

Sistema Especial de Liquidação e de Custódia - SELIC

VIII. Descrição das Operações

4. Operação Compromissada

4.1. Compra/venda com compromisso de recompra/revenda

4.1.2. Com PU de retorno em aberto (1057/SEL1054 tipo 2)

1 - Definição

Operação de compra/venda de títulos com compromisso de revenda/recompra sem preço certo de liquidação futura. O retorno dessa operação compromissada é efetuado com o código 1059, em tela, ou SEL1056 tipo 2, por mensagem.

O compromisso de recompra/revenda pode ser assumido para o dia posterior ao da liquidação da operação compromissada até, no máximo, o dia útil imediatamente anterior à data de vencimento dos títulos objeto dessa operação.

2 - Registro

Tela	Mensagem		
	Código	Descrição	Domínio
1057	SEL1054	IF requisita Operação Compromissada com PU de retorno em aberto.	Tag TpCompr = 02

2.1 - Observação

As operações compromissadas referentes à Liquidação do Leilão Informal estão descritas neste Capítulo na Seção 2.

2.2 - Preço Unitário (PU) de recompra/revenda

As operações compromissadas registradas sem o preço unitário de recompra/revenda tem a rentabilidade ou o parâmetro de remuneração predefinido e consignado:

- 1 - No documento "Ordem para Registro e Liquidação de Operação (DOC-8)", (ver modelo nº 30008-3 do Cadoc no Anexo 1 deste Manual). O campo utilizado para esse registro é o destinado ao "Carimbo e Assinaturas". Exemplo de critério de remuneração: 80% da Taxa SELIC + 6% a.a.
- 2 - Em nota de compra/venda, quando se trata de operações com clientes de conta de custódia Cliente 1.

Não há restrição em relação ao PU de retorno (recompra/revenda) ser menor ou igual ao PU da operação compromissada (compra/venda), com exceção das aplicações no extramercado.

2.3 - Operações com clientes

As operações dos participantes com seus clientes (conta Cliente 1) exigem a transmissão de um só comando, podendo este englobar operações com vários clientes. Nesse caso, o comando deve ser transmitido pelo seu respectivo total, observando-se conta, operação e título. Além disso, não há sensibilização da conta Reservas Bancárias do participante no STR.

Sistema Especial de Liquidação e de Custódia - SELIC

VIII. Descrição das Operações

4. Operação Compromissada

4.1. Compra/venda com compromisso de recompra/revenda

4.1.2. Com PU de retorno em aberto (1057/SEL1054 tipo 2)

3 - Liquidação financeira

A instituição financeira não-liquidante pode optar por liquidar a operação compromissada com o seu liquidante-padrão ou com outro liquidante. No segundo caso, deve ser preenchido:

- o campo **LIQ CED**, para indicar o liquidante da instituição que consta como cedente da operação; e/ou
- o campo **LIQ CES**, para indicar o liquidante da instituição que consta como cessionário da operação, o qual deve requisitar limite operacional a esse liquidante.

4 - Associações

A operação compromissada com PU de retorno em aberto é considerada **operação principal** em uma cadeia de operações associadas. De modo geral, só deve ser associada a operações acessórias, como o redesconto e a operação compromissada intradia.¹

5 - Regras gerais

As operações compromissadas com PU de retorno em aberto **não** podem ser objeto de intermediação, estorno e valorização.

Nota:

1 - Ver Capítulo VII, Seção 1, Tópicos Especiais, Associações, para mais detalhes.

Sistema Especial de Liquidação e de Custódia - SELIC

VIII. Descrição das Operações

4. Operação Compromissada

4.1. Compra/venda com compromisso de recompra/revenda

4.1.2. Com PU de retorno em aberto (1057/SEL1054 tipo 2)

6 - Orientação para o registro de operações em tela e por mensagem

TELA

```
BACEN  Departamento de Operações de Mercado Aberto      * SELIC - SPB *
DICEL  Sistema Especial de Liquidação e de Custódia      BANCO XYZ

(*) OPE ▶1057◀      TIT ▶100000◀
CED ▶NNNNNNNNNN◀      LIQ CED ▶ (*)◀
CES ▶YYYYYYYYYY◀      LIQ CES ▶ (*)◀
D/C ▶1◀      DTR ▶28022001◀      DTO ▶      ◀

NOP      VENC      FACE/QT      PU      PURET      NOPORIG
▶150000◀▶23022002◀      1000◀      90000000000◀      ◀      ◀      ◀

NOPASS ▶ (*) ◀      PREFSTR ▶*◀      NOPRET ▶ (*) ◀      STR ▶      (*) ◀
VLF/IDA ▶      (*) ◀      ◀      VLF/RET ▶      ◀      ▶▶
```

