

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：564期

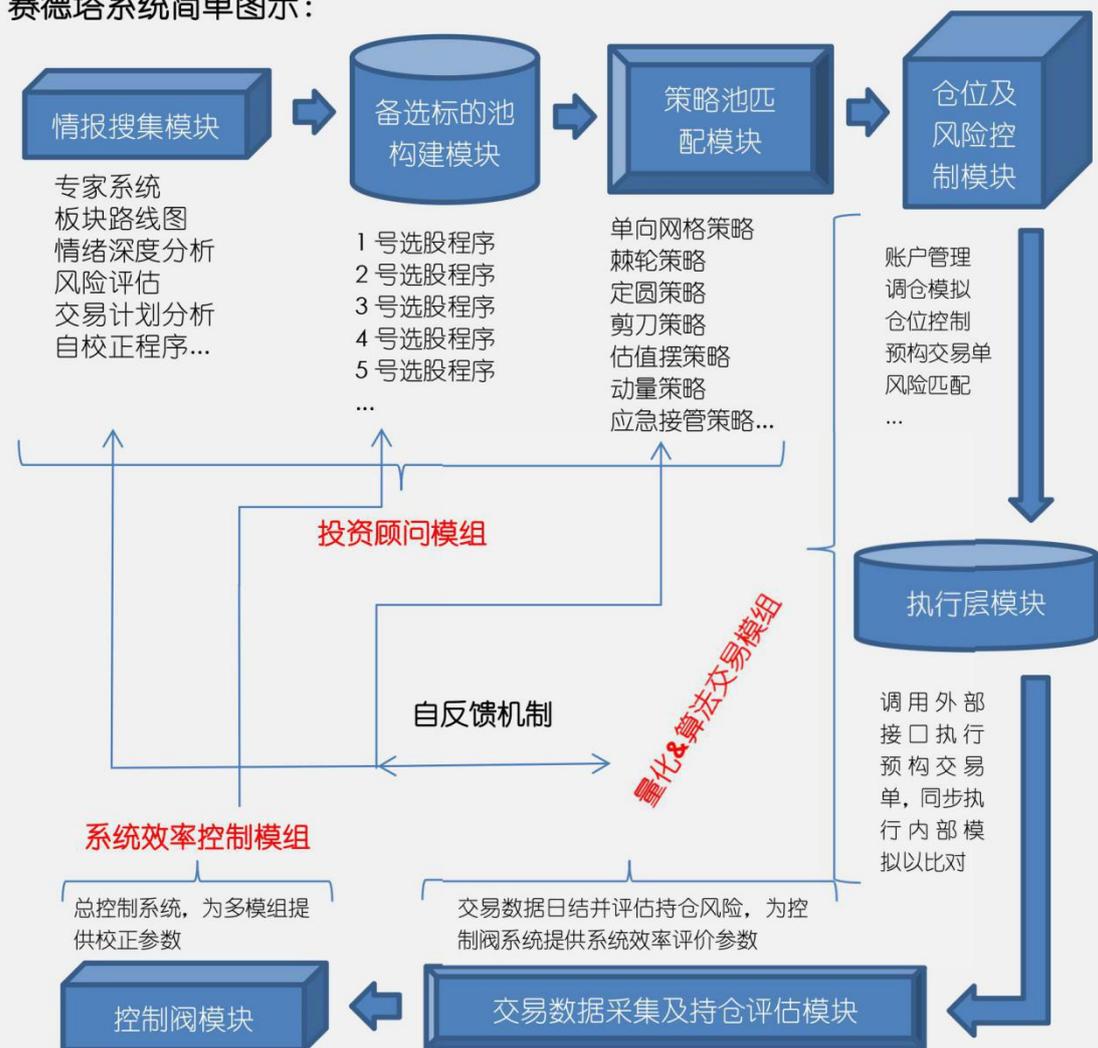
日期：2018/12/24

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:

