

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：607期

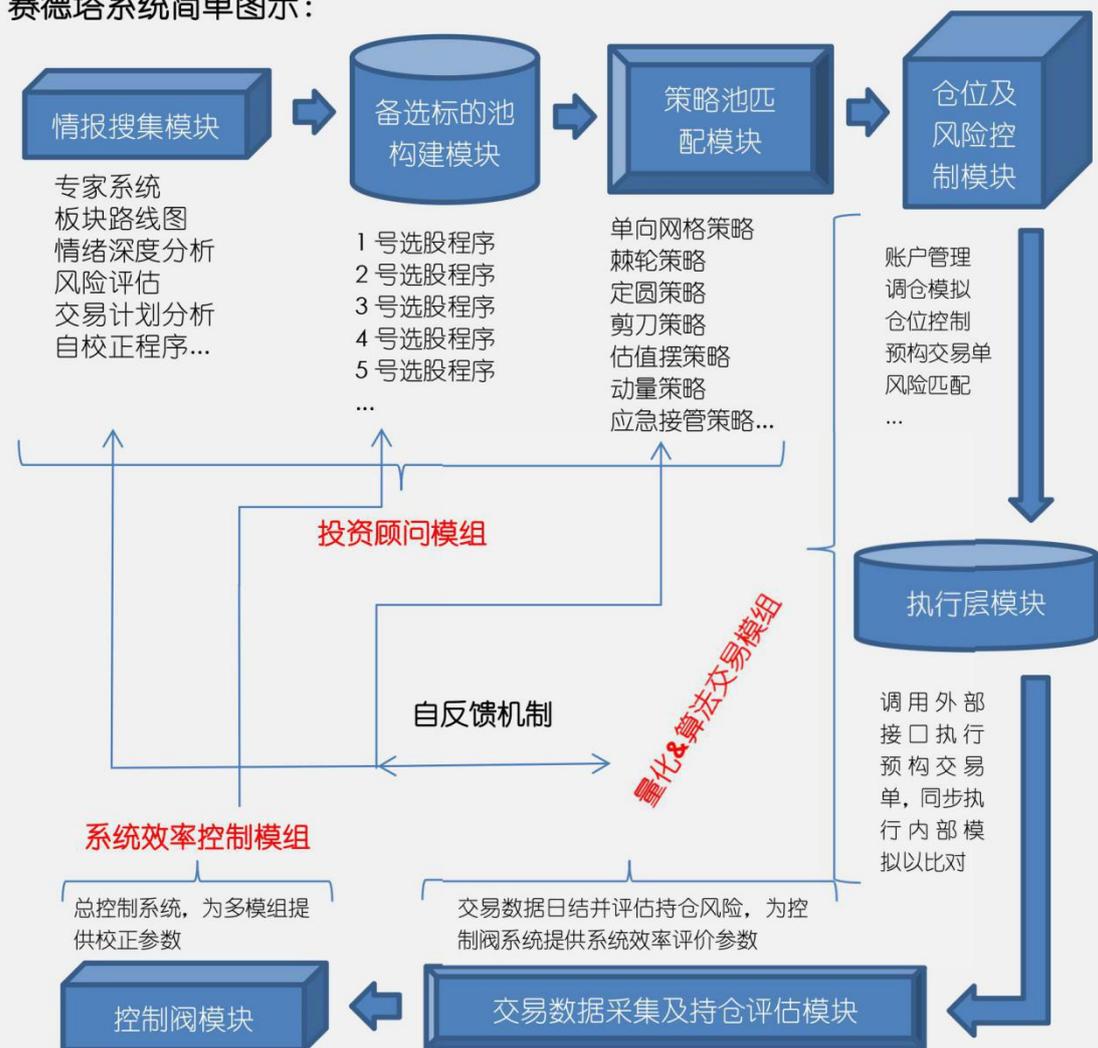
日期：2019/03/05

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](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:

