

# 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：497期

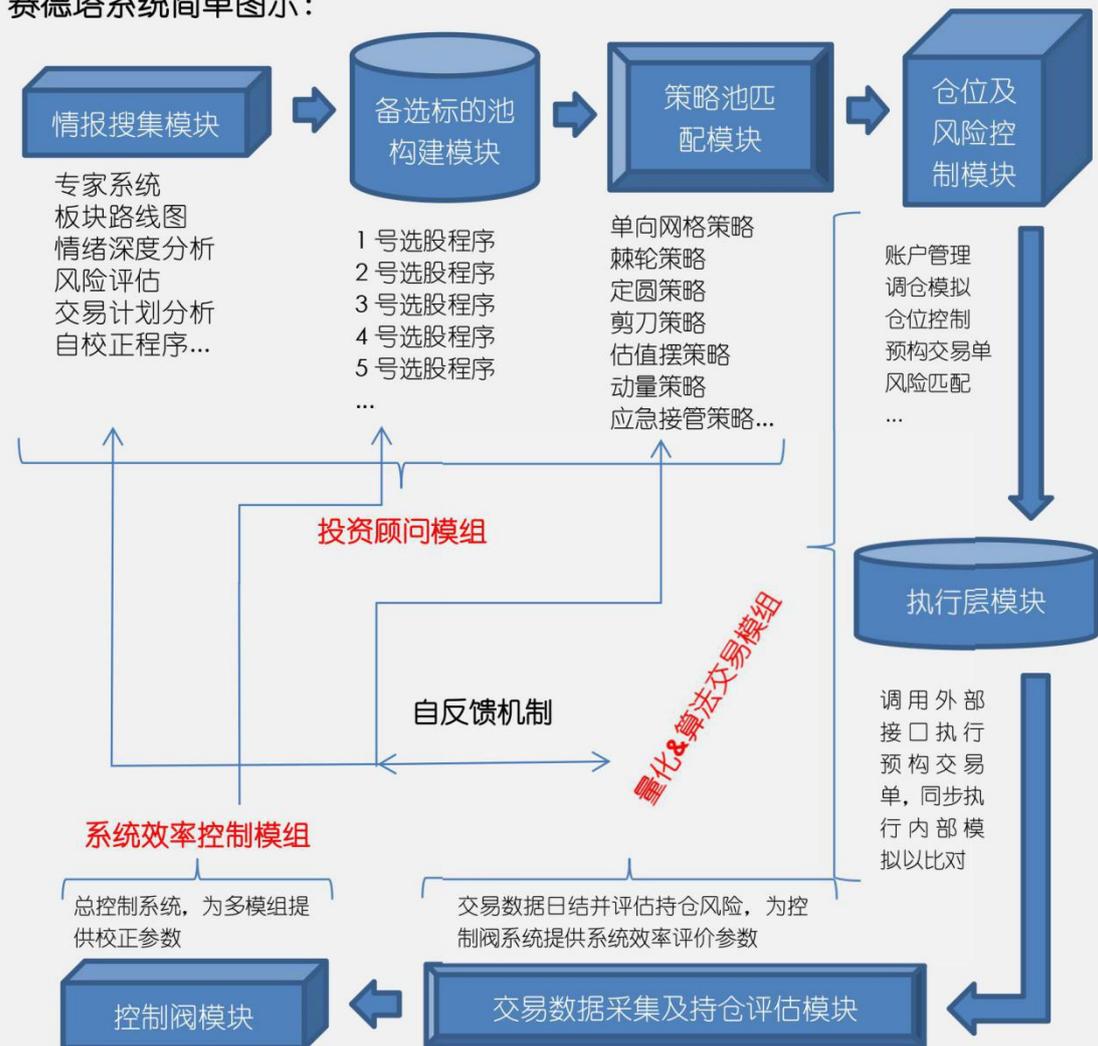
日期：2018/09/12

## 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：

当日大盘超预期过早兑现看空预期，而根据目前更新分析结果，系统以 66.89% 的置信度为次日提供看多预期，预期确定性并不足，而目前逐日预期准确性也确实十分有限。但根据当日提供的校准分析结果，系统仅能较为准确预判目前下行趋势是存在多头抵抗的，或者换句话说在不断刷新谷值的同时存在反向买入力量，而系统比较确定的是，目前大盘极有可能跌穿阶段性低点并创下 15 年以来的指数新低。或者说，在完成此轮大级别探底之前，大盘不可能出现有效反弹，所以目前仍有持仓的投资者应抓住每次机会减仓或清仓。另外，今日系统更改周级别预期为看空，也就是说短期在再次存在技术性修复后，下周仍有可能是大盘刷新新低纪录的阶段，投资者需要格外小心。同时，值得提醒的是，目前系统仍未更改对下月的看多预期，也就是说如果在理想的情况下，本月大盘将完成探底过程，所以在本月继续强烈推荐不交易的前提下投资者也应注意下月的机会。当然，由于目前理论上的有效修复仍有多层阻力需要克服，所以空仓等待到下个月不存在踏空风险。最后值得提醒的是，理论上的当前日级别调整维持周期极限时间窗口为 0.74-1.07 个交易日，所以本周四没有明显抵抗或翻红的话，则本周五出现类似情况的可能性就非常之高（然而，深蓝超算依照建议空仓到现在，是否有修复对个人来说意义已经不大）。

在操作上，深蓝超算继续建议维持严格空仓状态，在阶段性修复确认出现之前，不建议参与。而在板块定位问题上，当日模糊匹配系统结果为：优先关注基本金属、稀土永磁；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，投资者今日适当需要关注模式定位题材则有：油价相关、食品安全、网络安全、粤港自贸、高送转、次新股、稀缺资源、黄金概念、基本金属、海工装备、国产软件、超级品牌和国产芯片，近期在阶段性探底完成之前，深蓝超算继续严格提醒空仓。另外，虽然严格建议不交易，但投资者近期可优先关注贵金属及资源板块。

\*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

如所预期的，大盘再次提前转空，但今日更新数据让分析结果出现了几点改变，简单提醒一下。首先，周级别改看空，本周如有修复，将不会影响大盘继续探底。然后，本周内仍有技术性修复机会，转多机会会在未来 1 个交易日左右时间出现，而该交易日建议只出不进，近期能否充分减仓或清仓将直接决定资金安全性。最后，目前系统对本月内具体波动形式预判无法达到非常精准的程度，但本月内的大盘持续下跌的事实已经在上个月断言，而近期无论如何修复都无法改变这一事实，继续建议投资者严格空仓，持仓则应抓住每日机会尽快出局，因为系统目前存在大盘跌穿大周期低点 2638 点的可能性，投资者必须密切注意。因为下方每次刷新新低水平，都有可能是关键性转折点。

