# 任务描述

建仓：300个

倒仓：150个

价差：>= 2

区间：[7,10] 平仓BASIS小于7，建仓BASIS大于10

# 学习

建仓：买现货+买认购期权+买认沽期权

平仓：卖现货+卖认购期权+买认沽期权

若建仓顺利，可以根据减仓的BASIS平仓

Profit = 建仓 – 平仓

= 买现货 + 买认购期权 + 买认沽期权 - 卖现货 - 卖认购期权 - 买认沽期权

= 现货 – 现货 + Basis建 – 现货 + 现货 – Basis平

= Basis建 – Basis平

若

等待行权日收取Basis，那么profit只有Basis建仓

所以

可以通过在行权日之前多次交割来累计Basis

# 注意与问题

注意：行权价的月份要选对