

公益社団法人 日本アクチュアリー会
2023 年度 CERA 試験・研修要領

2023 年 6 月 29 日
公益社団法人 日本アクチュアリー会
CERA 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)に関する専門知識及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し、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 試験及び CERA 研修は、CERA 資格認定要件の一部を構成するもので、2023 年度は以下の要領で実施します。

なお、今後以下に記載の実施内容に変更が生じた場合には、当会ホームページあるいは 9 月初旬を目途に試験申込者宛に送付予定の「CERA 試験 注意事項」に記載いたします。

CERA 研修については、10 月末目処に改めてご案内します。

I. CERA 試験

公式 CPD : 3.0 単位
<リスク管理>

1. 試験概要

- 出題: 英国アクチュアリー会 (IFoA) の SP9 試験
- 試験形式: 3 時間 20 分の記述試験
- 留意点:
 - ・日本の CERA 試験は、英国アクチュアリー会 (Institute and Faculty of Actuaries; 以下、IFoA という) の SP9 (Enterprise Risk Management, Specialist Principles) をベースとするもので、オンラインで実施されます。
 - ・所定の要件を満たすコンピュータやインターネットを使用できる環境であれば、どこでも受験可能です。
 - ・問題は英文ですが、解答は日本語に限ります(問題の日本語訳はありません)。
 - ・試験の詳細については、IFoA のホームページの以下の URL を参照願います。

<https://actuaries.org.uk/qualify/my-exams/ifo-a-exams>

SP9 試験はオープンブック試験("open book")であり、書籍、電子ファイル、オンライン等を利用可能ですが、剽窃(※)を行うこと(Plagiarism)等は「不適切な行為」として厳しく禁じられています。「不適切な行為」があったことが判明した場合は、今回の試験を 0 点とし、CERA 資格に関する規則第 12 条に基づき、悪質な場合は将来の受験を禁止することを含めて検討します。

なお、ChatGPT を含む生成 AI (人工知能) ツールの使用は「不適切な行為」として禁じられています。

(※) 剽窃とは、参考にした書籍、資料、過去の試験の解答案等の内容をコピー・ペーストしたり、出典等を明らかにせずあたかも自分の考えであるかのように答案に記載すること。

詳細は次の IFoA のホームページの URL をご一読ください。

① 剽窃の禁止

<https://actuaries.org.uk/qualify/prepare-for-your-exams/assessment-regulations/inappropriate-conduct/plagiarism>

(※) 上記の翻訳を日本アクチュアリー会のHP (CERA について / CERA になるには) に掲載しています。

② AI (人工知能) ツールの使用の禁止

<https://actuaries.org.uk/qualify/my-exams/exam-news/use-of-ai-tools-in-ifo-a-exams/>
<https://actuaries.org.uk/qualify/prepare-for-your-exams/assessment-regulations/use-of-ai-tools-in-ifo-a-assessments/>

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: SP9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 Identification (リスクのカテゴリーと特定)
- ④ Risk Modelling and Aggregation of Risks (リスクのモデリング及びリスクの統合)
- 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)

2023年のSP9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/documents/sp9-syllabus-2023>

(2) テキスト・教材

2023年用のテキストは、次の4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 (2017), Financial Enterprise Risk Management (2nd edition)
(松山直樹訳「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、アクチュアリー会HP
会員専用サイトでは割引価格で購入可能)
- IAA (2009), Practice Note on enterprise risk management for capital and solvency purposes
in the insurance industry
- S&P, Insurance criteria: Evaluating the enterprise risk management practices of insurance companies

IFoA 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。2023年用のテキストを含む SP9 試験の教材一式 (Combined Materials

Pack)には、次の教材が含まれ、その購入費用は 369 ポンド(送料別、eBook は 349 ポンド)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
- 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。

<https://www.acted.co.uk/>

また、過去の SP9試験の問題等については、IFoA 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、“SP9”または“ST9”を選択してください。

<https://www.actuaries.org.uk/studying/prepare-your-exams/past-exam-papers-and-examiners-reports>

(※)上記の翻訳を日本アクチュアリー会のHP(CERA について/CERA になるには)に掲載しています。

4. 合格基準

IFoA の SP9 試験の採点基準・合格基準に従って、当会で決定します。

5. 試験日時

日程 :2023 年 9 月 21 日(木)

開始時刻:IFoA より 8 月下旬から 9 月初旬ごろに送付予定のオンラインによる受験の手続きに記載(開始時刻は 15:00~18:00 の間、英国夏時間で 7:00~10:00)

6. 試験注意事項の送付

9 月初旬を目途に、「CERA 試験 注意事項」を試験申込者に当会から送付いたします。

II. CERA 研修

2023 年度の CERA 研修の実施要領(含、申込方法等)については、10 月末日処に当会ホームページに掲載します。

III. 申込方法等

1. 受験の申込み

(1) 申込方法・申込書

「CERA 試験申込書」は別紙のとおりです。必要事項を正確に記入し、申し込みください。

(2) 受験料

CERA 試験受験料 35,000 円

受験料の領収証は、8月初旬までに日本アクチュアリー会事務局(E-Mail: cera@actuaries.jp)から申込書に記載いただきました e-mail アドレス宛に電子メールで送付します。9月6日(水)までに受験料の領収証が送付されない場合は、事務局(E-Mail: cera@actuaries.jp)へお問い合わせください。

※CERA研修の受講料およびその払込みについては、別途ご案内します。

CERA研修受講料の払込みは試験申込時には不要です。

(3) 申込締切日※

2023年7月19日(水)

※締切後は一切受け付けませんので、十分ご注意ください。また、締切後は受験料の返金はできません。

2. 受験票の送付

受験票は発行しませんが、試験日の2週間前頃に、IFoAよりオンラインによる受験の手続きが通知される予定です。

3. 合否結果の通知

○通知時期:2024年1月中旬頃に通知予定(具体的な日付は受験料の領収証送付時にご案内します)。

○通知方法:合否結果は本人あて(申込書に記載いただきました e-mail アドレス)に電子メールで通知します。

4. 個人情報の取扱い

申込書に記入された「氏名」「生年月日」等及び合否結果等の個人情報については、試験運営、試験関係事務、会員管理事務(通信事務等)及び統計資料、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、IFoAに提供されることがあります。

(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せる必要があるため、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