

Inventario de límites del NTMR

Categoría	Tipo	Nombre de la métrica de riesgo	Subcategoría	Frecuencia de monitoreo	Sistema de gestión de límites
A	NTMR para toda la empresa Métricas regulatorias y de inclinación al riesgo	IRE estático puntual (+/-100 pb, +/-200 pb)	Citigroup, CBNA	Mensualmente	Onyx
		EVS run-off puntual (+/-100 pb, +/-200 pb)	Citigroup, CBNA		
		Capital en riesgo de OCI	Citigroup, CBNA		
		Pérdida por estrés en el ratio de NIH en FX	Citigroup, CBNA		
		Límite de pérdida por estrés basado en el capital para NTMR	Citigroup, CBNA		
B	Otras métricas de NTMR para toda la empresa (no regulatorias y no relacionadas con la inclinación al riesgo)	Límite HTM HLA	Citigroup	Mensualmente	Onyx
		Límite HTM no HLA		Mensualmente	Onyx
		Límite de pérdidas por estrés del TCE de Citigroup en FX		Mensualmente	Onyx
		Límites de sensibilidad a los factores de riesgo para instrumentos AFS		Diariamente	Limit Central
C	Métricas significativas de NTMR a nivel de unidad dentro del IRRBB	IRE estático puntual (+/-100 pb, +/-200 pb)	CTI, MT, entidades jurídicas	Mensualmente	Onyx
		EVS run-off puntual (+/-100 pb, +/-200 pb)	CTI, MT, entidades jurídicas	Mensualmente	Onyx
		Límites de sensibilidad a los factores de riesgo para instrumentos AFS	Entidades jurídicas	Diariamente	Limit Central
		Exposición al ratio de NIH en FX	Citigroup	Mensualmente	Onyx
		Vista por producto de la pérdida por estrés basada en capital	Citigroup	Mensualmente	Onyx
		Otros límites de riesgo de mercado (DV01, CR01, capital en riesgo en OCI, FX nocional, etc.)	CTI, MT, GSP	Diaria/semanalmente	Onyx/Limit Central
D	Otras métricas de NTMR menos significativas	IRE estático puntual (+/-100 pb, +/-200 pb)	Entidades jurídicas	Mensualmente	Onyx
		EVS run-off puntual (+/-100 pb, +/-200 pb)	Entidades jurídicas, Segmentos de negocio	Mensualmente	Onyx
		Límites de sensibilidad a los factores de riesgo para instrumentos AFS	Entidades jurídicas	Diariamente	Limit Central
		Vista por negocio de la pérdida por estrés basada en capital	Segmentos de negocio	Mensualmente	Onyx
		Otros límites de riesgo de mercado (riesgo básico, sensibilidad al factor de riesgo de MBS, FX, etc.)	CTI, MT	Diariamente	Onyx/Limit Central