

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：522期

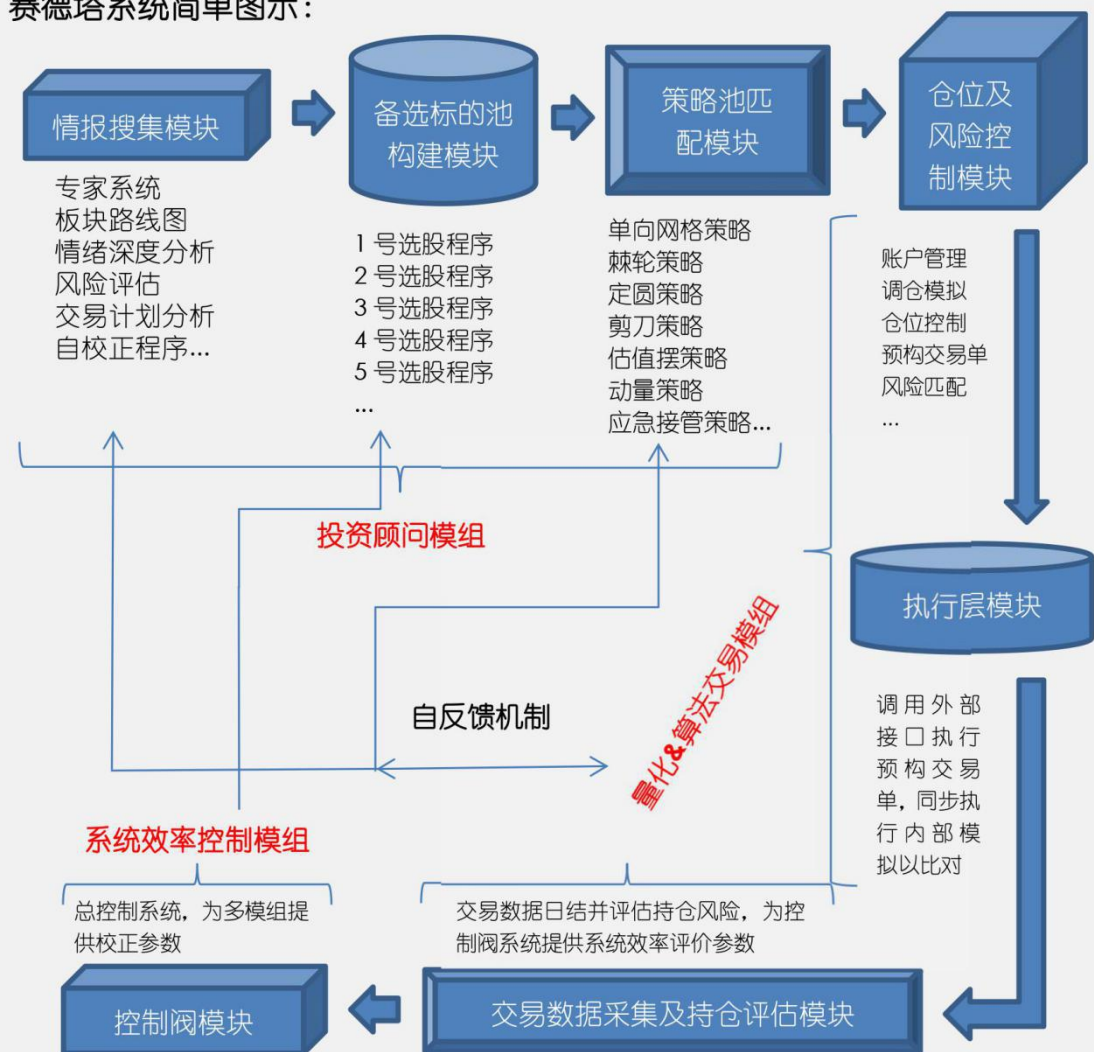
日期：2018/10/25

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](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:

