

Dokumentation ZKB Dataset Service XML-Format

Dokumentation File-Strukturen und fachlicher Kontext im ZKB Dataset Service

Änderungsnachweis

| Datum | Version | Änderungen | Seiten |
|------------|---------|---|----------------------------|
| 24.03.2023 | 1.0 | Erstellung des Dokumentes | alle |
| 15.06.2023 | 1.1 | <ul style="list-style-type: none">Ergänzung Datumsart 'Transaktionsdatum' und 'Timestamp'Ergänzung Attribut 'balancelnChf' und 'balancelnChfCreditDebitIndicator' in der Struktur 'Konto und Darlehen' (Verfügbar ab Oktober 2023)Ergänzung Struktur 'OTC Positionen' | 6 31, 32, 35 36 – 39 |
| 09.11.2023 | 1.2 | <ul style="list-style-type: none">Ergänzung Definition 'dataType'Diverse kleinere fachliche Anpassungen | 57 alle |

Inhaltsverzeichnis

| | | |
|------------|--|-----------|
| 1 | Einführung | 5 |
| 1.1 | Zweck und Inhalt dieser Dokumentation | 5 |
| 2 | Hinweise ZKB Dataset | 6 |
| 2.1 | Verfügbarkeit von Daten | 6 |
| 2.1.1 | Fachliche Ausprägungen von Datenlieferungen | 6 |
| 2.1.2 | Daten pro Buchungstag aufbereitet | 6 |
| 2.1.3 | Datenverfügbarkeit | 6 |
| 2.1.4 | Einmalige Datenbestellungen | 6 |
| 2.1.5 | Wiederholende Datenbestellungen | 7 |
| 2.1.6 | Prüfung der Verfügungsrechte | 7 |
| 2.1.7 | Datenlieferung via SFTP-Server («Secure File Transfer Protocol») | 7 |
| 2.1.8 | Ex-Brokerage / In-Custody | 7 |
| 2.2 | Fachliche Erklärungen | 9 |
| 2.2.1 | Berechnungsbeispiel Wertschriftenkauf | 9 |
| 2.2.2 | Berechnungsbeispiel für Kurse (Währungen mit Standard 100 zu Währungen mit Standard 1) | 9 |
| 2.2.3 | Erläuterung transactionSubtype Optionen und Futures | 10 |
| 2.2.4 | Depotarten innerhalb der Zürcher Kantonalbank | 10 |
| 3 | Spezifikation der Datenlieferungen im Native Format | 11 |
| 3.1 | Allgemeine Informationen | 11 |
| 3.1.1 | Mögliche Werte eines Attributs | 11 |
| 3.1.2 | List Attribute | 11 |
| 3.1.3 | Darstellung von Betragswerten | 12 |
| 3.1.4 | Statement, Reversal und Rektifikat | 12 |
| 3.1.5 | Deklaration der Transaktionsarten und Transaktionstypen | 12 |
| 3.1.6 | Definition von standardmässig gelieferten Attributen | 12 |
| 3.2 | Fachliche Definition allgemeiner Teil | 13 |
| 3.3 | Transaktionen | 14 |
| 3.3.1 | Wertschriften | 14 |
| 3.3.2 | Devisen und Edelmetall | 18 |
| 3.3.3 | Konto und Feste Vorschüsse | 20 |
| 3.3.4 | Geldmarkt- und Treuhandanlagen | 22 |
| 3.3.5 | Hypotheken und Darlehen | 24 |
| 3.4 | Positionen | 25 |
| 3.4.1 | Wertschriften | 25 |
| 3.4.2 | Devisen und Edelmetall | 29 |
| 3.4.3 | Konto und feste Vorschüsse | 31 |
| 3.4.4 | Geldmarkt- und Treuhandanlagen | 33 |
| 3.4.5 | Hypotheken und Darlehen | 35 |
| 3.4.6 | OTC (over the counter) | 36 |
| 3.5 | Bewertungen | 40 |
| 3.5.1 | Wertschriften | 40 |
| 3.5.2 | Devisen und Edelmetall | 42 |
| 3.5.3 | Geldmarkt- und Treuhandanlagen | 43 |
| 3.6 | Stammdaten | 44 |
| 3.6.1 | Wertschriften | 44 |
| 3.6.2 | Devisen und Edelmetall | 46 |
| 3.6.3 | Geldmarkt- und Treuhandanlagen | 47 |
| 4 | Detailbeschreibung | 48 |

| | | |
|------------|--|-----------|
| 4.1 | Beschreibung und mögliche Werte | 48 |
| 4.1.1 | unitOfQuantity | 48 |
| 4.1.2 | priceType | 48 |
| 4.1.3 | bookingType | 48 |
| 4.1.4 | interestFrequencyCode | 49 |
| 4.1.5 | interestPeriod | 49 |
| 4.1.6 | optionStyle | 49 |
| 4.1.7 | interestFrequencyCode (loan) | 50 |
| 4.1.8 | interestPeriod (loan) | 50 |
| 4.1.9 | creditDebitIndicator | 50 |
| 4.1.10 | inOutIndicator | 50 |
| 4.1.11 | product | 50 |
| 4.1.12 | moneyMarketType | 50 |
| 4.1.13 | valorStatus | 50 |
| 4.1.14 | optionType | 51 |
| 4.1.15 | valorTypeTelekurs | 51 |
| 4.1.16 | transactionType | 52 |
| 4.1.17 | transactionSubtype | 52 |
| 4.1.18 | buySellIndicator | 53 |
| 4.1.19 | statementType | 53 |
| 4.1.20 | valorIdentification | 54 |
| 4.1.21 | accountIndicator | 54 |
| 4.1.22 | reversalIndicator | 54 |
| 4.1.23 | fxType | 54 |
| 4.1.24 | valorTypeGroup | 55 |
| 4.1.25 | type | 55 |
| 4.1.26 | otclInstrumentTypeCode | 55 |
| 4.1.27 | otclInstrumentSubtypeCode | 56 |
| 4.1.28 | strikePriceType | 57 |
| 4.1.29 | settlementTypeCode | 57 |
| 4.1.30 | nominalChange | 57 |
| 4.1.31 | InterestType | 57 |
| 4.1.32 | interestDerivatTypeCodeTrading | 57 |
| 4.1.33 | interestDerivatSubtypeCodeTrading | 57 |
| 4.1.34 | dataType | 57 |

1 Einführung

Die Bank bietet mit der Datenlieferung eine Dienstleistung (nachstehend «ZKB Dataset Service») an. Damit kann der Kunde beziehungsweise sein Bevollmächtigter die Bank beauftragen, seine Daten an einen externen Dienstleister oder an sich selbst zu übermitteln. Daten werden einem Drittdienstleister oder Benutzer mittels einer filebasierten und gesicherten Datenlieferung via SFTP-Server («Secure File Transfer Protocol») oder über einen Self-Service Kanal der Bank zur Verfügung gestellt. Use Cases können zum Beispiel die Übermittlung von Bankdaten («Positionen», «Transaktionen» oder «Kontoinformationen») sein.

Die gelieferten Daten unterliegen den beschriebenen Sorgfaltspflichten in den «Nutzungsbedingungen für die Datenlieferung via ZKB Dataset Service».

1.1 Zweck und Inhalt dieser Dokumentation

Diese Dokumentation zum ZKB Dataset Service richtet sich an Personen, die mit der technischen Implementation von Datenlieferungen beauftragt sind. Zudem werden in dieser Dokumentation Details zu den File-Formaten und dem fachlichen Kontext der effektiven Werte erläutert. Sie enthält:

- Technische Beschreibungen von File-Strukturen
- Eine fachliche Beschreibung und Details zu Datenlieferungen
- Details zum Aufbau der File-Strukturen
- Beispiele zu den Datenlieferungen

2 Hinweise ZKB Dataset

2.1 Verfügbarkeit von Daten

2.1.1 Fachliche Ausprägungen von Datenlieferungen

Es können vermögensrelevante Daten zu den Datenarten Transaktionen, Positionen, Stammdaten und Bewertungen bestellt werden. Dabei werden Stammdaten und Bewertungen nur zu Positionen ausgeliefert, die sich effektiv in Kundendepots oder Kundenkonti befinden. Pro Datenart wird je ein File erstellt, welche folgende Vermögensarten umfassen:

Transaktionen:

- Wertschriften
- Devisen und Edelmetall
- Konto und festen Vorschüssen
- Geldmarkt- und Treuhandanlagen
- Hypotheken und Darlehen

Positionen:

- Wertschriften
- Devisen und Edelmetall
- Konten und festen Vorschüssen
- Geldmarkt- und Treuhandanlagen
- Hypotheken und Darlehen

Stammdaten und Bewertungen:

- Wertschriften
- Devisen und Edelmetall
- Geldmarkt- und Treuhandanlagen

2.1.2 Daten pro Buchungstag aufbereitet

Die Daten aus Transaktionen, Positionen, Stammdaten und Bewertungen werden pro Buchungsdatum der Bank aufbereitet. Ein Buchungsschnitt erfolgt um ca. 20:00h. Erfolgt eine Buchung einer Transaktion nach diesem Zeitpunkt, so wird die Transaktion (mit der Auswirkung auf eine entsprechende Position) mit dem nächsten Buchungstag ausgeliefert. Es können nur Daten zu abgeschlossenen Buchungstagen bezogen werden.

Beispiel:

| Abschlusszeitpunkt | Abschlussdatum | Buchungstag | Auslieferung |
|--------------------|----------------|-------------|--------------|
| 16:00h | 20.06.2022 | 20.06.2022 | 21.06.2022 |
| 21:00h | 20.06.2022 | 21.06.2022 | 22.06.2022 |

2.1.2.1 Datumsart Transaktionsdatum

Die Daten aus Transaktionen und Positionen werden pro Transaktionsdatum aufbereitet. Der Zeitraum für das Transaktionsdatum ist von 00:00 bis 23:59, sprich einem Tag gemäss gregorianischem Kalender. Daten können für diese Datumsart bei einer einmaligen Bestellung auch untertags bezogen werden.

2.1.2.2 Datumsart Timestamp

Die Daten aus Transaktionen und Positionen werden für einen, von der Bank festgelegten, Zeitraum aufbereitet. Bei einer periodischen Bestellung ist der Zeitraum immer von 06:00 Uhr des gewählten Tages bis 05:59 Uhr des darauffolgenden Tages. Bei einer einmaligen Bestellung kann der Zeitraum für den Transaktionszeitraum vom selbst Benutzer definiert werden.

2.1.3 Datenverfügbarkeit

Daten werden bis maximal 24 Monate zurück zur Verfügung gestellt.

(Anmerkung: jedoch maximal zurück bis 20.11.2021, da die Daten vorher nicht zur Verfügung stehen)

2.1.4 Einmalige Datenbestellungen

Eine Datenlieferung kann für einen bestimmten Tag oder eine bestimmte Zeitspanne bei der Zürcher Kantonalbank bestellt werden. Wird über eine bestimmte Zeitspanne eine Datenlieferung bestellt, wird für jeden einzelnen abgefragten Buchungstag ein separates File ausgeliefert.

Wird eine Datenbestellung als einmalige Bestellung konfiguriert, so werden die Daten sofort ausgeliefert.

2.1.5 Wiederholende Datenbestellungen

Bestellungen von Daten können als eine wiederholende Datenauslieferung konfiguriert werden. Bei wiederholenden Datenauslieferungen kann zwischen einer täglichen und monatlichen Auslieferung gewählt werden.

Eine als "täglich" konfigurierte Bestellung erfolgt täglich (an Bankwerktagen) und die zugehörigen Files werden ca. um 07:00h zur Verfügung gestellt.

Eine als "monatlich" konfigurierte Bestellung erfolgt monatlich bei Positionen und Transaktionen am ersten Arbeitstag des neuen Monats. Die zugehörigen Files werden ca. um 07:00h zur Verfügung gestellt.

Wird eine Datenbestellung als eine wiederholende Bestellung konfiguriert, so werden die Daten ab dem nächsten Bankwerktag ausgeliefert.

2.1.6 Prüfung der Verfügungsrechte

Vor jeder Datenlieferung im eBanking werden die Rechte eines Datenbezügers auf die Daten geprüft. Entsprechen die zur Verfügung stehenden Rechte nicht der gewünschten Datenbestellung, so wird diese Information am Datenbezüger in der File-Lieferung mitgeteilt (warningList, siehe Kapitel 3.2):

"some accounts or safekeeping accounts are not included in the file because rights are missing to show them"

Hinweis

Daten, die im Namen einer Firma an Einzelpersonen gebunden sind (gebundene Vertreterregelung), müssen von einem Kunden bei der Bank explizit freigeschaltet werden.

2.1.7 Datenlieferung via SFTP-Server («Secure File Transfer Protocol»)

Im Falle eines Filebezugs über einen eigenen autorisierten Server können Sie sich an Ihren persönlichen Kundenbetreuer wenden. Eine Verbindung kann in Zusammenarbeit zwischen technischen Supports Ihrerseits sowie der Zürcher Kantonalbank aufgesetzt werden.

2.1.8 Ex-Brokerage / In-Custody

Es können Daten zu Instrumenten geliefert werden, die bei der Zürcher Kantonalbank verwahrt werden. Sind Instrumente nicht bei der Zürcher Kantonalbank in Verwahrung (ex-Custody), können keine Informationen via ZKB Dataset ausgeliefert werden.

Werden Instrumente über einen anderen Broker gehandelt, aber bei der Zürcher Kantonalbank verwahrt, so können die Daten via ZKB Dataset zur Verfügung gestellt werden.

Bei Wertschriftentransaktionen findet sich bei den Ex-Brokerage Transaktionen ein exBrokerageIndicator (exBrokerageIndicator = 'true'). Dieser Indikator zeigt an, ob es sich um die Abwicklung einer Ex-Brokerage Transaktion handelt. Diese Transaktion dient aber lediglich zur Avisierung / als Information. Die Kontobuchung sowie die Verbuchung der Position im Depot findet erst mit der erfolgreichen Abwicklung des Settlements statt (i.d.R. am Valutatag). Der zugehörige Settlement Order wird ebenfalls mit dem exBrokerageIndicator = 'true' ausgeliefert. Eine Referenzierung der Wertschriftentransaktion zur Abwicklung der Settlement-Transaktion ist über die Identifikation der Position (positionIdentification) gewährleistet.

Eine Ex-Brokerage Transaktion hat Auswirkungen auf das

- Wertschriften-Transaktionsfile (Transaktion)
- Konto- und Darlehen-Positionenfile (Kontoauszug)
- Wertschriften-Positionenfile (Depotbestand)

Gegenüberstellung Ex-Brokerage vs. In-Brokerage

Transaktion

| Verkauf Wertschriften von Stk. 100 über CHF 10'000.00 Ex-Brokerage | Verkauf Wertschriften von Stk. 200 über CHF 20'000.00 In-Brokerage |
|--|---|
| transactionList transaction statement statementType transactionIdentification bookingDate 2023-03-01 valueDate 2023-03-03 transactionDate 2023-03-01 exBrokerageIndicator true brokerName xy brokerIdentification 123456 transactionType securitiesExchange transactionSubtype sell ... netAmountInMaccCurrency 10000 netAmountCreditDebitIndicator credit ... bookings bookingSecurityList bookingSecurity inOutIndicator out quantity 100 | transactionList transaction statement statementType transactionIdentification bookingDate 2023-03-01 valueDate 2023-03-03 transactionDate 2023-03-01 exBrokerageIndicator false brokerName brokerIdentification transactionType securitiesExchange transactionSubtype sell ... netAmountInMaccCurrency 20000 netAmountCreditDebitIndicator credit ... bookings bookingSecurityList bookingSecurity inOutIndicator out quantity 200 |

| Settlement Wertschriften von Stk. 100 über CHF 10'000.00 Ex-Brokerage | Settlement Wertschriften von Stk. 100 über CHF 10'000.00 Ex-Brokerage | Settlement Wertschriften von Stk. 200 über CHF 20'000.00 In-Brokerage |
|---|--|---|
| transactionList transaction statement statementType transactionIdentification bookingDate 2023-03-03 valueDate 2023-03-03 transactionDate 2023-03-01 exBrokerageIndicator true brokerName brokerIdentification transactionType securitiesTransfer transactionSubtype deliveryVsPayment ... netAmountInMaccCurrency 10000 netAmountCreditDebitIndicator debit ... bookings bookingSecurityList bookingSecurity inOutIndicator in quantity 100 | transactionList transaction statement statementType transactionIdentification bookingDate 2023-03-03 valueDate 2023-03-03 transactionDate 2023-03-01 exBrokerageIndicator false brokerName brokerIdentification transactionType securitiesTransfer transactionSubtype deliveryVsPayment ... netAmountInMaccCurrency 10000 netAmountCreditDebitIndicator credit ... bookings bookingSecurityList bookingSecurity inOutIndicator out quantity 100 | transactionList transaction statement statementType transactionIdentification bookingDate 2023-03-03 valueDate 2023-03-03 transactionDate 2023-03-01 exBrokerageIndicator true brokerName brokerIdentification transactionType securitiesTransfer transactionSubtype deliveryVsPayment ... netAmountInMaccCurrency 20000 netAmountCreditDebitIndicator credit ... bookings bookingSecurityList bookingSecurity inOutIndicator out quantity 100 |

Kontoauszug

| Kontoauszug am 01.03.2023 Ex-Brokerage | Kontoauszug am 03.03.2023 In-Brokerage |
|--|--|
| positionList position positionAccount balance 20000 balanceCreditDebitIndicator credit balanceInclUnbookedTransactions 30000 balanceInclUnbookedTransactionsCreditDebitIndicator credit pendingExBrokerageAmount 10000 pendingExBrokerageAmountCreditDebitIndicator credit | positionList position positionAccount balance 30000 balanceCreditDebitIndicator credit balanceInclUnbookedTransactions 30000 balanceInclUnbookedTransactionsCreditDebitIndicator credit pendingExBrokerageAmount 0 pendingExBrokerageAmountCreditDebitIndicator credit |

Depotbestand

| Depotbestand am 01.03.2023 Ex-Brokerage | Depotbestand am 03.03.2023 In-Brokerage |
|---|---|
| positionList position positionSecurity aggregatedQuantity 300 aggregatedQuantityCreditDebitIndicator credit bookedQuantity 200 bookedQuantityCreditDebitIndicator credit pendingExBrokerageQuantity 100 pendingExBrokerageCreditDebitIndicator credit | positionList position positionSecurity aggregatedQuantity 300 aggregatedQuantityCreditDebitIndicator credit bookedQuantity 300 bookedQuantityCreditDebitIndicator credit pendingExBrokerageQuantity 0 pendingExBrokerageCreditDebitIndicator credit |

Die Daten können von den restlichen übermittelten Bankdaten wie beispielsweise des Anlagereports abweichen (Beispiel: Valuta vs. Trading Sicht).

