

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：597期

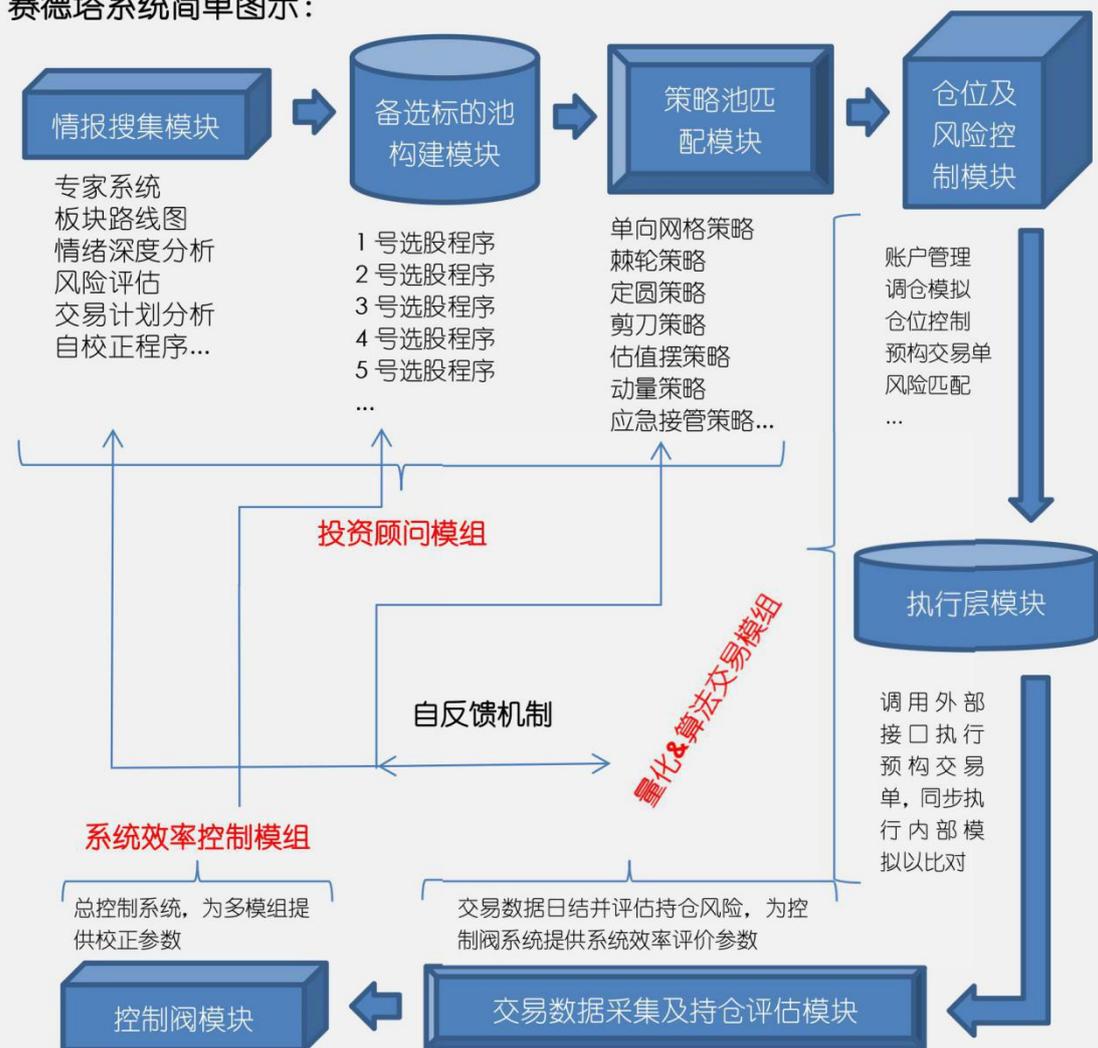
日期：2019/02/19

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：情报搜集模块（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!

