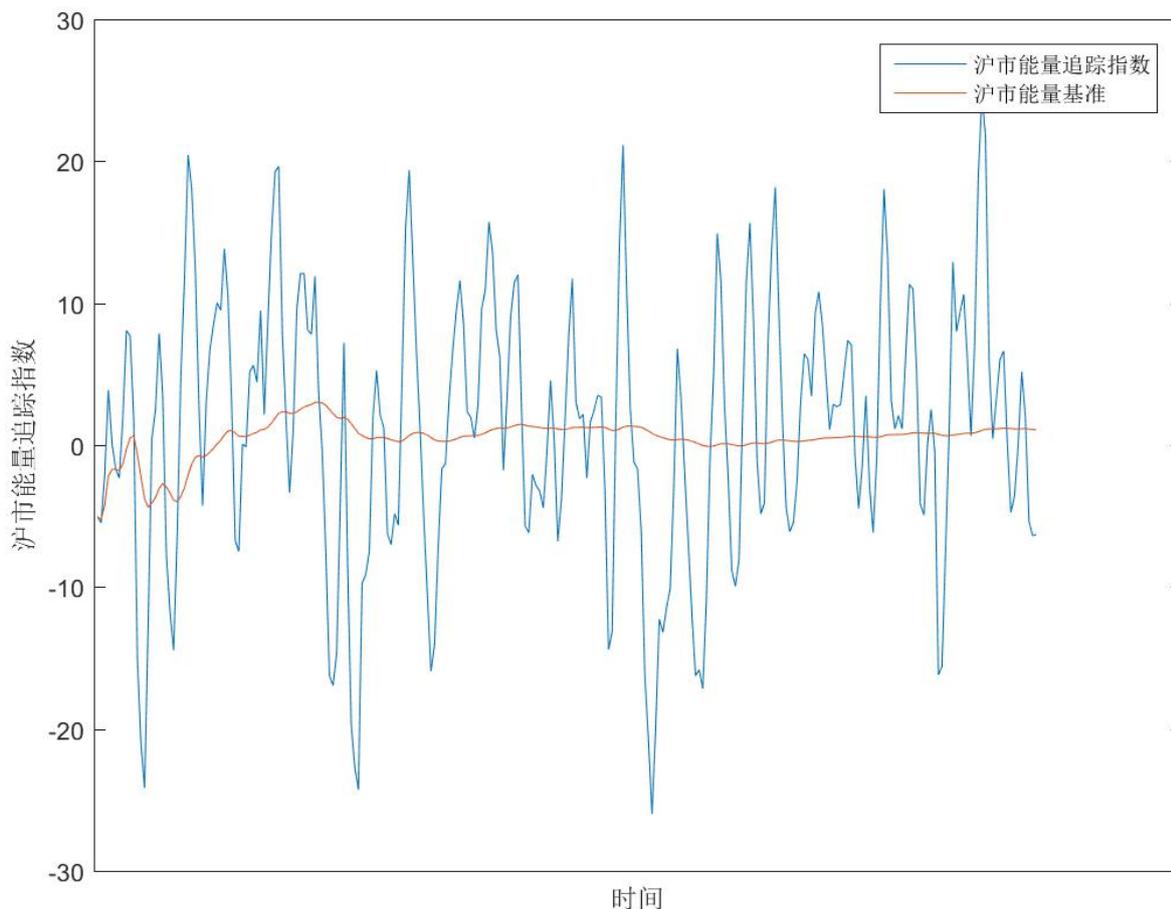
情绪指数是否处于增压区: 处于多头增压区

参照点指数反转 2%所需时间: 98 个交易日

热图的问题今日就不做过多展开了, 因为当日数据与昨日变化不大, 目前依然是消息高度优势的盘面环境, 短线投资者做好题材投资即可 (以及动量投资)。今日最重要的部分在 IEA 指数和情绪指数的匹配上, 下面先来看看情绪指数波动及由程序定位的情绪指数历史匹配预测:



