

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：531 期

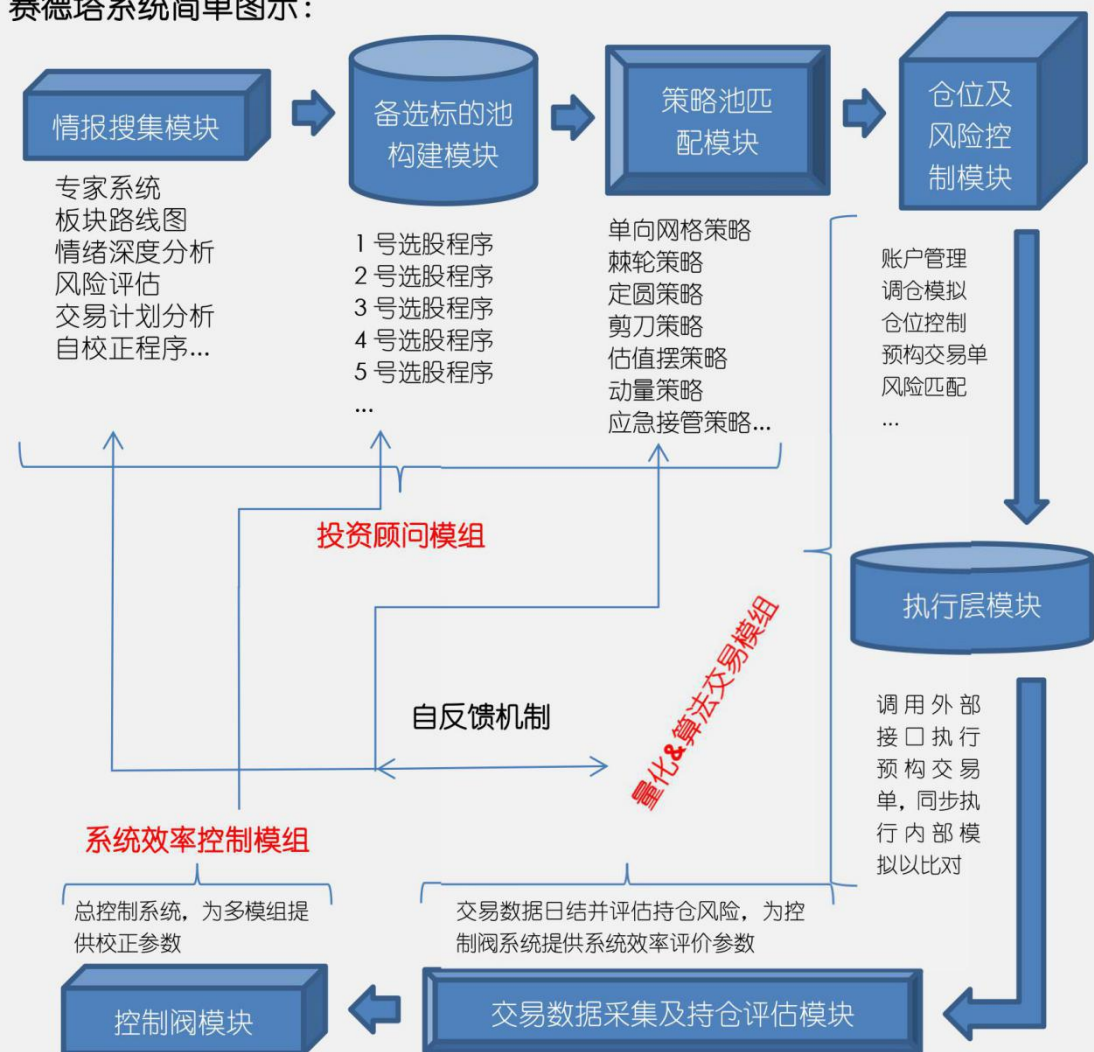
日期：2018/11/7

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:

