

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：467期

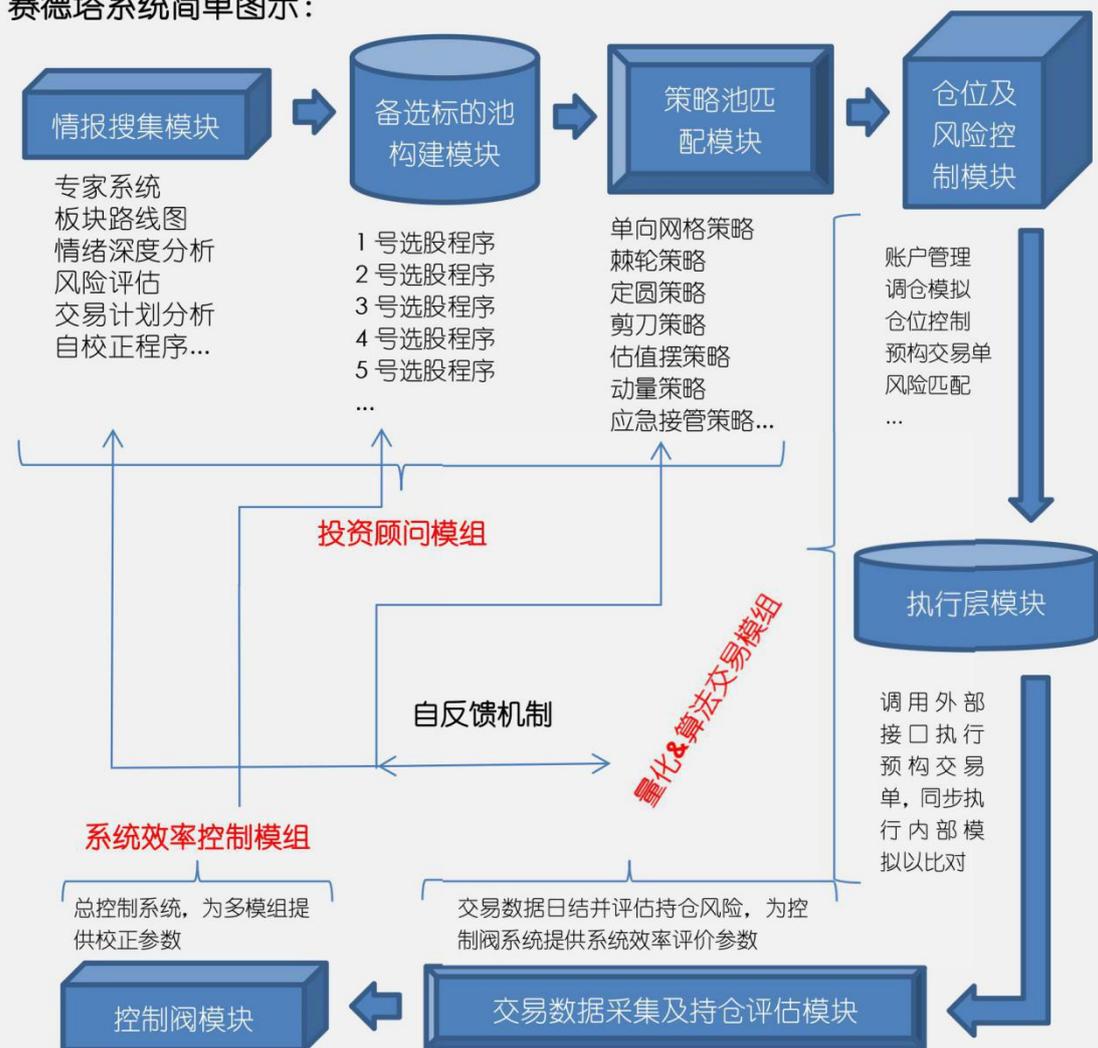
日期：2018/08/01

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：情报搜集模块（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](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：

