

金融機関として世界初（注）のインテル® Xeon Phi™ コプロセッサを用いた デリバティブ評価システムの本番運用開始について

みずほ証券株式会社（取締役社長：本山 博史）は、2014年3月10日より世界の金融機関で初めて（注）インテル® Xeon Phi™ コプロセッサを用いたデリバティブ評価システムの本番運用を開始しました。現在、運用を開始しているプレーンデリバティブに加えて、エキゾチックデリバティブについても今夏を目途に本番運用を開始する予定です。

インテル® Xeon Phi™ コプロセッサはインテル株式会社（代表取締役社長：江田 麻希子）が2013年6月に発表した並列高速計算向けのコプロセッサです。世界のスーパーコンピューターがランキングされるサイトで、No.1となったスーパーコンピューターでも使用されています¹。みずほ証券と株式会社フィクスターズ（取締役社長：三木 聡）が共同で開発を行い、インテル® Xeon Phi™ コプロセッサを用いて計算プラットフォームを一新して高速化計算を行うことに成功しました。

低金利環境下での運用手段の一つとしてデリバティブを組み込んだ仕組債に対するニーズが高まるなかで、デリバティブを評価する際の複雑かつ大量の計算を高速化することの重要性が高まってきております。一般に、複雑なエキゾチックデリバティブの計算を行う場合、大量の計算サーバを用意する必要がありますが、インテル® Xeon Phi™ コプロセッサを使った本開発により、従来の計算サーバ、インテル® Xeon® プロセッサ（8コア）搭載システムとの計算比較でおよそ30倍程度の高速化を行うことに成功しました。自社で構築したデリバティブ評価システムの高速化により、お客さまに対して以下のようなメリットがあります。

1. 多くのニーズに対応した大量かつ多様な商品提供をスピーディーに実現できること
2. 評価の精緻化が可能になったことにより、フェアで競争力のあるプライスを提供できること
3. 大量に計算ができることにより、リスク管理を高度化し商品提供者として安心いただけるリスクマネジメントを実践できること

今後もみずほ証券は、最先端のテクノロジーを用いた先進的な取り組みを通じて、お客さまに付加価値の高いサービスを提供してまいります。

¹ スーパーコンピューターランキングサイトTop500に掲載。時点は2013年11月現在
（注）出典：2014年6月2日現在、みずほ証券株式会社調べ

* Intel、インテル、Xeon、Xeon Phiは米国およびその他の国におけるインテル コーポレーションの商標です。
その他の社名、製品名などは、一般に各社の商標または登録商標です。

本発表に際し、インテル株式会社 常務執行役の平野 浩介は、「このたびのみずほ証券株式会社の先進的な取り組みは、より価値の高い金融商品とサービスを提供できると期待しています。デリバティブ評価システムにインテルのテクノロジーが採用され、大幅な処理速度向上が可能となりました。インテルは今後も半導体技術の革新を通じ、より高いコンピューティング環境の創造を進めてまいります」と述べています。

以 上