

# 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：415期

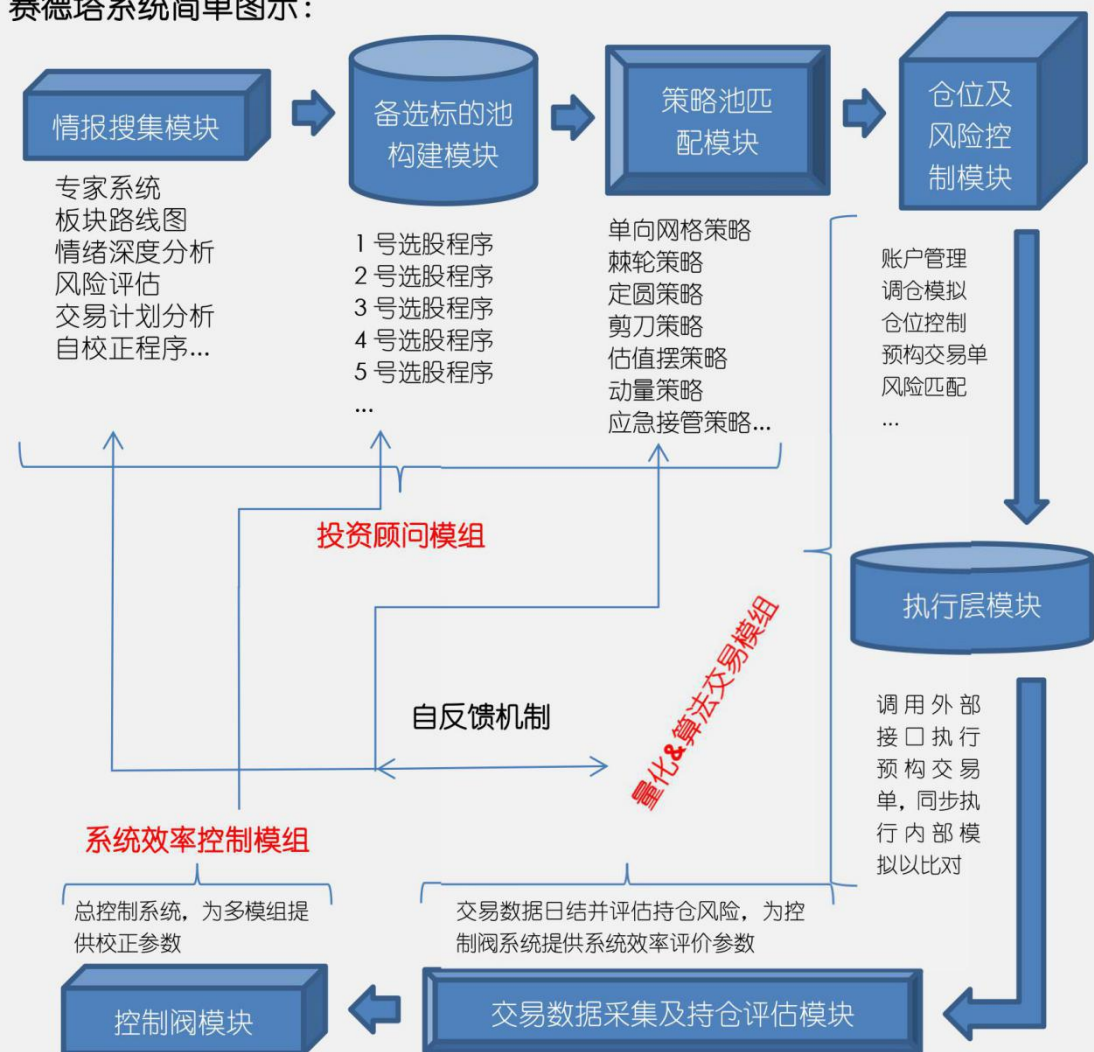
日期：2018/05/17

## 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](mailto:504936733@qq.com)

Telephone: 13870916570

深蓝超算对外站点:

<https://xueqiu.com/DBS>

[C\\_ResearchCentre](https://xueqiu.com/DBS)

QQ: 504936733

Weichat:



欢迎留言或联系深蓝超算  
交流学习!

