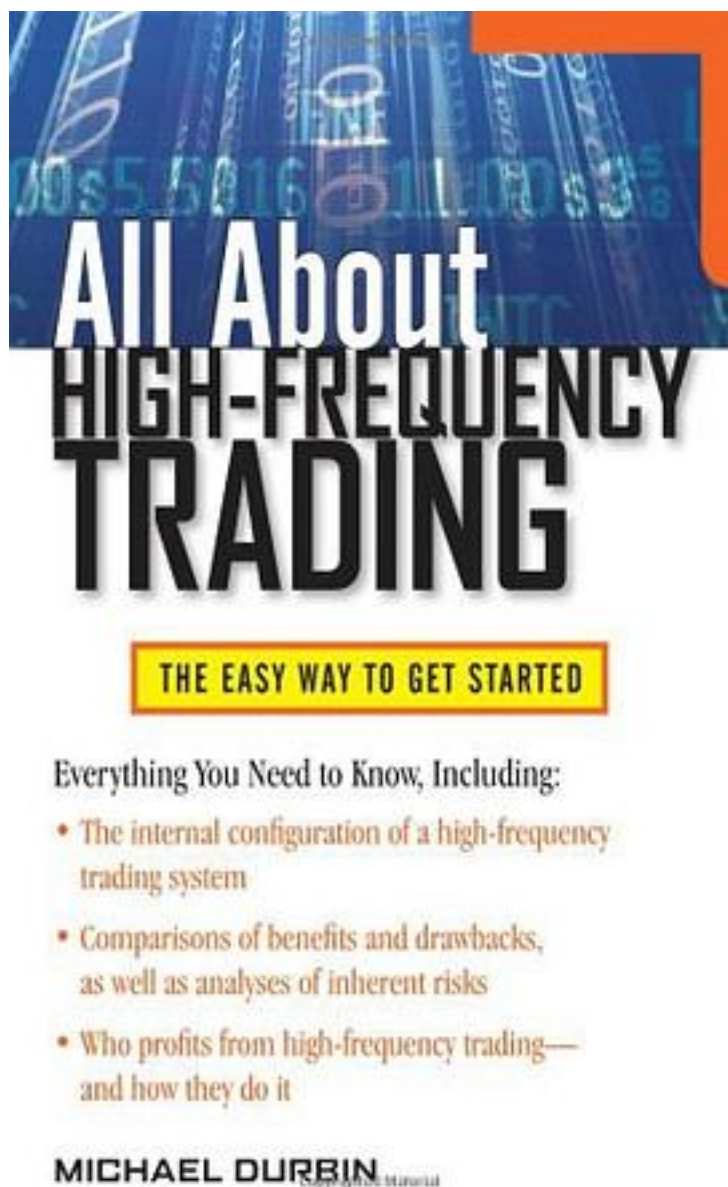


All About High-Frequency Trading



Everything You Need to Know, Including:

- The internal configuration of a high-frequency trading system
- Comparisons of benefits and drawbacks, as well as analyses of inherent risks
- Who profits from high-frequency trading—and how they do it

MICHAEL DURBIN
Copyright © 2010 Michael Durbin

[All About High-Frequency Trading_下载链接1](#)

著者:Michael Durbin

出版者:McGraw-Hill

出版时间:2010-7-26

装帧:Paperback

isbn:9780071743440

A DETAILED PRIMER ON TODAY'S MOST SOPHISTICATED AND CONTROVERSIAL TRADING TECHNIQUE Unfair ...brilliant ...illegal ...inevitable. High-frequency trading has been described in many different ways, but one thing is for sure--it has transformed investing as we know it. All About High-Frequency Trading examines the practice of deploying advanced computer algorithms to read and interpret market activity, make trades, and pull in huge profits--all within milliseconds. Whatever your level of investing expertise, you'll gain valuable insight from All About High-Frequency Trading's sober, objective explanations of: The markets in which high-frequency traders operate How high-frequency traders profit from mispriced securities Statistical and algorithmic strategies used by high-frequency traders Technology and techniques for building a high-frequency trading system The ongoing debate over the benefits, risks, and ever-evolving future of high-frequency trading

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:

[All About High-Frequency Trading 下载链接1](#)

标签

高频交易

交易

金融，交易

量化交易

量化

Microstructure

HFT

对冲基金

评论

别托大了，加个introductory吧，此书的中文版估计会让顾部长那种傻逼趋之若鹜的。

有点走火入魔。。。

介绍了几种简单的套利、高频、做市商策略，手把手教你怎么搭建一个高频平台。现在门槛好高，都要从HFT进化到UHF了。数学和计算机才是通用的工具啊。

入门读物

strategy那章 学了几个新单词嘿 whack-bid lift-offer 这么搭配的啊原来

all about series, brief introduction

看了几页就知道是圈里人写得东西。连jargon都一模一样。当然strategy比较naive啦，但是介绍到这个程度已经不错了。trading infrastructure可以更详细一些的，不过这样已经很有帮助了。under the

hood写得很真实。当然具体的implementation不同Desk各有不同。推荐作为公司未来的培训读物 -.-!

【2017.06.11】理论都是好的，因为国内不能直接接股市交易接口，然后跑的比特币(没有交易手续费前)做测试。在50毫秒的网络时延面前，任何高频交易理论都是扯淡啊。

入门用靠谱。功夫在诗外，搞好数学和计算机，熟悉市场结构是基础。

纯入门的读物

这书的题目取的很好，一个是“All”，另一个是“about”。大抵可以做一本科普的读物来读的，不过好的一点是书不厚，但内容是如此之全，以至于，如果你足够牛，你完全可以在读完后开发出一整套高频交易的系统出来。对于那些想同时看看代码长什么样的人，可以试试那本《Quantitative Trading(How to build your own algorithmic trading business)》

[All About High-Frequency Trading_ 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...

[All About High-Frequency Trading_ 下载链接1](#)