2.2 Fachliche Erklärungen

2.2.1 Berechnungsbeispiel Wertschriftenkauf

Um zu veranschaulichen, wie Transaktionen abgerechnet werden, folgt hier ein Beispiel zu einem Wertschriftenkauf:

Beispiel Abrechnung:

Kauf 100 Stk. AAPL

Abrechnung

| | | |
|---------------------------------|-----|-----------|
| Betrag Börsenkauf | USD | 15'001.00 |
| Courtage Aktien | USD | 111.29 |
| Börsengebühr | USD | 2.82 |
| Eidg. Umsatzabgabe | USD | 23.98 |
| Abrechnungstotal | USD | 15'139.09 |
| Nettobetrag (Kurs USD/CHF 0.97) | CHF | 14'684.90 |

Ein Beispiel zu der Darstellung in einem File ist unter [3.1.2](#) zu finden.

2.2.2 Berechnungsbeispiel für Kurse (Währungen mit Standard 100 zu Währungen mit Standard 1)

Sämtliche Umrechnungskurse von Währungen werden mit der Notation 1 zu X angegeben. Währungen, für welche der Kurs typischerweise für 100 Stück angegeben wird (bsp. SEK, JPY, DKK), werden auch 1 zu X angegeben.

Beispiel:

Ein Kunde verkauft ein Instrument in JPY und schreibt den Gegenwert seinem CHF Konto gut.

Der ausgewiesene Wechselkurs in der Filelieferung bezieht sich auf 1 JPY zu x CHF. Folgender Kurs wird geliefert: 0.0071

2.2.3 Erläuterung transactionSubtype Optionen und Futures

Folgende Fälle beschreiben, wann welcher transactionSubtype im Zusammenhang mit Optionen und Futures genutzt wird:

BuyToOpen: Es wird eine Longposition eingegangen.

SellToClose: Es wird eine Longposition glattgestellt.

SellToOpen: Es wird eine Shortposition eingegangen.

BuyToClose: Es wird eine Shortposition glattgestellt.

2.2.4 Depotarten innerhalb der Zürcher Kantonalbank

Die Zürcher Kantonalbank verwendet den Begriff Depot oder Container im Sinnen eines Verwahrungs-Gefässes. In einem Depot oder Container werden sämtliche Titel, Kontrakte, etc. verwahrt. Die Depots oder Container unterscheiden sich in der Art des zu verwahrenden Instruments und der Identifizierungsnummern. Folgende Tabelle weist aus, in welchen Depots oder Containern, welche Instrumente verwahrt werden:

| Produktbezeichnung | Instrumentenbeispiele | Beispiel Nummer |
|---------------------------------|--|------------------------|
| Geldmarkt- und Devisengeschäfte | FX-Spot, Money Market Call | 1-77**-***** |
| Wertschriftendepot | Aktien, Obligationen, Optionen und Futures | 1-26**-***** |

3 Spezifikation der Datenlieferungen im Native Format

3.1 Allgemeine Informationen

3.1.1 Mögliche Werte eines Attributs

Sind in einem Attribut die Werte eingeschränkt, sind diese in den fachlichen Spezifikationen gekennzeichnet. Die möglichen Werte sind unter Kapitel 4 beschrieben.

3.1.2 List Attribute

Attribute, welche sich unter einem Element mit dem Zusatz "List" befinden, können im Schema mehrmals aufgelistet werden. Für jedes einzelne Buchungselement einer Transaktion wird eine separate List erstellt. Beispielsweise können so bei einer Börsenabrechnung die verschiedenen Bestandteile wie zum Beispiel Börsengebühren oder Quellensteuer getrennt ausgewiesen werden.

Beispiel:

| Kauf | Courtage Aktien | Börsengebühr | Eidg. Umsatzabgabe | Nettobetrag |
|-------------|------------------------|---------------------|---------------------------|--------------------|
| 100 AAPL | USD 111.29 | USD 2.82 | USD 23.98 | USD 15'139.09 |

transactionList

transaction

statement

grossAmountInReferenceCurrency 15001
netAmountInReferenceCurrency 15139.09
netAmountInMaccCurrency 14684.90
netAmountCreditDebitIndicator debit
fxRateReferenceCurrencyToMaccCurrency 0.97

bookings

bookingSecurityList

bookingSecurity

bookingType security

inOutIndicator in

quantity 100

unitOfQuantity

positionCurrency USD

valorIdentification

valorIdentification US0378331005

bookingCashList

bookingCash

bookingType courtage

amount 111.29

currency USD

creditDebitIndicator debit

bookingCash

bookingType stampDuty

amount 23.98

currency USD

creditDebitIndicator debit

bookingCash

bookingType exChangeFee

amount 2.82

currency USD

creditDebitIndicator debit

Ausnahme:

Bei FX und Money Market Transaktionen werden für die einzelnen Buchungselemente nicht in einer List dargestellt, sondern als einzelne Attribute im Schema aufgelistet.

3.1.3 Darstellung von Betragswerten

Sämtliche Beträge, welche innerhalb einer Filestruktur ausgewiesen sind, werden als absoluter Wert geliefert. Zu jedem Betrag wird ein CreditDebitIndicator (Soll- / Haben-Code) geliefert, welcher ausweist, ob es sich um eine Gutschrift oder Belastung auf dem Kundenkonto oder -Depot handelt.

3.1.4 Statement, Reversal und Rektifikat

Eine Transaktion wird als Neugeschäft, Storno oder Rektifikat gekennzeichnet (statementType statement, reversal, rectificat). Wird eine Transaktion storniert, wird diese als eigener Record geliefert. Dieser Record wird mit statementType "reversal" gekennzeichnet. Ein Storno / Reversal wird mit den gleichen Betragsvorzeichen sowie einer Referenzierung auf den Originalrecord geliefert.

3.1.5 Deklaration der Transaktionsarten und Transaktionstypen

Die Transaktionsart (beispielsweise fx, securitiesExchange) einer Transaktion beschreibt die Produktgruppe, der Transaktionstyp definiert den genauen Vorgang (beispielsweise fxSpot, buy).

3.1.6 Definition von standardmässig gelieferten Attributen

Attribute, welche in einem Datenfile immer geliefert werden, sind in den Filestrukturen (Kapitel 3.2) mit x in der Spalte M (mandatory) markiert.

3.2 Fachliche Definition allgemeiner Teil

Der allgemeine Teil ist jeweils zuoberst in jedem File zu finden. Im allgemeinen Teil findet man Informationen zu etwaigen Rechtekonflikten oder Fehlern, zudem sind die Bestellungsparameter und die ID des Files darin enthalten. Auf den allgemeinen Teil folgen dann die individuellen Teile zu Transaktionen, Positionen, Stammdaten und Bewertungen.

| Feldname / Attribut | M | Datatype | Defintion | Option / Beispiel |
|-------------------------|---|----------|---|---|
| zkbDatasetNative | | | | |
| header | | | | |
| orderParameter | | | | |
| name | x | string | Name der Bestellung (gemäss Bestellungskonfiguration) | Beispielwert: "Bestellung ZKB Dataset" |
| dataType | x | string | Datenfile-Art (gemäss Bestellungskonfiguration) | Siehe 4.1.34 |
| dateType | x | string | Datumsart der Bestellung (gemäss Bestellungskonfiguration) | Beispielwert: "bookingDate" |
| fromDate | x | date | Startdatum des Datenbezugs (ISO 8601) | Beispielwert: "2022-03-01" |
| toDate | x | date | Enddatum des Datenbezugs (ISO 8601) | Beispielwert: "2022-03-01" |
| deliveryInstruction | x | string | Bereitstellungsort der Bestellung (gemäss Bestellungskonfiguration) | Beispielwert: "eBanking and authorized server" |
| periodicity | x | string | Periodizität der Bestellung (gemäss Bestellungskonfiguration) | Beispielwert: "daily" |
| fileId | x | integer | File-ID | Beispielwert: "89461" |
| zkbId | x | string | Technische ID ZKB | Beispielwert: "be624188-641c-4e25-975b-cdec4c16f0c9" |
| createdAt | x | string | Zeitpunkt der Generierung | Beispielwert: "2022-09-15T02:36:38" |
| downloadedAt | x | string | Zeitpunkt des Downloads | Beispielwert: "2022-09-15T02:36:39" |
| warningList | | | | |
| warning | | string | Auflistung von Warnungen | Beispiel: "some accounts or safekeeping accounts are not included in the file because rights are missing to show them" |
| errorList | | | | |
| error | | string | Auflistung von Fehlern | Beispielwert: "The server encountered an unexpected condition that prevented it from fulfilling the request." |

3.3 Transaktionen

3.3.1 Wertschriften

3.3.1.1 Fachliche Beschreibung

Bereitstellung von Transaktionsdaten zu Wertschriftentransaktionen

| Feldname / Attribut | M | Data type | Defintion | Option / Beispiel |
|-----------------------------------|---|-----------|---|--|
| transactionList | | | | |
| transaction | | | | |
| statement | | | | |
| statementType | x | string | Abrechnungstyp | Siehe 4.1.19 |
| transactionIdentification | x | string | Identifikationsnummer der Transaktion | Beispielwert: "WS_123456789" |
| reversedTransactionIdentification | | string | Identifikationsnummer der ursprünglichen Transaktion, im Falle eines Stornos | Beispielwert: "WS_123456789S" |
| bookingDate | x | date | Buchungsdatum (ISO 8601) | Beispielwert: "2022-01-08" |
| valueDate | x | date | Valutadatum (ISO 8601) | Beispielwert: "2022-01-08" |
| transactionDate | x | date | Transaktionsdatum (ISO 8601) | Beispielwert: "2022-01-08" |
| exBrokerageIndicator | | string | Ex-Brokerage Indikator Zeigt an, wenn es sich um eine Ex-Brokerage Transaktion handelt | Beispielwert: "true" |
| brokerName | | string | Name des fremden Brokers bei einer Ex-Brokerage Transaktion | Beispielwert: "Jefferies & Co. Jersey City" |
| brokerIdentification | | string | eindeutige Identifikationsnummer des fremden Brokers bei einer Ex-Brokerage Transaktion | Beispielwert: "123456" |
| transactionType | | string | Die Transaktionsart beschreibt die Art der Transaktion | Siehe 4.1.16 |
| transactionSubtype | | string | erweitert die Transaktionsart | Siehe 4.1.17 |
| clientIdentification | | string | Eindeutige Identifikationsnummer des Partners (Besitzer des Geschäfts) | Beispielwert: "1.234.567-8" |
| portfolioIdentification | | string | Identifikationsnummer des Anlageportfolios | Beispielwert: "9470012345678" |
| portfolioReferenceCurrency | | string | Referenzwährung des Anlageportfolios | Beispielwert: "CHF" |
| identificationSafeKeepingAccount | | string | Wertschriftendepot-Nummer Die Wertschriftendepot-Nummer wird ohne Bindestriche abgefüllt. Im gewohnten Format sieht sie wie folgt aus: 1-2600-12345678 | Beispielwert: "1260012345678" |
| descriptionSafeKeepingAccount | | string | Rubrik des Wertschriftendepots | Beispielwert: "Vermögensverwaltung" |
| macIdentification | | string | Kontonummer / IBAN | Beispielwert: "CH6500700123456789101" |
| descriptionMacc | | string | Rubrik des Abrechnungskontos | Beispielwert: "Steuern" |
| maccCurrency | | string | Kontowährung (ISO 4217) | Beispielwert: "CHF" |
| tradingCurrency | | string | Handelswährung (ISO 4217) | Beispielwert: "CHF" |

| Feldname / Attribut | M | Data type | Defintion | Option / Beispiel |
|--|---|-----------|---|--|
| referenceCurrency | | string | Referenzwahrung (ISO 4217) | Beispielwert: "CHF" |
| grossAmountInTradingCurrency | | decimal | Brutto Handelsbetrag in Handelswahrung | Beispielwert: "10000.55" |
| grossAmountInReferenceCurrency | | decimal | Brutto Handelsbetrag in Referenzwahrung | Beispielwert: "10000.55" |
| netAmountInReferenceCurrency | | decimal | Netto Abrechnungsbetrag in Referenzwahrung | Beispielwert: "10000.55" |
| netAmountInMaccCurrency | | decimal | Netto Abrechnungsbetrag in Kontowahrung | Beispielwert: "10000.55" |
| netAmountCreditDebitIndicator | | string | Soll- und Haben-Indikator | Siehe 4.1.9 |
| fxRateTradingCurrencyToReferenceCurrency | | decimal | Devisenkurs der Handelswahrung zur Referenzwahrung | Beispielwert: "5.1234" |
| fxRateReferenceCurrencyToMaccCurrency | | decimal | Devisenkurs der Referenzwahrung zur Kontowahrung | Beispielwert: "0.722037" |
| corporateActionDetail | | | In dieser Auflistung werden mehr Details zu der eigentlichen Verwaltungshandlung gegeben Je nach Typ werden unterschiedliche Felder angezeigt | |
| priceRate | | decimal | Der Preis entspricht einem Bezugspreis, Dividendenpreis etc. der Satz z.B. einem Zinssatz etc. | Beispielwert: "100%" |
| priceType | | string | Art des Preises | Siehe 4.1.2 |
| currency | | string | Wahrung der Verwaltungshandlung (ISO 4217) | Beispielwert: "CHF" |
| newSecurityList | | | | |
| newSecurity | | | | |
| valorIdentification | | | In den folgenden Attributen wird der neue Titel identifiziert | |
| valorIdentification | | string | Valorennummer mit fuhrenden Nullen | Siehe 4.1.20 |
| valorsin | | string | ISIN des Valors | Beispielwert: "CH0238627142" |
| valorTextShort | | string | Text kurz des Valors auf 20 Zeichen beschrankt | Beispielwert: "Bossard Hldg N" |
| valorTextLong | | string | Text lang des Valors | Beispielwert: "Namen-Akt Bossard Holding AG" |
| ratioOld | | decimal | Gibt das Verhaltnis des alten Titels an | Beispielwert: "1" |
| ratioNew | | decimal | Gibt das Verhaltnis des neuen Titels an | Beispielwert: "3" |
| mktplace | | | | |
| mktplaceCode | | string | Borsenplatz Telekurs-Code | Beispielwert: "4" |
| mktplaceIsoCode | | string | Borsenplatz ISO-Code (ISO 10383) | Beispielwert: "XSWX" |
| mktplaceNameShort | | string | Borsenplatz Name kurz | Beispielwert: "SIX Swiss Excha" |
| mktplaceNameLong | | string | Borsenplatz Name lang | Beispielwert: "SIX Swiss Exchange" |
| averagePriceInTradingCurrency | | decimal | Durchschnittspreis in Handelswahrung | Beispielwert: "1241.99" |
| averagePriceType | | string | Art des Preises | Siehe 4.1.2 |
| marketValueInReferenceCurrency | | decimal | Kurswert in Referenzwahrung | Beispielwert: "68242.28" |

