

**Kleine Anfrage zur schriftlichen Beantwortung
gemäß § 46 Abs. 1 GO LT**

Abgeordnete Stefan Wenzel (GRÜNE)

Fragen zum künftigen Geschäftsmodell der NORD/LB: Hier Geschäftsbereich Markets

Anfrage des Abgeordneten Stefan Wenzel (GRÜNE) an die Landesregierung, eingegangen am 08.08.2019

Im Geschäftsbericht 2018 der NORD/LB heißt es im Lagebericht auf Seite 111: „Im Bereich Markets besteht die Chance, durch den geplanten Ausbau der institutionellen Kundenbeziehungen vor allem in Europa die Kundenbasis zu erweitern, Ertragspotenziale zu nutzen und Marktanteile dieses Absatzmarktes hinzuzugewinnen. Durch neue Produktinitiativen und die Weiterentwicklung von bestehenden Produkten werden vorhandene Kundenbeziehungen intensiviert und zusätzliche Ertragspotenziale ausgeschöpft.

Herausforderungen ergeben sich vor allem durch weitere mögliche Veränderungen im Marktumfeld, die durch Margenrückgänge, Negativzinssätze und ein verändertes Investorenverhalten gekennzeichnet sind. Darüber hinaus wirken sich aufsichtsrechtliche Themen, mit Einfluss auf das Kundengeschäft, wie z. B. eine erhöhte Eigenkapitalunterlegung, auf das Segment aus.“

1. Wie hoch sind die Kreditäquivalente aus Derivaten (inklusive Add-on und unter Berücksichtigung von Netting), die in der Bilanz 2018 in das Gesamtexposure eingeflossen sind?
2. Wie hoch sind in der Bilanz 2018 die Kreditäquivalente aus Derivaten exklusive Add-on und ohne Berücksichtigung von Netting?
3. Inwiefern und mit welcher Wirkung hat sich das Verfahren der Bank zur Bewertung von Derivaten, wie beispielsweise im Geschäftsbericht 2005 (Seite 106 ff) beschrieben, durch die Kapitaladäquanzverordnung (CRR) geändert (bitte Nominalwerte und Marktwerte pos/neg vorher/nachher nennen)?
4. Wie viel Aktiva bindet der Geschäftsbereich Markets in der Bilanz 2018 der NORD/LB?
5. Wie viele risikowirksame Aktiva (RWA) bindet der Geschäftsbereich Markets in der Bilanz 2018 der NORD/LB?
6. Wie viele risikowirksame Aktiva (RWA) binden Derivate in der Bilanz 2018 der NORD/LB?
7. Wie entwickeln sich die durch den Geschäftsbereich Markets bzw. durch Derivate gebundenen o. g. risikowirksamen Aktiva durch die fiktive Anwendung der kommenden Basel-IV-Regulierung?
8. Welche Finanzdienstleistungsprodukte werden von dem Geschäftsbereich Markets angeboten?
9. Welche maßgeblichen Geschäfte hat der Geschäftsbereich Markets bislang getätigt?
10. Welche „neuen Produktinitiativen“ sind „vor allem in Europa“ geplant?
11. Was bzw. wer ist mit „institutionellen Kundenbeziehungen“ genau gemeint?
12. Wie viel Prozent dieser „institutionellen Kundenbeziehungen“ entfallen auf a) Banken, b) Versicherungen, c) Industrie, d) Gewerbe, e) Hedgefonds, f) Pensionsfonds, g) Kommunen, Bundesländer, h) Staaten, i) Sparkassen?
13. Wie viel Prozent dieser „institutionellen Kundenbeziehungen“ entfallen auf Geschäfte in a) Niedersachsen, b) Sachsen-Anhalt, c) Mecklenburg-Vorpommern, d) Deutschland, e) Europa, f) Nord- und Südamerika, g) Asien, h) Afrika, i) Ozeanien?

14. Auf welche Branchen verteilen sich Derivate, die die NORD/LB jeweils auf eigene Rechnung oder im Kundenauftrag hält?
15. Wie verteilen sich von der NORD/LB auf eigene Rechnung oder im Kundenauftrag gehaltene Derivate auf Festgeschäfte, Swapgeschäfte, Optionsgeschäfte, Produkte 2. Ordnung, Sonstiges?
16. Wie werden in der Ratingstruktur die mit „Fair Value“ in die verschiedenen Ratingklassen eingestuften Derivate im Detail bewertet (bitte Rechtsgrundlage und Verfahren für „Fair Value“-Bewertung beschreiben)?
17. Welche außerbilanziellen Risiken bestehen bei der NORD/LB (siehe u. a. Seite 118 Geschäftsbericht 2018)?
18. Welche stillen Beteiligungen hält die NORD/LB derzeit direkt oder über Treuhänder?
19. Welche stillen Beteiligungen werden von konsolidierten Tochterunternehmen der NORD/LB gehalten?
20. Welche stillen Beteiligungen wurden kürzlich an die M. M. Warburg & Co verkauft oder im Zuge des NORD/LB-Asset-Management-Deals übertragen?
21. Mit welchem Wert wird das Exposure in Zypern mit Stand vom Ende des 2. Quartals 2019 in den Büchern geführt (Geschäftsbericht 2018 allein 634 Millionen Euro in der Kategorie Corporates/Sonstige)?
22. Ist es korrekt, dass bei der Bank nur etwa 25 % der risikogewichteten Aktiva und weniger als 10 % der Aktiva durch Sicherheiten, Bürgschaften, Grundpfandrechte oder Garantien gedeckt sind?
23. Wenn nein, wie hoch sind die in Frage 22 genannten Werte?
24. Negative Fair Values aus Hedge-Accounting-Derivaten in Höhe von 1,771 Milliarden Euro auf der Passiv-Seite der Bilanz: Welche Kalkulation, welche Grundlagen und welche Ursachen stehen hinter dieser Bilanzposition?

(Verteilt am 13.08.2019)