



拉萨

—— 你的营业部是明牌 ——

十分钟短片剧本

作者：奥米豆

aomidou.com

内容简介

一句话梗概：三十六岁的便利店夜班店员奥米，白天在股吧复盘，是"拉萨军团"的资深成员——东方财富拉萨营业部，全网散户数量最多的席位，人称"散户大本营"。她引以为傲："拉萨出征，寸草不生。"直到某天，一个做量化私募的老同学告诉她：市场上的对手盘模型里，"拉萨席位买入"是一个公开的反向因子——你们每一次打板，都在对手盘的雷达上亮了红灯。你们的勇敢，就是别人的信号。

核心现象：席位数据的双刃剑：龙虎榜公开营业部的买卖数据，而拉萨系营业部聚集了全网最多的散户——于是"拉萨买入"成了散户情绪的公开仪表盘。对手盘不需要偷看你的账户，他们只看第二天的龙虎榜：拉萨大举买入=情绪顶=次日砸盘的坐标。散户以为自己在打板，其实是在给全市场发自己的持仓广播。《门牌》的姊妹篇：那边是冒充游资，这边是猎杀散户自己的明牌。

人物表

奥米	36 岁，便利店夜班店员，白天复盘炒股，本片主角
老同学	量化私募从业者（真相担当）
券商客服	营业部客服
大V	股吧意见领袖

声明：本剧本纯属虚构，人物、机构均与现实无关，不构成任何投资建议。股市有风险，投资需谨慎。龙虎榜数据为公开信息，席位分析不构成投资建议。请理性看待市场数据。

第一场 反向指标

第一钩 · 0:00—0:50

△ 凌晨五点，奥米下夜班。她打开复盘软件，昨天的龙虎榜：她打板的那只票，买一"东方财富拉萨团结路第二营业部"，买入 2.1

亿——那是她所在的"军团"。股吧的热帖标题却是：

△ 特写帖子标题：《拉萨团建完毕，明日核按钮预定》。点赞 3400，评论 900，第一条热评："散户大本营都冲了，谁去接盘？当然是拉萨自己。"

奥米（盯着屏幕，一夜的疲惫全醒了）我们买什么，全世界第二天都知道。我们的勇敢，在别人的模型里，叫"情绪顶点信号"。

△ 黑屏字幕：两个月前。

（旁白）我以为我在打板，后来才明白：我在发广播。我的每一次买入，都是全市场看得见的明牌——而我自己，是最后一个知道的。

第二场 军团

0:50—2:40

△ 两个月前。白天补觉醒来，奥米刷股吧，"拉萨军团出征"的帖子永远沸腾：那是东方财富旗下几家拉萨营业部，因为开户门槛低、互联网导流多，聚集了全网数量最庞大的散户。龙虎榜上，"拉萨天团"常年霸榜买一到买五。

大V（股吧）家人们！拉萨军团出征，寸草不生！昨天的榜一看见没有？五拉萨齐上，这就是人民战争的汪洋大海！

奥米（跟帖）军团出征，寸草不生！+1

△ 她的战法是"跟随军团"：每天收盘看龙虎榜，拉萨大举买入的票，次日竞价跟进。胜率居然不错——毕竟散户合力也是力。她以为这是"与人民同行"。

△（伏笔：她的账户开在拉萨营业部——她从开户那天起，就自动加入了"被观察名单"。她不知道的是，全市场有几百个量化策略的因子库里，都有同一个字段：拉萨买入占比。）

老同学

（偶尔聊天）奥米，你还在拉萨席位？你知道你这等于全市场直播吗？

奥米（不屑）直播怎么了？团结就是力量，拉萨五万人，一人一手就是五百万手，机构怕我们！

第三场 模型

2:40—4:20

△ 老同学约她吃饭，带来一台笔记本，当面给她演示了那个让她血凉的模型：

老同学（指着屏幕）这是我们厂的因子库之一，叫"散户情绪反向因子"。数据就来自公开龙虎榜。逻辑很简单：拉萨系营业部净买入占流通市值超过0.8%

的票，次日开盘卖出的期望收益，为+1.2%；做多的期望收益，为-0.7%。

奥米……什么意思？

老同学 意思是：你们的"军团出征"，在我们的模型里是一个明确的卖出信号。你们合力买得越猛，对手盘第二天砸得越准。你们不是在与庄搏斗，你们是在给庄递坐标。打板族管这叫"承接"，我们管这叫"流动性供给"。

