

Sistema Especial de Liquidação e de Custódia - SELIC

VIII. Descrição das Operações

4. Operação Compromissada

4.2. Recompra/revenda

4.2.3. Antecipação (1055/SEL1056 tipo 3)

1 - Definição

Antecipação de recompra/revenda, parcial ou total. As operações compromissadas contratadas sob os códigos 1054, 1057, 1044 e 1047, em tela, ou SEL1054 tipos 1, 2, 3 e 4, por mensagem, podem ter o retorno antecipado sob código 1055/SEL1056 tipo 3, desde que haja interesse das partes envolvidas.

NOT APPROVED possível efetuar a antecipação parcial de uma operação compromissada intradia.

2 - Registro

As antecipações são lançadas sob o código 1055/SEL1056 tipo3, tendo como **número de operação SELIC** um número da faixa da instituição cedente, e como **número de operação original**, o número da operação de retorno atribuído pelo sistema (9XXXXXX).

A parcela final, se for lançada na data de retorno prevista originalmente, deve ser feita sob o código 1056/SEL1056 tipo 1 ou 1059/SEL1056 tipo 2, tendo como **número de operação SELIC** o número da operação de retorno atribuído pelo sistema (9XXXXXX).

Tela	Mensagem		
Código	Código	Descrição	Domínio
1055	SEL1056	IF requisita Antecipação parcial ou total de Retorno de Operação Compromissada	Tag TpRetCompr = 03

2.1 - Preço Unitário (PU) de recompra/revenda antecipada

O PU de retorno antecipado da operação compromissada deve ser determinado livremente pelas partes.

Não há restrição em relação ao PU de retorno (recompra/revenda) ser menor ou igual ao PU da operação compromissada (compra/venda)¹.

Há 1 (uma) **exceção**, no caso do compromisso de recompra/revenda ser antecipado para o mesmo dia em que foi efetuada a operação compromissada, tornando-se uma operação

NOT APPROVED Nessa situação, o PU da operação compromissada e o PU de retorno (recompra/revenda) são obrigatoriamente iguais. Observe-se que essa regra é válida mesmo para as operações compromissadas com PU em aberto com ou sem livre movimentação (1047/SEL1054 tipo 4 e 1057/SEL1054 tipo 2). Ou seja, o PU dessa 1055/SEL1056 tipo 3 deve ser idêntico ao PU registrado na operação compromissada (compra/venda).

Nota:

1 - Essa regra não é válida para as aplicações no extramercado ou para as operações em que o Banco Central é uma das contrapartes. Nesse caso, o PU da 1055 deve ser maior do que o PU da operação compromissada e menor ou igual ao PU de retorno (recompra/revenda).

Sistema Especial de Liquidação e de Custódia - SELIC

VIII. Descrição das Operações

4. Operação Compromissada

4.2. Recompra/revenda

4.2.3. Antecipação (1055/SEL1056 tipo 3)

2.2 - 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.

~~3 - Liquidação financeira~~

~~A instituição financeira não liquidante pode optar por liquidar a antecipação do retorno da 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 antecipação do retorno de operação compromissada *over* ou com prazo igual ou superior a dois dias 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.

A antecipação do retorno de operação compromissada para o mesmo dia em que foi efetuada (tornando-a intradia) é considerada **operação acessória** em um conjunto de operações associadas. Ver Capítulo VII, Seção 1, Tópicos Especiais, Associações.

5 - Intermediação

Não é possível antecipar o retorno de uma operação compromissada em que haja instituição intermediária envolvida.

6 - Valorização

É admitida a valorização de antecipação de retorno de operação compromissada, desde que no prazo de **até dois dias úteis**, em operações não associadas, e que **não** envolvam a conta Reservas Bancárias.

6.1 - Em tela

A valorização é feita mediante a operação 1355, ou seja, o segundo algarismo do código da operação preenchido com o valor 3. O campo **DTO** é preenchido com a data em que a operação deveria ter sido lançada originalmente.

