

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：340期

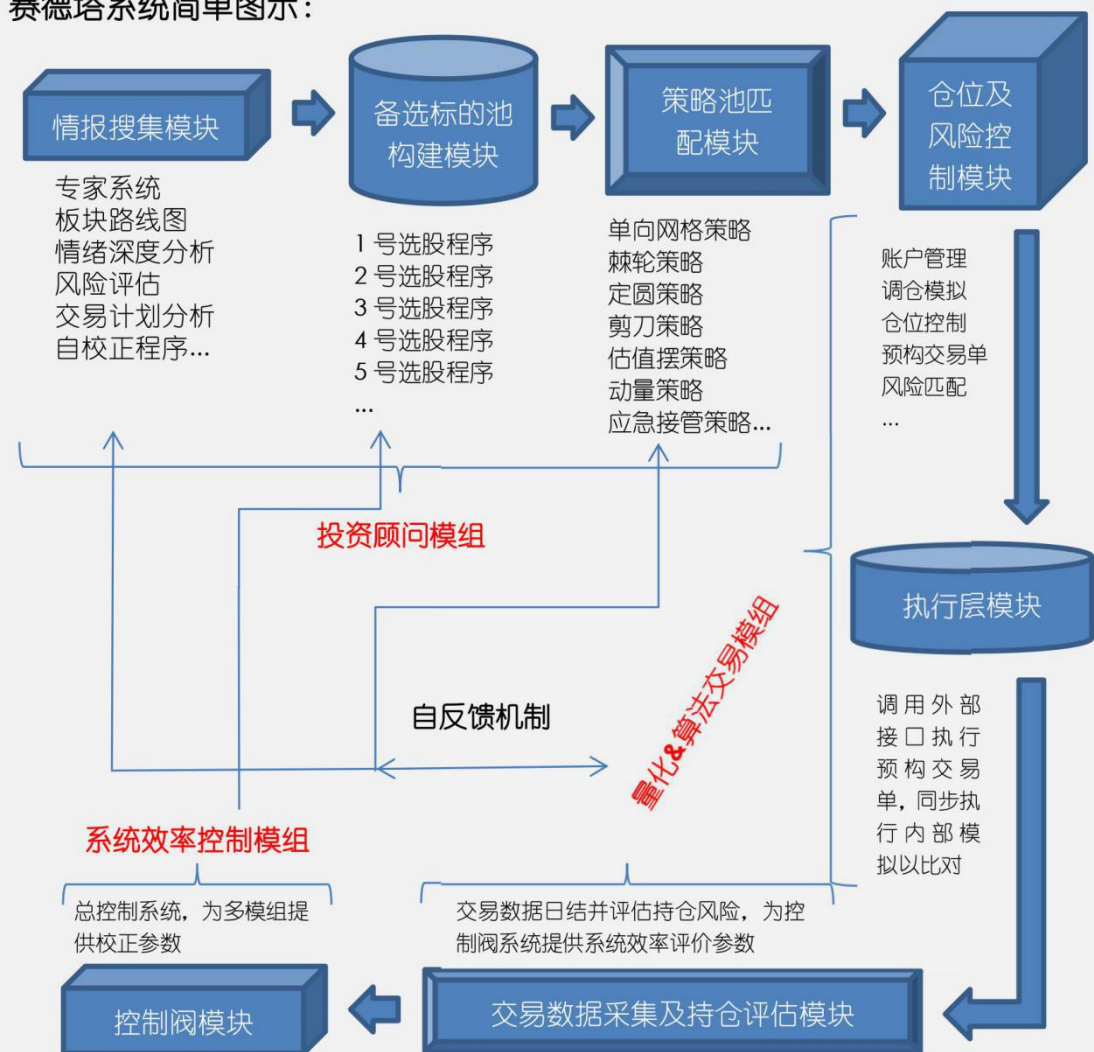
日期：2018/01/18

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!

