

Réf.: ST.19-0394  
Lettre circulaire

Luxembourg, le 27 septembre 2019

A tous les organismes de placement collectif  
luxembourgeois

A toutes les sociétés d'investissement en capital à  
risque (SICAR)

***Mise à jour des règles de vérification du rapport titre par titre pour contrôler la  
cohérence d'information avec les rapports U 1.1 de la CSSF***

Mesdames, Messieurs,

Dans le cadre de l'exploitation des données transmises par les banques centrales nationales à la banque centrale européenne (BCE) sur base de l'orientation BCE/2013/7 concernant les statistiques sur les détentions de titres, les contrôles sur les titres individuels émis par les fonds d'investissement montrent que la qualité de certaines informations doit être améliorée.

De plus, la BCL utilise les données rapportées dans la collecte titre par titre pour répondre à ses obligations dans le cadre de l'orientation BCE/2012/21 concernant le cadre de contrôle de la qualité des données pour la base de données centralisée sur les titres de la BCE.

Dans ce contexte, la BCL a constaté des incohérences entre les données transmises dans les rapports titre par titre et les données transmises dans les rapports U 1.1 requis par la Commission de surveillance du secteur financier (CSSF).

Pour pallier ces problèmes, la BCL va entreprendre des comparaisons systématiques entre ces deux sources. Le document «règles de vérification du rapport titre par titre» mis à jour sur le site internet de la BCL est complété par de nouvelles règles de vérification.

Ces nouvelles règles sont basées sur une comparaison des informations entre le rapport titre par titre et le rapport U 1.1 par classe de parts. Dans ce cadre, il est nécessaire que les identifiants CSSF des fonds, compartiments et classes soient corrects.

La BCL transmettra les résultats des vérifications en deux étapes. La première consiste à vérifier que les identifiants des classes existent dans les deux rapports à partir des rapports de la période de référence d'août 2019. La BCL mettra en œuvre la deuxième étape sur la période de référence de septembre 2019 pour la vérification de la cohérence des informations pour chaque classe identifiée par les codes CSSF des fonds, compartiments et classes.

Veillez croire, Mesdames, Messieurs, à l'assurance de notre parfaite considération.

BANQUE CENTRALE DU LUXEMBOURG

Philippe Arondel  
Chef de la section Statistiques  
économiques et financières

Roland Nockels  
Chef du département Statistiques