当日大盘兑现上行持续预期,但目前继续监测到显著压力,短期压力兑现节点依然确定为顺延而非消除,此处再次强调注意。根据当日分析结果,系统目前以 90.48%置信度维持看空预期,但系统继续顺延潜在上行维持周期为 2.60-2.66 个交易日,即当前上行阶段目前存在覆盖本周的可能性。所以,目前继续维持对于中短长线投资者保持活跃、优先低买的基本操作判定。最后,目前系统继续维持对周级别和月级别预期看多的基本趋势方向,即在可见的中远期,大盘仍不存在大幅下调的基础,但这里还是要再次说明,这并不能排除短期调整的可能性,且在上一轮短调基础上,目前日级别 IEA 水平出现二次下滑迹象,近日短线投资者一定要遵循控仓原则。另一方面,目前场内时已经明确存在洗盘需要的,推荐近期操作,特别是追逐性操作只保持隔夜进行,日间短线不推荐持仓等待,中长线布局可以不断低买,但需要注意已经充分盈利部分仓位动态减仓。

在操作原则上,低买和注意短期风险双预期同时保持,这里不再展开复述。而在板块定位问题上,当日模糊匹配系统结果为:优先关注国产软件;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:上证 50、高送转、国产软件、券商概念、超级品牌、猪肉概念、国产芯片。操作方面的问题不多强调,注意一下短期减仓,中长线不断追加,隔夜操作优先,波段操作目标月级别大波段,短期坚定持股不动,其他问题不展开。

*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

目前大盘基本趋势方向未出现偏移,只是投资者需要注意短期大盘作二次转向向下调整,但这里只是可能而已,如果发生,短期底部将变得更加夯实,即意味着大盘 3000 点整数关口将确认站稳并转为大级别支撑。所以,投资者应该很清楚近期应该如何操作,为了避免短期调整,首先短线投资者要控仓交易,且注意追逐性操作要尽可能减少;隔夜操作可以继续维持,但注意不要将隔夜操作变成短线操作,要设置明确的止盈止损位置;最后,中长线投资者只要看准低估标的就应该反复逆向加仓买入,目前仓位应该是逐步提高的,但如果是已持有标的已经充分盈利,则本阶段所选标的应视作达到目标,就应该开始动态减仓并同步布局其他新标的,即短期此类投资者应开始考虑换股。如果是没有操作的投资者,暂时先不要急于布局,短期有低买机会再布置进场操作,即不调不买。

