

Règlement relatif au Comité des risques de la Banque nationale suisse

du 14 mai 2004 (état le 1^{er} mai 2013)

I. Dispositions générales

Art. 1 But

Le présent règlement définit les tâches et les compétences du Comité des risques de la Banque nationale suisse (BNS), sa composition, son organisation et les rapports à fournir.

Art. 2 Mandat

¹ Le Comité des risques aide le Conseil de banque à surveiller (*monitoring*) la gestion des risques et à évaluer la gouvernance du processus de placement.

² Il coordonne son activité avec celle du Comité d'audit et collabore avec ce dernier dans la mesure où leurs tâches se recoupent.

Art. 3 Composition

¹ Le Comité des risques se compose de trois membres du Conseil de banque. Le Conseil de banque désigne chaque année, lors de sa première séance qui suit l'Assemblée générale ordinaire, les membres et le président du Comité des risques.

² Les membres du Comité des risques sont indépendants, en particulier de la Direction générale élargie. La majorité des membres du Comité des risques possèdent les connaissances et l'expérience requises dans le domaine de la gestion des risques.

II. Tâches

Art. 4 Gestion des risques

¹ Le Comité des risques surveille la gestion des risques inhérents à la gestion des actifs financiers et en rend compte au Conseil de banque.

² Il surveille la gestion des risques opérationnels, juridiques et de réputation qui découlent de la gestion des actifs financiers.

³ Il examine les rapports sur la surveillance des risques de marché, de crédit et de liquidité.

⁴ Il évalue régulièrement, à l'intention du Conseil de banque, l'adéquation et l'efficacité des méthodes utilisées pour mesurer les risques et l'état des risques encourus.

Art. 5 Gouvernance du processus de placement

¹ Le Comité des risques évalue, à l'intention du Conseil de banque, la gouvernance du processus de placement.

Art. 6 Autoévaluation

Le Comité des risques évalue régulièrement son domaine d'activité, la façon d'assumer ses responsabilités et son travail. Il examine périodiquement l'adéquation du présent règlement et soumet d'éventuelles propositions de modification au Conseil de banque.

III. Compétences

Art. 7 Droit de regard et droit à l'information

¹ La Direction générale élargie met à la disposition du Comité des risques toutes les informations dont il a besoin pour accomplir son mandat conformément à l'article 2. En cas de besoin, le Comité peut exiger de la Direction générale élargie tous les dossiers et toutes les informations qu'il considère comme nécessaires et opportunes.

² Si nécessaire, le Comité des risques peut interroger des collaborateurs de la BNS. Le président de la Direction générale doit en être informé au préalable, sauf disposition contraire du président du Conseil de banque.

Art. 8 Autres investigations

¹ Le Comité des risques peut procéder à d'autres investigations qu'il estime nécessaires et opportunes pour accomplir son mandat conformément à l'article 2.

² A cette fin, il peut mobiliser des ressources supplémentaires, internes ou externes (des spécialistes, par exemple). Le président de la Direction générale doit en être informé au préalable.

IV. Organisation

Art. 9 Séances

¹ Le Comité des risques se réunit au moins deux fois par an. Si nécessaire, des séances supplémentaires sont convoquées.

² Les suppléants des 2^e et 3^e départements ainsi que le chef de l'unité d'organisation (UO) Gestion des risques assistent en général aux séances. Le président peut consentir des dérogations et décider la consultation de spécialistes de la BNS.

³ Si nécessaire, des chefs d'autres unités d'organisation, voire des spécialistes de la BNS, peuvent être appelés en consultation.

⁴ Le président du Conseil de banque et les membres de la Direction générale sont habilités à participer (sans droit de vote) aux séances du Comité des risques.

Art. 10 Présidence

¹ Le président organise le travail du Comité des risques et arrête l'ordre du jour des séances. Il envoie les convocations aux séances au moins 5 jours ouvrés à l'avance, dirige les séances et veille à en rendre compte au Conseil de banque.

² En cas d'urgence, le président peut prévoir une séance même sans observation du délai de convocation.

³ En cas d'empêchement du président, la séance est dirigée par un autre membre du Comité des risques.

Art. 11 Décisions et procès-verbal

¹ Le Comité des risques prend ses décisions à la majorité des voix des membres présents. En cas d'égalité des suffrages, la voix du président est prépondérante.

² Le Comité des risques peut délibérer valablement en présence d'au moins deux membres. Les personnes participant par conférence téléphonique ou vidéoconférence sont considérées comme présentes.

³ A titre exceptionnel, les décisions peuvent être prises également par voie de circulaire, à moins qu'un membre n'exige la tenue d'une séance. Ces décisions doivent être consignées au procès-verbal de la séance suivante.

⁴ Un procès-verbal est dressé pour chaque séance. Celui-ci comprend le libellé exact des décisions et, si les délibérations portent sur des questions essentielles, les motifs des décisions.

V. Rapports

Art. 12 Information du Conseil de banque

¹ Les procès-verbaux des séances du Comité des risques sont adressés au Conseil de banque. Le président du Comité des risques informe sans délai le président du Conseil de banque d'incidents importants.

² Le président informe le Conseil de banque, à sa séance suivante, des constatations et décisions importantes du Comité des risques. Il soumet au Conseil de banque les recommandations nécessaires.

Art. 13 Rapport annuel sur la gestion des risques

Après en avoir discuté en son sein, le Comité des risques présente au Conseil de banque le rapport annuel sur la gestion des risques.

Edicté par:	Conseil de banque	Edicté le:	14.05.2004
Entrée en vigueur:	01.07.2004	Auteur:	UO Affaires juridiques et services
Fondements juridiques:	Art. 12 Règlement d'organisation		
Remplace:	-		
Modifié le:	Modifié par:	En vigueur depuis le:	Chiffre(s):
12.04.2013	Conseil de banque	01.05.2013	Tous