

BANCO CENTRAL DO BRASIL
DIRETORIA COLEGIADA

Circular nº 3.385, de 30.05.08 – DOU-1, de 03.06.08.

Altera o Regulamento do Mercado de Câmbio e Capitais Internacionais (RMCCI) no tocante aos procedimentos relativos ao registro de operações de câmbio interbancárias eletrônicas.

A Diretoria Colegiada do Banco Central do Brasil, em sessão realizada em 15 de maio de 2008, considerando o disposto no art. 11, III, da Lei 4.595, de 31 de dezembro de 1964, com base no art. 23 da Lei nº 4.131, de 3 de setembro de 1962, no artigo 36 da Resolução nº 3.265, de 4 de março de 2005, e tendo em vista o art. 2º da Circular nº 3.280, de 9 de março de 2005, decidiu:

Art. 1º A seção 2 do capítulo 4 do título 1 do Regulamento do Mercado de Câmbio e Capitais Internacionais - RMCCI, divulgado pela Circular nº 3.280, de 9 de março de 2005, passa a vigorar com a redação estabelecida nas folhas anexas a esta Circular.

Art. 2º Esta Circular entrará em vigor na data de sua publicação.

MARIO GOMES TORÓS
Diretor
MARIA CELINA BERARDINELLI ARRAES
Diretora
ANEXO

REGULAMENTO DO MERCADO DE CÂMBIO E CAPITAIS INTERNACIONAIS

TÍTULO: 1 - Mercado de Câmbio

CAPÍTULO: 4 - Operações Interbancárias no País e Operações com Instituições Financeiras no Exterior

SEÇÃO: 2 - Operações Interbancárias Eletrônicas no País

1. As operações conduzidas sob a sistemática de interbancário eletrônico são realizadas com ou sem intermediação de câmara ou prestador de serviços de compensação e de liquidação cujo sistema tenha sido autorizado pelo Banco Central do Brasil para liquidação de operações de câmbio.

2. Representa compromisso firme e irrevogável entre as partes, substituindo, para todos os efeitos legais, o formulário de contrato de câmbio definido pelo Banco Central do Brasil a que se refere o parágrafo 2º do artigo 23 da Lei 4.131, de 03.09.1962:

a) no caso de operação realizada sem intermediação de câmara ou prestador de serviços de compensação e de liquidação, a confirmação, pelo banco vendedor da moeda estrangeira, dos dados da operação registrados no Sisbacen pelo banco comprador da moeda estrangeira;

b) no caso de operação realizada por intermédio de câmara ou prestador de serviços de compensação e de liquidação:

I - a confirmação no Sisbacen, pela câmara ou prestador de serviços de compensação e de liquidação, dos dados da operação registrados pelo banco comprador da moeda estrangeira e confirmados pelo banco vendedor da moeda estrangeira, quando não houver uso de sistemas de negociação sem identificação da contraparte (tela cega);
II - a verificação da identidade, no ambiente Sisbacen, das chaves contidas nas mensagens enviadas pelo banco comprador e pelo banco vendedor com a chave enviada pela câmara ou prestador de serviços de compensação e de liquidação, quando houver uso de sistemas de negociação sem identificação da contraparte (tela cega);(NR)

3. No caso de operação realizada sem intermediação de câmara ou prestador de serviços de compensação e de liquidação, a confirmação da operação no Sisbacen pelo banco vendedor da moeda estrangeira implica a celebração de dois contratos de câmbio onde figuram como partes contratantes o banco comprador e o banco vendedor da moeda estrangeira.

4. No caso de operação realizada por intermédio de câmara ou prestador de serviços de compensação e de liquidação, a confirmação ou a verificação da identidade no ambiente Sisbacen, tratadas na alínea "b" do item 2 desta seção, implica a celebração de quatro contratos de câmbio, da seguinte forma:

a) um par de contratos de câmbio em que figuram como partes contratantes o banco comprador da moeda estrangeira e a câmara ou prestador de serviços de compensação e de liquidação;

b) um par de contratos de câmbio em que figuram como partes contratantes o banco vendedor da moeda estrangeira e a câmara ou prestador de serviços de compensação e de liquidação. (NR)

5. Os contratos de câmbio de que trata esta seção são gerados automaticamente pelo Sisbacen para liquidação em dia certo, não sendo admitidos cancelamentos, baixas, prorrogações ou antecipações do prazo pactuado.

