

Reglement über den Risikoausschuss der Schweizerischen Nationalbank

vom 14. Mai 2004 (Stand am 1. Mai 2013)

I. Allgemeines

Art. 1 Zweck

Dieses Reglement regelt die Aufgaben und Kompetenzen des Risikoausschusses der Schweizerischen Nationalbank (SNB) und legt seine Zusammensetzung und Organisation sowie die Berichterstattung fest.

Art. 2 Auftrag

¹ Der Risikoausschuss unterstützt den Bankrat in der Überwachung (Monitoring) des Risikomanagements und der Beurteilung der Governance des Anlageprozesses.

² Er koordiniert seine Tätigkeit mit jener des Prüfungsausschusses und arbeitet mit ihm zusammen, soweit sich ihre Aufgaben überschneiden.

Art. 3 Zusammensetzung

¹ Der Risikoausschuss besteht aus drei Mitgliedern des Bankrats. Der Bankrat bestimmt jährlich in seiner ersten Sitzung nach der ordentlichen Generalversammlung die Mitglieder und den Vorsitzenden des Ausschusses.

² Die Mitglieder des Risikoausschusses sind unabhängig, insbesondere vom Erweiterten Direktorium. Die Mehrheit der Mitglieder des Risikoausschusses verfügt über Kenntnisse und Erfahrungen auf dem Gebiet des Risikomanagements.

II. Aufgaben

Art. 4 Risikomanagement

¹ Der Risikoausschuss überwacht zuhanden des Bankrats das Risikomanagement der Bewirtschaftung der finanziellen Aktiven.

² Er überwacht das Management der finanziellen, operationellen, rechtlichen und Reputationsrisiken, welche sich aus der Bewirtschaftung der finanziellen Aktiven ergeben.

³ Er berät die Berichte zur Überwachung der Markt-, Kredit- und Liquiditätsrisiken.

⁴ Er beurteilt zuhanden des Bankrats regelmässig die Angemessenheit und Wirksamkeit der eingesetzten Risikomessmethoden und den Ausweis der eingegangenen Risiken.

Art. 5 Governance des Anlageprozess

Der Risikoausschuss beurteilt zuhanden des Bankrats die Governance des Anlageprozesses.

Art. 6 Selbstbeurteilung

Der Risikoausschuss beurteilt regelmässig seinen Aufgabenbereich, die Art der Wahrnehmung seiner Verantwortung und seine Leistung. Er prüft periodisch die Angemessenheit dieses Reglements und unterbreitet dem Bankrat allfällige Änderungsanträge.

III. Kompetenzen

Art. 7 Einsichts- und Informationsrecht

¹ Das Erweiterte Direktorium legt dem Risikoausschuss sämtliche Informationen offen, die er zur Erfüllung seines Auftrags gemäss Artikel 2 benötigt. Der Ausschuss kann vom Erweiterten Direktorium sämtliche Akten und Informationen verlangen, die er dafür als notwendig und geeignet erachtet.

² Der Risikoausschuss kann bei Bedarf Mitarbeitende der SNB befragen. Der Präsident des Direktoriums ist darüber vorgängig zu informieren, sofern der Präsident des Bankrats nicht eine abweichende Anordnung trifft.

Art. 8 Weitere Abklärungen

¹ Der Risikoausschuss kann alle weiteren Abklärungen vornehmen, die er zur Erfüllung seines Auftrags gemäss Artikel 2 als notwendig und geeignet erachtet.

² Er kann dazu zusätzliche interne oder externe Ressourcen (z.B. Spezialisten) beanspruchen. Der Präsident des Direktoriums ist darüber vorgängig zu informieren.

IV. Organisation

Art. 9 Sitzungen

¹ Der Risikoausschuss tagt mindestens zweimal jährlich. Bei Bedarf werden zusätzliche Sitzungen einberufen.

² Die Stellvertreter des II. und des III. Departements sowie der Leiter der OE Risikomanagement wohnen in der Regel den Sitzungen des Risikoausschusses bei. Der Vorsitzende entscheidet über Ausnahmen und den Beizug von Fachspezialisten der SNB.

³ Bei Bedarf werden auch Leiter anderer Organisationseinheiten bzw. Fachspezialisten der SNB beigezogen.

⁴ Der Präsident des Bankrats und die Mitglieder des Direktoriums sind berechtigt, an den Sitzungen des Risikoausschusses (ohne Stimmrecht) teilzunehmen.

Art. 10 Vorsitz

¹ Der Vorsitzende organisiert die Arbeit des Risikoausschusses und legt die Traktanden für die Sitzungen fest. Er lädt mindestens 5 Arbeitstage im Voraus zu den Sitzungen ein, leitet diese und sorgt für die Berichterstattung an den Bankrat.

² In dringenden Fällen kann der Vorsitzende eine Sitzung auch ohne Einhaltung der Einberufungsfrist ansetzen.

³ Bei Verhinderung des Vorsitzenden wird die Sitzung durch ein anderes Mitglied des Risikoausschusses geleitet.

Art. 11 Beschlussfassung und Protokoll

¹ Der Risikoausschuss fasst seine Beschlüsse mit der Mehrheit der anwesenden Stimmen. Bei Stimmgleichheit hat der Vorsitzende den Stichentscheid.

² Er ist beschlussfähig, wenn mindestens zwei Mitglieder anwesend sind. Sitzungsteilnehmer, die per Telefon- oder Videokonferenz zugeschaltet sind, gelten als anwesend.

³ In Ausnahmefällen können Beschlüsse auch auf dem Zirkularweg gefasst werden, sofern nicht ein Mitglied eine Sitzung verlangt. Solche Beschlüsse sind in der nächsten Sitzung in das Protokoll aufzunehmen.

⁴ Über die Sitzungen wird ein Protokoll geführt. Es enthält den Wortlaut der Beschlüsse, bei Beratungen über wesentliche Fragen zudem die Begründung der Beschlüsse.

V. Berichterstattung

Art. 12 Information des Bankrats

¹ Der Bankrat erhält die Protokolle der Sitzungen des Risikoausschusses. Über wichtige Vorfälle wird der Präsident des Bankrats vom Vorsitzenden des Ausschusses unverzüglich informiert.

² Der Vorsitzende unterrichtet den Bankrat an dessen nächster Sitzung über die wesentlichen Erkenntnisse und Entscheidungen des Risikoausschusses. Er unterbreitet dem Bankrat die nötigen Empfehlungen.

Art. 13 Jahresbericht des Risikomanagements

Der Risikoausschuss bringt dem Bankrat den Jahresbericht des Risikomanagements zur Kenntnis, nachdem er im Risikoausschuss vorbesprochen worden ist.

Erlassen durch:	Bankrat	Erlassen am:	14.05.2004
Inkraftsetzung:	01.07.2004	Eigner:	Recht und Dienste
Rechtsgrundlage:	Art. 12 Organisationsreglement		
Ersetzt:	–		
Geändert am:	Geändert durch:	Änderung gültig per:	Ziffer(n):
12.04.2013	Bankrat	01.05.2013	alle