

# Inventaire des plafonds NTMR

Catégorie	Type	Nom de l'indicateur de risque	Sous-catégorie	Fréquence de Surveillance	Système de gestion des plafonds
A	NTMR au niveau de l'entreprise  Indicateurs réglementaires et de propension au risque	Spot Static IRE (+/-100 pb, +/-200 pb)	Citigroup, CBNA	Mensuel	Onyx
		Spot Runoff EVS (+/-100 pb, +/-200 pb)	Citigroup, CBNA		
		Capital OCI à risque	Citigroup, CBNA		
		Perte due au stress du ratio FX NIH	Citigroup, CBNA		
		Plafond de perte due au stress basé sur le capital pour le NTMR	Citigroup, CBNA		
B	Autres indicateurs NTMR de l'entreprise (non réglementaires et non basés sur la propension au risque)	Plafond HTM HLA	Citigroup	Mensuel	Onyx
		Plafond HTM non HLA		Mensuel	Onyx
		Plafond de perte due au stress TCE FX de Citigroup		Mensuel	Onyx
		Plafonds de sensibilité au facteur de risque AFS		Quotidien	Plafond central
C	Indicateurs NTMR IRRBB importants au niveau de l'unité	Spot Static IRE (+/-100 pb, +/-200 pb)	CTI, MT, entités juridiques	Mensuel	Onyx
		Spot Runoff EVS (+/-100 pb, +/-200 pb)	CTI, MT, entités juridiques	Mensuel	Onyx
		Plafonds de sensibilité au facteur de risque AFS	Entités juridiques	Quotidien	Plafond central
		Exposition au ratio FX NIH	Citigroup	Mensuel	Onyx
		Perte due au stress lié au capital Aperçu du produit	Citigroup	Mensuel	Onyx
		Autres plafonds de risque de marché (DV01, CR01, capital OCI à risque, valeur notionnelle FX, etc.)	CTI, MT, GSP	Quotidien/hebdomadaire	Onyx/Plafond central
D	Autres indicateurs NTMR moins importants	Spot Static IRE (+/-100 pb, +/-200 pb)	Entités juridiques	Mensuel	Onyx
		Spot Runoff EVS (+/-100 pb, +/-200 pb)	Entités juridiques, secteurs d'activité	Mensuel	Onyx
		Plafonds de sensibilité au facteur de risque AFS	Entités juridiques	Quotidien	Plafond central
		Perte due au stress lié au capital Aperçu de la division	Secteurs d'activité	Mensuel	Onyx
		Autres plafonds de risque de marché (risque de base, sensibilité au facteur de risque MBS, FX, etc.)	CTI, MT	Quotidien	Onyx/Plafond central