## 核心观点：

当日系统维持昨日全部预测路径及时间窗口分析结果，短期大盘已陷入调整格局之中，目前市场处于 IEA 指示的空头动能累积区，等待空头动能衰竭需要至少到下周中段；所以，根据赛德塔系统当日维持结果，短期继续看空指数，月级别预期依然处于低置信度下的看空状态中，下周极有可能覆盖主调整区，空头动能衰竭前几个交易日，系统也会及时提醒。但需要注意的是，由于目前振幅较小，调整幅度也价格十分有限，已布局投资者只要作好操作计划的，可以继续坚持不改，但在加仓或买入细节上可以考虑适当放宽间隔。最后，当前盘面暂时不建议投资者开新仓，空闲仓位建议全部计划配置在已布局标的上，首要目标关注跨周的修复问题。而在时间窗口上，预计本轮调整还有至少 3 个交易日的时间，空头动能枯竭点应在下周三或下周四，投资者在此之前可视情况逐层作好布局准备，严格制定适合自己使用的棘轮策略操作（建议仓位控制极限在八成以下）。

今日大盘的走向其实是完全符合昨日预期的，这是修正后确定性比较高的预期，且今日最佳题材中的草甘膦也是前日覆盖的题材，在当前这种盘面下进行类似的定位其实是相当困难的。投资者也可以继续关注定位结果选择近期比较值得关注的模式性题材板块。而在板块定位问题上，当日模糊匹配系统结果为：优先关注机构重仓、上证 50 和在线旅游；而在高精度定位基础上，系统在给出模糊匹配结果的基础上继续给出当日模式定位更新结果，今日精确模式识别定位结果为：油价相关，今日投资者适当需要关注模式定位题材则有：次新股、黄金概念、金属资源类题材、国产软件、高送转、超级品牌和国产芯片。其实从题材预测分布看，近一段时间来的市场模式性题材范围很小，几乎都集中在今日定位的这些概念题材之中，其中根据频率着重推荐资源、国产软件、国产芯片和超级品牌题材。另外，深蓝超算目前正在加速开发第一个个股机会自动检索+个股自动盯盘决策模块，该程序是一个可以自成体系的模块，数据使用网络爬虫采集，第一阶段主要分析盘面数据，以后会逐步根据需要增加财报、个股消息自动分析程序。

\*更多详细内容请查看简报正文，核心观点部分未囊括当日全部预测结果，预测及分析细节以正文为准

\*提醒：部分内容由于逐日迭代更新，可能会出现忘记更新的情况，趋势分析应以正文前半部分及核心观点内容为准

在昨日路径修复后，今日赛德塔系统再次很好地兑现了昨日的预期，目前投资者必须清楚，由于多头动能突然异常增长后又迅速衰退，导致整体盘面再次进入 IEA 水平上的空头动能累积区，该过程根据 IEA 时间窗口分析结果，应再持续 3 个交易日左右，即除非发生较大变动，否则空头动能的潜在衰竭点应至少在下周三之后。另外就是，目前月级别预期继续以低置信度维持在看空档上，投资者下一阶段布局是一定需要的，但首要目标是周级别修复，而不是月级别修复，这里的持股周期预期是完全不同的。也就是说，目前的盘面是不建议长时间持股的，这就要求大跌时下手要狠，达不到预期的情况下下手也要狠。

