

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：558期

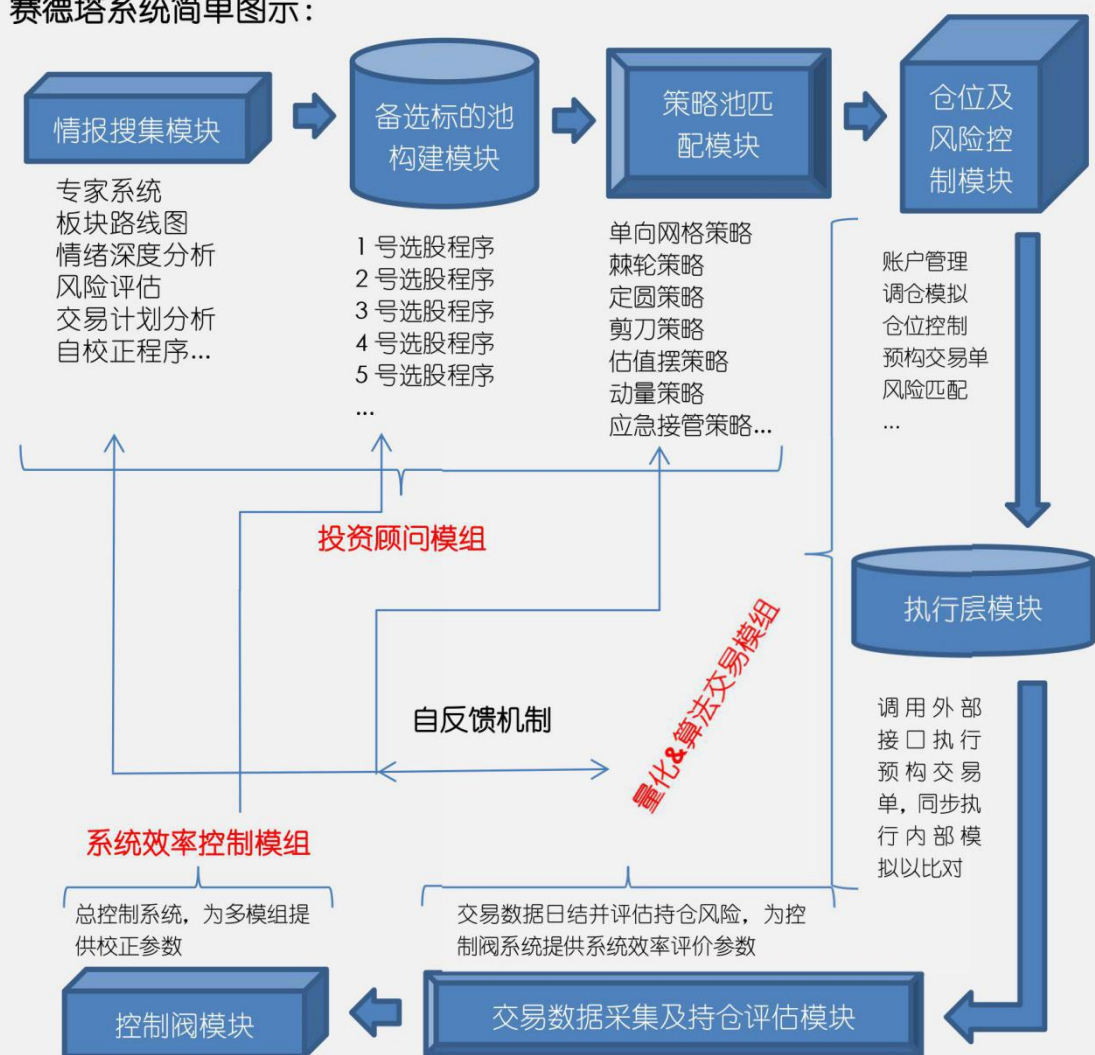
日期：2018/12/14

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

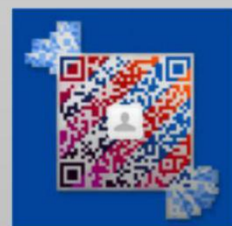
Telephone: 13870916570

深蓝超算对外站点:

https://xueqiu.com/DBS_C_ResearchCentre

QQ: 504936733

Weichat:



欢迎留言或联系深蓝超算
交流学习!