| Feldname / Attribut | M | Data type | Defintion | Option / Beispiel |
|--------------------------------------|---|-----------|--|---|
| accruedInterestInReferenceCurrency | | decimal | Marchzins in Referenzwahrung | Beispielwert: "1241.99" |
| triggeringValorIdentification | | | In den folgenden Attributen wird der auslosende Valor einer Corporate Action identifiziert | |
| valorIdentification | | string | Valorennummer mit fuhrenden Nullen | Siehe 4.1.20 |
| valorIdentificationTelekurs | | string | SIX Valorennummer | Beispielwert: "23862714" |
| valorTickerTelekurs | | string | Ticker Telekurs des Valors | Beispielwert: "BOSN" |
| valorsin | | string | ISIN des Valors | Beispielwert: "CH0238627142" |
| valorTextShort | | string | Text kurz des Valors auf 20 Zeichen beschrankt | Beispielwert: "Bossard Hldg N" |
| valorTextLong | | string | Text lang des Valors | Beispielwert: "Namen-Akt Bossard Holding AG" |
| valorTypeGroup | | string | Titelart-Gruppe des Valors | Siehe 4.1.24 |
| valorTypeTelekurs | | string | Titelart-Telekurs des Valors | Siehe 4.1.15 |
| transactionAdditionalDetails | | string | Abrechnungstext zu Lieferspesen | Freitext bis 600 Zeichen Beispielwert: "Externe Referenz 5284532742" |
| bookings | | | | |
| bookingSecurityList | | | | |
| bookingSecurity | | | | |
| identificationSafeKeepingAccount | x | string | Wertschriftendepot-Nummer Die Wertschriftendepot-Nummer wird ohne Bindestriche abgefullt. Im gewohnten Format sieht sie wie folgt aus: 1-2600-12345678 | Beispielwert: "1260012345678" |
| bookingIdentification | x | string | Identifikationsnummer der Titelbuchung | Beispielwert: "WS_123456789_3" |
| reversalIndicator | x | boolean | Storno-Indikator | Siehe 0 |
| positionIdentification | | string | Identifikationsnummer der Position | Beispielwert: "WS_12346578" |
| referenceToReversedBooking | | string | Identifikationsnummer der ursprunglichen Buchung, im Falle eines Stornos | Beispielwert: "WS_123456789_4" |
| bookingType | x | string | Buchungstyp | Siehe 4.1.3 |
| inOutIndicator | x | string | Eingang- und Ausgang-Indikator fur die Wertschriften im Depot | Siehe 4.1.10 |
| quantity | x | decimal | Menge | Beispielwert: "400000" |
| unitOfQuantity | x | string | Art der Menge | Siehe 4.1.1 |
| positionCurrency | x | string | Positionswahrung (ISO 4217) | Beispielwert: "CHF" |
| valorIdentification | | | | |
| valorIdentification | x | string | Valorennummer mit fuhrenden Nullen | Siehe 4.1.20 |
| valorIdentificationTelekurs | | string | SIX Valorennummer | Beispielwert: "23862714" |
| valorTickerTelekurs | | string | Ticker Telekurs des Valors | Beispielwert: "BOSN" |
| valorsin | | string | ISIN des Valors | Beispielwert: "CH0238627142" |

| Feldname / Attribut | M | Data type | Defintion | Option / Beispiel |
|--|---|-----------|--|---|
| valorTextShort | x | string | Text kurz des Valors auf 20 Zeichen beschränkt | Beispielwert: "Bossard Hldg N" |
| valorTextLong | x | string | Text lang des Valors | Beispielwert: "Namen-Akt Bossard Holding AG" |
| valorTypeGroup | x | string | Titelart-Gruppe des Valors | Siehe 4.1.24 |
| valorTypeTelekurs | | string | Titelart-Telekurs des Valors | Siehe 4.1.15 |
| transactionPriceInPositionCurrency | | decimal | Transaktionspreis in Positionswährung | Beispielwert: "1241.99" |
| transactionPriceType | | string | Art des Preises | Siehe 4.1.2 |
| fundsReferenceCurrency | | string | Fonds-Referenzwährung (ISO 4217) | Beispielwert: "EUR" |
| fxRatePositionCurrencyToFundsReferenceCurrency | | decimal | Devisenkurs der Positionswährung zur Fonds-Referenzwährung | Beispielwert: "0.722037" |
| bookingCashList | | | | |
| bookingCash | | | | |
| bookingType | x | string | Buchungstyp | Siehe 4.1.3 |
| macIdentification | | string | Kontonummer / IBAN | Beispielwert: "CH6500700123456789101" |
| amount | x | decimal | Abrechnungsbetrag | Beispielwert: "25876.12" |
| currency | | string | Referenzwährung (ISO 4217) | Beispielwert: "USD" |
| creditDebitIndicator | x | string | Soll- und Haben-Indikator | Siehe 4.1.9 |

3.3.2 Devisen und Edelmetall

3.3.2.1 Fachliche Beschreibung

Bereitstellung von Transaktionsdaten zu Devisen- und Edelmetalltransaktionen.

| Feldname / Attribut | M | Data type | Defintion | Option / Beispiel |
|-----------------------------------|---|-----------|---|---|
| transactionList | | | | |
| transaction | | | | |
| statement | | | | |
| statementType | x | string | Abrechnungstyp | Siehe 4.1.19 |
| transactionIdentification | x | string | Identifikationsnummer der Transaktion | Beispielwert: "WS_123456789" |
| reversedTransactionIdentification | | string | Identifikationsnummer der ursprünglichen Transaktion, im Falle eines Stornos | Beispielwert: "WS_123456789S" |
| bookingDate | x | date | Buchungsdatum (ISO 8601) | Beispielwert: "2022-01-08" |
| valueDate | x | date | Valutadatum (ISO 8601) | Beispielwert: "2022-01-08" |
| transactionDate | x | date | Transaktionsdatum (ISO 8601) | Beispielwert: "2022-01-08" |
| transactionType | x | string | Die Transaktionsart beschreibt die Art des Auftrags | Siehe 4.1.16 |
| transactionSubtype | x | string | erweitert die Transaktionsart | Siehe 4.1.17 |
| clientIdentification | | string | Eindeutige Identifikationsnummer des Partners (Besitzer des Geschäfts) | Beispielwert: "1.234.567-8" |
| portfolioidentification | | string | Identifikationsnummer des Anlageportfolios | Beispielwert: "9470012345678" |
| portfolioReferenceCurrency | | string | Referenzwährung des Anlageportfolios | Beispielwert: "CHF" |
| identificationSafeKeepingAccount | | string | Nummer des Geldmarkt- und Devisendepots Die Nummer des Geldmarkt- und Devisendepots wird ohne Bindestriche abgefüllt. Im gewohnten Format sieht sie wie folgt aus: 1-7700-12345678 | Beispielwert: "1770012345678" |
| descriptionSafeKeepingAccount | | string | Rubrik des Wertschriftendepots | Beispielwert: "Vermögensverwaltung" |
| macIdentificationBuy | | string | Kontonummer / IBAN des Kauf Kontos | Beispielwert: "CH6500700123456789101" |
| macDescriptionBuy | | string | Rubrik des Kauf Kontos | Beispielwert: "Anlegen" |
| macIdentificationSell | | string | Kontonummer / IBAN des Verkauf Kontos | Beispielwert: "CH6500700123456789101" |
| macDescriptionSell | | string | Rubrik des Verkauf Kontos | Beispielwert: "Anlegen" |
| positionIdentification | | string | Identifikationsnummer der Position | Beispielwert: "WS_12346578" |
| fxType | | string | Art des FX Kontrakts | Siehe 4.1.23 |
| instrumentName | | string | Name des Instruments | Beispielwert: "FX Forward - EUR/USD, 06.09.2021" |
| instrumentIdentification | | string | Kontraktidentifikationsnummer | Beispielwert: "131778719" |
| nominalCurrency | | string | Nominalwährung / gehandelte Währung (ISO 4217) | Beispielwert: "EUR" |

| Feldname / Attribut | M | Data type | Defintion | Option / Beispiel |
|--|---|-----------|---|---------------------------------|
| buySellIndicator | | string | Kauf- und Verkauf-Indikator der Nominalwährung | Siehe 4.1.18 |
| buyAmount | | decimal | Kaufbetrag (aus Kundensicht) | Beispielwert: "7126584" |
| buyCurrency | | string | Währung des Kaufbetrags (aus Kundensicht) (ISO 4217) | Beispielwert: "USD" |
| sellAmount | | decimal | Verkauf Betrag (aus Kundensicht) | Beispielwert: "6000000" |
| sellCurrency | | string | Währung des Verkauf Betrags (aus Kundensicht) (ISO 4217) | Beispielwert: "EUR" |
| fxRateNominalCurrencyToCounterCurrency | | decimal | Devisenkurs von einer Einheit der gehandelten Währung zu Gegenwährung | Beispielwert: "1.187764" |
| fxRateTraded | | decimal | Effektiv gehandelter Devisenkurs | Beispielwert: "0.841918" |
| swapReference | | string | Gemeinsame Referenz der FX Swap Legs | Beispielwert: "FXSW.4591277" |
| ndfFixingCurrency | | string | Fixing-Währung eines NDF-Geschäfts (ISO 4217) | Beispielwert: "USD" |
| ndfFixingDate | | date | Fixing-Datum eines NDF-Geschäfts (ISO 8601) | Beispielwert: "2022-03-12" |
| ndfFixingFxRateSource1 | | string | Quelle des Fixing-Kurses 1 | Beispielwert: "BRL09" |
| ndfFixingFxRateSource2 | | string | Quelle des Fixing-Kurses 2 | Beispielwert: "WMR16" |
| ndfFixingFxRate | | decimal | Fixierter Devisenkurs am Fixing-Datum zwischen der Fixing-Währung und der nicht lieferbaren zweiten Währung | Beispielwert: "1.187764" |
| ndfFixingAmount | | decimal | Fixingbetrag in NDF Fixingwährung | Beispielwert: "6000000" |
| ndfFixingAmountCreditDebitIndicator | | string | Soll- und Haben-Indikator | Siehe 4.1.9 |

3.3.3 Konto und Feste Vorschüsse

3.3.3.1 Fachliche Beschreibung

Bereitstellung von Transaktionsdaten zu Kontotransaktionen, darin enthalten sind auch die festen Vorschüsse.

| Feldname / Attribut | M | Data type | Defintion | Option / Beispiel |
|---------------------------------------|---|-----------|--|--|
| transactionList | | | | |
| transaction | | | | |
| statement | | | | |
| statementType | x | string | Abrechnungstyp | Siehe 4.1.19 |
| transactionIdentification | x | string | Identifikationsnummer der Transaktion | Beispielwert: "WS_123456789" |
| reversedTransactionIdentification | | string | Identifikationsnummer der ursprünglichen Transaktion, im Falle eines Stornos | Beispielwert: "WS_123456789S" |
| bookingDate | x | date | Buchungsdatum (ISO 8601) | Beispielwert: "2022-01-08" |
| valueDate | x | date | Valutadatum (ISO 8601) | Beispielwert: "2022-01-08" |
| transactionDate | x | date | Transaktionsdatum (ISO 8601) | Beispielwert: "2022-01-08" |
| transactionType | | string | Die Transaktionsart beschreibt die Art des Auftrags | Siehe 4.1.16 |
| transactionSubtype | | string | erweitert die Transaktionsart | Siehe 4.1.17 |
| clientIdentification | | string | Eindeutige Identifikationsnummer des Partners (Besitzer des Geschäfts) | Beispielwert: "1.234.567-8" |
| portfolioidentification | | string | Identifikationsnummer des Anlageportfolios | Beispielwert: "9470012345678" |
| portfolioReferenceCurrency | | string | Referenzwährung des Anlageportfolios | Beispielwert: "CHF" |
| bookingType | | string | Buchungstyp | Siehe 4.1.3 |
| accountIdentification | x | string | Kontonummer / IBAN | Beispielwert: "CH6500700123456789101" |
| descriptionAccount | | string | Rubrik des Kontos | Beispielwert: "Zahlungen" |
| maccCurrency | x | string | Kontowährung (ISO 4217) | Beispielwert: "CHF" |
| referenceCurrency | | string | Vergütungswährung (ISO 4217) | Beispielwert: "CHF" |
| amountInMaccCurrency | x | decimal | Vergütungsbetrag in Kontowährung | Beispielwert; "3047.85" |
| creditDebitIndicator | x | string | Soll- und Haben-Indikator | Siehe 4.1.9 |
| fxRateReferenceCurrencyToMaccCurrency | | decimal | ZKB Umrechnungskurs per Rekapdatum zwischen der "referenceCurrency" und "maccCurrency" | Beispielwert: "1.07465" |
| amountInReferenceCurrency | | decimal | Vergütungsbetrag in Vergütungswährung | Beispielwert: "3047.85" |
| metalAccountIndicator | x | boolean | Indikator, ob es sich um ein Metall-Konto handelt | Siehe 4.1.21 |
| loanAccountIndicator | x | boolean | Indikator, ob es sich um ein Fester Vorschuss-Konto handelt | Siehe 4.1.21 |
| transactionAdditionalDetails | | string | Vertriebstext Mobile | Beispielwert: "Withholding tax" |
| bookingDetailList | | | | |
| bookingDetail | | | | |

| Feldname / Attribut | M | Data type | Defintion | Option / Beispiel |
|------------------------------|---|-----------|--|---|
| zvIdentification | x | string | interne Identifikationsnummer des Teilauftrags | Beispielwert: "AM210906A3336565" |
| amountInReferenceCurrency | x | decimal | Betrag des Teilauftrags | Beispielwert: "750.35" |
| referenceCurrency | x | string | Vergütungswährung (ISO 4217) | Beispielwert: "CHF" |
| transactionAdditionalDetails | | string | Vertriebstext Detail | Beispielwert: "Max Muster, Musterstrasse 1, 8001 Zürich" |

3.3.4 Geldmarkt- und Treuhandanlagen

3.3.4.1 Fachliche Beschreibung

Bereitstellung von Transaktionsdaten zu Geldmarkt- und Treuhandanlagen-Transaktionen.

| Feldname / Attribut | M | Data type | Defintion | Option / Beispiel |
|-----------------------------------|---|-----------|---|--|
| transactionList | | | | |
| transaction | | | | |
| statement | | | | |
| statementType | x | string | Abrechnungstyp | Siehe 4.1.19 |
| transactionIdentification | x | string | Identifikationsnummer der Transaktion | Beispielwert: "WS_123456789" |
| reversedTransactionIdentification | | string | Identifikationsnummer der ursprünglichen Transaktion, im Falle eines Stornos | Beispielwert: "WS_123456789S" |
| bookingDate | x | date | Buchungsdatum (ISO 8601) | Beispielwert: "2022-01-08" |
| valueDate | x | date | Valutadatum (ISO 8601) | Beispielwert: "2022-01-08" |
| transactionDate | x | date | Transaktionsdatum (ISO 8601) | Beispielwert: "2022-01-08" |
| transactionType | x | string | Die Transaktionsart beschreibt die Art des Auftrags | Siehe 4.1.16 |
| transactionSubtype | x | string | erweitert die Transaktionsart | Siehe 4.1.17 |
| moneymarketType | x | string | Art des Geldmarkt Kontrakts | Siehe 4.1.12 |
| clientIdentification | | string | Eindeutige Identifikationsnummer des Partners (Besitzer des Geschäfts) | Beispielwert: "1.234.567-8" |
| portfolioidentification | | string | Identifikationsnummer des Anlageportfolios | Beispielwert: "9470012345678" |
| portfolioReferenceCurrency | | string | Referenzwährung des Anlageportfolios | Beispielwert: "CHF" |
| identificationSafeKeepingAccount | | string | Nummer des Geldmarkt- und Devisendepots. Die Nummer des Geldmarkt- und Devisendepots wird ohne Bindestriche abgefüllt. Format: 1-7700-12345678 | Beispielwert: "1770012345678" |
| maccdentification | | string | Kontonummer / IBAN | Beispielwert: "CH6500700123456789101" |
| descriptionMacc | | string | Rubrik des Kontos | Beispielwert: "Zahlungen" |
| financialInstrumentName | | string | Name des Instruments | Beispielwert: "Fiduciary Time USD, 1.33%, 13.09.2021-15.09.2021, RABONL2UXXX" |
| financialInstrumentIdentification | | string | Kontraktidentifikationsnummer | Beispielwert: "131778740" |
| positionIdentification | | string | Identifikationsnummer der Position | Beispielwert: "WS_12345678" |
| netAmountCreditDebitIndicator | | string | Soll- und Haben-Indikator des Netto Abrechnungsbetrags | Siehe 4.1.9 |
| currency | | string | Referenzwährung (ISO 4217) | Beispielwert: "CHF" |
| amount | | decimal | Abrechnungsbetrag | Beispielwert: "1000000" |
| amountCreditDebitIndicator | | string | Soll- und Haben-Indikator des Abrechnungsbetrags | Siehe 4.1.9 |

| Feldname / Attribut | M | Data type | Defintion | Option / Beispiel |
|------------------------------------|---|-----------|--|-----------------------------|
| interestAmount | | decimal | Bruttobetrag der abgerechneten Zinsen | Beispielwert: "50024.65" |
| interestAmountCreditDebitIndicator | | string | Soll- und Haben-Indikator des Bruttobetrags der abgerechneten Zinsen | Siehe 4.1.9 |
| withholdingTaxOnInterestAmount | | decimal | Betrag der Verrechnungssteuer bei einem Geldmarktgeschäft | Beispielwert: "18006.80" |
| commission | | decimal | Betrag der Kommission auf Treuhandanlagen | Beispielwert: "10000" |
| vatOnCommission | | decimal | Betrag der Mehrwertsteuer auf einer Treuhandanlagen-Kommission | Beispielwert: "860.00" |
| netAmount | | decimal | Netto Abrechnungsbetrag | Beispielwert: "3000000" |