当日盘面兑现昨日的弱化看多预期,但需要明确的是目前盘面并未脱离下降通道的潜在中继阶段,即大盘仍有可能进一步下探。同时,根据当日更新数据分析结果,目前系统继续维持昨日预判框架,次日以78.26%置信度增强看多修复观点,建议投资者优先离场或清理已有持仓,空仓投资者建议继续保持;而根据时间窗口分析结果,目前系统认可的下调持续期在3.51-6.00个交易日区间内,期间不排除大盘阶段性超跌修复的可能,而最近的一次显著修复距离当前节点的可能周期范围在0.70-1.20个交易日之间,即次日出现显著修复的可能性很高。另外,目前周级别预测继续维持看空,即根据阶段性长周期分析结果,大盘仍存在进一步下挫的可能性,但目前系统认为再次下调后将构筑未来一段时间以来的低点,投资者应注意底部确定情况下的试多操作,这里的前提条件是正向趋势稳定性得以确认,而确认的标准至少是当前修复阶段回撤时不出现大幅反转的征兆,相关技术图形应该对广大读者来说并不陌生。除此之外,目前月级别预期继续维持看多,年底机构及管理层要求指数上行的潜在需要非常明显,月级别系统看多存在现实基础,投资者即使要操作,深蓝超算也再次提醒向指数型权重标的的偏离,这里就包括了金融权重及上证50_核心权重标的,其中标的选择不作详细说明。

在操作原则上,继续暂时不强调低买原则,修复是否有效有待确认,投资者目前应继续按兵不动,同时短期回踩前注意减仓维持本金安全。在板块定位问题上,当日模糊匹配系统结果为:优先关注央视50_、上证50_、券商概念、超级品牌(框定题材都具有高度倾向性,请注意);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:上证50_、超级品牌,投资者今日适当需要关注模式定位题材则有:基本金属、油价相关、券商概念、草甘膦、稀土永磁、高送转、国产芯片(均为年内核心题材,当日模式识别也对应了大量上述核心权重题材)。深蓝超算再次严正提醒,目前短期不确定性很强,稳健性上讨论建议投资者继续等待正向趋势稳定后再行操作,但需要操作或有操作需求的,近期偏向性非常明确,超跌时应关注权重类标的的布局机会,且由于目前确定大级别低点还为时过早,投资者如需要操作,应作好部分浮亏的心理准备。

*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

当日盘面是兑现了昨日的弱化看多预期的,这也能很好解释昨日分裂的结论,一方面大盘确实承受极大压力,但另一方面机构拉升指数的需求又异常强烈,这也构成了当日盘面的主要内容。当然,对于类似盘面来说,深蓝超算必须继续定义为正向趋势非稳定性,因为目前还不确定是否仍存在稳定的负向趋势,毕竟目前处于一个指数趋势上的中继阶段,确认则至少还需要一个交易周的数据来衡量大盘的基本趋势倾向,或者说根据系统预测下周为承压周,则下周如不跌穿短期支撑或者维持一个基本正向趋势不变,则短期介入还是比较安全的。但在明确之前,如果像深蓝超算一样希望保持严格的本金安全理念,则深蓝超算不建议布局或者说应继续保持空仓。其他问题不多强调,今日内容较昨日同样具备较强的继承性,深蓝超算也不希望多做延展。

