

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, Vol. 30, No. 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, Vol. 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, Vol 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, Accepted, 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.