

公益社団法人 日本アクチュアリー会
2021 年度 CERA 試験・研修要領

2021 年 6 月 30 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、2021 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、当会ホームページにてお知らせします。

また、CERA 研修については、10 月末日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 15 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すが、IFoA では 2020 年 4 月期の試験からオンラインによる受験を導入し、現在は日本の CERA 試験に利用している SP9 を含めて、すべてオンライン試験になっています。このため、昨年度より日本アクチュアリー会でも CERA 試験の実施方法を見直しています
- ・オンライン試験となり、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せん。
- ・試験のオンライン化に伴い、2019 年度まで参考資料として配付していた問題の日本語訳はなくなりました。
- ・オンライン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://www.actuaries.org.uk/studying/my-exams/ifo-exams>

なお、完全なオープンブック試験 ("fully open book") となり、書籍、電子ファイル、オンライン等何でも利用可能ですが、剽窃を行うこと (Plagiarism) は厳しく禁じられています。詳細は IFoA のホームページの上記 URL 内「Examinations Handbook」(P12) をご参照ください。

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)

2021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/studying/curriculum/enterprise-and-risk-management>

(2) テキスト・教材

2021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)
- ・ 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

3冊目および4冊目をテキスト・教材として昨年より追記していますが、どちらも従来から後述の
Combined Material Packに含まれているものであり、実質的な変更はありません。

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。2021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370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 (従前の Question and Answer Bank の内容を含む)
- ・ 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>

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:2021 年 9 月 28 日(火)

時間:未定(開始時刻は 16:00~18:00 の間、英国夏時間で 8:00~10:00)

(注)時間が決まりましたら、当会の HP 等でもお知らせします。

II. CERA 研修

2021 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

別紙(1)「CERA 試験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) 申込書

「CERA 試験申込書」は別紙(2)のとおりです。「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。

(3) 受験料

CERA 試験受験料 35,000 円

受験料の領収証を 8 月末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 1 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。

(4) 申込締切日※

2021 年 7 月 21 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、締切後は受験料は返金できません。

2. 受験票の送付

受験票は発行しませんが、追って英国アクチュアリー会(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:2022年1月中旬の予定(受験料の領収証送付時に通知します。)

○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。

なお、CERA 試験合格者及び 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、合否結果の通知日から1週間以内に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