[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.