3.3.5 Hypotheken und Darlehen

3.3.5.1 Fachliche Beschreibung

Bereitstellung von Transaktionsdaten zu Hypotheken- und Darlehen-Transaktionen.

| Feldname / Attribut | M | Data type | Defintion | Option / Beispiel |
|-----------------------------------|---|-----------|--|--|
| transactionList | | | | |
| transaction | | | | |
| statement | | | | |
| statementType | x | string | Abrechnungstyp | Siehe 4.1.19 |
| transactionIdentification | x | string | Identifikationsnummer der Transaktion | Beispielwert: "WS_123456789" |
| reversedTransactionIdentification | | string | Identifikationsnummer der ursprünglichen Transaktion, im Falle eines Stornos | Beispielwert: "WS_123456789S" |
| bookingDate | x | date | Buchungsdatum (ISO 8601) | Beispielwert: "2022-01-08" |
| valueDate | x | date | Valutadatum (ISO 8601) | Beispielwert: "2022-01-08" |
| transactionDate | x | date | Transaktionsdatum (ISO 8601) | Beispielwert: "2022-01-08" |
| transactionType | x | string | Die Transaktionsart beschreibt die Art des Auftrags | Siehe 4.1.16 |
| transactionSubtype | x | string | erweitert die Transaktionsart | Siehe 4.1.17 |
| clientIdentification | | string | Eindeutige Identifikationsnummer des Partners (Besitzer des Geschäfts) | Beispielwert: "1.234.567-8" |
| portfolioidentification | | string | Identifikationsnummer des Anlageportfolios | Beispielwert: "9470012345678" |
| portfolioReferenceCurrency | | string | Referenzwährung des Anlageportfolios | Beispielwert: "CHF" |
| accountIdentification | x | string | Identifikationsnummer des Darlehens oder der Hypothek | Beispielwert: "CH2130700123456789101" |
| descriptionAccount | | string | Rubrik des Darlehens oder der Hypothek | Beispielwert: "Zahlungen" |
| positionIdentification | | string | Identifikationsnummer der Position | Beispielwert: "WS_12346578" |
| bookingCreditList | | | | |
| bookingCredit | | | | |
| bookingType | x | string | Buchungstyp | Siehe 4.1.3 |
| maccCurrency | x | string | Kontowährung (ISO 4217) | Beispielwert: "CHF" |
| referenceCurrency | x | string | Referenzwährung (ISO 4217) | Beispielwert: "CHF" |
| creditDebitIndicator | x | string | Soll- und Haben-Indikator | Siehe 4.1.9 |
| amountInReferenceCurrency | x | decimal | Betrag in Referenzwährung | Beispielwert: "1000000" |
| amountInMaccCurrency | x | decimal | Betrag in Kontowährung | Beispielwert: "1000000" |
| transactionAdditionalDetails | | string | Buchungstext | Beispielwert: "KAP.RUECKZLG" |

3.4 Positionen

3.4.1 Wertschriften

3.4.1.1 Fachliche Beschreibung

Bereitstellung von Positionsdaten zu Wertschriftenpositionen.

| Feldname / Attribut | M | Data type | Defintion | Option / Beispiel |
|--|---|-----------|--|--|
| positionList | | | | |
| position | | | | |
| positionIdentification | x | string | Identifikationsnummer der Position | Beispielwert: "WS_12346578" |
| clientIdentification | | string | Eindeutige Identifikationsnummer des Partners (Besitzer des Geschäfts) | Beispielwert: "1.234.567-8" |
| portfolioIdentification | | string | Identifikationsnummer des Anlageportfolios | Beispielwert: "9470012345678" |
| portfolioReferenceCurrency | | string | Referenzwährung des Anlageportfolios | Beispielwert: "CHF" |
| accountIdentification | x | string | Kontonummer / IBAN | Beispielwert: "CH6500700123456789101" |
| descriptionAccount | | string | Rubrik des Kontos | Beispielwert: "Zahlungen" |
| positionCurrency | x | string | Positionswährung (ISO 4217) | Beispielwert: "CHF" |
| positionSecurity | | | | |
| aggregatedQuantity | x | decimal | Summe von pendenter und gebuchter Menge | Beispielwert: "600000" |
| aggregatedQuantityCreditDebitIndicator | x | string | Soll- und Haben-Indikator des Abrechnungsbetrags | Siehe 4.1.9 |
| bookedQuantity | x | decimal | Gebuchte Menge | Beispielwert: "400000" |
| bookedQuantityCreditDebitIndicator | x | string | Soll- und Haben-Indikator des Abrechnungsbetrags | Siehe 4.1.9 |
| pendingExBrokerageQuantity | x | decimal | Pendente Buchung aus Ex-Brokerage Transaktion | Beispielwert: "200000" |
| pendingExBrokerageCreditDebitIndicator | x | string | Soll- und Haben-Indikator des Abrechnungsbetrags | Siehe 4.1.9 |
| unitOfQuantity | x | string | Art der Menge | Siehe 4.1.1 |
| safeKeepingPlace | x | integer | Code der Depotstelle der Position | Beispielwert: "CHASUS44XXX" |
| safeKeepingAccountRefCurrency | x | string | Referenzwährung des Wertschriftendepots (ISO 4217) | Beispielwert: "EUR" |
| costPriceInPositionCurrency | | decimal | Einstandspreis in Positionswährung | Beispielwert: "22.18" |
| costPriceInSafeKeepingAccountRefCurrency | | decimal | Einstandspreis in Wertschriftendepot Referenzwährung | Beispielwert: "23.06" |
| costPriceCreditDebitIndicator | | string | Soll- und Haben-Indikator des Einstandspreises | Siehe 4.1.9 |
| costPriceType | | string | Art des Preises | Siehe 4.1.2 |
| costPriceFxRate | | decimal | Devisenkurs der Positionswährung zu Wertschriftendepot Referenzwährung zum Kaufzeitpunkt | Beispielwert: "1.2867" |
| costValueInPositionCurrency | | decimal | Einstandswert in Positionswährung | Beispielwert: "80056.84" |

| Feldname / Attribut | M | Data type | Defintion | Option / Beispiel |
|---|---|-----------|--|--|
| costValueInSafeKeepingAccountRefCurrency | | decimal | Einstandswert in Depotreferenzwahrung | Beispielwert: "90001.08" |
| costValueCreditDebitIndicator | | string | Soll- und Haben-Indikator des Einstandswerts | Siehe 4.1.9 |
| lastBookingDate | | date | Buchungsdatum der letzten Bestandesveranderung (ISO 8601) | Beispielwert: "2022-05-05" |
| marketValueInPositionCurrency | | decimal | Aktueller Wert in Positionswahrung | Beispielwert: "120056.84" |
| marketValueInSafeKeepingAccountRefCurrency | | decimal | Aktueller Wert in Wertschriftendepot-Referenzwahrung | Beispielwert: "126085.12" |
| marketValueCreditDebitIndicator | | string | Soll- und Haben-Indikator des aktuellen Werts | Siehe 4.1.9 |
| marketPrice | | decimal | Marktpreis der Position | Beispielwert: "28.95" |
| marketPriceCreditDebitIndicator | | string | Soll- und Haben-Indikator des Kurses | Siehe 4.1.9 |
| marketPriceCurrency | | string | Wahrung des Kurses (ISO 4217) | Beispielwert: "EUR" |
| marketPriceFxRate | | decimal | Devisenkurs der Positionswahrung zu Wertschriftendepot Referenzwahrung | Beispielwert: "0.9856" |
| marketPriceType | | string | Art des Preises | Siehe 4.1.2 |
| marketPriceDate | | date | Datum des Kurses (ISO 8601) | Beispielwert: "2022-05-18" |
| marketPriceMktPlace | | string | Borsenplatz des Marktpreises | |
| mktPlaceCode | | string | Borsenplatz Telekurs-Code | Beispielwert: "4" |
| mktPlaceIsoCode | | string | Borsenplatz ISO-Code (ISO 10383) | Beispielwert: "XSWX" |
| mktPlaceNameShort | | string | Borsenplatz Name kurz | Beispielwert: "SIX Swiss Excha" |
| mktPlaceNameLong | | string | Borsenplatz Name lang | Beispielwert: "SIX Swiss Exchange" |
| accruedInterestInPositionCurrency | | decimal | Marchzins in Positionswahrung | Beispielwert: "400.12" |
| accruedInterestCreditDebitIndicator | | string | Soll- und Haben-Indikator des Marchzins | Siehe 4.1.9 |
| accruedInterestInSafeKeepingAccountCurrency | | decimal | Marchzins in Wertschriftendepot Referenzwahrung | Beispielwert: "685.32" |
| valorIdentification | | | | |
| valorIdentification | x | string | Valorennummer mit fuhrenden Nullen | Siehe 4.1.20 |
| valorIdentificationTelekurs | | string | SIX Valorennummer | Beispielwert: "23862714" |
| valorTickerTelekurs | | string | Ticker Telekurs des Valors | Beispielwert: "BOSN" |
| valorIsin | | string | ISIN des Valors | Beispielwert: "CH0238627142" |
| valorTextShort | | string | Text kurz des Valors auf 20 Zeichen beschrankt | Beispielwert: "Bossard Hldg N" |
| valorTextLong | | string | Text lang des Valors | Beispielwert: "Namen-Akt Bossard Holding AG" |
| valorTypeGroup | | string | Titelart-Gruppe des Valors | Siehe 4.1.24 |
| valorTypeTelekurs | | string | Titelart-Telekurs des Valors | Siehe 4.1.15 |

| Feldname / Attribut | M | Data type | Defintion | Option / Beispiel |
|---|---|-----------|---|---|
| valorStatus | x | string | Status des Valors | Siehe 4.1.13 |
| valorOpeningDate | | date | Eröffnungsdatum des Instruments (ISO 8601) | Beispielwert: "2014-04-11" |
| valorEndDate | | date | Endverfalldatum des Instruments (ISO 8601) | Beispielwert: "2024-01-05" |
| valorInterestRate | | decimal | Zinssatz | Beispielwert: "8.5" |
| valorInterestFrequencyCode | | string | Zinsusanz | Siehe 4.1.4 |
| valorFirstInterestPaymentDate | | date | erster Zinszahlungstermin (ISO 8601) | Beispielwert: "2012-07-05" |
| valorInterestPeriod | | string | Periodizität der Zinsgutschrift | Siehe 4.1.5 |
| valorOptionType | | string | Valor Optionstyp | Siehe 4.1.14 |
| valorOptionStyle | | string | Valor Optionsstil | Siehe 4.1.6 |
| valorContractAmount | | decimal | Kontraktgrösse des Valors | Beispielwert: "100" |
| valorSmallestDenomination | | decimal | kleinste Stückelung des Valors | Beispielwert: "1" |
| valorMinimumTradeVolume | | decimal | Mindesthandelsmenge des Valors | Beispielwert: "100000" |
| numberOfUnderlyingValors | x | integer | Anzahl der Basisvaloren des Valors | Beispielwert: "1" |
| underlyingList | | | | |
| underlying | | | | |
| priceOfUnderlying | | decimal | Basispreis | Beispielwert: "1241.99" |
| creditDebitIndicator | | string | Vorzeichen des Basispreises | Siehe 4.1.9 |
| priceOfUnderlyingCurrency | | string | Währung des Basispreises (ISO 4217) | Beispielwert: "USD" |
| priceOfUnderlyingPriceType | | string | Art des Preises | Siehe 4.1.2 |
| valorIdentification | | | | |
| valorIdentification | | string | Valorennummer mit führenden Nullen des unterliegenden Titels | Siehe 4.1.20 |
| valorIdentificationTelekurs | | string | SIX Valorennummer des unterliegenden Titels | Beispielwert: "23862714" |
| valorTickerTelekurs | | string | Ticker Telekurs des unterliegenden Valors | Beispielwert: "BOSN" |
| valorIsin | | string | ISIN des unterliegenden Valors | Beispielwert: "CH0238627142" |
| valorTextShort | | string | Text kurz des Valors auf 20 Zeichen beschränkt | Beispielwert: "Bossard Hldg N" |
| valorTextLong | | string | Text lang des unterliegenden Valors | Beispielwert: "Namen-Akt Bossard Holding AG" |
| valorTypeGroup | | string | Titelart-Gruppe des unterliegenden Valors | Siehe 4.1.24 |
| valorTypeTelekurs | | string | Titelart-Telekurs des unterliegenden Valors | Siehe 4.1.15 |
| mktplace | | | | |
| Börsenplatz, über welchen die Position gehandelt wurde | | | | |
| mktplaceCode | | string | Börsenplatz Telekurs-Code | Beispielwert: "4" |
| mktplaceIsoCode | | string | Börsenplatz ISO-Code (ISO 10383) | Beispielwert: "XSWX" |

| Feldname / Attribut | M | Data type | Defintion | Option / Beispiel |
|---------------------|---|-----------|-----------------------|---------------------------------------|
| mktplaceNameShort | | string | Börsenplatz Name kurz | Beispielwert: "SIX Swiss Excha" |
| mktplaceNameLong | | string | Börsenplatz Name lang | Beispielwert: "SIX Swiss Exchange" |

3.4.2 Devisen und Edelmetall

3.4.2.1 Fachliche Beschreibung

Bereitstellung von Positionsdaten zu Devisen- und Edelmetall-Positionen.