核心观点：

当前赛德塔系统判断维持：当日对主板指数惯性上行继续维持至少一个交易日的预期已兑现，且由于当日系统并未修改当前周期任何趋势预测结果，昨日分析及预期内容继续维持。即当前多头惯性动能将在本周或最迟到下周初消耗殆尽，并由此出现阶段性预期的最后一次整体上扬前调整，具体调整节点目前无法被确认在本周五还是下周初，且当前各项数据显示多头进攻动能仍可以保持两个交易日左右，也就是说权重标的对大盘指数的拉升能力仍有可能维持两个交易日左右。投资者应当优先考虑反向布局，并抓住机会，优先选择本轮惯性动能所维持的上行阶段中就一直调整的小盘标的进行布局，是否存在业绩及发展空间将是第一考虑要素。与此同时，由于系统识别未来以月级别为单位，大盘指数仍有相当幅度的上行空间，一些拉升不足或尚未显著启动的权重标的仍应该作为重点参考标的。近期模式定位结果表现良好，请继续保持关注！当日更新的模式定位结果则为：超级品牌、高送转、煤化工、金属资源题材、水利建设、海工装备、智能穿戴、油价相关、5G 概念；模糊匹配结果为：业绩支撑型题材（高送转）、超级品牌、黄金概念、油气相关题材、租售同权（部分地产）题材、氟化工等（不建议过度关注 ST 题材）。

