

# **Dokumentation ZKB Dataset Service CSV-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"> <li>Ergänzung Attribut 'balancelnChf' in der Struktur 'Konto und Darlehen' (Verfügbar ab 26.09.2023)</li> <li>Ergänzung Struktur 'OTC Positionen'</li> </ul>                                                                                                      | 31<br>33 – 36                   |
| 09.11.2023 | 1.2     | <ul style="list-style-type: none"> <li>Ergänzung Definition 'dataType'</li> <li>Diverse kleinere fachliche Anpassungen</li> </ul>                                                                                                                                                                    | 46<br>Alle                      |
| 21.03.2024 | 1.3     | <ul style="list-style-type: none"> <li>Ergänzung Triggering Quantity und Triggering Quantity Position Currency für Verwaltungshandlungen (3.3.1)</li> <li>Ergänzung Attribut für eine QR-Referenz aus einem Zahlungsauftrag und Kontonummern eines Zahlungsempfänger (3.3.4.1)</li> </ul>            | 17<br>24                        |
| 09.06.2024 | 1.4     | <ul style="list-style-type: none"> <li>Ergänzung Struktur 'OTC-Transaktionen' (3.3.6)</li> <li>Ergänzung Detailbeschreibungen (4..1.6 , 4.1.17 , 4.1.27 , 4.1.29 , 4.1.34 , 14.1.35)</li> <li>Ergänzung Erfüllungsart bei 'Positionen Wertschriften' aus Wertschriften Optionen (3.4.1.1)</li> </ul> | 26 - 28<br>40, 44, 47, 48<br>30 |
| 19.09.2024 | 1.5.1   | <ul style="list-style-type: none"> <li>Ergänzung Pretty Strike für OTC Positionen</li> <li>Lieferung von kumulierten Variation Margins bei Wertschriftenpositionen</li> <li>Ergänzung von Trade Date und Value Date in FX Positions</li> </ul>                                                       | 38<br>30<br>32                  |
| 20.03.2025 | 1.5.2   | <ul style="list-style-type: none"> <li>Ergänzung Attribut 'referenceTransactionIdentification' als Referenz von einer Settlement Transaktion auf eine Ex-Brokerage STEX-Transaktion.</li> </ul>                                                                                                      | 20                              |
| 02.06.2025 | 1.5.3   | <ul style="list-style-type: none"> <li>Korrektur des Depotformates / identificationSafekeepingAccount</li> <li>Ergänzung Attribute 'zvPartyInfo' (1-4) zur spezifischen Identifikation eines Zahlungsauftraggeber bei einem Zahlungseingang</li> </ul>                                               | div.<br>24                      |

## Inhaltsverzeichnis

|            |                                                                                        |           |
|------------|----------------------------------------------------------------------------------------|-----------|
| <b>1</b>   | <b>Einführung</b>                                                                      | <b>5</b>  |
| <b>1.1</b> | <b>Zweck und Inhalt dieser Dokumentation</b>                                           | <b>5</b>  |
| <b>2</b>   | <b>Hinweise ZKB Dataset</b>                                                            | <b>6</b>  |
| <b>2.1</b> | <b>Verfügbarkeit von Daten</b>                                                         | <b>6</b>  |
| 2.1.1      | Fachliche Ausprägungen von Datenlieferungen                                            | 6         |
| 2.1.2      | Aufbereitung der Daten                                                                 | 6         |
| 2.1.3      | Datenverfügbarkeit                                                                     | 6         |
| 2.1.4      | Einmalige Datenbestellungen                                                            | 6         |
| 2.1.5      | Wiederholende Datenbestellungen                                                        | 6         |
| 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         |
| <b>2.2</b> | <b>Fachliche Erklärungen</b>                                                           | <b>9</b>  |
| 2.2.1      | Berechnungsbeispiel Wertschriftenkauf                                                  | 9         |
| 2.2.2      | Berechnungsbeispiel für Kurse (Währungen mit Standard 100 zu Währungen mit Standard 1) | 10        |
| 2.2.3      | Erläuterung transactionSubtype Optionen und Futures                                    | 10        |
| 2.2.4      | Depotarten innerhalb der Zürcher Kantonalbank                                          | 10        |
| <b>3</b>   | <b>Spezifikation der Datenlieferungen</b>                                              | <b>12</b> |
| <b>3.1</b> | <b>Allgemeine Informationen</b>                                                        | <b>12</b> |
| 3.1.1      | Mögliche Werte eines Attributs                                                         | 12        |
| 3.1.2      | Aufbau und Unterteilung der CSV-Struktur                                               | 12        |
| 3.1.3      | Mehrere Titelnbuchungen innerhalb einer Transaktion                                    | 13        |
| 3.1.4      | Darstellung Transaktion Konto und Darlehen                                             | 13        |
| 3.1.5      | Darstellung von Betragswerten                                                          | 13        |
| 3.1.6      | Statement, Storno und Rektifikat                                                       | 13        |
| 3.1.7      | Deklaration der Transaktionsarten und Transaktionstypen                                | 14        |
| 3.1.8      | Definition von standardmässig gelieferten Attributen                                   | 14        |
| 3.1.9      | Attributsbezeichnung in eDL                                                            | 14        |
| <b>3.2</b> | <b>Fachliche Definition allgemeiner Teil</b>                                           | <b>14</b> |
| <b>3.3</b> | <b>Transaktionen</b>                                                                   | <b>15</b> |
| 3.3.1      | Verwaltungshandlungen                                                                  | 15        |
| 3.3.2      | Wertschriften                                                                          | 18        |
| 3.3.3      | Devisen und Edelmetall                                                                 | 21        |
| 3.3.4      | Konto und Darlehen                                                                     | 23        |
| 3.3.5      | Geldmarkt- und Treuhandanlagen                                                         | 25        |
| 3.3.6      | OTC-Derivate                                                                           | 26        |
| <b>3.4</b> | <b>Positionen</b>                                                                      | <b>29</b> |
| 3.4.1      | Wertschriften                                                                          | 29        |
| 3.4.2      | Devisen und Edelmetall                                                                 | 31        |
| 3.4.3      | Konto und Darlehen                                                                     | 33        |
| 3.4.4      | Geldmarkt- und Treuhandanlagen                                                         | 34        |
| 3.4.5      | OTC (over the counter)                                                                 | 35        |
| <b>4</b>   | <b>Detailbeschreibung</b>                                                              | <b>39</b> |
| <b>4.1</b> | <b>Beschreibung und mögliche Werte</b>                                                 | <b>39</b> |
| 4.1.1      | unitOfQuantity                                                                         | 39        |
| 4.1.2      | priceType                                                                              | 39        |
| 4.1.3      | bookingType                                                                            | 39        |
| 4.1.4      | bookingTypeSecurity                                                                    | 39        |

|        |                                   |    |
|--------|-----------------------------------|----|
| 4.1.5  | interestFrequencyCode             | 39 |
| 4.1.6  | interestPeriod                    | 40 |
| 4.1.7  | optionStyle                       | 40 |
| 4.1.8  | interestFrequencyCode (loan)      | 40 |
| 4.1.9  | interestPeriod (loan)             | 40 |
| 4.1.10 | inOutIndicator                    | 40 |
| 4.1.11 | product                           | 41 |
| 4.1.12 | moneyMarketType                   | 41 |
| 4.1.13 | valorStatus                       | 41 |
| 4.1.14 | optionType                        | 41 |
| 4.1.15 | valorTypeTelekurs                 | 42 |
| 4.1.16 | transactionType                   | 42 |
| 4.1.17 | transactionSubtype                | 43 |
| 4.1.18 | buySellIndicator                  | 44 |
| 4.1.19 | statementType                     | 44 |
| 4.1.20 | valorIdentification               | 45 |
| 4.1.21 | accountIndicator                  | 45 |
| 4.1.22 | reversalIndicator                 | 45 |
| 4.1.23 | fxType                            | 45 |
| 4.1.24 | valorTypeGroup                    | 45 |
| 4.1.25 | type                              | 46 |
| 4.1.26 | otclInstrumentTypeCode            | 46 |
| 4.1.27 | otclInstrumentSubtypeCode         | 46 |
| 4.1.28 | strikePriceType                   | 47 |
| 4.1.29 | settlementTypeCode                | 47 |
| 4.1.30 | nominalChange                     | 47 |
| 4.1.31 | InterestType                      | 47 |
| 4.1.32 | interestDerivatTypeCodeTrading    | 48 |
| 4.1.33 | interestDerivatSubtypeCodeTrading | 48 |
| 4.1.34 | dataType                          | 48 |
| 4.1.35 | barrierTypeCode                   | 48 |

## 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 Transaktionen und Positionen bestellt werden. Zu beiden Datenarten, Transaktionen und Positionen, werden Daten für die folgenden Produkttypen generiert:

- Devisen und Edelmetall
- Geldmarkt- und Treuhandanlagen
- Konto und Darlehen
- Verwaltungshandlungen
- Wertschriften
- OTC-Derivate

#### 2.1.2 Aufbereitung der Daten

Bei der Konfiguration einer Bestellung kann zwischen drei verschiedenen Datumsarten gewählt werden. Je nach Datumsart, sind die Zeiträume für den Zusammenzug der Transaktionen, bzw. die Zeitpunkte für den Zusammenzug der Positionen unterschiedlich.

