Anlage 2

Im Jahr 2011 abgeschlossene Zinsderivatgeschäfte

Nr.	Abschluss-datum	Bank	Startbetrag in EUR	Art des Derivats	aktueller Bezugsbetrag in EUR per 30.6.2012	Stadt Nürnberg zahlt im Swap	aktueller Darlehenszins	Laufzeit
1	01.03.2011	öffentl.-rechtli. KI	10.000.000	Receiver Swap	0	6-Monats-Euribor + 1,578 % (act./360)	4,70% (30/360)	03.03.2011 - 15.08.2018
2	04.08.2011	öffentl.-rechtli. KI	18.400.000	Payer Swap	17.600.000	1,885% (30/360)	6-Monats-Euribor+0,05% (act./360)	08.08.2011 - 19.11.2014
3	18.10.2011	öffentl.-rechtli. KI	22.000.000	Payer Swap	21.656.250,00	2,5950%	6-Monats-Euribor+0,13% (act./360)	28.10.2011 - 21.11.2021

Im Jahr 2011 aufgelöste Zinsderivatgeschäfte

Nr.	Abschluss-datum	Bank	Startbetrag in EUR	Art des Derivats	aufgelöst am:	Stadt Nürnberg zahlt im Swap	Auflösungsbetrag (+ erhaltene Beträge, - bezahlte Beträge)	Ursprüngliche Laufzeit des aufgelösten Swaps
1	01.03.2011	öffentl.-rechtli. KI	10.000.000	Receiver Swap	02.08.2011	6-Monats-Euribor + 1,578 % (act./360)	+ 295.000 EUR	03.03.2011 - 15.08.2018

Darlehensaufnahmen im Jahr 2011

Anlage 1

	Darlehensbetrag			Valuta	Verzinsung	Kreditgeber	Zinsbindung/ Margenzusage	Tilgung	Derivat-geschäft	Abschluss-datum	Art d. Geschäfts	Startbetrag	Laufzeit	Zinssatz
Nr.	Investitionen	KE	für Umschuldung											
1	6.000.000,00	2010		26.01.2011	0 % bis 15.2.2013 1,55% bis 15.02.2016	Bund	15.02.2016	60.000,00 vj.	nein					
2			15.300.000,00	10.02.2011	6-M.-Euribor + 0,01 %	öffentl.-rechtl.	30.06.2013	510.000,00 hj.	nein					
3	25.000.000,00	2010		01.03.2011	3,618 % (30/360)	öffentl.-rechtl.	20.02.2041	416.666,66 hj.	nein					
4			17.440.000,00	20.05.2011	3,015 % (30/360)	öffentl.-rechtl.	20.05.2016	348.800,00 hj.	nein					
5	15.000.000,00	2010		22.06.2011	2,92 % (30/360)	Geschäftsbank	22.06.2016	234.375,00 hj.	nein					
6	10.000.000,00	2010		22.06.2011	6-M.-Euribor - 0,07 % act./360	Geschäftsbank	30.06.2013	156.250,00 hj.	nein					
7			30.000.000,00 (Forward Darlehen)	19.04.2012	3,55%	öffentl.-rechtl.	19.10.2027 (Laufzeitende)	1.000.000,00 hj.	nein					
8	10.500.000,00	2010		03.08.2011	2,71% 30/360	öffentl.-rechtl.	30.06.2016	175.000,00 hj.	nein					
9	14.500.000,00	2010		03.08.2011	6-M.-Euribor + 0,05 %	öffentl.-rechtl.	30.12.2013	250.000,00 hj.	nein					
10			12.200.000,00	25.10.2011	2,899 % 30/360	öffentl.-rechtl.	20.11.2031 (Laufzeitende)	305.000,00 hj.	nein					
11	22.000.000,00	2010		28.10.2011	6-M.-Euribor + 0,13 % (act./360)	öffentl.-rechtl.	21.11.2021	343.750,00 hj.	ja	18.10.2011	Payer Swap	22.000.000,00	28.10.2011 bis 21.11.2021	2,595% (30/360)
12	30.000.000,00	2011		28.12.2011	2,599% 30/360	öffentl.-rechtl.	30.12.2020 (Laufzeitende)	300.000,00 vj.	nein					

Neuaufnahmen	KE	Umschuldungen
103.000.000,00	2010	
30.000.000,00	2011	
133.000.000,00		74.940.000,00