

Schriftliche Kleine Anfrage

der Abgeordneten Robert Bläsing und Finn-Ole Ritter (FDP) vom 30.01.15

und Antwort des Senats

Betr.: Entwicklung der Portfolios der Versorgungsrücklagen der Freien und Hansestadt Hamburg (III)

Die Freie und Hansestadt Hamburg (FHH) bildet in geringem Umfang Rücklagen für aktuelle und zukünftige Versorgungsverpflichtungen. Zu diesen Rücklagen zählen insbesondere:

- a. *das Sondervermögen Versorgungsrücklage für die Beamtenpensionen,*
- b. *das Sondervermögen Zusatzversorgung für die Angestelltenruhegelder,*
- c. *das Sondervermögen Zusätzlicher Versorgungsfonds unter anderem für die Beihilfen für ehemalige Beamte und Angestellte der Stadt,*
- d. *das Sondervermögen Versorgungsfonds für die Altersversorgung der Abgeordneten der Bürgerschaft der FHH und*
- e. *der Hamburgische Versorgungsfonds (HVF) AöR.*

Mit dem Finanzbericht zum Haushaltsplan 2015/2016 wurde die 2015 beginnende Verwendung des unter Punkt c. genannten Sondervermögens zur Dämpfung des Kostenanstiegs bei den Versorgungsausgaben vorgestellt und von der Hamburgischen Bürgerschaft beschlossen.

Aus Drs. 20/14320 gehen die Portfolios der ersten drei oben genannten Sondervermögen zum 31.12.2014 hervor. Dabei fällt auf, dass von rund 1 Milliarde Euro Gesamtvolumen mittlerweile 120 Millionen Euro allein in Anleihen der FHH investiert wurden. Gemäß Drs. 20/3005 gab es am 31.12.2011 noch keine Anleihen der FHH in den Portfolios.

Vor diesem Hintergrund fragen wir den Senat:

Der Senat beantwortet die Fragen teilweise aufgrund von Auskünften der HGV Hamburger Gesellschaft für Vermögens- und Beteiligungsmanagement mbH (HGV) wie folgt:

1. *Ließen die Anlagerichtlinien zu den eingangs unter a. bis c. genannten Portfolios schon immer den Kauf eigener Wertpapiere (also solcher der FHH) zu?*
 - a. *Wenn ja, warum wurden zumindest bis Ende 2011 offenbar keine Wertpapiere der FHH gekauft?*
 - b. *Wenn nein, wann wurden die Anlagerichtlinien durch wen beziehungsweise auf wessen Veranlassung aus welchen Gründen geändert, um auch Wertpapiere der FHH kaufen zu können?*

- c. Wann genau wurden die Anleihen der FHH jeweils in welchem Volumen gekauft?

Ja, weil zunächst Landesschatzanweisungen anderer Länder gekauft und diese bei zunehmendem Anlagevolumen aus Gründen der Portfoliodiversifikation auch durch Wertpapiere der Freien und Hansestadt Hamburg ergänzt wurden. Im Übrigen siehe Anlage 1.

2. In welchem Umfang (prozentualer Anteil) ist die FHH jeweils (als mitgebende Partei) an den Länder-Anleihen mit den ISIN DE000A1K01Z2, DE000A1A6K25, DE000A1PGZ58, DE000A1R01Z7, DE000A1YQCQ3 und DE000A13R889 beteiligt?

Siehe Anlage 2.

3. Aus welchen Gründen wurden die Anlagerichtlinien 2013 dahin gehend geändert, dass keine Wertpapiere anderer Euro-Staaten mehr gekauft werden dürfen?

Anlass für die Änderung waren in den Jahren 2005 – 2010 erworbene Staatsanleihen anderer Euro-Staaten, deren Rating sich so verschlechtert hatte, dass dieses nicht mehr den Anforderungen für den Neuerwerb von Anleihen entsprach.

4. Ist die am 01.02.2015 auslaufende italienische Staatsanleihe mit der ISIN IT0003719918 erfolgreich und vollständig ausgezahlt worden? In welche Wertpapiere wurde die erlangte Liquidität reinvestiert?

Ja. Die Mittel werden derzeit von der Deutschen Bundesbank in Wertpapiere verschiedener Länder reinvestiert.

5. Wie beziehungsweise zu welchen Konditionen, insbesondere bezüglich Verzinsung und Laufzeit, ist der 2013 an den HVF gezahlte Haushaltszuschuss von 35 Millionen Euro derzeit angelegt?

