工作周报

1. 工作内容及进度：
   * IH和期权套利模型
     + 完善套利组合策略；
     + 检测策略实盘运行情况；
     + Diff计算回测历史；
     + 测试Diff增长影响
       - * 计算了一下去年情况，偏差较大；
         * 下周计划根据去年运行情况，将数据导出，放到同一图上最至关比对，然后估算相关系数；
2. 下周计划:
   * 跟踪组合策略运行情况
   * 下周Diff将增加2000点，套利空间应该有较大反应，根据具体情况，实盘加减仓；
   * 研究其他交易策略；