

# 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：641期

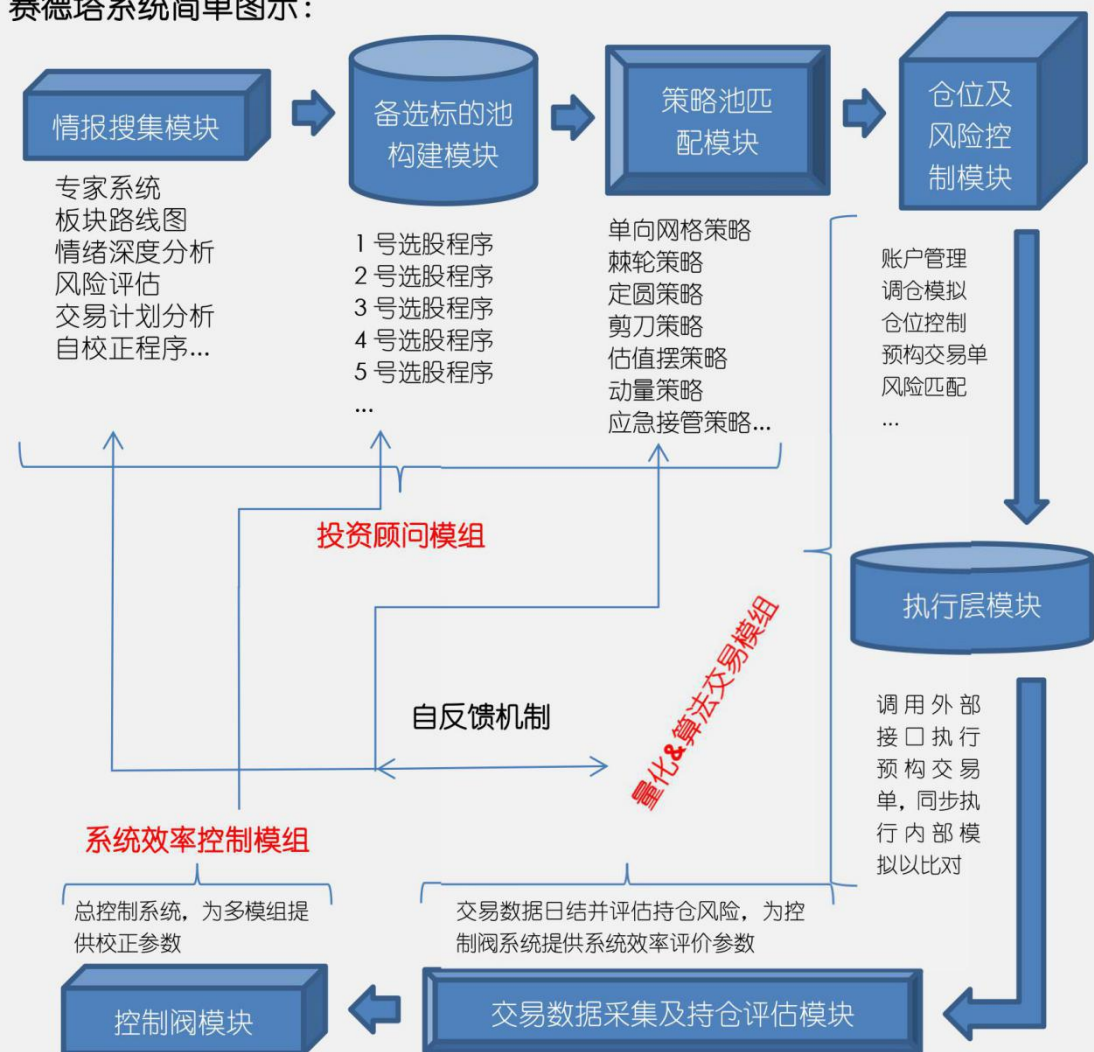
日期：2019/04/23

## 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](mailto:504936733@qq.com)

Telephone: 13870916570

深蓝超算对外站点:

[https://xueqiu.com/DBS\\_C\\_ResearchCentre](https://xueqiu.com/DBS_C_ResearchCentre)

QQ: 504936733

Weichat:



欢迎留言或联系深蓝超算  
交流学习!

