

# 이 력 서



이름	유민현	영문	Minhyun Yoo	한문	柳旻鉉
나이	28 (만 26세)				
휴대폰	010-6363-0369	E-mail	ymh1989@korea.ac.kr yoomh1989@gmail.com		
홈페이지	https://sites.google.com/site/yoomh1989/	포트폴리오	https://github.com/ymh1989/		
주소	서울특별시 성북구 안암동5가 고려대학교 정경대학 금융공학협동과정 서울특별시 노원구 공릉동 584-6 405호				

## 학력사항

재학기간	학교명 및 전공	학점	구분
2015.03-2017.02	고려대학교 금융공학협동과정 석사과정 지도교수: 수학과 김준석 교수님		재학
2008.03-2015.02	고려대학교 세종캠퍼스 컴퓨터정보학과 연계전공: 파생금융공학	4.06 / 4.5	졸업
2005.03-2008.02	과천고등학교		졸업

## 활동사항

기간	활동 내용	활동구분	기관 및 장소
2014.12-현재	병렬프로그래밍(CUDA) 이용 금융공학 솔루션 개발	연구원	가람애널리틱스
2015.07-현재	산업수학 점화 프로그램	실무책임자	고려대학교 수학과 국가수리과학연구소
2016.03-현재	서울과학고 R&E 프로그램 지도	연구조교	고려대학교 수학과
2015.08-2015.09	산학협력 프로젝트 - 국내 증권사 장외파생 상품 가격결정 모듈 검증	연구원	고려대학교 수학과
2015.03-2015.12	서울과학고 R&E 프로그램 지도	연구조교	한국의대 수학교육과

## 관심분야

수치적 방법을 이용한 파생상품 가격결정 및 헷징
유한차분법을 이용한 편미분 방정식의 수치적 해법
적응식 격자를 이용한 유한차분법
미국식 옵션의 수치적 해법
분산감소 기법을 이용한 몬테칼로 시뮬레이션
다차원 금융문제 (Stochastic volatility, Jump-diffusion 모델 등)
국소변동성
프로그램 최적화 및 고성능 컴퓨팅 (CUDA)

## 관련 기술

프로그래밍 언어: C, C++, CUDA C, C#, Python, MATLAB
운영체제: Windows, Linux, Mac

## RESEARCH PUBLICATIONS

Choi, Y., Jeong, D., Kim, J., Kim, Y. R., Lee, S., Seo, S., & Yoo, M.

Robust and accurate method for the Black-Scholes equations with payoff-consistent extrapolation, Communications of the Korean Mathematical Society, 30(3), pp.297-311, 2015.

Choi, Y., Jeong, D., Lee, S., Yoo, M., & Kim, J.

Motion by mean curvature of curves on surfaces using the Allen-Cahn equation, International Journal of Engineering Science, 97, pp. 126-132, 2015.

Yoo, M., Jeong, D., Seo, S., & Kim, J.

A comparison study of explicit and implicit numerical methods for the equity-linked securities, The Honam Mathematical Journal, 37, pp. 441-455, 2015.

Kim, J., Kim, T., Jo, J., Choi, Y., Lee, S., Hwang, H., Yoo, M., & Jeong, D.

A practical finite difference method for the three-dimensional Black-Scholes equation, European Journal of Operational Research, 2015.

Jeong, D., Yoo, M., & Kim, J.

Accurate and efficient computations of the Greeks for options near expiry using the Black-Scholes equations, Discrete Dynamics in Nature and Society, 2016.

Kim, J., Yoo, M., Son, H., Lee, S., Kim, M., Choi, Y., Jeong, D., & Kim, Y.

Path Averaged Option Value Criteria for Selecting Better Options. Journal of the Korean Society for Industrial and Applied Mathematics, 20(2), pp.163-174, 2016.

## WORKING PAPERS

Jeong, D., Li, Y., Lee, S., Yoo, M., Choi, Y., & Kim, J.

Numerical simulation of the zebra pattern formation.

Jeong, D., Yoo, M., & Kim, J.

A hybrid Monte Carlo and finite difference method for option pricing.

Jeong, D., Yoo, M., & Kim, J.

Finite difference method for the Black-Scholes equation without boundary conditions.

## BOOK

정다래, 김영록, 황형석, 유민현, 김준석,

파생상품 프로그래밍,

경문사, 2015.

## 병역

복무기간	군별/ 계급/ 특기	미필사유
2010.02.17-2011.12.06	육군 / 병장 / 자동화체계운용	-

상기에 작성한 내용은 사실과 다름이 없음을 확인합니다.