工作周报

1. 工作内容及进度：
   * IH和期权套利模型
     + 修订模型策略
     + 编写了程序计算套利模型资金占用保证金及建仓成本价
     + 回扫历史套利情况
     + 2016年八九月份不归零问题，初步确认是除权引起来的，跟万德技术做了沟通，具体情况他们现在正在确认（期权规则还在一直完善中）；
2. 下周计划:
   * 针对该模型，继续确认详情，降低风险；
   * 测试其他套利模式；
3. 其他：

无