

量化交易分析报告

2026-02-27 | 大势评分: 90 分

一、大势分析

指数	收盘	MA20	MA60	>MA20	>MA60
中证 500	8557	8379	7772	✓	✓
中证 1000	8491	8274	7838	✓	✓
沪深 300	4727	4700	4656	✓	✓

大势评分: **90 分** → 强势牛市

建议总仓位: **80-100%**

二、整体仓位规划

建议仓位	持仓数	单只上限	现金
80-100%	3-5 只	15%	20%

三、个股及仓位

#	代码	名称	现价	MA20	5 日%	20 日%	评分	置信度	仓位
1	002594.SZ	比亚迪	96.39	91.06	+6.8	+2.9	95	95%	15.0%
2	601088.SH	中国神华	44.70	41.77	+7.8	+11.8	85	85%	15.0%
3	601225.SH	陕西煤业	24.81	22.48	+9.0	+15.9	85	85%	15.0%
4	688256.SH	寒武纪	1197.00	1164.13	+6.8	-10.3	60	60%	15.0%
5	600519.SH	贵州茅台	1440.10	1452.61	-3.0	+7.7	35	35%	11.8%
6	600036.SH	招商银行	38.66	38.73	-0.1	+3.1	25	30%	不建
7	002371.SZ	北方华创	465.99	482.29	-4.1	-8.7	25	30%	不建
8	603986.SH	兆易创新	295.00	298.68	-4.4	-0.8	25	30%	不建
9	002230.SZ	科大讯飞	54.59	57.19	-4.4	-7.1	25	30%	不建
10	000333.SZ	美的集团	77.46	78.47	-2.0	+0.9	25	30%	不建
11	603259.SH	药明康德	96.32	98.04	-5.5	-1.3	25	30%	不建
12	300750.SZ	宁德时代	346.33	355.69	-5.2	-0.2	15	30%	不建
13	600276.SH	恒瑞医药	54.70	57.66	-6.1	-7.3	15	30%	不建
14	002475.SZ	立讯精密	49.16	51.89	-3.2	-11.4	15	30%	不建
15	002415.SZ	海康威视	31.18	32.10	-3.7	-2.4	15	30%	不建
16	600030.SH	中信证券	27.06	27.91	-2.0	-2.6	15	30%	不建

17	300059.SZ	东方财富	21.93	22.75	-2.0	-5.9	15	30%	不建
18	300760.SZ	迈瑞医疗	183.25	189.46	-1.4	-6.3	15	30%	不建
19	300896.SZ	爱美客	139.73	145.33	-3.8	-2.2	5	30%	不建
20	601318.SH	中国平安	62.45	65.94	-4.3	-2.3	5	30%	不建
21	601888.SH	中国中免	77.90	90.42	-17.7	-16.5	0	30%	不建

四、重点推荐

1. 002594.SZ 比亚迪 现价 96.39 建仓 89.24 止盈 98.35 止损 86.51

仓位:15.0% | 强 | 评分 95

2. 601088.SH 中国神华 现价 44.70 建仓 40.93 止盈 45.11 止损 39.68

仓位:15.0% | 强 | 评分 85

3. 601225.SH 陕西煤业 现价 24.81 建仓 22.03 止盈 24.27 止损 21.35

仓位:15.0% | 强 | 评分 85

4. 688256.SH 寒武纪 现价 1197.00 建仓 1140.85 止盈 1257.26 止损 1105.93

仓位:15.0% | 强 | 评分 60

仅供参考