

**Formulaire I.a**

**Annexe 1 de la circulaire CSSF 15/612**

**Informations à fournir par un GFIA luxembourgeois qui gère des FIA non réglementés (établis à Luxembourg, dans un autre État membre de l’UE ou dans un pays tiers) et/ou des FIA réglementés établis dans un pays tiers (FIA sans compartiments)**

COMMISSION DE SURVEILLANCE

DU SECTEUR FINANCIER

283, route d’Arlon L-1150 Luxembourg

BP : L-2991 Luxembourg

|  |
| --- |
| 1) Informations sur le GFIA et le FIA |
| 1 | Code CSSF du GFIA  | O | A      |
| 2 | Nom du GFIA | O |       |
| 3 | Nom du FIA | O |       |
| 4 | Nationalité du FIA | O |       |
| 5 | Code national du FIA | N |       |
| 6 | Code LEI du FIA  | N |       |
| 7 | Date de constitution du FIA | O |       |
| 8 | Adresse du FIA | O |       |
| 9 | FIA réglementé | O |       |
| 10 | Nom et adresse de l’autorité de surveillance |  |       |
| 11 | Devise de référence du FIA | O |       |
| 12 | Nom et adresse de la banque dépositaire | O |       |
| 13 | Type(s) de part (action(s)) (Code National, Code ISIN, nom du type de part/action)  | O |       |
| 14 | Date à partir de laquelle le GFIA gère le FIA (sous le format JJ/MM/AAAA) | O |       |
| 15 | Pays dans lesquels le FIA est commercialisé à des investisseurs professionnels | O |       |
| 16 | Stratégie du FIA | O | Cochez une et une seule stratégie dans le tableau à la fin de la présente annexe. |

**Notice d’utilisation pour remplir les informations requises dans les différents champs qui figurent dans la table qui précède :**

* A l’exception du point 10 qui n’est à remplir que dans le cas où le FIA est réglementé, tous les champs de la colonne droite de la table précédente sont obligatoires, si le champ est précédé de la lettre « O » dans la colonne précédente. Les champs qui sont précédés de la lettre « N » sont à remplir lorsque l’information est disponible.
* Point 1 : Le code CSSF du GFIA est l’identifiant que la CSSF a attribué au GFIA. Il est composé de la lettre A et de huit chiffres. Le code CSSF du FIA peut être consulté sur le site de la CSSF sous l’URL suivante :

<http://supervisedentities.cssf.lu/index.html?language=fr&type=AIF#AdvancedSearch>

* Point 5 : Par code national, il faut entendre le code que l’autorité de surveillance a attribué au FIA lorsque celui est surveillé. Si le FIA n’est pas réglementé, il y a lieu d’indiquer le numéro d’immatriculation ou analogue. Pour les FIA non réglementés luxembourgeois, le numéro du registre de commerce doit être indiqué.
* Point 16 : Il s’agit d’indiquer la stratégie qui décrit le mieux celle appliquée par le FIA. Les stratégies qui figurent dans le tableau à la fin de la présente annexe sont les 35 stratégies prévues à l’annexe IV du Règlement Délégué (UE) N° 231/2013 de la Commission du 19 décembre 2012 et qui ont été reprises dans la table 3 de l’annexe II du rapport final de l’AEMF relatif aux obligations de *reporting* sous les articles 3(3)(d) et 24(1), (2) et (4) de la directive GFIA (document ESMA/2013/1339 (*revised*) du 15/11/2013). A toutes fins utiles les stratégies, leurs abréviations, leur type de FIA correspondant ainsi que les traductions françaises figurent à la fin du présent document. Il est rappelé qu’il est impératif de choisir une seule stratégie (mettre une croix dans la dernière colonne de cette stratégie).

|  |
| --- |
| 2) Informations sur le FIA maître, si le FIA est un FIA nourricier  |
| Si le FIA est un FIA nourricier, les informations suivantes sur le FIA maître sont à compléter : |
| 17 | Nom du FIA maître | O |       |
| 18 | Nationalité du FIA maître | O |       |
| 19 | Code national du FIA maître | N |       |
| 20 | Code LEI du FIA maître | N |       |
| 21 | Date de constitution du FIA maître | O |       |
| 22 | Adresse du FIA maître | O |       |
| 23 | Nom du GFIA du FIA maître | O |       |

En complément du formulaire, les documents suivants sont à soumettre :

1. la dernière version des statuts, si la CSSF ne dispose pas encore de celle-ci ;
2. un document d’émission, si un tel document existe ;
3. le dernier rapport annuel du FIA (« comptes annuels ») dans le cas où un tel rapport a déjà été établi.

Le formulaire Ia est à transmettre ensemble avec les documents énumérés ci-dessus à la CSSF directement via eDesk ([portail eDesk](https://edesk.apps.cssf.lu/edesk-dashboard/dashboard/getstarted?lng=fr)).

