10.17.2017

Working on hist HK (ytd and wtd sharpe)

Test all output for correctness.

Save into files.

10.18

First day in sz.

Set up database.

Fixed the fx error of total trade pnl.

方大碳素 is getting smoked.

Was in northern china for 2.5 weeks.

What was done:

* Migrating to IntelliJ, set up database
* Restructured code
* Updated A share list
* H share monitor

What was done in summer:

1. R package chinaTrading
2. Migrating to github

**10.19.2017**

HK hist data:

1. Graphing of ytd and wtd data with graphBarTemporal
2. Outputting wtd and ytd data.
3. Do the same thing with US stocks. Want Ytd and Wtd graphs and outputting data on request
4. Analyse top stock ytd and wtd each morning.

Issues:

Hibernate doesn't work with Java 9. (Under Intellij). Might need to add the package JAXB.

Get hibernate to work in Java 9 in intellij. Then can use the latest java 9 compiler and added features in completablefutures etc.

Stocks:

Annual sharpe of some home appliances are back : add pos on 平安，伊利，

US historical data problems:

1. Data is not including after market trading (pre open trading)
2. Using “not start with finished” to identify end of historical data is not correct. Use historicalDataEnd (find out how to implement that). There are some finished processes that are hogging space that doesn’t end with “finished”

2017.10.20

1. BOCFX needs to be periodically obtained from boc whpj website, written into a file, and morningtask needs to retrieve this figure from file, not from online (unstable)

Set up a BABA overnight trader. (Or US general overnight trader)

To be done around 3:45 am to 3:59 am HKT)

Condition:

Day low + wtd low.

Limit position size.

Put limit order.

10.20 weekly recap

Friday, market was up in general, not enough exposure to quality small caps. Too much delta concentrated on the three big names (moutai, icbc and changjiang electric).

Markets started with -4k pnl, recovered to flat by noon and dropped to -6k at finish, whole ptf highly correlated with changjiang elec.

Stay away from Sungang citic, already being checked on flow, go to other branches for last two.

Task this weekend:

10.20 Misc

回深2天。吸收了周边的能量。 要注意最差状态下环境能汲取的能量。09年已经吸收了很多的能量，这是重要的。

深圳明显更绿，环境更好。

如果是在北方，这个季节万物凋零，环境对于人是消耗，人需要不断的抵触环境带来的伤害，这明显是负面的。

注意识别环境是消耗还是补充。

在深圳的几天里，明显有血满复活的感觉。倚赖于绿色的环境，温暖的气候，周围的人气和生活感，还有山的庇护。

如果在最差的心情条件下，环境都可以给予很大的支持，那么这就是一个好环境。

如果下意识是排斥的，基本可以直接排除，下意识包含很多科学的东西。

Whenever something of existence is worse than if you didn’t have it, you need to throw it away. When you think about a period of time in history, if something didn’t exist then life quality would be better, then that something was unworthy of existence.

在海口的时候，周围人还不够，不足以形成能量来源，随着西海岸愈加繁荣，这点可以持续观察。冬天没有雾霾，海口有成为潜在居住城市的潜力。

广州的优点也在于生活的便捷性，舒适度。

香港的生活也不错，吃饭方便，人多，提供很多人气的来源。

纽约冬天的气候不好，当年去的时候状态极好，并且在面试中披荆斩棘，利用运动保持了一段时间的好状态，后来因为天气迅速转凉很快失去的良好的状态。 纽约冬天的阳光还是够的。回忆起在第五大道，中午去吃午饭的情景。阳光还是不错的。但是因为有秋天的萧瑟，是负面的。

这次去京，唯一的成果就是以后再也不想去。空旷的环境，缺少山，水，绿，漫天的苍蝇，灰尘，丑陋的城市。对北京从来没有过好感，对喜欢北京的人也从来不理解。人都是用脚投票的，价值观当中不喜欢北京的早晚会离开。

四大城市当中，广深在南方，相对温暖。但是广州雨水太多，日晒不够，这可以用去海南来解决。海南的3,4,5月可以用来躲避深圳多雨的春天。

深圳整体来说还是正面能量较多。

投资：

在京完成了像intellij的转换，这点是好的。转换的契机是netbeans太不好用了。机动性是很重要的。当感觉不对的时候，立即转换是好的。对感情也要有这种当机立断，对工作也是，后来证明那些都是正确的决定。这次深圳窗户断裂，也是给了一个回来的契机。回来的状态立即好回来不少。

这次处理窗户问题，待人和气，深入老百姓群中，这是好的。不要太高傲。心里要尊重每一个人，要脱敏感化，要接地气。像快手这个平台，很多劳苦大众在上面展现自己的人生，这也是很好的。知乎上面的人鄙视快手；可这才是生活的本真。越是底层，接地气越是实在，踏实。