因为当日系统维持了昨日的几乎全部预测路径结果，所以当日简报仅作简单补充：

周级别中长周期系统决策树预测：下跌

月级别大周期系统决策树预测：下跌

当前中短期盘面预判描述：大周期下行趋势，局部惯性下挫维持，维持惯性下跌；

战略布局建议：下行持续，不宜操作

当日情绪指数：40.7488；昨日情绪指数：45.3119

当日主力情绪指数：40.0435

当日散户情绪指数：40.7503

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：64.93

深蓝超算研究中心出品

历史匹配位置 5 个交易日指数涨跌比例：-0.018832

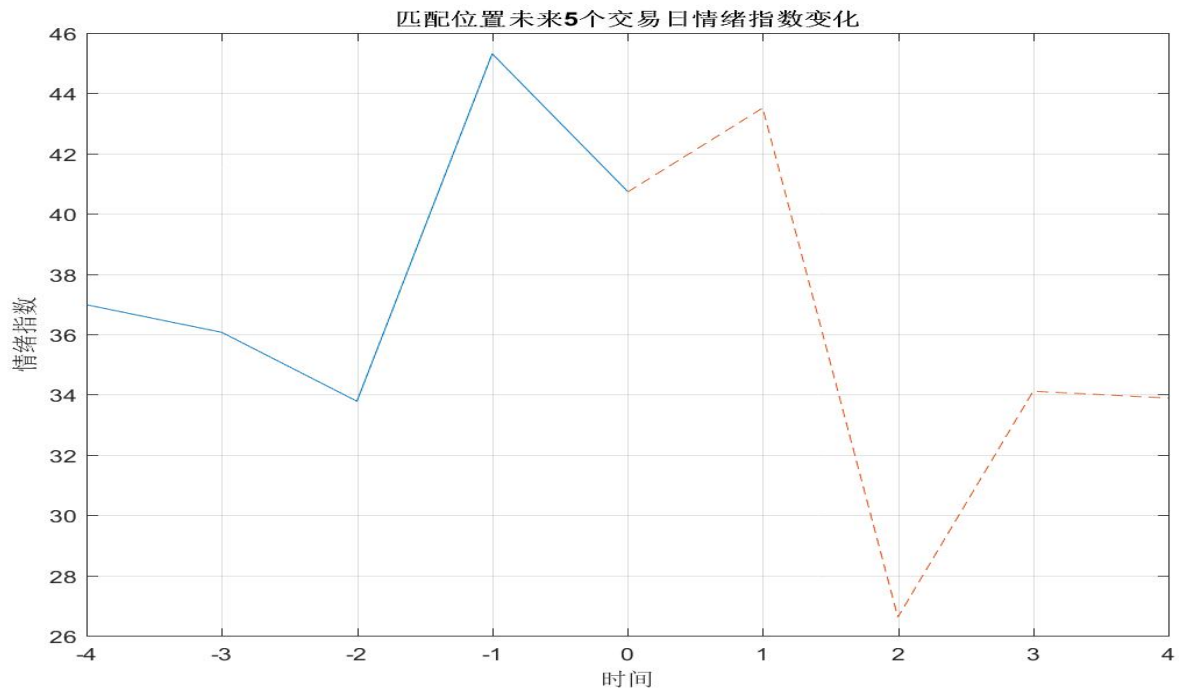
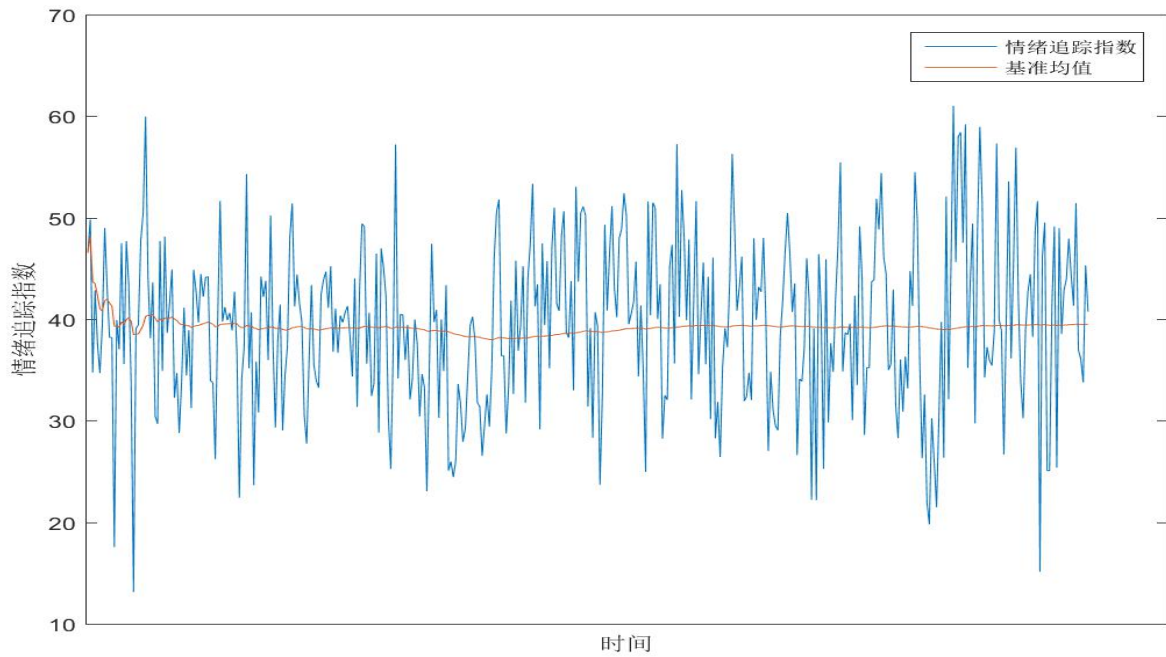
历史匹配位置 5 个交易日指数波动率：25.9341