Die Mittel wurden mit einem Zinssatz von 0,26 Prozent und einer Laufzeit bis zum 30. Juni 2015 angelegt.

6. Wie viel ist derzeit von dem 2012 an den HVF gezahlten Haushaltszuschuss in Höhe von 218 Millionen Euro noch übrig? In welcher Form und zu welchen Konditionen (vergleiche Frage 5.) ist er derzeit angelegt?

	Betrag in Mio. €	Zinssatz	Laufzeit
Kapitalmarkt	51	0,35%/0,89%	16.02.2015/04.12.2015
HGV	74	0,7%	01.03.2015
HGV	64	0,9%	01.03.2016

7. Hat die HGV die ihr vom HVF aus dem Haushaltszuschuss gewährten Inhaberschuldverschreibungen am 01.03.2013 und am 01.03.2014 vollständig und pünktlich zurückgezahlt?

- a. Wenn nein, warum nicht? Wie wurde die Situation gegebenenfalls gelöst?
b. Wie hat die HGV die 80 Millionen Euro der beiden Tranchen refinanziert?

Ja. Die Refinanzierung erfolgte durch Aufnahme anderer Darlehen und Begebung einer Namensschuldverschreibung. Im Übrigen: entfällt.

8. Hat der HVF 2014 über die aus dem Jahresabschluss 2013 bekannte Höhe von circa 204 Millionen Euro hinaus Verbindlichkeiten aufgenommen?

Wenn ja, wann in welcher Höhe aus welchen Gründen?

9. Wird beim HVF die Aufnahme von weiteren Verbindlichkeiten für die Jahre 2015 bis 2018 geprüft oder ist diese geplant?

Wenn ja, zu wann in welcher Höhe?

Nein.

Anlage 1

Übersicht Vermögensbestand nominal (Stichtag 31.12.2014)

**Zusatzversorgung
der Freien und Han-
sestadt Hamburg**

Bezeichnung	ISIN	Fälligkeit	Kupon	Nennwert	Kaufdatum
Land Hamburg LSA A-3 v. 12 (19)	DE000A1H3EK1	26.03.2019	2,000	3.000.000,00	25.04.2012
				3.000.000,00	

**Versorgungsrücklage
der Freien und Han-
sestadt Hamburg**

Bezeichnung	ISIN	Fälligkeit	Kupon	Nennwert	Kaufdatum
Land Hamburg LSA A.3 v. 12 (19)	DE000A1H3EK1	26.03.2019	2,000	13.000.000,00	25.04.2012
Land Hamburg LSA A.4 v. 12 (20)	DE000A1H3EL9	04.09.2020	1,500	10.000.000,00	10.09.2012
Land Hamburg LSA A.5 v. 12 (22)	DE000A1H3EM7	26.09.2022	1,875	16.200.000,00	18.09.2012
				39.200.000,00	

**Zusätzlicher Versorgungsfonds für die Altersversorgung
der Bediensteten der Freien und Hansestadt Hamburg**

Bezeichnung	ISIN	Fälligkeit	Kupon	Nennwert	Kaufdatum
Land Hamburg LSA A. 3 v. 12 (19)	DE000A1H3EK1	26.03.2019	2,000	4.000.000,00	25.04.2012
Land Hamburg LSA A. 3 v. 12 (19)	DE000A1H3EL9	04.09.2020	1,500	8.000.000,00	10.09.2012
Land Hamburg LSA A. 3 v.14(21)	DE000A1YCQA8	18.06.2021	1,000	10.000.000,00	12.06.2014
Land Hamburg LSA A. 3 v.14(21)	DE000A1YCQA8	18.06.2021	1,000	30.000.000,00	14.08.2014
Land Hamburg LSA A. 5 v. 12 (22)	DE000A1H3EM7	26.09.2022	1,875	1.800.000,00	18.09.2012
Land Hamburg LSA A. 2v.14(24)	DE000A1R0ZC7	27.02.2024	1,875	25.000.000,00	27.02.2014
				78.800.000,00	

Prozentualer Anteil der FHH an gemeinsamen Länderanleihen

<u>Länderjumbos</u>	<u>Anteil der FHH</u>
DE000A1K01Z	16%
DE000A1A6K25	20%
DE000A1PGZ58	16%
DE000A1R01Z7	15%
DE000A1YCC03	25%
DE000A11QQ25	18%
DE000A13R889	13%