由于今日赛德塔系统全部维持昨日分析及预判结果，所有今日简报的主要内容仅对昨日内容进行补充和少量校准而已。

首先，当日格局性预判与昨日几乎保持一致，结果如下：

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，局部惯性进攻维持，短期修复有效；

战略布局建议：上行不变，最佳抄底

当日情绪指数：36.3206；昨日情绪指数：30.8833

当日主力情绪指数：32.9864

当日散户情绪指数：36.324

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：相对位置方向不匹配

历史匹配位置 5 个交易日指数波幅：28.68

历史匹配位置 5 个交易日指数涨跌比例：-0.0084333

历史匹配位置 5 个交易日指数波动率：13.7144

情绪指数是否处于增压区：处于非增压区

参照点指数反转 2%所需时间：15 个交易日

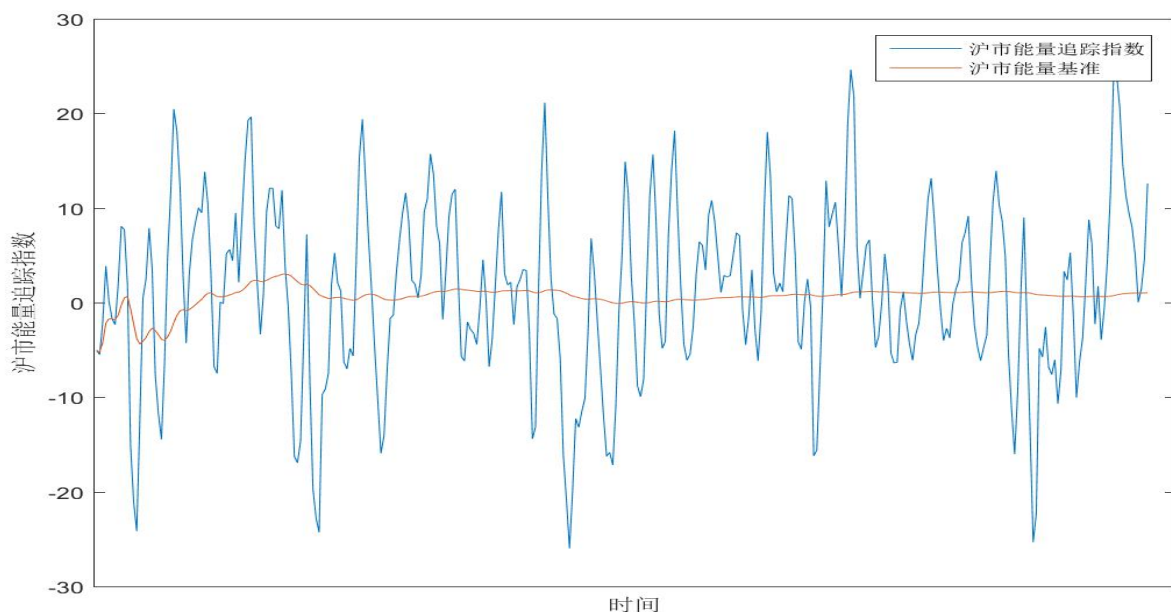
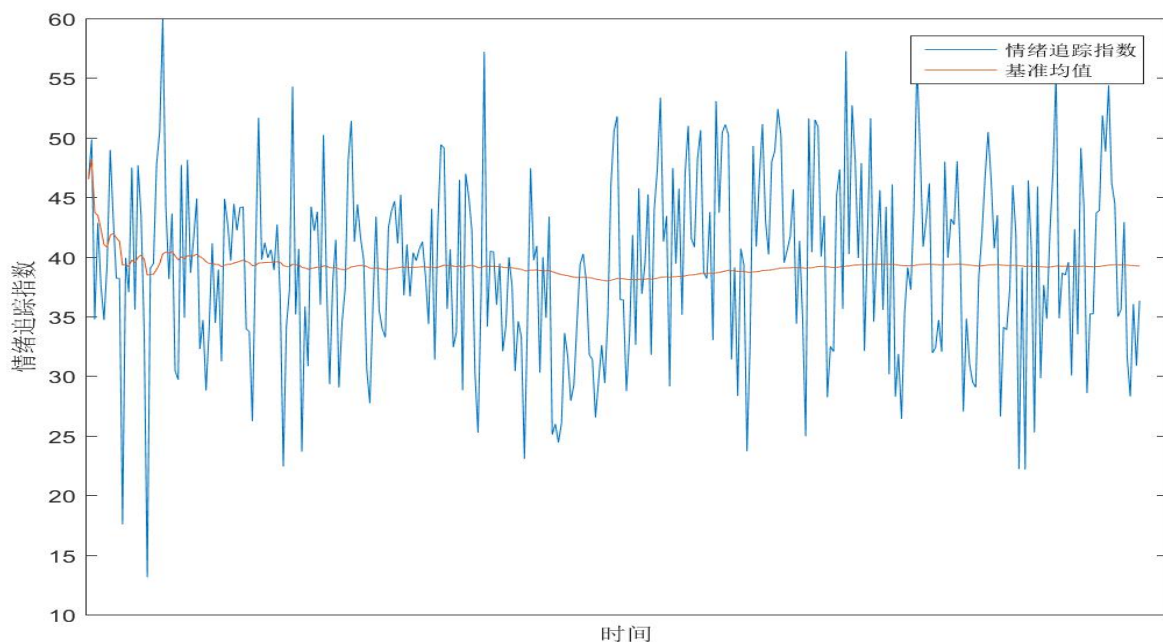
专家系统自校准意见：无系统校准意见

操作建议校准：无校准意见

简单地说，赛德塔系统依然高度看好指数继续保持上行状态，同时由于主板及中小创不同步的现象已经维持了相当长的时间，大量中小创标的持续杀跌已经创造了巨大的盈利空间，预计主力资金将陆续进行调仓，从而为下一轮大幅上行做好准备。因此，赛德塔系统认为大盘将以月度为周期持续一段时间的进攻格局，不排除指数在短时间内创出近年新高的可能性。除此之外，目前短期盘面仍存在至少一次的调整，根据时间窗口度量，当前多头进攻动能仍可以维持大约两个交易日左右，所以此次日级别调整预期实质上已经后移至下周初的某个时间，投资者应当针对时间窗口计算结果重新校正进行的操作计划。最后，目前情绪指数朝着昨日预期的方向运行，这也在侧面验证了至少存在一次日级别调整的预期。如此，目前的综合意见是：短线投资者继续把握好隔夜交易，中长线投资者只能布