## 重点解析:

目前大盘仍如预期处于衰竭过程中，昨日系统就已经提醒下行周期最快仍需维持一个交易日左右，最慢需要再等待 2 个交易日左右。而从当日盘面运行结果看，目前大盘仍存在保守起见 1.42-1.79 个交易日的衰竭维持期。但与此同时，根据当日分析结果，系统目前也以 74.45% 置信度提高看多预期，换句话说大盘持续下行开始出现压力，理想状态下未来 2 个交易日之内必然出现反转。所以，对于随时将出现反转的基本预期来说，投资者继续保持持仓甚至反向加仓都是支持，且相对安全的（之所以说相对，部分已经大幅上涨，存在显著派发压力的标的还是少参与比较好，投资者每一轮操作需要同时考虑潜在上行空间和潜在下行空间，要想维持正收益，至少要保证如下公式平衡： $(1 + \text{潜在上行空间}) * \text{发生概率} - (1 - \text{潜在下行空间}) * \text{发生概率} \geq 0$ ，一旦计算结果小于 0，请宁缺无纵！）。另外，基于当日修正的周级别看多预期和月级别看多预期，中远期预期已经得到修正，即目前看调整有可能仅限制于本周之内，且很有可能马上结束；但为确保预期准确性，投资者依据该预期调整操作方案应该尽可能延后至本周末端。所以，总结来说，接下来到周四之前，投资者理论上讲看到大盘的反转修复，这里仍建议逢跌继续布局，而目前从时间窗口上看，次日如继续调整，则其一定是短期内的最佳介入点，深蓝超算是推荐投资者在该节点补仓的，其中已经重仓的投资者除外。多谈一点展望，目前短期涨跌并没有什么值得担忧的，因为就短线而言，月内或最晚至下月初，投资者应该是存在离场机会的，但这里的问题是希望充分盈利的话（深蓝超算对充分盈利的目标定在 50%），更长的持仓周期很有必要的，而目前盘面持续在最近的一个箱体中震荡迟迟无法突破，假设近期这轮修复仍无法达到该目标的话，那深蓝超算可以很负责地猜测未来中长期走势有可能出现变动，或者换句话说投资者至少是需要先锁定利润，尽可能减仓到较低水平地，这是为了防止大盘以更长的周期返回主升浪。

在操作原则上，简单地描述近期操作，就是短期先考虑加仓或维持持仓直至本轮修复开始并展开，后面考虑灵活处理，如果大盘能够突破前期高点或者说突破箱体上沿，那投资者应尽可能维持持有状态，假如出现困难或者说无法以长阳突破的，建议投资者优先考虑减仓或者说停止买入。当前的原则是，区间内从低点高点仍有机会，但高点如果维持高点水平将会产生危险，投资者应保持对于关键节点操作的冷静！当日模糊匹配系统结果为：优先关注 ST 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，投资者今日应该适当需要关注模式定位题材则有：ST 概念、猪肉概念。短期机会应优先考虑把握，本轮修复开始，仍应优先注意高点的冲击强度，不够的话一定开始减仓。