MENSAGEM

Código Mensagem: SEL1054 Emissor: IF Destinatário: SELIC

```
<SELReqOperacaoCompromissada>
<CodMsg>SEL1054</CodMsg>
<NumCtrlIF>XYZ</NumCtrlIF>
<ISPBIF>33333333</ISPBIF>
<TpCompr>02</TpCompr>
<NumOpSEL>150000</NumOpSEL>
<DtOp>20010223</DtOp>
<DtOpRet>20010228</DtOpRet>
<CtCed>NNNNNNNNNN</CtCed>
<CtCes>YYYYYYYYYY</CtCes>
<TpDeb_Cred>D</TpDeb_Cred>
<IFLiqdantCed>(*)</IFLiqdantCed>
<IFLiqdantCes>(*)</IFLiqdantCes>
<IdentdTitSEL>100000</IdentdTitSEL>
<DtVenc>20020223</DtVenc>
<PU>900,00000000</PU>
<PUREt>(*)</PUREt>
<QtdTit>1000</QtdTit>
<VlrFinanc>900000,00</VlrFinanc>
<VlrFinancRet>(*)</VlrFinancRet>
<NivelPref>(*)</NivelPref>
<ChASEL>(*)</ChASEL>
<DtMovto>20010223</DtMovto>
</SELReqOperacaoCompromissada>
```

(*) - ver observações no quadro de correspondência dos campos.

Sistema Especial de Liquidação e de Custódia - SELIC

VIII. Descrição das Operações

4. Operação Compromissada

4.1. Compra/venda com compromisso de recompra/revenda

4.1.2. Com PU de retorno em aberto (1057/SEL1054 tipo 2)

O quadro a seguir indica os campos obrigatórios para preenchimento em tela com a sua devida correspondência às mensagens:

Descrição dos campos de registro de operações em tela e por mensagem

Campo		Descrição
Tela	Mensagem	
OPE	CodMsg	Código da operação compromissada. Tela: 1057 Mensagem: SEL1054
-	NumCtrlIF	Número de controle da instituição financeira. Só é informado por mensagem.
-	ISPBIF	Número do ISPB da instituição financeira. Só é informado por mensagem.
-	TpCompr	Tipo compromisso: 02 Só é informado por mensagem.
TIT	IdentdTitSEL	Código do título público.
CED	CtCed	Cedente, que pode ser conta de custódia normal: a - própria (tipo 00 ou 30) ¹ ; b - de cliente 1, quando o cessionário for conta própria do mesmo participante no SELIC; c - de cliente 2, quando o cessionário for conta própria de outro participante no SELIC; d - de cliente especial (tipo 70), quando o cessionário for conta própria (tipo 00 ou 30); e - de cliente específico (tipo 80), quando o cessionário for conta própria (tipo 00 ou 30).
CES	CtCes	Cessionário, que pode ser conta de custódia normal: a - própria (tipo 00 ou 30) ¹ ; b - de cliente 1, quando o cedente for conta própria do mesmo participante no SELIC; c - de cliente 2, quando o cedente for conta própria de outro participante no SELIC; d - de cliente especial (tipo 70), quando o cedente for conta própria (tipo 00 ou 30); e - de cliente específico (tipo 80), quando o cedente for conta própria (tipo 00 ou 30).
LIQ CED	IFLiqdantCed	Código da conta da instituição liquidante do cedente. Esse campo não deve ser preenchido se a liquidação for efetuada pelo próprio liquidante-padrão.
LIQ CES	IFLiqdantCes	Código da conta da instituição liquidante do cessionário. Esse campo não deve ser preenchido se a liquidação for efetuada pelo próprio liquidante-padrão.
D/C	TpDeb_Cred	Código de débito de título p/ cedente: (1) para tela ou (D) para mensagem. Código de crédito de título p/ cessionário: (2) para tela ou (C) para mensagem.

Sistema Especial de Liquidação e de Custódia - SELIC

VIII. Descrição das Operações

4. Operação Compromissada

4.1. Compra/venda com compromisso de recompra/revenda

4.1.2. Com PU de retorno em aberto (1057/SEL1054 tipo 2)

Campo		Descrição
Tela	Mensagem	
DTO	DtOp	Tela: em branco. Mensagem: data da operação.
DTR	DtOpRet	Data do retorno da operação compromissada.
NOP	NumOpSEL	Número da faixa numérica da instituição cedente.
VENC	DtVenc	Data do vencimento do título público.
FACE/QT	QtdTit	Valor face/quantidade.
PU	PU	PU da operação compromissada. ²
PURET	PURet	(em branco)
NOPORIG	-	(em branco)
NOPASS	ChASEL	Número da operação associada. Esse campo só deve ser preenchido quando houver uma operação associada.
PREFSTR	NívelPref	Nível de preferência, indicado pelo cessionário com as letras "B", "C" ou "D". Se o campo for mantido em branco é assumido o nível mais baixo de preferência: "D".
NOPRET	NumOpSELRet	Número da operação SELIC de retorno. Tela: em branco. ³ Mensagem: campo preenchido pelo Sistema na R1.
STR	NumCtrlSTR	Número de controle do STR. Tela: em branco. ⁴ Mensagem: campo preenchido pelo Sistema na R1, quando há movimentação da conta Reservas Bancárias.
VLF/IDA	VlrFinanc	Valor financeiro líquido. Em tela, só deve ser preenchido quando a operação envolver a carteira própria do participante e suas contas de cliente 1.
VLF/RET	VlrFinancRet	(em branco)
-	DtMovto	Data do movimento. Só é informado por mensagem.