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

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：31.8444；昨日情绪指数：40.445

当日主力情绪指数：30.5112

当日散户情绪指数：31.8445

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：12.89

历史匹配位置 5 个交易日指数涨跌比例：-0.0038449

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：4.9558

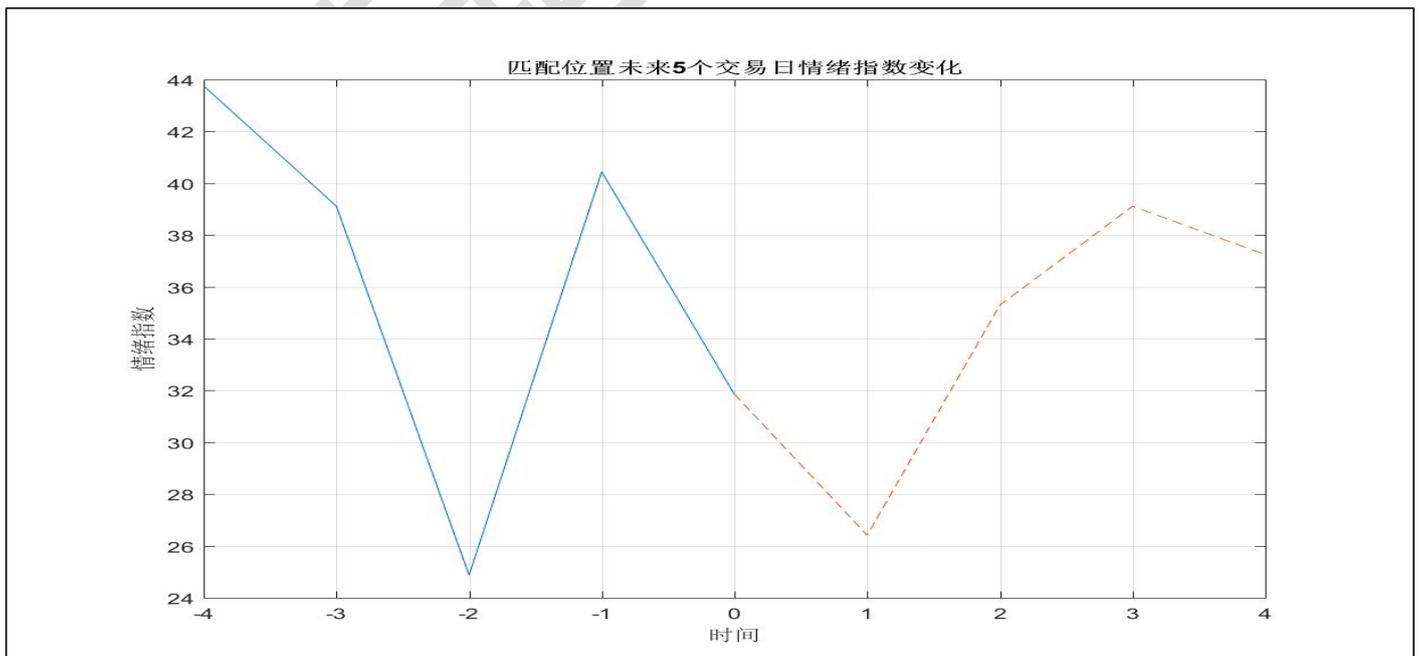
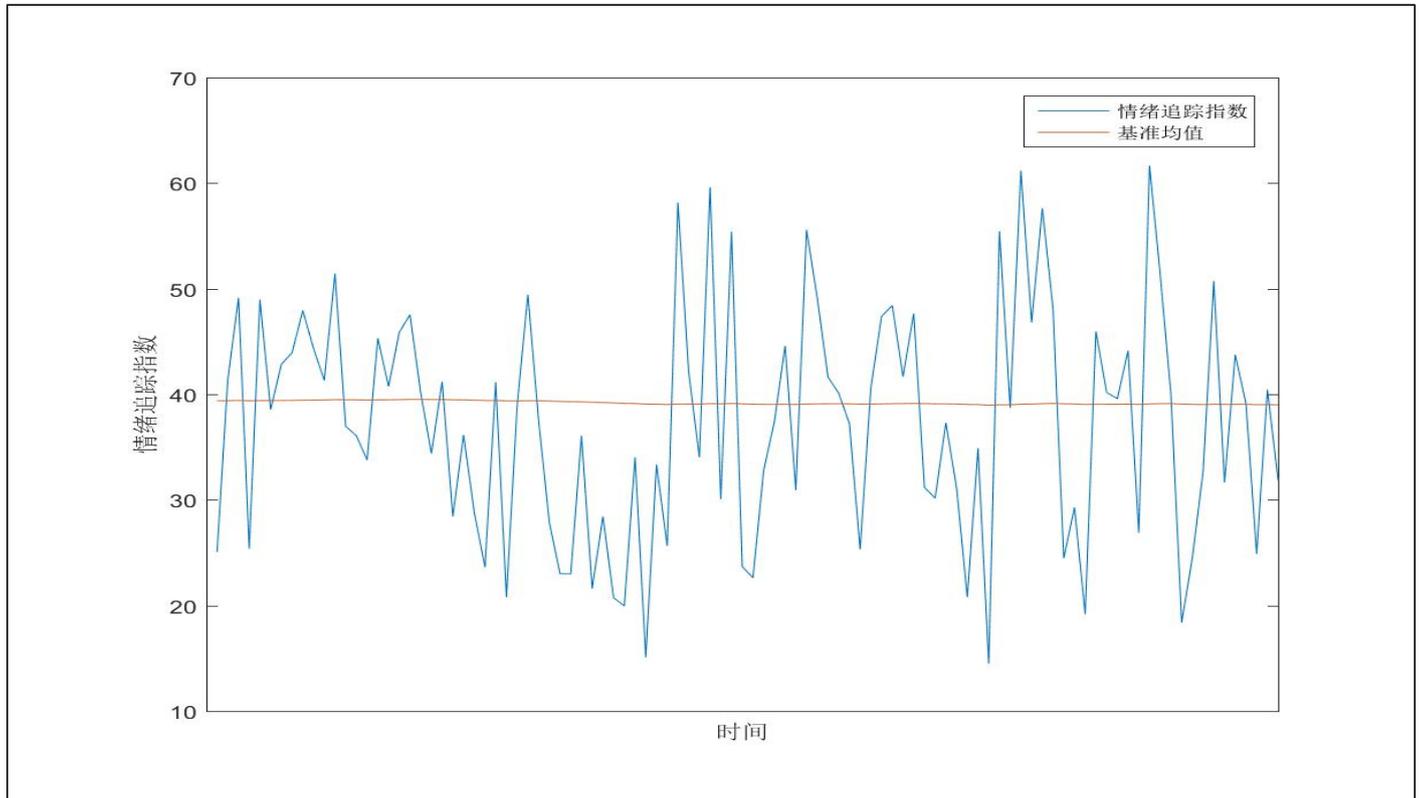
情绪指数是否处于增压区：处于多头增压区