奥米（不服）那是因为你们偷看数据！

老同学（笑了）偷看？龙虎榜是交易所每天收盘后公开发布的，拉萨买入多少、哪几个营业部、金额多大，全网同步。这不是偷看，这是你们自己举着的牌子。你们管拉萨叫"散户大本营"，我们管拉萨叫"散户情绪温度计"。温度计自己不会发热，但它告诉所有看表的人：什么时候该浇凉水。

你所谓的"军团"，在对手盘眼里是一个指标；你所谓的"合力"，在模型里是一个因子。你们所有人在同一时间买了同一只票——这不是力量，这是靶心。

第四场 核按钮

4:20—5:50

△ 回到当下时间线前一天。她打板的"某智能"，拉萨军团五席位齐买 3.8 亿，股吧彻夜狂欢"二波启动"。

△ 次日 9:25，集合竞价：涨停价上挂着 60 万手卖单。9:30 开盘，直接砸到 -3%。全天阴跌，收盘 -8%。当晚龙虎榜：拉萨席位买入 3.8 亿，卖出 1.2 亿——买了砸，砸了买，原来是军团内部的互相踩踏；而卖一，是一家熟悉的一线游资席位，卖出 2.6 亿。

大V（股吧，强行挽尊）洗盘！绝对是洗盘！拉萨的家人拿住！

奥米（这次没有跟帖。她翻开老同学的模型，找到那只票的历史回测：拉萨买入占比 1.1%，模型给出的次日评级：卖出，置信度 87%。）

奥米（给老同学发消息）你早就知道今天会砸？

老同学（回复）我不知道今天。模型只知道"每当这个信号出现，历史上七次天下跌"。我们不下注某一天，我们只下注概率。下注某一天的是你们——而你们每一次下注，都在给我们补充训练数据。

△ 奥米盯着"训练数据"四个字，忽然笑了。她打开交易软件，挂了一个条件单：拉萨席位买入占比超过 0.8% 的票，系统自动拉入黑名单。

你研究的是股票，对手盘研究的是你。席位数据的残酷在于：它保护的从来不是买卖的人，是看得懂数据的人。

第五场 换席位

5:50—7:00

△ 奥米去营业部咨询换席位——换个券商，把账户从拉萨系迁走。

券商客服（客服）女士，拉萨营业部费率万

1.5，是全市场最低的，换别的券商费率会涨到万 3，您确定吗？

奥米 确定。我以前以为低费率是我的福利，现在知道了，那是我的标价——便宜的费率，换来的是我的持仓被广播。这个费率差价，我买的是隐身。

券商客服

（笑）女士，您这个说法很有意思。其实数据公开对所有人是公平的……

奥米 公平？数据是公开的，可模型是私有的。这就好比我的家门敞开是事实，但你天天蹲在我家对面做笔记，就是你不对了。我不怪你们卖数据，我只管我自己的门。

△ 她换了一家传统券商的大户室席位——佣金贵了，但她的买卖从此混在几百个账户的营业部数据里，不再被单独标注为"散户情绪"。

老同学（知道后发来消息）行啊，学会隐身了。不过提醒一句：换席位只是不亮明牌，赢不赢还得看自己的系统。

奥米（回）我知道。我以前是"军团的一员"，从今往后，我是"我自己部队的唯一士兵"。

第六场 独立日

7:00-8:10

△ 三个月后。奥米的账户摆脱了"跟随军团"的打法，开始建立自己的规则：

奥米（笔记本上）第一，不再看股吧热帖买卖——那是情绪的集体广播。第二，不再跟随龙虎榜——那是昨天的战报，不是明天的地图。第三，拉萨买入占比超 0.8% 的票，永久拉黑——不与军团同行，不做靶心。第四，把"军团出征，寸草不生"从我的词典里删掉——寸草不生的，是我们自己。

△ 她的收益曲线不再大开大合，但也不再动不动-8%。夜班时她偶尔打开股吧，"拉萨军团"依旧每天在出征，每天有人晒涨停，每天有人骂"核按钮"。她不再愤怒，只觉得像在岸上看水。

