工作总结

杨林彬 2016年9月9日星期五

这周主要是把一个暑假的编码结果进行了规范化整理，通过整理做了一些分类优化，也发现了暑假编码中存在的一些问题。目前除了香港联合交易所，所有已有的UK已经整理好。

**优化：**

1. 以上海金属期货交易所为例，其产品都是金属期货。那么文档就按照不同的品种来分类，每一个文档记录着对应种类的金属期货的10年的UK编码。

**问题：**

1. 暑假的期权编码我们是按照自己的一套方案来编码的

(1、一个月的上证50ETF期权按照其权利金的不同有许多支。2、期权在市场上的波动非常频繁。因此我们考虑采用这样的方案:按照月份来给期权编码，并把“交收价格”就看做是权利金，每个月份期权代码最小的期权的权利金令为0，作为基准。其他的高于基准的分别令为1、2、3，类似地，低于基准的权利金就令为-1，-2，-3。随着期权价格的变化，上下浮动的价格序号也会做出相应的调整)

因此在UKID的设置上，和其他产品会稍有不同，其他产品的UKID是直接去取UK码的后8位。而期权的UKID，是按照数据在Excel中的排序直接转化为8位64进制码的。

1. 香港联合交易所的数据暑假做得不够好，准备重新做一次（数据比较乱）。

这周收到张涵雅发来的数据，还没有来得及去处理(那个数据还需要分类)。