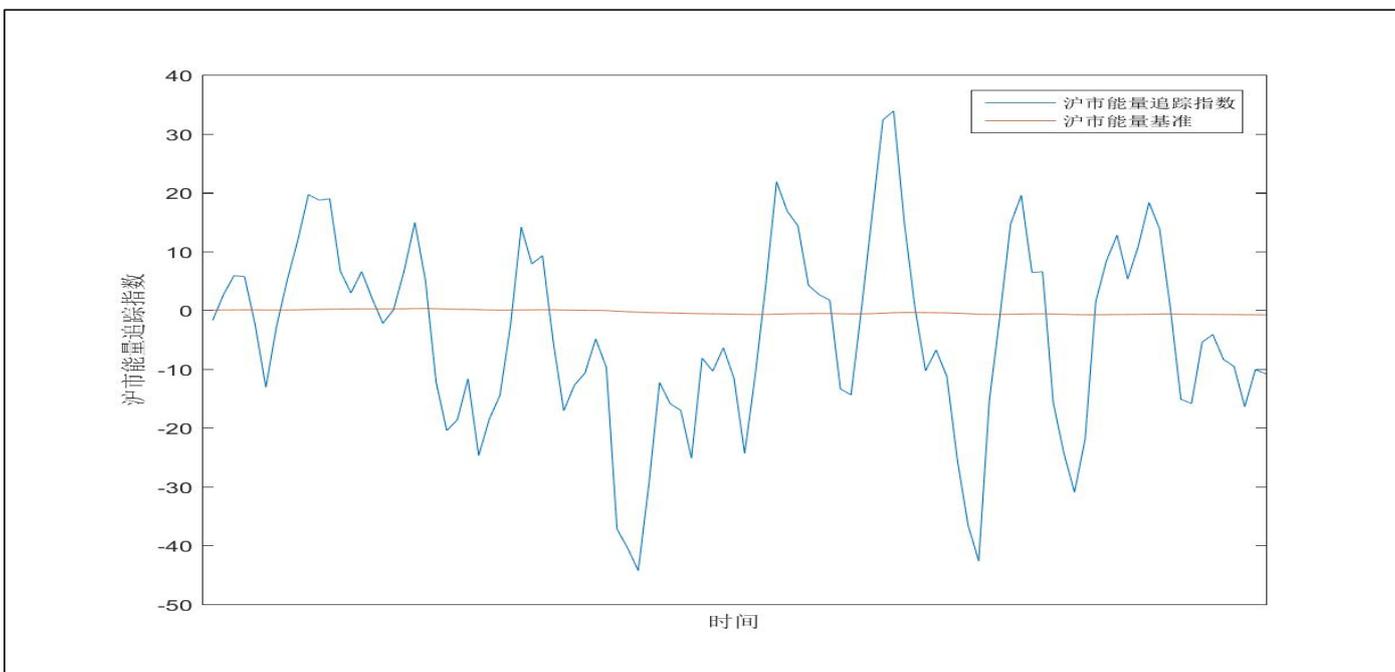
参照点指数反转 2%所需时间：30 个交易日

情绪指数历史参照次日涨概率为：0.66892；次日跌概率为：0.33108

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：近日盘面下行抗跌平台有可能被破坏，平台上方不宜布局，等待平台下方 V 型底出现