第一次去一个地方的印象一般很重要。对于北京，98年第一次去就没有好感。05年第一次去深圳，印象不算差。10年来深圳的时候才是喜欢，那段时间的状态一直在提升，也是我人生中最喜欢的阶段之一。只不过当时我没意识到我对其他的地方容忍度那么低，有点complacent，做出了错误的去纽约的决定。纽约阶段没有什么值得回味的地方。但是在深圳，有在那个游泳池迎着太阳游泳的记忆，在华侨城跳水的记忆。有在各种地方吃午饭的记忆，那些都是正面的，是好的，是需要继续的。差的东西是要扔掉的，是要抵制的。

好的地方，好的生活会让人轻松。

好的做事方式，会让人睡得安稳。

好的投资方式，会让人轻松，不紧张，顺其自然，浑然天成。

吃了一次不喜欢的东西，何必再吃？

刚才在fb上读了一篇文章，讲风水。自己感觉好的，就是好风水。这个跟我的观察也是不谋而合。风水不需要什么高深的理论，第一感觉最重要。平准街感觉就不好，那个地方人气不够，活动空间也小，没有足够的藏风聚气。风也大。没有任何优点。没有黑山街57号有足够的人气。

10.21.2017

大部分交易时间都是在写程序。各种流程上省时间，在流程上花时间比盯盘要重要。

Ideally, 每天看盘的时间应该很短。收盘调仓是重要的，也是战略的核心组成部分。

每天需要做的东西需要想方设法的speed up. 每天叠加起来的时间很可观。

This week: bottom line: +18k. (all stocks, futs flat). Trade: +2k.

On per trade basis: 1.2% gain, that is the strength of EOD rebalancing of high sharpe stocks.

交易必须简单化(occam’s razor)

10.22

Realignment of priorities.

Be a bit active. Lose some weight.

10.23凌晨

刚回到家里，今天下午去了广州。车晚点，3点多才到。

到了广州，先去农讲所的中山图书馆。环境不错。

广州最近天气舒适宜人，越秀充满了生活气息。

广州的人群给我的感觉比深圳要朴素，朴实，没那么差的价值观。三观都挺正的，没人特别急躁，大家都不紧不慢。富的早，经过了30多年的积淀，人都比较踏实。

晚上回深圳也是一波三折。本来是没票，后来不知怎么又买到了坐票。(Be nice, and you will be lucky)

广州人特别多，多的超出人的想象。人普遍素质比较高，不紧不慢，不像深圳这样步步紧逼。

广州很明显年轻人更多，单身也多。深圳你出没的地方人比较少，从来没见过这么集中的年轻人群出没。在北京也没有这么多。有很多大学的地方就会有这种向心力。广州三教九流什么都有。人群的素质方差较大，人平均比深圳要穷。但是在广州生活更踏实，更有生活气息。

今后去广州要更加频繁。去的时候要买好回程票，以防万一，坐车的人简直是太多了。

几种方法：手写英文材料，或者用laptop写英文材料。

在购书中心，日语部。

今天和人交谈的机会很多，远远多于自己开车。所以要prefer这种出行方式。尽量接触社会。等车的时候旁边有一个深圳工作的女的一直在抱怨她被要求付5000元饭费的问题。还一直抱怨自己没开车来，这些抱怨太多了。

周围大多数人都在刷朋友圈和微博，这代表了没有思想水平，也是比较差的低档次。还有玩游戏的，都是很差的。下次升舱是最基本的，多20块没什么，却可以过滤掉很多闲杂人等，提高人群的档次。

这次在广州，心态很好，很踏实，心平气和，基本不跟群众产生任何矛盾。这与2013年刚在深圳开车时到处大嗓门是形成鲜明的对比的。深圳的素质还是低，性子还是急。看看漫漫和翠翠，两个在广州长大的人，就很淑女，虽然有小想法但是比深圳长大的好多了。对于深圳长大的人，我不太喜欢。

生活节奏慢下来，心平气和，与人为善，这样自己也高高兴兴。什么事宁可慢不要快。不要急躁。以前在深圳的公交车上，还跟人骂了起来，现在一想都觉得可笑，放在现在的我身上是不可能发生的。

在外长时间曝露的好处就是对外部脱敏，这点很重要，当你长时间在家里的时候，就会过分依赖家里的环境，这个对自己是不利的。所以尽量要在外面。

广州vs深圳。我还是喜欢广州多一些。粤文化圈的底蕴还是好的。也是我所喜欢的。深圳这种乱七八糟大杂烩的感觉我很不喜欢。

之后，如果想在广州一日，早晨出发，中午之前到达，吃饭，下午在省图网络交易即可。早晨也不需要交易。晚上可坐动车返回。这样可以maximize exposure。抓到那些广州上学的深圳人比较好。要点是一定要提前订票，最好是6,7点左右。第二是要有坐垫，即可靠头又可以作为坐垫。

也可以在广住一段时间，体验一下生活。应该是很好的。

现在重点之一就是抢夺资源。投资渐渐走入正轨，也该成家了。今天看到太多了。人那么多，一定有戏。人越多，概率越大，趋近于1。在广州接受教育也是比较好的选择之一。要好于深圳。