

Перечень лимитов по NTMR

Категория	Тип	Название показателя риска	Подкатегория	Частота мониторинга	Система управления лимитами
A	NTMR на уровне всей организации Нормативно-правовые показатели и показатели допустимого уровня риска	Spot Static IRE (+/-100 б. п., +/-200 б. п.) Spot Runoff EVS (+/-100 б. п., +/-200 б. п.) Капитал под риском OCI Стресс-убыток по соотношению FX NIH Лимит стресс-убытка на основе капитала для NTMR	Citigroup, CBNA Citigroup, CBNA Citigroup, CBNA Citigroup, CBNA Citigroup, CBNA	Ежемесячно	Onyx
B	Прочие показатели NTMR для всей организации (не нормативно-правовые и не относящиеся к допустимому уровню риска)	Лимит HLA HTM Лимит, не относящийся к HLA HTM Лимит стресс-убытка FX TCE Citigroup Лимиты чувствительности факторов риска AFS	Citigroup	Ежемесячно Ежемесячно Ежемесячно Ежедневно	Onyx Onyx Onyx Limit Central
C	Значимые показатели NTMR по IRRBB на уровне подразделений	Spot Static IRE (+/-100 б. п., +/-200 б. п.) Spot Runoff EVS (+/-100 б. п., +/-200 б. п.) Лимиты чувствительности факторов риска AFS Подверженность рискам по соотношению FX NIH Стресс-убыток на основе капитала: обзор по продуктам Прочие лимиты рыночного риска (DV01, CRO1, капитал под риском OCI, номинальный FX и др.)	CTI, MT, юридические лица CTI, MT, юридические лица Юридические лица Citigroup Citigroup CTI, MT, GSP	Ежемесячно Ежемесячно Ежедневно Ежемесячно Ежемесячно Ежедневно/еженедельно	Onyx Onyx Limit Central Onyx Onyx Onyx / Limit Central
D	Прочие менее значимые показатели NTMR	Spot Static IRE (+/-100 б. п., +/-200 б. п.) Spot Runoff EVS (+/-100 б. п., +/-200 б. п.) Лимиты чувствительности факторов риска AFS Стресс-убыток на основе капитала: обзор по направлениям деятельности Прочие лимиты рыночного риска (базисный риск, чувствительность факторов риска MBS, FX и др.)	Юридические лица юридические лица, направления деятельности Юридические лица Направление деятельности CTI, MT	Ежемесячно Ежемесячно Ежедневно Ежемесячно Ежедневно	Onyx Onyx Limit Central Onyx Onyx / Limit Central