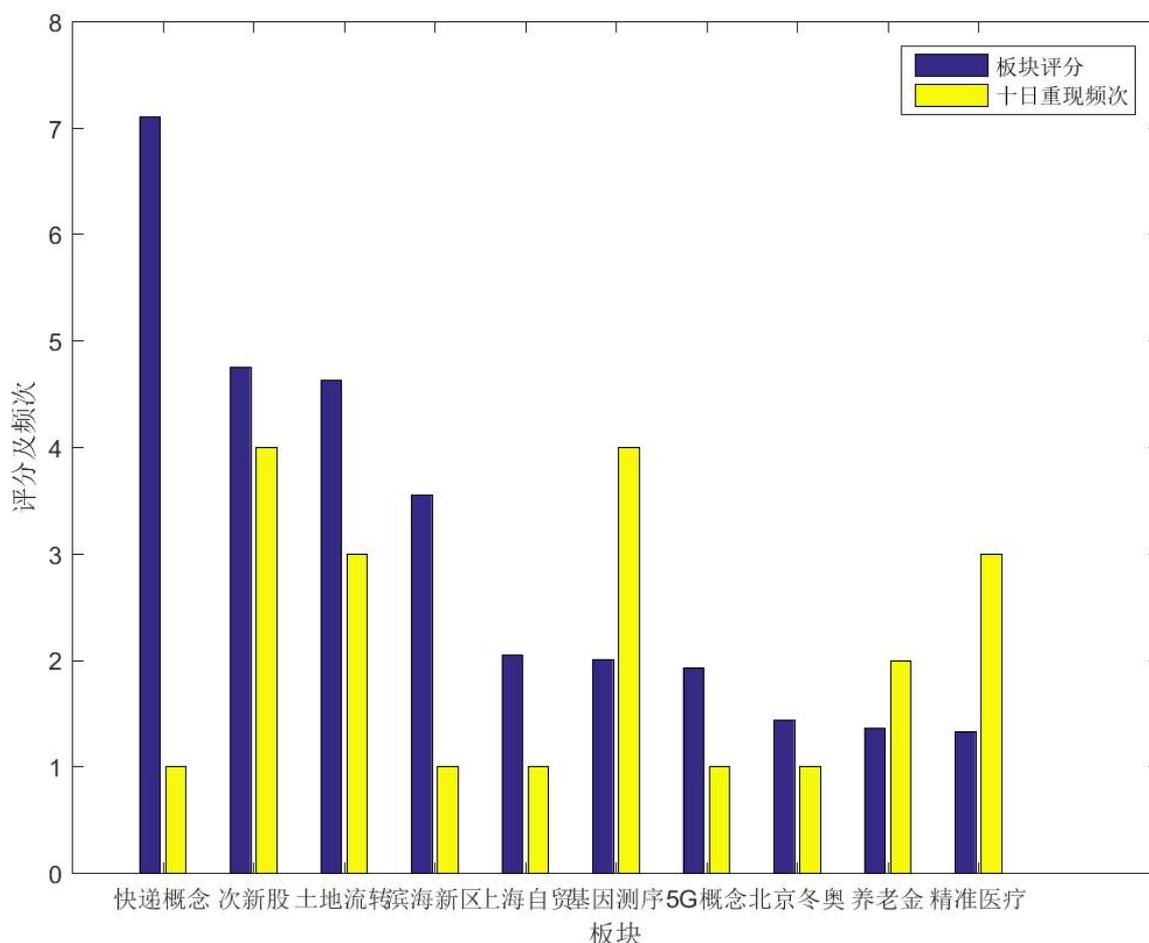
即使暂时不考虑情绪指数匹配需要修正的问题，仅从数据本身来看，情绪指数已经处于多头增压区是即成事实，而 IEA 指数仅仅出现速度线小幅加速也说明目前空头实际做多资金不足，指数上扬已经是不能否认的预期。但这里的关键问题就是什么时候；从历史数据看，深蓝超算要说应该在两个交易日内必然发生指数上扬过程。为什么呢？情绪指数已经抵达 30 之后，就已经接近多头增压区的极值区域边缘，从已有统计数据看，情绪指数抵达 20 以下是非常罕见的极度恐慌状态，而深蓝超算目前已有数据也只记录过两次。而更多情况是，30-25 区间意味着必然发生的报复性反弹！加入明日继续调整，则情绪指数极有可能被进一步打压到 30-25 区间。更大的问题是，IEA 指数（下面显示的 IEA 指数为沪市 IEA 指数，当日不提供深市 IEA 指数展示，两指标当日形态区别不大）当日实际速度下降非常有限，这导致空头控制区的扩展范围微乎其微，多项指标都显示调整不可能超越明日。



这里可以仔细观察一下沪市 IEA 指数，当日较昨日下午下挫不足 0.1 个点，之前所说的拐点依然随时都有可能出现。说完了指数趋势问题，我们再来看看盘面，如往常一样，先来看看当日板块排位信息：

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	快递概念	7.1039	1	新进
2	次新股	4.7552	4	新进
3	土地流转	4.6281	3	新进
4	滨海新区	3.5526	1	新进
5	上海自贸	2.0523	1	新进
6	基因测序	2.0069	4	新进
7	5G 概念	1.9266	1	新进
8	北京冬奥	1.4334	1	新进
9	养老金	1.3643	2	新进
10	精准医疗	1.3271	3	新进