核心观点:

系统提前提示的周期不明的调整已在当日兑现，无论是在原预测节点周三还是在滞后周期的周四选择短暂离场，当日根据逢低优先考虑买入原则，应选择收割完成首波段利润后再次介入。而仅对于本周期内第一阶段预期来说，实际走向与预测走向也保持了高度拟合，另外由于系统原预测结果显示大盘在调整后还存在第一阶段冲高机会，所以未完成减仓的投资者目前也不应选择亏损离场（止损除外），下周应有本周期内理论上的最后一阶段离场机会，投资者应注意。根据当日分析结果显示，系统目前以 100% 置信度看多修复，而根据校准结果，下周大盘极有可能出现长阳突破走势，从而完成本周期最后一阶段冲高动作，进而再次进入周期性调整阶段。根据当前时间窗口估计，系统为日级别调整提供 1.18-1.61 个交易日的调整维持滞后期，逢低请保持仓位追加（整体仓位控制请继续维持，推荐控制仓位为 5 成，视风险承受能力可适当增加总仓位）。最后，根据周级别和月级别预测结果，系统继续维持周级别和月级别看多预期，除了本月内仍存在月级别收阴可能性之外，整体中期盘面还是看好，所以目前推荐继续操作，空仓等待并不是最优应对策略。

在操作原则上，调整因为已兑现，且根据预期本轮调整极有可能是日级别的，所以投资者应维持继续逢低买入，但下周中后阶段修复兑现时，因为处于本周期最后阶段冲高期间，建议投资者逢高尽快收割利润；因此，因为目前盘面仍处于熊市周期，投资者应尽可能降低利润预期，具体情况应根据自身情况决定（如风险承受能力较好的话，进行月级别操作也是支持的，但这意味着操作必须考虑跨月级别的期间周期性调整冲击）。而在板块定位问题上，当日模糊匹配系统结果为：优先关注次新股；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，投资者今日应该适当需要关注模式定位题材则有：ST 概念、油价相关、水利建设、券商概念、5G 概念、草甘膦、食品安全、高送转、超级品牌、国产芯片。再次强调虽然题材定位准确性较好，但根据盘面涨跌程度不同，不同阶段内定位题材可操作性可能不强，更精确地分析目前还在设计中，投资者应基于题材定位方向综合考虑盘面波动情况选择交易执行策略；但尽管如此，肯定的是，建议投资者在每次交易时必须制定完备的计划，在考虑到最好和最坏情况的前提下依据策略进行交易，无计划交易在当前阶段是极具危险性的。

*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

如上面所说明的，系统确定短期内将出现的调整已在当日兑现，并未延伸至滞后期，只要在周三节点附近清理完持仓的，今日都是应该反向再次介入的，因为该操作与目前深蓝超算个人操作是一致的，都是将本波动周期分为两段来操作，而至于该波动周期为什么可以分两段来操作，之前也有提示，这里不再赘述。对于实际操作来说，深蓝超算一向是提示因人而异，但深蓝超算也不断强调投资者必须清晰认清目前所处阶段，后面涨跌可能性如何，持续时间有多久，中长期展望又如何，这都是投资者在制定具体执行策略之前必须清楚的，否则任何操作都会像无头苍蝇一样，逢多忍不住追，逢空忍不住跑。然而，深蓝超算在往期也强调过，虽然赛德塔系统设计的初衷就是部分充当路径规划工作，并最终拥有自主分析、操作能力，但百分之百准确对于人类还是机器来说都是不存在的。对于深蓝超算个人来说，为什么预测不可能百分之百准确，个人的解释永远都是数据不足，毕竟对于现有技术来说，获取所有扰动因子的相关数据是根本不可能的，所以在确保预测效率尽可能高的前提下，长期以同一原则和规则操作是可以保持收益长期累积的，这也是目前深蓝超算所作工作的最终目标。

