

Aanvraagformulier Uitzondering positielimiet

Dit formulier is bedoeld voor niet-financiële entiteiten die gebruik willen maken van de positielimiet uitzondering (artikel 5:89a, vierde lid, Wft) of de positielimiet uitzondering willen beëindigen. Dit formulier is ingedeeld in drie secties: 1. Algemene informatie, 2. Posities die in aanmerking komen voor positielimiet uitzondering, en 3. Ondertekening.

1. Algemene informatie en type aanvraag

1.1 Naam van de niet-financiële entiteit die uitzondering aanvraagt:

1.2 Legal Entity Identifier (hierna LEI) NB: Indien geen LEI, Kamer van Koophandel nummer:

1.3 Naam en functie van de contactpersoon bij de aanvrager:

1.4 Type aanvraag. Selecteer de reden tot aanvraag door middel van het aanvinken van één van de onderstaande boxen:

- Nieuwe aanvraag
- Nieuwe aanvraag als gevolg van wijziging zoals beschreven in Artikel 8, vierde lid van gedelegeerde verordening (EU) 2017/591. Geef bestaand referentie aanvraagnummer:

- Beëindiging van bestaande positielimiet uitzondering. Ga direct door naar sectie 3 'Ondertekening'. Geef bestaand referentie aanvraagnummer:

2. Posities die in aanmerking komen voor positielimiet uitzondering

Om de posities die in aanmerking komen voor de uitzondering te kunnen beoordelen is het van belang dat u in duidelijke bewoordingen¹ beschrijft / toelicht op welke recente periode de opgegeven informatie betrekking heeft. Uit de opgegeven informatie moet duidelijk blijken hoe de positie de rechtsreeks met de commerciële activiteiten van de niet-financiële entiteit verband houdende risico's verlaagt.

2.1 De contracttabel

In tabel 1 wordt gevraagd om gegevens op markt-, product- en instrumentniveau waarover de aanvrager redelijkerwijs kan beschikken. De onderste twee velden verwijzen naar de looptijd van hedge² posities uitgedrukt in verhandelde eenheden, waarbij onderscheid wordt gemaakt tussen een contract dat in de eerstvolgende maand na een observatie moment vervalt (spot-maand contract), en een contract dat niet onder deze definitie valt (andere-maanden contract³); zie artikel 2, tweede en derde lid van gedelegeerde verordening (EU) 2017/591.

Tabel 1

Naam grondstoffenderivatencontract/ economisch gelijkwaardige over-the- counter derivatencontract	
Naam handelsplatform	
Market Identifier Code	
Venue Product Code	
Eenheid (MWh)	
Hedge positie van spot-maand contracten	
Hedge positie van andere-maanden contracten ⁴	

¹ Twee inleidende zinnen ter illustratie: (i) "De cijfers zijn gebaseerd op de financiële verslaggeving van jaar x", (ii) "De volgende beschrijving is gebaseerd op de afgelopen 12 maanden." Die periode wordt ook gebruikt voor de vaststelling van de positielimiet voor spot-maand contracten; zie artikel 10, tweede lid van gedelegeerde verordening (EU) 2017/591.