##### 2.1.2.1 Datumsart Buchungsdatum

Die Daten aus Transaktionen und Positionen 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   |

##### 2.1.2.2 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.

##### 2.1.2.3 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. Pro Bestellung ist der Zeitraum aber auf 6 Monate eingeschränkt. (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. Wiederholende Bestellungen können nur an Bankarbeitstagen bereitgestellt werden.

#### 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 die folgende Information dem 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, bzw. einen autorisierten Server der Zürcher Kantonalbank 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 dazugehörige 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-Transaktionenfile (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 |

Am 01.03.2023 (Trade Date)

Zu Gunsten einer übersichtlicheren Darstellung werden die Attribute nicht von links nach rechts (CSV üblich), sondern von oben nach unten aufgelistet.

| Attribut                | Werte Ex-Brokerage | Werte In-Brokerage |
|-------------------------|--------------------|--------------------|
| valueDate               | 03.03.2023         | 03.03.2023         |
| transactionDate         | 01.03.2023         | 01.03.2023         |
| exBrokerageIndicator    | true               | false              |
| brokerName              | XY                 |                    |
| brokerIdentification    | 123456             |                    |
| transactionType         | securitiesExchange | securitiesExchange |
| transactionSubtype      | sell               | sell               |
| netAmountInMaccCurrency | 10'000.00          | 20'000.00          |
| InOutIndicator          | Out                | out                |
| quantity                | 100                | 200                |

Am 03.03.2023 (Settlement Date)

Zu Gunsten einer übersichtlicheren Darstellung werden die Attribute nicht von links nach rechts (CSV üblich), sondern von oben nach unten aufgelistet.

| Attribut                | Werte Ex-Brokerage | Werte Ex-Brokerage | Werte In-Brokerage |
|-------------------------|--------------------|--------------------|--------------------|
| valueDate               | 03.03.2023         | 03.03.2023         | 03.03.2023         |
| transactionDate         | 01.03.2023         | 01.03.2023         | 01.03.2023         |
| exBrokerageIndicator    | true               | false              | false              |
| brokerName              |                    |                    |                    |
| brokerIdentification    |                    |                    |                    |
| transactionType         | securitiesTransfer | securitiesTransfer | securitiesTransfer |
| transactionSubtype      | deliveryVsPayment  | deliveryVsPayment  | deliveryVsPayment  |
| netAmountInMaccCurrency | -10'000.00         | 10'000.00          | 20'000.00          |
| InOutIndicator          | in                 | out                | out                |
| quantity                | 100                | 100                | 200                |

### Kontoauszug

|                           |
|---------------------------|
| Kontoauszug am 01.03.2023 |
| Kontoauszug am 03.03.2023 |

| balance   | balanceInclUnbookedTransactions | pendingExBrokerageAmount |
|-----------|---------------------------------|--------------------------|
| 20'000.00 | 30'000.00                       | 10'000.00                |
| 30'000.00 | 30'000.00                       | 0.00                     |

## Depotbestand

|                            |
|----------------------------|
| Depotbestand am 01.03.2023 |
| Depotbestand am 03.03.2023 |

| aggregatedQuantity | bookedQuantity | pendingExBrokerageQuantity |
|--------------------|----------------|----------------------------|
| 300                | 200            | 100                        |
| 300                | 300            | 0                          |

### Hinweis

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 |

Die einzelnen Geldbuchungen einer solchen Abrechnung werden im ZKB Dataset File in grob kategorisierten Kategorien, spezifisch auf den jeweiligen Produkttyp, addiert und ausgewiesen

#### Beispiel Auslieferung ZKB Dataset:

Zu Gunsten einer übersichtlicheren Darstellung werden die Attribute nicht von links nach rechts (CSV üblich), sondern von oben nach unten aufgelistet.

| Attribut                              | Wert       | Herleitung                                               |
|---------------------------------------|------------|----------------------------------------------------------|
| grossAmountInReferenceCurrency        | -15'001.00 | Bruttobetrag in Abrechnungswährung (USD)                 |
| foreignCommissionInReferenceCurrency  | 23.98      | Eidg. Umsatzabgabe                                       |
| swissCommissionInReferenceCurrency    | 111.29     | Courtage Aktien                                          |
| variousExpensesInReferenceCurrency    | 0          |                                                          |
| stockExchangeFeesInReferenceCurrency  | 2.82       | Börsengebühr                                             |
| taxAmountInReferenceCurrency          | 0          |                                                          |
| totalExpensesInReferenceCurrency      | 138.09     | Summe aller Spesen (111.29 + 2.82 + 23.98)               |
| other                                 | 0          |                                                          |
| netAmountInReferenceCurrency          | -15'139.09 | Nettobetrag in Abrechnungswährung (USD)                  |
| netAmountInMaccCurrency               | -14'684.90 | Nettobetrag in Kontowährung (CHF)                        |
| fxRateReferenceCurrencyToMaccCurrency | 0.97       | Wechselkurs Abrechnungswährung zu Kontowährung (USD/CHF) |

#### Attributsbeschreibung:

| Attribut                                    | Beschreibung                                                                                                         | Transaktionen |                            |
|---------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------|----------------------------|
|                                             |                                                                                                                      | Wertschriften | Verwaltungs-<br>handlungen |
| foreignCommissionInReferenceCurrency        | Summe aller fremden Kommission, welche bei der Ausführung der Transaktion angefallen sind.                           | X             |                            |
| swissCommissionInReferenceCurrency          | Summe aller inländischen Kommissionen welche bei der Ausführung der Transaktion angefallen sind.                     | X             |                            |
| variousExpensesInReferenceCurrency          | Summierung aller übrigen Spesen, welche in keinem anderen Cluster untergebracht werden konnten.                      | X             | X                          |
| stockExchangeFeesInReferenceCurrency        | Summe aller Börsengebühren, welche von den Börsenplattformen für die Abwicklung der Transaktion erhoben worden sind. | X             |                            |
| taxAmountInReferenceCurrency                | Summe aller regulatorischen Steuern und Gebühren, welche im Zusammenhang mit der Transaktion erhoben worden sind.    | X             |                            |
| totalExpensesInReferenceCurrency            | Zusammenzug alles oben erwähnte Spesen und Gebühren im Zusammenhang mit der ausgeführten Transaktion.                | X             |                            |
| corporateActionTaxAmountInReferenceCurrency | Summe aller Gebühren und Spesen im Zusammenhang mit einer abgerechneten Verwaltungshandlung.                         |               | X                          |
| other                                       | Alle nicht gemappten Abzüge (Fallback).                                                                              | X             | X                          |

#### 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

verwahrenen 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**-*****    |
| OTC Derivategeschäfte           | FX- und PM-Optionen, Interest Rate Swaps, Cross Currency Swap, Cap/Floor, Forward Rate Agreement, Swaptions auf IRS und CDS, Credit Default Swaps, Total Return Swaps | 1-79**-*****    |

### 3 Spezifikation der Datenlieferungen

#### 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 Aufbau und Unterteilung der CSV-Struktur

Die CSV-Struktur kann bei einer Transaktion in verschiedene Bereiche unterteilt werden. Je nach Produkttyp unterscheiden sich die Bereiche und starten in unterschiedlichen Spalten. Bei Positionen gibt es keine Bereiche, zwischen welchen differenziert werden müsste. Folgend sind die Bereiche der verschiedenen Transaktionen-Files mit den zugehörigen Spalten deklariert:

###### 3.1.2.1 Transaktionen – Edelmetall und Devisen

- Abrechnung – Spalte A – AJ

###### 3.1.2.2 Transaktionen – Geldmarkt- und Treuhandanlagen

- Abrechnung – Spalte A – Z

###### 3.1.2.3 Transaktionen – Konto und Darlehen

- Abrechnung – Spalte A – V
- Details Kontozahlung – Spalte W – Z

###### 3.1.2.4 Transaktionen – Wertschriften

- Abrechnung – Spalte A – P
- Geldebuchung - Spalte Q – AH
- Titelnbuchung – Spalte AR – BK

###### 3.1.2.5 Transaktionen – Verwaltungshandlungen

- Abrechnung – Spalte A – M und Y – AI
- Geldebuchung - Spalte N – X
- Titelnbuchung – Spalte AJ – BB

### 3.1.3 Mehrere TitelmBuchungen innerhalb einer Transaktion

Wenn eine Transaktion mehrere TitelmBuchungen enthlt, werden diese gemss folgender Logik abgebildet:

Die Transaktion wird ber mehrere Zeilen im CSV hinweg abgebildet. Der Abrechnungs- und Geldbuchungsteil wiederholt sich jeweils bei den verschiedenen Zeilen und der TitelmBuchungsteil weicht bei den verschiedenen Zeilen ab.