题外话说到这里，继续看一下部分直输内容；

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

深蓝超算研究中心出品

当日情绪指数: 15.3674; 昨日情绪指数: 47.1605

当日主力情绪指数: 16.8841

当日散户情绪指数: 15.3674

主散情绪指数分析提示: 市场情绪完全由散户主导, 主力买盘偏强, 局部大资金埋伏较多

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: 50.58

历史匹配位置 5 个交易日指数涨跌比例: 0.00039455

历史匹配位置 5 个交易日指数波动率: 21.6276

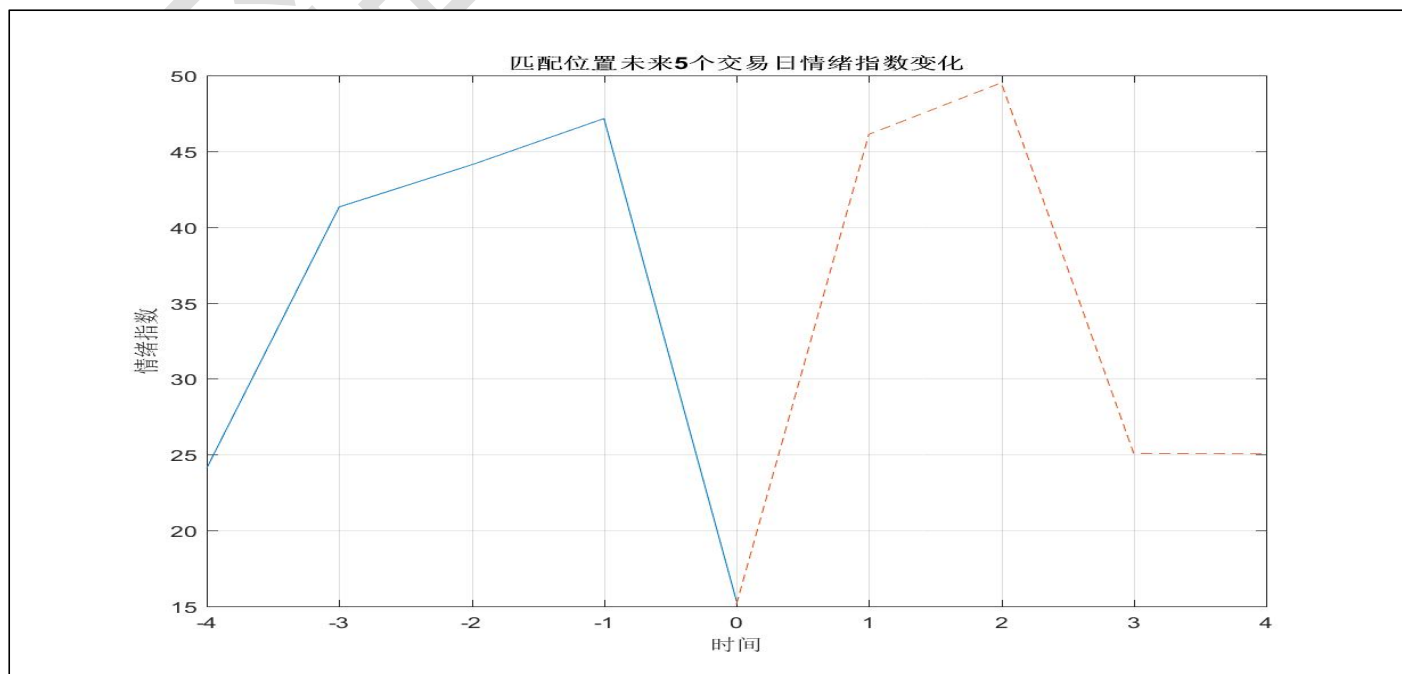
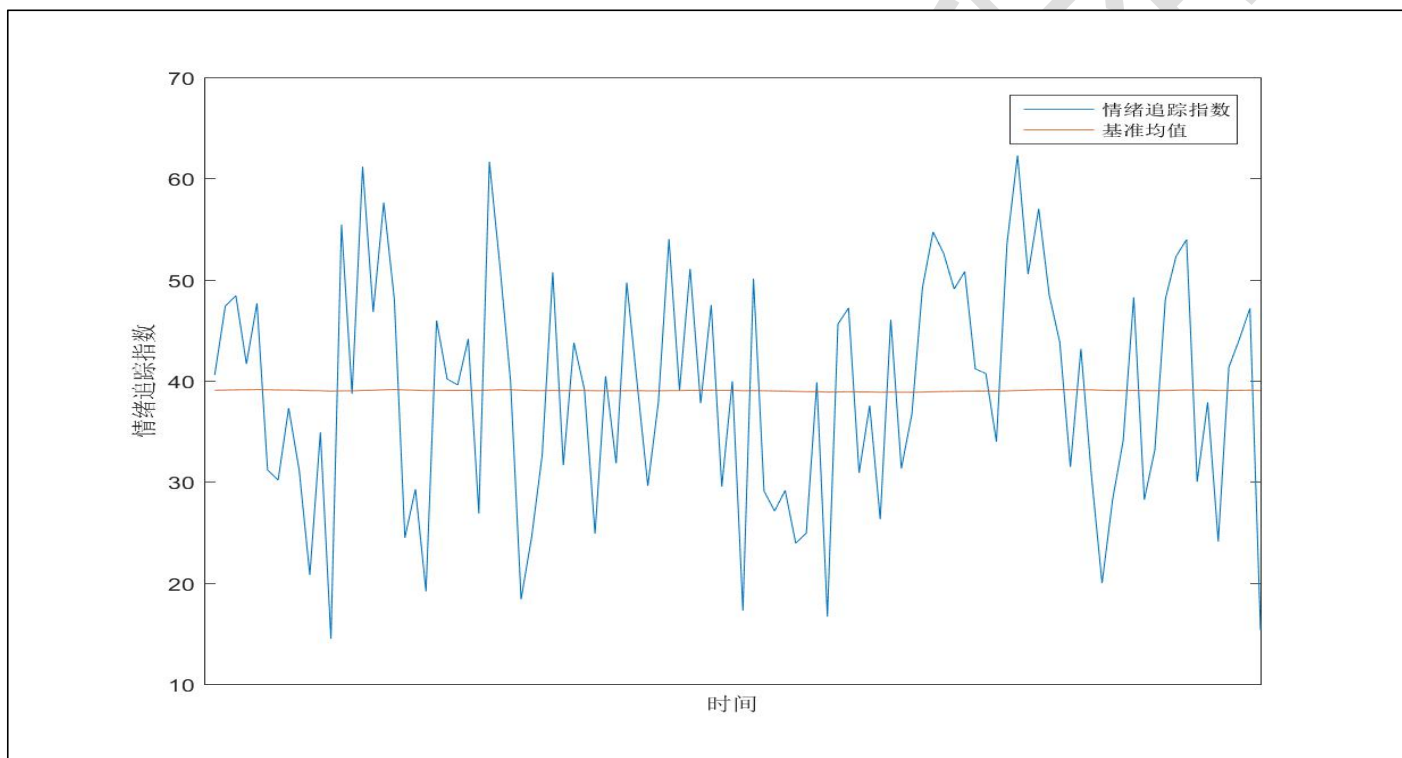
情绪指数是否处于增压区: 处于多头增压区