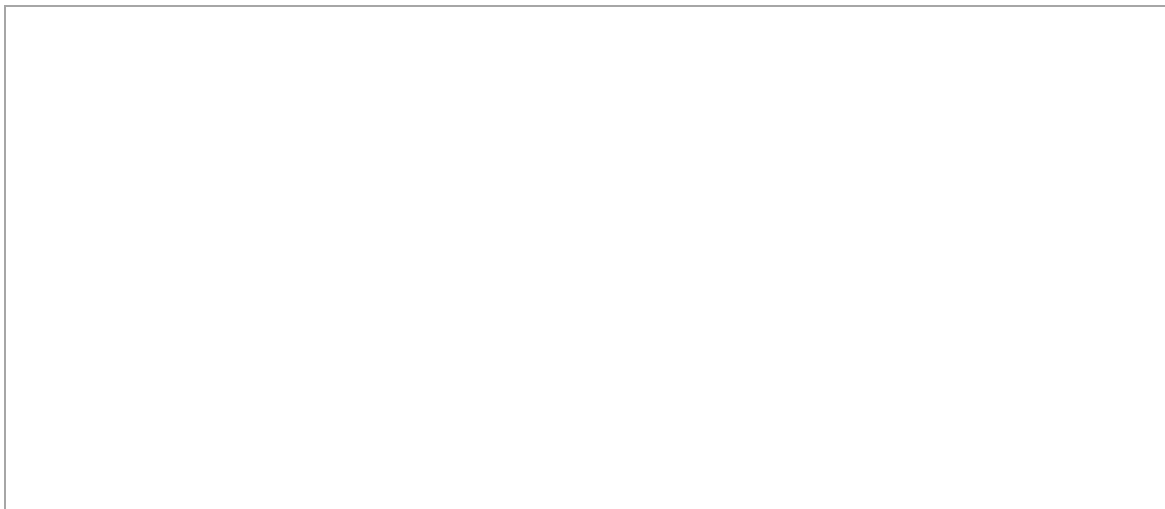
² Dit zijn posities in op handelsplatformen verhandelde grondstoffen-derivaten en in economische zin gelijkwaardige over-the-counter contracten die worden aangehouden door of voor rekening van een niet-financiële entiteit en waarvan objectief kan worden vastgesteld dat deze posities de rechtsreeks met de commerciële activiteit van de niet-financiële entiteit verband houdende risico's verlagen.

³ Ter illustratie: Op 25 november 2017, het observatiemoment, is een 'spot-maand contract' een contract dat de onderliggende waarde / grondstof levert in de maand december 2017 en een 'andere-maand contract' een contract dat de onderliggende waarde / grondstof levert in een latere maand / periode, bijvoorbeeld in januari 2018 en/of februari 2018, en/of maart 2018 enz.

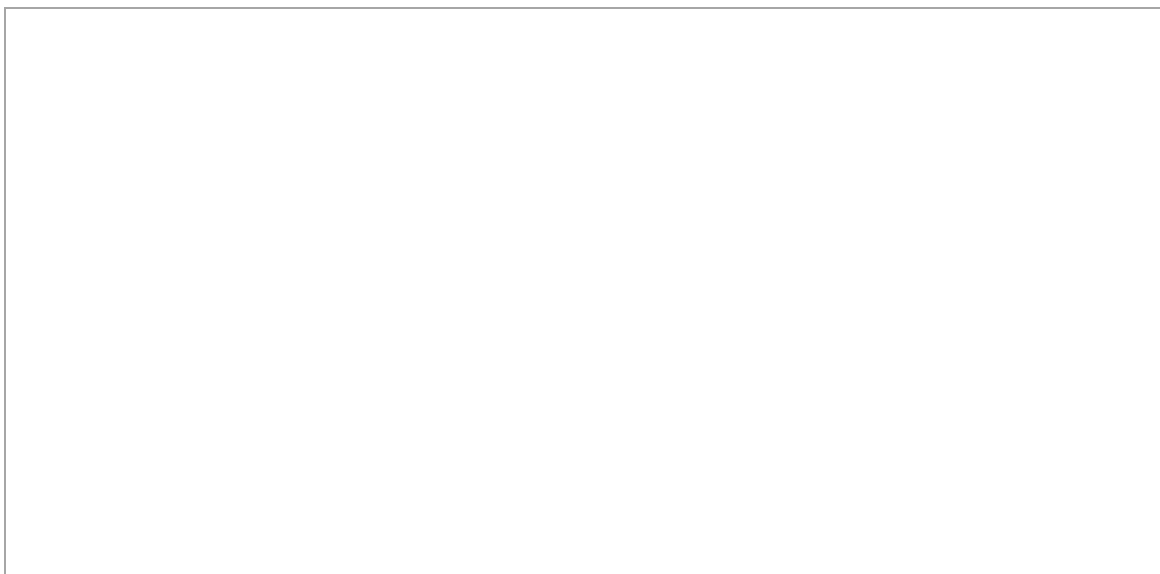
⁴ Voor de waarde van dit veld ('andere-maanden contracten') moeten, indien van toepassing, posities met verschillende leveringsperiodes gesaldeerd worden.

