

BIJLAGE 1

Maatregel inzake short selling

Stichting Autoriteit Financiële Markten (AFM) en De Nederlandsche Bank N.V. (DNB) geven hierbij te kennen dat de AFM, gezien de huidige uitzonderlijke marktomstandigheden en mede gelet op het aanhangige wetsvoorstel tot wijziging van de Wft, nieuwe maatregelen aankondigt met betrekking tot het houden van een short positie in financiële ondernemingen. Het betreft financiële ondernemingen als bedoeld in de bijlage Financiële Ondernemingen behorend bij deze maatregel. Derhalve is de maatregel van 21 september 2008 met ingang van 5 oktober 2008 niet meer van toepassing onverminderd het bepaalde in paragraaf 2(IV) van onderhavige maatregel.

DNB verwelkomt deze aankondiging vanuit het oogpunt van financiële stabiliteit.

1.Short selling met betrekking tot Financiële Ondernemingen

(I)Een persoon die een transactie of handelsorder verricht of bewerkstelligt die (of op zichzelf of in samenhang met andere transacties of handelsorders) het volgende effect sorteert:

a.het creëren van een Netto shortpositie¹ in een Financiële Onderneming; of

b.het vergroten van een Netto shortpositie in een Financiële Onderneming welke positie bestond voor 5 oktober 2008;

wordt geacht onder het verbod van artikel 5:58, eerste lid, van de Wet op het financieel toezicht te vallen (marktmanipulatie).

(II)Onderdeel (I) is niet van toepassing op een persoon handelend in de hoedanigheid van Market Maker².

(III)Onderdeel (I) is niet van toepassing op een transactie of handelsorder die is verricht of bewerkstelligd voor 5 oktober 2008.

(IV)Deze regeling wordt van kracht op 5 oktober 2008 en geldt voor een termijn van 30 dagen. Zowel de duur als de inhoud van deze maatregel kan tussentijds worden gewijzigd.

2.Melding van bestaande posities

(I)De AFM verzoekt de persoon, die een Meldplichtige shortpositie³ – ongeacht op welke wijze en wanneer deze positie ontstaan is – heeft of zal krijgen in een Financiële Onderneming, een adequate doorlopende melding te doen.

(II)In onderdeel (I) wordt onder ‘adequate doorlopende melding’ verstaan een melding gedaan aan de AFM uiterlijk op de eerstvolgende werkdag nadat de Meldplichtige shortpositie is ontstaan. De melding bevat in elk geval de naam van de persoon die de positie heeft, de omvang van de positie, de naam van de desbetreffende Financiële Onderneming en de datum waarop de Meldplichtige shortpositie werd gehouden.

(III)De eerste melding onder deze maatregel wordt gedaan einde dag op dinsdag 7 oktober 2008. Deze melding betreft de posities die worden gehouden op maandag 6 oktober 2008 einde dag.

(IV)Het verzoek om shortposities te melden op grond van de maatregel van 21 september 2008 blijft van kracht voor de shortposities gehouden op 3 oktober 2008 einde dag.

(V)Dit verzoek wordt van kracht op 5 oktober 2008 en geldt voor een termijn van 30 dagen. Zowel de duur als de inhoud van dit verzoek kan tussentijds worden gewijzigd.

DEFINITIES

1. Netto shortpositie: het economisch belang gerelateerd aan het totaal geplaatste kapitaal van de desbetreffende Financiële Onderneming. Bij het berekenen of een persoon een shortpositie heeft, dient

de persoon iedere vorm van economisch belang gerelateerd aan het totaal geplaatste kapitaal van de desbetreffende Financiële Onderneming in aanmerking te nemen.

2. Market Maker: een persoon die op de financiële markten doorlopend blijkt geeft van de bereidheid voor eigen rekening te handelen door financiële instrumenten tegen door hem vastgestelde prijzen te kopen of te verkopen (zowel in het OTC-segment als op de geregementeerde markten en multilaterale handelsfaciliteiten) op een wijze die er normaal gesproken voor zorgt dat er liquiditeit tot stand wordt gebracht in de markten op constante basis, met dien verstande dat dit zowel voor de bied als de laat kant dient te gelden.

3. Meldplichtige shortpositie: een netto shortpositie die een economisch belang vertegenwoordigt in het totaal geplaatste kapitaal van de desbetreffende Financiële Onderneming van een kwart procent (0.25%) of meer. Bij het berekenen of een persoon een meldplichtige shortpositie heeft, dient de persoon iedere vorm van economisch belang gerelateerd aan het totaal geplaatste kapitaal van de desbetreffende Financiële Onderneming in aanmerking te nemen, met uitzondering van een economisch belang dat hij houdt in de hoedanigheid van Market Maker.

BIJLAGE FINANCIËLE ONDERNEMINGEN

AEGON N.V. NL0000303709
ING GROEP N.V. NL0000303600
FORTIS N.V. BE0003801181
BINCKBANK N.V. NL0000335578
KAS BANK N.V. NL0000362648
SNS REAAL N.V. NL0000390706
VAN DER MOOLEN HOLDING N.V. NL0000370179
VAN LANSCHOT N.V. NL0000302636