

# 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：541期

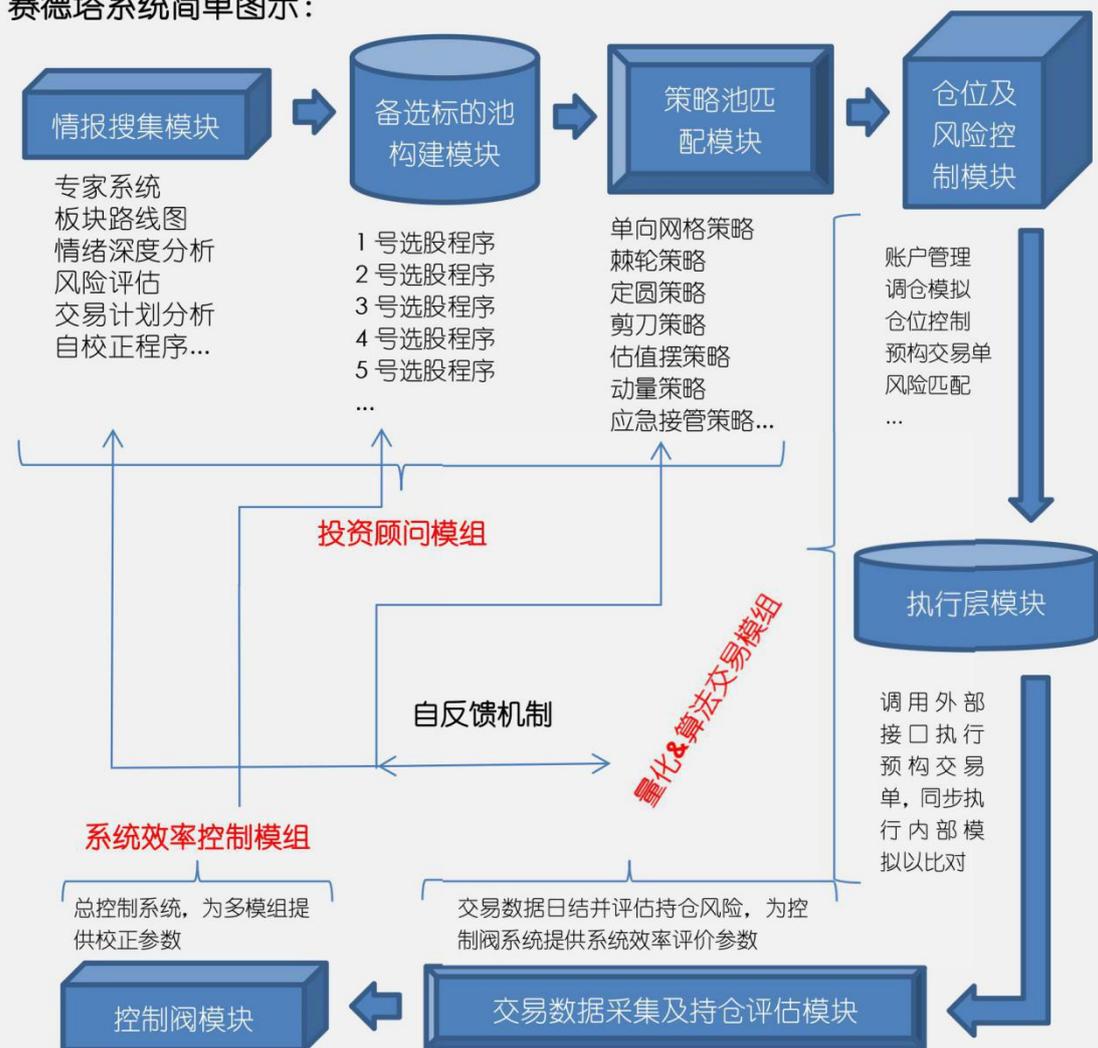
日期：2018/11/21

## 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:



## 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_C_ResearchCentre)

QQ: 504936733

Weichat:



欢迎留言或联系深蓝超算  
交流学习!