重点解析:

当前情况看, IEA 水平上的顶部钝化过程仍在进行中, 但不得不承认的是, 如近期系统所提示的, 大盘仍存在惯性上行动力但这种惯性被破坏也非常容易, 所以原则上目前是不推荐买入, 近期保持只出不进是最理智的操作, 投资者应考虑自身的风险承受能力选择如何操作, 但有一点必须强调, 那就是仍在交易的投资者需要保持隔夜操作, 尽可能不要维持一个交易日以上的持仓, 且严格空仓必须维持。根据当日分析结果, 整体趋势预期并没有出现较大变动, 系统目前仍以 65.08%置信度维持看空预期, 但上行波段仍有维持 1-2.54 个交易日的可能性, 这就意味着短期场内仍有做多资金补充, 虽然转空很容易, 但在没有充分诱因的情况下这种转换较为困难。正如校准信息所提示, 目前的情况近似于局部逃顶, 投资者不应随意认为个人有可能在最高点离场, 这并不切实际。另外, 目前周级别和月级别继续维持看空预期, 投资者需要密切注意短期的仓位情况, 目前直轻不宜重, 在风险消散前尽可能不再买入。

在操作原则上, 目前维持不操作即可, 即不买入, 有离场机会的继续保持离场, 短期应适当提高止损标准, 避免损失扩大。而在板块定位问题上, 当日模糊匹配系统结果为: 优先关注页岩气、油气设服、可燃冰、天然气 (注意短期能源板块机会); 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: ST 概念、水利建设、上证 50、食品安全、国产软件、次新股、黄金概念、基本金属、券商概念、超级品牌、国产芯片。场内资金除了追逐短期消息面热点之外, 仍在主推权重股, 建议投资者注意短期不要轻易追逐热点, 避免遭遇年初热点过多、切换过快的问题。最后, 如上面反复强调的, 短期应注意不要买入。

*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

从今日 IEA 水平趋势看, 目前 IEA 衰退趋势仍在维持之中, 目前没有出现显著持续下调的主要原因在于场内仍有大量资金做多, 这在很大程度上抵消了获利盘离场的影响。但部分抵消并不代表全部抵消, 从近期趋势变化看, 这种抵消获利盘离场影响的做多动力正出现越来越不充足的迹象。所以, 原则上很容易理解, 短期尽可能不要考虑买入, 目前因为盘面出于近似局部逃顶特征, 短期持续冲高有可能成为诱多的一部分, 执意追加仓位做多并不是理性的操作。对于这种情况, 深蓝超算在长时间的测试、研究中发现, 对于任何一种趋势交易策略来说, 如果没有基于风险评判的仓位调节系统, 类似阶段将是一轮交易中回撤程度最大的部分; 所以, 对于基于目标的量化交易体系来说, 这种情况下为了保证下一阶段布局有充足资金和尽可能少的套牢盘, 目前错过部分小概率利润将换回后期对于总资金的大概率利润, 其中的数理关系非常清晰, 而足够理想的策略往往也是反人性的, 所以这里再次强调近期尽可能不要买入, 维持只出不进的操作。

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: 下跌

当前中短期盘面预判描述: 大周期下行趋势, 局部惯性下挫维持, 短期调整无效;