6. No caso de operação de câmbio realizada sem intermediação de câmara ou prestador de serviços de compensação e de liquidação:

a) as partes utilizam a transação PCAM380;

b) o banco comprador da moeda estrangeira registra os dados da operação em tela própria na transação PCAM380, aberta até as 17h (dezesete horas), devendo efetuar tal registro em até trinta minutos após o ajuste das condições com o banco vendedor da moeda estrangeira;

c) o banco vendedor da moeda estrangeira confirma os dados e elementos da operação no decorrer dos primeiros trinta minutos que se iniciam com o registro feito pelo banco comprador da moeda estrangeira;

d) dois contratos de câmbio são gerados conforme o item 3 desta seção, os quais não são liquidados de forma automática pelo Sisbacen;

e) os bancos comprador e vendedor da moeda estrangeira devem emitir comandos para a liquidação dos contratos de câmbio por meio da opção "liquidação de operações", na transação PCAM380;

f) a operação registrada pelo banco comprador da moeda estrangeira e não confirmada pelo banco vendedor da moeda estrangeira no prazo indicado na alínea "c" é bloqueada pelo sistema, ficando a reativação do registro na dependência de novo comando do banco comprador da moeda estrangeira;

g) as instruções relativas à entrega da moeda estrangeira são registradas em tela específica da transação PCAM385, devendo, para esse efeito, ser cadastrados até nove banqueiros, por moeda, os quais receberão numeração seqüencial de 1 a 9, sendo o acesso a essa informação restrito ao banco cadastrante;

h) no caso de operação com o Banco Central do Brasil/Departamento de Operações das Reservas Internacionais - Depin, tendo por base a taxa de câmbio do boletim "Fechamento Ptax", o registro é realizado em tela própria em até vinte minutos após a divulgação da referida taxa pelo Depin, devendo a confirmação dessa operação ocorrer nos primeiros vinte minutos que se iniciam com o registro feito pelo banco comprador da moeda estrangeira. (NR)

7. No caso de operação de câmbio realizada por intermédio de câmara ou prestador de serviços de compensação e de liquidação em que não houver uso de sistemas de negociação sem identificação da contraparte (tela cega):

a) as partes e a câmara ou prestador de serviços de compensação e de liquidação utilizam a transação PCAM383;

b) o banco comprador da moeda estrangeira registra os dados da operação em tela própria na transação PCAM383, aberta até as 17h (dezesete horas), devendo efetuar tal registro em até trinta minutos após o ajuste das condições com o banco vendedor da moeda estrangeira;

c) o banco vendedor da moeda estrangeira confirma os dados e elementos da operação no decorrer dos primeiros trinta minutos que se iniciam com o registro feito pelo banco comprador da moeda estrangeira, devendo ser observado, nos casos em que a confirmação seja devida após as 17h (dezesete horas), o horário limite de 17h15 (dezesete horas e quinze minutos) para tal providência, respeitado o prazo máximo de 30 minutos;

d) a câmara ou prestador de serviços de compensação e de liquidação confirma os dados e elementos da operação no decorrer dos primeiros trinta minutos que se iniciam com a confirmação feita pelo banco vendedor da moeda estrangeira, devendo ser observado, nos casos em que a confirmação seja devida após as 17h (dezesete horas), o horário limite de 17h30 (dezesete horas e trinta minutos) para tal providência, respeitado o prazo máximo de 30 minutos;

e) quatro contratos de câmbio são gerados na forma do item 4 desta seção, e o lançamento do evento de liquidação de cada contrato de câmbio é efetuado automaticamente pelo Sisbacen na transação PCAM383;

f) os quatro contratos de câmbio têm identificador comum, de modo a caracterizar as partes na negociação original;

g) a operação registrada pelo banco comprador da moeda estrangeira e não confirmada pelo banco vendedor da moeda estrangeira no prazo indicado na alínea "c" é bloqueada pelo sistema, ficando a reativação do registro na dependência de novo comando do banco comprador da moeda estrangeira;

h) a operação confirmada pelo banco vendedor da moeda estrangeira e não confirmada pela câmara ou prestador de serviços de compensação e de liquidação no prazo indicado na alínea "d" é bloqueada pelo sistema, ficando a reativação do registro na dependência de novo comando do banco comprador da moeda estrangeira e respectivas confirmações pelo banco vendedor e pela câmara ou prestador de serviços de compensação e de liquidação. (NR)

7A. No caso de operação de câmbio realizada por intermédio de câmara ou prestador de serviços de compensação e de liquidação com uso de sistemas de negociação sem identificação da contraparte (tela cega):

a) as partes e a câmara ou prestador de serviços de compensação e de liquidação utilizam mensagens específicas do Catálogo de Mensagens do Sistema de Pagamentos Brasileiro e a transação PCAM383;

