

平成 28 年 8 月 30 日訂正版

(I-5 の試験時間が変更されていますので、ご注意ください。)

公益社団法人 日本アクチュアリー会
平成 28 年度 CERA 試験・研修要領

平成 28 年 7 月
公益社団法人 日本アクチュアリー会
ERM 資格委員会
委員長 吉村 雅明

日本アクチュアリー会の行う CERA 試験は、ERM(エンタープライズ・リスクマネジメント)に関する専門知識および問題解決能力を有するかどうかを判定することを目的とするものです。また、CERA 研修は、日本の状況を踏まえた ERM 実務に関連する知識・技術の習得等を目的とするものです。CERA 試験および CERA 研修は、CERA 資格認定要件の一部を構成するもので、平成 28 年度は以下の要領で実施します。

また、正会員を対象に、CPD カードを用いた出席確認を行いますので、正会員の方は、CERA 試験・研修ともに既に配付しております CPD カードを忘れずにご持参下さい。

I. CERA 試験

公式 CPD : 3.0 単位
<リスク管理>

1. 試験概要

- 出題: Institute and Faculty of Actuaries (英国アクチュアリー会、以下「IFA」という)の ST9 試験
 - 試験形式: 3 時間の筆記試験
 - 留意点
 - ・問題は英文ですが、解答は日本語に限りません。
 - ・問題の日本語訳が参考資料として添付されます。この日本語訳はあくまで参考のためのものであり、採点は英文の内容に基づいて行われますので、解答にあたっては必ず英文を確認してください。
 - ・使用可能な電卓は、次の条件に該当する機種に限りません。
 - イ. 電源内蔵式であるもの
 - ロ. 数値を表示する部分がおおむね水平であるもの
 - ハ. 外形寸法がおおむね次の大きさを超えないもの [20cm×20cm×高さ 5cm]
 - ニ. 次の機能を有しないもの
 - ・紙に記録する機能
 - ・音(音階、音声等)を発する機能
 - ・プログラムの入力機能
- (注意)電卓の貸出は行わないので、必ず持参してください。なお、過去の ST9 試験の計算を要する試験問題については、いわゆる関数電卓を使用することを前提に出題されていますので、関数電卓を持参してください。ただし、上記のとおりプログラムの入力機能を有する機種は使用できませんので、注意してください。

<使用可能な電卓の例>

イ. 日本で比較的入手しやすい次の機種

- ・ Casio fx-JP900
- ・ Casio fx-375ES
- ・ Sharp EL-520M
- ・ Sharp EL-509M

ロ. IFA が指定する次の機種

- ・ Casio FX82 シリーズ
- ・ Casio FX83 シリーズ
- ・ Casio FX85 シリーズ
- ・ Hewlett Packard HP12c シリーズ
- ・ Sharp EL531 シリーズ
- ・ Texas Instruments BA II Plus シリーズ
- ・ Texas Instruments TI-30 シリーズ

2. 受験資格

日本アクチュアリー会の正会員または準会員

3. 試験範囲及びテキスト等

(1) 試験範囲: ST9試験のシラバスに準拠し、概要は次のとおりです。

- ① ERM Concept and Framework (ERMの概念及び枠組み)
- ② ERM Process (ERMのプロセス)
- ③ Risk Categories and Classification (リスクのカテゴリーと分類)
- ④ Risk Modelling and Aggregation of Risks (リスクのモデリングおよびリスクの統合)
- ⑤ Risk Measurement and Assessment (リスク測定と評価)
- ⑥ Risk Management Tools and Techniques (リスク管理のツール及び技法)
- ⑦ Capital Management (資本管理)

2016年のST9試験のシラバスの詳細については以下のURLを参照してください。

<https://www.actuaries.org.uk/studying/prepare-your-exams/syllabus-and-changes-syllabus>

(2) テキスト・教材

2016年用のテキストは、次の2冊です。

- ・ Lam, James (2014), Enterprise Risk Management: From Incentives to Controls (2nd edition)
(林康史等訳「戦略的リスク管理入門」勁草書房)

- ・ Sweeting, Paul (2011), Financial Enterprise Risk Management

(松山直樹等訳「フィナンシャルERM—金融・保険の統合的リスク管理」朝倉書店)

また、IFAの資格試験を受験する場合は、ActEd※というアクチュアリー教育を行っている英国の会社に登録して、その教材を利用するのが一般的です。2016年用のテキストを含む ST9 試験の教材一式 (Combined Materials Pack) には、上記の2冊のテキストおよび次の教材が含まれ、その購入費用は330ポンド(送料別)です。試験勉強に際しては、テキストを読むだけでなく、これらの教材を活用することを推奨します。