战略布局建议: 下行危险, 优先清仓

当日情绪指数: 46.3133; 昨日情绪指数: 54.7241

当日主力情绪指数: 49.1062

当日散户情绪指数: 46.3101

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: 相对位置方向匹配

历史匹配位置 5 个交易日指数波幅: 48.59

历史匹配位置 5 个交易日指数涨跌比例: -0.0097359

历史匹配位置 5 个交易日指数波动率：20.8262

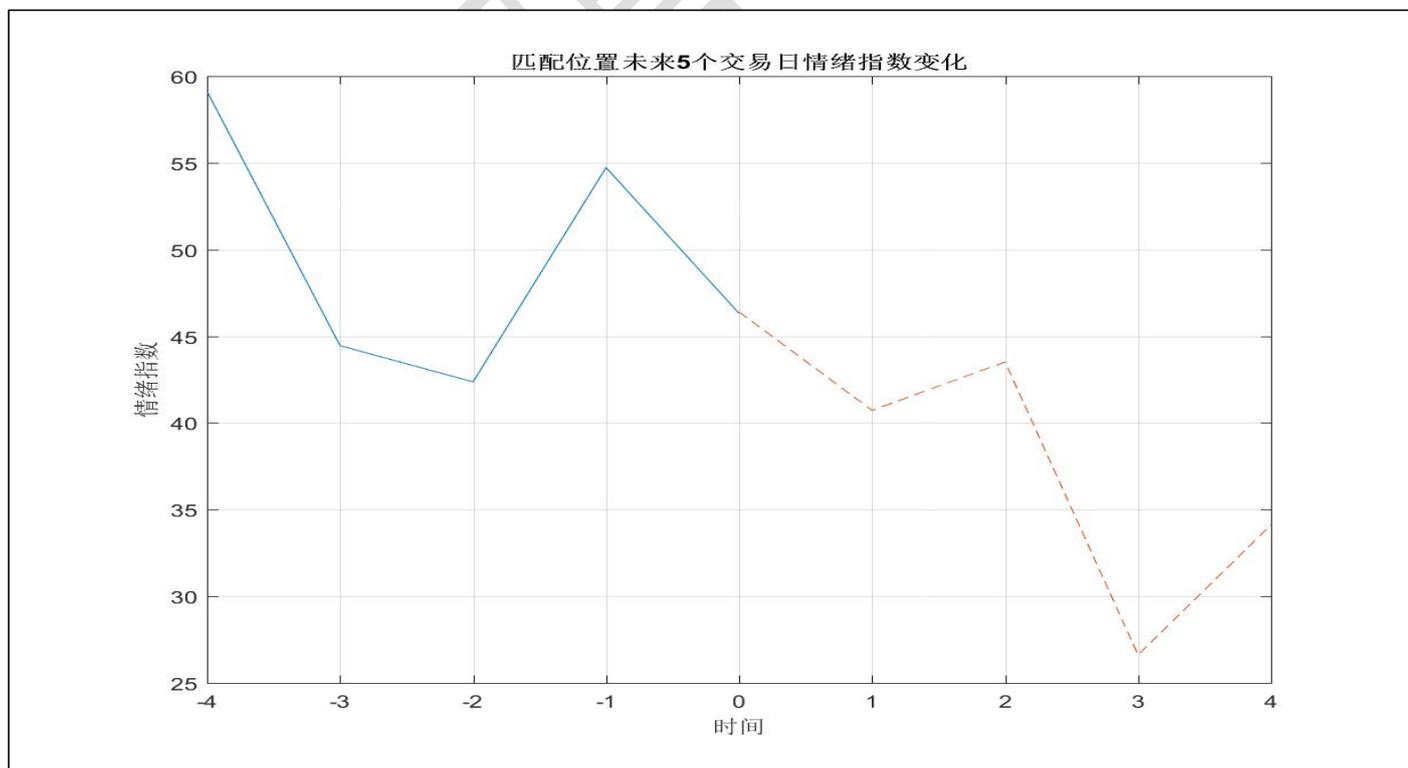
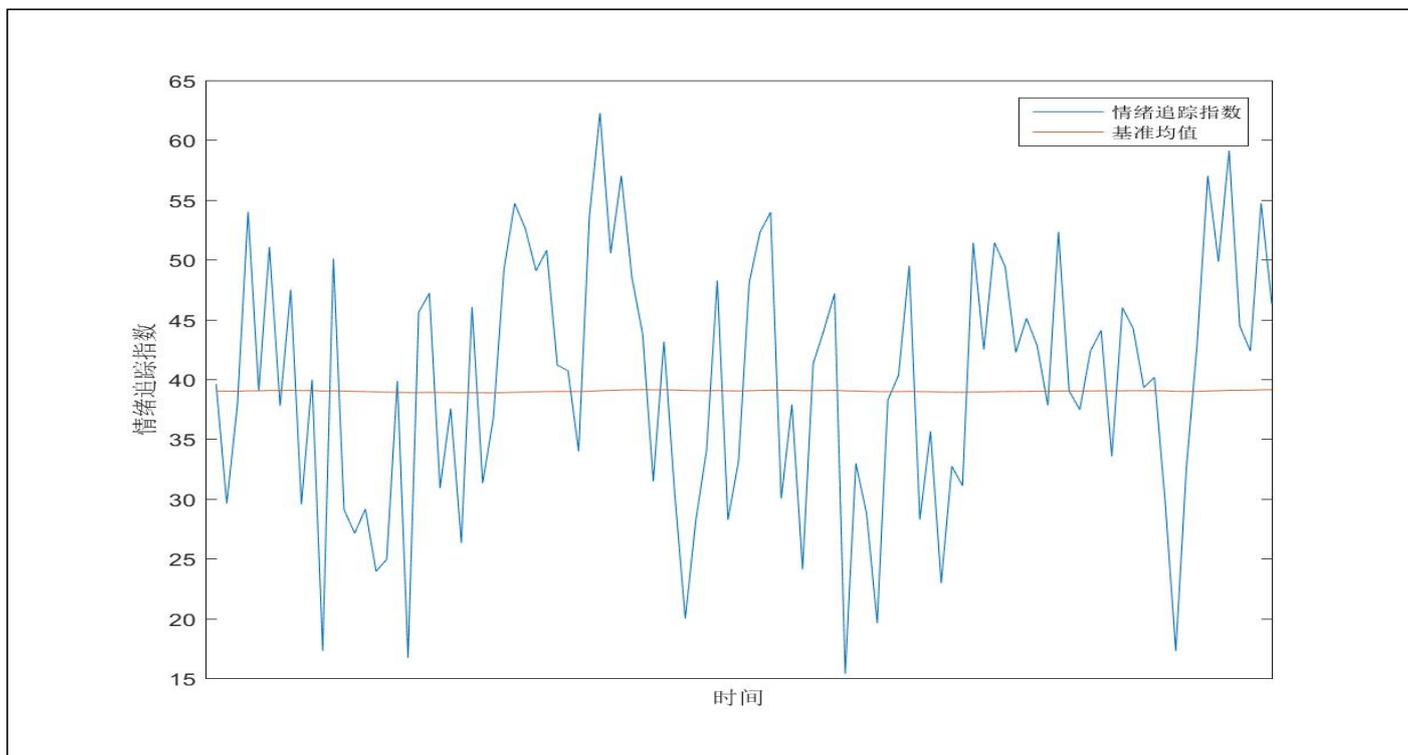
情绪指数是否处于增压区：处于空头增压区