Beispiel:

Kapitalerhhung mit Bezugsrecht im Verhltnis 4 (alt, Bezugsrecht) : 1 (neu, Aktie) : 0.1 (neu, Warrant)

und Bezugspreis von CHF 10.00 je Aktie und Warrant

*Zu Gunsten einer bersichtlicheren Darstellung werden die Attribute nicht von links nach rechts (CSV blich), sondern von oben nach unten aufgelistet. Zudem sind nicht alle Attribute aufgefhrt fr den entsprechenden Bereich aufgefhrt, die vollstndige Verwaltungshandlungs-Struktur ist unter [3.3.1](#) zu finden. Die Bereiche sind farblich markiert, sodass klar ist, zu welchem Bereich die entsprechenden Attribute gehren.*

|               |
|---------------|
| Abrechnung    |
| Geldbuchung   |
| TitelmBuchung |

| Spaltenbezeichnung        | Wert Zeile 1     | Wert Zeile 2     | Wert Zeile 3     |
|---------------------------|------------------|------------------|------------------|
| statementType             | statement        | statement        | statement        |
| transactionIdentification | WS_123456789     | WS_123456789     | WS_123456789     |
| bookingDate               | 06.02.2023       | 06.02.2023       | 06.02.2023       |
| valueDate                 | 06.02.2023       | 06.02.2023       | 06.02.2023       |
| transactionDate           | 06.02.2023       | 06.02.2023       | 06.02.2023       |
| transactionType           | corporateActions | corporateActions | corporateActions |
| transactionSubtype        | capitalIncrease  | capitalIncrease  | capitalIncrease  |
| etc.                      |                  |                  |                  |
| macIdentification         | IBAN             | IBAN             | IBAN             |
| macCurrency               | CHF              | CHF              | CHF              |
| netAmountInMacCurrency    | 1'000.00         | 1'000.00         | 1'000.00         |
| triggeringValorIsin       | CHXXXXXXXXXX     | CHXXXXXXXXXX     | CHXXXXXXXXXX     |
| triggeringValorTypeGroup  | rights           | rights           | rights           |
| etc.                      |                  |                  |                  |
| bookingIdentification     | WS_123456789_1   | WS_123456789_2   | WS_123456789_3   |
| reversalIndicator         | false            | false            | false            |
| positionIdentification    | WS_12345678      | WS_87654321      | WS_85274163      |
| inOutIndicator            | out              | in               | in               |
| quantity                  | 400              | 100              | 10               |
| bookingValorIsin          | CHXXXXXXXXXX     | CHYYYYYYYYYY     | CHZZZZZZZZZZ     |
| bookingValorTypeTelekurs  | rights           | shares           | warrants         |
| ratioOldAsset             | 4                | 4                | 4                |
| ratioNewAsset             | 1                | 1                | 0.1              |
| etc.                      |                  |                  |                  |

### 3.1.4 Darstellung Transaktion Konto und Darlehen

Smtliche Transaktionen, welche Kontobuchungen beinhalten, werden im erwhnten File, im Sinne eines Kontoauszugs, konsolidiert ausgewiesen. Die Transaktion selbst und die Details dazu ist im entsprechenden Transaktionsfile zu finden. Der Link wird ber die "transactionIdentification" gemacht.

### 3.1.5 Darstellung von Betragswerten

Smtliche Betrge, welche innerhalb einer Filestruktur ausgewiesen sind, werden mit einem Vorzeichen ausgeliefert. Das Vorzeichen ist aus Kundensicht dargestellt.

### 3.1.6 Statement, Storno und Rektifikat

Eine Transaktion wird als Neugeschft, 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.

### 3.1.7 Deklaration der Transaktionsarten und Transaktionstypen

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

### 3.1.8 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.

### 3.1.9 Attributsbezeichnung in eDL

Ab dem Kapitel 3.2 sind die Strukturen der CSV Files aufgeführt. In der letzten Spalte "Attributsbezeichnung in eDL" ist jeweils das Vorgänger Attribut in eDL aufgelistet.

## 3.2 Fachliche Definition allgemeiner Teil

Der Header befindet sich in jedem File auf den obersten beiden Zeilen, jeweils in den Spalten A - M. Im Header 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 und Positionen.

*Zu Gunsten einer übersichtlicheren Darstellung werden die Attribute nicht von links nach rechts (CSV üblich), sondern von oben nach unten aufgelistet.*

| Feldname / Attribut | M | Data type | Defintion                                                           | Option / Beispiel                                                                                                         | Attributsbezeichnung in eDL |
|---------------------|---|-----------|---------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------|
| name                | x | string    | Name der Bestellung (gemäss Bestellungskonfiguration)               | Beispielwert:<br>"Bestellung ZKB Dataset"                                                                                 | -                           |
| dataType            | x | string    | Datenfile-Art (gemäss Bestellungskonfiguration)                     | Siehe <a href="#">4.1.34</a>                                                                                              | -                           |
| dateType            | x | string    | Datumsart der Bestellung (gemäss Bestellungskonfiguration)          | Beispielwert:<br>"bookingDate"                                                                                            | -                           |
| periodicity         | x | string    | Periodizität der Bestellung (gemäss Bestellungskonfiguration)       | Beispielwert:<br>"daily"                                                                                                  | -                           |
| fromDate            | x | date      | Startdatum des Datenbezugs (ISO 8601)                               | Beispielwert:<br>"11.09.2023"                                                                                             | -                           |
| toDate              | x | date      | Enddatum des Datenbezugs (ISO 8601)                                 | Beispielwert:<br>"11.09.2023"                                                                                             | -                           |
| deliveryInstruction | x | string    | Bereitstellungsort der Bestellung (gemäss Bestellungskonfiguration) | Beispielwert:<br>"eBanking and authorized server"                                                                         | -                           |
| fileId              | x | integer   | File-ID                                                             | Beispielwert:<br>"89461"                                                                                                  | -                           |
| zkblId              | x | string    | Technische ID ZKB                                                   | Beispielwert:<br>"be624188-641c-4e25-975b-cdec4c16f0c9"                                                                   | -                           |
| createdAt           | x | string    | Zeitpunkt der Generierung                                           | Beispielwert:<br>"2023-10-29T10:47:09"                                                                                    | -                           |
| downloadedAt        | x | string    | Zeitpunkt des Downloads                                             | Beispielwert:<br>"2023-10-29T20:23:19"                                                                                    | -                           |
| warning             |   | string    | Auflistung von Warnungen                                            | Beispiel:<br>"some accounts or safekeeping accounts are not included in the file because rights are missing to show them" | -                           |
| error               |   | string    | Auflistung von Fehlern                                              | Beispielwert:<br>" The server encountered an unexpected condition that prevented it from fulfilling the request. "        | -                           |