- ・ Course Notes
- ・ Question and Answer Bank
- ・ Series X Assignments

※ActEdの教材利用については、以下のURLを参照してください。

<http://www.acted.co.uk/index.htm>

また、過去のST9試験の問題等については、IFAのホームページに掲載されていますので、以下のURLを参照し、“ST9”を選択してください。

<http://www.actuaries.org.uk/students/pages/past-exam-papers>

4. 合格基準

IFAのST9試験の採点基準・合格基準を参考に、当会で決定します。

5. 試験日時

日程:平成28年9月28日(水)

時間:14:15~17:30(ただし、14:15~14:30は、問題を読む時間(解答を書くことはできません。)
14:30~17:30は、解答時間)

6. 試験会場

TKP 東京駅日本橋カンファレンスセンター TGビル別館4F ホール4A

※会場地図等は、[こちら](#)をご覧ください。昨年と異なりますので、ご注意願います。

(申込人数によっては、会場が変更となる場合があります。その場合には、別途ご連絡します。)

II. CERA 研修

公式 CPD : 14.5 単位 (予定) *
* 詳細案内時に改めて連絡します。
<リスク管理>

1. 研修概要

- 1日半の集合研修です。
- ERMに関する日本特有の状況やERMのケース・スタディについて、講義やグループ学習により理解を深めることを主眼とします。
- 詳細な内容、教材等については、11月中旬にアクチュアリー会ホームページに掲載します。

2. 受講資格

日本アクチュアリー会の正会員または準会員で、原則として平成 28 年度 CERA 試験を受験した者

3. 修了基準

全講義の出席をもって修了とします。一部の講義に参加しても修了とは扱われませんので、ご注意ください。

4. 研修日時

1日目:平成 28 年 12 月 2 日(金) 14:30~19:30

2日目:平成 28 年 12 月 3 日(土) 8:50~19:30

5. 研修会場

アクチュアリー会大会議室

※会場地図等は、[こちら](#)をご覧ください。昨年と異なりますので、ご注意願います。

(申込人数によっては、会場が変更となる場合があります。その場合には、別途ご連絡します。)

Ⅲ. 申込方法等

1. 受験・受講の申込み

(1) 申込方法

別紙(1)「CERA 試験・研修申込手続等について」の要領に従ってお申し込みください。

(2) 受験料・受講料

75,000 円(CERA 試験受験料 45,000 円、CERA 研修受講料 30,000 円)※

※CERA 試験のみ申し込む場合は 45,000 円、CERA 研修のみ申し込む場合は 30,000 円

(既に CERA 研修を修了済の方は、CERA 研修の再受講は不要です。)

なお、CERA 研修のみの申込は、既に CERA 試験に合格している方に限ります。)

(3) 申込締切日※

平成 28 年 8 月 1 日(月)当日消印まで

※締切後は一切受け付けませんので、十分ご注意ください。

(4) 申込書

「CERA 試験・研修申込書」は別紙(2)のとおり。「申込書記入時の注意」に従い、必要事項を正確にご記入ください。

2. 受験・受講票の送付

受験・受講票は 8 月末に送付します。9 月 5 日(月)までに受験・受講票が到着しない場合は、日本アクチュアリー会事務局(電話:03-5548-6033、E-Mail: cera2016@actuaries.jp)へお問い合わせください。

3. 合格者の発表・研修結果の通知

○発表・通知時期:平成 29 年 1 月中旬の予定(受験・受講票送付時に通知します。)

○発表方法:CERA 試験については、日本アクチュアリー会ホームページ(<http://www.actuaries.jp/>)にて合格者の受験番号を掲示します。また、合否結果は、申込書記載の送付先住所への直接郵送により本人あてに通知します。CERA 研修については、研修結果(修了したか否か)を申込書記載の送付先住所へ直接郵送することにより本人あてに通知します。

4. 個人情報の取扱い

申込書に記入された「氏名」「生年月日」「住所」等および合否結果等の個人情報については、試験・研修運営、試験・研修関係事務(受験・受講票等の送付等)、会員管理事務(通信事務等)および統計資料、その他当会の運営に必要な資料の作成に利用します。また、IFA に提供されることがあります。

なお、CERA 試験合格者および CERA 資格取得者の方につきましては、当会会員向けに発行するアクチュアリージャーナルに「氏名」「所属会社名」を掲載する予定です。掲載を希望されない方は、合格発表日から1週間以内(当日の消印有効)に書面にて日本アクチュアリー会事務局までお申し出ください。

(参考)CERA 資格認定要件は、以下のとおりです。

CERA 資格の取得を希望する者で次の要件をすべて満たした者に対して、当会理事会の承認を経て、CERA 資格を付与します。

- ①日本アクチュアリー会の正会員
- ②CERA試験に合格
- ③所定のCERA研修を修了
- ④所定の同意書に署名(CERAが国際的に相互認定される資格であることから、懲戒に関する公開情報は他国にも知らしめる必要があるため、懲戒の訴えに関する公開情報がCERA資格認定を行う他国のアクチュアリー会に伝達されること等への同意が必要)

以上