

## 500 gange hurtigere beregning af risici

17/02/2015 - Af Hans Henrik Lærke [hhl@finansforbundet.dk](mailto:hhl@finansforbundet.dk)

Det tidskrævende arbejde med risikovurderinger ser ud til at kunne reduceres med mange, mange timer. En voldsom forøgelse af hastigheden i beregningerne er i hvert fald et resultat af foreløbigt fire års forskningsarbejde, som Københavns Universitet og CFIR står bag sammen med SimCorp, Danske Bank, Nordea og Nykredit.

"Vi har udviklet hardware til en sammenlignelig pris, til det bankerne har i dag. Det er 500 gange speed-up i forhold til det man bruger nu", siger Martin Elsman, centerchef i forskningscentret HIPERFIT (High Performance Computing for Financial Information Technology) ved Københavns Universitet til Nyhedsbrevet Finans.

Ønsket om hurtigere beregninger af risici, som kan give bankerne et overblik over langtidsperspektiverne, var grunden til, at netværksorganisationen CFIR (Copenhagen Finance IT Region) samlede parter fra finansverdenen og forskningsverdenen, så HIPERFIT så dagens lys i 2010.

"Man vil gerne kunne agere hurtigt, når der skal træffes finansielle beslutninger. Og man kan bedre vurdere, hvis man kender tallene", siger Martin Elsman.

Det skal opnås ved, at flere computerkerner arbejder samtidigt om opgaverne. Teknologien og algoritmerne i processen er kendte, men hastigheden skal udvikles. Til det har man hentet inspiration hos en helt anden brugergruppe af hurtigt arbejdende computere.

"Det er den samme teknik, man kender fra computerspil, hvor der er udviklet meget på grafikkort, så flere kerner arbejder sammen. Det er noget af den teknologi, som kan overføres", lyder det.

For at sikre at forskningen retter sig mod bankernes konkrete behov, leverer samarbejdspartnerne SimCorp, Danske Bank, Nordea og Nykredit benchmarks til forskerne fra Datalogisk Institut, Matematisk Institut og Niels Bohr Instituttet på Københavns Universitet.

Perspektiverne i forskernes arbejde er, at bankerne på sigt vil have mulighed for at benytte mere virkelighedsnære modeller for prissætning og risikoberegninger, og de dermed vil kunne beskytte sig bedre overfor konjunkturudsving samt andre risikofaktorer.

Endnu er der lang vej, men en overvejelse bankerne så småt kan begynde at gøre sig sig, er, hvordan de nye værktøjer skal introduceres.

"Vi skal finde ud af, hvordan vi kan få det ind i bankerne. Det er en længere proces, og det er her skoen trykker lige nu", siger centerchefen, der fortæller at en del af forskningscenterets fokus er flyttet til netop den udfordring.

HIPERFITs forskningsarbejde løber frem til 2016. Midlerne kommer fra Det Strategiske Forskningsråd, som har støttet med 31,4 millioner kroner, mens bankerne har spædet til med et tocifret millionbeløb.

[Tak for din anbefaling](#)

Emner:

- [Finansiel sektor](#)
- [Sektorens udvikling](#)

**Start debatten**

**Kommentér**