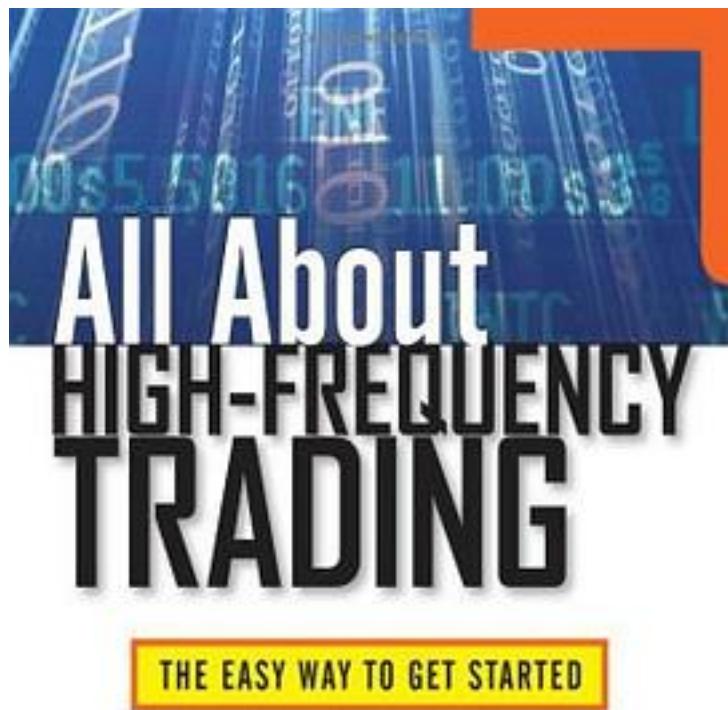


All About High-Frequency Trading



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

[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](#)