### 3.3 Transaktionen

#### 3.3.1 Verwaltungshandlungen

##### 3.3.1.1 Fachliche Beschreibung

| Feldname / Attribut                         | M | Data type | Defintion                                                                    | Option / Beispiel                                  | Attributsbezeichnung in eDL        |
|---------------------------------------------|---|-----------|------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------|------------------------------------|
| statementType                               | x | string    | Abrechnungstyp                                                               | Siehe <a href="#">4.1.19</a>                       | -                                  |
| transactionIdentification                   | x | string    | Identifikationsnummer der Transaktion                                        | Beispielwert:<br>"WS_123456789"<br>"WS_123456789S" | ORDERNRAVQ (+ STORNOKZ)            |
| reversedTransactionIdentification           |   | string    | Identifikationsnummer der ursprünglichen Transaktion, im Falle eines Stornos | Beispielwert:<br>"WS_123456789"                    | -                                  |
| bookingDate                                 | x | date      | Buchungsdatum (ISO 8601)                                                     | Beispielwert:<br>"11.09.2023"                      | BUCHDATE                           |
| valueDate                                   | x | date      | Valutadatum (ISO 8601)                                                       | Beispielwert:<br>"11.09.2023"                      | VALDAT                             |
| transactionDate                             | x | date      | Transaktionsdatum (ISO 8601)                                                 | Beispielwert:<br>"11.09.2023"                      | HANDELDATE                         |
| transactionType                             |   | string    | Die Transaktionsart beschreibt die Art der Transaktion                       | Siehe <a href="#">4.1.16</a>                       | -                                  |
| transactionSubtype                          |   | string    | Erweitert die Transaktionsart                                                | Siehe <a href="#">4.1.17</a>                       | ORDERTYPETXT                       |
| clientIdentification                        |   | string    | Eindeutige Identifikationsnummer des Partners (Besitzer des Geschäfts)       | Beispielwert:<br>"1.234.567-8"                     | CIFSTNR                            |
| portfolioIdentification                     |   | string    | Nummer des Anlageportfolios                                                  | Beispielwert:<br>"9470012345678"                   | PORTFOLIONR                        |
| portfolioReferenceCurrency                  |   | string    | Referenzwährung des Anlageportfolios (ISO 4217)                              | Beispielwert:<br>"CHF"                             | -                                  |
| identificationSafeKeepingAccount            |   | string    | Wertschriftendepot-Nummer                                                    | Beispielwert:<br>"1-2600-12345678"                 | APPLNR + HBNR + ZWNR + GESCHNRKURZ |
| descriptionSafeKeepingAccount               |   | string    | Rubrik des Wertschriftendepots                                               | Beispielwert:<br>"Vermögensverwaltung"             | DEPRUB1                            |
| macIdentification                           |   | string    | Geschäftsnummer / IBAN des Abrechnungskontos                                 | Beispielwert:<br>"CH6500700123456789101"           | IBANNR                             |
| descriptionMacc                             |   | string    | Rubrik des Abrechnungskontos                                                 | Beispielwert:<br>"Anlegen"                         | -                                  |
| maccCurrency                                |   | string    | Kontowährung (ISO 4217)                                                      | Beispielwert:<br>"CHF"                             | KTOWRG                             |
| referenceCurrency                           |   | string    | Abrechnungswährung (ISO 4217)                                                | Beispielwert:<br>"CHF"                             | ABRWRG                             |
| grossAmountInReferenceCurrency              |   | decimal   | Bruttobetrag in Abrechnungswährung                                           | Beispielwert:<br>"325.12"                          | BRUTTOABRWRG                       |
| corporateActionTaxAmountInReferenceCurrency |   | decimal   | Steuern in Abrechnungswährung                                                | Beispielwert:<br>"615.19"                          | STUERNABRWRG                       |
| variousExpensesInReferenceCurrency          |   | decimal   | Diverse Spesen in Abrechnungswährung                                         | Beispielwert:<br>"478.12"                          | -                                  |
| other                                       |   | decimal   | andere Geldebuchungen                                                        | Beispielwert:<br>"325.12"                          | -                                  |
| netAmountInReferenceCurrency                |   | decimal   | Nettobetrag in Abrechnungswährung                                            | Beispielwert:<br>"10000.55"                        | NETABRBETABRWRG                    |
| netAmountInMaccCurrency                     |   | decimal   | Nettobetrag in Kontowährung                                                  | Beispielwert:<br>"10000.55"                        | NETABRBETKTOWRG                    |
| fxRateReferenceCurrencyToMaccCurrency       |   | decimal   | Devisenkurs der Abrechnungswährung zur Kontowährung                          | Beispielwert:<br>"0.722037"                        | -                                  |

| Feldname / Attribut                   | M | Data type | Defintion                                                                                                                                | Option / Beispiel                               | Attributsbezeichnung in eDL |
|---------------------------------------|---|-----------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------|-----------------------------|
| triggeringValorIdentification         |   | string    | Valorennummer mit führenden Nullen                                                                                                       | Siehe <a href="#">4.1.20</a>                    | TRIGVALONR                  |
| triggeringValorIdentificationTelekurs |   | string    | SIX Valorennummer                                                                                                                        | Beispielwert:<br>"23862714"                     | -                           |
| triggeringValorTickerTelekurs         |   | string    | Ticker Telekurs des Valors                                                                                                               | Beispielwert:<br>"BOSN"                         | -                           |
| triggeringValorsin                    |   | string    | ISIN des Valors                                                                                                                          | Beispielwert:<br>"CH0238627142"                 | TRIGISINIVALONR             |
| triggeringValorTextShort              |   | string    | Text kurz des Valors auf 20 Zeichen beschränkt                                                                                           | Beispielwert:<br>"Bossard Hldg N"               | TRIGITKURZTEXT              |
| triggeringValorTextLong               |   | string    | Text lang des Valors                                                                                                                     | Beispielwert:<br>"Namen-Akt Bossard Holding AG" | -                           |
| triggeringValorTypeGroup              |   | string    | Titelart-Gruppe des Valors                                                                                                               | Siehe <a href="#">4.1.24</a>                    | -                           |
| triggeringValorTypeTelekurs           |   | string    | Titelart-Telekurs des Valors                                                                                                             | Siehe <a href="#">4.1.15</a>                    | -                           |
| priceRate                             |   | decimal   | Ausschüttungsbetrag der Verwaltungshandlung                                                                                              | Beispielwert:<br>"3.60"                         | -                           |
| priceType                             |   | string    | Art des Preises                                                                                                                          | Siehe <a href="#">4.1.2</a>                     | -                           |
| currency                              |   | string    | Währung der Corporate Action (ISO 4217)<br>Weist auch aus, falls es sich bei einem der obigen Werte um einen prozentualen Betrag handelt | Beispielwert:<br>"CHF"                          | -                           |
| bookingIdentification                 | x | string    | Identifikationsnummer bei Titelnbuchung                                                                                                  | Beispielwert:<br>"WS_123456789_3"               |                             |
| reversalIndicator                     | x | boolean   | Storno-Indikator                                                                                                                         | Siehe <a href="#">4.1.22</a>                    | STORNOKZ                    |
| positionIdentification                |   | string    | Identifikationsnummer der Position                                                                                                       | Beispielwert:<br>"WS_12346578"                  | -                           |
| bookingTypeSecurity                   | x | string    | Buchungstyp                                                                                                                              | Siehe <a href="#">4.1.4</a>                     | BUCHTYPETXT                 |
| inOutIndicator                        | x | string    | Eingang- und Ausgang-Indikator für die Wertschriften im Depot                                                                            | Siehe <a href="#">4.1.10</a>                    | MUTCDTXT                    |
| quantity                              | x | decimal   | Menge                                                                                                                                    | Beispielwert:<br>"400000"                       | STCKNOM                     |
| unitOfQuantity                        | x | string    | Art der Menge                                                                                                                            | Siehe <a href="#">4.1.1</a>                     | -                           |
| positionCurrency                      | x | string    | Positionswährung (ISO 4217)                                                                                                              | Beispielwert:<br>"CHF"                          | POSWRG                      |
| bookingValorIdentification            | x | string    | Valorennummer mit führenden Nullen                                                                                                       | Siehe <a href="#">4.1.20</a>                    | VALONR                      |
| bookingValorIdentificationTelekurs    |   | string    | SIX Valorennummer                                                                                                                        | Beispielwert:<br>"23862714"                     | -                           |
| bookingValorTickerTelekurs            |   | string    | Ticker Telekurs des Valors                                                                                                               | Beispielwert:<br>"BOSN"                         | -                           |
| bookingValorsin                       |   | string    | ISIN des Valors                                                                                                                          | Beispielwert:<br>"CH0238627142"                 | ISINVALONR                  |
| bookingValorTextShort                 | x | string    | Text kurz des Valors auf 20 Zeichen beschränkt                                                                                           | Beispielwert:<br>"Bossard Hldg N"               | TITKURZTEXT                 |
| bookingValorTextLong                  | x | string    | Text lang des Valors                                                                                                                     | Beispielwert:<br>"Namen-Akt Bossard Holding AG" | -                           |
| bookingValorTypeGroup                 | x | string    | Titelart-Gruppe des Valors                                                                                                               | Siehe <a href="#">4.1.24</a>                    | -                           |
| bookingValorTypeTelekurs              |   | string    | Titelart-Telekurs des Valors                                                                                                             | Siehe <a href="#">4.1.15</a>                    | -                           |
| transactionPriceType                  |   | string    | Art des Preises                                                                                                                          | Siehe <a href="#">4.1.2</a>                     | -                           |
| ratioOldAsset                         |   | decimal   |                                                                                                                                          | Beispielwert:<br>"100"                          |                             |