上周五弱调整预期未兑现，短期市场摆动不确定性依然保持相对强势，目前短期趋势依然保持较难精确度量。根据当日分析结果，系统以 73.63%置信度维持短期看空预期（预测最大延迟周期为 1.15-1.40 个交易日），这与当日无量翻红有着必然的联系。目前场内买量极弱导致市场存在随时下调的可能性，根据原预期路径，本月的月级别调整可以确认将兑现，且短期调整需要依然存在，但在本月调整的基础上，系统继续维持月级别看多预期，即考虑到节点已经逼近月末，再加上当日更新的周级别看多预期，短期在调整预期的基础上，大盘应逐渐出现一定程度的修复，因此深蓝超算已经说明，个人计划采用延长持仓周期的方案以更大的弹性弥补当前阶段交易已经造成的损失。但对所有投资者而言，现在的几个重点问题是，触及止损必须离场，控仓不变，继续维持 50%以下，止损水平继续稳定在 20%左右（即全仓的 10%左右），买卖继续维持高卖低买原则，目标继续维持减少损失优先，盈利为次要目标，这就意味着短期保持风险控制依然是最重要的（以上提供参数均为个人操作设置阈值参数，个人应依据标的的情况选择，止损水平需参考个人风险承受能力以及持股标的的波动水平综合确认）。

在操作原则上，短期负向趋势稳定性继续维持，损失不大的投资者还是建议延长持股周期为跨月，等待下月大局转好，当前因为市场成交过于寡淡，投资者必须注意不推荐继续追加持仓，特别对于那些仓位已经接近 5 成的投资者，目前应静观其变，或者尽可能以高抛低吸方式降低持仓成本。而在板块定位问题上，当日模糊匹配系统结果为：优先关注 5G 概念和超级品牌；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：草甘膦，投资者今日应该适当需要关注模式定位题材则有：次新股、上证 50、国产软件、券商概念、5G 概念、高送转、超级品牌、国产芯片。继续维持上周五主要操作建议的前提下，再次强调，目前主要目标已经从盈利转为减少损失，因此近期操作的重点已经发生迁移，投资者必须注意目前的主要原则，但如果是无持仓或已清仓投资者，推荐继续维持至下月市场好转。

*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

如上面所提示，近期隔夜波动不确定性较强，精确度量具有很大的难度，或者类似当日情况，因此市场成交寡淡，市场承受的非市场因素干扰过于严重，投资者仅能依据当前市场所处格局或者状态来确认近期操作的基本方向。一般地说，当前仍处于严格熊市中，而更重要的是，目前大盘处于一次月级别调整的尾声，短期虽然盘面仍承受较为严重的压力，但跨周和跨月周期下，大盘应出现逐渐修复的中期趋势，这就意味着不少标的，如没有选择错误的话，应出现一定程度的修复；这里的底线是，对于当前阶段操作来说，投资者至少可以挽回部分损失，而对于一些表现较好的标的，投资者甚至可以期望一定程度的回报。但这里再次强调一下，尽管周级别和月级别预期暂时看好，但季度预期仍呈现 IEA 谷底状态，这就意味着季度反转有可能出现但也有可能继续延长。如果要具体说，期望大盘重回季度级别修复状态，等待半年左右的长周期并不是不可能的，所以再次强调，本阶段操作追逐的是少量机会带来的利润，保护本金继续应作为第一要务来处理。其他问题不再展开，继续看一下当日部分直输内容：

