

平成 28 年 11 月 18 日

CERA 研修申込者各位

(公社) 日本アクチュアリー会
ERM 資格委員会
委員長 吉村 雅明

平成 28 年度 CERA 研修開催案内

平成 28 年度の CERA 研修を下記の要領により開催いたします。

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、9 月 28 日に実施した CERA 試験とともに CERA 資格認定要件の一部を構成します。参加申込者におかれては、下記内容を熟読の上、ご参加ください。

記

1. 日 時

1 日目：平成 28 年 12 月 2 日（金） 14：30～19：40
2 日目：平成 28 年 12 月 3 日（土） 9：00～19：40

公式 CPD：14.5 単位
<リスク管理>

2. 場 所

日本アクチュアリー会 大会議室
東京都中央区晴海 1-8-10 晴海アイランド トリトンスクエア オフィスタワーX 2 階
詳細は以下の URL をご参照ください。

<http://www.actuaries.jp/intro/index.html>

3. スケジュール（変更の可能性があります）

○ 1 日目：平成 28 年 12 月 2 日（金）

時間	内容	講師
14：30～14：35	委員長挨拶	ERM 資格委員長 吉村 雅明 君
14：35～15：40	イントロダクション・参加者の自己紹介	明治大学 松山 直樹 君
15：50～17：50	GW*：リスク管理におけるベストプラクティスの評価	明治大学 松山 直樹 君
18：00～19：30	講義：リスクアペタイトフレームワークとストレステストについて	金融庁 内田 善彦 氏
19：30～19：40	一日目のまとめ	明治大学 松山 直樹 君

○ 2 日目：平成 28 年 12 月 3 日（土）

時間	内容	講師
9：00～9：10	2 日目のガイダンス	明治大学 松山 直樹 君
9：10～10：10	講義：試験における弱点の補強と解説	明治大学 松山 直樹 君
10：20～12：20	GW*：戦略リスクの特定とその軽減策	明治大学 松山 直樹 君
12：20～13：30	昼食	
13：30～15：30	GW*：投資戦略への ALM 原則の適用についての分析	明治大学 松山 直樹 君
15：40～17：40	GW*：現代的なイミュニゼーションと実際	明治大学 松山 直樹 君
18：00～19：30	講義：リスクの定量化について	東京大学名誉教授 楠岡 成雄 氏
19：30～19：40	まとめ	明治大学 松山 直樹 君

*GW：グループワーク

4. 研修資料

(1) 事前に読んでおくべき資料（⑥のみ当日ご持参ください）

① CERA 試験（ST9）の全教材

② IAA「アクチュアリーによる包括的リスク評価 CARE（2010）」

<http://www.actuaries.jp/comm/ERM/ERM-255.pdf>

③ 金融庁金融研究研修センター「欧州の先進的な保険リスク管理システムに関する研究会報告書」（2008）

<http://www.fsa.go.jp/frtc/kenkyu/20080909/01.pdf>

④ IAIS「ALM 基準」（2006）

http://www.actuaries.jp/comm/toushiriron_alm/aj65.pdf

⑤ IAIS「ALM イシューペーパー」（2006）

http://www.actuaries.jp/comm/toushiriron_alm/aj68.pdf

⑥ 追加資料（研修 1 週間前までに配布予定）

(2) 当日配布資料

(3) 参考資料

藤井健司「増補版 金融リスク管理を変えた 10 大事件+X」（金融財政事情研究会）

藤井健司「日本の金融リスク管理を変えた 10 大事件」（金融財政事情研究会）

5. 修了基準

全ての講義・グループワーク(GW)への出席をもって修了とします。一部にしか出席されない場合や、講義・GW への参加態度によっては修了と判定できない場合もありますので、ご注意ください。

6. 注意事項等

① 受験・受講票および写真付身分証明書を持参してください（1 日目、2 日目とも）。いずれかでも持参していない場合は受講できません。

② 正会員の方は CPD カードも持参してください（1 日目、2 日目とも）。

③ 筆記用具、電卓（電源内蔵式で、紙に記録する機能、音（音階、音声等）を発する機能のないもの）および事前に送付した研修資料（⑥追加資料）を持参してください。

④ 会場は、1 日目（12 月 2 日（金））は 14:00、2 日目（12 月 3 日（土））は 8:30 に開場します。それまで会場には入場できません。

⑤ 受講番号（Y+4 桁の番号）と同じ番号の席に着席してください。

⑥ 試験会場内での喫煙・飲食（ガムを含む）は禁止します（昼食時は除きます）。ただし、ペットボトルの飲物は可とします。

⑦ 昼食は各自でご用意願います。（弁当を持参されるか会場近くの飲食店をご利用ください。）

⑧ 携帯電話は、電源を切るか、マナーモードに設定してください。

⑨ 回収を求められた配付資料については、必ず返却してください。

⑩ 研修会場として指定されたエリア以外への立ち入りは禁止します。

以上