| Feldname / Attribut        | M | Data type | Defintion                             | Option / Beispiel             | Attributsbezeichnung in eDL |
|----------------------------|---|-----------|---------------------------------------|-------------------------------|-----------------------------|
| ratioNewAsset              |   | decimal   |                                       | Beispielwert:<br>" 1 "        |                             |
| triggeringQuantity         |   | decimal   | Auslösende Postionsmenge              | Beispielwert:<br>" 10000.55 " |                             |
| TriggeringPositionCurrency |   | String    | Währung der auslösenden Postionsmenge | Beispielwert:<br>" CHF "      |                             |

### 3.3.2 Wertschriften

#### 3.3.2.1 Fachliche Beschreibung

Bereitstellung von Transaktionsdaten zu Wertschriftentransaktionen

| Feldname / Attribut               | M | Data type | Defintion                                                                                 | Option / Beispiel                                  | Attributsbezeichnung in eDL        |
|-----------------------------------|---|-----------|-------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------|------------------------------------|
| statementType                     | x | string    | Abrechnungstyp                                                                            | Siehe <a href="#">4.1.19</a>                       |                                    |
| transactionIdentification         | x | string    | Identifikationsnummer der Transaktion                                                     | Beispielwert:<br>"WS_123456789"<br>"WS_123456789S" | ORDERNRAVQ (+ STORNOKZ)            |
| reversedTransactionIdentification |   | string    | Identifikationsnummer der ursprünglichen Transaktion, im Falle eines Stornos              | Beispielwert:<br>"WS_123456789"                    | ORIG_AUFTR_NR                      |
| bookingDate                       | x | date      | Buchungsdatum (ISO 8601)                                                                  | Beispielwert:<br>"11.09.2023"                      | BUCHDATE                           |
| valueDate                         | x | date      | Valutadatum (ISO 8601)                                                                    | Beispielwert:<br>"11.09.2023"                      | VALDAT                             |
| transactionDate                   | x | date      | Transaktionsdatum (ISO 8601)                                                              | Beispielwert:<br>"11.09.2023"                      | HANDELDAT                          |
| exBrokerageIndicator              |   | string    | Ex-Brokerage Indikator<br>Zeigt an, wenn es sich um eine Ex-Brokerage Transaktion handelt | Beispielwert:<br>"true"                            | -                                  |
| brokerName                        |   | string    | Name des fremden Brokers bei einer Ex-Brokerage Transaktion                               | Beispielwert:<br>"Jefferies & Co. Jersey City"     | -                                  |
| brokerIdentification              |   | string    | eindeutige Identifikationsnummer des fremden Brokers bei einer Ex-Brokerage Transaktion   | Beispielwert:<br>"123456"                          | -                                  |
| transactionType                   |   | string    | Die Transaktionsart beschreibt die Art der Transaktion                                    | Siehe <a href="#">4.1.16</a>                       | -                                  |
| transactionSubtype                |   | string    | Erweitert die Transaktionsart                                                             | Siehe <a href="#">4.1.17</a>                       | ORDERTYPETXT                       |
| clientIdentification              |   | string    | Eindeutige Identifikationsnummer des Partners (Besitzer des Geschäfts)                    | Beispielwert:<br>"1.234.567-8"                     | CIFSTNR                            |
| portfolioIdentification           |   | string    | Identifikationsnummer des Anlageportfolios                                                | Beispielwert:<br>"9470012345678"                   | PORTFOLIONR                        |
| portfolioReferenceCurrency        |   | string    | Referenzwährung des Anlageportfolios                                                      | Beispielwert:<br>"CHF"                             | -                                  |
| identificationSafeKeepingAccount  |   | string    | Wertschriftendepot-Nummer                                                                 | Beispielwert:<br>"1-2600-12345678"                 | APPLNR + HBNR + ZWNR + GESCHNRKURZ |
| descriptionSafeKeepingAccount     |   | string    | Rubrik des Wertschriftendepots                                                            | Beispielwert:<br>"Vermögensverwaltung"             | DEPRUB1                            |
| macclIdentification               |   | string    | Geschäftsnummer / IBAN des Abrechnungskontos                                              | Beispielwert:<br>"CH6500700123456789101"           | ABRKONT                            |
| descriptionMacc                   |   | string    | Rubrik des Abrechnungskontos                                                              | Beispielwert:<br>"Steuern"                         | -                                  |
| maccCurrency                      |   | string    | Kontowährung (ISO 4217)                                                                   | Beispielwert:<br>"CHF"                             | KTOWAEHRCD                         |
| tradingCurrency                   |   | string    | Handelswährung (ISO 4217)                                                                 | Beispielwert:<br>"CHF"                             | KURSWAERCD                         |
| referenceCurrency                 |   | string    | Referenzwährung (ISO 4217)                                                                | Beispielwert:<br>"CHF"                             | ABRWAHRCD                          |
| grossAmountInTradingCurrency      |   | decimal   | Bruttobetrag in Handelswährung                                                            | Beispielwert:<br>"10000.55"                        | -                                  |

| Feldname / Attribut                      | M | Data type | Defintion                                                     | Option / Beispiel                                                          | Attributsbezeichnung in eDL |
|------------------------------------------|---|-----------|---------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------|
| grossAmountInReferenceCurrency           |   | decimal   | Bruttobetrag in Abrechnungswährung                            | Beispielwert:<br>"10000.55"                                                | -                           |
| netAmountInReferenceCurrency             |   | decimal   | Nettobetrag in Abrechnungswährung                             | Beispielwert:<br>"10000.55"                                                | NETABRBETABWHG              |
| netAmountInMaccCurrency                  |   | decimal   | Nettobetrag in Kontowährung                                   | Beispielwert:<br>"10000.55"                                                | NETABRBETKTWHG              |
| fxRateTradingCurrencyToReferenceCurrency |   | decimal   | Devisenkurs der Handelswährung zur Abrechnungswährung         | Beispielwert:<br>"5.1234"                                                  | -                           |
| fxRateReferenceCurrencyToMaccCurrency    |   | decimal   | Devisenkurs der Abrechnungswährung zur Kontowährung           | Beispielwert:<br>"0.722037"                                                | -                           |
| mktplaceCode                             |   | string    | Börsenplatz Telekurs-Code                                     | Beispielwert:<br>"4"                                                       | BOEPLCD                     |
| mktplaceIsoCode                          |   | string    | Börsenplatz ISO-Code (ISO 10383)                              | Beispielwert:<br>"XSWX"                                                    | -                           |
| mktplaceNameShort                        |   | string    | Börsenplatz Name kurz                                         | Beispielwert:<br>"SIX Swiss Excha"                                         | -                           |
| mktplaceNameLong                         |   | string    | Börsenplatz Name lang                                         | Beispielwert:<br>"SIX Swiss Exchange"                                      | BOEPLTXT                    |
| averagePriceInTradingCurrency            |   | decimal   | Durchschnittspreis in Handelswährung                          | Beispielwert:<br>"1241.99"                                                 | KURSKW                      |
| averagePriceType                         |   | string    | Art des Preises                                               | Siehe <a href="#">4.1.2</a>                                                | -                           |
| marketValueInReferenceCurrency           |   | decimal   | Kurswert in Abrechnungswährung                                | Beispielwert:<br>"68242.28"                                                | KURSWERTAW                  |
| accruedInterestInReferenceCurrency       |   | decimal   | Marchzins in Abrechnungswährung                               | Beispielwert:<br>"1241.99"                                                 | MARCHZ                      |
| transactionAdditionalDetails             |   | string    | Abrechnungstext zu Lieferspesen                               | Freitext bis 600 Zeichen<br>Beispielwert:<br>"Externe Referenz 5284532742" | -                           |
| foreignCommissionInReferenceCurrency     |   | decimal   | Kommission Ausland in Abrechnungswährung                      | Beispielwert:<br>"6342.98"                                                 | COURTABETR                  |
| swissCommissionInReferenceCurrency       |   | decimal   | Schweizerische Kommission in Abrechnungswährung               | Beispielwert:<br>"8272.23"                                                 | COURTBETR                   |
| variousExpensesInReferenceCurrency       |   | decimal   | Diverse Spesen in Abrechnungswährung                          | Beispielwert:<br>"6412.04"                                                 | DIVSPES                     |
| stockExchangeFeesInReferenceCurrency     |   | decimal   | Börsengebühren in Abrechnungswährung                          | Beispielwert:<br>"2590.68"                                                 | GEBBETR                     |
| taxAmountInReferenceCurrency             |   | decimal   | Betrag Steuern in Abrechnungswährung                          | Beispielwert:<br>"1089.56"                                                 | STUEARBETR                  |
| totalExpensesInReferenceCurrency         |   | decimal   | Summe aller Spesen in Abrechnungswährung                      | Beispielwert:<br>"48532.12"                                                | SPESTOT                     |
| other                                    |   | decimal   | andere                                                        | Beispielwert:<br>"0.00"                                                    | -                           |
| bookingIdentification                    | x | string    | Identifikationsnummer der Buchung                             | Beispielwert:<br>"WS_123456789_3"                                          |                             |
| reversalIndicator                        | x | boolean   | Storno-Indikator                                              | Siehe <a href="#">4.1.22</a>                                               | STORNOKZ                    |
| positionIdentification                   |   | string    | Identifikationsnummer der Position                            | Beispielwert:<br>"WS_12346578"                                             | -                           |
| bookingTypeSecurity                      | x | string    | Buchungstyp                                                   | Siehe <a href="#">4.1.4</a>                                                | BUCHTYPETXT                 |
| inOutIndicator                           | x | string    | Eingang- und Ausgang-Indikator für die Wertschriften im Depot | Siehe <a href="#">4.1.10</a>                                               | MUTCDTXT                    |
| quantity                                 | x | decimal   | Menge                                                         | Beispielwert:<br>"400000"                                                  | STCKNOM                     |
| unitOfQuantity                           | x | string    | Art der Menge                                                 | Siehe <a href="#">4.1.1</a>                                                | -                           |

