

# Sistema Especial de Liquidação e de Custódia - SELIC

## VIII. Descrição das Operações

### 4. Operação Compromissada

#### 4.2. Recompra/revenda

##### 4.2.1. Com PU de retorno definido (1056/SEL1056 tipo 1)

### 1 - Definição

Retorno de operação compromissada para liquidação de compromisso assumido anteriormente com PU de retorno definido. As operações compromissadas contratadas sob os códigos 1044 e 1054, em tela, ou SEL1054 tipo 3 e SEL1054 tipo 1, por mensagem, devem ter o retorno sob código 1056/SEL1056 tipo 1.

#### 1.1 - Para retorno originado de operação 1044/SEL1054 tipo 3

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 do vencimento dos títulos objeto dessa operação.

#### 1.2 - Para retorno originado de operação 1054/SEL1054 tipo 1

O compromisso de recompra/revenda pode ser assumido para o próprio dia ou para dia posterior ao da liquidação da operação compromissada.

A data desse compromisso não pode ser posterior à data do resgate dos títulos objeto da operação compromissada. Caso o vencimento dos papéis recaia em dia não-útil, o compromisso pode ser assumido para o dia útil subsequente, coincidindo com o resgate dos títulos.

No caso de operação compromissada com prazo igual ou superior a dois dias úteis, a data do compromisso pode ocorrer, no máximo, até o dia útil imediatamente anterior ao do resgate dos títulos objeto da negociação. Ou seja, a operação *over* (prazo de um dia útil) é o **único caso** em que o compromisso pode coincidir com a data do resgate dos papéis.

### 2 - Registro

As contrapartes sempre lançam a recompra/revenda, exceto no caso de retorno de operação compromissada originada de operação 1054/SEL1054 tipo 1, quando esta recai no dia de resgate dos títulos sob compromisso. Nesse caso, os respectivos lançamentos são transmitidos automaticamente pelo SELIC nos procedimentos de abertura do sistema.

Tela	Mensagem		
Código	Código	Descrição	Domínio
1056	SEL1056	IF requisita Retorno de Operação Compromissada	Tag TpRetCompr = 01

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

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

Há 2 (duas) **exceções**, no caso de retorno de operação compromissada originada de operação 1054/SEL1054 tipo 1:



# Sistema Especial de Liquidação e de Custódia - SELIC

## VIII. Descrição das Operações

### 4. Operação Compromissada

#### 4.2. Recompra/revenda

##### 4.2.1. Com PU de retorno definido (1056/SEL1056 tipo 1)

1 - Se o compromisso de recompra/revenda for assumido para o próprio dia (operação intradia), o PU da operação compromissada é obrigatoriamente igual ao PU de retorno (recompra/revenda).

2 - Se a data do compromisso de um dia útil (*over*) coincidir com a do resgate do título, o preço de recompra/revenda é o estabelecido pelo Demab e divulgado por este até a abertura (do SELIC) do dia útil imediatamente anterior ao do resgate dos títulos.<sup>1</sup>

Não há restrição em relação ao PU de retorno (recompra/revenda) ser menor ou igual ao PU da operação compromissada<sup>2</sup>. Porém, no caso de haver intermediação na operação, a regra é válida desde que o intermediador não tenha prejuízo.

## 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 o 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.

Admite-se a liquidação antecipada, total ou parcial, da recompra/revenda decorrente de operação compromissada sem intermediação. Para maiores detalhes, ver Sub-Seção 4.2.3, De retorno antecipado (1055/SEL1056 tipo 3), neste Capítulo.

Caso a data do retorno coincida com a data do resgate do papel (situação possível apenas para retorno de operação compromissada de um dia útil originada de operação 1054/SEL1054 tipo 1), a liquidação da operação 1056/SEL1056 tipo 1 deve ser obrigatoriamente com o liquidante-padrão.

Os compromissos de recompra/revenda assumidos para a mesma data podem ser consolidados, desde que 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. Para maiores detalhes, ver Sub-Seção 4.3, Consolidação (1058/SEL1058), neste Capítulo.

### Notas:

1 - O PU de retorno é informado nos endereços eletrônicos [www.selic.rtm](http://www.selic.rtm) e [www.bcb.gov.br](http://www.bcb.gov.br).

2 - Exceção a essa regra são as operações de aplicação no extramercado e as que envolvem o Banco Central do Brasil.

# Sistema Especial de Liquidação e de Custódia - SELIC

## VIII. Descrição das Operações

### 4. Operação Compromissada

#### 4.2. Recompra/revenda

##### 4.2.1. Com PU de retorno definido (1056/SEL1056 tipo 1)

---

#### 4 - Associações

O retorno de operação compromissada de um dia útil (*over*), ou com prazo igual ou superior a dois dias, é considerado **operação principal** em uma cadeia de operações associadas. De modo geral, só deve ser associado a operações acessórias, como o redesconto e a operação compromissada intradia. Já o retorno de operação compromissada intradia é considerado **operação acessória** em um conjunto de operações associadas.<sup>1</sup>

#### 5 - Regras gerais

O retorno de operações compromissadas com PU de retorno definido **não** admite estorno e valorização.