- b) a câmara ou prestador de serviços de compensação e de liquidação, imediatamente após o fechamento da operação no sistema de negociação, pelos bancos comprador e vendedor da moeda estrangeira, envia mensagem com os dados da operação ao Banco Central do Brasil e aos bancos comprador e vendedor, observado o horário-limite das 17h (dezessete horas);
- c) os bancos comprador e vendedor, após recebimento de mensagem da câmara ou prestador de serviços de compensação e de liquidação, enviam mensagem de confirmação, em até 30 (trinta) minutos, ao Banco Central do Brasil, observado o horário-limite de 17h30 (dezessete horas e trinta minutos);
- d) os quatro contratos de câmbio são gerados na forma do item 4 desta seção, por ocasião da verificação da identidade referida na alínea "b" do item 2 desta seção, e o lançamento do evento de liquidação de cada contrato de câmbio é efetuado automaticamente pelo Sisbacen na transação PCAM383;
- e) os quatro contratos de câmbio têm identificador comum, de modo a caracterizar as partes na negociação original, sendo referido identificador visível apenas para o Banco Central do Brasil e para a câmara ou prestador de serviços de compensação e de liquidação;
- f) a inobservância do contido na alínea "c" implica o expurgo das referidas operações do Sisbacen, as quais serão consideradas inexistentes. (NR)

8. São atribuídos de forma automática pelo Sisbacen os códigos de natureza dos contratos de câmbio de que trata esta seção.

9. Quando do registro das operações de câmbio interbancárias, os bancos devem declarar no Sisbacen:

- a) as operações que tenham por finalidade o giro financeiro; e
- b) as operações que tenham por finalidade a passagem de linha. (NR)

10. Para efeitos do disposto no item anterior, consideram-se:

- a) operações de câmbio interbancárias que tenham por finalidade o giro financeiro - aquelas contratadas por bancos que atuam em posição intermediária e final em uma cadeia de operações negociada cujo resultado corresponde a uma operação entre dois bancos que não seria comportada por seus próprios limites operacionais recíprocos ou por outros fatores impeditivos;
- b) operações de câmbio interbancárias que tenham por finalidade a passagem de linha - aquelas em que um banco entrega moeda estrangeira a outro por intermédio de uma operação de venda de moeda estrangeira para liquidação em determinada data e, simultaneamente, contrata o recebimento dessa mesma moeda estrangeira por meio de uma operação de compra para liquidação em um dia a mais em relação à data de liquidação da operação de venda.

11. O Banco Central do Brasil divulga, na transação PCOT700, as seguintes informações das operações de câmbio interbancárias celebradas eletronicamente e contratadas em dólares dos Estados Unidos:

a) em relação às contratações para liquidação pronta:

- I - volume das transações efetuadas no dia útil anterior;
- II - volume dos negócios efetuados, no próprio dia, até o momento da consulta;
- III - taxa média ponderada de câmbio, prevalente no mercado interbancário, apurada para as operações contratadas no dia útil anterior;
- IV - taxa da última operação de valor superior a US\$100.000,00 (cem mil dólares dos Estados Unidos), registrada no dia útil anterior;
- V - taxa média ponderada de câmbio apurada, no próprio dia, em função dos registros das contratações até então efetivadas;
- VI - taxa da última operação de valor superior a US\$100.000,00 (cem mil dólares dos Estados Unidos), registrada no dia;

b) em relação às operações contratadas para liquidação futura:

- I - volume das transações efetuadas no dia útil anterior;
- II - volume dos negócios efetuados, no próprio dia, até o momento da consulta;
- III - volume das operações e correspondente taxa média ponderada resultante das taxas de câmbio acrescidas dos respectivos prêmios, no caso de operações com prêmio prefixado;
- IV - volume das operações, no caso de operações com prêmio pós-fixado.

12. Os dados relativos aos volumes diários nas respectivas moedas das operações e às taxas médias ponderadas estão disponíveis, na transação PCOT390, inclusive para as operações interbancárias a termo, para consulta pelos bancos autorizados a operar no mercado de câmbio.

13. A entrega da moeda nacional relativa aos contratos de câmbio de que trata esta seção é efetuada por meio de comando próprio no Sistema de Transferências de Reservas - STR.

14. No cumprimento de obrigações decorrentes do processo de liquidação de operações de câmbio com utilização da transação PCAM383 em que haja inadimplência de uma das partes, os bancos autorizados a operar em câmbio podem dar curso a operação de compra ou de venda de moeda estrangeira com câmara ou prestador de serviços de compensação ou de liquidação, sob o código de natureza de operação "55048 - CAPITAIS BRASILEIROS A CURTO PRAZO - Obrigações vinculadas a operações interbancárias".

15. Os horários indicados nesta seção referem-se à hora de Brasília.

16. Pode ser impedida de atuar sob a sistemática de que trata esta seção a instituição que concorra para a ineficiência ou dificulte o funcionamento regular da referida sistemática, sem prejuízo das sanções legais e regulamentares cabíveis.