

Sistema Especial de Liquidação e de Custódia - SELIC

VIII. Descrição das Operações

4. Operação Compromissada

4.2. Recompra/revenda

4.2.2. Com PU de retorno em aberto (1059/SEL1056 tipo 2)

1 - Definição

Retorno de operação compromissada para liquidação de compromisso assumido anteriormente com PU de retorno em aberto. As operações compromissadas contratadas sob os códigos 1047 e 1057, em tela, ou SEL1054 tipo 4 e SEL1054 tipo 2, por mensagem, devem ter o retorno sob código 1059/SEL1056 tipo 2.

O compromisso de recompra/revenda pode ser assumido para 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.

2 - Registro

Tela	Mensagem		
Código	Código	Descrição	Domínio
1059	SEL1056	IF requisita Retorno de Operação Compromissada com PU de retorno em aberto.	Tag TpRetCompr = 02

2.1 - Preço Unitário (PU) de recompra/revenda

As operações compromissadas registradas sem o preço unitário de recompra/revenda têm 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, com exceção das aplicações no extramercado.

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 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

Sistema Especial de Liquidação e de Custódia - SELIC

VIII. Descrição das Operações

4. Operação Compromissada

4.2. Recompra/revenda

4.2.2. Com PU de retorno em aberto (1059/SEL1056 tipo 2)

- 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 antecipação, 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.

4 - Associações

O retorno de operação compromissada com PU de retorno em aberto 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.¹

5 - Regras gerais

A recompra/revenda de operação compromissada com PU de retorno em aberto **não** admite 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

4.2. Recompra/revenda

4.2.2. Com PU de retorno em aberto (1059/SEL1056 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 ▶1059◀      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>02</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

4.2.2. Com PU de retorno em aberto (1059/SEL1056 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: 1059 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: 02 Só é informado por mensagem.
TIT	IdentdTitSEL	Código do título público.
CED	CtCed	Cedente, é a conta utilizada como cessionária da operação 1057/SEL1054 tipo 2 ou 1047/SEL1054 tipo 4 correspondente.
CES	CtCes	Cessionário, é a conta utilizada como cedente da operação 1057/SEL1054 tipo 2 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 (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 é igual ao Número Operação SELIC Retorno fornecido ¹ : 1 - Por mensagem - na R1 da contratação da operação compromissada que originou a recompra/revenda; 2 - Por tela - no campo NOPRET da operação compromissada que originou a recompra/revenda.
VENC	DtVenc	Data do vencimento do título público.
FACE/QT	QtdTit	Valor face/quantidade.

Sistema Especial de Liquidação e de Custódia - SELIC

VIII. Descrição das Operações

4. Operação Compromissada

4.2. Recompra/revenda

4.2.2. Com PU de retorno em aberto (1059/SEL1056 tipo 2)

Campo		Descrição
Tela	Mensagem	
PU	PU	Preço unitário de compromisso calculado, pelas partes envolvidas, com base no critério de remuneração constante do documento "Ordem para Registro e Liquidação de Operação (DOC-8)", (ver <u>modelo nº 30008-3</u> do Cadoc no Anexo 1 deste Manual), da operação 1057/SEL1054 tipo 2 ou 1047/SEL1054 tipo 4 correspondente. ²
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. 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 a ser utilizado na operação 1059/SEL1056 tipo 2 em seu extrato de recompras e revendas em aberto no endereço eletrônico www.selic.rtm. Para maiores detalhes, ver Capítulo VII, Seção 5, Tópicos Especiais, Extratos.
- 2 - Não há restrição em relação ao PU de recompra/revenda da 1059/SEL1056 tipo 2 ser menor ou igual ao PU da operação compromissada que lhe deu origem.
- 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

4.2.2. Com PU de retorno em aberto (1059/SEL1056 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 retorno de operação comprometida, 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.