昨日维持看空预期继续保持兑现实状态, 同时根据当日数据分析更新结果, 系统继续以 56.08% 置信度维持弱化看空调整预期 (大盘存在随时正向反扑可能性, 投资者当前应有适当仓位配置), 未来调整极限持续周期估计为 1.34-1.43 个交易日 (配合美国中期大选事件, 一个交易日左右大盘应存在较大变动)。与此同时, 目前系统修改周级别预期为看多, 月级别预期维持看多, 盘面整体估计偏好, 可预期范围内, 大盘应至少维持区间震荡走势, 投资者应考虑寻机介入机会, 其中推荐以低买为主, 不建议也不鼓励追逐买入, 操作风格应偏向短线 (周级别持仓)。同时, 需要额外提醒的是, 如果调整时跌幅扩大破坏整体正向趋势稳定性, 建议立刻撤出资金。

在操作原则上, 投资者应保持资金强流动性, 逢低考虑建仓部分随大盘调整的标的, 这里对于题材选择应以有效调整后的权重为主, 部分国家明确政策支持的创业板技术性题材也可以寻找介入机会, 且应尤其注意低买原则。而在板块定位问题上, 当日模糊匹配系统结果为: 优先关注稀缺资源、基本金属、油价相关、小金属、人脑工程、赛马概念 (能源资源类题材近期已定位, 兑现情况不重复强调, 目前系统倾向于资源题材保持连续性); 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: 基本金属、稀缺资源、小金属, 投资者今日应该适当需要关注模式定位题材则有: 黄金概念、上证 50、氟化工、5G 概念、国产芯片、草甘膦、国产软件、高送转。再次强调, 近期操作建议倾向于低买做多, 轻仓为主, 但提醒逢低买入, 唯一的变数是一旦出现破坏正向趋势稳定性的走法, 建议投资者立刻撤离。

*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

由于系统已连续提醒空头压力, 昨日预期在当日继续维持准确兑现实状态, 不再拓展说明。同时, 再次强调盘面目前处于可操作状态, 预期已发生变化, 中期区间内, 投资者应尽可能捕捉利润 (建议逢低布局, 跨周持有, 设置好止损或在破坏性走势出现时应急撤离):

