

PROGRAMA DE EVALUACIONES DEL BANCO DE ESPAÑA

PLAN DE EVALUACIONES 2022-2023 DEL BANCO DE ESPAÑA

Banco de España



PLAN DE EVALUACIONES 2022-2023 DEL BANCO DE ESPAÑA

Banco de España

Índice

1	Antecedentes	4
2	Ámbito de trabajo	4
3	Ámbito temporal	5
4	Desarrollo y coordinación de las evaluaciones	5
	4.1 Coordinación del Plan y de las evaluaciones	5
	4.2 Equipo evaluador	5
	4.3 Fases	5
5	Aprobación	6

1 Antecedentes

Las directrices del programa de evaluaciones del Banco de España (en adelante, las directrices) establecen en su apartado quinto que, por período anual, se fijarán entre dos y tres evaluaciones que se plasmarán en el Plan anual de evaluaciones aprobado por el Consejo de Gobierno, a propuesta del Gobernador.

Conforme a las directrices, podrán ser objeto de evaluación aquellas actividades que lleva a cabo el Banco de España en ejercicio de sus funciones, enmarcándose las respectivas evaluaciones en el análisis de su ámbito operativo o de gestión y quedando, por tanto, excluidos del marco de evaluación aspectos como el cumplimiento o control financiero o normativo, así como, en general, aquellas actuaciones que corresponda realizar a la Auditoría Interna del Banco o a otros organismos fiscalizadores o de control.

En este contexto, las direcciones generales del Banco han propuesto posibles ámbitos de evaluación que afectan a sus respectivas áreas, de cara a su sometimiento a evaluación. Tales propuestas fueron valoradas en su conjunto por el Comité de Dirección, tomando en consideración la relevancia estratégica de los objetos de evaluación sugeridos, así como la conveniencia de su realización.

Adicionalmente, y según se prevé en las directrices, se podrán realizar de forma puntual evaluaciones adicionales a las previstas en este documento, siempre que así lo acuerden los órganos rectores del Banco.

2 Ámbito objetivo

El presente Plan de Evaluaciones establece las siguientes evaluaciones a realizar en el periodo 2022-2023:

- i. Evaluación de la investigación en el Banco de España
- ii. Evaluación de la actividad de proyección económica del Banco de España
- iii. Evaluación acerca de la adecuación de los conocimientos y recursos tecnológicos para el desarrollo de las funciones de supervisión prudencial de las entidades de crédito

Como **anexo** al presente documento se incluyen las fichas descriptivas de las evaluaciones, donde se detalla la descripción del objetivo y su alcance preliminar.

Cada una de estas evaluaciones proporcionará una valoración de las respectivas actuaciones o funciones del Banco desarrolladas en los anteriores ámbitos, en cuyo contexto podrán desarrollarse indicadores para medir eficacia, eficiencia y calidad, con la finalidad última de fortalecer los mecanismos de seguimiento y control del cumplimiento de objetivos y recomendaciones resultantes de la evaluación.

3 **Ámbito temporal**

El presente Plan de Evaluaciones se refiere al periodo 2022 - 2023, de manera que sus actuaciones se iniciarán en 2022 y, en la medida de lo posible, se concluirán a lo largo del año natural, que finaliza el 31 de diciembre de 2023.

En cada una de las fichas descriptivas que se acompañan como anexo se incluye una estimación de la duración de cada una de las evaluaciones y del calendario.

La materialización de los plazos así previstos ha de tener en cuenta las restricciones que impone la contratación de evaluadores externos, en función de su coste, ya que este determina no solo el órgano que puede autorizar dicha contratación, sino también los plazos internos de tramitación.

4 **Desarrollo y coordinación de las evaluaciones**

4.1 **Coordinación del Plan y de las evaluaciones**

Sin perjuicio de la estructura de soporte del Programa de Evaluaciones, conforme a lo dispuesto en las directrices, bajo la figura de un coordinador general, cada una de las evaluaciones comprendidas en el presente Plan será coordinada por un miembro asignado al efecto de la dirección general implicada que hará las veces de interlocutor con el equipo de evaluación.

4.2 **Equipo evaluador**

Cada una de las evaluaciones se llevará a cabo con la contribución de un equipo de evaluadores externos que serán seleccionados entre personas de reconocida competencia y trayectoria profesional en el marco de actuación objeto de la respectiva evaluación.

Las directrices del programa de evaluaciones prevén la posibilidad de que las evaluaciones se lleven a cabo con recursos internos, desde un área que no participe en el proceso o actuación objeto de evaluación, siempre que lo autorice el Consejo de Gobierno. Las evaluaciones objeto del presente Plan está previsto que se realicen con recursos externos.

4.3 **Fases**

Las evaluaciones previstas en el presente Plan se desarrollarán conforme a las siguientes fases:

- Selección y contratación del equipo de evaluación externo, conforme a las normas de contratación aplicables al Banco de España.
- Ejecución de la evaluación, mediante el trabajo de campo y análisis conducido por el equipo evaluador externo, con el apoyo de los coordinadores y/o interlocutores internos designados al efecto.
- Presentación de los resultados de la evaluación a la finalización de la misma, mediante la información de las conclusiones alcanzadas y la propuesta de recomendaciones realizadas en el seno de la evaluación.

- La evaluación estará sujeta a los criterios de publicidad previstos en las directrices, realizándose la correspondiente difusión previa y/o posterior sobre la misma, a cuyo efecto se tendrán en cuenta las consideraciones de confidencialidad que puedan resultar aplicables en cada caso.
- La figura de coordinador del plan se encargará del seguimiento de las recomendaciones formuladas en el marco de la evaluación, conforme al plan de acción que se elabore por el área evaluada.

5 Aprobación

Este Plan de Evaluaciones 2022 - 2023 ha sido aprobado por el Consejo de Gobierno con fecha 15 de marzo de 2022 y modificado el 27 de julio del mismo año, a propuesta del Gobernador.

Anexo: Detalle de las evaluaciones comprendidas en el Plan de Evaluaciones 2022-2023

1 Evaluación externa sobre la investigación en el Banco de España

Direcciones Generales o Departamentos implicados	Dirección General de Economía y Estadística
Calendario	La evaluación se iniciará en la segunda mitad de 2022.
Objetivo y alcance de la evaluación	<p>Entre las responsabilidades del Banco de España figuran el análisis económico y la investigación. Esto conlleva el estudio y el seguimiento, entre otros, de los siguientes campos: la economía española y su entorno; las políticas económicas, con especial atención a la política monetaria del área del euro, y el sistema financiero y bancario.</p> <p>La importancia estratégica de la investigación es clave, ligada al aumento de la relevancia e influencia del Banco de España en los debates económicos, lo que ha motivado que, dentro del Plan Estratégico del Banco de España, se incida en la importancia de la selección y revisión de los temas prioritarios en los que se van a centrar el análisis y la investigación del Banco de España.</p> <p>En 2011 se llevó a cabo una evaluación externa de la investigación en el Banco de España. Los evaluadores que llevaron a cabo dicho estudio fueron Lucrecia Reichlin, Jordi Gali y Luis Servén.</p> <p>Como consecuencia de los cambios organizativos de calado sucedidos en las áreas investigadoras del Banco en estos últimos 10 años, y las numerosas contrataciones de personal investigador, así como la definición formal de las prioridades investigadoras del Banco acometida al amparo del Plan Estratégico, resulta de interés realizar una nueva evaluación externa de la función investigadora del Banco de España.</p>
Descripción de la evaluación	El alcance de la evaluación externa comprenderá la revisión crítica de la función de investigación y análisis económico en el Banco de España.

2 Evaluación del proceso de proyección económica del Banco de España

Direcciones Generales o departamentos implicados	Dirección General de Economía y Estadística
Calendario	La evaluación se iniciará en el segundo semestre de 2022
Objetivo y alcance de la evaluación	<p>Las proyecciones macroeconómicas de la economía española se elaboran con carácter trimestral por la Dirección General de Economía y Estadística. Se publican como parte del Boletín Económico, en el que aparecen como recuadro 1 del Informe trimestral de la economía española.</p> <p>Dicho Informe analiza la evolución reciente de la economía, dentro del contexto internacional y del área del euro e incorpora en su análisis una serie de Recuadros que inciden en algunos temas económicos considerados relevantes.</p> <p>De los cuatro ejercicios de previsión anuales, dos corresponden al ejercicio conjunto de proyecciones que se realiza en el marco del Eurosistema y que constituyen las previsiones de referencia en el contexto de la toma de decisiones de la política monetaria.</p> <p>Las proyecciones se difunden con carácter trimestral, incluyendo el correspondiente acto de presentación ante la prensa por el DG de Economía y Estadística el día de su publicación. Las proyecciones del Banco de España son por tanto una información de gran relevancia y atención por parte de terceros, incluyendo analistas y medios de comunicación.</p> <p>En este contexto, resulta de especial interés contar con una valoración de esta actuación, ya sea desde la óptica de la metodología para su elaboración como del grado de ajuste de las proyecciones realizadas.</p>
Descripción de la evaluación	La evaluación consistirá en una revisión crítica de la actividad de elaboración periódica de las proyecciones macroeconómicas de la economía española.

3 Evaluación acerca de la adecuación de los conocimientos y recursos tecnológicos para el desarrollo de las funciones de supervisión prudencial de las entidades de crédito

Direcciones Generales o Departamentos implicados	Dirección General de Supervisión (DGS).
Calendario	La evaluación se iniciará en 2023.
Objetivo y alcance de la evaluación	<p>Entre las funciones del Banco de España, y en concreto de la DGS, destaca las relativa a la supervisión prudencial de las entidades de crédito.</p> <p>El desarrollo exponencial de la tecnología ha creado nuevas oportunidades que permiten a las autoridades de supervisión ser más proactivas y eficientes en su función. La transformación digital de las funciones supervisoras es, si cabe, más relevante, en un entorno económico incierto y complejo como el actual, que exige a estas autoridades mantener un seguimiento estrecho de los riesgos y dar una respuesta adecuada y a tiempo.</p> <p>Como parte del esfuerzo promovido inicialmente por Plan Estratégico 2024, y reforzado en las orientaciones decididas en su revisión intermedia para impulsar la digitalización en todas las áreas del BE, una de las prioridades de la DGS, ha sido dar un impulso a la innovación tecnológica dentro de la dirección, coordinando el desarrollo de herramientas Suptech, y reforzando, a través de la formación, los conocimientos tradicionales del supervisor con nuevas competencias como el análisis de datos.</p> <p>Adicionalmente, la DGS participa en las iniciativas de la agenda de digitalización del Mecanismo Único de Supervisión (MUS) y forma parte de los diferentes grupos de trabajo creados a tal efecto.</p> <p>En este contexto, resulta de especial interés contar con una valoración externa de la adecuación de los conocimientos y los recursos tecnológicos de los que dispone la DGS para el desarrollo de las funciones de supervisión prudencial de las entidades de crédito, debido a su alineamiento con la orientación decidida en la revisión intermedia y a la aportación que las recomendaciones resultantes puedan proporcionar a la ambición declarada en el Plan Estratégico 2024 de que <i>“El Banco de España aspira a ser reconocido como un referente en la supervisión prudencial de todos los riesgos asociados a la actividad bancaria; particularmente, en la supervisión de aquellos riesgos en los que tiene una mayor experiencia y conocimiento, como la supervisión del riesgo de crédito y del riesgo tecnológico”</i>.</p>
Descripción de la evaluación	El alcance de la evaluación externa comprenderá una revisión crítica de la adecuación de los conocimientos y recursos tecnológicos para el desarrollo de las funciones de supervisión prudencial de las entidades de crédito, incluida la contribución del BE al desarrollo de las funciones del MUS.

PUBLICACIONES DEL BANCO DE ESPAÑA

PROGRAMA DE EVALUACIONES DEL BANCO DE ESPAÑA

- 01 BANCO DE ESPAÑA: Directrices del programa de evaluaciones del Banco de España
- 02 BANCO DE ESPAÑA: Plan de Evaluaciones del Banco de España 2022-2023