##### 5.1 - Intermediação

No caso de haver intermediação na operação compromissada 1054/SEL1054 tipo 1, o retorno dessa operação tem as seguintes características:

- 1 - A instituição intermediária (*broker*) não lança a 1056/SEL1056 tipo 1. **Apenas** o comprador e o vendedor final efetuam os lançamentos.
- 2 - As pontas da operação (comprador e vendedor final) lançam a 1056/SEL1056 tipo 1 utilizando como contraparte a conta da instituição intermediária, e o sistema promove a atualização da operação.

---

#### 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

#### 4.2. Recompra/revenda

##### 4.2.1. Com PU de retorno definido (1056/SEL1056 tipo 1)

## 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 ▶1056◀      TIT ▶100000◀
CED ▶NNNNNNNNNN◀      LIQ CED ▶ (*)◀
CES ▶YYYYYYYYYY◀      LIQ CES ▶ (*)◀
D/C ▶1◀      DTR ▶      ◀      DTO ▶22022001◀

NOP      VENC      FACE/QT      PU      PURET      NOPORIG
▶950000◀▶23022002◀      1000◀      90100000000◀      ◀      ◀      ◀

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>01</TpRetCompr>
<NumOpSEL>950000</NumOpSEL>
<NumOpSELRet>(*)</NumOpSELRet>
<DtOp>20010223</DtOp>
<DtOpRet>(*)</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

##### 4.2.1. Com PU de retorno definido (1056/SEL1056 tipo 1)

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 do retorno da operação compromissada. Tela: 1056 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: 01 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 ou 1044/SEL1054 tipo 3 correspondente.
CES	CtCes	Cessionário: é a conta utilizada como cedente da operação 1054/SEL1054 tipo 1 ou 1044/SEL1054 tipo 3 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. <sup>1</sup>
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. <sup>1</sup>
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 (igual à data do movimento). Só é informada por mensagem.
DTR	DtOpRet	(em branco)
DTO	DtOpOr	Data da operação original (data do lançamento da operação compromissada correspondente).
NOP	NumOpSEL	O Número de Operação SELIC deve ser o Número Operação SELIC Retorno fornecido <sup>2</sup> : 1 - Por mensagem - na R1 da contratação da operação compromissada que originou a recompra/revenda, ou na R1 do evento de consolidação de operação compromissada SEL1058. <sup>3</sup> 2 - Por tela - no campo NOPRET da operação compromissada que originou a recompra/revenda, ou no campo NOPRET da operação de consolidação de operação compromissada 1058. <sup>3</sup>

# Sistema Especial de Liquidação e de Custódia - SELIC

## VIII. Descrição das Operações

### 4. Operação Compromissada

#### 4.2. Recompra/revenda

##### 4.2.1. Com PU de retorno definido (1056/SEL1056 tipo 1)

Campo		Descrição
Tela	Mensagem	
VENC	DtVenc	Data do vencimento do título público.
FACE/QT	QtdTit	Valor face/quantidade.
PU	PU	Preço unitário de retorno da operação 1054/SEL1054 tipo 1 ou 1044/SEL1054 tipo 3 correspondente. <sup>4</sup>
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	-	(em branco)
STR	NumCtrlSTR	Número de controle do STR. Tela: em branco. <sup>5</sup> 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 - Caso a data do retorno coincida com a data do resgate do papel, a liquidação da operação 1056/SEL1056 tipo 1 deve ser obrigatoriamente com o liquidante-padrão.
- 2 - A instituição pode verificar o número de operação a ser utilizado na operação 1056/SEL1056 tipo 1 em seu extrato de recompras e revendas no endereço eletrônico [www.selic.rtm](http://www.selic.rtm). Para maiores detalhes, ver Capítulo VII, Seção 5, Tópicos Especiais, Extratos.
- 3 - É possível requisitar a consolidação de operações compromissadas de uma mesma instituição (desde que 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) por meio da operação 1058/SEL1058. Para maiores detalhes, ver Sub-Seção 4.3, Consolidação (1058/SEL1058), neste Capítulo.
- 4 - Não há restrição em relação ao PU de recompra/revenda da 1056/SEL1056 tipo 1 ser menor ou igual ao PU da operação compromissada que lhe deu origem. Porém, no caso de haver intermediação na operação, a regra é válida desde que o intermediador não tenha prejuízo.
- 5 - 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

##### 4.2.1. Com PU de retorno definido (1056/SEL1056 tipo 1)

## 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 retorno de operação comprometida, a resposta apresenta as seguintes informações:

<b>Mensagem:</b> Resposta ao Requisitante de Retorno Operação Compromissada		
<b>Tag Mensagem:</b> SELReqRetornoOperacaoCompromissadaRespReq		
<b>Código Mensagem:</b> SEL1056R1	<b>Emissor:</b> SELIC	<b>Destinatário:</b> IF
<b>Tag</b>	<b>Nome do Campo</b>	<b>Obrig.</b>
<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](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**).

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.