

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：575 期

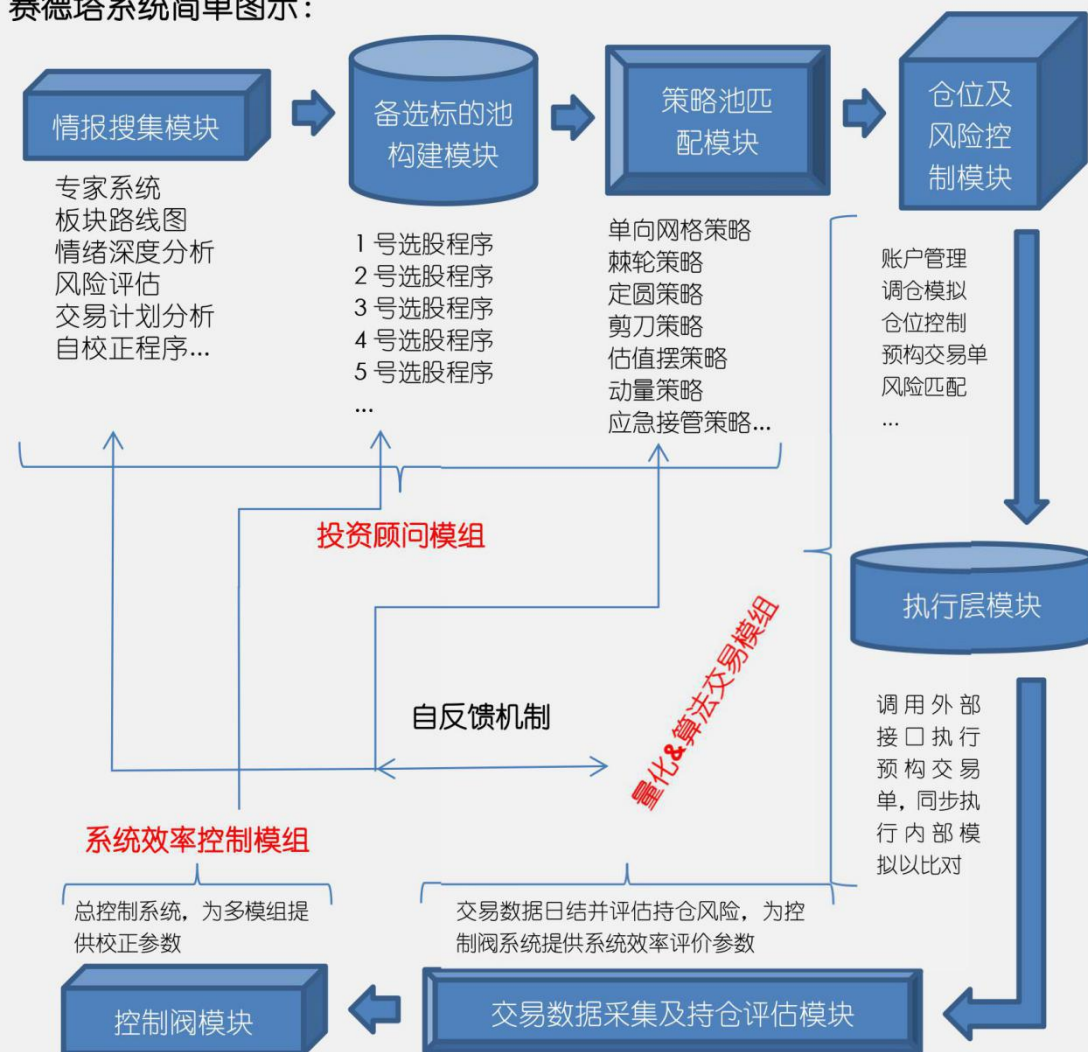
日期：2019/01/10

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:

