

# Sistema Especial de Liquidação e de Custódia - SELIC

## VIII. Descrição das Operações

### 4. Operação Compromissada

#### 4.3. Consolidação (1058/SEL1058)

##### 1 - Definição

A operação de consolidação de operações compromissadas permite transformar em **uma única operação** diversas operações de recompra/revenda, desde que observadas as seguintes condições:

- Cedente e cessionário sejam os mesmos, em todas as operações;
- Ambos lancem suas respectivas pontas (necessário duplo comando);
- Somente operações 1044 e 1054 (operações compromissadas com PU de retorno definido) podem ser consolidadas;
- Tenham por objeto títulos com o mesmo código, vencimento e preço unitário de recompra/revenda; e
- Decorram de operações compromissadas **sem** intermediação, liquidadas na mesma data e com o mesmo preço unitário de venda/compra.

Podem ser consolidadas operações desde a data da contratação até, e inclusive, a data de retorno das operações.

Pode também ser consolidado o saldo de uma operação que já tenha sido parcialmente antecipada.<sup>1</sup>

##### 2 - Registro

Tela	Mensagem	
Código	Código	Descrição
1058	SEL1058	IF requisita consolidação de operações compromissadas

A operação de consolidação é lançada tendo como **número de operação SELIC** um número da faixa da instituição cedente.

O valor financeiro da operação compromissada é calculado, multiplicando-se o PU pela quantidade (total) e truncando com duas casas decimais como é o padrão estabelecido pelo SELIC.

O valor financeiro da recompra/revenda é calculado da mesma forma que no parágrafo anterior só que usando o PU de retorno.

---

##### Nota:

- 1 - Para maiores detalhes, ver neste Capítulo, Sub-Seção 4.3, Operação Compromissada, De retorno antecipado (1055/SEL1056 tipo 3).

# Sistema Especial de Liquidação e de Custódia - SELIC

## VIII. Descrição das Operações

### 4. Operação Compromissada

#### 4.3. Consolidação (1058/SEL1058)

---

Uma vez atualizada a operação de consolidação (1058/SEL1058), os participantes envolvidos devem lançar o retorno dos compromissos consolidados (1056/SEL1056) na data prevista. O novo número de operação SELIC para o lançamento do retorno é informado pelo sistema:

- Por mensagem: no campo número da operação SELIC de retorno (**NumOpSELRet**) da R1 da SEL1058;
- Por tela: no campo **NOPRET**, após a atualização da operação 1058.

### 3 - Regras gerais

As operações consolidadas **não** podem ser objeto de estorno e valorização.

Também **não** é admitida intermediação nas operações compromissadas a serem consolidadas.

Os participantes envolvidos **não** devem lançar o retorno individual (1056/SEL1056 tipo 1) de qualquer das operações (1044 SEL1054 tipo 2 ou 1054 SEL1054 tipo 1) consolidadas pela 1058 (SEL1058).

Na atualização da operação consolidada **não** há movimentação da conta Reservas Bancárias dos participantes.

# Sistema Especial de Liquidação e de Custódia - SELIC

## VIII. Descrição das Operações

### 4. Operação Compromissada

#### 4.3. Consolidação (1058/SEL1058)

## 4 - 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 ▶1058◀      TIT ▶100000◀
CED ▶NNNNNNNNNN◀      LIQ CED ▶      ◀
CES ▶YYYYYYYYYY◀      LIQ CES ▶      ◀
D/C ▶1◀      DTR ▶23082002◀      DTO ▶      ◀

NOP      VENC      FACE/QT      PU      PURET      NOPORIG
▶150000◀▶23022003◀      1000◀      90100000000◀      90200000000◀      ◀      ◀

NOPASS ▶      ◀      PREFSTR ▶      ◀      NOPRET ▶ (*)      ◀ STR ▶      ◀
VLF/IDA ▶      ◀      90100000◀      VLF/RET ▶      ◀      90200000◀      ▶      ◀
```

### MENSAGEM

Código Mensagem: SEL1058 Emissor: IF Destinatário: SELIC

