Python版本号:3.6.8

策略逻辑：

Dual Thrust是一个趋势跟踪策略，当现价突破上轨时做多，当现价跌穿下轨时做空。 上轨：开盘价+K波动 下轨：开盘价-K波动 波动：max(HH - LC, HC - LL) 其中HH为N天最高价的最大值，LC为N天收盘价的最小值，HC为N天收盘价的最大值，LL为N天最低价的最小值

模型代码概要：

最初，我们根据前几天的开盘价、收盘价、最高价和最低价建立上下限阈值。当市场开盘，价格超过某些阈值时，我们将在上/下阈值之前采取多/空头寸。该策略在日内交易中相当有用。然而，在这个策略中没有止损/盈利的位置。当价格从一个阈值转到另一个阈值时，我们会扭转我们的头寸。我们需要在一天结束前清除所有的头寸。

参考代码原理及出处：

<https://github.com/je-suis-tm/quant-trading#7-dual-thrust>