De hieronder in 2.2 - 2.5 gevraagde informatie is gebaseerd op artikel 8, tweede lid van gedelegeerde verordening (EU) 2017/591. Wanneer de aanvraag volgt op significante wijzigingen in de aard of waarde van commerciële activiteiten of handelsactiviteiten in grondstoffenderivaten, zoals bedoeld in artikel 8, vierde lid van gedelegeerde verordening (EU) 2017/591, dan moet de in 2.2 - 2.5 gevraagde informatie de relevante wijziging duidelijk beschrijven / toelichten.

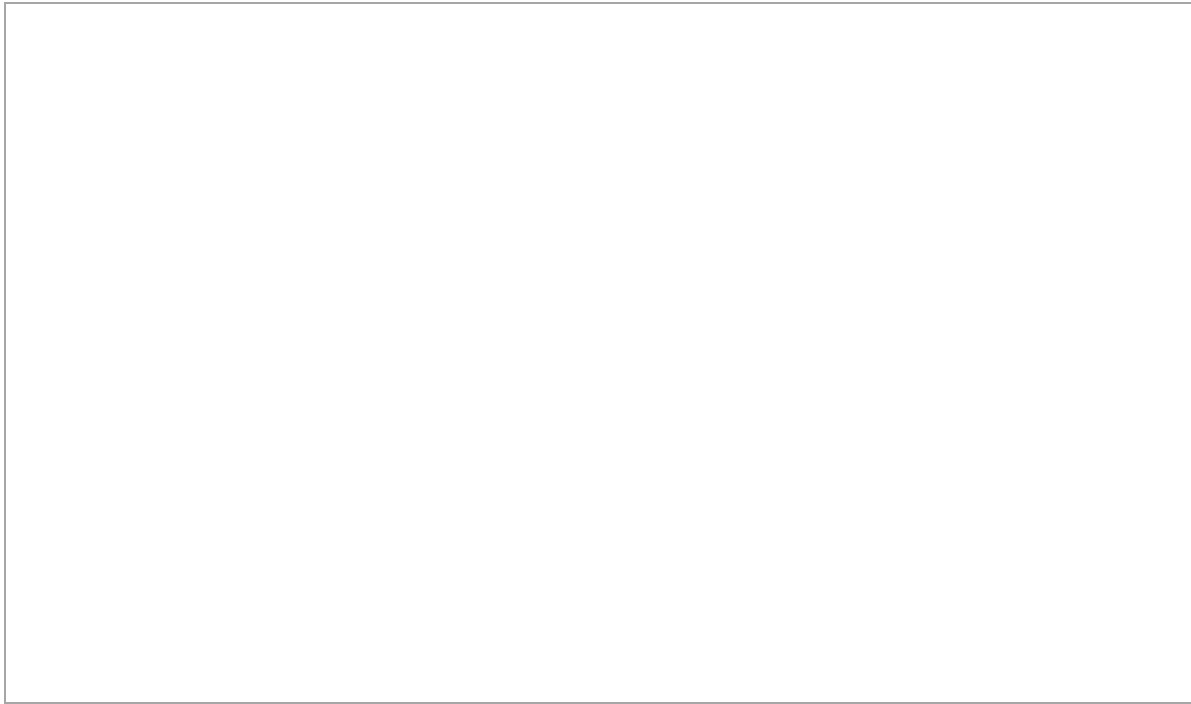
2.2 Beschrijf de aard en de waarde van de commerciële activiteiten van de niet-financiële entiteit in de grondstof waarop het grondstoffenderivaat, waarvoor vrijstelling is aangevraagd, betrekking heeft:



