策略逻辑：

本策略通过识别双重上市的套利机会，两个期货交易所对日内期货价格的错配，并寻求套利点。同时对仓位设立一定的限制，最大进行250次套利交易防止出现大规模损失。

代码模型及简要：

1. 读取两家交易所的数据。
2. 设置前250手数据。
3. 寻找A交易所的Bid价格大于B交易所的Ask价格，以及B交易所的Bid价格大于A交易所的Ask价格的时间戳。
4. 进行买低卖高的套利策略。

参考代码及原理出处：

<https://github.com/JerBouma/AlgorithmicTrading/tree/master/Dual%20Listing%20Arbitrage>