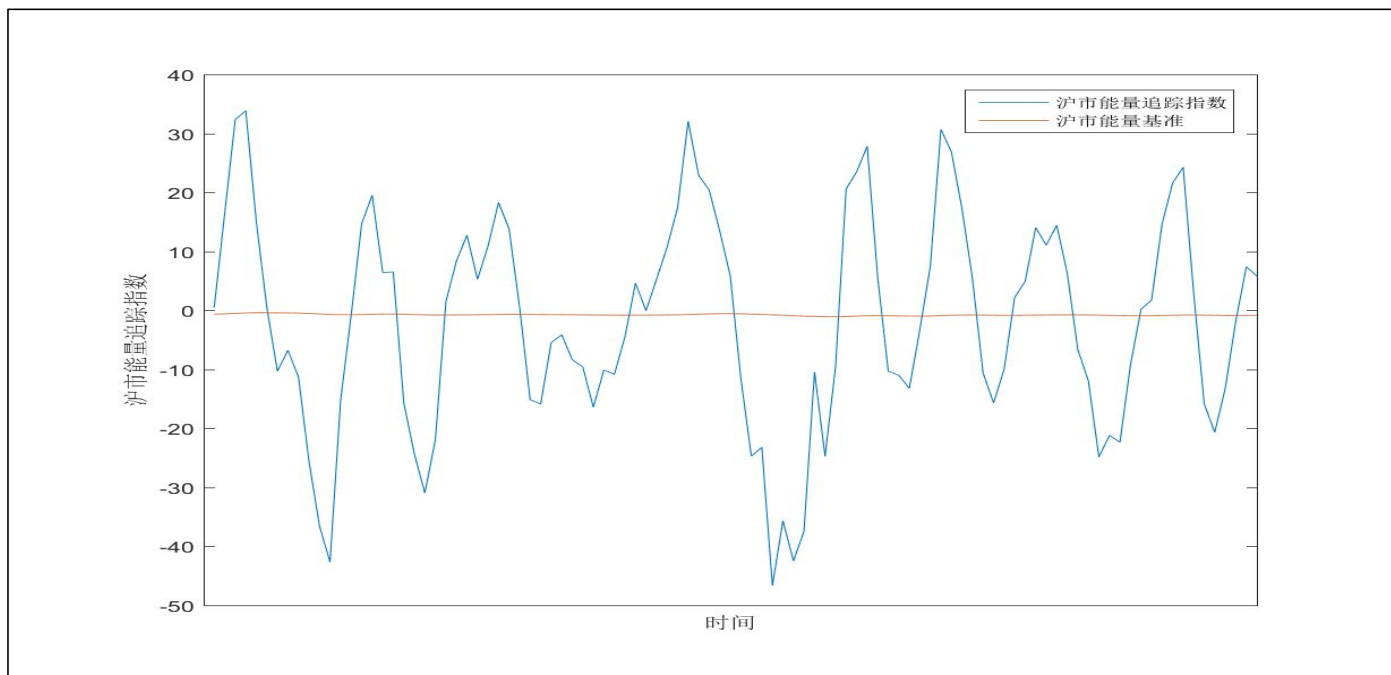
参照点指数反转 2%所需时间: 6 个交易日

情绪指数历史参照次日涨概率为: 1; 次日跌概率为: 0

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: 近日盘面偏多震荡格局或将出现长阳突破, 震荡中可适当布局拉指数标的, 看多做多





当日更新内容分析如下：

- 1、投资者应意识到一个问题，目前调整仅是暂时的，本波段内的继续修复仍是具备较高可能性的。但也必须提醒，在下周短期修复后，由于大盘将不可避免地运行到局部多头动能的高点，再次出现周级别调整的可能性非常高，所以无论是将本周期分为两段操作的投资者还是无视调整继续持仓的投资者，推荐在下周必须选择清理所有持仓，目的是避开下一周期的调整阶段，降低收益回撤的可能性和程度。最后，也必须肯定的是，目前中期大盘，在春节前是暂时不存在大级别调整的，所以本阶段投资者可以保持操作状态，期间只需要避开周期性的调整阶段即可；但另一点重要的是，控仓依然是目前的核心问题。
- 2、当日系统以 100%置信度提供看多预期，系统预测潜在日级别调整持续周期为 1.18-1.61 个交易日（但可能性极低，因为目前情绪指数已经被压缩至多头反转的极限水平，历史数据对比，该位置是百分之百会出现反转修复的，所以之前提示的逢低买入建议在当日是有效的）。根据当前预期，深蓝超算已经完成第二阶段布局，虽然留有追加余地，但在可能性较小的前提下，下周出现修复获利机会是一定会选择优先离场的，推荐投资者也这样处理。
- 3、周级别预测和月级别预测目前都维持看多，无论如何调整，如何维持，下周出现修复的可能性都是确定，投资者应该优先注意逢高离场。另外，由于月级别预期依然向好，并不在乎风险持续作中长线的投资者（虽然不推荐）则应该继续坚持逢低追加持仓（实在要这样操作，请保持每次追加仓位之间的距离足够大，也就是说，根据深蓝超算的操作原则，如果熊市期选择长线操作，必须考虑到大盘崩溃向下的可能性，并对此做好对应的仓位调动安排）。