- Spots werden nicht als Position angezeigt

| Feldname / Attribut | M | Data type | Defintion | Option / Beispiel |
|-------------------------------|---|-----------|---|--|
| positionList | | | | |
| position | | | | |
| positionIdentification | x | string | Identifikationsnummer der Position | Beispielwert: "WS_86035105" |
| clientIdentification | | string | Eindeutige Identifikationsnummer des Partners (Besitzer des Geschäfts) | Beispielwert: "1.234.567-8" |
| portfolioIdentification | | string | Identifikationsnummer des Anlageportfolios | Beispielwert: "9470012345678" |
| portfolioReferenceCurrency | | string | Referenzwährung des Anlageportfolios | Beispielwert: "CHF" |
| accountIdentification | x | string | Kontonummer / IBAN | Beispielwert: "CH6500700123456789101" |
| descriptionAccount | | string | Rubrik des Kontos | Beispielwert: "Zahlungen" |
| positionCurrency | x | string | Positionswährung (ISO 4217) | Beispielwert: "CHF" |
| positionFx | | | | |
| currentPrice | x | decimal | aktueller Bewertungskurs | Beispielwert: "123654.98" |
| priceDate | x | date | Datum der Bewertung (ISO 8601) | Beispielwert: "2021-09-20" |
| valuation | x | decimal | Wiederbeschaffungswert in Fremdwährung | Beispielwert: "200000.35" |
| valuationCreditDebitIndicator | x | string | Soll- und Haben-Indikator des Wiederbeschaffungswertes in Fremdwährung | Siehe 4.1.9 |
| valuationCurrency | x | string | Währung des Wiederbeschaffungswertes in Fremdwährung (ISO 4217) | Beispielwert: "EUR" |
| swapReference | | string | Swap Referenz | Beispielwert: "FXSW.4591234" |
| fxType | x | string | Art des Devisen Kontrakts inklusive Information über die Kontraktentstehung | Siehe 4.1.23 |
| instrumentName | x | string | Name des Instruments | Beispielwert: "Forex Forward Far Leg - EUR/CHF 06.09.2021" |
| instrumentIdentification | x | string | Kontraktidentifikationsnummer | Beispielwert: "131778726" |
| nominalCurrency | x | string | Nominalwährung / gehandelte Währung (ISO 4217) | Beispielwert: "EUR" |
| buySellIndicator | x | string | Indikator, ob es sich aus Sicht Kunde um einen Kauf oder Verkauf handelt | Siehe 4.1.18 |
| buyAmount | x | decimal | Kaufbetrag Kunde | Beispielwert: "900000" |
| buyCurrency | x | string | Währung des Kaufbetrag Kunde (ISO 4217) | Beispielwert: "USD" |

| Feldname / Attribut | M | Data type | Defintion | Option / Beispiel |
|--|---|-----------|---|-------------------------------|
| sellAmount | x | decimal | Verkaufsbetrag Kunde | Beispielwert: "800000" |
| sellCurrency | x | string | Währung des Verkaufsbetrag Kunde (ISO 4217) | Beispielwert: "EUR" |
| fxRateNominalCurrencyToCounterCurrency | x | decimal | Devisenkurs von einer Einheit der gehandelten Währung zu Gegenwährung | Beispielwert: "1.086071" |
| fxRateTraded | x | decimal | Effektiv gehandelter Devisenkurs | Beispielwert: "1.086071" |
| ndfFixingCurrency | | string | Fixingwährung eines NDF- Geschäfts (ISO 4217) | Beispielwert: "EUR" |
| ndfFixingDate | | date | Fixingdatum eines NDF-Geschäfts (ISO 8601) | Beispielwert: "2021-09-20" |
| ndfFixingFxRateSource1 | | string | Quelle des Fixingkurses 1 | Beispielwert: "BRL09" |
| ndfFixingFxRateSource2 | | string | Quelle des Fixingkurses 2 | Beispielwert: "WMR03" |
| ndfFixingFxRate | | decimal | Fixierter Devisenkurs am Fixingdatum zwischen der Fixingwährung und der nichtlieferbaren zweiten Währung | Beispielwert: "1.086071" |
| ndfFixingAmount | | decimal | Fixingbetrag in NDF Fixingwährung "€" | Beispielwert: "500000" |
| ndfFixingAmountCreditDebitIndicator | | string | Soll- und Haben-Indikator des Fixingbetrags in NDF Fixingwährung | Siehe 4.1.9 |

3.4.3 Konto und feste Vorschüsse

3.4.3.1 Fachliche Beschreibung

Bereitstellung von Positionsdaten zu Positionen von Konten und festen Vorschüssen.

| Feldname / Attribut | M | Data type | Defintion | Option / Beispiel |
|--|---|-----------|---|--|
| positionList | | | | |
| position | | | | |
| positionIdentification | x | string | Identifikationsnummer der Position | Beispielwert: "WS_86035105" |
| clientIdentification | | string | Eindeutige Identifikationsnummer des Partners (Besitzer des Geschäfts) | Beispielwert: "1.234.567-8" |
| portfolioIdentification | | string | Identifikationsnummer des Anlageportfolios | Beispielwert: "9470012345678" |
| portfolioReferenceCurrency | | string | Referenzwährung des Anlageportfolios | Beispielwert: "CHF" |
| accountIdentification | x | string | Kontonummer / IBAN | Beispielwert: "CH6500700123456789101" |
| descriptionAccount | | string | Rubrik des Kontos | Beispielwert: "Zahlungen" |
| positionCurrency | x | string | Positionswährung (ISO 4217) | Beispielwert: "CHF" |
| positionAccount | | | In einer Kontoposition kann nur positionAccount oder positionLoan vorkommen | |
| balance | x | decimal | Buchsaldo | Beispielwert: "1000000" |
| balanceCreditDebitIndicator | x | string | Soll- und Haben-Indikator des Buchsaldos | Siehe 4.1.9 |
| balanceInChf | | decimal | Buchsaldo in CHF | Beispielwert: "1000000" |
| balanceInChfCreditDebitIndicator | | string | Soll- und Haben-Indikator des Buchsaldos in CHF | Siehe 4.1.9 |
| balanceInclUnbookedTransactions | x | decimal | Saldo angepasst um kontoseitig noch nicht verbuchte Transaktionen | Beispielwert: "1010000" |
| balanceInclUnbookedTransactionsCreditDebitIndicator | x | string | Soll- und Haben-Indikator | Siehe 4.1.9 |
| amountInclUnbookedTransactionsInMaccCurrency | x | decimal | Saldo angepasst um kontoseitig noch nicht verbuchte Transaktionen in Kontowährung | Beispielwert: "1010000" |
| amountInclUnbookedTransactionsInMaccCurrencyCreditDebitIndicator | x | string | Soll- und Haben-Indikator des Saldos der nicht verbuchten Transaktionen in Kontowährung | Siehe 4.1.9 |
| pendingExBrokerageAmount | x | decimal | Pendente Buchung aus Ex-Brokerage Transaktion | Beispielwert: "10000" |
| pendingExBrokerageAmountCreditDebitIndicator | x | string | Soll- und Haben-Indikator des Saldos der nicht verbuchten Transaktionen in Kontowährung | Siehe 4.1.9 |
| positionLoan | | | In einer Kontoposition kann nur positionAccount oder positionLoan vorkommen | |
| balance | x | decimal | Buchsaldo | Beispielwert: "1000000" |

| Feldname / Attribut | M | Data type | Defintion | Option / Beispiel |
|----------------------------------|---|-----------|---|-------------------------------|
| balanceCreditDebitIndicator | x | string | Soll- und Haben-Indikator des Buchsaldos | Siehe 4.1.9 |
| product | | string | Produktbezeichnung für Hypotheken und Darlehen | Siehe 4.1.11 |
| interestRate | | decimal | Zinssatz | Beispielwert: "1.5" |
| interestFrequencyCode | | string | Zinsusanz | Siehe 4.1.7 |
| nextInterestPaymentDate | | date | Nächster Zinszahlungstermin (ISO 8601) | Beispielwert: "2022-03-31" |
| interestPeriod | | string | Periodizität der Zinsbelastung | Siehe 4.1.8 |
| termStart | | date | Laufzeit Beginn (ISO 8601) | Beispielwert: "2018-01-01" |
| termEnd | | date | Laufzeit Ende (ISO 8601) | Beispielwert: "2025-01-01" |
| balanceInChf | | decimal | Buchsaldo in CHF | Beispielwert: "1000000" |
| balanceInChfCreditDebitIndicator | | string | Soll- und Haben-Indikator des Buchsaldos in CHF | Siehe 4.1.9 |

3.4.4 Geldmarkt- und Treuhandanlagen

3.4.4.1 Fachliche Beschreibung

Bereitstellung von Positionsdaten zu Geldmarkt- und Treuhandanlagen-Positionen.

| Feldname / Attribut | M | Data type | Defintion | Option / Beispiel |
|-------------------------------------|---|-----------|--|--|
| positionList | | | | |
| position | | | | |
| positionIdentification | x | string | Identifikationsnummer der Position | Beispielwert: "WS_86035105" |
| clientIdentification | | string | Eindeutige Identifikationsnummer des Partners (Besitzer des Geschäfts) | Beispielwert: "1.234.567-8" |
| portfolioIdentification | | string | Identifikationsnummer des Anlageportfolios | Beispielwert: "9470012345678" |
| portfolioReferenceCurrency | | string | Referenzwährung des Anlageportfolios | Beispielwert: "CHF" |
| accountIdentification | x | string | Kontonummer / IBAN | Beispielwert: "CH6500700123456789101" |
| descriptionAccount | | string | Rubrik des Kontos | Beispielwert: "Zahlungen" |
| positionCurrency | x | string | Positionswährung (ISO 4217) | Beispielwert: "CHF" |
| positionMoneyMarket | | | | |
| balance | x | decimal | Aktueller Anlagebetrag in Positionswährung | Beispielwert: "15000000" |
| balanceCreditDebitIndicator | x | string | Soll- und Haben-Indikator des aktuellen Anlagebetrags | Siehe 4.1.9 |
| moneymarketType | x | string | Typ der Geldmarkt- oder Treuhandanlage | Siehe 4.1.12 |
| financialInstrumentName | x | string | Kontraktname | Beispielwert: "Money Market Time USD, 1.33%, 13.09.21-15.09.21" |
| financialInstrumentIdentification | x | string | Kontraktidentifikationsnummer | Beispielwert: "131778743" |
| valueFromDate | x | date | Start Valutadatum der Geldmarkt- oder Treuhandanlage (ISO 8601) | Beispielwert: "2021-09-13" |
| valueToDate | | date | Verfallsdatum der Geldmarkt- oder Treuhandanlage (ISO 8601) | Beispielwert: "2021-09-15" |
| interestFrequencyCode | x | string | Zinsusanz | Siehe 4.1.4 |
| interestRate | | decimal | Zinssatz | Beispielwert: "1.36" |
| interestPeriod | | string | Periodizität der Zinsgutschrift | Siehe 4.1.5 |
| nextInterestPaymentDate | | date | Nächster Zinszahlungstermin (ISO 8601) | Beispielwert: "2021-09-15" |
| commissionRate | | decimal | Kommissionsatz bei Treuhandanlagen | Beispielwert: "0.3" |
| noticePeriod | | integer | Kündigungsfrist bei Geldmarkt- oder Treuhandcallgeld in Tagen | Beispielwert: "30" |
| investmentBank | | string | Anlagebank bei Treuhandanlagen Zürcher Kantonalbank bei Geldmarkt | Beispielwert: "L.M.T. Bank" |
| accruedInterestInPositionCurrency | | decimal | Marchzins in Positionswährung | Beispielwert: "200" |
| accruedInterestCreditDebitIndicator | | string | Soll- und Haben-Indikator des Marchzinses in Positionswährung | Siehe 4.1.9 |

| Feldname / Attribut | M | Data type | Defintion | Option / Beispiel |
|----------------------------|----------|------------------|--|-------------------------------|
| accruedInterestEvalDate | | date | Datum, bis zu welchem der Marchzins berechnet ist (ISO 8601) | Beispielwert: "2021-09-08" |

3.4.5 Hypotheken und Darlehen

3.4.5.1 Fachliche Beschreibung

Bereitstellung von Positionsdaten zu Positionen von Hypotheken und Darlehen.

| Feldname / Attribut | M | Data type | Defintion | Option / Beispiel |
|----------------------------------|---|-----------|--|--|
| positionList | | | | |
| position | | | | |
| positionIdentification | x | string | Identifikationsnummer der Position | Beispielwert: "WS_86035105" |
| clientIdentification | | string | Eindeutige Identifikationsnummer des Partners (Besitzer des Geschäfts) | Beispielwert: "1.234.567-8" |
| portfolioIdentification | | string | Identifikationsnummer des Anlageportfolios | Beispielwert: "9470012345678" |
| portfolioReferenceCurrency | | string | Referenzwährung des Anlageportfolios | Beispielwert: "CHF" |
| accountIdentification | x | string | Kontonummer / IBAN | Beispielwert: "CH6500700123456789101" |
| descriptionAccount | | string | Rubrik des Kontos | Beispielwert: "Zahlungen" |
| positionCurrency | x | string | Positionswährung (ISO 4217) | Beispielwert: "CHF" |
| positionLoan | | | | |
| balance | x | decimal | Buchsaldo | Beispielwert: "800000" |
| balanceCreditDebitIndicator | x | string | Soll- und Haben-Indikator des Buchsaldos | Siehe 4.1.9 |
| product | | string | Produktbezeichnung für Hypotheken und Darlehen | Siehe 4.1.11 |
| interestRate | | decimal | Zinssatz | "Beispielwert: "1.8" |
| interestFrequencyCode | | string | Zinsusanz | Siehe 4.1.7 |
| nextInterestPaymentDate | | date | Nächster Zinszahlungstermin (ISO 8601) | Beispielwert: "2022-03-31" |
| interestPeriod | | string | Periodizität der Zinsbelastung | Siehe 4.1.8 |
| termStart | | date | Laufzeit Beginn (ISO 8601) | Beispielwert: "2018-01-01" |
| termEnd | | date | Laufzeit Ende (ISO 8601) | Beispielwert: "2025-01-01" |
| balanceInChf | | decimal | Buchsaldo in CHF | Beispielwert: "1000000" |
| balanceInChfCreditDebitIndicator | | string | Soll- und Haben-Indikator des Buchsaldos in CHF | Siehe 4.1.9 |

3.4.6 OTC (over the counter)

3.4.6.1 Fachliche Beschreibung

Bereitstellung von Positionsdaten zu OTC-Positionen.

| Feldname / Attribut | M | Data type | Defintion | Option / Beispiel |
|--------------------------------|---|-----------|--|--|
| positionList | | | | |
| position | | | | |
| positionIdentification | x | string | Identifikationsnummer der Position | Beispielwert: "WS_86035105" |
| clientIdentification | | string | Eindeutige Identifikationsnummer des Partners (Besitzer des Geschäfts) | Beispielwert: "1.234.567-8" |
| portfolioIdentification | | string | Identifikationsnummer des Anlageportfolios | Beispielwert: "9470012345678" |
| portfolioReferenceCurrency | | string | Referenzwährung des Anlageportfolios | Beispielwert: "CHF" |
| accountIdentification | x | string | Kontonummer / IBAN | Beispielwert: "CH6500700123456789101" |
| descriptionAccount | | string | Rubrik des Kontos | Beispielwert: "Zahlungen" |
| positionCurrency | x | string | Positionswährung (ISO 4217) | Beispielwert: "CHF" |
| positionOtcDerivat | | | | |
| instrumentIdentification | x | string | Kontraktidentifikationsnummer | Beispielwert: "IRS.419200500" |
| derivatReference | x | string | Derivatreferenz | Beispielwert: "FX0000102290656" |
| instrumentName | x | string | Kontraktname | Beispielwert: "IRS - CHF 31.03.2021 - 31.12.2036" |
| otcInstrumentTypeCode | x | string | OTC Kontaktart | Siehe 4.1.26 |
| orderOpeningIdentification | | string | Eröffnungsnummer Kontrakt | Beispielwert: "628704483" |
| transcationDate | x | date | Transaktionsdatum (ISO 8601) | Beispielwert: "2021-09-15" |
| openingDate | x | date | Eröffnungsdatum (ISO 8601) | Beispielwert: "2021-09-15" |
| maturityDate | | date | Verfalldatum (ISO 8601) | Beispielwert: "2023-04-26" |
| buySellIndicator | | string | Indikator, ob es sich aus Sicht Kunde um einen Kauf oder Verkauf handelt | Siehe 4.1.18 |
| optionType | | string | Optionstyp | Siehe 4.1.14 |
| staticData | | | | |
| callAmount | | decimal | Callbetrag | Beispielwert: "10000.55" |
| callAmountCreditDebitIndicator | | string | Soll- und Haben-Indikator des Callbetrags | Siehe 4.1.9 |
| callCurrency | | string | Callwährung (ISO 4217) | Beispielwert: "CHF" |
| putAmount | | decimal | Putbetrag | Beispielwert: "10000.55" |
| putAmountCreditDebitIndicator | | string | Soll- und Haben-Indikator des Putbetrags | Siehe 4.1.9 |
| putCurrency | | string | Putwährung (ISO 4217) | Beispielwert: "CHF" |

