

# حصر حدود المخاطر السوق غير المتعلقة بالتداول (NTMR)

الفئة	النوع	اسم مقياس المخاطر	الفئة الفرعية	وتيرة المتابعة	نظام إدارة الحدود
أ	مخاطر السوق غير المتعلقة بالتداول (NTMR) على مستوى الشركة المقاييس التنظيمية ومقاييس تقبل المخاطرة	معدل العائد الثابت الفوري (+/-100 نقطة أساس، +/-200 نقطة أساس) حساسية القيمة الاقتصادية (EVS) لـ +/-100 Spot Runoff نقطة أساس، +/-200 نقطة أساس) رأس المال المعرض للمخاطر من الدخل الشامل المترافق (OCI) خسارة الضغط على نسبة NIH لصرف العملات الأجنبية حد خسارة الإجهاد القائم على رأس المال لمخاطر السوق غير المتعلقة بالتداول (NTMR)	CBNA، Citigroup CBNA، Citigroup CBNA، Citigroup CBNA، Citigroup CBNA، Citigroup	شهريًا	Onyx
ب	مقاييس مخاطر السوق غير المتعلقة بالتداول (NTMR) الأخرى على مستوى الشركة (غير التنظيمية وغير المتعلقة بقبول المخاطرة)	حد HLA HTM حد Non-HLA HTM Citigroup FX TCE حد خسارة الإجهاد على AFS حدود حساسية عوامل الخطر	Citigroup	شهريًا شهريًا شهريًا يومياً	Onyx Onyx Onyx Limit Central
ج	مقاييس مخاطر السوق غير المتعلقة بالتداول (NTMR) على مستوى وحدة IRRBB المهمة نسبيًا	معدل العائد الثابت الفوري (+/-100 نقطة أساس، +/-200 نقطة أساس) حساسية القيمة الاقتصادية (EVS) لـ +/-100 Spot Runoff نقطة أساس، +/-200 نقطة أساس) حدود حساسية عوامل الخطر AFS تعرُّض نسبة NIH لصرف العملات الأجنبية عرض المنتج لخسارة الإجهاد على أساس رأس المال حدود مخاطر السوق الأخرى (CR01، DV01)، ورأس المال المعرض للمخاطر من الدخل الشامل المترافق (OCI)، والقيمة الاسمية لسعر الصرف، إلخ)	MT، الكيانات القانونية MT، الكيانات القانونية الكيانات القانونية Citigroup Citigroup GSP، MT، CTI	شهريًا شهريًا يومياً شهريًا شهريًا يومي/ أسبوعي	Onyx Onyx Limit Central Onyx Onyx Onyx / Limit Central
د	مقاييس مخاطر السوق غير المتعلقة بالتداول (NTMR) الأخرى الأقل أهمية نسبيًا	معدل العائد الثابت الفوري (+/-100 نقطة أساس، +/-200 نقطة أساس) حساسية القيمة الاقتصادية (EVS) لـ +/-100 Spot Runoff نقطة أساس، +/-200 نقطة أساس) حدود حساسية عوامل الخطر AFS نظرة أعمال خسارة الإجهاد القائمة على رأس المال حدود مخاطر السوق الأخرى (مخاطر الأساس، وحساسية عوامل خطر MBS، وصرف العملات الأجنبية، إلخ.)	الكيانات القانونية الكيانات القانونية، قطاعات الأعمال الكيانات القانونية قطاعات الأعمال MT، CTI	شهريًا شهريًا يومياً شهريًا يومياً	Onyx Onyx Limit Central Onyx Onyx / Limit Central