策略逻辑：

菲阿里四价策略是一种简单趋势型日内交易策略。昨天最高点、昨天最低点、昨日收盘价、今天开盘价,可并称为菲阿里四价。

没有持仓下，当现价突破上轨时做多，当现价跌穿下轨时做空；以开盘价作为止损价，尾盘平仓，其中

上轨=昨日最高点；

下轨=昨日最低点；

止损=今日开盘价。

代码模型及简要：

（与DualThrust类似）

1、生成memory日频数据，包括最高价、最低价、开盘价和收盘价

2、生成交易信号，按照条件生成多空信号

参考代码及原理出处：掘金量化（已对在线回测框架进行重构）