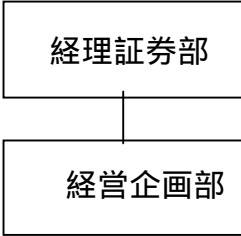


## 【アクションプログラムに基づく個別の取組み】

都留信用組合

|                 |                |   |
|-----------------|----------------|---|
| 項 目             |                | 2. 経営力の強化<br>(6) 協同組織中央機関の機能強化  |
| 現状の分析及び評価       |                | 戦略目標、リスク管理方針に従い運用しておりますが、市場動向に大きく左右される面もあり、そのバランスを取りつつ運用することを意識しております。また、収益目標等に見合った適切な「市場関連リスク」の管理体制の整備・強化を図っております。   |
| 計画<br>(目標設定を含む) | 取組方針<br>及び目標   | 市場リスクを考慮しながら「健全性の維持」と「収益性の向上」の双方バランスの取れた有価証券運用を行います。  |
|                 | 具体的取組策         | 1.市場関連リスクに関するモニタリング報告<br>時価変動額(10BPV、株価10%下落額)の把握<br>2.保有区分の把握と自己資本比率への影響度と正確性の認識<br>(1)自己資本比率の正確性<br>(2)マーケットリスク相当額の算出の正確性<br>3.市場関連リスク管理体制の再認識<br>(1)経営陣の認識および理事会への報告<br>経営方針に沿った戦略目標の明確化<br>ポジション枠の設定とリスク・リミットおよび損失限度の管理<br>(2)リスク管理のための規定等の整備<br>4. A L M管理手法のレベルアップとシステムの再構築 |
| 実施スケジュール        | 17年度上期         | 日々、長期金利の動向、株価等マーケットの動向を注視すると共に、リスク量の測定値を参考に管理体制の整備・強化を図ります。   |
|                 | 下期             |   |
|                 | 18年度上期         |   |
|                 | 下期             |   |
|                 | (参考)<br>19年度以降 |   |
| 推進態勢            |                | 毎月開催される「リスク管理委員会」で、市場リスクの現状把握・分析結果を報告すると同時に、委員会からの指示により更にリスク管理の強化策を図ります。<br><br>推進統括部署 『経理証券部』<br>関連部署 『経営企画部』<br>推進責任者 経理証券部長<br>責任者補佐 経理証券部主任調査役  |

|    |   |
|----|---|
|    |  <pre>graph TD; A[経理証券部] --- B[経営企画部];</pre> |
| 備考 |   |