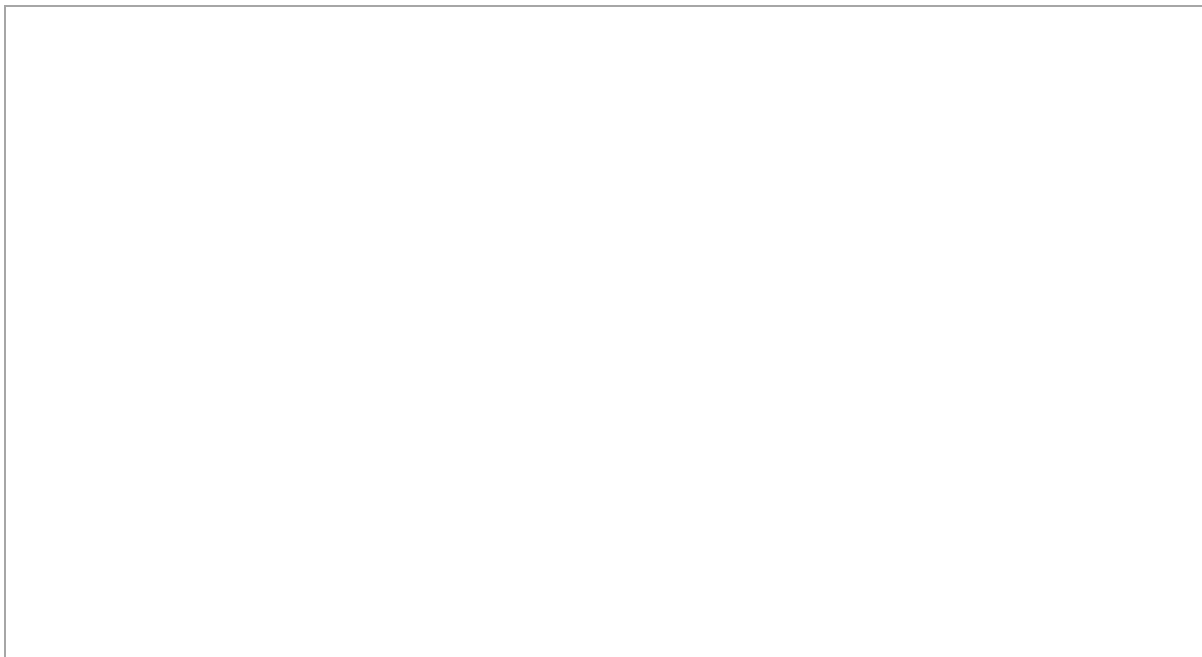
2.3 Beschrijf de aard en de waarde van de activiteiten van de niet-financiële entiteit in de handel en posities in de desbetreffende op handelsplatformen verhandelde grondstoffenderivaten en in hun in economische zin gelijkwaardige otc-contracten:



2.4 Beschrijf de aard en de omvang van de blootstellingen en risico's in de grondstof die de niet-financiële entiteit heeft of verwacht te hebben als gevolg van haar commerciële en/of handelsactiviteiten en die door het gebruik van grondstoffenderivaten beperkt worden of zouden worden:



2.5 Geef een toelichting bij de wijze waarop de niet-financiële entiteit door het gebruik van grondstoffenderivaten de blootstelling en risico's in haar commerciële activiteiten rechtstreeks verlaagt:



2.6 Aanvullende documenten

U bent niet verplicht aanvullende documenten toe te voegen⁵ aan deze aanvraag, maar als u van mening bent dat deze documenten uw aanvraag ondersteunen (bijvoorbeeld handelsdata, informatie gebruikt voor de nevenactiviteiten notificatie, en/of informatie gebruikt voor de EMIR-rapportage), vul dan onderstaande gegevens in:

Aantal in de aanvraag bijgevoegde documenten:

Naam document 1

Aantal pagina's

-

Naam document 2

Aantal pagina's

-

Naam document 3

Aantal pagina's

-

Naam document 4

Aantal pagina's

-

Naam document 5

Aantal pagina's

-

⁵ De AFM gaat zorgvuldig om met uw bedrijfs- en persoonsgegevens. Daarom gebruiken we een speciaal programma om vertrouwelijke gegevens met encryptie (versleuteling) te verzenden. Dit programma heet Cryptshare. Meer informatie (handleiding) vindt u op onze website www.afm.nl/over-afm/contact/bestanden.

3. Ondertekening

De aanvraag dient te worden ondertekend door een daartoe bevoegd vertegenwoordiger van de aanvrager. Met het indienen van dit formulier bevestigt de aanvrager gebruik te maken van de positielimiet uitzondering die beschreven staat in artikel 5:89a, vierde lid, Wft, of de relevante positielimiet uitzondering te beëindigen.

Naam van bevoegde vertegenwoordiger van de niet-financiële entiteit:

Handtekening van de bevoegde vertegenwoordiger van de aanvrager:

Datum: