

Comunicado nº 42.025 de 22/8/2024

COMUNICADO Nº 42.025, DE 22 DE AGOSTO DE 2024

Divulga condições para a realização de operações compromissadas com instituições financeiras participantes do módulo Oferta Pública (Ofpub).

O Banco Central do Brasil, com base no disposto na Resolução BCB nº 75, de 23 de fevereiro de 2021, torna público que, das 12:00 às 12:30 horas do dia 23 de agosto de 2024, acolherá propostas das instituições financeiras participantes do módulo Ofpub para a realização de operações de venda de títulos públicos com compromisso de revenda assumido pela instituição financeira compradora, admitida a livre movimentação dos títulos, com as seguintes características:

I – títulos:

- a) Letras do Tesouro Nacional (LTN): vencimentos em 1º/1/2025, 1º/4/2025, 1º/7/2025, 1º/10/2025, 1º/1/2026, 1º/4/2026, 1º/7/2026, 1º/10/2026, 1º/7/2027, 1º/1/2028, 1º/7/2028 e 1º/1/2030;
- b) Notas do Tesouro Nacional, Série B (NTN-B): vencimentos em 15/5/2025, 15/8/2026, 15/5/2027, 15/8/2028, 15/5/2029, 15/8/2030, 15/8/2032, 15/5/2033, 15/5/2035, 15/8/2040, 15/5/2045, 15/8/2050, 15/5/2055 e 15/8/2060;
- c) Notas do Tesouro Nacional, Série F (NTN-F): vencimentos em 1º/1/2025, 1º/1/2027, 1º/1/2029, 1º/1/2031, 1º/1/2033 e 1º/1/2035; e
- d) Letras Financeiras do Tesouro (LFT): vencimentos em 1º/3/2025, 1º/9/2025, 1º/3/2026, 1º/9/2026, 1º/3/2027, 1º/9/2027, 1º/3/2028, 1º/9/2028, 1º/3/2029, 1º/9/2029, 1º/3/2030, 1º/6/2030 e 1º/9/2030.

II – valor financeiro máximo desta oferta: R\$ 4.000.000.000,00 (quatro bilhões de reais), observado que, de um mesmo título/vencimento, cada instituição financeira poderá adquirir, no máximo, 100% do valor de sua(s) proposta(s) aceita(s);

III – preços unitários de venda: os informados pelo Departamento de Operações do Mercado Aberto (Demab), às 11:30 horas de 23/8/2024, na página do Sistema Especial de Liquidação e de Custódia (Selic) na internet (www.rtm.selic.gov.br);

IV – divulgação do resultado: 23/8/2024, a partir das 12:30 horas;

V – data de liquidação da venda: 26/8/2024; e

VI – data de liquidação da revenda: 25/11/2024.

2. Na formulação das propostas, limitadas a 3 (três) por instituição, deverão ser informados o percentual, com 4 (quatro) casas decimais, a ser aplicado sobre o fator diário da taxa Selic deduzido de uma unidade e o valor financeiro, em milhares de reais.

3. As propostas deverão ter curso na aba Ofpub/Ofdealer do Selic, opção “Lançamento” do submenu “Operações Compromissadas”.

4. O resultado será apurado pelo critério de percentual único, acatando-se todas as propostas com percentual igual ou inferior ao percentual máximo aceito pelo Banco Central do Brasil, o qual será aplicado a todas as propostas vencedoras.

5. A instituição com proposta aceita deverá informar ao Demab, até as 16:00 horas de 23/8/2024, o vencimento e o valor financeiro de cada um dos títulos objeto de sua compra, utilizando o módulo “Lastro” do Selic.

6. O preço unitário da revenda será calculado com a seguinte fórmula:

$$PU_{revenda} = PU_{venda} \times \prod_{k=1}^n \{[(fk - 1) \times S/100] + 1\} - CJ1 \times \prod_{k=1}^m \{[(fk - 1) \times S/100] + 1\} - CJ2 \times \prod_{k=1}^q \{[(fk - 1) \times S/100] + 1\}$$

k=1

em que:

I – PUrevenda corresponde ao preço unitário de revenda do título ao Banco Central do Brasil na data do compromisso, arredondado na oitava casa decimal;

II – PUvenda corresponde ao preço unitário de venda do título pelo Banco Central do Brasil, conforme definido no primeiro parágrafo, inciso III;

III – f corresponde ao fator diário da taxa Selic, divulgado pelo Banco Central do Brasil, relativo ao k-ésimo dia útil;

IV – S corresponde ao percentual definido no quarto parágrafo;

V – n corresponde ao número de dias úteis compreendidos entre a data de liquidação da venda, inclusive, e a data de liquidação da revenda, exclusive;

VI – CJ1 corresponde ao primeiro cupom de juros unitário pago pelo título durante a vigência do compromisso;

VII – m corresponde ao número de dias úteis compreendidos entre a data de pagamento do cupom de juros, inclusive, e a data de liquidação da revenda, exclusive;

VIII – CJ2 corresponde ao segundo cupom de juros unitário pago pelo título durante a vigência do compromisso;

IX – q corresponde ao número de dias úteis compreendidos entre a data de pagamento do segundo cupom de juros, inclusive, e a data de liquidação da revenda, exclusive; e

X – P corresponde ao produtório.

7. Não havendo pagamento de cupom de juros durante a vigência do compromisso, os valores “CJ1” e “CJ2” contidos na fórmula definida no sexto parágrafo serão iguais a zero.

8. As operações de que tratam este Comunicado devem ser registradas no Selic sob o código 1047.

Departamento de Operações do Mercado Aberto

André de Oliveira Amante

Chefe