Sistema Especial de Liquidação e de Custódia - SELIC

VIII. Descrição das Operações

4. Operação Compromissada

4.2. Recompra/revenda

4.2.3. Antecipação (1055/SEL1056 tipo 3)

6.2 - Por mensagem

A valorização é feita utilizando-se o código da operação a ser efetivada, mudando-se apenas a Tag <DtOp>, que deve ser a data na qual a operação deveria ter sido lançada.

6.3 - Exemplo

TELA: **OPE:** 1355 **DTO:** 21022001

Os demais campos são iguais aos da operação 1055.

MENSAGEM: <DtOp>20010221</DtOp>

Os demais campos são iguais aos da mensagem SEL1056 tipo 3.

Sistema Especial de Liquidação e de Custódia - SELIC

VIII. Descrição das Operações

4. Operação Compromissada

4.2. Recompra/revenda

4.2.3. Antecipação (1055/SEL1056 tipo 3)

7 - 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 ▶1055◀      TIT ▶100000◀
CED ▶NNNNNNNNNN◀      LIQ CED ▶ (*)◀
CES ▶YYYYYYYYYY◀      LIQ CES ▶ (*)◀
D/C ▶1◀      DTR ▶26102001◀      DTO ▶22022001◀

NOP      VENC      FACE/QT      PU      PURET      NOPORIG
▶150000◀▶23022002◀      1000◀      90100000000◀      ◀940515◀ ◀

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

MENSAGEM

Código Mensagem: SEL1056 Emissor: IF Destinatário: SELIC

```
<SELReqRetornoOperacaoCompromissada>
<CodMsg>SEL1056</CodMsg>
<NumCtrlIF>XYZ</NumCtrlIF>
<ISPBIF>33333333</ISPBIF>
<TpRetCompr>03</TpRetCompr>
<NumOpSEL>150000</NumOpSEL>
<NumOpSELRet>940515</NumOpSELRet>
<DtOp>20010223</DtOp>
<DtOpRet>20011026</DtOpRet>
<DtOpOr>20010222</DtOpOr>
<CtCed>NNNNNNNNNN</CtCed>
<CtCes>YYYYYYYYYY</CtCes>
<TpDeb_Cred>D</TpDeb_Cred>
<IFLiqdantCed>(*)</IFLiqdantCed>
<IFLiqdantCes>(*)</IFLiqdantCes>
<IdentdTitSEL>100000</IdentdTitSEL>
<DtVenc>20020223</DtVenc>
<PU>901,00000000</PU>
<QtdTit>1000</QtdTit>
<VlrFinanc>901000,00</VlrFinanc>
<NivelPref>(*)</NivelPref>
<ChASEL>(*)</ChASEL>
<DtMovto>20010223</DtMovto>
</SELReqRetornoOperacaoCompromissada>
```

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

Sistema Especial de Liquidação e de Custódia - SELIC

VIII. Descrição das Operações

4. Operação Compromissada

4.2. Recompra/revenda

4.2.3. Antecipação (1055/SEL1056 tipo 3)

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: 1055; ou 1355 (para valorização). Mensagem: SEL1056.
-	NumCtrlIF	Número de controle da instituição financeira. Só é informado por mensagem.
-	ISPBIF	Número do ISPB da instituição financeira. Só é informado por mensagem.
-	TpRetCompr	Tipo retorno compromisso: 03. Só é informado por mensagem.
TIT	IdentdTitSEL	Código do título público.
CED	CtCed	Cedente: é a conta utilizada como cessionária da operação 1054 (SEL1054 tipo 1), 1057 (SEL1054 tipo 2), 1044 (SEL1054 tipo 3) ou 1047 (SEL1054 tipo 4) correspondente.
CES	CtCes	Cessionário: é a conta utilizada como cedente da operação 1054 (SEL1054 tipo 1), 1057 (SEL1054 tipo 2), 1044 (SEL1054 tipo 3) ou 1047 (SEL1054 tipo 4) correspondente.
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.
-	DtOp	Data da Operação: 1 - Para operação no dia do lançamento: igual à Data do Movimento; 2 - Para valorização: igual à Data em que a operação deveria ter sido lançada. Só é informado por mensagem.
DTR	DtOpRet	Data do retorno da operação compromissada.
DTO	DtOpOr	Tela: 1 - Para operação no dia do lançamento: igual à Data em que foi lançada a operação compromissada; 2 - Para valorização: igual à Data em que a operação deveria ter sido lançada. Mensagem: Data em que foi lançada a operação compromissada.