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

当日情绪指数：49.495；昨日情绪指数：40.3389

当日主力情绪指数：45.2636

当日散户情绪指数：49.4999

主散情绪指数分析提示：主力离场居多，散户全力接盘

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：60.92

历史匹配位置 5 个交易日指数涨跌比例：0.00018926

历史匹配位置 5 个交易日指数波动率：28.6894

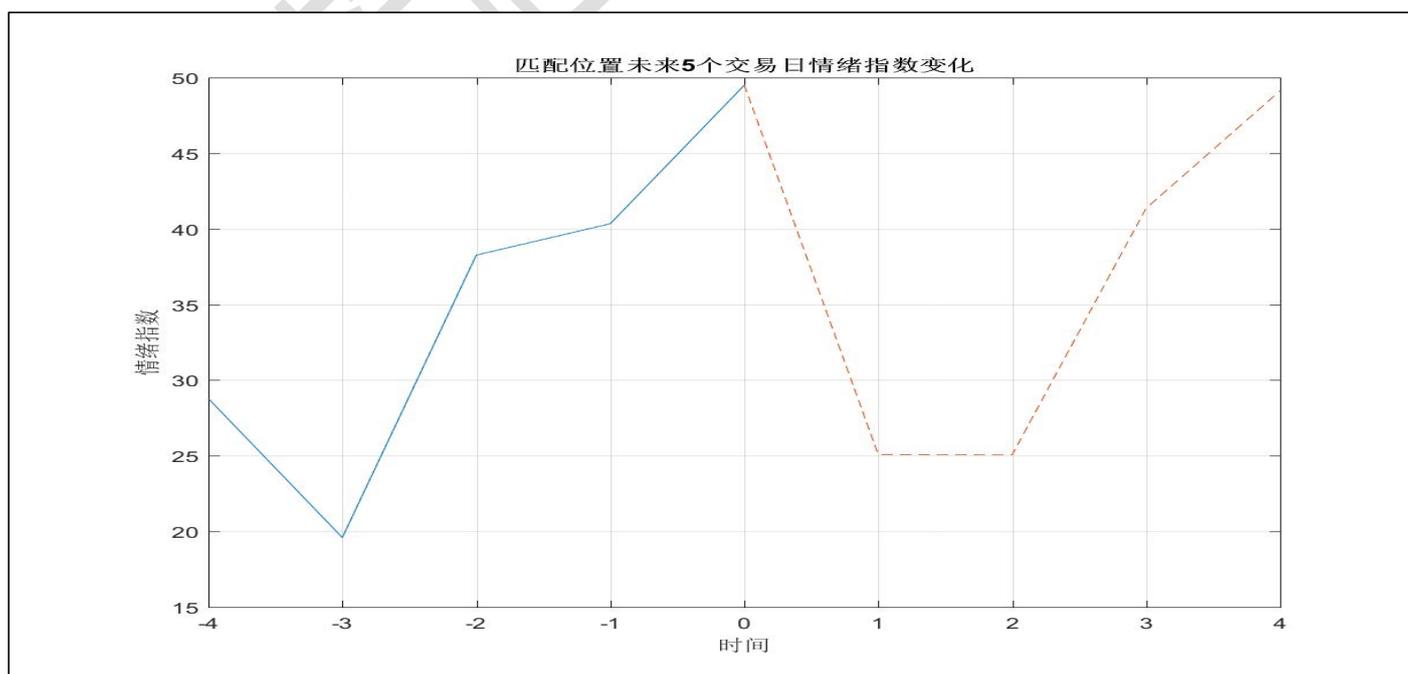
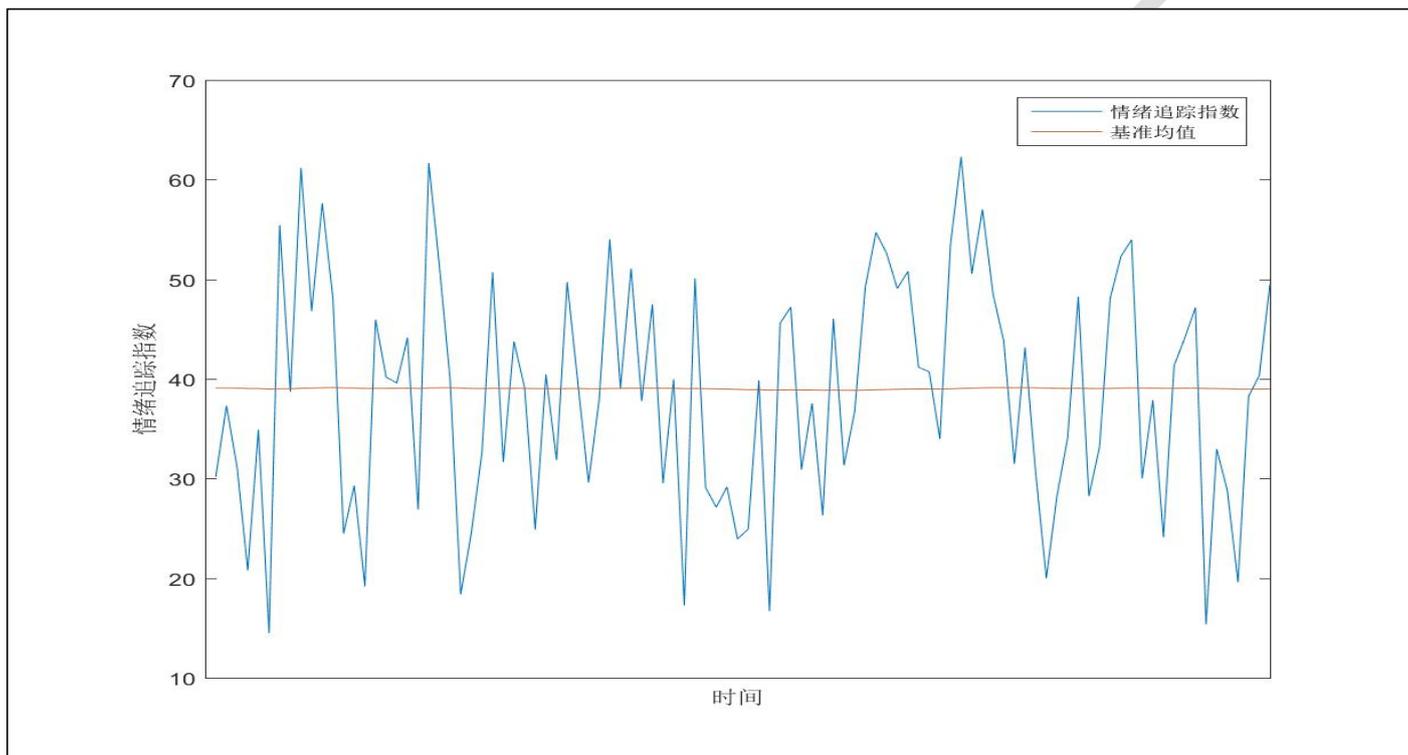
情绪指数是否处于增压区：处于空头增压区

