[1] Cvitanic J, Kirilenko A A. High Frequency Traders and Asset Prices[J]. Ssrn Electronic Journal, 2010.

[2] Chaboud A P, Chiquoine B, Hjalmarsson E, et al. Rise of the Machines: Algorithmic Trading in the Foreign Exchange Market[J]. The Journal of Finance, 2014, 69(5):2045–2084.

[3] Macintosh J G. High Frequency Traders: Angels or Devils?[J]. Ssrn Electronic Journal, 2013(391).

[4] 来升强. 高频数据交易策略与波动性分析[D]. 厦门大学, 2009.

[5] 王苏生, 江国朝, 余臻,等. 高频交易刍论——基于中国证券市场的实证研究[M]. 清华大学出版社, 2016.

[6] 胡天福. 高频交易在中国证券市场的应用研究[D]. 上海交通大学, 2012.

[7] 潘晔. 基于高频交易模式下期货投资组合策略研究[D]. 华南理工大学, 2014.

[8] 李超. 我国股指期货与股票组合的高频套利策略研究[D]. 南京大学, 2013.

[9] 姜金胜. 证券网上交易及其在我国的发展[J]. 青年学报, 2006, 20(1):61-64.

[10] 蓝海平. 高频交易的技术特征、发展趋势及挑战[J]. 证券市场导报, 2014(4):59-64.

[11] 戴文华. 中国证券市场的技术系统架构和基本要素分析[J]. 证券市场导报, 2003(3):4-8.

[12] 李臻. 基于做市商策略的股指期货市场自动化交易实证研究[J]. 时代金融旬刊, 2015(21):110-112.

[13] 肖卓华. 浅析统计套利的内涵及其在中国的应用前景[J]. 时代金融旬刊, 2011(12):2-2.

[14] 方昊. 统计套利的理论模式及应用分析 --基于中国封闭式基金市场的检验[J]. 统计与决策, 2005(12):14-16.

[15] 王帅. 量化投资:从行为金融到高频交易[D]. 华东师范大学, 2013.

[16] 期货日报. 量化策略的分类和目前国内的市场容量[J]. 期货日报, 2015.

[17] 吴晓雄. 我国主要商品期货的价格波动与避险效率研究[D]. 西南交通大学, 2015.

[18] 王春峰, 张庆翠. 中国股市波动性过程中的长期记忆性实证研究[J]. 系统工程, 2004, 22(1):78-83.

[19] 张宇. 我国股市的动量和反转投资策略实证研究[D]. 复旦大学, 2010.

[20] Long J B D, Shleifer A, Summers L H, et al. Positive Feedback Investment Strategies and Destabilizing Rational Speculation[J]. The Journal of Finance, 1990, 45(2):379-395.

[21] Barberis Nicholas,Andrei Shleifer and Robert Vishny, A model of investor sentiment[J], Journal of Financial Economics, 1998,(3):307-343

[22] Daniel K, Hirshleifer D, Subrahmanyam A. Investor Psychology and Security Market under- and Overreactions[J]. The Journal of Finance, 1998, 53(6):1839-1885.

[23] 波涛. 系统交易方法[M]. 经济管理出版社, 1998.