| Feldname / Attribut                            | M | Data type | Defintion                                                                        | Option / Beispiel                               | Attributsbezeichnung in eDL |
|------------------------------------------------|---|-----------|----------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------|-----------------------------|
| positionCurrency                               | x | string    | Positionswährung (ISO 4217)                                                      | Beispielwert:<br>"CHF"                          | POSWHG                      |
| valorIdentification                            | x | string    | Valorennummer mit führenden Nullen                                               | Siehe <a href="#">4.1.20</a>                    | VALONR                      |
| valorIdentificationTelekurs                    |   | string    | SIX Valorennummer                                                                | Beispielwert:<br>"23862714"                     | -                           |
| valorTickerTelekurs                            |   | string    | Ticker Telekurs des Valors                                                       | Beispielwert:<br>"BOSN"                         | -                           |
| valorisin                                      |   | string    | ISIN des Valors                                                                  | Beispielwert:<br>"CH0238627142"                 | ISINVALONR                  |
| valorTextShort                                 | x | string    | Text kurz des Valors auf 20 Zeichen beschränkt                                   | Beispielwert:<br>"Bossard Hldg N"               | TITKURZTEXT                 |
| valorTextLong                                  | x | string    | Text lang des Valors                                                             | Beispielwert:<br>"Namen-Akt Bossard Holding AG" | -                           |
| valorTypeGroup                                 | x | string    | Titelart-Gruppe des Valors                                                       | Siehe <a href="#">4.1.24</a>                    | -                           |
| valorTypeTelekurs                              |   | string    | Titelart-Telekurs des Valors                                                     | Siehe <a href="#">4.1.15</a>                    | -                           |
| transactionPriceType                           |   | string    | Art des Preises                                                                  | Siehe <a href="#">4.1.2</a>                     | -                           |
| fundsReferenceCurrency                         |   | string    | Fonds-Referenzwährung (ISO 4217)                                                 | Beispielwert:<br>"EUR"                          | -                           |
| fxRatePositionCurrencyToFundsReferenceCurrency |   | decimal   | Devisenkurs der Positionswährung zur Fonds-Referenzwährung                       | Beispielwert:<br>"0.722037"                     | -                           |
| referenceTransactionIdentification             |   | string    | Referenz von einer Settlement Transaktion auf eine Ex-Brokerage STEX Transaktion | Beispielwert:<br>"WS_123456789"                 | -                           |

### 3.3.3 Devisen und Edelmetall

#### 3.3.3.1 Fachliche Beschreibung

Bereitstellung von Transaktionsdaten zu Devisen- und Edelmetalltransaktionen.

| Feldname / Attribut               | M | Data type | Defintion                                                                    | Option / Beispiel                                      | Attributsbezeichnung in eDL        |
|-----------------------------------|---|-----------|------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------|------------------------------------|
| statementType                     | x | string    | Abrechnungstyp                                                               | Siehe <a href="#">4.1.19</a>                           | -                                  |
| transactionIdentification         | x | string    | Identifikationsnummer der Transaktion                                        | Beispielwert:<br>"WS_123456789"                        | -                                  |
| reversedTransactionIdentification |   | string    | Identifikationsnummer der ursprünglichen Transaktion, im Falle eines Stornos | Beispielwert:<br>"WS_123456789"                        | -                                  |
| bookingDate                       | x | date      | Buchungsdatum (ISO 8601)                                                     | Beispielwert:<br>"11.09.2023"                          | -                                  |
| valueDate                         | x | date      | Valutadatum (ISO 8601)                                                       | Beispielwert:<br>"11.09.2023"                          | VERFALL                            |
| transactionDate                   | x | date      | Transaktionsdatum (ISO 8601)                                                 | Beispielwert:<br>"11.09.2023"                          | ABSCHLUSSDATUM                     |
| transactionType                   | x | string    | Die Transaktionsart beschreibt die Art des Auftrags                          | Siehe <a href="#">4.1.16</a>                           | -                                  |
| transactionSubtype                | x | string    | Erweitert die Transaktionsart                                                | Siehe <a href="#">4.1.17</a>                           | -                                  |
| clientIdentification              |   | string    | Eindeutige Identifikationsnummer des Partners (Besitzer des Geschäfts)       | Beispielwert:<br>"1.234.567-8"                         | CIFSTNR                            |
| portfolioIdentification           |   | string    | Identifikationsnummer des Anlageportfolios                                   | Beispielwert:<br>"9470012345678"                       | PORTFOLIONR                        |
| portfolioReferenceCurrency        |   | string    | Referenzwährung des Anlageportfolios (ISO 4217)                              | Beispielwert:<br>"CHF"                                 | -                                  |
| identificationSafeKeepingAccount  |   | string    | Nummer des Geldmarkt- und Devisendepots                                      | Beispielwert:<br>"1-7700-12345678"                     | APPLNR + HBNR + ZWNR + GESCHNRKURZ |
| descriptionSafeKeepingAccount     |   | string    | Rubrik des Wertschriftendepots                                               | Beispielwert:<br>"Vermögensverwaltung"                 | -                                  |
| macIdentificationBuy              |   | string    | Geschäftsnummer / IBAN des Kauf Kontos                                       | Beispielwert:<br>"CH6500700123456789101"               | -                                  |
| macDescriptionBuy                 |   | string    | Rubrik des Kauf Kontos                                                       | Beispielwert:<br>"Anlegen"                             | -                                  |
| macIdentificationSell             |   | string    | Geschäftsnummer / IBAN des Verkauf Kontos                                    | Beispielwert:<br>"CH6500700123456789101"               | -                                  |
| macDescriptionSell                |   | string    | Rubrik des Verkauf Kontos                                                    | Beispielwert:<br>"Anlegen"                             | -                                  |
| positionIdentification            |   | string    | Identifikationsnummer der Position                                           | Beispielwert:<br>"WS_12346578"                         | -                                  |
| fxType                            |   | string    | Art des FX Kontrakts                                                         | Siehe <a href="#">4.1.23</a>                           | -                                  |
| instrumentName                    |   | string    | Kontraktname                                                                 | Beispielwert:<br>"FX Forward - EUR/USD,<br>06.09.2021" | -                                  |
| instrumentIdentification          |   | string    | Kontraktidentifikationsnummer                                                | Beispielwert:<br>"131778719"                           | KONTRAKTNR                         |
| nominalCurrency                   |   | string    | Nominalwährung / gehandelte Währung (ISO 4217)                               | Beispielwert:<br>"EUR"                                 | -                                  |
| buySellIndicator                  |   | string    | Kauf- und Verkauf-Indikator der Nominalwährung                               | Siehe <a href="#">4.1.18</a>                           | KAUF_VERKAUF                       |
| buyAmount                         |   | decimal   | Kaufbetrag (aus Kundensicht)                                                 | Beispielwert:<br>"7126584"                             | BETRAG                             |
| buyCurrency                       |   | string    | Währung des Kaufbetrags (aus Kundensicht) (ISO 4217)                         | Beispielwert:<br>"USD"                                 | WAEHRUNG                           |

