



孙丽华  
副教授

院系: 经济与金融系  
邮箱: sunlihua@tongji.edu.cn  
办公电话: +86-21-65982274

## 教育经历

- 2006-2010: 博士 香港科技大学
- 2002-2006: 学士 北京大学

## 研究与教学领域

- 投资组合与风险管理, 金融衍生品定价, 最优化方法, 蒙特卡洛模拟

## 语言能力

- 英语: 熟练

## 工作经历

### 教学经历

- 2010/12-至今: 同济大学经济与管理学院经济与金融系

### 海外经历

- 2014/11/06-2014/11/18: 美国运筹与管理学会, Yingdi 公司, 参加会议及学术交流
- 2014/10/02-2014/10/14: 芬兰阿尔托大学, 学术交流
- 2013/08: 香港 East Asian Simulation Workshop, 发言
- 2010/11-2011/02: 香港科技大学, 访问教授
- 2011/12: Winter Simulation Conference 美国亚利桑那州凤凰城, 会议发言
- 2009/12: Winter Simulation Conference 美国德克萨斯州奥斯丁市, 会议发言
- 2006/09-2010/09: 香港科技大学, 博士在读

## 科学研究

### 研究项目

- 国家自然科学基金: 用方差减小技术估计协方差矩阵可变时投资组合的 VaR 和 CVaR, 2011/01-2013/12
- 上海市人力资源与社会保障局: 用方差减小法定价高维价外美式期权, 2012

### 部分出版物

- Lihua Sun, L. Jeff Hong, Zhaolin Hu, Balancing Exploitation and Exploration in Discrete Optimization via Simulation Through a Gaussian Process- Based Search, Operations Research,

2014, Vol.62 No.6: 1416-1438

- N. Cai, L. Sun, Valuation of Stock Loans with Jump Risk, *Journal of Economic Dynamics and Control*, 2014, 40(3): 213-214
- Guiyun Feng, Guangwu Liu, Lihua Sun, A Nonparametric Method for Pricing and Hedging American Options, *Proceedings of the 2013 Winter Simulation Conference*, 2013
- Sun, L. and L. J. Hong, Asymptotic Representations for Importance-sampling Estimators of Value-at-Risk and Conditional Value-at-Risk, *Operations Research Letters*, 38, 246-251
- Sun, L., L. J. Hong and Z. Hu, Optimization via Simulation using Gaussian Process-based search, *Proceedings of the 2011 Winter Simulation Conference*, 4134-4145