系统已经明确提醒，当前点位不建议也不支持买入，目前大盘存在继续持续探底的基本条件，且各分析模块都验证和认可了该预期，所以投资者目前盲目介入存在极大的风险。与此同时，根据系统分析结果，深蓝超算必须提醒，暂时不需要担心因为触底而踏空错失低买机会，该节点预期至少应出现在下月，本月内的实际操作难度很大，相对风险收益情况来说简直是得不偿失。其他问题不多提，已经是反复说了很长时间的问题了。

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：

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	锂电池	6.2711	1	新进
2	军工	5.4911	2	新进
3	大飞机	4.1170	5	重现
4	北斗导航	3.8144	4	重现
5	航母概念	3.4124	2	新进
6	全息技术	2.3109	3	新进
7	通用航空	1.7009	1	新进
8	水利建设	1.6572	1	新进
9	地热能	1.6503	1	新进
10	3D 玻璃	1.4192	1	新进

目前月内暂以剧烈波动预期为主，短期投资者应继续规避日级别风险！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	1
ST 概念	1
基金重仓	1
基本金属	1

稀土永磁	1
食品安全	1
智能穿戴	1
苹果概念	1
基因测序	1
国产软件	1
5G 概念	1
高送转	1
钛白粉	1
国产芯片	1

历史数据匹配结果不需要深蓝超算做过多解释，目前大盘指数周期性的调整再修复，当前短期趋势仍未改变，投资者建议继续维持空仓，目前交易机会极其稀少，建议投资者作好短线交易准备。这里短期特别建议投资者优先关注的目标为：基本金属和稀土永磁。

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：16.86%；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：食品安全；五日单元匹配概率为：15.00%；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：网络安全；五日单元匹配概率为：15.44%；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：粤港自贸；五日单元匹配概率为：16.13%；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：高送转；五日单元匹配概率为：11.85%；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：4.90%。
- 多元匹配板块为：稀缺资源；五日多元匹配概率为：4.11%。
- 多元匹配板块为：黄金概念；五日多元匹配概率为：20.00%。
- 多元匹配板块为：基本金属；五日多元匹配概率为：19.75%。
- 多元匹配板块为：海工装备；五日多元匹配概率为：13.79%。
- 多元匹配板块为：国产软件；五日多元匹配概率为：7.04%。
- 多元匹配板块为：超级品牌；五日多元匹配概率为：7.87%。
- 多元匹配板块为：国产芯片；五日多元匹配概率为：18.06%。

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则有：油价相关、食品安全、网络安全、粤港自贸、高送转、次新股、稀缺资源、黄金概念、基本金属、海工装备、国产软件、超级品牌和国产芯片。其中预测置信度较高的题材有黄金概念、基本金属和国产芯片，但深蓝超算目前依然严格不建议交易，因为当前个股把握难度太大，单次交易的风险损失已远大于潜在收益，仅从概率角度讲，如不采用大资金操纵，普通投资者的亏损概率是非常大的。

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：

<b>备选池类型</b>	<b>机筛结果（已剔除停牌和 ST 股）</b>
<b>底部类型</b>	同德化工、通裕重工、太化股份、梅花生物
<b>中继类型</b>	思源电气
<b>进攻类型</b>	华工科技、诚益通、长江传媒、四创电子、常熟银行、亚振家居

<b>备选池类型</b>	<b>机筛结果（已剔除停牌和 ST 股）</b>
<b>超级绩优</b>	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

<b>当日精选</b>	<b>风格精选（已剔除停牌和 ST 股）</b>
<b>策略目标推荐</b>	同德化工、思源电气、诚益通、长江传媒、亚振家居

\*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。

\*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
<b>指数中期趋势（月级别）</b>	<b>再次调整或筑底完成</b>	<b>调整覆盖：9 月 结束时间：10 月初 返回主升区间需：3 个月左右</b>
<b>指数短中期趋势（周级别）</b>	<b>周级别看空</b>	<b>开始时间：下周？</b>
<b>指数超短期趋势（日级别）</b>	<b>日级别修复</b>	<b>开始时间：1 个交易日左右？</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

2018/09/12