```
<SELReqConsolidOperacaoCompromissada>
<CodMsg>SEL1058</CodMsg>
<NumCtrlIF>XYZ</NumCtrlIF>
<ISPBIF>33333333</ISPBIF>
<NumOpSEL>150000</NumOpSEL>
<DtOpRet>20020823</DtOpRet>
<CtCed>NNNNNNNNNN</CtCed>
<CtCes>YYYYYYYYYY</CtCes>
<TpDeb_Cred>D</TpDeb_Cred>
<IdentdTITSEL>100000</IdentdTITSEL>
<DtVenc>20030223</DtVenc>
<PU>901,00000000</PU>
<PUret>902,00000000</PUret>
<QtdTit>1000</QtdTit>
<VlrFinanc>901000,00</VlrFinanc>
<VlrFinancRet>902000,00</VlrFinancRet>
<DtMovto>20010223</DtMovto>
</SELReqConsolidOperacaoCompromissada>
```

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

# Sistema Especial de Liquidação e de Custódia - SELIC

## VIII. Descrição das Operações

### 4. Operação Compromissada

#### 4.3. Consolidação (1058/SEL1058)

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. Tela: 1058 Mensagem: SEL1058
-	NumCtrlIF	Número de controle da instituição financeira. Só é informado por mensagem.
-	ISPBIF	Número do ISPB da instituição financeira. Só é informado por mensagem.
TIT	IdentdTitSEL	Código do título público.
CED	CtCed	Cedente da operação de retorno (1056/SEL1056).
CES	CtCes	Cessionário da operação de retorno (1056/SEL1056).
LIQ CED	-	(em branco)
LIQ CES	-	(em branco)
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.
DTR	DtOpRet	Data do retorno da operação compromissada.
DTO	-	(em branco)
NOP	NumOpSEL	Número da faixa numérica da instituição cedente.
VENC	DtVenc	Data do Vencimento do título público.
FACE/QT	QtdTit	Somatório das quantidades das operações individuais.
PU	PU	PU da operação compromissada.
PURET	PURet	PU de retorno (recompra/revenda).
NOPORIG	-	(em branco)
NOPASS	-	(em branco)
PREFSTR	-	(em branco)
NOPRET	NumOpSELRet	Número da operação SELIC de retorno. Tela: em branco. <sup>1</sup> Mensagem: campo preenchido pelo Sistema na R1.
STR	-	(em branco)
VLF/IDA	VlrFinanc	Valor financeiro líquido da operação compromissada: calculado multiplicando-se o PU pela quantidade (total) e truncando com duas casas decimais.
VLF/RET	VlrFinancRet	Valor financeiro líquido da recompra/revenda: calculado multiplicando-se o PU de retorno pela quantidade (total) e truncando com duas casas decimais.

#### Nota:

- 1 - O campo NOPRET não deve ser preenchido pelo usuário. Com a atualização da operação 1058, esse campo é preenchido automaticamente pelo Sistema com o número de operação de retorno consolidado a ser utilizado no lançamento da operação 1056 (SEL1056 tipo 1).

# Sistema Especial de Liquidação e de Custódia - SELIC

## VIII. Descrição das Operações

### 4. Operação Compromissada

#### 4.3. Consolidação (1058/SEL1058)

Campo		Descrição
Tela	Mensagem	
-	DtMovto	Data do movimento. Só é informado por mensagem.

## 5 - 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 consolidação de operações compromissadas, a resposta apresenta as seguintes informações:

<b>Mensagem:</b> Resposta ao Requisitante de Consolidação Operações Compromissadas		
<b>Tag Mensagem:</b> SELReqConsolidOperacaoCompromissadaRespReq		
<b>Código Mensagem:</b> SEL1058R1	<b>Emissor:</b> SELIC	<b>Destinatário:</b> IF
<b>Tag</b>	<b>Nome do Campo</b>	<b>Obrig.</b>
<SELReqConsolidOperacaoCompromissadaRespReq>		
<CodMsg>	Código Mensagem	X
<NumCtrlIF>	Número Controle IF	X
<ISPBIF>	ISPB IF	X
<SitOpSEL>	Situação Operação Selic	X
<NumOpSELRet>	Número Operação Selic Retorno	X
<DtHrSit>	Data Hora Situação	X
<DtMovto>	Data Movimento	X
</SELReqConsolidOperacaoCompromissadaRespReq>		

Alguns campos merecem destaque:

- 1 - **Número Operação SELIC Retorno:** Informa o número da operação de retorno resultante da consolidação das recompras/revendas a ser utilizado na SEL1056 tipo 1.
- 2 - **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](http://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**).

# Sistema Especial de Liquidação e de Custódia - SELIC

## VIII. Descrição das Operações

### 4. Operação Compromissada

#### 4.3. Consolidação (1058/SEL1058)

---

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.
- 2 - **NOPRET:** Esse campo é preenchido automaticamente pelo Sistema fornecendo o número de retorno das operações compromissadas consolidadas a ser utilizado na operação 1056 na data do compromisso.