## 核心观点:

系统昨日看多反转预期已在当日兑现, 而根据当日更新分析结果, 系统以 58.45% 置信度再次将预期转空, 这也说明近期盘面如拟合结果所显示的, 应该是较为动荡的。同时, 根据当日时间窗口计算结果, 系统对调整的周期范围估计为 1.39-2.29 个交易日, 即大盘目前仍处于调整周期中, 且短期大盘继续维持调整阶段的时间还有 1-3 个交易日。所以, 除了继续看空本周内行情 (同时认可本周内逢低介入机会) 之外, 系统继续看多周级别和月级别预期。总结来说, 中期系统继续高度看好盘面持续上行, 短期调整机会将是投资者应该重视的低买机会, 而出于风险考虑, 深蓝超算建议维持逐级买入, 不推荐单次重仓买入模式, 同时投资者应控制配给的最大仓位, 毕竟当前系统仍未能确认远期大盘是否已经走出低谷, 或者说不确定中期修复之后是否还存在大级别调整; 如此, 交易持仓周期推荐继续维持短期 (周级别) 为主。

在操作原则上, 由于目前趋势稳定性依然得以保持, 且由于调整预期兑现, 再加上其预期维持周期并不长, 投资者应尽快寻找择机介入, 但买入应遵循宁低勿高, 循序渐进的原则 (低买和控仓仍是第一要务)。而在板块定位问题上, 当日模糊匹配系统结果为: 优先关注油气设服、油价相关、海洋经济、可燃冰 (模糊匹配结果具备高度指向性, 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, 今日无精确模式识别定位结果, 投资者今日应该适当需要关注模式定位题材则有: 数字中国、ST 概念。当前盘面正向趋势稳定性保持得非常好, 尽管大盘尚未展示出大周期持续修复得潜力, 但中期在指数上, 大盘至少应有所修复, 投资者应逢低寻找机会, 在指数性修复机会中寻找套利机会, 专业性越差的投资者建议保持越低的仓位。

\*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

昨日看多反转预期在当日已兑现, 且由于目前系统预测运行路径与实际走势高度一致, 深蓝超算不多做展开说明, 需要重视的是, 本轮调整是高度受限的, 周级别上大盘仍有进一步冲高的需要, 垃圾股炒作仍将存在并维持一段周期, 但推荐关注重点应在对指数有显著贡献的权重标的上。另外, 系统当日分析结果高度偏向于海上油气资源开发角度题材, 投资者应结合实际消息面寻找机会。其他问题不多展开, 调整将主要被限制于周内, 本周应逢低考虑介入机会, 且本周剩余交易日仍在调整过程中, 投资者应予以重视, 请勿追逐!

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, 局部无调整可能, 维持惯性上涨;