局存在利好或业绩支撑的小盘股，或者等待日级别调整再行选择新一轮权重标的进行埋伏。

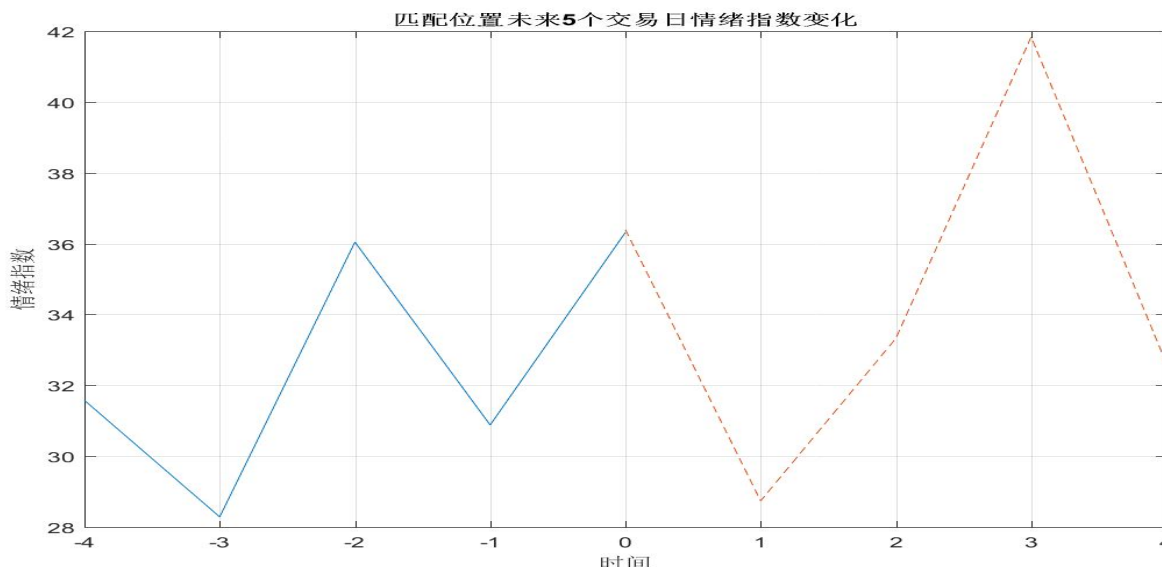
到这里，其实今日赛德塔系统所做的修正及补充内容就全部叙述完毕了。我们再来看看情绪指数与 IEA 指数趋势图所指示的其他信息：



如之前所预期的，IEA 指数有意在新的多头动能控制区制造一个低于上一顶点的新高点，而根据 IEA 指数速度数据计算，类似进攻延伸至多只能维持到（包括）下周一，投资者应该注意下周出现的日级别调整，但注意这是日级别调整，并不会影响多头维持进攻状态。而更值得注意的是，目前情绪指数的波动情况预示着大盘整体空头情绪其实是比较丰富的，卖空力量肯定是存在且在发挥积极作用的，否则大盘指数本应比现在的进攻结果更加可观。换句话说，目前场内做空力量也十分积极，但指数之所以不下跌，是由于主力资金维持了较强的进入状态，且这种状态是具有一定可持续性的，所以大家应当意识到，指数虽然没有发生调整，但这种调整确实正在发生之中。这种高位边涨边调的状态，将有利于指数维持当前高度（主力资金不立场），同时为中小盘标的创造足够的盈利空间，投

资者应当从中看到机遇!