大V（私信她）奥姐，最近军团出征你怎么不跟了？

奥米（回）我退伍了。你们继续保家卫国，我回家种地了。

大V（追）种地能挣几个钱？

奥米（发了一张自己的月度收益截图：+3.1%，连续四个月）不多。但这是我自己挣的钱，不是别人模型里的"供给"。

散户最大的幻觉，是以为自己在一个"集体"里就安全。集体的买卖数据一旦公开，集体就是全市场最大的单一信号——而你，是信号里的一个数字。

第七场 讲坛

8:10-9:20

△ 半年后，一个券商的投资者教育讲座请奥米去做分享——题目是《一个拉萨老兵的退役报告》。台下坐了两百个散户，一半是拉萨军团的老战友。

奥米（开场）我先自报家门：东方财富拉萨团结路第二营业部，前"军团"成员，跟随龙虎榜打板三年，给市场交了 11

万学费。今天不讲怎么选股，讲一件事：你们知道自己每天在裸奔吗？

△ 她把老同学那个"散户情绪反向因子"的公开研究（脱敏版）投在大屏上：拉萨买入占比与次日收益的回测曲线。台下一片哗然。

奥米 我不怪量化，人家用公开数据做研究，合法合规。我怪的是我们自己：我们把自己的买卖，做成了一面全世界都能看见的旗帜，然后抱怨敌人炮火太准。从今天起，记住三件事：不看热帖下单，不跟席位冲锋，不把自己的账户开成全市场的温度计。

台下（有人举手）姐，那我们散户还有活路吗？

奥米 有。活路只有一条：不做信号。你买你的，他算他的——当你不在任何人的因子里发光，你就安全了一半。另一半，靠你自己的系统。

散户的护城河不是人数，是噪音。当你混在人群里发声，你是信号；当你沉默地执行自己的系统，你才是噪音——而市场，收割信号，奖励噪音。

第八场 新榜

9:20-10:00

△ 又一年。奥米夜班下班，照例看一眼龙虎榜。拉萨军团依然霸榜，买的票第二天依然有“核按钮”的帖子。她平静地划过，目光落在一只不起眼的票上：无龙虎榜，无热帖，成交量温和。

△ 她按自己的系统做了检查：基本面过关，位置不高，仓位按计划。买入。

△ 三天后，这只票安安静静涨了7%。股吧无人讨论，没有人喊“出征”，也没有人等“核按钮”。

奥米（旁白）这7%是我挣过最安静的钱。没有军团的呐喊，没有对手的雷达，只有我自己的系统在执行。

△ 手机响，是老同学：“最近没你的拉萨数据了，模型里少了你这个样本。”她笑了，回道：

奥米 样本退役了。从今天起，我是你们因子库里的空值。祝你们的模型，再也抓不到我。

△ 黑屏字幕：市场上只有一种人不交“明牌税”——不把买卖当宣言的人。拉萨的灯永远亮着，但你可以不在灯下站队。

△（完）

节奏与悬念设计说明

时间点	钩子 / 铺垫	作用
0:00	"明日核按钮预定"	生死开局：军团的另一面
1:50	"军团出征寸草不生"	信仰的口号
2:50	反向因子模型	机制全解
4:20	60万手核按钮	信号变现的一天
5:50	"低费率是标价"	醍醐灌顶核心句
7:00	退伍四条	方法落地
8:10	"收割信号，奖励噪音"	题眼
9:20	"我是空值"	终钩：安静的胜利

拍摄与传播提示

1. 本片与《门牌》互为镜像：《门牌》讲散户误信别人的席位，《拉萨》讲散户暴露自己的席位——两集连看，构成"席位双骗"完整图谱。
2. 老同学的"温度计"比喻（散户不发热，但告诉所有人何时浇凉水）是全片最佳台词，务必原样保留。
3. 回测数据细节请量化从业者把关：因子逻辑要讲得清但算得粗，避免变成"策略教学"。
4. 觉悟句只说一遍："集体的买卖数据一旦公开，集体就是全市场最大的单一信号。"
5. 结尾"空值"是技术梗，散户观众未必懂——但弹幕和二次传播会替它解释。

关于奥米豆



奥米豆 (aomidou.com) 是一个专注数据与心性训练的投资成长网站。

《拉萨》里的奥米，从一个"信号"退回了"噪音"。体系的价值，就是让系统替你执行，让数据里没有你。

在奥米豆，你可以：

- 用数据训练眼——席位三查：龙虎榜依赖度、热帖驱动度、营业部集中度；
- 用心性训练手——"军团""出征""合力"写进纪律清单：集体即靶心；
- 最终形成属于自己的投资体系——做噪音，不做信号。

市场收割信号，奖励噪音。

奥米豆 · aomidou.com

—— 本电子书由奥米豆出品 · aomidou.com ——