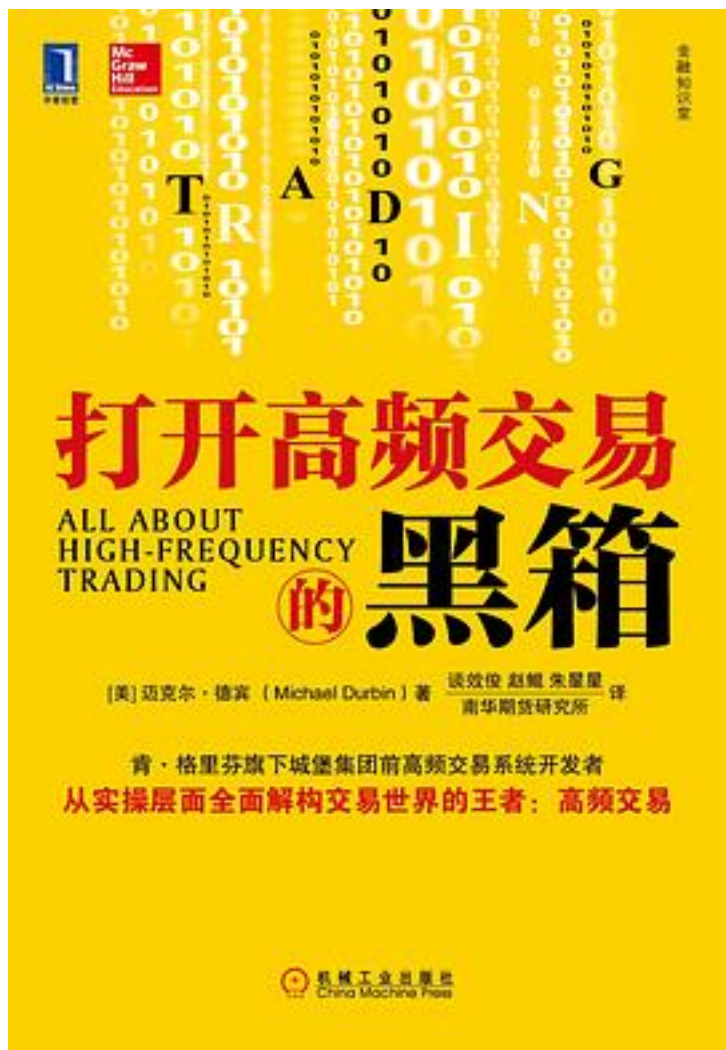


打开高频交易的黑箱



[打开高频交易的黑箱_下载链接1](#)

著者: (美) 迈克尔·德宾

出版者: 机械工业出版社

出版时间: 2014-1

装帧: 平装

isbn: 9787111446583

复杂的金融工程、高端的编程语言、纷繁的交易算法、尖端的硬件体系，这是高频交易的必备元素，但仅有这些是无法构造出高频交易系统的。

为了构建高频交易系统，投资者还必须掌握高频交易背后的市场机理、策略方法、交易规则等知识，而本书则对这些高频交易实际操作中的技巧和方法做了系统的梳理，有助于读者了解高频交易的实际操作与运营的基础知识。同时本书还介绍了做市商制度与各式套利策略。这对于国内读者来说，也是一个很好的借鉴。

作者介绍:

迈克尔·德宾

(Michael Durbin)

资深金融技术咨询顾问，衍生品定价与交易软件系统专家。他的量化投资从业生涯始于MOATS（交易系统之母）团队，当时他主要负责固定收益类衍生品与利率计算软件设计工作。2003年，他加入了知名宽客与对冲基金经理——肯·格里芬的城堡集团，负责构建高频期权交易系统，而正是这套系统，成为了日后城堡集团的印钱机器。2005年，他加入蓝色资本集团，主要负责系统开发与交易主机维护。同时，他还在杜克大学与北卡罗来纳大学教堂山分校担任兼职教授，教授衍生品相关课程。

目录: 前言

第1章 搞砸了 / 1

第2章 交易101 / 9

权益性证券 / 9

交易所 / 13

委托单簿 / 18

交易 / 24

交易者 / 27

第3章 交易策略 / 41

投资者与做市商 / 43

投资者策略 / 46

做市商策略 / 53

再谈投资者策略 / 67

套利策略 / 68

预测者策略 / 78

高频交易者的起源 / 86

第4章 提速 / 89

购买还是自建 / 92

让设计适应变化 / 95

分布式与负载平衡 / 98

设计最高效的软件 / 100

出色的通信机制 / 104

内核之外的任务处理 / 107

并行处理 / 111

直连交易所接收数据和执行指令 / 112

原生API / 114

共置 / 116

高速数据通道 / 118

实时监控 / 121

第5章 揭开面纱 / 125

高频交易服务器的位置 / 126

基础设施：系统通信和数据库 / 129
各种组件 / 130
交互场景 / 156
仪表盘 / 163
合上面纱 / 163
第6章 有关高频交易的争论 / 165
好处 / 165
担忧 / 168
玩过界了？ / 177
未来可期？ / 183
现在如何 / 185
术语表 / 187
· · · · · (收起)

[打开高频交易的黑箱_下载链接1](#)

标签

高频交易

金融

量化

投资

交易

金融科技

计算机

投机

评论

前面的策略部分还行，后面技术就跳过了

正好多看全场免费看三天看着玩，例子很生动，中学生也能看懂

良心作者，确实是在解说高频交易的原理

太可怕了。中国市场如果T+0并放大QFII额度，被人血洗完全是可预期的。

一个高频交易员的自我修养

书比较薄，看得也不仔细，但也对HFT是干啥的，有了些了解。

显然这本书的专业性毋庸置疑，同时也让我们读起来有些晦涩。
书中对交易和委托单成交等细节的描述也确实可以加深我们对金融交易市场的了解！
要详细了解的话得多读几遍，慢慢读，一遍是不行的！毕竟陌生词汇有点多

对外行了解高频交易做什么很有帮助

高频交易入门级读物，语言相对通俗一点。

这本书的作者有特别的写作技巧：明明丢出了海量的专业词汇和专业概念
却能让读者莫名自信自己都读懂了

基本概念科普还可以

基本概念说得很清楚 翻译也很赞！ 作为入门 很好！

科普~

高频交易的儿童绘本，写得挺清楚。三星半。

【Kindle】从程序员视角讲解高频交易

国外的高频交易系统好复杂哦

基础入门

基本上没用。。。满足一下小白的好奇心而已

里面有些策略还是不错的

看完了依旧没赚钱

[打开高频交易的黑箱_下载链接1](#)

书评

做短线你就是跟高频交易的程序作对，直接反应到账户上的就是你操作股指期货或商品期货中巨大的滑价，用过市价单的人都知道。抱歉，你的评论太短了
抱歉，你的评论太短了 抱歉，你的评论太短了 抱歉，你的评论太短了
抱歉，你的评论太短了 抱歉，你的评论太短了 抱歉，你的评...

[打开高频交易的黑箱_下载链接1](#)