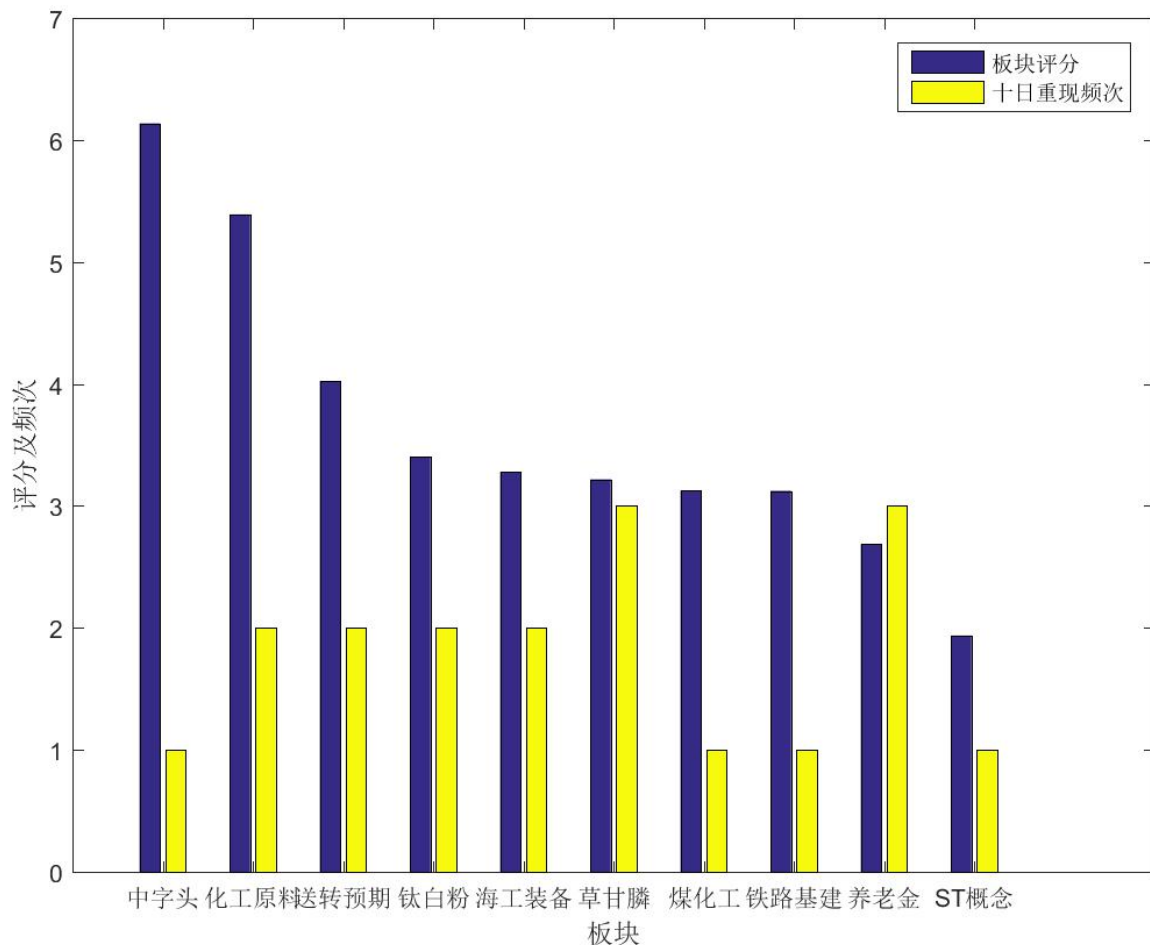
其实，说到这里，今日简报的趋势分析内容就已经接近结束了，在此之前，我们还是先看看情绪指数的历史数据匹配结果，希望可以验证上面赛德塔系统所提供的预期：



在一个交易日左右误差的情况下，预期的情绪指数应当在明日或下周一出现本阶段的最后一次下调，并在下周后期迎来指数的再次上扬，即昨日所说的先升后降再升过程，大盘目前就处于这里所说的本阶段首次上扬状态中；也就是说，短期内将出现至少一个交易日的调整已经预期之内的问题，即情绪指数匹配预期结果与上述赛德塔系统提供的基本预测是匹配的。

好了，今日简报内容补充信息不多，而到这里的趋势分析部分就告一段落了，如往常一样，我们还是再来简单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	中字头	6.1354	1	新进
2	化工原料	5.3894	2	新进
3	送转预期	4.0251	2	重现
4	钛白粉	3.4031	2	新进
5	海工装备	3.2788	2	新进
6	草甘膦	3.2177	3	新进
7	煤化工	3.1254	1	新进
8	铁路基建	3.1231	1	新进
9	养老金	2.6853	3	新进
10	ST 概念	1.9374	1	新进



目前大盘短线调整预期已从周线级别修改回日线级别（本阶段最后一次显著调整预期将发生在下周初），理性猜测是大盘将继续维持进攻格局，短线投资者可以继续保持活跃，等待优势低点反向布局，而中长线投资者在完成收割该阶段盈利后就暂时不建议再次大举进入了（或按上述建议操作）。这个问题上面也提过，深蓝超算在这里仅作二次提醒，下面不再赘述。我们再看看 5 个交易日的板块定位情况：

近 5 个交易日预测定位的概念板块	预测频次
煤化工	1
ST 概念	1
黄金概念	1
油价相关	1
油气设服	1
网络安全	1
氟化工	1
在线旅游	1
北京冬奥	1
高送转	1
钛白粉	1
超级品牌	2
租售同权	1