当日大盘表现异常，跌幅与量能匹配程度较差，而当日系统也监测到下跌由机构及主力资金集中砸盘引起，不排除异常下跌震盘吸筹的可能性。而在昨日明确提醒预测精度下降的情况下，当日赛德塔系统验证大盘短中期波动方向有可能向另一条路径转移。即根据最新分析结果，在明日应存在一定程度修复的前提下，大盘维持在空头控制区的周期有可能直接维持到跨周水平，即一步到位完成调整而不出现原预期中的无效修复过程。但从超短期修复角度看，系统为持续下挫周期提供了 0.78-0.98 个交易日的窗口框定结果，但同时根据系统分析结果，目前短期谷底迹象非常明显，而远期分析结果也在首次一致看短期大盘的逐步修复，则今日应为起点交易日，未来一段时间大盘将持续维持在修复区间中，投资者在当前位置除了标的存在问题之外，深蓝超算是极其反对抛盘止损的。同时，根据计算结果，系统已给明日提供了 70.92% 的上涨概率，而校准结果也提示在 2 个交易日大盘一定需要出现一次修复，整体走势表现应为先抑后扬，投资者应注意捕捉低点机会。

在操作上，深蓝超算继续强调机械化的优势，在存在计划的情况下，异常状态下是可以缩小加仓间距的，这种情况下的加仓在确定标的没有问题的情况下属于主动进攻行为。而介于目前赛德塔系统提供的时间窗口数据，深蓝超算也选择在当日毫无疑问地逆向加仓，在放低预期的情况下，此时介入应是相对安全的。在板块定位问题上，当日模糊匹配系统结果（次级）为：优先关注移动支付、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；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，今日无精确模式识别定位结果，投资者适当需要关注模式定位题材为：煤化工、金属资源类、油价相关、上证 50、丝绸之路、钛白粉、草甘膦、高送转、超级品牌和国产芯片等。深蓝超算认为，因为系统给出的大盘修复回多头长期控制区需要一个多季度的时间，投资者不应预期大盘快速反弹，则其中应存在较多反复情况，所以投资者一定保持冷静和低买风格，无论如何确认，深蓝超算不建议满仓单次买入，也不建议追高！

*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

根据昨日系统的分析结果，赛德塔系统本是认为大盘应先出现一次无效修复再进行跨周调整，但近日数据更新后，该预期存在大幅修正；首先，短期无效调整过程可能被调整期延长所抹平，投资者仅需要关注低买即可；然后，月级别统一判断非常明确，大盘未来震荡向上仍是确定的基本趋势方向；最后，一直到年底，期间的大盘波动都会相对趋于激烈，投资者每次操作都请控制好利润预期，过高或不切实际的预期利润水平是不可取的。所以，近期操作遵循两个基本原则：1、控仓低买；2、主动分层买入。

从当日的具体数据和路径说，大盘目前的预期路径为隔夜大概率修复，但整体底部震荡期间可能一直维持到下周，所以根据系统分析，下周一或下周二可能是较好的大盘修复节点，投资者应视情况作好逆向布局准备，尝试捕捉价差机会。而对于次日修复来说，由于目前情绪指数处于多头增压区，次日大盘修复的概率高达 70.92%，保守估计在 2 个交易日一定会出现一次幅度未知但应有限的修复过程。同时，根据校准信息分析结果，当前大盘底部或近期大盘底部极有可能成为未来一段时间以来的价格底部，投资者此时如果像深蓝超算一样有持仓，应在损失可控的情况下坚定持仓，不轻易动摇。另外，目前根据大盘真正的远期多头控制回归趋势，系统认为筑底周期可能长达数月，所以深蓝超算再次提醒严格控制仓位重要性，跨周周期指数持续反复的可能性极高，投资者应在控制损失的情况下也积极设置合理止盈位置，不建议在确定性较差的时候维持不切实际的利润水平。今天路径依然较为模糊且有待确认，赛德塔系统继续只确认趋势方向，细节上依然不明确，深蓝超算也不进一步详细阐述，我们还是先看一下直输结果：