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: 55.4863; 昨日情绪指数: 50.187

当日主力情绪指数: 48.8426

当日散户情绪指数: 55.4658

主散情绪指数分析提示: 买盘过于分散,情绪异常,注意风险

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: 56.06

历史匹配位置 5 个交易日指数涨跌比例: -0.016874

历史匹配位置 5 个交易日指数波动率: 21.3529

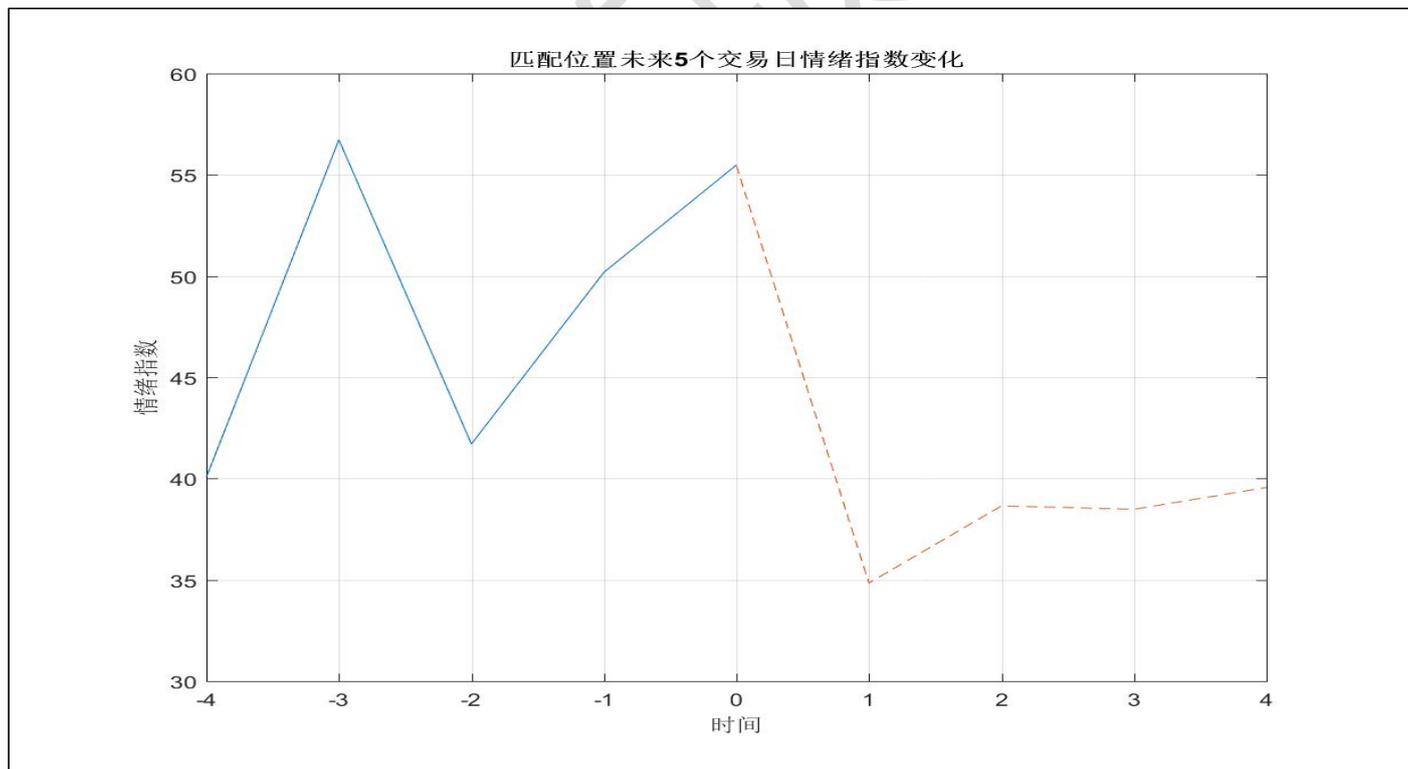
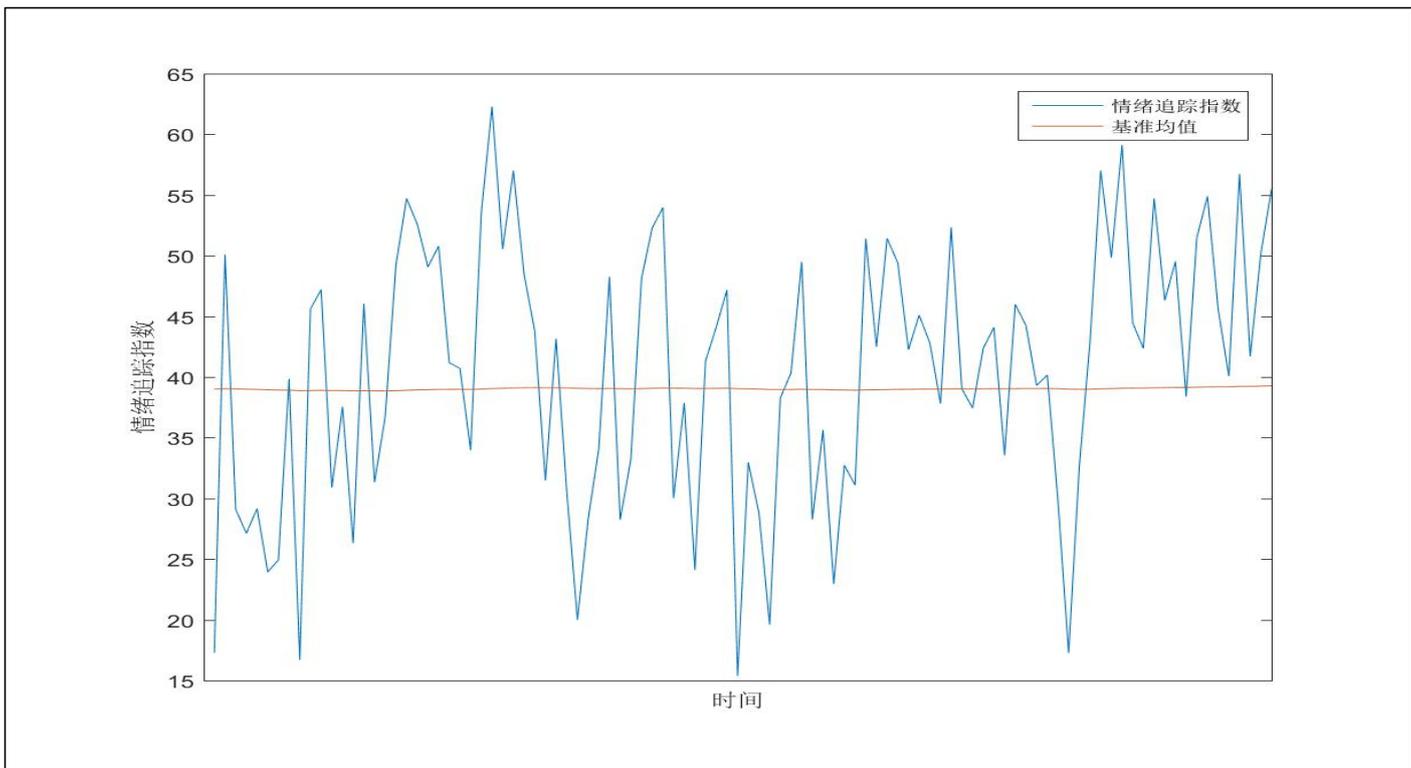
情绪指数是否处于增压区: 处于空头增压区