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:26.3083;昨日情绪指数:37.5566

当日主力情绪指数:27.4039

当日散户情绪指数:26.3081

主散情绪指数分析提示:主力全力接盘,散户抛盘居多

情绪指数定位结果:相对位置方向匹配

深蓝超算研究中心出品

历史匹配位置 5 个交易日指数波幅: 76.02

历史匹配位置 5 个交易日指数涨跌比例: -0.017292

历史匹配位置 5 个交易日指数波动率: 28.832

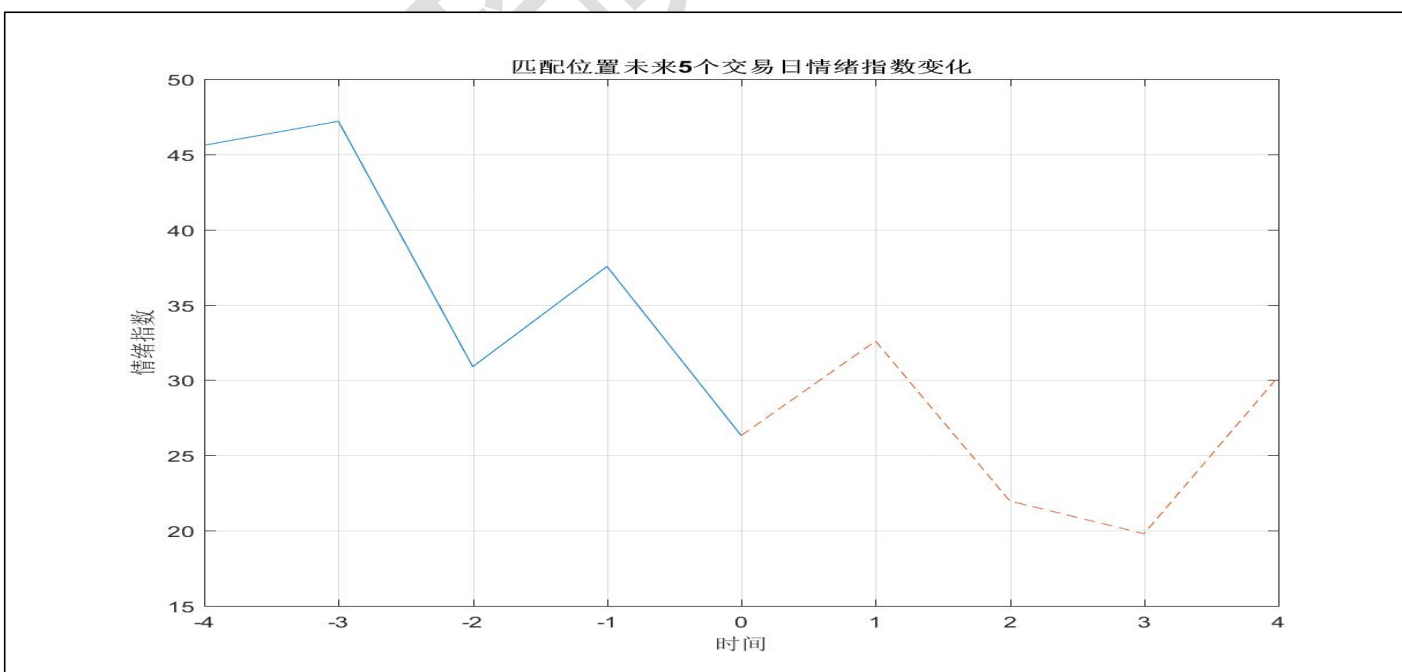
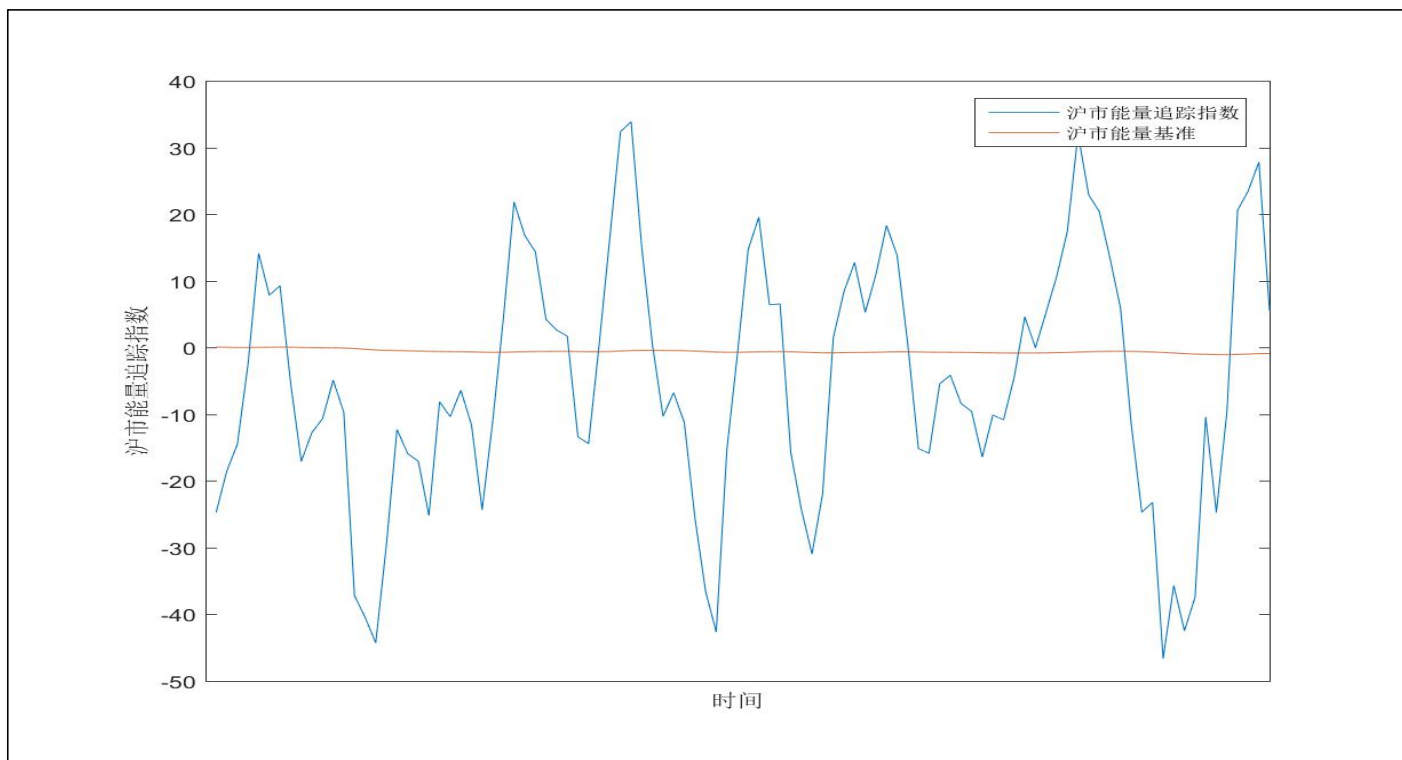
情绪指数是否处于增压区: 处于多头增压区