Sistema Especial de Liquidação e de Custódia - SELIC

VIII. Descrição das Operações

4. Operação Compromissada

4.2. Recompra/revenda

4.2.3. Antecipação (1055/SEL1056 tipo 3)

Campo		Descrição
Tela	Mensagem	
NOP	NumOpSEL	O Número de Operação SELIC é um número novo da faixa numérica da instituição cedente.
VENC	DtVenc	Data do Vencimento do título público.
FACE/QT	QtdTit	Valor face/quantidade.
PU	PU	O PU da 1055 pode ser igual ou menor ao PU de compra/venda da operação compromissada que lhe deu origem. Isso não é válido para as aplicações no extramercado e para as operações em que o Bacen é uma das contrapartes.
PURET	-	(em branco)
NOPORIG	NumOpSELRet	O Número de Operação SELIC Retorno deve ser igual ao Número Operação SELIC fornecido ¹ : 1 - Por mensagem - na R1 da contratação da operação compromissada que originou a recompra/revenda, ou na R1 no evento de consolidação de operação compromissada 1058 (SEL1058) ² . 2 - Por tela - no campo NOPRET da operação compromissada que originou a recompra/revenda, ou ainda, no caso de consolidação de operação compromissada, no campo NOPRET da operação 1058 (SEL1058) ² .
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	-	(em branco)
STR	NumCtrlSTR	Número de controle do STR. Tela: em branco. ³ 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	-	(em branco)
-	DtMovto	Data do movimento. Só é informado por mensagem.

Notas:

- 1 - A instituição pode verificar o número de operação de retorno fornecido pelo Sistema, no extrato de recompras e revendas (para retornos originados de operação 1054 ou 1044) ou no extrato de recompras e revendas em aberto (para retornos originados de operação 1057 ou 1047) no endereço eletrônico www.selic.rtm. Ver Capítulo VII, Seção 5, Tópicos Especiais, Extratos.
- 2 - É possível requisitar a consolidação de operações compromissadas de uma mesma instituição com mesmo título por meio da operação 1058 (SEL1058). Ver neste Capítulo, na Seção 4, Sub-Seção 4.4.
- 3 - 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

4.2. Recompra/revenda

4.2.3. Antecipação (1055/SEL1056 tipo 3)

8 - 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 retorno de operação compromissada, a resposta apresenta as seguintes informações:

Mensagem: Resposta ao Requisitante de Retorno Operação Compromissada		
Tag Mensagem: SELReqRetornoOperacaoCompromissadaRespReq		
Código Mensagem: SEL1056R1	Emissor: SELIC	Destinatário: IF
Tag	Nome do Campo	Obrig.
<SELReqRetornoOperacaoCompromissadaRespReq>		
<CodMsg>	Código Mensagem	X
<NumCtrlIF>	Número Controle IF	X
<ISPBIF>	ISPB IF	X
<NumOpSEL>	Número Operação Selic	X
<NumCtrlSTR>	Número Controle STR	
<SitOpSEL>	Situação Operação Selic	X
<DtHrSit>	Data Hora Situação	X
<DtMovto>	Data Movimento	X
</SELReqRetornoOperacaoCompromissadaRespReq>		

Alguns campos merecem destaque:

- 1 - **Número Controle STR:** Informa o número de controle de operação que envolva movimentação da conta Reservas Bancárias no STR.
- 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.

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.
- 2 - **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.