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	超级品牌	4.9378	3	重现
2	上证 50	2.5637	1	新进
3	食品安全	2.3171	2	新进
4	油价相关	1.4123	2	新进
5	节能环保	1.0673	1	新进
6	粤港自贸	1.0001	2	重现
7	水利建设	0.6459	4	重现
8	海绵城市	0.5719	2	新进
9	赛马概念	0.5275	1	新进
10	ST 概念	0.3237	3	新进

目前波动方向维持为正向，但稳定性再次回到被破坏边缘，短期投资者应注意逢低优先买入，下周冲高机会一旦出现，只出不进，推荐下周尽快出清持仓！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
煤化工	1
次新股	1
创投	1
ST 概念	1
移动支付	1
水利建设	1
石墨烯	2
北斗导航	1
土地流转	1
智能电视	1
王亚伟系	1
生态农业	1
蓝宝石	1
智能家居	1
燃料电池	1
氟化工	1
基因测序	1
小金属	1
超级电容	1
券商概念	1
人工智能	1
超级品牌	1
新能源车	1

历史数据匹配结果不需要深蓝超算做过多解释，目前大盘指数正处于明确的正向趋势待稳定性待修复区间中，当前注意逢低优先买入，下周逢高优先卖出。这里短期特别建议投资者优先关注的目标为：次新股。

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：ST 概念；五日单元匹配概率为：29.23%；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：20.76%；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：水利建设；五日单元匹配概率为：22.19%；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：20.51%；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：23.58%；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：21.32%；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：上证 50；五日多元匹配概率为：80.00%。
 多元匹配板块为：食品安全；五日多元匹配概率为：12.86%。
 多元匹配板块为：高送转；五日多元匹配概率为：28.09%。
 多元匹配板块为：超级品牌；五日多元匹配概率为：15.38%。
 多元匹配板块为：国产芯片；五日多元匹配概率为：20.51%。
 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：80.00%。

当日模式识别程序定位中，今日较高置信度的题材：上证 50，投资者今日适当需要关注模式定位题材则有：ST 概念、油价相关、水利建设、券商概念、5G 概念、草甘膦、食品安全、高送转、超级品牌、国产芯片。当日大幅调整与昨日无定位是对应的，从某种角度看，不难发现，大盘逼近调整边缘时，盘面题材都不具备任何规律性，这也是衰退的临界特征之一。而根据当日定位题材，下周盘面以权重为主迫使指数再次修复的可能性也非常大，投资者在执行当前交易计划的同时，推荐下周优先考虑离场机会。

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	奥特迅、美芝股份、移为通信、宏发股份、诺发股份、华体科技
进攻类型	深天地 A、松发股份

备选池类型	机筛结果 (已剔除停牌和 ST 股)
超级绩优	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	华体科技、移为通信、奥特迅、诺邦股份、深天地 A、松发股份