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：上涨

深蓝超算研究中心出品

当前中短期盘面预判描述：大周期上行趋势，局部惯性下挫维持，短期调整有效；

战略布局建议：上行不变，长线做多

当日情绪指数：31.1238；昨日情绪指数：37.2975

当日主力情绪指数：30.6822

当日散户情绪指数：31.1294

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：7.35

历史匹配位置 5 个交易日指数涨跌比例：0.00097787

历史匹配位置 5 个交易日指数波动率：3.7088

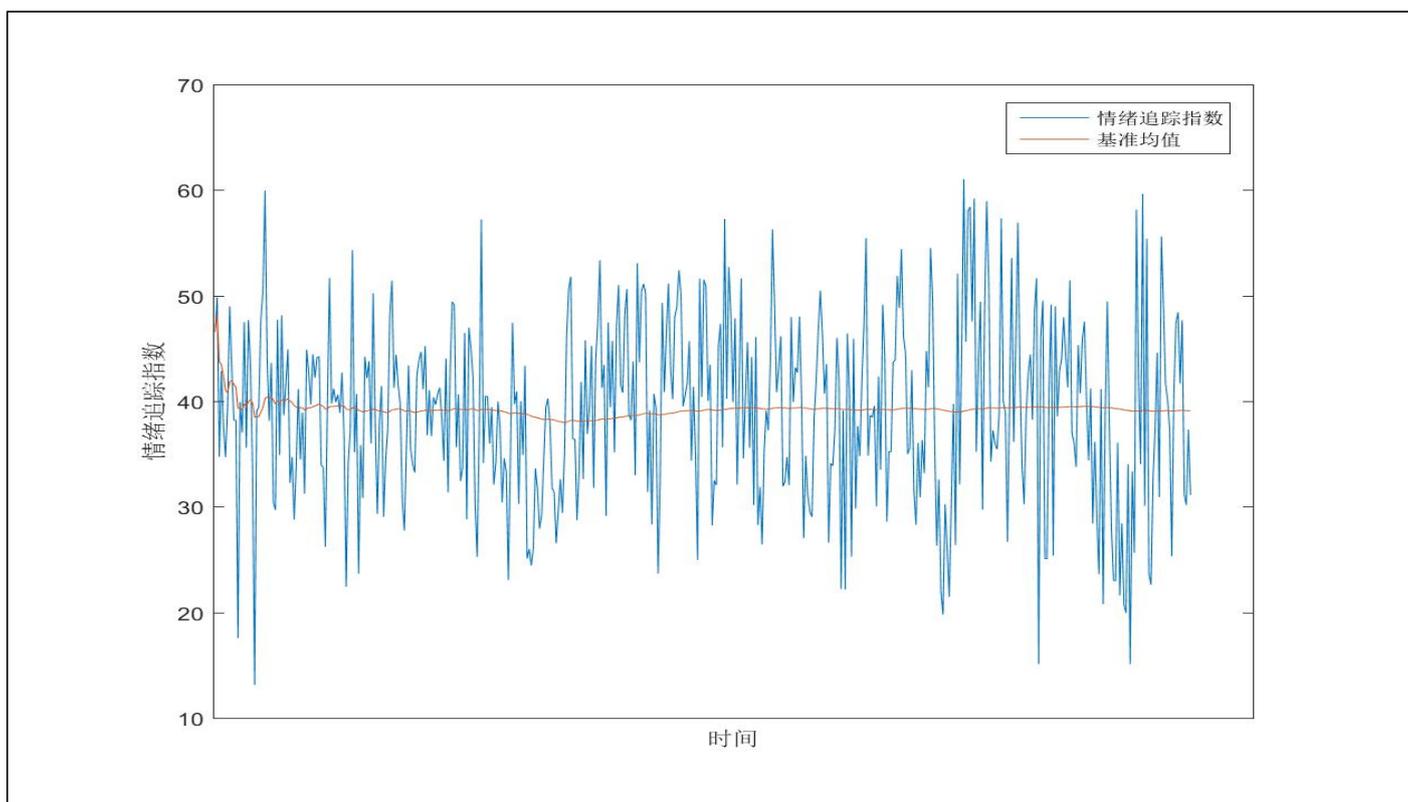
情绪指数是否处于增压区：处于多头增压区

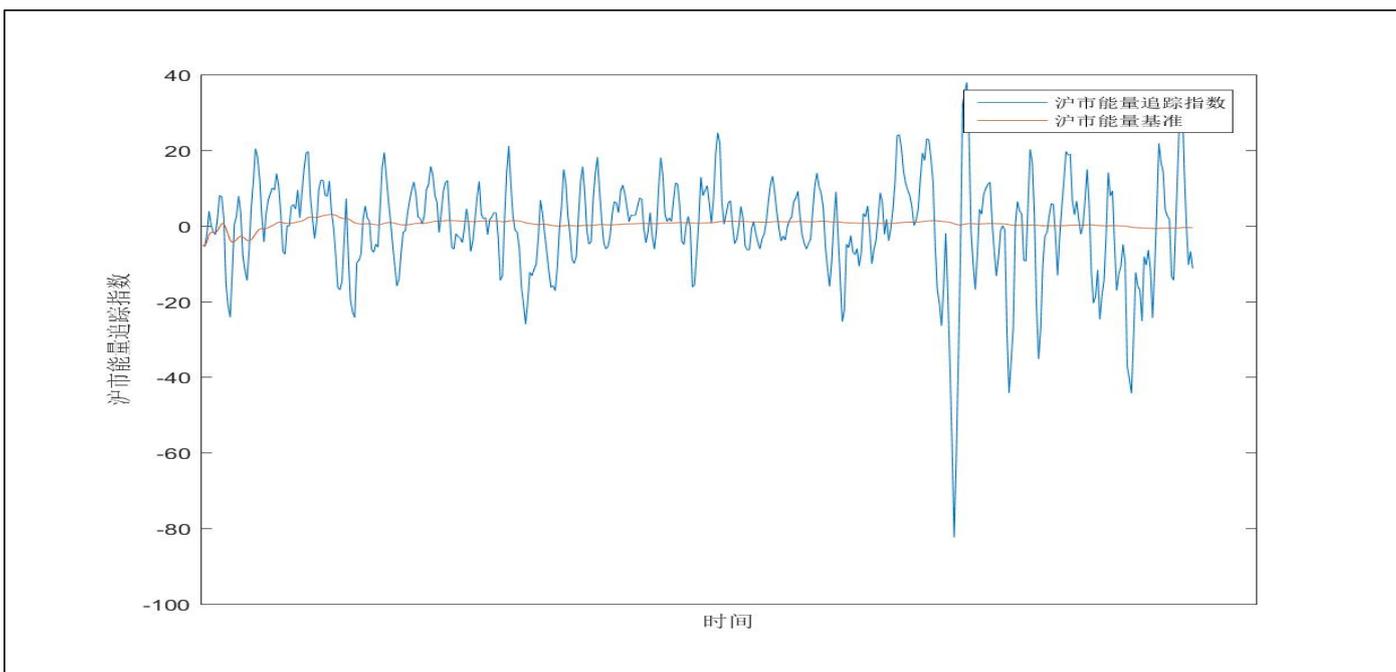
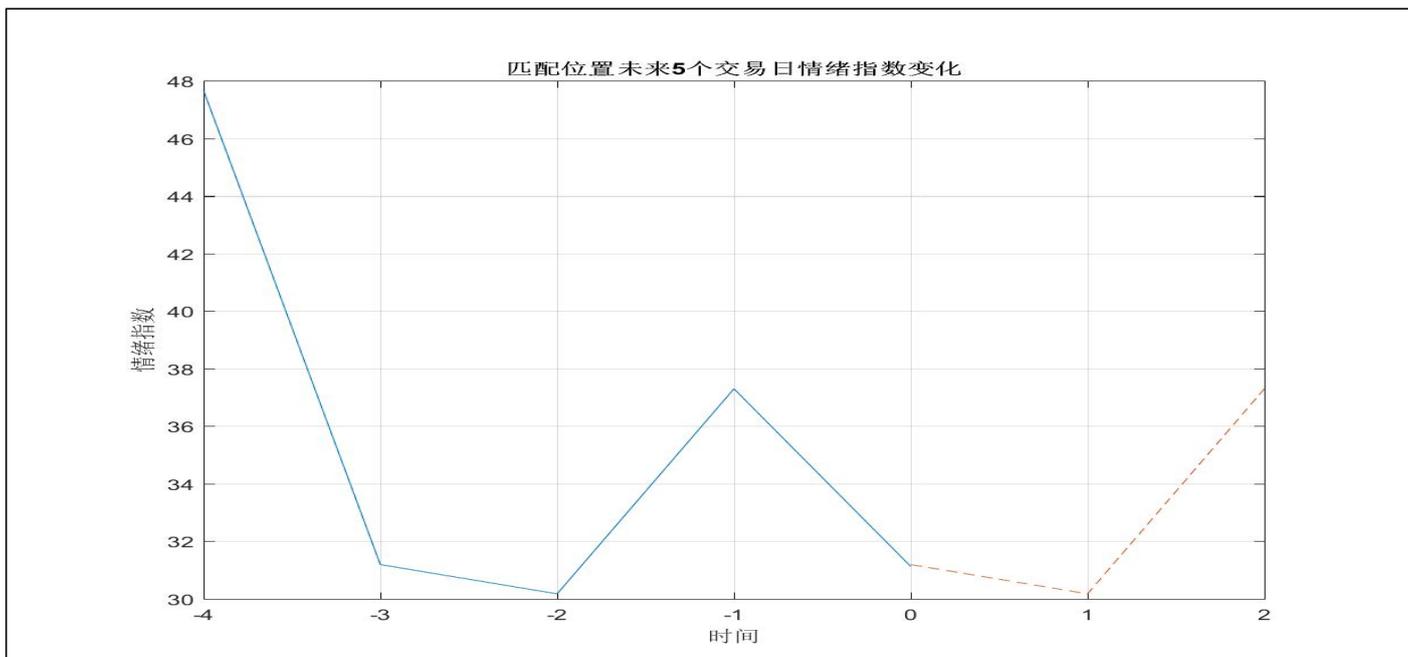
参照点指数反转 2%所需时间：无参照点