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: 41.1805; 昨日情绪指数: 50.7939

当日主力情绪指数: 39.6219

当日散户情绪指数: 41.1834

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: 41.18

历史匹配位置 5 个交易日指数涨跌比例: 0.0025573

历史匹配位置 5 个交易日指数波动率: 17.4196

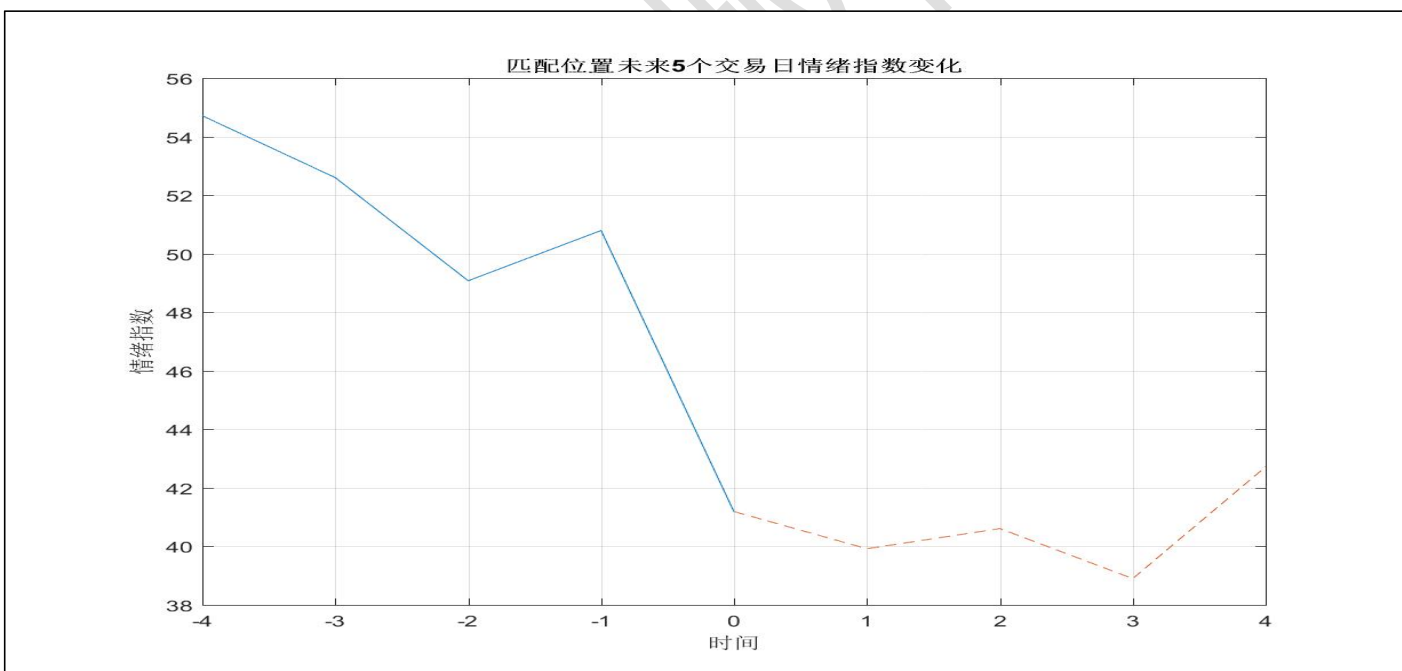
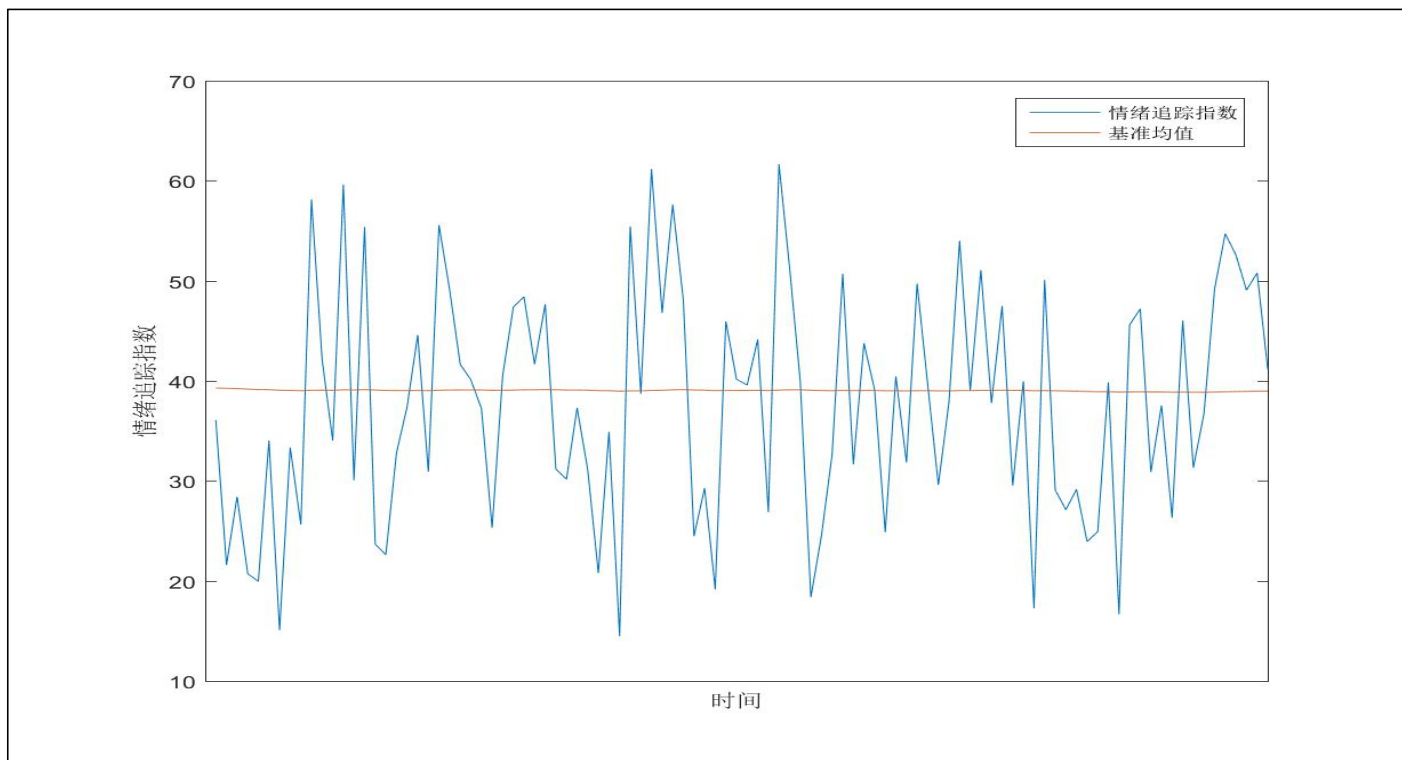
情绪指数是否处于增压区: 处于非增压区