| Feldname / Attribut                     | M | Data type | Defintion                                                                                                   | Option / Beispiel               | Attributsbezeichnung in eDL |
|-----------------------------------------|---|-----------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------|-----------------------------|
| sellAmount                              |   | decimal   | Verkauf Betrag (aus Kundensicht)                                                                            | Beispielwert:<br>"6000000"      | GEGENBETRAG                 |
| sellCurrency                            |   | string    | Währung des Verkauf Betrags (aus Kundensicht)<br>(ISO 4217)                                                 | Beispielwert:<br>"EUR"          | GEGENWAEHRUNG               |
| fxRateNominalCurrencyToCo unterCurrency |   | decimal   | Devisenkurs von einer Einheit der gehandelten Währung zu Gegenwährung                                       | Beispielwert:<br>"1.187764"     | KASSAKURS                   |
| fxRateTraded                            |   | decimal   | Effektiv gehandelter Devisenkurs                                                                            | Beispielwert:<br>"0.841918"     | TERMINKURS                  |
| swapReference                           |   | string    | Gemeinsame Referenz der FX Swap Legs                                                                        | Beispielwert:<br>"FXSW.4591277" | -                           |
| ndfFixingCurrency                       |   | string    | Fixing-Währung eines NDF-Geschäfts<br>(ISO 4217)                                                            | Beispielwert:<br>"USD"          | -                           |
| ndfFixingDate                           |   | date      | Fixing-Datum eines NDF-Geschäfts<br>(ISO 8601)                                                              | Beispielwert:<br>"11.09.2023"   | -                           |
| ndfFixingFxRateSource1                  |   | string    | Quelle des Fixing-Kurses 1                                                                                  | Beispielwert:<br>"BRL09"        | -                           |
| ndfFixingFxRateSource2                  |   | string    | Quelle des Fixing-Kurses 2                                                                                  | Beispielwert:<br>"WMR16"        | -                           |
| ndfFixingFxRate                         |   | decimal   | Fixierter Devisenkurs am Fixing-Datum zwischen der Fixing-Währung und der nicht lieferbaren zweiten Währung | Beispielwert:<br>"1.187764"     | -                           |
| ndfFixingAmount                         |   | decimal   | Fixingbetrag in NDF Fixingwährung                                                                           | Beispielwert:<br>"6000000"      | -                           |

### 3.3.4 Konto und Darlehen

#### 3.3.4.1 Fachliche Beschreibung

Bereitstellung von Transaktionsdaten zu Kontotransaktionen und Darlehen aller Art.

| Feldname / Attribut                   | M | Data type | Defintion                                                                              | Option / Beispiel                                          | Attributsbezeichnung in eDL      |
|---------------------------------------|---|-----------|----------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------|----------------------------------|
| statementType                         | x | string    | Abrechnungstyp                                                                         | Siehe <a href="#">4.1.19</a>                               | -                                |
| transactionIdentification             | x | string    | Identifikationsnummer der Transaktion                                                  | Beispielwert:<br>"C98EB7B75C981EED8EB8505CF<br>9DE8BDE001" | -                                |
| reversedTransactionIdentification     |   | string    | Identifikationsnummer der ursprünglichen Transaktion, im Falle eines Stornos           | Beispielwert:<br>"WS_123456789"                            | -                                |
| bookingDate                           | x | date      | Buchungsdatum<br>(ISO 8601)                                                            | Beispielwert:<br>"11.09.2023"                              | REKAPDATUM                       |
| valueDate                             | x | date      | Valutadatum<br>(ISO 8601)                                                              | Beispielwert:<br>"11.09.2023"                              | VALUTADATUM                      |
| transactionDate                       | x | date      | Transaktionsdatum<br>(ISO 8601)                                                        | Beispielwert:<br>"11.09.2023"                              | BUCHDAT                          |
| transactionType                       |   | string    | Die Transaktionsart beschreibt die Art des Auftrags                                    | Siehe <a href="#">4.1.16</a>                               | -                                |
| transactionSubtype                    |   | string    | Erweitert die Transaktionsart                                                          | Siehe <a href="#">4.1.17</a>                               | -                                |
| bookingType                           |   | string    | Buchungstyp                                                                            | Siehe <a href="#">4.1.3</a>                                | -                                |
| clientIdentification                  |   | string    | Eindeutige Identifikationsnummer des Partners (Besitzer des Geschäfts)                 | Beispielwert:<br>"1.234.567-8"                             | CIFSTNR                          |
| portfolioIdentification               |   | string    | Identifikationsnummer des Anlageportfolios                                             | Beispielwert:<br>"9470012345678"                           | PORTFOLIONR                      |
| portfolioReferenceCurrency            |   | string    | Referenzwährung des Anlageportfolios<br>(ISO 4217)                                     | Beispielwert:<br>"CHF"                                     | -                                |
| accountIdentification                 | x | string    | Geschäftsnummer / IBAN                                                                 | Beispielwert:<br>"CH6500700123456789101"                   | IBANNR                           |
| descriptionAccount                    |   | string    | Rubrik des Kontos                                                                      | Beispielwert:<br>"Zahlungen"                               | RUB                              |
| maccCurrency                          | x | string    | Kontowährung<br>(ISO 4217)                                                             | Beispielwert:<br>"CHF"                                     | KONTOWAEHRUNG /<br>WHGENH        |
| referenceCurrency                     |   | string    | Vergütungswährung<br>(ISO 4217)                                                        | Beispielwert:<br>"CHF"                                     | CURRENCY / WHGENH                |
| amountInMaccCurrency                  | x | decimal   | Vergütungsbetrag in Kontowährung                                                       | Beispielwert;<br>"3047.85"                                 | BUCHUNGSBETRAG /<br>BUCHBETRCHF  |
| fxRateReferenceCurrencyToMaccCurrency |   | decimal   | ZKB Umrechnungskurs per Rekapdatum zwischen der "referenceCurrency" und "maccCurrency" | Beispielwert:<br>"1.07465"                                 |                                  |
| amountInReferenceCurrency             |   | decimal   | Vergütungsbetrag in Vergütungswährung                                                  | Beispielwert:<br>"3047.85"                                 | BUCHUNGSBETRAG /<br>MENGEMESSEIN |
| metalAccountIndicator                 | x | boolean   | Indikator, ob es sich um ein Metall-Konto handelt                                      | Siehe <a href="#">0</a>                                    | -                                |
| loanAccountIndicator                  | x | boolean   | Indikator, ob es sich um ein Fester Vorschuss-Konto handelt                            | Siehe <a href="#">0</a>                                    | -                                |
| transactionAdditionalDetails          |   | string    | Buchungstext                                                                           | Beispielwert:<br>"Couponsgutschrift"                       | TRANSAKTIONSTXT                  |
| zvIdentification                      | x | string    | interne Identifikationsnummer des Teilauftrags                                         | Beispielwert:<br>"AM210906A3336565"                        | -                                |
| zvAmountInReferenceCurrency           | x | decimal   | Betrag des Teilauftrags                                                                | Beispielwert:<br>"750.35"                                  | -                                |
| zvReferenceCurrency                   | x | string    | Vergütungswährung<br>(ISO 4217)                                                        | Beispielwert:<br>"CHF"                                     | -                                |