情绪指数历史参照次日涨概率为：0.70922；次日跌概率为：0.29078

专家系统自校准意见：修正判断为先抑后扬，下杀后反转向上，注意反向买入

操作建议校准：近日盘中出现的 V 型反转或许将成为短期的最低点，注意捕捉隔夜超短线机会





再次要强调的是，今日大盘的下挫其实是相当异常的，但保守估计到本周五，大盘应至少出现一个交易日的止跌或修正走势，而实际调整浪因为根据当前预测已经与本轮调整浪连为一体，所以依然在修复优先减仓的情况下，系统预测大盘仍将经历相当程度的调整，视情况在接下来的一段时间里，投资者一定要准确并及时地抓住时机锁定利润或减仓以控制损失。当然，对于长线投资者来说，虽然周期较长，但到年底的大盘修复是确定性较强的事，耐心等待的过程中，短期的类似异常不利波动几乎可以忽略不计，深蓝超算建议资本无成本的投资者都保持一定程度的轻视短期波动态度，耐心等待大盘离开当前筑底区域（系统已至少把8月的前半段继续定位为筑底阶段）。

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：

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	上海自贸	8.6944	3	新进
2	水利建设	3.7557	2	新进
3	高送转	3.4691	2	新进
4	沪企改革	3.1932	3	新进
5	快递概念	3.1412	1	新进
6	知识产权	2.3854	1	新进
7	在线旅游	2.2214	2	新进
8	海洋经济	1.8171	1	新进
9	钛白粉	1.3413	2	新进
10	共享经济	1.1052	2	新进

短期修复仍是无效的，下挫过程将是个连续的调整过程，投资者注意超跌状态下的耐心持仓及有盈利情况下的优先止盈！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
次新股	3
稀缺资源	1
黄金概念	1
移动支付	1
基本金属	1
海工装备	1
食品安全	1
石墨烯	1
通用航空	1
创业成份	1
智能电视	1
王亚伟系	1
蓝宝石	1
智能家居	1
氟化工	1
小金属	2
超级电容	1
券商概念	1
航母概念	1
人工智能	1
钛白粉	1
超级品牌	
大飞机	
国产芯片	
网红直播	

