

حصر حدود المخاطر السوق غير المُتعلقة بالتداول (NTMR)

نظام إدارة الحدود	وتيرة المتابعة	الفئة الفرعية	اسم مقياس المخاطر	النوع	الفئة
Onyx	شهريًا	CBNA ، Citigroup	معدل العائد الثابت الفوري (+/- 100 نقطة أساس، +/- 200 نقطة أساس) حساسية القيمة الاقتصادية (EVS) ل +/- 100 Spot Runoff نقطة أساس، +/- 200 نقطة أساس) رأس المال المُعرّض للمخاطر من الدخل الشامل المُتراكم (OCI) خسارة الضغط على نسبة NIH لصرف العملات الأجنبية حد خسارة الإجهاد القائم على رأس المال لمخاطر السوق غير المُتعلقة بالتداول (NTMR)	مخاطر السوق غير المُتعلقة بالتداول (NTMR) على مستوى الشركة المقاييس التنظيمية ومقاييس تقبل المخاطرة	أ
Onyx	شهريًا	Citigroup	حد HLA HTM	مقاييس مخاطر السوق غير المُتعلقة بالتداول (NTMR) الأخرى على مستوى الشركة (غير التنظيمية و غير المُتعلقة بتقَبُل المخاطرة)	ب
Onyx	شهريًا		حد Non-HLA HTM		
Onyx	شهريًا		حد خسارة الإجهاد على Citigroup FX TCE		
Limit Central	يوميًا		حدود حساسية عوامل الخطر AFS		
Onyx	شهريًا	CTI ، MT ، الكيانات القانونية	معدل العائد الثابت الفوري (+/- 100 نقطة أساس، +/- 200 نقطة أساس) حساسية القيمة الاقتصادية (EVS) ل +/- 100 Spot Runoff نقطة أساس، +/- 200 نقطة أساس) حدود حساسية عوامل الخطر AFS	مقاييس مخاطر السوق غير المُتعلقة بالتداول (NTMR) على مستوى وحدة IRRBB المهمة نسبيًا	ج
Onyx	شهريًا	CTI ، MT ، الكيانات القانونية	تعرّض نسبة NIH لصرف العملات الأجنبية		
Limit Central	يوميًا		عرض المنتج لخسارة الإجهاد على أساس رأس المال		
Onyx	شهريًا	Citigroup	حدود مخاطر السوق الأخرى (DV01، وCR01، ورأس المال المُعرّض للمخاطر من الدخل الشامل المُتراكم (OCI)، والقيمة الاسمية لسعر الصرف، إلخ)		
Onyx	شهريًا	Citigroup			
Onyx / Limit Central	يومي/أسبوعي	CTI ، MT ، GSP			
Onyx	شهريًا	الكيانات القانونية	معدل العائد الثابت الفوري (+/- 100 نقطة أساس، +/- 200 نقطة أساس) حساسية القيمة الاقتصادية (EVS) ل +/- 100 Spot Runoff نقطة أساس، +/- 200 نقطة أساس) حدود حساسية عوامل الخطر AFS	مقاييس مخاطر السوق غير المُتعلقة بالتداول (NTMR) الأخرى الأقل أهمية نسبيًا	د
Onyx	شهريًا	الكيانات القانونية، قطاعات الأعمال			
Limit Central	يوميًا	الكيانات القانونية			
Onyx	شهريًا	قطاعات الأعمال	نظرة أعمال خسارة الإجهاد القائمة على رأس المال		
Onyx / Limit Central	يوميًا	CTI ، MT	حدود مخاطر السوق الأخرى (مخاطر الأساس، وحساسية عوامل خطر MBS، وصرف العملات الأجنبية، إلخ.)		