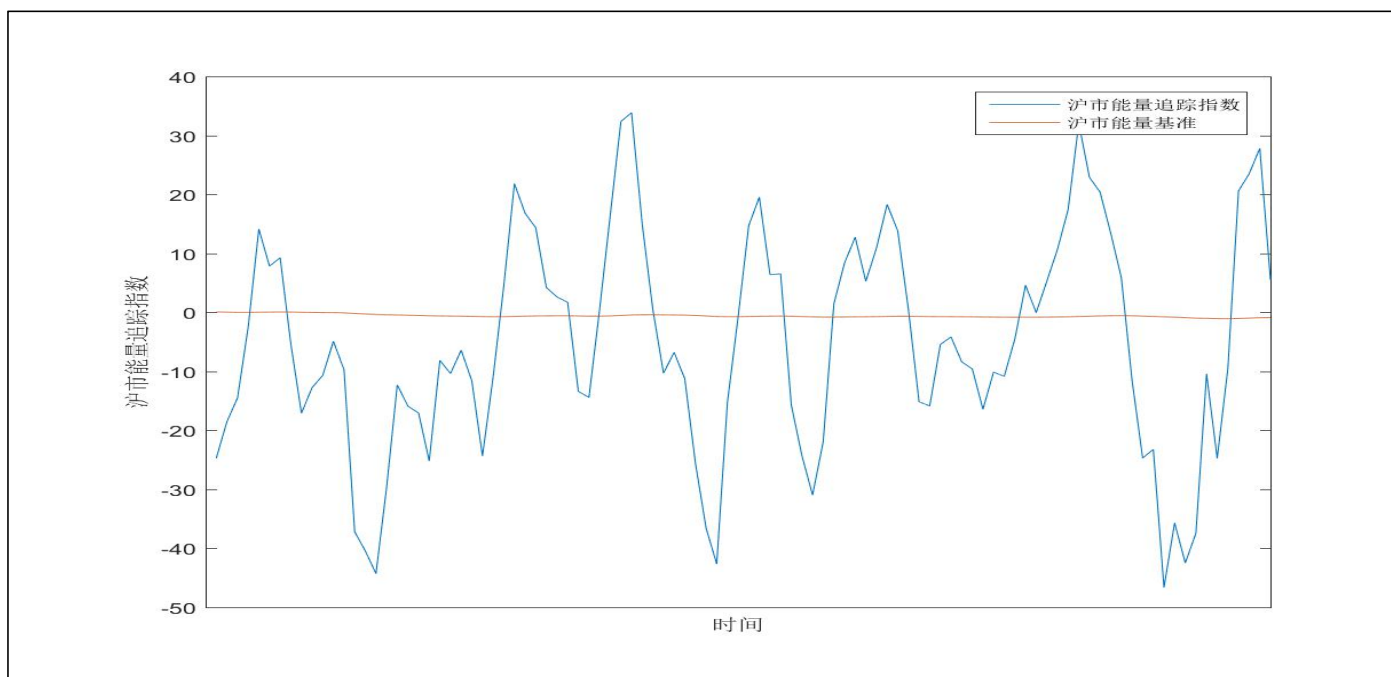
参照点指数反转 2%所需时间: 无参照点

情绪指数历史参照次日涨概率为: 0.78261; 次日跌概率为: 0.21739

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





当日更新内容分析如下：

- 1、必须事先声明，从目测角度说，大盘确实存在短期修复需要，而这种需要就体现在系统以 78.26%置信度提供次日看多预期上，系统分析表明当前弱势维持极限周期为 0.70-1.201 个交易日，即最晚到下周一大盘一定会出现较为显著的修复。但这里也不得不提一个隐忧，那就是日级别 IEA 显示盘面处于一个负向趋势的可变中继位置，即修复较强，则大盘将再出现一轮拉升，返回 2700 点，甚至更高点位都有可能，但如果修复偏弱，或者有其他因素干扰，则大盘将进入确定的负向阶段中，该阶段是大级别的，维持至少一周时间是很合理的，期间无法排除创新低的可能性，所以下周在近月盘面变化上是很关键的。深蓝超算必须提醒，一旦修复出现明确强势向上，拉开低点距离之后，阶段性调整只要有稳定支撑都可以介入，反之则应继续保持空仓。但在一切确定之前，深蓝超算还是提醒多看少动，避免不必要的本金损失。
- 2、周级别趋势目前继续框定为看空，即上面所说的第二种可能性，如确认是第二种可能，投资者需要作好指数创新低心理准备。
- 3、月级别上目前继续维持看多观点，从大级别预期上看，短期内大盘在整体情绪上已经出现了明显的转多迹象，但这种转多是由超跌引起的，因此要关注期持续性可能偏弱，只有在超跌诱发的看多转为资金推动的看多之后，投资者才可以确认该趋势是具备持续性的，原则很清晰，但为了管住手，深蓝超算还是建议投资者逐日要提醒自己注意这些事项，保护本金安全才能在需要真正发力时调动更多资源，对于这一点，深蓝超算认为是最能体现投资是系统性、繁复性工程的地方。

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	券商概念	5.1491	7	重现
2	租售同权	3.5082	1	新进
3	新三板	3.2388	1	新进
4	上证 180_	3.1525	1	新进
5	黄金概念	3.0973	2	新进
6	上证 50_	2.4640	3	新进
7	参股期货	1.7610	2	新进
8	中超概念	1.7262	2	重现
9	稀土永磁	1.2453	1	新进
10	债转股	0.9659	1	新进

目前月内暂以剧烈波动预期为主，目前盘面稳定性依然未确认恢复，继续提醒暂停交易（本周内可考虑减仓，达到单笔止损的可以止损，暂不推荐加仓）！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
AH 股	1
移动支付	1
央视 50_	1
上证 50_	1
石墨烯	2
智能电视	1
王亚伟系	1
蓝宝石	1
智能家居	1
氟化工	1
在线旅游	1
超级电容	1
券商概念	1
5G 概念	2
人工智能	1
共享经济	1
军民融合	1
超级品牌	2
乡村振兴	1
知识产权	1

历史数据匹配结果不需要深蓝超算做过多解释，目前大盘指数负向趋势稳定性过强，投资者建议维持观察状态，近期仅考虑减仓，暂不考虑建仓或加仓。这里短期特别建议投资者优先关注的目标为：央视 50_、上证 50_、券商概念、超级品牌。