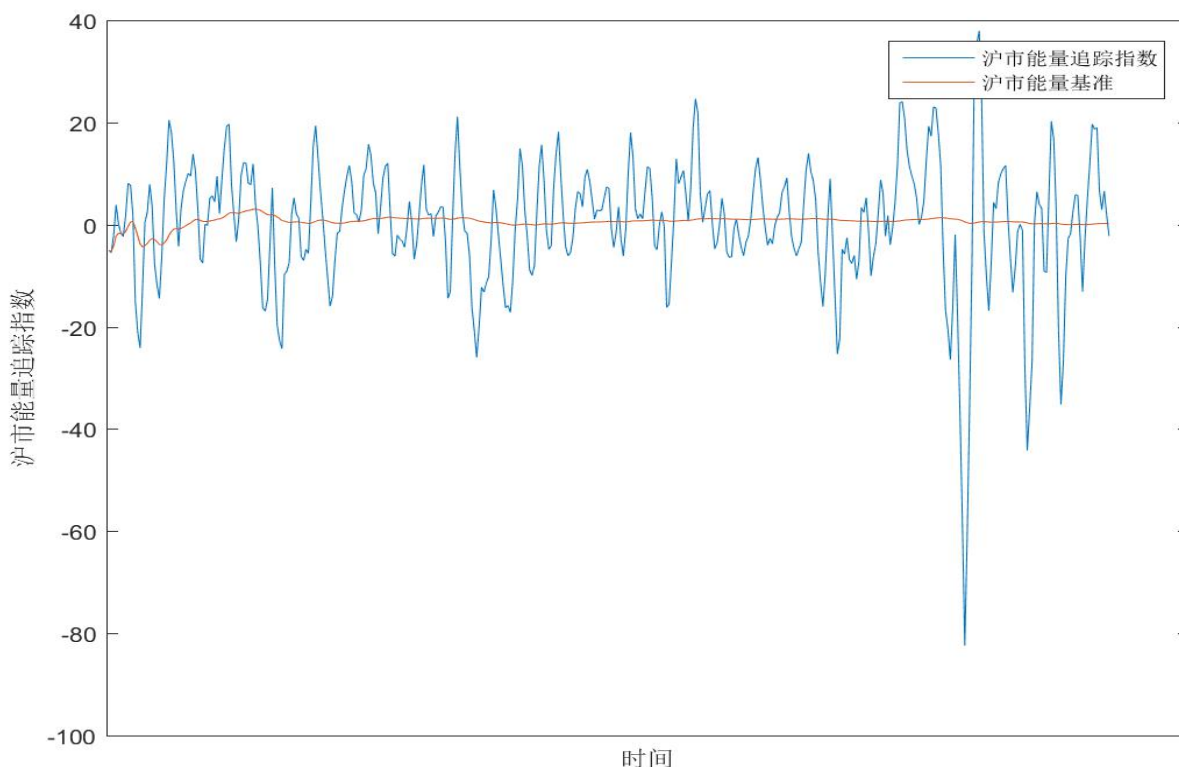
情绪指数是否处于增压区：处于非增压区

参照点指数反转 2%所需时间：51 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





从趋势波动情况看，不难理解，近期指数应与情绪指数波动类似，即震荡下行，这种空头情绪加重属于正常现象，而在指数没有超额快跌的情况下，触底还是比较艰难的。所以，未来几个交易日，深蓝超算认为大家最需要重视的是某个交易日的快速加深下挫，一旦出现，请一定逆向买入！因为在市场存量有限的前提下，类似情况出现后的短期修复通常是非常可靠的。这一点从 IEA 历史规律中就可以看到；另外，目前 IEA 指数确定处于不可逆下降通道之中，该位置向下只有触底才会有反弹的机会，而这里根据时间窗口计算，至少也需要 3 个交易日左右才有可能抵达 IEA 速度上的触底，实际 IEA 指数触底估计最短需要 4 个交易日，所以投资者近期最好不要过于心浮气躁。已经布局的，早就说过，设置好棘轮就不要多虑了，后面逐层逆向补仓即可。这一点，从深蓝超算布局的雪球 IEA 风格模拟就可以看到，由于后面布局几乎都是加倍进行的，所以当前出现的有限亏损是在预期之中的，这里预测的是超跌后的修复，定位准确是首要的，然后就是目标！深蓝超算再次提醒，目前中远期充满不确定性的情况下，过高的目标是非常糟糕的，如此投资者不但很难完成目标离场，还有可能反遭套牢。

说到这里，趋势分析部分的内容就说得差不多了，因为昨天已经覆盖了这些内容，所以继续赘述的意义是不大的。另一方面，深蓝超算近期正在开发首个个股机会自动搜索、决策及棘轮策略自动调用模块，这个集成式模块将预先制作多个接口，为以后扩展其他策略程序作好准备，但由于该模块的性质，完成后是无法以简报形式展示的。届时，出于测试目的，深蓝超算将接受每日一定数量的标的自动诊断。另外，由于程序将能同时自动完成标的检索和棘轮策略布置两项工作，未来简报中有可能以其他形式的详细操作流程表代替现有的备选池展示。毕竟，过多标的展示的意义是不大的，现在适不适合买，买什么，怎么买才是最终决定收益的成分！

