第四周工作进展

这一周我主要的工作是上海证券交易所期权、深圳证券交易所基金和国债的uk编码。

期权的编码思路是这样的：比如上证ETF50 12月份的期权可能有好几个权利金。我们利用12位二进制位，以该月份编号最小的期权的权利金为基准，并设定其为0，如果大于这个基准值则分别设为1、2、3，小于基准值则设定为-1、-2、-3，依此类推。

在编辑债券时，每支债券有明确的截止日期，因此对形式为yyyy/mm/dd的日期做了简单的分割处理，提取出年份和月份与1900年1月作比较从而计算出每支期权的日期编码。

深圳交易所上面的数据大多是不分小类的，因此通常是拿到一大堆数据后需要我们自己来分类。比如对于基金来说我们会利用其基金编码来确定其是否为LOF基金（160，162打头）。地债分类到地方债券而贴债则分类到国债中等等。

截至8月5日我们的暑期uk项目就告一段落了，但是这个项目肯定是要长期坚持的，因为很多的uk代码需要维护，股市是千变万化的。此外还有一个非常棘手的问题，就是香港联合交易所非常保守，相关数据难以找全。这些问题都是我们开学来要着手解决的。

**杨林彬**

**2016年8月5日**