*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！

*今日没有类型标的数量过多，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

底部类型		中继类型		进攻类型		廉价小盘	
代码	名称	代码	名称	代码	名称	代码	名称
002882	金龙羽	603603	博天环境	603933	睿能科技	300152	科融环境
002243	通产丽星	000068	华控赛格	600217	中再资环	000554	泰山石油
600242	中昌数据	000023	深天地 A	603268	松发股份	600866	星湖科技
603268	松发股份	002451	摩恩电气	000023	深天地 A	002295	精艺股份
601968	宝钢包装	002414	高德红外	002776	柏堡龙	002418	康盛股份
300648	星云股份	300399	京天利	002656	摩登大道	600448	华纺股份
603688	石英股份	002776	柏堡龙	002701	奥瑞金	601177	杭齿前进
300128	锦富技术	300649	杭州园林	002080	中材科技	600359	新农开发
300457	赢合科技	300500	启迪设计	002810	山东赫达	000560	我爱我家
002027	分众传媒	300596	利安隆	600809	山西汾酒	603828	柯利达
600555	海航创新	603637	镇海股份	300457	赢合科技	601228	广州港
600619	海立股份	300457	赢合科技	000550	江铃汽车	000590	启迪古汉
000703	恒逸石化	000999	华润三九	002399	海普瑞	000582	北部湾港
002752	昇兴股份	600874	创业环保	601579	会稽山	002214	大立科技
300721	怡达股份	002399	海普瑞	603605	珀莱雅	002606	大连电瓷
300429	强力新材	002883	中设股份	600600	青岛啤酒	601949	中国出版
002706	良信电器	600977	中国电影	600132	重庆啤酒	600828	茂业商业
603638	艾迪精密	300429	强力新材	603728	鸣志电器	300214	日科化学
600675	中华企业	603711	香飘飘	601500	通用股份	002620	瑞和股份
002528	英飞拓	603709	中源家居	600977	中国电影	000797	中国武夷
600220	江苏阳光	002606	大连电瓷	300429	强力新材	000920	南方汇通
002747	埃斯顿	600406	国电南瑞	603711	香飘飘	002438	江苏神通
002564	天沃科技	002686	亿利达	603828	柯利达	000757	浩物股份
600886	国投电力	600559	老白干酒	000902	新洋丰	000565	渝三峡 A
300266	兴源环境	300662	科锐国际	603558	健盛集团	002084	海鸥住工
300497	富祥股份	300144	宋城演艺	600315	上海家化	000599	青岛双星
600352	浙江龙盛	002621	三垒股份	600406	国电南瑞	603323	吴江银行
600900	长江电力	002856	美芝股份	603377	东方时尚	600891	秋林集团
002731	萃华珠宝	601088	中国神华	603444	吉比特	603167	渤海轮渡
601668	中国建筑	603679	华体科技	002731	萃华珠宝	300164	通源石油
600965	福成股份	002624	完美世界	603098	森特股份	600984	建设机械
600559	老白干酒	600681	百川能源	601668	中国建筑	300086	康芝药业
600246	万通地产	300622	博士眼镜	600270	外运发展	002083	孚日股份
300483	沃施股份	000688	国城矿业	300214	日科化学	300190	维尔利
002724	海洋王	002808	恒久科技	300014	亿纬锂能	002487	大金重工
002506	协鑫集成	600643	爱建集团	002212	南洋股份	600865	百大集团
002816	和科达	600305	恒顺醋业	000813	德展健康	000909	数源科技

深蓝超算研究中心出品

300401	花园生物	300240	飞力达	002394	联发股份	600292	远达环保
000656	金科股份	600377	宁沪高速	000920	南方汇通	300249	依米康
600873	梅花生物	603806	福斯特	000656	金科股份	000838	财信发展
002016	世荣兆业	002142	宁波银行	603288	海天味业	300218	安利股份
002320	海峡股份	300546	雄帝科技	300499	高澜股份	600213	亚星客车
600267	海正药业	300436	广生堂	603630	拉芳家化	300193	佳士科技
300212	易华录	002679	福建金森	600774	汉商集团	002628	成都路桥
603819	神力股份	600885	宏发股份	002812	恩捷股份	600780	通宝能源
000688	国城矿业	002373	千方科技	002320	海峡股份	600501	航天晨光
601233	桐昆股份	603043	广州酒家	000538	云南白药	002565	顺灏股份
603027	千禾味业	300096	易联众	300651	金陵体育	002483	润邦股份
002266	浙富控股	300233	金城医药	600887	伊利股份	600354	敦煌种业
000886	海南高速	603186	华正新材	000688	国城矿业	600969	郴电国际

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）	看多	出现时间：1 月？ 返回主升区间需：3 个月？
指数短中期趋势（周级别）	周级别看多	出现时间：下周
指数超短期趋势（日级别）	日级别修复	调整可能维持时间：1.18-1.61 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，下周同一时间我们再见，祝各位好运！

深蓝超算研究中心

2018/12/14