好了，信息就这么多，想必读者们都心里有数，后面应该怎么做，那趋势分析部分到这里就告一段落了，如往常一样，我们还是再来简单看看当日板块排位信息：

<b>排位</b>	<b>当日分析板块重排</b>	<b>当日板块自动评分</b>	<b>十日统计频次</b>	<b>较昨日变动</b>
-----------	-----------------	-----------------	---------------	--------------

1	化工原料	7.2611	1	新进
2	次新股	7.1197	3	新进
3	草甘膦	4.4934	3	新进
4	全息技术	3.9957	1	新进
5	钛白粉	3.6878	3	新进
6	氟化工	3.1627	2	新进
7	可燃冰	3.1617	2	新进
8	油改概念	3.0608	3	新进
9	油气设服	2.6002	2	新进
10	页岩气	2.2058	2	新进

大盘目前倾向于逐步修复，但不排除短期还有小幅调整的可能性。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
稀缺资源	1
机构重仓	1
CDM 项目	1
上证 50_	1
食品安全	1
在线旅游	1
基因测序	1
国产软件	1
超级品牌	1
租售同权	1
草甘膦	1

历史数据匹配结果不需要深蓝超算做过多解释，在区间下降的前提下，投资者应放宽棘轮间距持续作好布局准备，已有仓位也可以考虑逐层追加布局；总之，按照之前提示的较宽布局幅度继续保持。而这里近期特别建议投资者优先关注的目标为：机构重仓、上证 50\_和在线旅游。

我们现在就仔细看看 apriori 分时模式识别程序的分析结果（目前模式识别算法正在原算法基础上修改为大幅提高模式挖掘能力的浮动双向识别算法[原触发模式识别基础上，不再固定分析区间，而浮动穷举所有符合条件区间，从中发掘不同周期的强预测目标]）：