历史数据匹配结果不需要深蓝超算做过多解释，目前指数趋于平稳，中远期看好空翻多格局转移（月级别），投资者建议开始买入并逐步加重仓位。而这里短期特别建议投资者优先关注的目标（次级）为：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。

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：煤化工；五日单元匹配概率为：22.64%；该匹配板块在未来第 4 天出现的条件概率超过 50%。
 单元匹配板块为：稀缺资源；五日单元匹配概率为：18.36%；该匹配板块在未来第 3 天出现的条件概率超过 50%。
 单元匹配板块为：基本金属；五日单元匹配概率为：19.02%；该匹配板块在未来第 3 天出现的条件概率超过 50%。
 单元匹配板块为：油价相关；五日单元匹配概率为：18.21%；该匹配板块在未来第 3 天出现的条件概率超过 50%。
 单元匹配板块为：上证 50；五日单元匹配概率为：21.23%；该匹配板块在未来第 2 天出现的条件概率超过 50%。
 单元匹配板块为：丝绸之路；五日单元匹配概率为：17.83%；该匹配板块在未来第 3 天出现的条件概率超过 50%。
 单元匹配板块为：钛白粉；五日单元匹配概率为：21.03%；该匹配板块在未来第 3 天出现的条件概率超过 50%。
 单元匹配板块为：草甘膦；五日单元匹配概率为：19.12%；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：小金属；五日多元匹配概率为：9.59%。
 多元匹配板块为：高送转；五日多元匹配概率为：14.86%。
 多元匹配板块为：超级品牌；五日多元匹配概率为：5.88%。
 多元匹配板块为：国产芯片；五日多元匹配概率为：9.23%。

置信度较弱的匹配板块：

无匹配板块

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）。近期，由于调整了开发的优先级，深蓝超算将先滞后浮动周期模式识别算法的开发，先行开发标的管理、精选、策略匹配及决策模块（该模块中的个股分析程序子模块已完成，后面将现行开发配套策略程序，计划开发一套自动分析效果评估程序，但如果增加策略自动规划程序后占用资源过大，则先不开发）。

当日模式识别程序定位中，今日无较高置信度的题材，其他值得注意的题材有：煤化工、金属资源类、油价相关、上证 50、丝绸之路、钛白粉、草甘膦、高送转、超级品牌和国产芯片。投资者注意短期仍将出现较短的无效修复，不要追逐，注意优先处理持仓，超跌状态下视标的性质选择坚持不动或主动逆向加仓（深蓝超算的策略为后者，这也是深蓝超算一开始就采用单层比例较小的分仓买入策略的原因，真正等到大盘回到多头长期控盘期时间太长，容易错过其中的波段机会，而太早过重仓位又会推迟盈利节点，所以采用等比例长棘轮策略是相对而言更好的选择）！

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	喜临门
中继类型	三垒股份、利安隆
进攻类型	世龙实业、实丰文化、新莱应材、海波重科、广泽股份

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

当日精选	风格精选（已剔除停牌和 ST 股）
策略目标推荐	世龙实业、海波重科

*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：IEA 风格类型与每日精选标的合并，每日精选标的采用 IEA 风格预测选取，不存在技术形态上的共通点，算法仅通过计算未来趋势寻找最有可能盈利的标的，每日仅节选几只提供，每周不会提供该部分的备选池标的展示

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

*今日无类型标的数量过多，不会仅选择其中涨势最佳（或跌幅最小）的前十个标的的进行展示。

*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，这里每种标的的仅按照一定的原则提供部分标的的，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

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：

大盘趋势展望		
	方向	IEA 时间窗口度量
指数中期趋势（月级别）	预计回升	控盘主力转多需：1 个月左右 返回主升区间需：1.5 季度
指数短中期趋势（周级别）	继续调整	开始时间：本周末或下周初
指数超短期趋势（日级别）	修复	开始节点：2 个交易日（维持周期极短）

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

2018/08/01