\*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

上面的提示已经说得很清楚，深蓝超算也在上面提示了标的基本介入条件公式，对于该公式在实际应用中是不好预测概率，这里需要通过历史数据得出。简单地讲，如果一只标的潜在上行空间有 1 倍，历史近似情况十有二次发生，而同时潜在下行调整空间只有 50%，但历史近似情况却是十有六次发生，那么预期盈利比例就是  $(1 + 100%) * 0.2 - (1 - 50%) * 0.6 = 10%$ ，也就是说该标的可以操作，公式比较简单，但对于衡量一些错略无法区分的或看似美好，但大比例上涨压缩潜在上行空间、放大潜在下行空间的标的来说，它们是能够被很好甄别出风险的。深蓝超算以前就强调过，人类主观情绪在交易中容易放大错误和失误，那就意味着不管你之前做对过几次，只需要一次原因不明的重大失误，之前的利润积累都会灰飞烟灭，所以一套严密的风险控制、仓位控制系统是非常有必要存在的，深蓝超算花了很长时间搭建个人的一套标准，尽管每个投资者都有差异，但设计这么一套可以贯穿始终的标准对于任何人来说都是很有必要的。回到今日盘面，目前盘面明确在区间内的调整浪中，这一点已经提前预报过了，这里不再赘述，同时投资者也应该明确这轮调整因为幅度和力度都比较到位，理论上说反而缩短了实际调整维持周期，这是好消息，那么现在最大的问题就是是否如预期，大盘能够将本轮调整限制于本周之内。对此，尽管当日周级别预期肯定了调整限制于本周之内的基本方向性观点，但不可否认该修正后预期确认仍需要时间。所以，深蓝超算仍推荐投资者保持警惕的同时注意逆向加仓或至少维持当前仓位（由于维持了重仓状态，深蓝超算已经降低了持股标的的补仓位置，所以目前主要维持持仓状态而暂停加仓），投资者应该对于个人账户持仓状态有一个比较清晰的度量，

这就包括潜在回撤比例、风险水平等等情况以决定短期内是否继续逆向买入。但有一点投资者需要明确，还是那句话，目前至少标的本身不存在选择性问题的，投资者就应该至少维持原有仓位，这里只建议盈利部分保持动态减仓以锁定利润。原则就是如此，并不难理解，其他问题不展开。