需要注意的是，今日表现较好的房地产板块并不能在概念板块统计中得到体现。与此同时，深蓝超算希望重点强调一下重现频次的问题，可以看到，在十日板块统计中，今日位于榜单前十概念板块中的次新股、土地流转、基因测序和精准医疗都是出现频率极高的概念板块。这也从侧面证明了深蓝超算一直强调的近期动量操作的重要性，近月的多头资金有两个最大的特点，一个是倾向于创业板题材，另一个则是反复进出动量效应已经出现的题材主线中！

进一步说明，投资者可以继续观察近 5 个交易日以来塞得塔路线图子程序所统计定位的预测概念板块及其被预测的频率，不难发现，系统预测范围仍被牢牢锁定在创业板题材之中，而多头资金依然保持活跃的还有次新股和小金属板块，介于类似板块实际出现的频率，深蓝超算建议除了创业板题材标的之外，对于多头资金活跃的次新股和小金属板块也应该保持一定的关注度。

近 5 个交易日预测定位的概念板块	预测频次
次新股	1
移动支付	2
石墨烯	2
智能电视	2
王亚伟系	2
蓝宝石	2
智能家居	2
氟化工	2
小金属	1
超级电容	2
高送转	2
人工智能	2

到最后提一下操作，今日操作提示与昨日并没有什么不同，除了建议投资者继续积极布局之外，也建议已经有一定盈利积累的投资者注意两个问题。第一，如果盈利部分持仓已经在做持续减仓的，深蓝超算建议这部分投资者在积极逢低布局新标的之外，可以适当视情况保留一部分盈利部分仓位，以等待下一次指数冲高的到来；第二，对于此轮预期之中的冲高，深蓝超算提醒两种情况：（1）如果指数在 3400 冲高遇阻，这里的遇阻包括长上影线收在 3400 下方或略高于 3400 压力的情况；这里的遇阻还包括指数无法突破 3400 压力的情况，无论何种阻力出现，深蓝超算建议投资者不要做过多等待，立刻了解盈利部分全部持仓，同时视情况减仓或清空近期布局部分持仓。（2）如果指数以长阳突破或以光头长阳突破 3400 压力，动量效应将在盘面占据至少两个交易日的主导地位，盈利部分持仓和未盈利部分持仓都可以不做调整，继续持有，等待目标达成或动量衰竭迹象出现时再做处理。

说到这里，今日简报就基本接近结束了。再来补充一下今日的备选池：

备选池类型	机筛结果（已剔除停牌和 ST 股）
底部类型	无
中继类型	卫信康、秦港股份、凌钢股份、东方银星、金能科技、安科生物、浩云科技、中国神华、浪潮软件、广东鸿图……
进攻类型	久吾高新、光库科技、西藏城投、阳光电源、盐湖股份、泰禾集团、永辉超市、卧龙地产、韵达股份、木森林……

*今日中继类型（20 个）和进攻类型（16 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。

对应的，下面是近期的操作策略，除非市场出现较大变动，否则深蓝超算给出的操作原则不会做过大调整，因为操作计划需要保持一定的连续性，包括投资者自有的操作方法一样，不建议做过于频繁的更换：

指数短期	抵抗式震荡	预估指数转折时间点	最早于本周末
短线操作原则	中长线操作原则	短线标的的选取及买卖原则	中长线标的的选取及买卖原则
动量优先	低买优先	收盘价≈最高价，量能放大 0.5 倍以上（更多参数请自己设定） 相比买入基准价位置，量能放大 对应涨幅下降考虑离场	月平均波动幅度不超过 2%，连续至少一个月，价格低于上一高点 50%左右（长线标的的选择）或 10%-20%（短期中继型标的的选择）

			<p>量能水平同理，无显著利空或利空发布距今时间已过数月</p> <p>中继型出现原趋势破坏离场，底部长期埋伏型标的视情况间隔补仓，平台型走势补仓需等待新平台形成并确认，此类标的再不持续出现利空的情况下可维持补仓持有状态，当前安全性较高，如能发现此类标的，可以月为周期持有。盈利出局比例应保持为布局等待月数*10%。（等待一个月应保持 10%盈利水平出局，两个与则为 20%，以此类推）或盈利出局基于个人计划执行</p>
--	--	--	--

今日简报到此就告一段落了，相信上面给出的信息应该可以提供充分信息作出阶段性操作计划。以后简报仍将视情况增减内容，希望这些内容对大家能有帮助。明日同一时间我们再见，祝各位好运！

深蓝超算研究中心
2017/09/19