

2.k.

Herrn
Frank Samirae
Holunderweg 9

51427 Bergisch Gladbach

Jürgen Mumdey
Stadtkämmerer

Bürogebäude Hauptstr.
Hauptstr. 192, Zimmer 204
Telefon: 02202/ 142600
Telefax: 02202/ 142677
Internet: <http://www.bergischgladbach.de>
e-mail: j.mumdey@stadt-gl.de

21. September 2015

Ihre Anfrage bez. Derivate in der Ratssitzung zu Pkt. 9

Feststellung des Jahresabschlusses 2014 der eigenbetriebsähnlichen Einrichtung
"Immobilienbetrieb der Stadt Bergisch Gladbach"
0335/2015

Sehr geehrter Herr Samirae,

die Zinsderivate werden zur Begrenzung und Steuerung von Liquiditäts- und Zinsänderungsrisiken abgeschlossen. Dies ist regelmäßig der Fall bei variabel verzinslichen Darlehen (z.B. auf Basis des 6 Monats Euribor). Da der Bestand der Darlehen sich zum überwiegenden Teil aus festverzinslichen Positionen zusammensetzt, ist die Anzahl der Zinssicherungsgeschäfte geringer als die Gesamtzahl sämtlicher Darlehen des Immobilienbetriebs.

Die Überprüfung des Kreditportfolios des Immobilienbetriebes zum 31.12.2014 als auch zum aktuellen Zeitpunkt hat ergeben, dass 13 variabel verzinsliche Darlehen mit exakt 13 Zinsswaps zu Bewertungseinheiten zusammengefasst sind. Grund- und Sicherungsgeschäfte weisen 100% Konnexität aus. Es existieren keine von Grundgeschäften losgelöste Derivatepositionen.

Mit freundlichen Grüßen


Jürgen Mumdey
Stadtkämmerer