区块链 1

根据历史数据匹配结果，深蓝超算以后尽可能少说，因为这里很直观，不需要深蓝超算做过多解释，由于调整已兑现（具体覆盖周期不明），建议投资者继续重点关注一下业绩支撑型题材（高送转）、超级品牌、黄金概念、油气相关题材、租售同权（部分地产）题材、氟化工等（不建议过度关注 ST 题材）。

我们现在就仔细看看 apriori 分时模式识别程序的分析结果（由于该程序还未完成【已进入方案三的测试中】，该程序还有重要解读程序未完成，所以该程序是尚不能直接输出结果，当日结果由深蓝超算基于 apriori 分时模式识别程序分析结果整理而得，更改表现形式为优先级）：

预测将占优势的概念板块	预测优先级（1、2、3 级，1>2>3）
超级品牌	2
高送转	1
煤化工	3
金属资源类题材	1
水利建设	3
海工装备	3
智能穿戴	3
油价相关	2
5G 概念	2

注：此为全表的节选，由于更进一步的分析程序尚未完成，手动节选可能有漏

当日的分析结果为：超级品牌、高送转、煤化工、金属资源题材、水利建设、海工装备、智能穿戴、油价相关、5G 概念，大家注意一下短调预期已兑现，预测覆盖周期大幅收缩，阶段最后一次调整将以日级别在下周出现，注意优先布局。其他信息就不多做展开，大家自己考虑好了。另外，继续跟进的信息是：目前模式识别算法的开发已经完成第一部分，第二部分已进入 alpha 版本的后期开发（暂未关联模糊匹配程序与主程序趋势预判组件，beta 版本将进行相关开发工作，目前赛德塔系统所有模组均可以独立运行）。

操作上，深蓝超算提醒如下：目前盘面动量恢复良好，长期局面已走出低谷，预计大盘将逐步回到冲高格局之中，但目前肯定期间存在短期周级别调整的可能，投资者应尽可能捕捉短调机会。到这里，今日的简报就接近尾声了。我们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	超声电子、凯恩股份、国星光电
中继类型	安通控股、兖州煤业、盛和资源、卫信康、家家悦、阳光城、万年青、伟星股份、远光软件、金达威、聚龙股份、农尚环境
进攻类型	本钢板材、新安股份、中新赛克、网宿科技、凯众股份、久吾高科、光明地产、中国交建、中国建筑、欧普照明……

备选池类型	机筛结果（已剔除停牌和 ST 股）
超级绩优	隆基股份、中国平安、中兴通讯、美的集团、泸州老窖、科大讯飞

*注意：为适应市场风格变化需求，新增超级绩优题材，所选题材均根据财务数据筛选，所以每季度做一次变更，可参考按需寻找长线机会。

*注意：底部类型池已被清洗，请注意！

*今日进攻型类型标的（18 只）数量过多，仅选择其中涨势最佳（或跌幅最小）的前十个标的进行展示。

*当日全标的精选展示如下，不同于以往，深蓝超算决定对每次提供的全池进行节选，因为下一步深蓝超算将逐步开始对标的池自动管理系统开发投入更多精力，这里每种标的仅按照一定的原则提供部分标的，深蓝超算开发工作较多，每周做一次备选池的删减工作将改为每月进行一次。

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	先升后降再升	预估指数转折方向	日级别调整
		预估指数转折时间点	下周初
短线操作原则	中长线操作原则	短线标的选取及买卖原则	中长线标的选取及买卖原则
<p>动量优先！ 资金优先！</p>	<p>低买优先 超跌无需等待 分批建仓 (>=5)</p>	<p>收盘价~=最高价，量能放大 0.5 倍以上（更多参数请自己设定） 或至少维持均等水平</p> <p>价格驱动优先 相比买入基准价位置，量能放大 对应涨幅下降考虑离场</p>	<p>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（长线标的选择）或 10%-20%（短期中继型标的选择）</p> <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。简报每日都将视情况增减内容，希望这些内容对大家能有帮助。今日简报到此结束，明日同一时间我们再见，祝各位好运！