昨日提供空头维持预期已兑现, 而根据当日更新分析内容, 系统继续以 63.18%置信度维持看空预期, 且同时将修复波段维持周期缩短至 1.08-1.15 个交易日。另外, 目前周级别预期继续维持看空, 而月级别预期则继续维持看多, 不难看到, 系统在维持近期趋势预测路径的同时, 仅小幅修正了本轮修复波段剩余最大维持周期。如上面数据显示的, 目前大概率次日继续维持偏空走势, 调整波段已无法避免, 下周将是调整阶段的主要覆盖区间, 投资者应注意防御。如此, 近期操作建议可以完全维持, 即重仓投资者应继续考虑优先减仓, 但在反复几个交易日提醒之后, 深蓝超算相信绝大多数读者应该已经完成清仓或者尽可能多地降低了仓位, 那么目前可以暂时维持观望状态。对于空仓或轻仓投资者, 只要有操作意愿, 因为月级别依然看好, 调整主要覆盖区间可以考虑逐层介入, 目前超短线交易已经失效, 或者说至少难度是较大的, 小概率盈利不提醒, 目前最可靠的布局持仓周期为跨月, 有布局需要的应优先考虑这一条件。最后, 再次强调, 短期内有追高机会轻不要追逐, 或者说至少风险是很大的, 是否有能力捕捉弱市下的强势标的, 这里不考虑, 深蓝超算仅提示大概率盈利机会。

在操作原则上, 短期负向趋势稳定性被破坏, 原操作思路小幅修正, 月内有持仓优先处理, 没有持仓的目前请勿进行短线交易, 不希望交易或没有充足资金分仓操作请不要操作, 目前继续维持最大持仓占比为 5 成的基本建议, 下周为主调整区间, 有需要的投资者可以考虑优先逢低布局。最后, 再次强调, 目前已进入 IEA 衰退区间, 因为刚进入该区间, 所以完成调整有一个过程, 目前初步预期暂时看到覆盖下周, 是否还有延长不明确, 投资者应留好充足追加仓位。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; 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, 投资者今日也没有应该适当需要关注模式定位题材。目前没有定位题材, 已经明确体现目前不适合买入操作的基本思路, 这里再三提示, 希望广大读者不要在最适布局区间出现前布置过多仓位。

*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

虽然近期短期预测波动较大, 非市场因素持续产生干扰, 但持续关注简报的应该可以发现, 逐日修正及稳定的基本趋势路径保持了极高的预测准确性。而对于一些新关注的读者, 也可以发现, 塞得塔系统在逐日修正预测路径的前提下, 能够较为准确地检测到场内多空力量对比情况, 并以此作出最接近真实情况的策略建议。所以, 在目前市场接近衰退边缘的情况下, 非市场因素干扰下降, 对应逐日预测准确性有所提高, 其中的规律其实很清楚, 持续关注的简报的现在应该很清楚系统的预测能力。另外, 需要再次说明的是, 深蓝超算目前忙于搭建爬虫网络, 完成计划中的数据自动搜集模块, 所以简报内容将尽可能简化。