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：28.8707；昨日情绪指数：35.0453

当日主力情绪指数：30.5941

当日散户情绪指数：28.8656

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：24.1

历史匹配位置 5 个交易日指数涨跌比例：0.003291

历史匹配位置 5 个交易日指数波动率：9.651

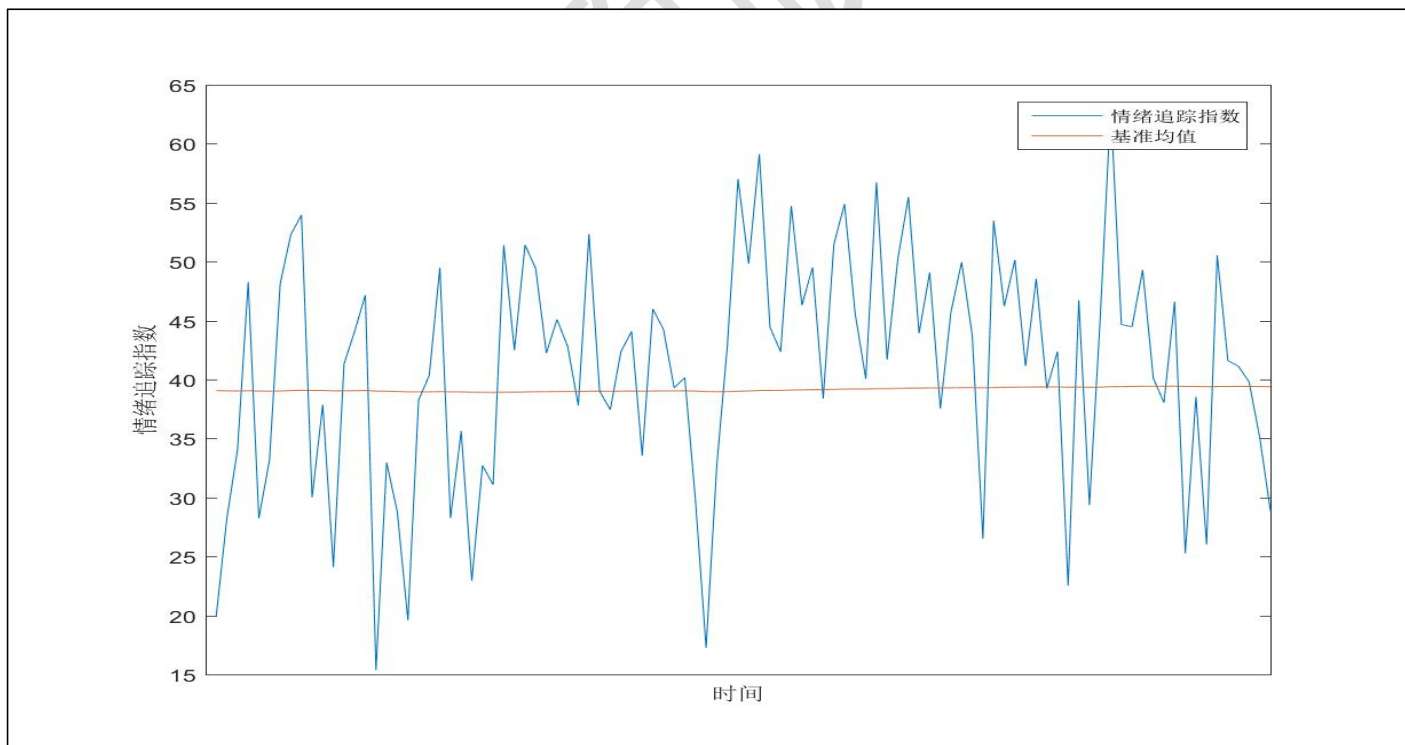
情绪指数是否处于增压区：处于多头增压区

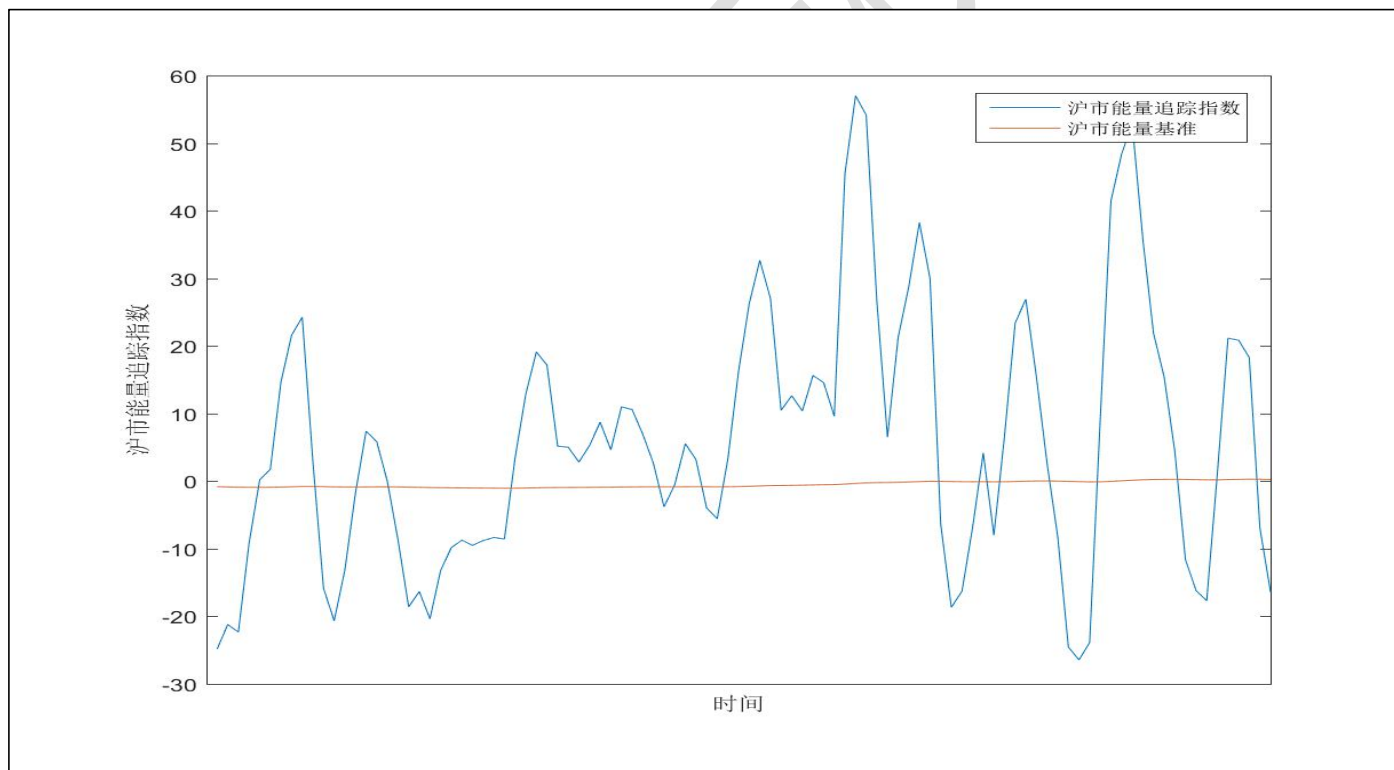
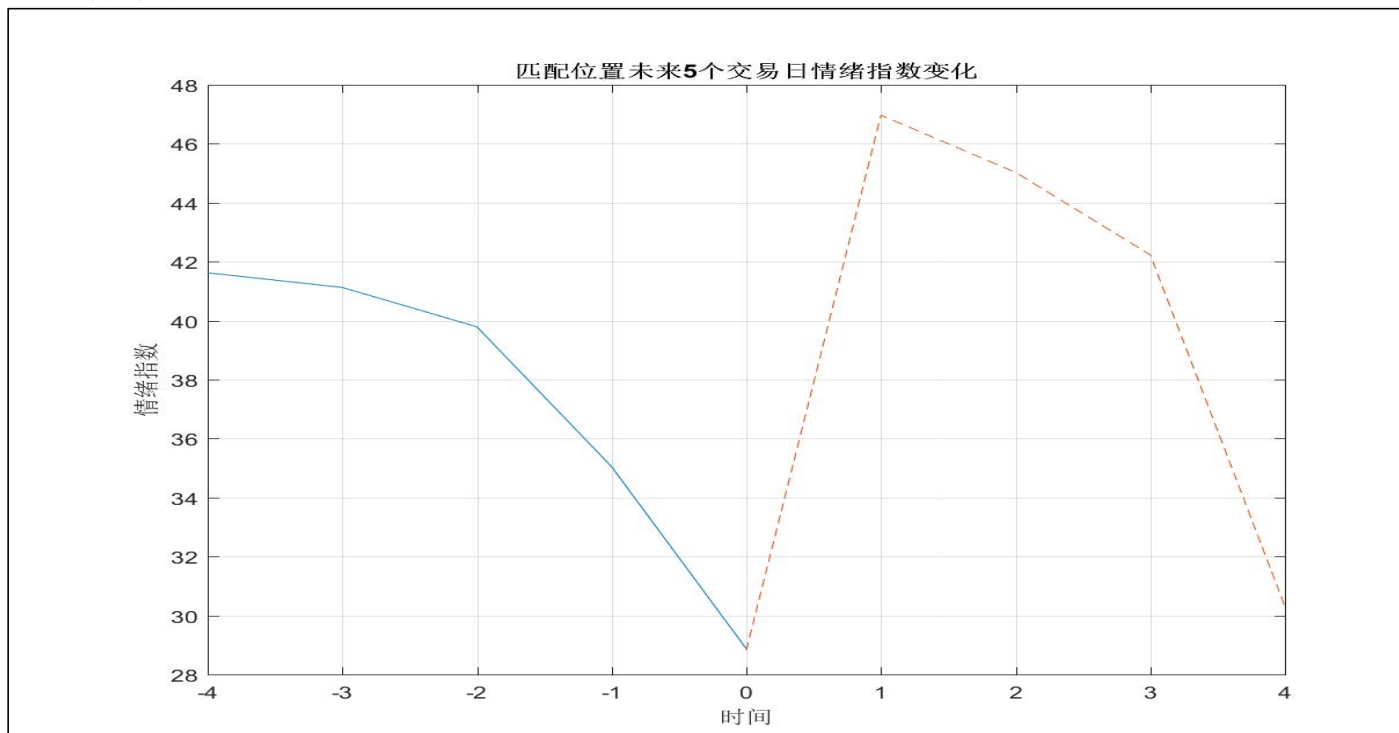
参照点指数反转 2%所需时间：122 个交易日