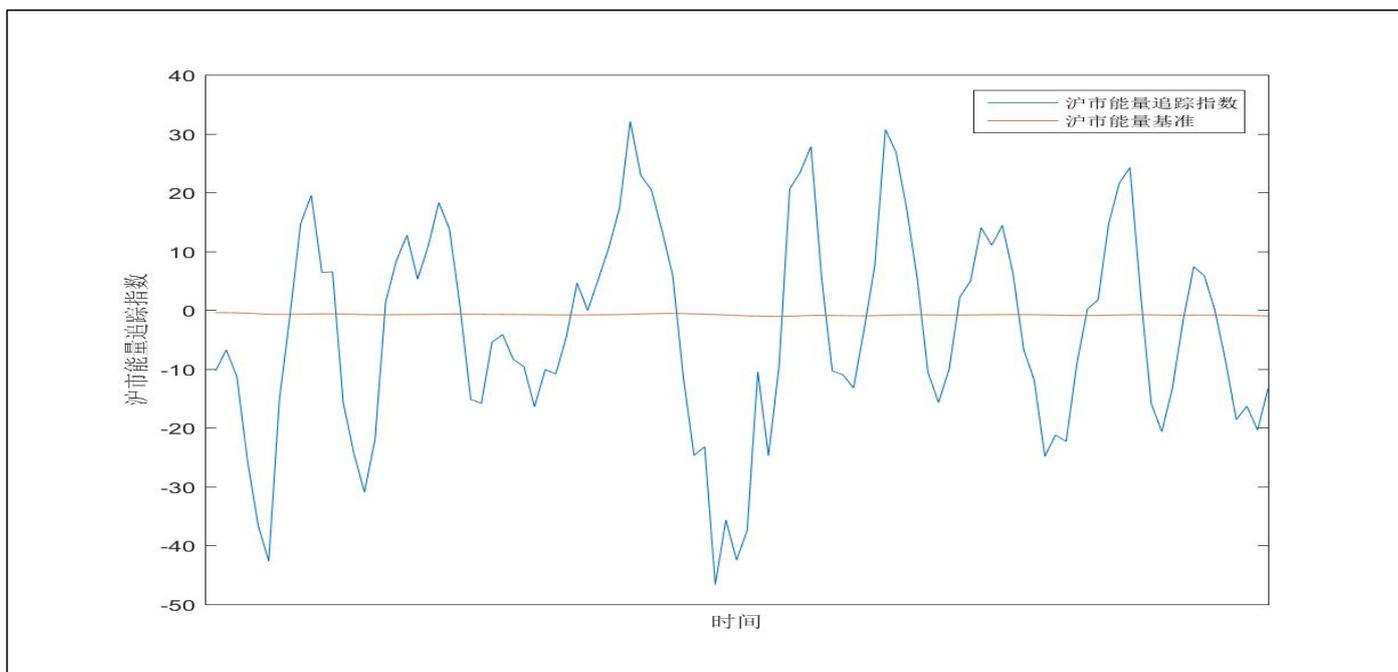
参照点指数反转 2%所需时间：17 个交易日

情绪指数历史参照次日涨概率为：0.26357；次日跌概率为：0.73643

专家系统自校准意见：专家系统需校准，大盘存在空头增压调整需要

操作建议校准：近日大盘有至少一次调整需要，大盘风险程度较小，不宜错过最佳反向布局时机，下探优先买入





当日更新内容分析如下：

- 1、当前日级别系统以 73.64%置信度保持短期看空预期，且系统预测最大等待周期为 1.15-1.40 个交易日，短期进一步调整预期依然强烈，投资者仍需要注意短期风险，或者至少短期逢高只出不进的操作建议需要继续维持。
- 2、周级别预期转为看多，在之前的持续调整之后，目前逼近月底，距离月级别调整周期结束的周期已经不远，再考虑短期调整已经过于强烈，在预期中，投资者应注意下月初盘面短期修复的可能性，因此目前只要损失可控的持仓，都可以转为跨月持仓，耐心等待损失缩小或者转盈利，继续追加持仓在仓位还不重的情况下可以继续。
- 3、月级别预期维持看多，这与之前的预期仍是保持高度一致的，不再赘述。

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	9.6806	4	新进
2	次新股	6.4254	5	重现
3	猪肉概念	5.4319	2	新进
4	乡村振兴	4.9541	1	新进
5	无线充电	4.4416	1	新进
6	华为概念	4.3995	2	新进
7	富士康	4.3781	1	新进
8	量子通信	3.9735	2	新进
9	美团概念	3.3291	3	新进
10	社保重仓	2.4814	1	新进

目前波动方向转负向并保持，投资者应注意短期该趋势的持续，以及跨月预期转好的潜在趋势方向！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
创投	1
ST 概念	1
水利建设	1
沪企改革	1
券商概念	1
5G 概念	1
超级品牌	1
租售同权	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，目前大盘指数正处于负向趋势中，修复跨月兑现的可能性较大，当前仍需注意控制风险，主要目标为减少损失或降低成本，次级目标为少量盈利。这里短期特别建议投资者优先关注的目标为：5G 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：草甘膦；五日单元匹配概率为：31.84%；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：24.34%。

多元匹配板块为：上证 50；五日多元匹配概率为：3.75%。

多元匹配板块为：国产软件；五日多元匹配概率为：11.54%。

多元匹配板块为：券商概念；五日多元匹配概率为：18.75%。

多元匹配板块为：5G 概念；五日多元匹配概率为：4.35%。

多元匹配板块为：高送转；五日多元匹配概率为：2.25%。

多元匹配板块为：超级品牌；五日多元匹配概率为：11.54%。

多元匹配板块为：国产芯片；五日多元匹配概率为：7.69%。

置信度较弱的匹配板块：

单元匹配板块为：草甘膦；五日单元匹配概率为：31.84%；该匹配板块在未来第 3 天出现的条件概率超过 50%。

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，今日较高置信度的题材为：草甘膦，投资者今日适当需要关注模式定位题材则有：次新股、上证 50、国产软件、券商概念、5G 概念、高送转、超级品牌、国产芯片。其他问题不再赘述，近期请勿开新仓！优先处理原有持仓，依据个股情况选择损失离场或跨月持股。

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	金宇车城、天桥起重、国发股份、万业企业、厦门国贸、城邦股份
中继类型	国检集团、和顺电气、启迪设计、瑞尔特、凯发电气、科士达、均胜电子、文一科技、国电南瑞、登云股份、深天地 A

进攻类型	高澜股份、海普瑞、诚迈科技、吴通控股、京泉华、金信诺、兴森科技、和仁科技、青岛啤酒、上海洗霸.....
-------------	---

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	金宇车城、厦门国贸、城邦股份、吴通控股、兴森科技、上海洗霸、恒润股份、晶华新材

*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 (29) 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
指数中期趋势 (月级别)	看多	出现时间：1 月? 返回主升区间需：不明确
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)	日级别看空	最大等待周期：1.15-1.40 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

2018/12/24