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：基本金属；五日单元匹配概率为：15.95%；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：17.37%；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：券商概念；五日单元匹配概率为：16.99%；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：草甘膦；五日单元匹配概率为：16.32%；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：稀土永磁；五日多元匹配概率为：4.48%。

多元匹配板块为：上证50；五日多元匹配概率为：42.86%。

多元匹配板块为：高送转；五日多元匹配概率为：13.95%。

多元匹配板块为：超级品牌；五日多元匹配概率为：30.93%。

多元匹配板块为：国产芯片；五日多元匹配概率为：18.67%。

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：

多元匹配板块为：上证50；五日多元匹配概率为：42.86%。

多元匹配板块为：超级品牌；五日多元匹配概率为：30.93%。

当日模式识别程序定位中，今日较高置信度的题材为：上证50、超级品牌，投资者今日适当需要关注模式定位题材则有：基本金属、油价相关、券商概念、草甘膦、稀土永磁、高送转、国产芯片。需要提醒的是，如果出现持续兑现修复预期，则近期定位题材保持优先正向波动的可能性极高，持有相关题材标的的投资者近期就将获得离场机会，请投资者抓住机会，但暂时不建议开仓也不建议加仓，请注意。

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	万年青、合兴包装、恒顺醋业、鲁抗医药
中继类型	招商蛇口、申通快递、洽洽食品、高争民爆、伟隆股份、汤成倍健、招商银行、宏达矿业
进攻类型	长江证券、亚太药业、东北证券、南华生物、溢多利、联化科技、华瑞股份、华创阳安、梦百合、西部证券.....

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	招商蛇口、南华生物、裕兴股份、昊华能源

*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的合并，每日精选标的的采用 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！

*今日进攻类型标的的数量 (16 只) 过多，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。

*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）	修复有效	出现时间：11月？ 返回主升区间需：不确定
指数短中期趋势（周级别）	周级别调整	维持时间：下周？
指数超短期趋势（日级别）	日级别看多	最大延迟周期：0.70-1.20 个交易日左右

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

2018/10/25