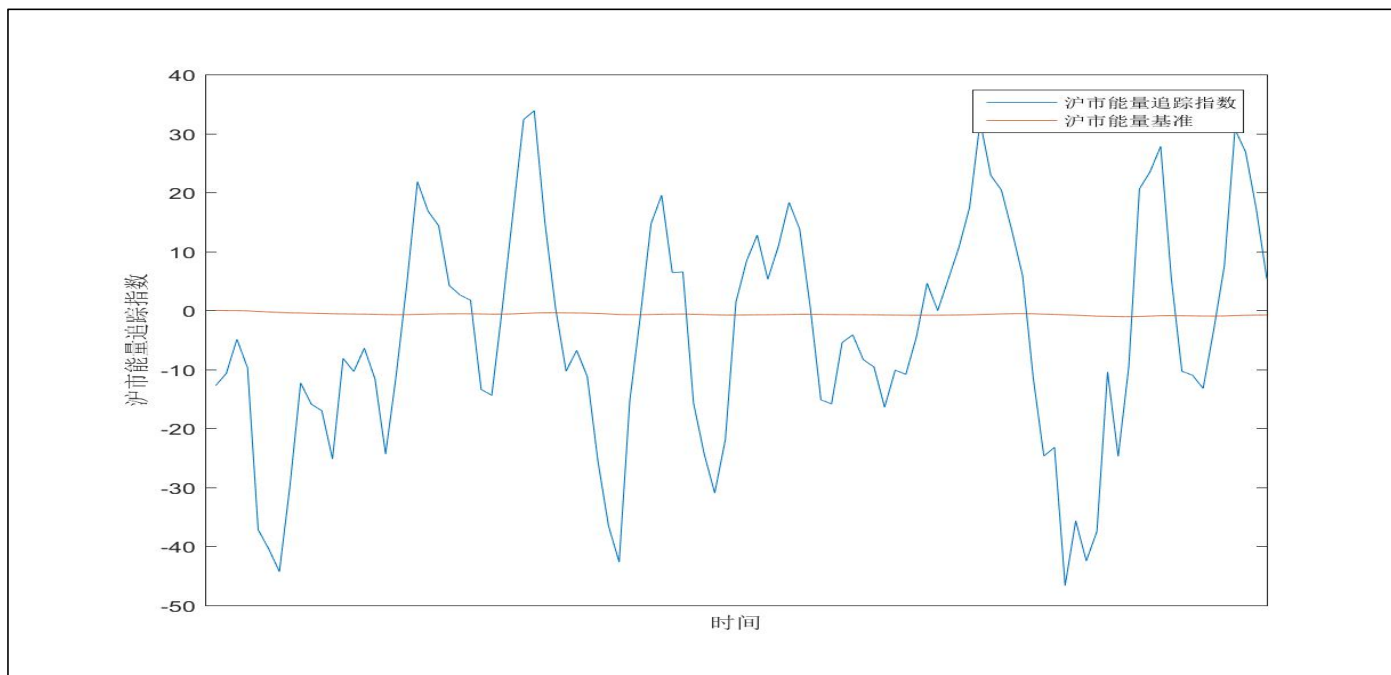
参照点指数反转 2% 所需时间: 186 个交易日

情绪指数历史参照次日涨概率为: 0.43925; 次日跌概率为: 0.56075

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





当日更新内容分析如下：

- 1、明确强调，从技术上说大盘仍处于弱化的衰退期，一个交易日左右周期存在一次转换机会，即大盘随时有可能出现反攻，目前大盘调整已出现概率上的弱化，如果无法成功反攻，则大盘将出现跨周调整，投资者应予以注意。
- 2、日级别上系统以 56.08%置信度维持弱化看空预期，系统中期预期偏向好转，投资者应优先考虑布局或底仓建立。
- 3、周级别预期转为看多，目前盘面整体预期向好，操作风险已大幅下降。
- 4、月级别预期维持看多，年底大盘大级别修复预期较为确定，投资者如布局标的较为稳定，可以考虑跨月持有。