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **AIF strategies:** |  |  |  |  |
| AIF type code | AIF type label | AIF strategy code | AIF strategy label | type de FIA - stratégie du FIA | [ ]  |
| HFND  | Hedge fund strategies | EQTY\_LGBS | Equity: Long Bias | fonds spéculatif - actions: biais long (Long Bias) | [ ]  |
| HFND  | Hedge fund strategies | EQTY\_LGST | Equity: Long/Short | fonds spéculatif - actions: stratégie de sélection (Long/Short Equity) | [ ]  |
| HFND  | Hedge fund strategies | EQTY\_MTNL  | Equity: Market neutral | fonds spéculatif - actions: stratégie de position neutre (Market Neutral) | [ ]  |
| HFND  | Hedge fund strategies | EQTY\_STBS | Equity: Short Bias | fonds spéculatif - actions: biais court (Short Bias) | [ ]  |
| HFND  | Hedge fund strategies | RELV\_FXIA | Relative Value: Fixed Income Arbitrage | fonds spéculatif - valeur relative: arbitrage sur produits de taux (Fixed Income Arbitrage) | [ ]  |
| HFND  | Hedge fund strategies | RELV\_CBAR | Relative Value: Convertible Bond Arbitrage | f onds spéculatif - valeur relative: arbitrage sur obligations convertibles (Convertible Bond Arbitrage) | [ ]  |
| HFND  | Hedge fund strategies | RELV\_VLAR  | Relative Value: Volatility Arbitrage | fonds spéculatif - valeur relative: arbitrage sur la volatilité (Volatility Arbitrage) | [ ]  |
| HFND  | Hedge fund strategies | EVDR\_DSRS | Event Driven: Distressed/Restructuring | fonds spéculatif - situations spéciales (Event Driven): difficulté/restructuration (Distressed/Restructuring) | [ ]  |
| HFND  | Hedge fund strategies | EVDR\_RAMA | Event Driven: Risk Arbitrage/Merger Arbitrage | fonds spéculatif - situations spéciales: arbitrage à risque/arbitrage sur fusions-acquisitions (Risk Arbitrage/Merger Arbitrage) | [ ]  |
| HFND  | Hedge fund strategies | EVDR\_EYSS | Event Driven: Equity Special Situations | fonds spéculatif - situations spéciales: Actions - situations spéciales (Equity Special Situations) | [ ]  |
| HFND  | Hedge fund strategies | CRED\_LGST | Credit Long/Short | fonds spéculatif - crédit: stratégie de sélection (Credit Long/Short) | [ ]  |
| HFND  | Hedge fund strategies | CRED\_ABLG | Credit Asset Based Lending | fonds spéculatif - crédit: prêt adossé à des actifs (Asset Based Lending) | [ ]  |
| HFND  | Hedge fund strategies | MACR\_MACR | Macro | fonds spéculatif - macro | [ ]  |
| HFND  | Hedge fund strategies | MANF\_CTAF | Managed Futures/CTA: Fundamental | fonds spéculatif - contrats à terme gérés/Conseillers en placement de dérivés (Managed Futures/CTA): fondamentale | [ ]  |
| HFND  | Hedge fund strategies | MANF\_CTAQ | Managed Futures/CTA: Quantitative | fonds spéculatif - contrats à terme gérés/Conseillers en placement de dérivés (Managed Futures/CTA): quantitative | [ ]  |
| HFND  | Hedge fund strategies | MULT\_HFND | Multi-strategy hedge fund | fonds spéculatif - multistratégie (Multi-Strategy) | [ ]  |
| HFND  | Hedge fund strategies | OTHR\_HFND  | Other hedge fund strategy | fonds spéculatif - autre type de stratégie | [ ]  |
| PEQF  | Private equity strategies | VENT\_CAPL | Venture Capital | fonds de capital-investissement - capital-risque (Venture Capital) | [ ]  |
| PEQF  | Private equity strategies | GRTH\_CAPL | Growth Capital | fonds de capital-investissement - capital-développement (Growth Capital) | [ ]  |
| PEQF  | Private equity strategies | MZNE\_CAPL | Mezzanine Capital | fonds de capital-investissement - capital-mezzanine (Mezzanine Capital) | [ ]  |
| PEQF  | Private equity strategies | MULT\_ PEQF | Multi-strategy private equity fund | fonds de capital-investissement - multistratégie (Multi-Strategy) | [ ]  |
| PEQF  | Private equity strategies | OTHR\_ PEQF | Other private equity fund strategy | fonds de capital-investissement - autre type de stratégie | [ ]  |
| REST  | Real estate strategies  | RESL\_REST |  Residential real estate | fonds immobilier - immobilier résidentiel | [ ]  |
| REST  | Real estate strategies  | COML\_REST | Commercial real estate | fonds immobilier - immobilier commercial | [ ]  |
| REST  | Real estate strategies  | INDL\_REST | Industrial real estate | fonds immobilier - immobilier industriel | [ ]  |
| REST  | Real estate strategies  | MULT\_REST | Multi-strategy real estate fund | fonds immobilier - multistratégie | [ ]  |
| REST  | Real estate strategies  | OTHR\_REST | Other real estate strategy | fonds immobilier - autre type de stratégie | [ ]  |
| FOFS  | Fund of fund strategies | FOFS\_FHFS | Fund of hedge funds | fonds de fonds - fonds de fonds spéculatifs | [ ]  |
| FOFS | Fund of fund strategies | FOFS\_PRIV  | Fund of private equity | fonds de fonds - fonds de fonds de capital-investissement | [ ]  |
| FOFS  | Fund of fund strategies | OTHR\_FOFS | Other fund of funds | fonds de fonds - autre type de fonds de fonds | [ ]  |
| OTHR  | Other Strategy | OTHR\_COMF | Commodity fund | autre - fonds de matières premières | [ ]  |
| OTHR  | Other Strategy | OTHR\_EQYF | Equity fund | autre - fonds investi en actions | [ ]  |
| OTHR  | Other Strategy | OTHR\_FXIF | Fixed income fund | autre - fonds à revenu fixe | [ ]  |
| OTHR  | Other Strategy | OTHR\_INFF  | Infrastructure fund | autre- fonds d’infrastructure | [ ]  |
| OTHR  | Other Strategy | OTHR\_OTHF | Other fund | autre - autre | [ ]  |