| Feldname / Attribut | M | Data type | Defintion | Option / Beispiel |
|--|---|-----------|---|----------------------------------|
| strikePrice | | decimal | Strikebetrag | Beispielwert: "22.50" |
| strikeCurrency | | string | Strikewährung (ISO 4217) | Beispielwert: "CHF" |
| strikePriceType | | string | Art des Strikepreises | Siehe 4.1.28 |
| upperBarrier | | decimal | Obere Barriere | Beispielwert: "1100.00" |
| lowerBarrier | | decimal | Untere Barriere | Beispielwert: "200.00" |
| optionStyle | | string | Optionsart | Siehe 4.1.6 |
| settlementTypeCode | | string | Lieferart | Siehe 4.1.29 |
| premium | | | | |
| startPremiumAmount | | decimal | Prämienbetrag bei Laufzeitbeginn | Beispielwert: "20000.00" |
| startPremiumAmountCreditDebitIndicator | | string | Soll- und Haben-Indikator des Prämienbetrags bei Laufzeitbeginn | Siehe 4.1.9 |
| startPremiumCurrency | | string | Prämienbetragswährung bei Laufzeitbeginn (ISO 4217) | Beispielwert: "CHF" |
| startPremiumDate | | date | Prämienlaufzeitbeginn (ISO 8601) | Beispielwert: "2021-09-15" |
| endPremiumAmount | | decimal | Prämienbetrag bei Laufzeitende | Beispielwert: "5'000.00" |
| endPremiumAmountCreditDebitIndicator | | string | Soll- und Haben-Indikator des Prämienbetrags bei Laufzeitende | Siehe 4.1.9 |
| endPremiumCurrency | | string | Prämienbetragswährung bei Laufzeitende (ISO 4217) | Beispielwert: "CHF" " |
| endPremiumDate | | date | Prämienlaufzeitende (ISO 8601) | Beispielwert: "2023-04-26" |
| underlyingList | | | | |
| valorIdentification | | string | Valorennummer mit führenden Nullen | Beispielwert: "IRS.552283956" |
| valorStartDate | | date | Valorlaufzeitbeginn (ISO 8601) | Beispielwert: "2021-09-15" |
| valorEndDate | | date | Valorlaufzeitende (ISO 8601) | Beispielwert: "2023-04-26" |
| referenceEntity | | string | Bezugsreferenz | Beispielwert: "ITRxEUR34/5" |
| interestFixingDate | | date | Zinsfixierungsdatum (ISO 8601) | Beispielwert: "2021-09-15" |
| referenceInterestRateCurve | | string | Referenzzinskurve | Beispielwert: "EUREURIBOR03M" |
| nominalChange | | boolean | Änderungen im Nominal erlaubt | Siehe 4.1.30 |
| otcInstrumentSubtypeCode | | string | Erweitert die OTC Kontraktart | Siehe 4.1.27 |
| ccsCurrentFx | | string | Aktueller Devisenkurs Cross Currency Swap | Beispielwert: "0.901713" |
| leg1 | | | | |
| nominalAmount | | decimal | Nominalbetrag Leg 1 | Beispielwert: "50000000.00" |
| nominalAmountCreditDebitIndicator | | string | Soll- und Haben-Indikator des Nominalbetrags Leg 1 | Siehe 4.1.9 |
| nominalCurrency | | string | Nominalwährung Leg 1 (ISO 4217) | Beispielwert: "CHF" |
| interestType | | string | Zinsart Leg 1 | Siehe 4.1.31 |

| Feldname / Attribut | M | Data type | Defintion | Option / Beispiel |
|---|---|-----------|---|------------------------------------|
| interestPeriod | | string | Zinsperiode Leg 1 | Siehe 4.1.5 |
| interestRate | | decimal | Zinssatz Leg 1 | Beispielwert: "2.1725" |
| interestFrequencyCode | | string | Zinsusanz Leg 1 | Siehe 4.1.4 |
| index | | string | Index Leg 1 | Beispielwert: "CHFSARON" |
| spread | | decimal | Zinsaufschlag Leg 1 | Beispielwert: "0.074" |
| nextInterestPaymentAmount | | decimal | Betrag nächste Zinszahlung Leg 1 | Beispielwert: "74841.53" |
| nextInterestPaymentAmountCreditDebitIndicator | | string | Soll- und Haben-Indikator des Betrags nächste Zinszahlung Leg 1 | Siehe 4.1.9 |
| nextInterestPaymentCurrency | | string | Währung nächste Zinszahlung Leg 1 (ISO 4217) | Beispielwert: "CHF" |
| nextInterestPaymentDate | | date | Termin nächste Zinszahlung Leg 1 (ISO 8601) | Beispielwert: "2022-09-15" |
| payerReceiver | | string | Indikator, ob die Zahlung für Leg 1 bezahlt oder empfangen wird | Beispielwert: "CLIENT_PAYS" |
| Leg2 | | | | |
| nominalAmount | | decimal | Nominalbetrag Leg 2 | Beispielwert: "127795527.16" |
| nominalAmountCreditDebitIndicator | | string | Soll- und Haben-Indikator des Nominalbetrags Leg 2 | Siehe 4.1.9 |
| nominalCurrency | | string | Nominalwährung Leg 2 (ISO 4217) | Beispielwert: "CHF" |
| interestType | | string | Zinsart Leg 2 | Siehe 4.1.31 |
| interestPeriod | | string | Zinsperiode Leg 2 | Siehe 4.1.5 |
| interestRate | | decimal | Zinssatz Leg 2 | Beispielwert: "3.385" |
| interestFrequencyCode | | string | Zinsusanz Leg 2 | Siehe 4.1.4 |
| index | | string | Index Leg 2 | Beispielwert: "EUREURIBOR03M" |
| spread | | decimal | Zinsaufschlag Leg 2 | Beispielwert: "0.48" |
| nextInterestPaymentAmount | | decimal | Betrag nächste Zinszahlung Leg 2 | Beispielwert: "1089.56" |
| nextInterestPaymentAmountCreditDebitIndicator | | string | Soll- und Haben-Indikator des Betrags nächste Zinszahlung Leg 2 | Siehe 4.1.9 |
| nextInterestPaymentCurrency | | string | Währung nächste Zinszahlung Leg 2 (ISO 4217) | Beispielwert: "CHF" |
| nextInterestPaymentDate | | date | Termin nächste Zinszahlung Leg 2 (ISO 8601) | Beispielwert: "2022-09-15" |
| payerReceiver | | string | Indikator, ob die Zahlung für Leg 2 bezahlt oder empfangen wird | Beispielwert: "CLIENT_RECEIVES" |
| valuation | | | | |
| valuationRate | | decimal | Kurs Wiederbeschaffungswert | Beispielwert: "21.002759" |
| valuationAmount | | decimal | Betrag Wiederbeschaffungswert | Beispielwert: "30212.888603" |
| valuationAmountCreditDebitIndicator | | string | Soll- und Haben-Indikator des Betrags Wiederbeschaffungswert | Siehe 4.1.9 |

| Feldname / Attribut | M | Data type | Defintion | Option / Beispiel |
|---|---|-----------|--|---|
| valuationCurrency | | string | Währung Wiederbeschaffungswert (ISO 4217) | Beispielwert: "CHF" |
| spotValuationAmount | | decimal | Spot Betrag Wiederbeschaffungswert | Beispielwert: "30216.858161" |
| spotValuationAmountCreditDebitIndicator | | string | Soll- und Haben-Indikator des Spot Betrags Wiederbeschaffungswert | Siehe 4.1.9 |
| spotValuationCurrency | | string | Spot Währung Wiederbeschaffungswert (ISO 4217) | Beispielwert: "CHF" |
| valuationOriginalAmount | | decimal | Originalbetrag Wiederbeschaffungswert | Beispielwert: "31500.00" |
| valuationInOriginalCurrencyCreditDebitIndicator | | string | Soll- und Haben-Indikator des Originalbetrags Wiederbeschaffungswert | Siehe 4.1.9 |
| valuationInOriginalCurrency | | string | Originalwährung Wiederbeschaffungswert (ISO 4217) | Beispielwert: "USD" |
| tradingReference | | string | Handelsreferenz | Beispielwert: "MW_29629518" |
| createDate | | date | Erstellungsdatum (ISO 8601) | Beispielwert: "2021-09-15" |
| tradingInstrumentName | | string | Handelsinstrumentname | Beispielwert: "CHF/IRS/SS-F/210914-230426/0.995" |
| interestRateCurveTrading | | string | Handelszinskurve | Beispielwert: "CHF-SSAR-ON" |
| interestDerivatTypeCodeTrading | | string | Zinsderivatart | Siehe 4.1.32 |
| interestDerivatSubtypeCodeTrading | | string | Erweitert die Zinsderivatart | Siehe 4.1.33 |
| lastFixedInterestRate | | decimal | Letzter fixierter Zinssatz | Beispielwert: "0.7066, 0" |
| marketPriceInPercent | | decimal | Marktkurs in Prozent | Beispielwert: "0.4742" |
| tradedPriceInPercent | | decimal | Handelskurs in Prozent | Beispielwert: "1.3" |
| strikeInPercent | | decimal | Strike in Prozent | Beispielwert: "0.155" |
| markToMarketAmount | | decimal | Markt zu Markt Betrag | Beispielwert: "5450718.00" |
| deltaAmount | | decimal | Delta Betrag | Beispielwert: "102763.39.00" |
| volatilityInPercent | | decimal | Volatilität in Prozent | Beispielwert: "1.28" |
| interestStartDate | | date | Zinslaufzeitbeginn (ISO 8601) | Beispielwert: "2021-09-15" |
| interestEndDate | | date | Zinslaufzeitende (ISO 8601) | Beispielwert: "2023-04-26" |

3.5 Bewertungen

3.5.1 Wertschriften

3.5.1.1 Fachliche Beschreibung

Bereitstellung von Bewertungen zu Wertschriftenpositionen.

| Feldname / Attribut | M | Data type | Defintion | Option / Beispiel |
|--------------------------------------|---|-----------|--|---|
| priceList | | | | |
| Price | | | | |
| valorIdentification | | | | |
| valorIdentification | x | string | Valorennummer mit führenden Nullen | Siehe 4.1.20 |
| valorIdentificationTelekurs | | string | SIX Valorennummer | Beispielwert: "23862714" |
| valorTickerTelekurs | | string | Ticker Telekurs des Valors | Beispielwert: "BOSN" |
| valorsin | | string | ISIN des Valors | Beispielwert: "CH0238627142" |
| valorTextShort | | string | Text kurz des Valors auf 20 Zeichen beschränkt | Beispielwert: "Bossard Hldg N" |
| valorTextLong | | string | Text lang des Valors | Beispielwert: "Namen-Akt Bossard Holding AG" |
| valorTypeGroup | | string | Titelart-Gruppe des Valors | Siehe 4.1.24 |
| valorTypeTelekurs | | string | Titelart-Telekurs des Valors | Siehe 4.1.15 |
| numberOfUnderlyingValors | x | integer | Anzahl der Basisvaloren des Valors | Beispielwert: "1" |
| underlyingList | | | | |
| underlying | | | | |
| priceOfUnderlying | | decimal | Basispreis | Beispielwert: "1241.99" |
| creditDebitIndicator | | string | Vorzeichen des Basispreises | Siehe 4.1.9 |
| priceOfUnderlyingCurrency | | string | Währung des Basispreises (ISO 4217) | Beispielwert: "USD" |
| priceOfUnderlyingPriceType | | string | Art des Preises | Siehe 4.1.2 |
| valorIdentificationUnderlying | | | | |
| valorIdentification | | string | Valorennummer mit führenden Nullen des unterliegenden Titels | Siehe 4.1.20 |
| valorIdentificationTelekurs | | string | SIX Valorennummer des unterliegenden Titels | Beispielwert: "23862714" |
| valorTickerTelekurs | | string | Ticker Telekurs des unterliegenden Valors | Beispielwert: "BOSN" |
| valorsin | | string | ISIN des unterliegenden Valors | Beispielwert: "CH0238627142" |
| valorTextShort | | string | Text kurz des Valors auf 20 Zeichen beschränkt | Beispielwert: "Bossard Hldg N" |
| valorTextLong | | string | Text lang des unterliegenden Valors | Beispielwert: "Namen-Akt Bossard Holding AG" |
| valorTypeGroup | | string | Titelart-Gruppe des unterliegenden Valors | Siehe 4.1.24 |
| valorTypeTelekurs | | string | Titelart-Telekurs des unterliegenden Valors | Siehe 4.1.15 |
| valorPrice | | | | |
| marketPrice | | decimal | Kurs der Position | Beispielwert: "28.95" |
| marketPriceCreditDebitIndicator | | string | Soll- und Haben-Indikator des Kurses | Siehe 4.1.9 |
| marketPriceCurrency | | string | Währung des Kurses (ISO 4217) | Beispielwert: "EUR" |

| Feldname / Attribut | M | Data type | Defintion | Option / Beispiel |
|----------------------------|---|-----------|-------------------------------------|---------------------------------------|
| marketPriceType | | string | Art des Preises | Siehe 4.1.2 |
| marketPriceDate | | date | Datum desurses (ISO 8601) | Beispielwert: "2022-05-18" |
| marketPriceMktplace | | | Börsenplatz des Marktpreises | |
| mktplaceCode | | string | Börsenplatz Telekurs-Code | Beispielwert: "4" |
| mktplaceIsoCode | | string | Börsenplatz ISO-Code (ISO 10383) | Beispielwert: "XSWX" |
| mktplaceNameShort | | string | Börsenplatz Name kurz | Beispielwert: "SIX Swiss Excha" |
| mktplaceNameLong | | string | Börsenplatz Name lang | Beispielwert: "SIX Swiss Exchange" |

3.5.2 Devisen und Edelmetall

3.5.2.1 Fachliche Beschreibung

Bereitstellung von Bewertungen zu Devisen- und Edelmetallpositionen.

| Feldname / Attribut | M | Datatype | Definition | Option / Beispiel |
|-------------------------------|---|----------|--|-------------------------------|
| priceList | | | | |
| price | | | | |
| instrumentIdentification | | string | Kontraktidentifikationsnummer | Beispielwert: "131778726" |
| instrumentPrice | | | | |
| currentPrice | | decimal | aktueller Bewertungskurs | Beispielwert: "123654.98" |
| priceDate | | date | Datum der Bewertung (ISO 8601) | Beispielwert: "2021-09-20" |
| valuation | | decimal | Wiederbeschaffungswert in Fremdwährung | Beispielwert: "200000.35" |
| valuationCreditDebitIndicator | | string | Soll- und Haben-Indikator des Wiederbeschaffungswertes in Fremdwährung | Siehe 4.1.9 |
| valuationCurrency | | string | Währung des Wiederbeschaffungswertes in Fremdwährung (ISO 4217) | Beispielwert: "EUR" |

3.5.3 Geldmarkt- und Treuhandanlagen

3.5.3.1 Fachliche Beschreibung

Bereitstellung von Bewertungen zu Geldmarkt- und Treuhandanlagen-Positionen.

| Feldname / Attribut | M | Data type | Defintion | Option / Beispiel |
|--|---|-----------|--|-------------------------------|
| priceList | | | | |
| price | | | | |
| financialInstrumentIdentification | | | | |
| financialInstrumentIdentification | x | string | Kontraktidentifikationsnummer | Beispielwert: "131778743" |
| financialInstrumentPrice | | | | |
| accruedInterestInPositionCurrency | | decimal | Marchzins in Positionswahrung | Beispielwert: "200" |
| accruedInterestCreditDebitIndicator | | string | Soll- und Haben-Indikator des Marchzinses in Positionswahrung | Siehe 4.1.9 |
| accruedInterestEvaluationDate | | date | Datum, bis zu welchem der Marchzins berechnet ist (ISO 8601) | Beispielwert: "2021-09-08" |

3.6 Stammdaten

3.6.1 Wertschriften

3.6.1.1 Fachliche Beschreibung

Bereitstellung von Stammdaten zu Wertschriftenpositionen.