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	5G 概念	8.1516	1	新进
2	小金属	6.5197	2	新进
3	猪肉概念	4.6697	1	新进
4	基本金属	4.4962	1	新进
5	黄金概念	3.8371	3	新进
6	ST 概念	3.6920	4	新进
7	人脑工程	3.6276	1	新进
8	国产软件	2.1774	1	新进
9	小米概念	2.0685	1	新进
10	生物识别	1.9407	2	新进

目前月内波动预期依然较为剧烈，目前盘面稳定性得到初步恢复确认，投资者可以考虑恢复交易（本周内可考虑逢低介入，短线持有）！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	2
稀缺资源	1
黄金概念	1
基本金属	1
油价相关	1
食品安全	1
送转预期	1
上海自贸	1
沪企改革	1
超导概念	1
氟化工	1
基因测序	1
小金属	1
国产软件	1
人脑工程	1
赛马概念	1
大飞机	1
单抗概念	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，目前大盘指数正向趋势稳定性恢复得到初步确认，而创投题材的政策向性也非常明确，因为接力题材暂时没有表现，需要注意题材持续性（资源能源板块已提前定位，参见前几期简报）。如此，投资者建议考虑恢复操作，但近期仅考虑谨慎逢低买入，不推荐追逐。这里短期特别建议投资者优先关注的目标为：稀缺资源、基本金属、油价相关、小金属、人脑工程、赛马概念。

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：稀缺资源；五日单元匹配概率为：17.66%；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：黄金概念；五日单元匹配概率为：17.32%；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：19.22%；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：氟化工；五日单元匹配概率为：20.32%；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：5G 概念；五日单元匹配概率为：23.33%；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：国产芯片；五日单元匹配概率为：20.27%；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：18.68%；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：基本金属；五日多元匹配概率逼近 100.00%。
- 多元匹配板块为：稀土永磁；五日多元匹配概率为：98.55%。
- 多元匹配板块为：小金属；五日多元匹配概率逼近 100.00%。
- 多元匹配板块为：国产软件；五日多元匹配概率为：16.22%。
- 多元匹配板块为：高送转；五日多元匹配概率为：3.49%。
- 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：基本金属；五日多元匹配概率逼近 100.00%。

多元匹配板块为：稀土永磁；五日多元匹配概率为：98.55%。

多元匹配板块为：小金属；五日多元匹配概率逼近 100.00%。

当日模式识别程序定位中，今日较高置信度的题材为：基本金属、稀土永磁、小金属，投资者今日适当需要关注模式定位题材则有黄金概念、上证 50、氟化工、5G 概念、国产芯片、草甘膦、国产软件、高送转：。当前大盘暂时脱离危险期，建议投资者恢复资金流动性并开始选择部分待介入标的随时准备逢低买入，且建议在近期调整预期强烈的时候进行，本次调整幅度应受控，但确认需要继续观察，周级别上投资者可以保持逢跌布局（强调一下，目前系统分析表明，即使确认局部正向趋势稳定性，当前也仅适合短线操作，中长期趋势稳定性尚未恢复，当前强调资源能源板块）。

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	合兴包装
中继类型	三晖电气、新宁物流、恒锋信息、贵州燃气
进攻类型	星期六、兆日科技、富安娜、易联众、珠江钢琴、北京科锐、华扬联众、三维通信、中国电影、德赛电池.....

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	恒锋信息、贵州燃气、星期六、兆日科技、富安娜、珠江钢琴、北京科锐、三维通信、浙江交科、神力股份

*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：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！

*今日进攻类型标的数量（19 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，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）	修复看多	出现时间：11 月或 12 月？ 返回主升区间需：不确定
指数短中期趋势（周级别）	周级别看多	开始时间：下周？

指数超短期趋势 (日级别)	日级别看空	持续周期: 1.34-1.43 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

2018/11/7

深蓝超算版权所有