

# Comunicado nº 39.268 de 13/10/2022

COMUNICADO Nº 39.268, DE 13 DE OUTUBRO DE 2022

Divulga condições para a realização de operações compromissadas com instituições financeiras participantes do módulo Oferta Pública (Ofpub).

O Banco Central do Brasil, com base no disposto na Resolução BCB nº 75, de 23 de fevereiro de 2021, torna público que, das 12:00 às 12:30 horas do dia 14 de outubro de 2022, acolherá propostas das instituições financeiras participantes do módulo Ofpub para a realização de operações de venda de títulos públicos com compromisso de revenda assumido pela instituição financeira compradora, admitida a livre movimentação dos títulos, com as seguintes características:

I – títulos:

- a) Letras do Tesouro Nacional (LTN): vencimentos em 1º/4/2023, 1º/7/2023, 1º/10/2023, 1º/1/2024, 1º/4/2024, 1º/7/2024, 1º/10/2024, 1º/1/2025, 1º/7/2025 e 1º/1/2026;
- b) Notas do Tesouro Nacional, Série B (NTN-B): vencimentos em 15/5/2023, 15/8/2024, 15/5/2025, 15/8/2026, 15/5/2027, 15/8/2028, 15/8/2030, 15/8/2032, 15/5/2035, 15/8/2040, 15/5/2045, 15/8/2050, 15/5/2055 e 15/8/2060;
- c) Notas do Tesouro Nacional, Série F (NTN-F): vencimentos em 1º/1/2025, 1º/1/2027, 1º/1/2029, 1º/1/2031 e 1º/1/2033; e
- d) Letras Financeiras do Tesouro (LFT): vencimentos em 1º/3/2023, 1º/9/2023, 1º/9/2024, 1º/3/2025, 1º/9/2025, 1º/3/2026, 1º/9/2026, 1º/3/2027, 1º/9/2027, 1º/3/2028 e 1º/9/2028.

II – valor financeiro máximo desta oferta: R\$ 4.000.000.000,00 (quatro bilhões de reais), observado que, de um mesmo título/vencimento, cada instituição financeira poderá adquirir, no máximo, 100% do valor de sua(s) proposta(s) aceita(s);

III – preços unitários de venda: os informados pelo Departamento de Operações do Mercado Aberto (Demab), às 11:30 horas de 14/10/2022, na página do Sistema Especial de Liquidação e de Custódia (Selic) na internet ([www.rtm.selic.gov.br](http://www.rtm.selic.gov.br));

IV – divulgação do resultado: 14/10/2022, a partir das 12:30 horas;

V – data de liquidação da venda: 17/10/2022; e

VI – data de liquidação da revenda: 16/1/2023.

2. Na formulação das propostas, limitadas a 3 (três) por instituição, deverão ser informados o percentual, com 4 (quatro) casas decimais, a ser aplicado sobre o fator diário da taxa Selic deduzido de uma unidade e o valor financeiro, em milhares de reais.

3. As propostas deverão ter curso na aba Ofpub/Ofdealer do Selic, opção “Lançamento” do submenu “Operações Compromissadas”.

4. O resultado será apurado pelo critério de percentual único, acatando-se todas as propostas com percentual igual ou inferior ao percentual máximo aceito pelo Banco Central do Brasil, o qual será aplicado a todas as propostas vencedoras.

5. A instituição com proposta aceita deverá informar ao Demab, até as 16:00 horas de 14/10/2022, o vencimento e o valor financeiro de cada um dos títulos objeto de sua compra, utilizando o módulo “Lastro” do Selic.

6. O preço unitário da revenda será calculado com a seguinte fórmula:

$$PU_{revenda} = PU_{venda} \times \prod_{k=1}^n \{[(fk - 1) \times S/100] + 1\} - CJ1 \times \prod_{k=1}^m \{[(fk - 1) \times S/100] + 1\} - CJ2 \times \prod_{k=1}^q \{[(fk - 1) \times S/100] + 1\}$$

em que:

I –  $PU_{revenda}$  corresponde ao preço unitário de revenda do título ao Banco Central do Brasil na data do compromisso, arredondado na oitava casa decimal;

II –  $PU_{venda}$  corresponde ao preço unitário de venda do título pelo Banco Central do Brasil, conforme definido no primeiro parágrafo, inciso III;

III –  $f$  corresponde ao fator diário da taxa Selic, divulgado pelo Banco Central do Brasil, relativo ao  $k$ -ésimo dia útil;

IV –  $S$  corresponde ao percentual definido no quarto parágrafo;

V –  $n$  corresponde ao número de dias úteis compreendidos entre a data de liquidação da venda, inclusive, e a data de liquidação da revenda, exclusive;

VI –  $CJ1$  corresponde ao primeiro cupom de juros unitário pago pelo título durante a vigência do compromisso;

VII –  $m$  corresponde ao número de dias úteis compreendidos entre a data de pagamento do cupom de juros, inclusive, e a data de liquidação da revenda, exclusive;

VIII –  $CJ2$  corresponde ao segundo cupom de juros unitário pago pelo título durante a vigência do compromisso;

IX – q corresponde ao número de dias úteis compreendidos entre a data de pagamento do segundo cupom de juros, inclusive, e a data de liquidação da revenda, exclusive; e

X – P corresponde ao produtório.

7. Não havendo pagamento de cupom de juros durante a vigência do compromisso, os valores “CJ1” e “CJ2” contidos na fórmula definida no sexto parágrafo serão iguais a zero.

8. As operações de que tratam este Comunicado devem ser registradas no Selic sob o código 1047.

Departamento de Operações do Mercado Aberto

André e Oliveira Amante

Chefe