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: 45.0992; 昨日情绪指数: 42.2525

当日主力情绪指数: 46.1549

当日散户情绪指数: 45.0948

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: 相对位置方向不匹配

历史匹配位置 5 个交易日指数波幅: 29.65

历史匹配位置 5 个交易日指数涨跌比例: -0.0065247

历史匹配位置 5 个交易日指数波动率: 13.7185

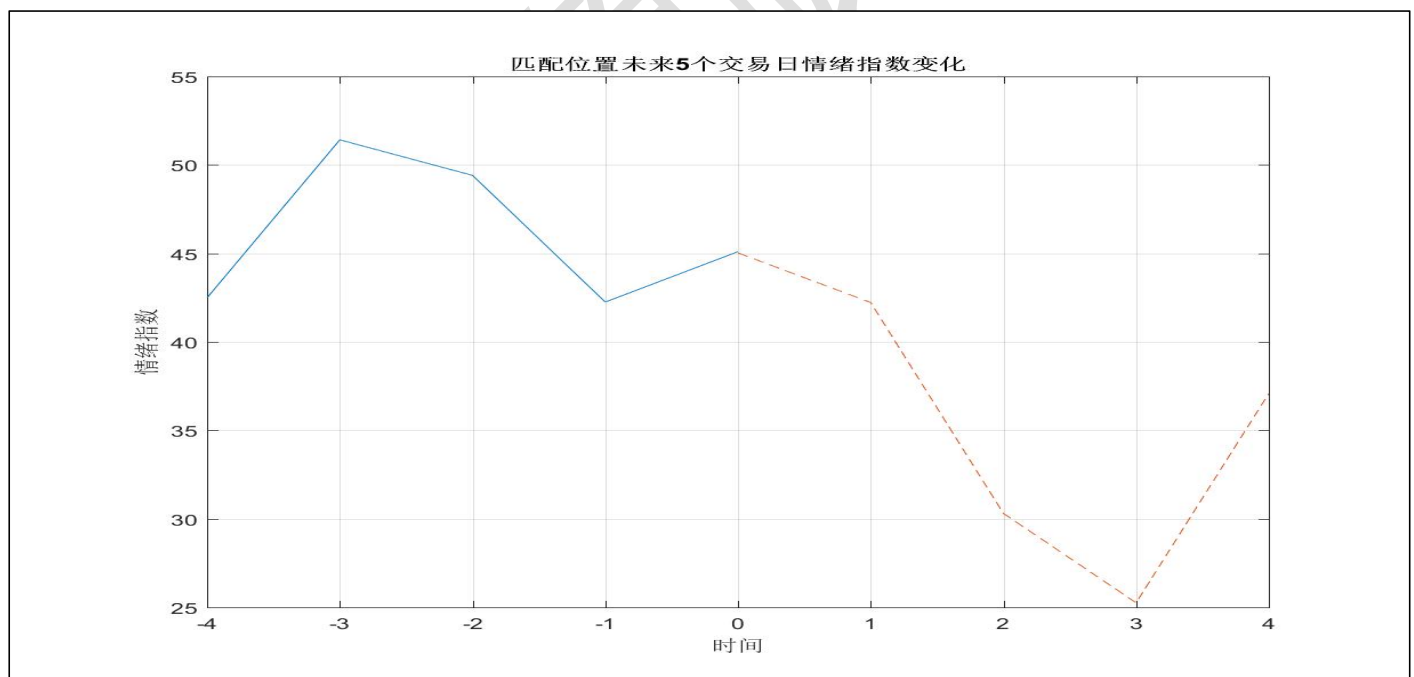
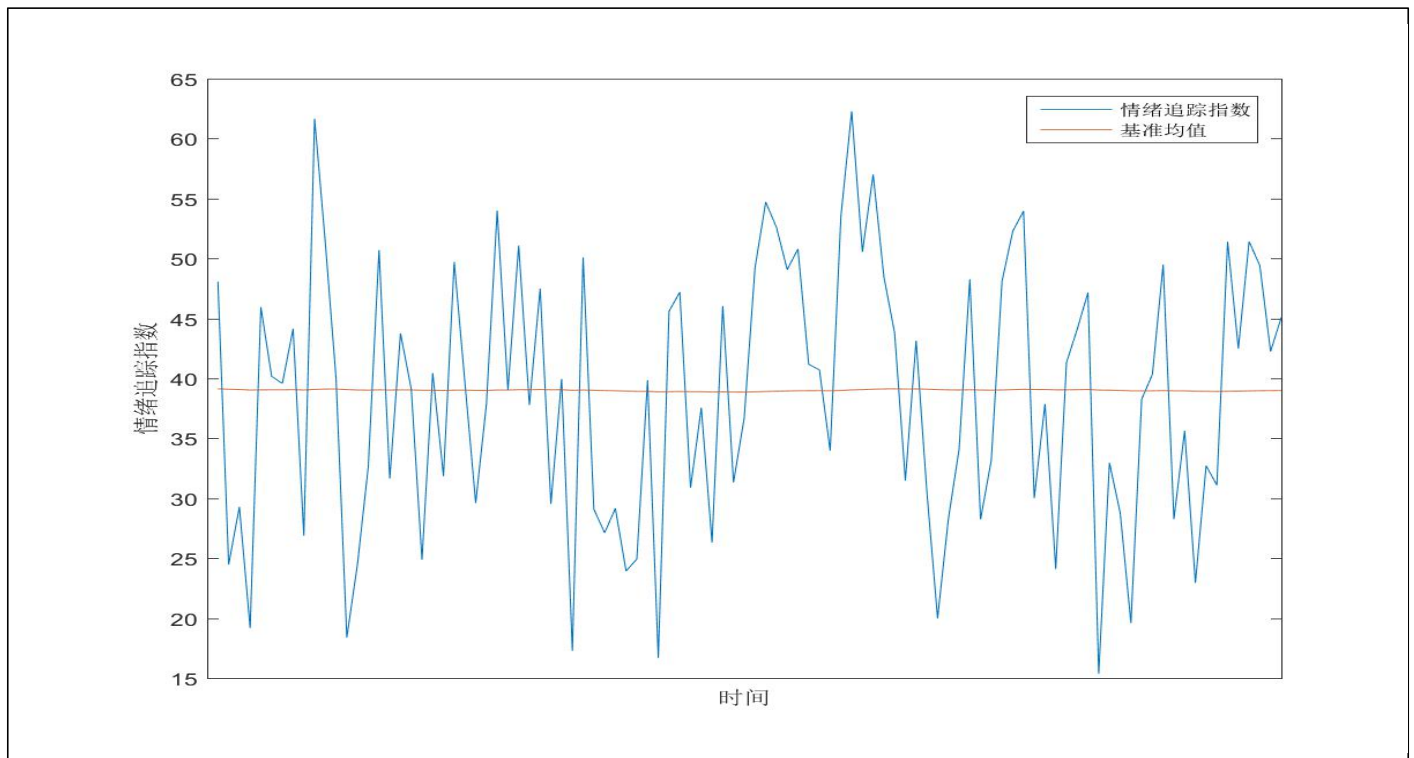
深蓝超算研究中心出品