战略布局建议: 看多做多, 适度追高

当日情绪指数: 43.1531; 昨日情绪指数: 31.4823

当日主力情绪指数: 36.9467

当日散户情绪指数: 43.1726

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: 73.97

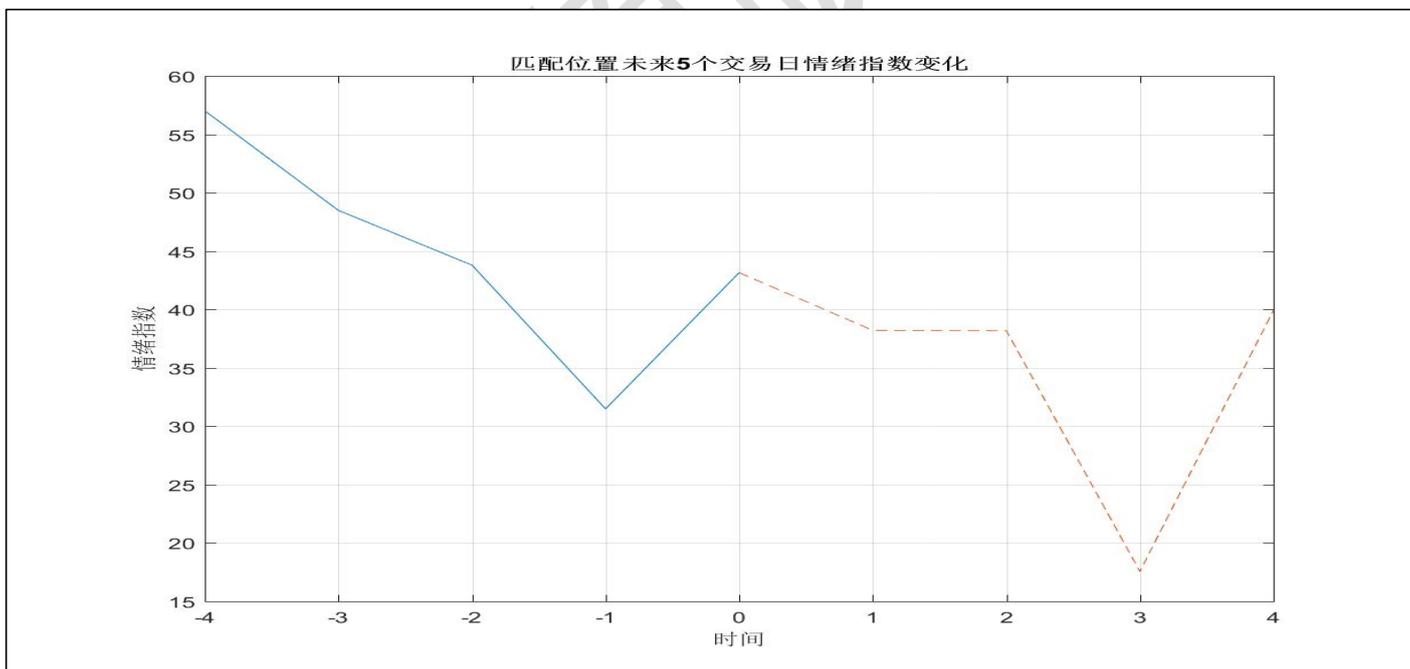
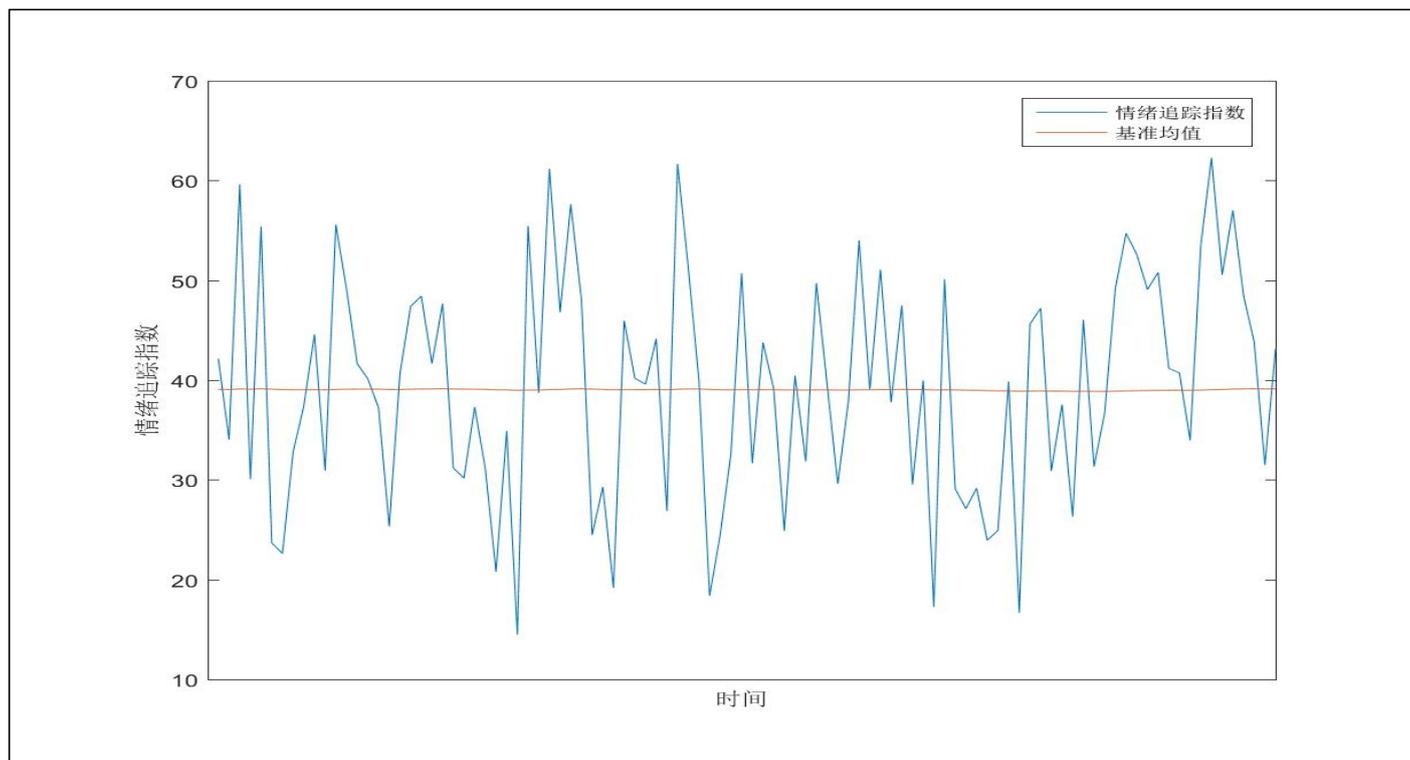
历史匹配位置 5 个交易日指数涨跌比例: -0.022129

