

СОДЕРЖАНИЕ

ПРОЛОГ	ДВЕ КУЛЬТУРЫ	19			
■ Физика и финансы	■ Чем занимаются кванты	■ Модель Блэка-Шульца			
■ Кванты и трейдеры	■ Беспристрастное мышление и превосходная математика могут предугадывать законы физики	■ Могут ли они оказаться полезными в такой же мере и в сфере финансовой деятельности?	■		
ГЛАВА 1	ИЗБИРАТЕЛЬНОЕ СРОДСТВО	37			
■ Притягательность науки	■ Славные дни физики элементарных частиц	■ Движимый амбициями в Колумбийский университет	■ Легендарные физики и подающий надежды вундер-кинд	■ Талант против характера, планы против удачи	■
ГЛАВА 2	СТУДЕНЧЕСКИЕ ГОДЫ	49			
■ Студенческая жизнь	■ Замечательные лекции	■ Т.Д. — ярчайшая звезда факультета физики	■ Семь долгих лет	■ Из последних сил	■
ГЛАВА 3	СТИЛЬ ЖИЗНИ	75			
■ Физика как святыня для молодых ученых	■ Непростая жизнь исследователя	■ На краю гибели, публикация — единственное спасение	■ Безумная радость сотрудничества и открытий	■	
ГЛАВА 4	СЕНТИМЕНТАЛЬНОЕ ВОСПИТАНИЕ	89			
■ Очарование Оксфорда	■ Одно исследование по физике влечет за собой другое	■ Особенности английского характера	■ Антропософия	■	
ГЛАВА 5	ЧИНОВНИКИ	103			
■ Карьера физика-исследователя и отцовство на нью-йоркском Верхнем Ист-Сайде	■ Счастливая жизнь, но... минусы похожих карьер	■			
ГЛАВА 6	ЗНАНИЯ ВЫСШИХ МИРОВ	111			
■ Вдали от семьи	■ Новая эра медитации	■ Карма	■ Прощай, физика	■	

ГЛАВА 7	В ИСПРАВИТЕЛЬНОЙ КОЛОНИИ	121
■ Мир промышленности — работа не для души, но ради денег ■ Центр анализа бизнес-систем в лабораториях Белла ■ Маленькая частичка гигантской иерархии ■ Разработка программного обеспечения — это прекрасно ■		
ГЛАВА 8	ВРЕМЯ ОСТАНОВИТЬСЯ	145
■ Уолл-стрит на горизонте ■ Собеседования в инвестиционных банках ■ Прощайте, лаборатории Белла ■		
ГЛАВА 9	ТРАНСФОРМАЦИЯ	157
■ Financial Strategies Group в Goldman, Sachs&Co ■ Изучение теории опционов ■ Превращение в кванта ■ Общение с трейдерами ■ Новый склад характера ■		
ГЛАВА 10	ДОТЯНУТЬСЯ ДО ЗВЕЗД	173
■ История теории опционов ■ Знакомство и сотрудничество с Фишером Блэком ■ Модель Блэка–Дермана–Тойя ■		
ГЛАВА 11	ПОД ВЛИЯНИЕМ ОБСТОЯТЕЛЬСТВ	207
■ Обычай и нравы Уолл-стрит ■ Смелые решения некоторых знакомых ■ Переменчивость заразительна ■		
ГЛАВА 12	ЖЕСТОКИЙ НАЧАЛЬНИК	225
■ Беспокойный год в Salomon Brothers ■ Моделирование ипотечных кредитов ■ Навыки сотрудников Salomon в области количественного маркетинга ■ Удачное увольнение ■		
ГЛАВА 13	ЦИВИЛИЗАЦИЯ И ПРИНОСИМЫЕ ЕЮ ОГОРЧЕНИЯ	239
■ Goldman — дом родной ■ Управление Quantitative Strategies Group ■ Деривативы акционерного капитала ■ Опционы Nikkei и экзотические опционы ■ Тесное сотрудничество с трейдерами ■ Финансовый инжиниринг становится истинным призванием ■		

ОГЛАВЛЕНИЕ	■ 9 ■
ГЛАВА 14 ХОХОТ В НОЧИ	263
■ Загадочная “улыбка” волатильности ■ По ту сторону модели Блэка–Шульца: соревнование по разработке моделей локальной волатильности опционов ■ Правильную модель сложно найти ■	
ГЛАВА 15 ПРОШЛОГОДНИЙ СНЕГ	289
■ Консолидация Уолл-стрит ■ Свободная форма одежды ■ Переход из подразделения деривативов к управлению рисками в пределах всей компании ■ Бум Интернет-компаний ■ Мой уход ■	
ГЛАВА 16 ВЕЛИКИЙ ПРЕТЕНДЕНТ	305
■ Круг замкнулся: возвращение в Колумбийский университет ■ Между физикой и финансами ■ Различные цели и стремления требуют различного уровня точности ■ Финансовые модели в качестве мыслительных экспериментов ■	
ПРЕДМЕТНЫЙ УКАЗАТЕЛЬ	313