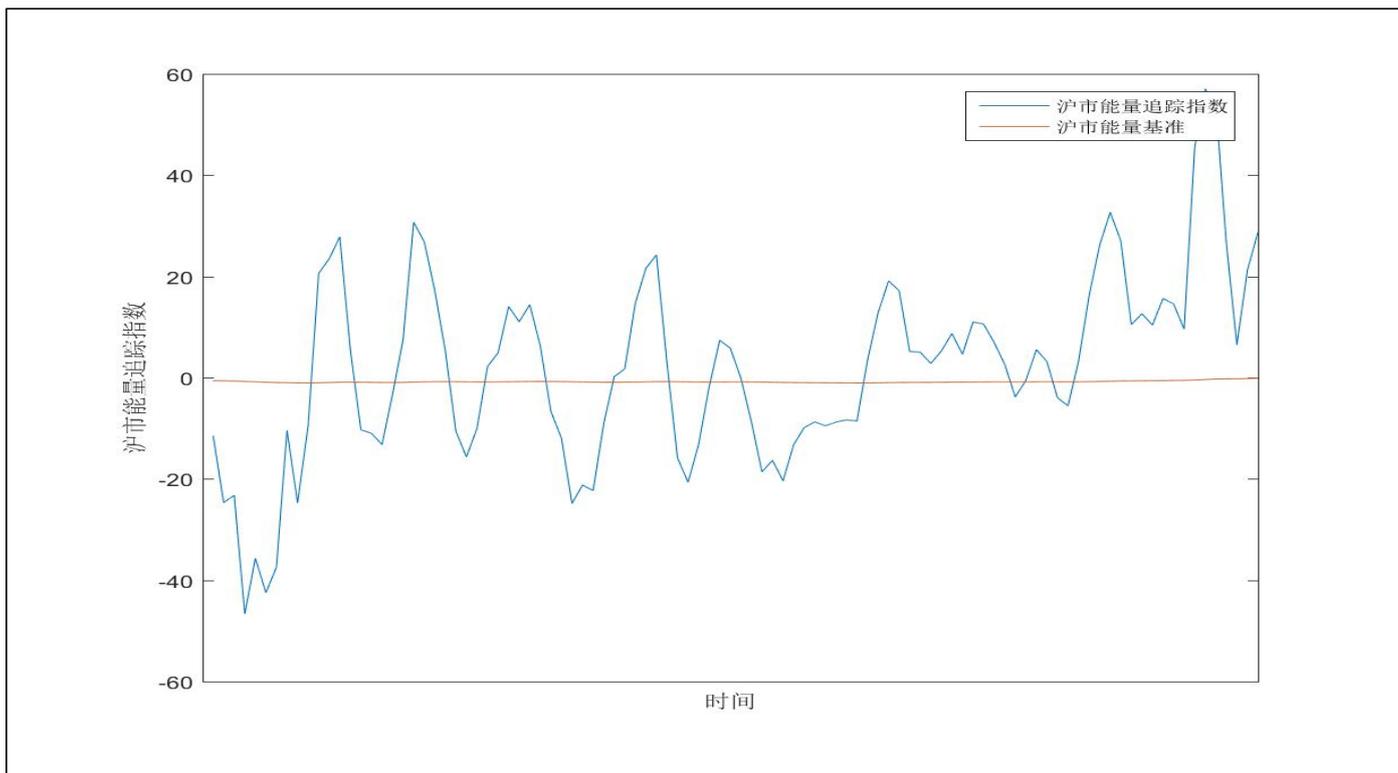
参照点指数反转 2%所需时间: 19 个交易日

情绪指数历史参照次日涨概率为: 0.095238; 次日跌概率为: 0.90476

专家系统自校准意见：输出结果矛盾，优先选择盈利出局避险，未盈利持仓维持

操作建议校准：目前市场风险程度较低，但短期走势不明朗，可维持持仓观察，有盈利先行出局，保持波段操作





当日更新内容分析如下：

- 1、日级别当前以 90.48%置信度维持看空预期，修复潜在维持周期增加到：2.60-2.66 个交易日，即未来周内继续看多，但操作需要带有一定防御性。投资者应避免短期调整导致不必要的损失，同时调整出现时应考虑优先买入。
- 2、周级别预期维持看多，重复的问题不多强调，短调预期可能会在上行中被消化，但可以肯定的是，目前大级别持续上行方向已经可以确认，跨周级别上短线可以大胆操作。
- 3、月级别预期保持为看多，该问题不重复强调，目前季度 IEA 识别底部转向确认，短期虽然无法排除调整，或者类似去年年初转向后再次调整的情况，但可以肯定的是，本次转向具备很大程度上大级别转向潜力，或者说盘面上转向至少需要维持 2 个季度左右。

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	人工智能	8.1515	1	新进
2	国产芯片	8.0595	1	新进
3	云计算	6.8387	2	新进
4	超清视频	5.9507	1	新进
5	工业互联	5.7867	1	新进
6	智能电视	5.0835	2	重现
7	触摸屏	4.3970	1	新进
8	全息技术	3.9633	2	重现
9	边缘计算	3.6431	1	新进
10	增强现实	3.6123	1	新进

目前大盘方向维持为正且稳定，目前隔夜可以维持操作，短线注意短调风险但仍可操作，中长线抓住机会逢低逐层买入，收集低价筹码，其他操作建议不展开。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
食品安全	1
特斯拉	1
油改概念	1
独家药品	1
超导概念	1
国产软件	2
5G 概念	1
国产芯片	1

历史数据匹配结果不需要深蓝超算做过多解释，目前大盘指数目前恢复正向趋势稳定阶段，当前中短长及隔夜投资者都可以考虑不断买入，目前远期预期全面转好，投资者应该尽可能在低价筹码仍然充足的情况快速吸收；另一个需要注意的关键问题是近月推荐尽可能拿住低价筹码，可以设置动态止盈，但不要因为短期调整而轻易离场。这里短期特别建议投资者优先关注的目标为：国产软件。

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：上证 50；五日单元匹配概率为：16.74%；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：高送转；五日单元匹配概率为：17.26%；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：国产软件；五日多元匹配概率为：16.87%。

多元匹配板块为：券商概念；五日多元匹配概率为：7.61%。

多元匹配板块为：超级品牌；五日多元匹配概率为：11.40%。

多元匹配板块为：猪肉概念；五日多元匹配概率为：7.25%。

多元匹配板块为：国产芯片；五日多元匹配概率为：24.71%。

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：上证 50、高送转、国产软件、券商概念、超级品牌、猪肉概念、国产芯片。其他问题不多强调，短期注意逢低买入。

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	三盛教育、通威股份

进攻类型	钱江水利、金新农、宇环数控、科远股份、华银电子、联创电子、蓝光发展、日海智能、迪安诊断、佳讯飞鸿.....
-------------	---

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	钱江水利、宇环数控、联创电子、迪安诊断、佳讯飞鸿.....

*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（347 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：3 月? 4 月? 已返回主升区间
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	修复最大持续周期：2.60-2.66 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

2019/03/05