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)