Notas:

- 1 - Quando o cedente ou cessionário estiver classificado como sociedade de crédito, financiamento e investimento ou de arrendamento mercantil, só pode ter como contraparte uma conta de custódia normal própria (tipo 00 ou 30).
- 2 - Quando a operação englobar várias operações da carteira própria do participante e suas contas de cliente 1, o campo PU deve ser preenchido com o preço médio correspondente.
- 3 - O campo NOPRET não deve ser preenchido pelo usuário. Quando da atualização da operação compromissada o campo é preenchido automaticamente pelo sistema com o número da operação de retorno.
- 4 - O campo STR não deve ser preenchido pelo usuário. Ao ser atualizada a operação em que há movimentação da conta Reservas Bancárias, esse campo aparece automaticamente na tela com o número de controle do STR.

Sistema Especial de Liquidação e de Custódia - SELIC

VIII. Descrição das Operações

4. Operação Compromissada

4.1. Compra/venda com compromisso de recompra/revenda

4.1.2. Com PU de retorno em aberto (1057/SEL1054 tipo 2)

7 - Resposta do Sistema

Aos participantes usuários da RSFN, a resposta à mensagem enviada se dá por meio de Mensagem de Resposta ao Requisitante (R1), que informa o estado atual da operação.

No caso específico de operação compromissada, a resposta apresenta as seguintes informações:

Mensagem: Resposta ao Requisitante de Operação Compromissada		
Tag Mensagem: SELReqOperacaoCompromissadaRespReq		
Código Mensagem: SEL1054R1	Emissor: SELIC	Destinatário: IF
Tag	Nome do Campo	Obrig.
<SELReqOperacaoCompromissadaRespReq>		
<CodMsg>	Código Mensagem	X
<NumCtrlIF>	Número Controle IF	X
<ISPBIF>	ISPB IF	X
<NumOpSEL>	Número Operação Selic	X
<NumCtrlSTR>	Número Controle STR	
<NumOpSELRet>	Número Operação Selic Retorno	
<SitOpSEL>	Situação Operação Selic	X
<DtHrSit>	Data Hora Situação	X
<DtMovto>	Data Movimento	X
</SELReqOperacaoCompromissadaRespReq>		

Alguns campos merecem destaque:

- 1 - **Número Operação SELIC Retorno:** Informa o número da operação de retorno da operação compromissada a ser utilizado na SEL1056 tipo 2.
- 2 - **Número Controle STR:** Informa o número de controle de operação que envolva movimentação da conta Reservas Bancárias no STR.
- 3 - **Situação Operação SELIC:** Informa a situação da operação. Todas as possibilidades estão descritas no Capítulo VI, Seção 1, Operações, Registro.

Quando houver problema na formação ou no conteúdo da mensagem de entrada, seu emitente receberá uma **Mensagem de Erro** como resposta. Para detalhamento desses erros, verificar o Catálogo de Mensagens, no endereço eletrônico www.bcb.gov.br.

No caso de participante de outras redes que não a RSFN, o recebimento da resposta do sistema se dá por tela, logo após o usuário transmitir a operação (após preencher todos os campos necessários e teclar <Xmit> com o cursor posicionado no campo **Envio**).

A tela de resposta contém os mesmos dados já preenchidos pelo usuário e mais as seguintes informações:

- 1 - **Situação da operação:** A situação da operação aparece automaticamente na tela, após ela ter sido enviada. Todas as possibilidades estão descritas no Capítulo VI, Seção 1, Operações, Registro.

Sistema Especial de Liquidação e de Custódia - SELIC

VIII. Descrição das Operações

4. Operação Compromissada

4.1. Compra/venda com compromisso de recompra/revenda

4.1.2. Com PU de retorno em aberto (1057/SEL1054 tipo 2)

- 2 - **NOPRET:** Esse campo é preenchido automaticamente pelo sistema com o número da operação de retorno (1059) a ser lançada na data do compromisso.
- 3 - **STR:** Ao ser atualizada a operação em que há movimentação da conta Reservas Bancárias, esse campo aparece automaticamente na tela com o número de controle do STR.