策略想法：

想在現有PCP套利策略的基礎上，去設計出多一點風險，同時增加獲得穩定報酬機會的策略，

利用夜盤收盤 (05:00) 與日盤開盤(08:45) 之間的價格變動來做操作，主要是想要透過延遲組建PCP的方式，觀察是否可以創造或放大價差套利空間。

為了規避不完整PCP所帶來的潛在風險，所以只選擇腳3為Short Call 或 Short Put的數據，其代表目前腳1+期貨的損益會類似於Long Call 或 Long Put，風險相對較小。

腳3 (價格較便宜的那個選擇權)

夜盤數據有反映出晚上美股、國際情勢走勢等數據，而隔天的日盤開盤也會

理論上

中間相隔快4小時

目的：想賭賭看如果在有一點點風險的情況下可以獲得怎麼樣的收益。

延續上次PCP策略，嘗試如果在夜盤3:00~5:00時，如果PCP策略出現腳3為SC、SP時，先不買腳3 (只有腳1跟期貨 – 長得像BC、BP)，然後等到日盤開盤在平倉，平倉方法：

1. 找尋履約價相同之SC、SP
2. 如果沒有的話，找開盤後5~10分鐘內之均價 (或是其他設定，相對靠近之100點)
3. 如果都沒有的話，可以選擇直接平倉掉腳1跟期貨

這代表說會有一段時間是沒有組成PCP的

PCP一搶到之後其實就享有比別人更優惠的價格

跑回歸：

第一層先選PCP的其中一筆，第二層去計算這筆PCP隔天開盤前5分鐘均價，去找適合之新的腳3

策略1：在開盤後找到相同履約價的 SC / SP，不過是取其開盤5分鐘內的平均價格

策略2：如果找不到相同履約價，可以找原履約價正負100點上下的合約 (幫我想一下如果有而且不只一個的話，找哪一個比較合適)，也同樣是取開盤5分鐘內的平均價格

平均價格可依照tick資料來計算，雖然可能是不連續的，但沒關係，就是把5分鐘內數據相加在除以相加的總數

策略3：如果連附近100點都沒有，就直接選擇將腳1、期貨平倉，平倉就是根據tick資料，然後做出相反方向的部位操作