| Feldname / Attribut | M | Data type | Defintion | Option / Beispiel |
|-------------------------------|---|-----------|--|---|
| staticDataList | | | | |
| staticData | | | | |
| type | x | string | Stammdaten-Typ | Siehe 4.1.25 |
| valorIdentification | | | | |
| valorIdentification | x | string | Valorennummer mit führenden Nullen | Siehe 4.1.20 |
| valorIdentifiacionTelekurs | | string | SIX Valorennummer | Beispielwert: "23862714" |
| valorTickerTelekurs | | string | Ticker Telekurs des Valors | Beispielwert: "BOSN" |
| valorsin | | string | ISIN des Valors | Beispielwert: "CH0238627142" |
| valorTextShort | | string | Text kurz des Valors auf 20 Zeichen beschränkt | Beispielwert: "Bossard Hldg N" |
| valorTextLong | | string | Text lang des Valors | Beispielwert: "Namen-Akt Bossard Holding AG" |
| valorTypeGroup | | string | Titelart-Gruppe des Valors | Siehe 4.1.24 |
| valorTypeTelekurs | | string | Titelart-Telekurs des Valors | Siehe 4.1.15 |
| valorStaticData | | | | |
| valorStatus | x | string | Status des Valors | Siehe 4.1.13 |
| valorOpeningDate | | date | Eröffnungsdatum des Instruments (ISO 8601) | Beispielwert: "2014-04-11" |
| valorEndDecayDate | | date | Endverfalldatum des Instruments (ISO 8601) | Beispielwert: "2024-01-05" |
| valorInterestRate | | decimal | Zinssatz | Beispielwert: "8.5" |
| valorInterestFrequencyCode | | string | Zinsusanz | Siehe 4.1.14 |
| valorFirstInterestPaymentDate | | date | erster Zinszahlungstermin (ISO 8601) | Beispielwert: "2012-07-05" |
| valorInterestPeriod | | string | Periodizität der Zinsgutschrift | Siehe 4.1.5 |
| valorOptionType | | string | Valor Optionstyp | Siehe 4.1.14 |
| valorOptionStyle | | string | Valor Optionsstil | Siehe 4.1.6 |
| valorContractAmount | | decimal | Kontraktgrösse des Valors | Beispielwert: "100" |
| valorSmallestDenomination | | decimal | kleinste Stückelung des Valors | Beispielwert: "1" |
| valorMinimumTradeVolume | | decimal | Mindesthandelsmenge des Valors | Beispielwert: "100000" |
| numberOfUnderlyingValors | x | integer | Anzahl der Basisvaloren des Valors | Beispielwert: "1" |
| underlyingList | | | | |
| underlying | | | | |
| priceOfUnderlying | | decimal | Basispreis | Beispielwert: "1241.99" |
| creditDebitIndicator | | string | Vorzeichen des Basispreises | Siehe 4.1.9 |
| priceOfUnderlyingCurrency | | string | Währung des Basispreises (ISO 4217) | Beispielwert: "USD" |
| priceOfUnderlyingPriceType | | string | Art des Preises | Siehe 4.1.2 |
| valorIdentification | | | | |

| Feldname / Attribut | M | Data type | Defintion | Option / Beispiel |
|-----------------------------|---|-----------|--|---|
| valorIdentification | | string | Valorennummer mit führenden Nullen des unterliegenden Titels | Siehe 4.1.20 |
| valorIdentificationTelekurs | | string | SIX Valorennummer des unterliegenden Titels | Beispielwert: "23862714" |
| valorTickerTelekurs | | string | Ticker Telekurs des unterliegenden Valors | Beispielwert: "BOSN" |
| valorIsin | | string | ISIN des unterliegenden Valors | Beispielwert: "CH0238627142" |
| valorTextShort | | string | Text kurz des Valors auf 20 Zeichen beschränkt | Beispielwert: "Bossard Hldg N" |
| valorTextLong | | string | Text lang des unterliegenden Valors | Beispielwert: "Namen-Akt Bossard Holding AG" |
| valorTypeGroup | | string | Titelart-Gruppe des unterliegenden Valors | Siehe 4.1.24 |
| valorTypeTelekurs | | string | Titelart-Telekurs des unterliegenden Valors | Siehe 4.1.15 |
| mktplace | | | | |
| mktplaceCode | | string | Börsenplatz Telekurs-Code | Beispielwert: "4" |
| mktplaceIsoCode | | string | Börsenplatz ISO-Code (ISO 10383) | Beispielwert: "XSWX" |
| mktplaceNameShort | | string | Börsenplatz Name kurz | Beispielwert: "SIX Swiss Excha" |
| mktplaceNameLong | | string | Börsenplatz Name lang | Beispielwert: "SIX Swiss Exchange" |

3.6.2 Devisen und Edelmetall

3.6.2.1 Fachliche Beschreibung

Bereitstellung von Stammdaten zu Devisen- und Edelmetallpositionen.

| Feldname / Attribut | M | Data type | Defintion | Option / Beispiel |
|--|---|-----------|---|--|
| staticDataList | | | | |
| staticData | | | | |
| type | x | string | Stammdaten-Typ | Siehe 4.1.25 |
| fxType | | string | Art des Devisen Kontrakts inklusive Information über die Kontraktentstehung | Siehe 4.1.23 |
| instrumentName | | string | Name des Instruments | Beispielwert: "Forex Forward Far Leg - EUR/CHF 06.09.2021" |
| instrumentIdentification | | string | Instrumentennummer | Beispielwert: "131778726" |
| nominalCurrency | | string | Nominalwährung / gehandelte Währung (ISO 4217) | Beispielwert: "EUR" |
| buyAmount | | decimal | Kaufbetrag Kunde | Beispielwert: "900000" |
| buyCurrency | | string | Währung des Kaufbetrag Kunde (ISO 4217) | Beispielwert: "USD" |
| sellAmount | | decimal | Verkauf Betrag | Beispielwert: "800000" |
| sellCurrency | | string | Währung des Verkauf Betrags (ISO 4217) | Beispielwert: "EUR" |
| fxRateNominalCurrencyToCounterCurrency | | decimal | Devisenkurs von einer Einheit der gehandelten Währung zu Gegenwährung | Beispielwert: "1.086071" |
| fxRateTraded | | decimal | Effektiv gehandelter Devisenkurs | Beispielwert: "1.086071" |
| ndfFixingCurrency | | string | Fixingwährung eines NDF- Geschäfts (ISO 4217) | Beispielwert: "EUR" |
| ndfFixingFxRateSource1 | | string | Quelle des Fixingkurses 1 | Beispielwert: "BRL09" |
| ndfFixingFxRateSource2 | | string | Quelle des Fixingkurses 2 | Beispielwert: "WMR03" |

3.6.3 Geldmarkt- und Treuhandanlagen

3.6.3.1 Fachliche Beschreibung

Bereitstellung von Stammdaten zu Geldmarkt- und Treuhandanlagen-Positionen.

| Feldname / Attribut | M | Data type | Defintion | Option / Beispiel |
|-----------------------------------|---|-----------|--|---|
| staticDataList | | | | |
| staticData | | | | |
| type | x | string | Stammdaten-Typ | Siehe 4.1.25 |
| moneyMarketType | x | string | Typ der Geldmarkt- oder Treuhandanlage | Siehe 4.1.12 |
| financialInstrumentName | x | string | Kontraktname | Beispielwert: "Money Market Time USD, 1.33%, 13.09.21-15.09.21" |
| financialInstrumentIdentification | x | string | Kontraktidentifikationsnummer | Beispielwert: "131778743" |
| valueFromDate | x | date | Start Valutadatum der Geldmarkt- oder Treuhandanlage (ISO 8601) | Beispielwert: "2021-09-13" |
| valueToDate | | date | Verfallsdatum der Geldmarkt- oder Treuhandanlage (ISO 8601) | Beispielwert: "2021-09-15" |
| interestFrequencyCode | x | string | Zinsusanz | Siehe 4.1.4 |
| interestRate | | decimal | Zinssatz | Beispielwert: "1.36" |
| interestPeriod | | string | Periodizität der Zinsgutschrift | Siehe 4.1.5 |
| nextInterestPaymentDate | | date | Nächster Zinszahlungstermin (ISO 8601) | Beispielwert: "2021-09-15" |
| commissionRate | | decimal | Kommissionssatz bei Treuhandanlagen | Beispielwert: "0.3" |
| noticePeriod | | integer | Kündigungsfrist bei Geldmarkt- oder Treuhandcallgeld in Tagen | Beispielwert: "30" |
| investmentBank | | string | Anlagebank bei Treuhandanlagen Zürcher Kantonalbank bei Geldmarkt | Beispielwert: "L.M.T. Bank" |

4 Detailbeschreibung

4.1 Beschreibung und mögliche Werte

4.1.1 unitOfQuantity

| Mögliche Werte | Beschreibung / Verwendungszweck |
|----------------|---|
| nominal | absoluter Betrag (z.B. Nennwert einer Obligation) |
| unitsNumber | Anzahl Stücke (z.B. Anzahl Aktien) |

4.1.2 priceType

| Mögliche Werte | Beschreibung / Verwendungszweck |
|--------------------|---|
| perUnit | Preis pro Stück (z.B. Aktie) |
| percentage | Preis in Prozenten des Nennwerts (z.B. Obligation) |
| percentagePerAnnum | Preis in Prozenten des Nennwerts aufs Jahr gerechnet (z.B. Zinszahlungen) |

4.1.3 bookingType

| Mögliche Werte | Kategorie | | | | Beschreibung / Verwendungszweck |
|---------------------------|-----------|----------|---|--------------|---|
| | Steuern | Gebühren | Geldbuchung (Belastung und Gutschrift) | Titelbuchung | |
| additionalWithholdingTax | x | | | | Zusätzlicher Steuerrückbehalt |
| administrationFee | | x | | | Adminstrationsgebühren |
| brokerageFee | | x | | | Brokerage Gebühren |
| capitalGain | | | x | | Kapitalgewinn |
| cash | | | x | | Geldbuchung generell |
| cashSettlement | | | x | | Barabgeltung |
| courtage | | x | | | ZKB-Gebühr: Courtage |
| custodyFee | | x | | | Depotgebühren |
| custodyFeeInclVAT | | x | | | Depotgebühren inkl. MwSt |
| dividend | | | x | | Dividende |
| exchangeFee | | x | | | Börsengebühren |
| exCustForeignBrokerageFee | | x | | | Fremde Brokerage Gebühren |
| fatcaBackupWithholdingTax | x | | | | Fatca Backup Withholding Tax (US Steuer) |
| fatcaWithholdingTax | x | | | | Fatca Withholding Tax (US Steuer) |
| finalLiqPayment | | | x | | Liquidationszahlung |
| financialTransactionTaxES | x | | | | Transaktionssteuer Spanien |
| financialTransactionTaxFR | x | | | | Transaktionssteuer Frankreich |
| financialTransactionTaxIT | x | | | | Transaktionssteuer Italien |
| foreignBrokerageFee | | x | | | Fremde Gebühren Brokerage |
| fractionPayment | | | x | | Fraktionenzahlung (Gutschrift oder Belastung) |
| interestRevenue | | | x | | Marchzinsen |
| intOnPremium | | | x | | Prämienanteil einer Ertragsabrechnung eines strukturierten Produkts |
| levy | | x | | | Börsengebühr |
| liqPayment | | | x | | Liquidationszahlung |
| managementFee | | | x | | Verwaltungsgebühr |
| metal | | | | x | Menge gebuchtem Metall |
| net | | | x | | Nettobetrag in Kontowährung |
| netDividend | | | x | | Netto Dividende |
| nominalReduction | | | x | | Bruttobetrag Kapitalrückzahlung |
| otherFee | | x | | | übrige Gebühren |
| otherFeeTaxes | x | | | | übrige lokale Gebühren oder Steuern |
| others | | | x | x | übrige Buchungen |
| performanceFee | | | x | | Performance Gebühr |
| redemption | | | x | | Bruttobetrag Rückzahlung |
| redemptionFee | | x | | | Gebühr Rückzahlung |

| Mögliche Werte | Kategorie | Beschreibung / Verwendungszweck |
|------------------|-----------|---------------------------------|
| revenue | | x Ertrag |
| secFeeUSA | x | Börsengebühr |
| security | | x Titelbuchung |
| settlementFee | x | Settlement Gebühr |
| stampDuty | x | Stempelsteuern |
| stampDutyUK_IR | x | Stempelsteuern UK und Irland |
| subscriptionFee | x | Ausgabekommission Fonds |
| thirdPartyFee | x | Fremde Gebühren: EUREX |
| transactionFee | x | Transaktionsgebühren |
| USWithholdingTax | x | US-Quellensteuer |
| valueAddedTax | x | Mehrwertsteuer |
| variationMargin | | x Variation Margin |
| withholdingTax | x | Quellensteuer |
| withholdingTaxCH | x | Verrechnungssteuer |

4.1.4 interestFrequencyCode

| Mögliche Werte | Beschreibung / Verwendungszweck |
|----------------|--|
| u30E_360lsda | 30/360 Usanz, wird typischerweise in den USA verwendet |
| act_actlcma | Tage/Jahr basiert auf der Länge der Zinsperiode (Eurobond-Markt ab 1999) |
| act_365L | Anzahl der Tage/Jahr hängt von der Häufigkeit der Coupons ab und davon, ob es sich um ein Schaltjahr handelt |
| bus_252 | spezielle Methode für den brasilianischen Markt |
| u30E_360lcma | Methode für den Eurobond-Markt vor 1999 (ISMA-Regel) |
| act_360 | Internationale Usanz (Effektive Anzahl Tage eines Monats / 360 Tage pro Jahr) |
| act_365 | Britische Usanz (Effektive Anzahl Tage eines Monats / 365 Tage pro Jahr) |
| act_actlsda | Jeder Tag wird nach Anzahl der Tage im Jahr gewichtet |

4.1.5 interestPeriod

| Mögliche Werte | Beschreibung / Verwendungszweck |
|---------------------|---|
| byClosing | Zinstermin bei der Schliessung des Valors |
| accordingToDateList | Zinstermin gemäss der Datenliste |
| endOfMonth | Zinstermin am Ende des Monats |
| onEvent | Zinstermin auf ein Ereignis |
| atMaturity | Zinstermin bei Verfall des Valors |
| monthlyRolling | Zinstermin monatlich rollierend |
| quarterlyRolling | Zinstermin quartalsweise rollierend |
| Years2 | Zinstermin zwei-jährlich |
| endOfQuarter | Zinstermin am Ende des Quartals |
| annualRolling | Zinstermin jährlich rollierend |
| quarterlyOn20th | Zinstermin quartalsweise am 20. |
| semiAnnualRolling | Zinstermin halbjährlich rollierend |

4.1.6 optionStyle

| Mögliche Werte | Beschreibung / Verwendungszweck |
|----------------|--|
| amer | Amerikanischer Stil (Ausübung bis und mit Verfall) |
| euro | Europäischer Stil (Ausübung nur per Verfall) |
| berm | Bermudan Stil (Ausübung an spezifischen Daten) |

4.1.7 interestFrequencyCode (loan)

| Mögliche Werte | Beschreibung / Verwendungszweck |
|----------------|---------------------------------|
| act_360 | Internationale Usanz |
| act_365 | Britische Usanz |
| u30_360 | Schweizer und DE Usanz |

4.1.8 interestPeriod (loan)

| Mögliche Werte | Beschreibung / Verwendungszweck |
|----------------|---------------------------------|
| monthly | Zinstermin monatlich |
| quarterly | Zinstermin vierteljährlich |
| semiAnnual | Zinstermin halbjährlich |
| annual | Zinstermin jährlich |
| atMaturity | Zinstermin auf Verfall |

4.1.9 creditDebitIndicator

| Mögliche Werte | Beschreibung / Verwendungszweck |
|----------------|---------------------------------|
| debit | Soll (Positiv) |
| credit | Haben (Negativ) |

4.1.10 inOutIndicator

| Mögliche Werte | Beschreibung / Verwendungszweck |
|----------------|---------------------------------|
| in | Eingang |
| out | Ausgang |

4.1.11 product

| Mögliche Werte | Beschreibung / Verwendungszweck |
|---------------------------|-----------------------------------|
| fixedLoan | ZKB Festdarlehen |
| fixedAdvance | ZKB Fester Vorschuss |
| fixedRateMortgage | ZKB Festhypothek |
| environmentalLoan | ZKB Umweltdarlehen |
| startMortgage | ZKB Starthypothek |
| termLoan | ZKB Festkredit |
| variableLoan | ZKB Variables Darlehen |
| rolloverTermLoan | ZKB Rollover Festkredit |
| liborLoan | ZKB Libor Darlehen |
| liborMortgage | ZKB Libor Hypothek |
| variableMortgage | ZKB Variable Hypothek |
| homegateFixedRateMortgage | homegate.ch Festhypothek |
| homegateLiborMortgage | homegate.ch Libor Hypothek |
| homegateVariableMortgage | homegate.ch Variable Hypothek |
| rolloverMortgage | ZKB Rollover Hypothek |
| rolloverLoan | ZKB Rollover Darlehen |
| rolloverAdvance | ZKB Rollover Vorschuss |
| fixedLoanOnRolloverBasis | ZKB Festkredit auf Rollover-Basis |

4.1.12 moneyMarketType

| Mögliche Werte | Beschreibung / Verwendungszweck |
|------------------------|---------------------------------|
| moneyMarketTimeDeposit | Geldmarkt Festgeld |
| moneyMarketCallDeposit | Geldmarkt Callgeld |
| fiduciaryTimeDeposit | Treuhand Festgeld |
| fiduciaryCallDeposit | Treuhand Callgeld |

4.1.13 valorStatus

| Mögliche Werte | Beschreibung / Verwendungszweck |
|----------------|---------------------------------|
| active | aktiv |
| inactive | inaktiv |

4.1.14 optionType

| Mögliche Werte | Beschreibung / Verwendungszweck |
|----------------|---------------------------------|
| call | Call-Option |
| put | Put-Option |
| special | Spezial |