单元匹配板块为：油价相关；五日单元匹配概率为：33.22%；该匹配板块在未来第 3 天出现的条件概率超过 50%。

多元匹配板块为：次新股；五日多元匹配概率为：21.88%。

多元匹配板块为：黄金概念；五日多元匹配概率为：7.25%。

多元匹配板块为：基本金属；五日多元匹配概率为：12.99%。

多元匹配板块为：小金属；五日多元匹配概率为：15.49%。

多元匹配板块为：国产软件；五日多元匹配概率为：7.69%。

多元匹配板块为：高送转；五日多元匹配概率为：11.59%。

多元匹配板块为：超级品牌；五日多元匹配概率为：12.33%。

多元匹配板块为：国产芯片；五日多元匹配概率为：11.32%。

置信度较弱的匹配板块：

单元匹配板块为：油价相关；五日单元匹配概率为：33.22%；该匹配板块在未来第3天出现的条件概率超过50%。

置信度较高的匹配板块：

无匹配板块

当前模式识别程序正进入第三次算法迭代研究已经完成，下一步模组将添加新代码，敬请期待修正后模式识别程序（预测精度已经从7成提高到了9成（89.47%），但涉及代码修改、补充工作较多，短时暂无法上线；浮动周期模式识别算法的开发计划在本次算法迭代结束后进行，未来该程序将有能力提供适合不同持仓期限风格投资者的题材选择）。当日模式识别程序定位中，今日较高置信度的题材为：油价相关，而其他值得注意的题材则有：次新股、黄金概念、金属资源类、国产软件、高送转、超级品牌和国产芯片。目前由于大盘进入空头动能累积区，深蓝超算构建的IEA风格追踪组合需要抵抗至少3个交易日的空头冲击，预计此轮将能调动剩余60%仓位中的大部分，因此，计划临时调整杠杆比例为75%，对应持仓标的各增加一层额外棘轮倍数买入计划，计划总承受损失不超过5%。而依据近期系统提供的题材目标，如具备出局条件，优先替换或移动仓位到资源、芯片和超级品牌类题材股。

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	国农科技、千方科技、瑞康医药、跨境通、宜安科技、东华测试、中国卫星、吉林高速、海天精工
中继类型	科信技术、东音股份、恒华科技、中国软件、能科股份、康斯特、润和软件、光力科技、未名医药、新美星.....
进攻类型	中新赛克、东方材料、中文传媒、扬帆新材、山东海化、沃施股份、天邦股份、祥和实业、报喜鸟、新野纺织.....
IEA类型	亚威股份、炬华科技、天原集团、通源石油、云图控股、GQY视讯、通程控股、新疆众和、北玻股份、龙宇燃油.....

备选池类型	机筛结果（已剔除停牌和ST股）
超级绩优	保利地产、贵州茅台、大秦铁路、中国国旅、美的集团、云南白药、上汽集团

当日精选	风格精选（已剔除停牌和ST股）
策略目标推荐	国农科技、千方科技、新宏泽、新美星、科信技术、能科股份

\*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：新增IEA风格化类型，所选标的根据IEA时间窗口分析算法计算最优布局点选取，形态及其他方面几乎没有共性，共性在于符合IEA风格特征，目标的需配合棘轮策略使用，每日最多只节选十只展示

\*注意：超级绩优及廉价小盘标的选取条件已更改，之前所选标的将继续维持，直到不再符合基本条件为止，请注意！

\*今日中继类型标的数量（16只）、进攻类型标的数量（32只）和IEA风格类型标的数量（152只）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。

\*新增每日综合风格精选类型，仅展示当日最值得关注的标的，如不存在则不会展示任何标的。

\*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。

\*全池节选（每次为最优前50，本周只有两个交易日，不做全池节选）

由于深蓝超算主要使用棘轮策略操作，具体操作原则每期简报都有提醒，该部分从今日开始删除具体操作原则部分：

<b>大盘趋势展望</b>		
	<b>方向</b>	<b>IEA 时间窗口度量</b>
<b>指数中期趋势（月级别）</b>	<b>？</b>	<b>&gt;=1 个月</b>
<b>指数短中期趋势（周级别）</b>	<b>调整？</b>	<b>至少维持 3 个交易日</b>
<b>指数超短期趋势（日级别）</b>	<b>短调？</b>	<b>维持周期：3-5 个交易日</b>

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！

深蓝超算研究中心

2018/05/17