情绪指数历史参照次日涨概率为：0.74453；次日跌概率为：0.25547

专家系统自校准意见：修正判断为先抑后扬，下杀后反转向，注意反向买入

操作建议校准：近日盘中有可能出现一次 V 型反转形态，市场环境较好，超跌可以迎跌买入，仓位可以适当提高





**当日更新内容分析如下:**

**1、日级别当前以 74.45%置信度转看多预期，系统认可调整周期 1.42-1.79 个交易日的维持，系统目前将调整周期缩短并定位于 1 个交易日左右，即最晚到本周四投资者就应该看到大盘出现反转；当然，本次修复也需要注意，目前对于大盘是否有可能出现突破箱体上沿的问题还不确定，投资者对于相对高点应该尤其注意，这里推荐无法有效突破的情况下优先减仓或清仓。**

**2、周级别修改为看多，目前因为累积调整放大，投资者可以期待大盘出现跨周修复，但目前确认仍需时间。**

**3、月级别基本预期继续维持为看多，月级别看多的问题就不多强调了，投资者维持原操作方向即可。**

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	猪肉概念	6.2099	6	重现
2	超级品牌	4.5271	2	新进
3	上海自贸	3.5357	3	新进
4	券商概念	3.2820	1	新进
5	沪企改革	2.7537	1	新进
6	迪士尼	2.0479	1	新进
7	基金重仓	1.9622	1	新进
8	超级真菌	1.9583	2	新进
9	租售同权	1.4482	1	新进
10	进口博览	1.1456	1	新进

目前大盘方向维持为正向且非稳定，当前各种操作类型可继续，目前建议优先逢低布局，逆向布局机会优先把握。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
ST 概念	1
移动支付	1
食品安全	1
石墨烯	1
互联网金融	1
上海自贸	1
智能电视	1
王亚伟系	1
蓝宝石	1
独家药品	1
智能家居	1
燃料电池	1
氟化工	1
超级电容	1
5G 概念	1
人工智能	1
超级品牌	1
工业大麻	1
猪肉概念	1
债转股	1

历史数据匹配结果不需要深蓝超算做过多解释，目前大盘指数目前维持非稳定正向趋势，当前不宜轻易离场（短期请尽快逆向买入），调整预期目前存在日级别维持的可能性，周内建议继续逆向买入，因为当前波动情况表明大盘

将在周内开始反转。需关注题材如下：ST 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]）：

**当日无单一匹配元素**

多元匹配板块为：ST 概念；五日多元匹配概率为：12.90%。

多元匹配板块为：猪肉概念；五日多元匹配概率为：10.98%。

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 概念和猪肉概念。目前操作继续维持与之前相同，不推荐投资者目前采用任何动量操作策略，低买仍是优先目标。

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	派生科技
中继类型	圣达生物、新美星、七一二、三联虹普、新华网、信雅达、太极集团、华媒控股、锦江投资、飞力达.....
进攻类型	美盈森、万润科技、好利来、坚朗五金、科达利、沃施股份、古鳌科技、万隆光电、上海机场、惠发股份

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、泸州老窖

当日精选	风格精选（已剔除停牌和 ST 股）
策略目标推荐	七一二、新华网、信雅达、锦江投资、东北证券、万润股份、好利来、科达利、万隆光电

\*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，之前所选标的将继续维持，直到不再符合基本条件为止，请注意！

\*今日中继类型标的数量（60 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: 4 月下旬? 已返回主升区间
指数短中期趋势 (周级别)	周级别看多	开始时间: 下周
指数超短期趋势 (日级别)	日级别看多	调整维持周期: 1.42-1.79 个交易日左右

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

2019/04/23

深蓝超算版权所有