4.1.15 valorTypeTelekurs

| Mögliche Werte | Beschreibung / Verwendungszweck |
|-----------------------------|--|
| bond | Obligationen, Schuldbuch |
| share | Aktien |
| mediumTermNote_federalBonds | Kassenobligationen und Bundesanleihen |
| coupon_talon | Coupons / Talons |
| otherWithoutCashflow | Sonstige ohne Cash-Flow |
| policy | Versicherungspolicen |
| structuredProduct | Strukturierte Produkte |
| trustShare | Trust-Shares |
| interestRate | Zinssätze |
| residualQuotaCertificate | Restquotenbescheinigungen |
| entitlement | Anrechte, Bezugsrechte |
| nationalCurrency | Nationale Währungen |
| trustCertificate | Trust-Zertifikate |
| shareCertificate | Anteilscheine |
| savingDeposit | Einlage, Depositen und Sparhefte |
| repoTransaction | REPO |
| technicalValor | Technische Valoren |
| floatingRateNote | Floating Rate Notes, variable Obligationen |
| warrant | Optionscheine, Warrants |
| repoBasket | REPO-Basket |
| future | Futures (Terminkontrakte) |
| moneymarketPaper | Geldmarktpapiere |
| commodity | Commodities |
| otherWithCash-flow | Sonstige mit Cash-Flow |
| coin | Münzen |
| preciousMetal | Edelmetalle |
| convertibleBond | Convertible Bonds |
| preciousMetalCertificate | Wertzertifikate für Edelmetalle |
| technicalCurrencyValor | Technische Devisenvaloren |
| index | Indizes |
| option | Call- und Put-Optionen |
| combination | Kombinationsgeschäfte |

4.1.16 transactionType

| Mögliche Werte | Beschreibung / Verwendungszweck |
|--------------------|--|
| fx | Devisenhandel |
| moneyMarket | Geldmarktanlagen |
| Fiduciary | Treuhandanlagen |
| physical | Physische Werte (z.B. Edelmetalle) |
| securitiesExchange | Wertschriften-Handel |
| securitiesTransfer | Wertschriftenlieferung |
| cash | Reine Gelbbuchungen ohne weiteres Geschäft als Grundlage |
| corporateActions | Corporate Action |
| taxes | Steuern |
| credit | Kredite und Darlehen |
| fees | Gebühren |

4.1.17 transactionSubtype

| Mögliche Werte | Beschreibung / Verwendungszweck |
|-------------------------|--|
| buy | Kauf eines Wertpapiers |
| buyIssue | Kauf einer Neuemission (Primärmarkt) |
| buyToClose | TOFF: Kauf, um eine TOFF-Position zu schließen |
| buyToOpen | TOFF: Kauf, um eine TOFF-Position zu eröffnen |
| redemption | Rücknahme |
| sell | Regulärer Verkauf eines Wertpapiers |
| sellToClose | TOFF: Verkauf, um eine TOFF-Position zu schließen |
| sellToOpen | TOFF: Verkauf, um eine TOFF-Position zu eröffnen |
| prepayment | Vorauszahlung für den Kauf z. B. eines Hedgefonds mit unregelmäßiger Berechnung des NAV |
| subscription | Zeichnung eines Fonds |
| exercise | Ausübung einer Option oder eines Warrants (Long-Position) |
| other | andere |
| assignment | Ausübung einer Option oder eines Warrants (Short-Position) |
| assimilation | Gleichstellung |
| bonus | Gratisausschüttung |
| capitalIncrease | Kapitalerhöhung |
| conversionBondShare | Umwandlung von Anleihen in Aktien |
| dividendCash | Bardividende, einschliesslich Kapitalgewinn |
| dividendChoice | Wahldividende |
| dividendReinvestment | Reinvestition der Dividende |
| dividendStock | Stockdividende |
| expirationOldSecurity | Verfall alter Wertpapiere, einschliesslich Verfall von Optionen und Warrants |
| finalLiquidationPayment | Abschliessende Liquidationszahlung |
| Merger | Fusion |
| publicOffer | Offerte |
| redemptionPartial | Teilweise Rückzahlung |
| redemptionPrior | vorzeitige Rückzahlung |
| reductionOfNominal | Reduktion des Nominals |
| revenue | Einnahmen, die in irgendeiner Weise mit einer Kapitalmassnahme zusammenhängen, aber nicht direkt als Teil der regulären Arten von Kapitalmaßnahmen erfasst werden. z. B. wenn ein Inhaber einer Anleihe eine besondere Einnahme erhält, wenn er ein Rückkaufangebot innerhalb eines bestimmten Zeitraums annimmt. |
| rightDistribution | Verteilung von Rechten (z. B. Bezugsrechte im Zusammenhang mit einer Kapitalerhöhung oder im Falle einer Dividende mit Wahlmöglichkeit zwischen Aktien und Bargeld) |
| instrumentExchange | Titelumtausch |
| spinOff | Spin-Off |
| split | Split |
| taxCorrections | Steuerberichtigungen |
| variationMargin | Variation Margin |
| fees | Gebühren (Die Unterscheidung der Gebührenarten erfolgt innerhalb des Attributs "bookingType") |

| Mögliche Werte | Beschreibung / Verwendungszweck |
|--------------------------|--|
| inflowOutflowDigital | Eingehende und ausgehende Zahlungen im Zusammenhang mit dem Geldkonto. Darunter fallen z.B. die Bezahlung von Rechnungen, bankenübergreifende Kontoüberträge, Kartenzahlungen, Bargeldbezüge, kunden-/bankübergreifende Daueraufträge, "LSV". |
| internalTransfer | Kontübertrag innerhalb desselben Kunden / derselben Bank |
| receiveFreeOfPayment | unentgeltlicher Empfang |
| deliveryFreeOfPayment | unentgeltliche Lieferung |
| deliverySecurityPayMoney | Lieferung von Wertpapieren gegen Fonds. Sacheinlagen zur Finanzierung |
| deliveryVsPayment | Lieferung gegen Zahlung |
| excustDeliveryVsPayment | Lieferung gegen Zahlung (ex-Custody) |
| deliveryVsSecurity | Lieferung gegen Wertschriften |
| physicalReceive | Erhalt von physischem Metall (ETF) aus Sacheinlagen |
| receiveVsPayment | Empfang gegen Zahlung |
| excustReceiveVsPayment | Empfang gegen Zahlung (ex-Custody) |
| slbDeliveryFreeOfPayment | unentgeltliche Lieferung (SLB) |
| slbDeliveryVsPayment | Lieferung gegen Zahlung (SLB) |
| slbReceiveVsPayment | Empfang gegen Zahlung (SLB) |
| fxSpot | FX Spot |
| openFxForward | Eröffnung eines FX-Forwards |
| swapSpotLeg | FX Swap Spot Leg |
| openSwapForwardLeg | Eröffnung eines FX Swap Forward Leg |
| closeFxForward | Abschluss eines FX Forwards oder eines FX Spots |
| openNDF | Eröffnung eines FX Non-Deliverable-Forward |
| closeNDF | Abschluss eines FX Non-Deliverable-Forward |
| open | Eröffnung |
| renew | Erneuerung |
| increase | Erhöhung |
| decrease | Reduktion |
| close | Abschluss |
| unwind | Abwicklung |
| interestPayment | Zinszahlung |
| interest | Zinszahlung |
| redemption | Rückzahlung bei Fälligkeit |

4.1.18 buySellIndicator

| Mögliche Werte | Beschreibung / Verwendungszweck |
|-----------------------|--|
| buy | Kauf |
| sell | Verkauf |

4.1.19 statementType

| Mögliche Werte | Beschreibung / Verwendungszweck |
|-----------------------|--|
| statement | Abrechnung |
| reversal | Storno: Im Falle eines Stornos wird ein nicht korrektes Geschäft zu den vergangenen Bedingungen erneut ausgelöst |
| rectificat | Rektifikat: Im Falle eines Rektifikats wird ein nicht korrektes Geschäft zu den aktuellen Bedingungen erneut ausgelöst |

4.1.20 valorIdentification

Beschreibung und Verwendungszweck

Die Valorenummer wird jeweils mit **neun** Ziffern ausgewiesen. Ist die eigentliche Valornummer kürzer, werden noch Nullen davorgestellt, bis die **neun** Stellen erreicht sind.

Bei manchen Titeln mit einer Fälligkeit, ist diese nach den **neun** Ziffern und einem Punkt auch ausgewiesen.

Valorenummer Aktie

Bsp. 023862714

Valorenummer Obligation

Bsp. 018433913

Valorenummer Kassenobligation

Bsp. 000138826

Valorenummer Option

Bsp. 069003312.20220121

4.1.21 accountIndicator

Mögliche Werte

Beschreibung / Verwendungszweck

true

wahr (z.B. metalAccountIndicator = true – Es ist ein Metallkonto)

false

falsch (z.B. metalAccountIndicator = false – Es ist kein Metallkonto)

4.1.22 reversalIndicator

Mögliche Werte

Beschreibung / Verwendungszweck

true

wahr (z.B. reversalIndicator = true – Storno)

false

falsch (z.B. reversalIndicator = false – kein Storno)

4.1.23 fxType

Mögliche Werte

Beschreibung / Verwendungszweck

fxSpot

FX Spot

fxSpotSwapLeg

FX Spot Swap Leg

fxForward

FX Forward

fxForwardSwapLeg

FX Forward Swap Leg

fxForwardNdf

FX Forward NDF

4.1.24 valorTypeGroup

| Mögliche Werte | Beschreibung / Verwendungszweck |
|-----------------------|--|
| bonds | Obligationen |
| shares | Aktien |
| futures | Futures |
| funds | Fonds |
| swap | Swap |
| commodities | Commodities |
| options | Optionen |
| structuredProducts | Strukturierte Produkte |
| insurancePolicies | Versicherungspolicen |
| documents | Dokumente |
| indices | Indizes |
| cash | Cash |
| others | Andere |
| metal | Metall |
| rights | Anrechte |
| warrants | Warrants |
| entitlement | Ansprüche |
| currency | Währungen |
| foreignExchange | Devisenhandel |
| moneyMarket | Geldmarktanlagen |
| fiduciary | Treuhandanlagen |
| creditDerivatives | Kreditderivate |
| interestRateOptions | Zinsoptionen |

4.1.25 type

| Mögliche Werte | Beschreibung / Verwendungszweck |
|-----------------------|---|
| valor | Stammdaten für ein Valor |
| fxInstrument | Stammdaten für ein FX-Instrument |
| moneyMarketInstrument | Stammdaten für ein Geldmarkt-Instrument |

4.1.26 otclInstrumentTypeCode

| Mögliche Werte | Beschreibung / Verwendungszweck |
|-----------------------|--|
| CCS | Cross Currency Swap |
| CDS | Credit Default Swap |
| CFC | Cap, Floor, Collar |
| FRA | Forward Rate Agreement |
| FXOPT | FX Option |
| IRS | Interest Rate Swap |
| OTHOTC | Other OTC |
| PMOPT | Precious Metal Option |
| SWOCDS | Swaption auf CDS |
| SWOIRS | Swaption auf IRS |
| TRS | Total Return Swap |

4.1.27 otclInstrumentSubtypeCode

| Mögliche Werte | Beschreibung / Verwendungszweck |
|---|---|
| fxOption | FX Option Plain Vanilla |
| fxOptionBarrier | FX Option Barrier |
| fxOptionDigital | FX Option Digital |
| preciousMetalOption | Precious Metal Option Plain Vanilla |
| preciousMetalOptionBarrier | Precious Metal Option Barrier |
| preciousMetalOptionDigital | Precious Metal Option Digital |
| forwardRateAgreement | Forward Rate Agreement Plain Vanilla |
| cdsSingleName | CDS Single Name |
| cdsIndex | Index |
| swaptionOnCds | Swaption auf Kreditderivate |
| swaptionOnIrs | Swaption auf IRS |
| totalReturnSwapPreciousMetals | Total Return Swap Precious Metals |
| totalReturnSwapHybrid | Total Return Swap Hybrid |
| totalReturnSwapCreditDerivatives | Total Return Swap Credit Derivatives |
| totalReturnSwapCommodities | Total Return Swap Commodities |
| inflationLinkedSwap | Inflation Linked Swap |
| totalReturnSwapInterest | Total Return Swap Interest |
| totalReturnSwapCurrencies | Total Return Swap Currencies |
| fxAccumulator | FX Accumulator |
| totalReturnSwapShares | Total Return Swap Shares |
| totalReturnSwapSingleNameCds | Total Return Swap Single Name CDS |
| totalReturnSwapIndexCds | Total Return Swap Index CDS |
| totalReturnSwapBonds | Total Return Swap Bonds |
| totalReturnSwapShareIndex | Total Return Swap Share Index |
| totalReturnSwapFunds | Total Return Swap Funds |
| financingTotalReturnSwapShares | Financing Total Return Swap Shares |
| financingTotalReturnSwapShareBasket | Financing Total Return Swap Share-Basket |
| financingTotalReturnSwapEtf | Financing Total Return Swap ETF |
| financingTotalReturnSwapEtfBasket | Financing Total Return Swap ETF-Basket |
| financingTotalReturnSwapStraightBond | Financing Total Return Swap Straight-Bond |
| financingTotalReturnSwapStraightBondBasket | Financing Total Return Swap Straight-Bond-Basket |
| financingTotalReturnSwapCocoBond | Financing Total Return Swap CoCo-Bond |
| financingTotalReturnSwapCocoBondBasket | Financing Total Return Swap CoCo-Bond-Basket |
| financingTotalReturnSwapConvertibleBondExclCoco | Financing Total Return Swap Convertible Bond excl Coco |
| financingTotalReturnSwapConvertibleBondBasketExclCoco | Financing Total Return Swap Convertible Bond-Basket excl Coco |
| cap | Cap |
| floor | Floor |
| collar | Collar |
| crossCurrencySwap | Cross Currency Swap Plain Vanilla |
| crossCurrencySwapMtm | Cross Currency Swap Mtm |
| nonDeliverableCrossCurrencySwap | Non-deliverable Cross Currency Swap |
| interestRateSwap | Interest Rate Swap Plain Vanilla |
| tomorrownextOvernightSwap | Tomorrow next Overnight Swap |
| overnightIndexSwap | Overnight Index Swap |
| rangeAccrualSwap | Range Accrual Swap |
| inverseFloaterSwap | Inverse Floater Swap - SNOW |
| flooredInterestRateSwap | Floored Interest Rate Swap |
| flooredOvernightIndexSwap | Floored Overnight Index Swap |
| pmAccumulator | PM Accumulator |

4.1.28 strikePriceType

| Mögliche Werte | Beschreibung / Verwendungszweck |
|----------------|---|
| Percentage | Beim Strikepreis handelt es sich um einen Prozentwert |
| Money | Beim Strikepreis handelt es sich um einen Betragswert |

4.1.29 settlementTypeCode

| Mögliche Werte | Beschreibung / Verwendungszweck |
|--------------------|---------------------------------|
| physicalSettlement | Physische Lieferung |
| cashSettlement | Barausgleich |

4.1.30 nominalChange

| Mögliche Werte | Beschreibung / Verwendungszweck |
|----------------|---|
| true | Bei IRS u.ä. kann sich die Berechnungsbasis (= Nominal) für die Zinsen während der Laufzeit verändern. Dies wird mit Abschluss des Kontraktes definiert. Es kann sowohl Reduktionen (= Amortisation) als auch Erhöhungen (= Aufstockung) geben. Hier wird auf der Position angezeigt, dass es solche Veränderungen gibt. |
| false | Bei IRS u.ä. kann sich die Berechnungsbasis (= Nominal) für die Zinsen während der Laufzeit verändern. Dies wird mit Abschluss des Kontraktes definiert. Es kann sowohl Reduktionen (= Amortisation) als auch Erhöhungen (= Aufstockung) geben. Hier wird auf der Position angezeigt, dass es solche Veränderungen <u>nicht</u> gibt. |
| leer | Attribut ist für das Produkt nicht relevant |

4.1.31 InterestType

| Mögliche Werte | Beschreibung / Verwendungszweck |
|----------------|---------------------------------|
| Fixed | Fester Zinssatz |
| Float | Variabler Zinssatz |
| Total Return | Total Return |

4.1.32 interestDerivatTypeCodeTrading

| Mögliche Werte | Beschreibung / Verwendungszweck |
|----------------|---------------------------------|
| swap | Swap |
| swaption | Swaption |
| cap | Cap |
| floor | Floor |

4.1.33 interestDerivatSubtypeCodeTrading

| Mögliche Werte | Beschreibung / Verwendungszweck |
|----------------|---|
| payer | Payer Swap aus Sicht Kunde (relevant für interestDerivatTypeCodeTrading = swap und swaption) |
| receiver | Receiver Swap aus Sicht Kunde (relevant für interestDerivatTypeCodeTrading = swap und swaption) |
| long | Long Position aus Sicht Kunde (relevant für interestDerivatTypeCodeTrading = cap und floor) |
| short | Short Position aus Sicht Kunde (relevant für interestDerivatTypeCodeTrading = cap und floor) |

4.1.34 dataType

| Mögliche Werte | Beschreibung / Verwendungszweck |
|----------------|---------------------------------|
| transactions | Transaktionen |
| positions | Positionen |
| prices | Bewertungen |
| static_data | Stammdaten |