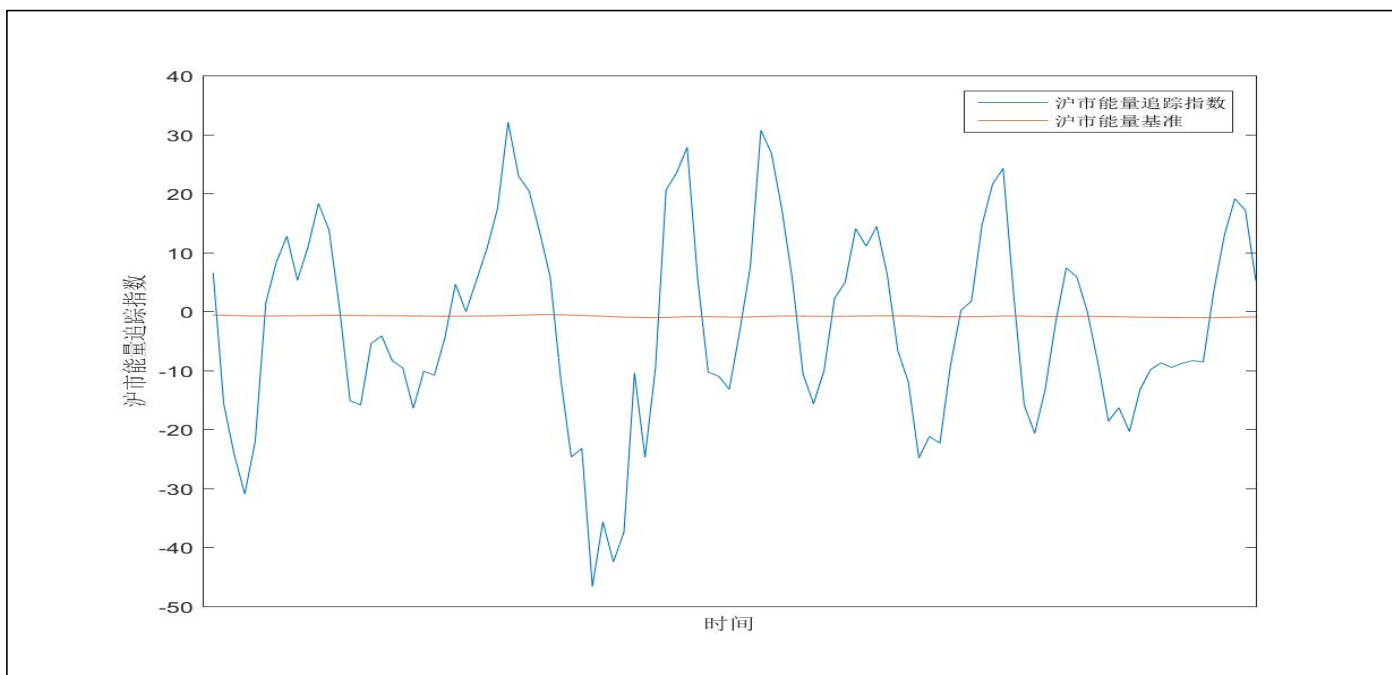
情绪指数是否处于增压区：处于非增压区

参照点指数反转 2%所需时间：120 个交易日

情绪指数历史参照次日涨概率为：0.36816；次日跌概率为：0.63184

专家系统自校准意见：无系统校准意见





当日更新内容分析如下：

- 1、当前日级别系统以 63.18%置信度维持空预期，系统检测显示大盘已进入调整区间，其中不能排除有短期正向修复的存在，但根据预期，目前修复区间的极限剩余维持周期仅有 1.08-1.15 个交易日，投资者需要注意，还没有充分减仓的现在必须抓紧，如果实在没有离场机会的，那必须考虑抵抗至少一周时间的调整阶段，整体持仓至盈利的周期有可能超过下个月（估计结果，因个人持股标的性质不同而不同，但还是那句话，如果现在还没有碰到回本或盈利的减仓机会，那么继续持股就很可能需要超过 1 个月时间）。
- 2、周级别预期继续维持看空，再次强调下周是预测中的主调整区间，请小心突然大幅下挫（调整目前预期覆盖周期有限，但具体情况需要下周具体分析），空仓或轻仓的可以考虑逢低介入，理论上下周的逆向布局可能需要持股至下个月，请根据个人操作习惯选择是否介入（下一阶段是否有短线机会尚不明确，但目前已不适合短线交易）。
- 3、月级别预期维持看多，目前中期趋势依然保持看好，主要盈利机会可能出现在春节之后，当前预期表明，选择持股过节或者节后买入对应风险程度都较小。

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	7.1417	4	新进
2	太阳能	7.0737	1	新进
3	富士康	5.5135	2	新进
4	新能源	5.0156	1	新进
5	风能	4.8685	1	新进
6	华为概念	3.7430	2	新进
7	黄金概念	3.4839	2	新进
8	智能电网	2.9522	3	新进
9	触摸屏	2.6718	1	新进
10	充电桩	2.6353	3	新进

目前波动方向为负向趋势出现修复迹象，投资者应注意短期微妙变化，目前微调短期操作原则，本月月内重仓优先

考虑离场，暂不推荐开新仓及追加仓位；但如果是轻仓或空仓投资者可以考虑在控仓前提下逢低布局（下周），持仓目前仅能考虑跨周中短线，短线持仓目前存在较高亏损概率！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	1
黄金概念	1
滨海新区	1
海工装备	1
上海自贸	1
智能电视	1
沪企改革	1
粤港自贸	1
人脑工程	1
券商概念	1
5G 概念	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修复阶段，但短期修复已不稳定，建议投资者仍在操作的话，当前请勿继续买入，等待低买机会。这里短期特别建议投资者优先关注的目标为：5G 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]）：

当日无模式匹配结果，请慎重操作！

当日模式识别程序定位中，今日无较高置信度的题材，投资者今日也没有适当需要关注模式定位题材。无定位题材需要警惕，不再赘述。

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	新北洋、多喜爱
中继类型	京泉华、鹏辉能源、汉嘉设计、牧高笛
进攻类型	创元科技、瑞丰光电、江海股份、移为通信、滨海能源、电连技术、金雷风电、通宇通讯、瑞特股份、国旅联合.....

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	牧高笛、创元科技、瑞丰光电、滨海能源、瑞特股份、福建金森

*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（15 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）	看多	出现时间：2 月？ 返回主升区间需：不明确
指数短中期趋势（周级别）	周级别看空	出现时间：下周？
指数超短期趋势（日级别）	日级别看空	修复最大维持周期：1.08-1.15 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，次日同一时间我们再见，祝各位好运！

深蓝超算研究中心

2019/01/10