Option Vol Curve Project

1．

在以下两种Case的情况下，如何利用Wing Model生成每个时刻的Vol Smile，使得每个合约的IV定价跟市场的贴合度尽可能高？

Case 1：临近交割时

Case 2：标的暴跌导致期权一边otm数量少甚至没有时，且很多期权熔断

2．

有没有更好的Vol Curve Model（可以利用以上两种Case进行多方面对比）？

注：

1. 连续交易时间为9：30-11：30， 13：00-14：57， 集合竞价时间为9：15-9：25， 14：57-15:00
2. 每天的数据有两个，分别为Option跟Underlying的数据，其中Underlying的数据为合成数据，Bid=Ask
3. Option数据里，盘中交易Bid = Ask为熔断时刻