

Regolamento del Comitato dei rischi della Banca nazionale svizzera

del 14 maggio 2004 (stato 1° maggio 2013)

I. Aspetti generali

Art. 1 Finalità

Il presente regolamento disciplina i compiti e le competenze del Comitato dei rischi della Banca nazionale svizzera (BNS), nonché la sua composizione, l'organizzazione e il reporting.

Art. 2 Mandato

¹ Il Comitato dei rischi supporta il Consiglio di banca nella sorveglianza (monitoraggio) della gestione del rischio e nella valutazione della governance del processo di investimento.

² Coordina la propria attività con quella del Comitato di verifica e collabora con esso laddove sussista una sovrapposizione di compiti.

Art. 3 Composizione

¹ Il Comitato dei rischi si compone di tre membri del Consiglio di banca, il quale ogni anno in occasione della prima riunione successiva all'Assemblea generale ordinaria designa i membri e il presidente del comitato.

² I membri del Comitato dei rischi sono indipendenti, in particolare dalla Direzione generale allargata. La maggioranza dei membri del Comitato dei rischi dispone di conoscenze ed esperienza relativamente alla gestione del rischio.

II. Compiti

Art. 4 Gestione del rischio

¹ Il Comitato dei rischi sorveglia la gestione dei rischi inerenti agli attivi finanziari e ne rende conto al Consiglio di banca.

² Sorveglia la gestione dei rischi finanziari, operativi, giuridici e di reputazione derivanti dalla gestione degli attivi finanziari.

³ Discute i rapporti relativi alla sorveglianza dei rischi di mercato, di credito e di liquidità.

⁴ Valuta regolarmente l'adeguatezza e l'efficacia dei metodi impiegati per la misurazione del rischio nonché la rendicontazione dei rischi assunti e ne rende conto al Consiglio di banca.

Art. 5 Governance del processo di investimento

Il Comitato dei rischi valuta la governance del processo di investimento e ne rende conto al Consiglio di banca.

Art. 6 Autovalutazione

Il Comitato dei rischi valuta regolarmente l'ambito di propria competenza, le modalità con cui esercita le proprie responsabilità nonché la propria prestazione. Esso verifica periodicamente l'adeguatezza del presente regolamento e sottopone al Consiglio di banca eventuali proposte di modifica.

III. Competenze

Art. 7 Diritto di consultazione e di informazione

¹ La Direzione generale allargata comunica al Comitato dei rischi tutte le informazioni di cui esso ha bisogno per l'assolvimento del proprio mandato ai sensi dell'art. 2. Il comitato può richiedere alla Direzione generale allargata tutti gli atti e tutte le informazioni che ritiene necessari e idonei a tale scopo.

² All'occorrenza, il Comitato dei rischi può consultare collaboratori della BNS. Il presidente della Direzione generale deve esserne informato preventivamente, salvo diversa istruzione da parte del presidente del Consiglio di banca.

Art. 8 Accertamenti ulteriori

¹ Il Comitato dei rischi può procedere a tutti gli ulteriori accertamenti che ritenga necessari e idonei all'assolvimento del proprio mandato ai sensi dell'art. 2.

² A tal fine può avvalersi di ulteriori risorse interne o esterne (p. es. specialisti). Il presidente della Direzione generale deve esserne informato preventivamente.

IV. Organizzazione

Art. 9 Riunioni

¹ Il Comitato dei rischi si riunisce almeno due volte all'anno. Se necessario, vengono indette riunioni aggiuntive.

² Di regola, i supplenti del 2° e del 3° dipartimento nonché il responsabile dell'UO Gestione del rischio presenziano alle sedute del Comitato dei rischi. Il presidente decide in merito a eventuali deroghe e alla convocazione di specialisti della BNS.

³ All'occorrenza la convocazione è estesa anche a responsabili di altre unità organizzative e a specialisti della BNS.

⁴ Il presidente del Consiglio di banca e i membri della Direzione generale sono autorizzati a partecipare (senza diritto di voto) alle riunioni del Comitato dei rischi.

Art. 10 Presidenza

¹ Il presidente organizza il lavoro del Comitato dei rischi e stabilisce i punti all'ordine del giorno. Convoca le riunioni con un preavviso di almeno 5 giorni, le conduce e ne rende conto al Consiglio di banca.

² In casi urgenti il presidente può indire una riunione anche senza preavviso.

³ In caso di impedimento del presidente la riunione viene condotta da un altro membro del Comitato dei rischi.

Art. 11 Decisioni e verbale

¹ Il Comitato dei rischi delibera a maggioranza dei voti presenti. In caso di parità di voti quello del presidente è decisivo.

² Il Comitato dei rischi è atto a deliberare se sono presenti almeno due membri. I partecipanti collegati per telefono o videoconferenza sono considerati presenti.

³ In casi eccezionali le decisioni possono essere prese tramite circolare, salvo che un membro non richieda una riunione. Le decisioni prese in tale forma devono essere iscritte nel verbale della seduta successiva.

⁴ Le riunioni vengono verbalizzate. Il verbale riporta il testo nonché, per i dibattimenti su questioni sostanziali, la motivazione delle delibere.

V. Rapporti

Art. 12 Informazione all'attenzione del Consiglio di banca

¹ Il Consiglio di banca riceve i verbali delle riunioni del Comitato dei rischi. Eventuali fatti importanti devono essere immediatamente portati a conoscenza del presidente del Consiglio di banca a cura del presidente del comitato.

² In occasione della riunione più prossima, il presidente del comitato informa il Consiglio di banca in merito alle principali conclusioni e deliberazioni del Comitato dei rischi, sottoponendogli le raccomandazioni del caso.

Art. 13 Relazione annuale della Gestione del rischio

Il Comitato dei rischi sottopone la relazione annuale della Gestione del rischio all'attenzione del Consiglio di banca dopo averla discussa in via preliminare.

Emanato da:	Consiglio di banca	Emanato il:	14.05.2004
Entrata in vigore:	01.07.2004	Autore:	Questioni giuridiche e servizi
Fondamenti giuridici:	Art. 12 del Regolamento di organizzazione		
Sostituisce:	–		
Modificato il:	Modificato da:	Modifica in vigore da:	Articolo/i:
12.04.2013	Consiglio di banca	01.05.2013	Tutti