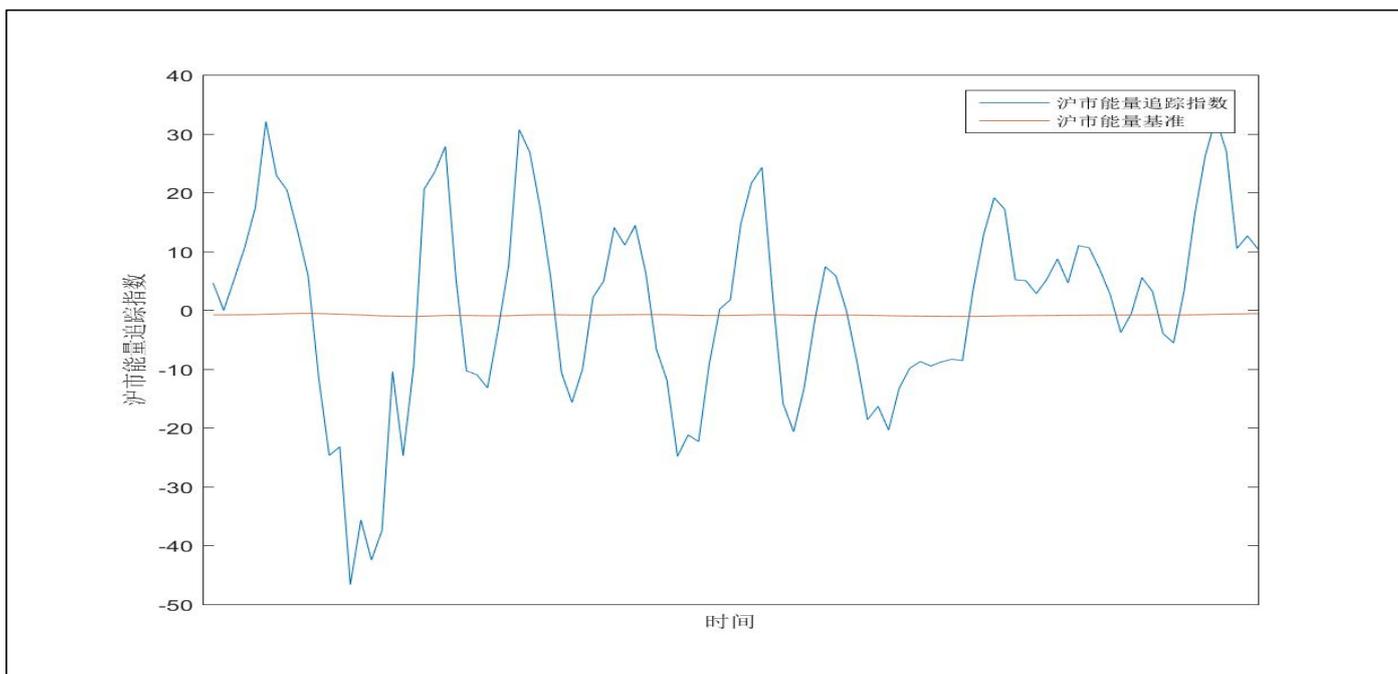
参照点指数反转 2%所需时间：51 个交易日

情绪指数历史参照次日涨概率为：0.34921；次日跌概率为：0.65079

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：近日大盘将加速下行，优先逃顶处理





当日更新内容分析如下：

- 1、日级别当前以 65.08%置信度维持看空预期，系统给出日级别上行潜在维持周期修改为 1-2.54 个交易日，这里注意一个问题，那就是再次出现多头动力增加的情况，投资者应注意短线不要操作、中长线不要布局，如需要操作，操作周期维持隔夜，且严格止损止盈必须坚持执行。
- 2、周级别预期维持看空，这与之前完全相同，其原因已经反复强调过了，目前调整浪随时会显著出现，而目前系统延迟预估于下周发生。
- 3、月级别预期维持看空，该预期因为已经维持了较长周期，所以大家应该都有印象，这也说明因为目前本月月级别修复预期极有可能兑现，而充分上涨后盘面存在大幅调整需要，投资者应予以重视。

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	互联网金融	6.6483	1	新进
2	北斗导航	6.0845	1	新进
3	大飞机	5.3916	2	新进
4	粤港自贸	4.8164	1	新进
5	触摸屏	4.4683	4	重现
6	国产软件	4.4253	1	新进
7	航母概念	4.0651	1	新进
8	债转股	3.9865	1	新进
9	3D 玻璃	3.7548	8	重现
10	冷链物流	2.6724	1	新进

目前大盘方向修改为负且不稳定，目前请勿买入，尤其在周内逢高不要追逐！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
移动支付	1
页岩气	1
油气设服	1
石墨烯	2
智能电视	1
王亚伟系	1
蓝宝石	1
智能家居	1
燃料电池	1
氟化工	1
在线旅游	1
超级电容	1
赛马概念	1
5G 概念	1
人工智能	1
可燃冰	1
新零售	1
乡村振兴	1
天然气	1
单抗概念	1

历史数据匹配结果不需要深蓝超算做过多解释, 目前大盘指数目前处于负向趋势不稳定阶段, 当前请保持离场状态。这里短期特别建议投资者优先关注的目标为: 页岩气、油气设服、可燃冰、天然气。

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: 21.05%; 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: 14.33%; 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: 上证 50; 五日单元匹配概率为: 14.35%; 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: 食品安全; 五日单元匹配概率为: 13.87%; 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: 国产软件; 五日单元匹配概率为: 13.49%; 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: 5.84%。
- 多元匹配板块为: 黄金概念; 五日多元匹配概率为: 18.68%。
- 多元匹配板块为: 基本金属; 五日多元匹配概率为: 21.84%。
- 多元匹配板块为: 券商概念; 五日多元匹配概率为: 6.74%。
- 多元匹配板块为: 超级品牌; 五日多元匹配概率为: 7.96%。
- 多元匹配板块为: 国产芯片; 五日多元匹配概率为: 13.10%。

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：ST 概念、水利建设、上证 50、食品安全、国产软件、次新股、黄金概念、基本金属、券商概念、超级品牌、国产芯片。目前不建议买入，其他问题不再提醒。

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	川恒股份、新宙邦、华域汽车、正泰电器
进攻类型	森特股份、紫光学大、诺德股份、东方证券、航天彩虹、汇金股份、神马股份、上海沪工、应流股份、云南城投.....

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	诺德股份、航天彩虹、上海沪工、应流股份.....

*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（63 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）	看空	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	上行最大持续周期：1-2.54 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！