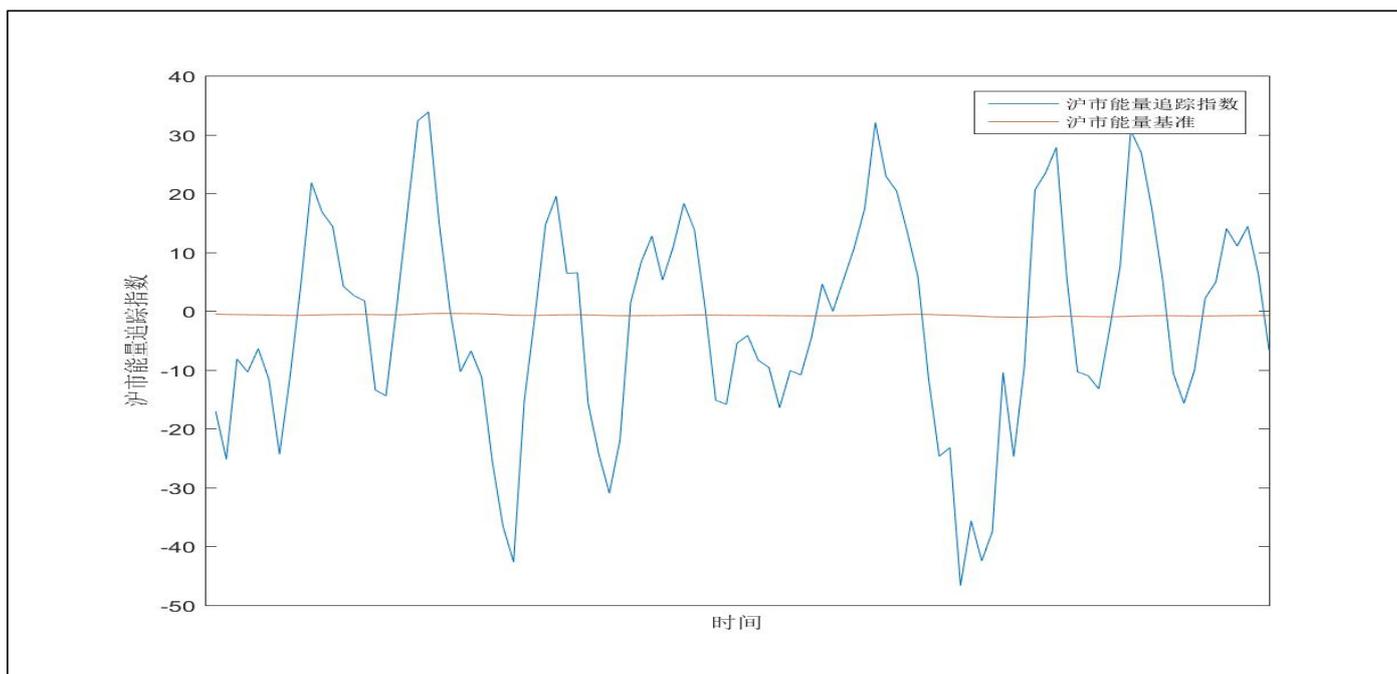
历史匹配位置 5 个交易日指数波动率: 36.7914

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: 40 个交易日

情绪指数历史参照次日涨概率为: 0.41553; 次日跌概率为: 0.58447





当日更新内容分析如下：

- 1、当前盘面分析结果显示，目前大盘仍处于调整周期中，且该调整过程应在本周内或最晚下周一结束，所以期间如果存在较大幅度调整应优先考虑介入；同时因为近期盘面较为动荡，提醒请勿追逐！另外，根据当日分析结果，系统以 58.45% 置信度提供看空调整预期，再次强调本周内逢低介入，逢高决绝买入。
- 2、周级别预期继续维持看好，由于预期偏好，本周逢低买入可考虑跨周持有，即周五买入风险较低。
- 3、月级别预期继续维持看好，中期预期持续维持向好，投资者买入应关注指数方面的快速修复。

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	快递概念	7.2029	2	重现
2	病毒防治	5.3384	2	新进
3	单抗概念	5.2909	1	新进
4	生物疫苗	4.7992	1	新进
5	免疫治疗	3.7769	1	新进
6	ST 概念	3.7132	6	重现
7	参股 360	3.6288	1	新进
8	独家药品	3.3849	1	新进
9	壳资源	3.3474	4	新进
10	体育产业	2.6704	2	新进

目前波动方向维持为正向，且目前盘面稳定性得到确认，但短期调整已经兑现，目前逢低建议优先考虑介入机会！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
ST 概念	1
稀缺资源	1
基本金属	1
油价相关	1
油气设服	1
海洋经济	1
氟化工	1
高送转	1
可燃冰	1
独角兽	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得到初步确认，且短期买入预期再次恢复，推荐逢低优先考虑买入。这里短期特别建议投资者优先关注的目标为：油气设服、油价相关、海洋经济、可燃冰（注意定位结果的偏向性）。

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：数字中国；五日单元匹配概率为：29.17%；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：ST 概念；五日多元匹配概率为：8.33%。

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，投资者今日适当需要关注模式定位题材则有：数字中国、ST 概念。目前定位结果显示，当前较为确认的机会在指数型权重和垃圾股标的上，海上油气资源角度可以考虑发掘机会，投资者可根据自身情况选择介入机会。

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	无
中继类型	宁沪高速
进攻类型	天能重工、浙江众成、晋亿实业、东杰智能、国泰集团、傲农生物、容大感光、百达精工、华夏幸福、柏莱雅.....

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** 浙江众成、容大感光、百达精工、嘉诚国际、华兰生物、苏泊尔、复星医药、重庆百货

\*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！

\*今日进攻类型标的数量（58 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。

\*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
指数中期趋势（月级别）	修复看多	出现时间：12 月？ 返回主升区间需：不确定
指数短中期趋势（周级别）	周级别修复	开始时间：下周
指数超短期趋势（日级别）	日级别调整	维持时间：1.39-2.29 个交易日

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

2018/11/21