

【NEWS RELEASE】

2019年10月9日

SMBC日興証券株式会社

クラウドサービスを活用した金融工学計算の基盤構築について

SMBC日興証券株式会社は、クラウドサービスを利用した xVA (信用力や担保金調達のコストをデリバティブ評価に反映させる評価調整基準) の分散計算基盤を開発し、2019年9月より利用を開始いたしました。これにより、計算基盤構築コストの大幅な削減を実現しました。

昨今のグローバルな金融規制やビジネスニーズの変化に応じて、健全な金融取引に求められる計算量は増加の一途を辿っており、計算リソースの確保は大きな課題と言えます。当社ではクラウドサービスの活用により、当社社員による2か月間の開発で最適な計算基盤を構築し、プロジェクト全体の期間は従来の開発手法と比べて5分の1未満への削減を実現しました。同時に、クラウドサービスの特徴である伸縮性を利用し、計算需要の発生に応じた機動的な計算リソースの調達とコストの極小化を実現しております。

本計算基盤はデリバティブの商品供給能力の向上に資する業務インフラであり、今後もデリバティブに対する計算需要の増加が予想される中で、お客さまのニーズへ対応したより迅速なサービス提供を目指すことが可能になりました。

開発には日本マイクロソフト株式会社(本社所在地:東京都港区)が提供するクラウドプラットフォーム「Microsoft Azure」の「Azure Batch」[※]を活用しています。「Azure Batch」を利用した内製開発による計算基盤構築は本邦金融機関で初の公開事例となります。

当社では、「お客さま本位のデジタルライゼーション」を実現するための様々な取り組みを実践しております。本システムも含め、今後もクラウドサービスを最大限に活用した効率的なシステム開発を推進してまいります。

※ 大規模な計算処理能力を提供する Microsoft 社のクラウドサービス。

いっしょに、明日のこと。
Share the Future

【日本マイクロソフト株式会社からのエンドースメント】

日本マイクロソフトは、SMBC日興証券株式会社様が最新の分散計算基盤を「Microsoft Azure」により実現されたことを心より歓迎いたします。

本分散計算基盤は金融派生商品の時価評価のための分散リスク計算処理を行うものであり、「Azure Batch」を活用することでハードウェア調達時間をなくすと共に基盤の構築・保守作業を最小化し、高度な金融工学の計算処理開発への注力を実現しています。さらにこれを卓越した技術力による自社開発で進めることで、よりスピーディな商品開発と優れたサービス提供を目指すことが可能になるという素晴らしい事例と考えております。

今後も日本マイクロソフトは金融工学エリアにおけるクラウド技術の更なる活用と発展をご支援して参ります。

日本マイクロソフト株式会社

エンタープライズ事業本部 金融サービス営業統括本部 業務執行役員 統括本部長

綱田 和功

以上