| Feldname / Attribut                  | M | Data type | Defintion                                       | Option / Beispiel                                                            | Attributsbezeichnung in eDL |
|--------------------------------------|---|-----------|-------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------|
| zvTransactionAdditionalDetails       |   | string    | Vertriebstext Detail                            | Beispielwert:<br>"Max Muster, Musterstrasse 1,<br>8001 Zürich" oder "QR-Nr." | -                           |
| reasonForPayment                     |   | string    | Zahlungszweck eines Zahlungsauftrag             | Beispielwert<br>"9894984035064689"                                           | -                           |
| qrReference                          |   | Decimal   | QR Referenz eines Zahlungsauftrags              | "Rechnung 123"                                                               | -                           |
| accountIdentificationBeneficialOwner |   | string    | Kontonummer eines Zahlungsempfängers            | "CH6500700123456789101"                                                      | -                           |
| zvPartyInfo1                         |   | string    | Detailinformation zu einem Zahlungsauftraggeber | Beispielwert:<br>"Max Muster"                                                | -                           |
| zvPartyInfo2                         |   | string    | Detailinformation zu einem Zahlungsauftraggeber | Beispielwert:<br>"Musterstrasse 1"                                           | -                           |
| zvPartyInfo3                         |   | string    | Detailinformation zu einem Zahlungsauftraggeber | Beispielwert:<br>"8001 Zürich"                                               | -                           |
| zvPartyInfo4                         |   | string    | Detailinformation zu einem Zahlungsauftraggeber | Beispielwert:<br>"CH"                                                        | -                           |

### 3.3.5 Geldmarkt- und Treuhandanlagen

#### 3.3.5.1 Fachliche Beschreibung

Bereitstellung von Transaktionsdaten zu Geldmarkt- und Treuhandanlagen-Transaktionen.

| Feldname / Attribut               | M | Data type | Defintion                                                                    | Option / Beispiel                                                                      | Attributsbezeichnung in eDL        |
|-----------------------------------|---|-----------|------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------|
| statementType                     | x | string    | Abrechnungstyp                                                               | Siehe <a href="#">4.1.19</a>                                                           | -                                  |
| transactionIdentification         | x | string    | Identifikationsnummer der Transaktion                                        | Beispielwert:<br>"WS_123456789"                                                        | AUFTRNR                            |
| reversedTransactionIdentification |   | string    | Identifikationsnummer der ursprünglichen Transaktion, im Falle eines Stornos | Beispielwert:<br>"WS_123456789"                                                        | -                                  |
| bookingDate                       | x | date      | Buchungsdatum (ISO 8601)                                                     | Beispielwert:<br>"11.09.2023"                                                          | -                                  |
| valueDate                         | x | date      | Valutadatum (ISO 8601)                                                       | Beispielwert:<br>"11.09.2023"                                                          | VALUTA                             |
| transactionDate                   | x | date      | Transaktionsdatum (ISO 8601)                                                 | Beispielwert:<br>"11.09.2023"                                                          | ABSCHLDAT                          |
| transactionType                   | x | string    | Die Transaktionsart beschreibt die Art des Auftrags                          | Siehe <a href="#">4.1.16</a>                                                           |                                    |
| transactionSubtype                | x | string    | Erweitert die Transaktionsart                                                | Siehe <a href="#">4.1.17</a>                                                           | GESCHART                           |
| moneymarketType                   | x | string    | Art des Geldmarkt Kontrakts                                                  | Siehe <a href="#">4.1.12</a>                                                           | KONTART                            |
| clientIdentification              |   | string    | Eindeutige Identifikationsnummer des Partners (Besitzer des Geschäfts)       | Beispielwert:<br>"1.234.567-8"                                                         | CIFSTNR                            |
| portfolioIdentification           |   | string    | Identifikationsnummer des Anlageportfolios                                   | Beispielwert:<br>"9470012345678"                                                       | PORTFOLIONR                        |
| portfolioReferenceCurrency        |   | string    | Referenzwährung des Anlageportfolios (ISO 4217)                              | Beispielwert:<br>"CHF"                                                                 | -                                  |
| identificationSafeKeepingAccount  |   | string    | Nummer des Geldmarkt- und Devisendepots.                                     | Beispielwert:<br>"1-7700-12345678"                                                     | APPLNR + HBNR + ZWNR + GESCHNRKURZ |
| descriptionSafeKeepingAccount     |   | string    | Rubrik des Wertschriftendepots                                               | Beispielwert:<br>"Vermögensverwaltung"                                                 | -                                  |
| macIdentification                 |   | string    | Geschäftsnummer / IBAN                                                       | Beispielwert:<br>"CH6500700123456789101"                                               | IBANNR                             |
| descriptionMacc                   |   | string    | Rubrik des Kontos                                                            | Beispielwert:<br>"Zahlungen"                                                           | -                                  |
| financialInstrumentName           |   | string    | Kontraktname                                                                 | Beispielwert:<br>"Fiduciary Time USD, 1.33%,<br>13.09.2021-15.09.2021,<br>RABONL2UXXX" | -                                  |
| financialInstrumentIdentification |   | string    | Kontraktidentifikationsnummer                                                | Beispielwert:<br>"131778740"                                                           | -                                  |
| positionIdentification            |   | string    | Identifikationsnummer der Position                                           | Beispielwert:<br>"WS_12346578"                                                         | -                                  |
| currency                          |   | string    | Referenzwährung (ISO 4217)                                                   | Beispielwert:<br>"CHF"                                                                 | BETRWHG                            |
| amount                            |   | decimal   | Abrechnungsbetrag                                                            | Beispielwert:<br>"1000000"                                                             | BETR                               |
| interestAmount                    |   | decimal   | Bruttobetrag der abgerechneten Zinsen                                        | Beispielwert:<br>"50024.65"                                                            | BRUTTOZINS                         |
| withholdingTaxOnInterestAmount    |   | decimal   | Betrag der Verrechnungssteuer bei einem Geldmarktgeschäft                    | Beispielwert:<br>"18006.80"                                                            | VERRECHNUNGSSTEUER                 |
| commission                        |   | decimal   | Betrag der Kommission auf Treuhandanlagen                                    | Beispielwert:<br>"10000"                                                               | KOMMISSIONSBETRAG                  |
| vatOnCommission                   |   | decimal   | Betrag der Mehrwertsteuer auf einer Treuhandanlagen-Kommission               | Beispielwert:<br>"860.00"                                                              | MWSTBETRAG                         |

| Feldname / Attribut | M | Data type | Defintion               | Option / Beispiel          | Attributsbezeichnung in eDL |
|---------------------|---|-----------|-------------------------|----------------------------|-----------------------------|
| netAmount           |   | decimal   | Netto Abrechnungsbetrag | Beispielwert:<br>"3000000" | NETTOZINS                   |

### 3.3.6 OTC-Derivate

#### 3.3.6.1 Fachliche Beschreibung

Bereitstellung von Transaktionsdaten zu OTC-Transaktionen.

| Feldname / Attribut               | M | Data type | Defintion                                                                    | Option / Beispiel                                    |
|-----------------------------------|---|-----------|------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|
| statementType                     | x | string    | Abrechnungstyp                                                               | Siehe <a href="#">4.1.19</a>                         |
| transactionIdentification         | x | string    | Identifikationsnummer der Transaktion                                        | Beispielwert:<br>"WS_123456789"                      |
| reversedTransactionIdentification |   | string    | Identifikationsnummer der ursprünglichen Transaktion, im Falle eines Stornos | Beispielwert:<br>"WS_123456789S"                     |
| bookingDate                       | x | date      | Buchungsdatum (ISO 8601)                                                     | Beispielwert:<br>"2024-01-20"                        |
| valueDate                         | x | date      | Valutadatum (ISO 8601)                                                       | Beispielwert:<br>"2024-01-20"                        |
| transactionDate                   | x | date      | Transaktionsdatum (ISO 8601)                                                 | Beispielwert:<br>"2024-01-20"                        |
| transactionType                   | x | string    | Die Transaktionsart beschreibt die Art des Auftrags                          | Beispielwert:<br>"otc"                               |
| transactionSubtype                | x | string    | Erweitert die Transaktionsart                                                | Siehe <a href="#">4.1.17</a>                         |
| otcInstrumentTypCode              | x | string    | Art des OTC-Instrumentes                                                     | Siehe <a href="#">4.1.26</a>                         |
| otcInstrumentSubtypCode           | x | String    | Subtyp des OTC-Instrumentes                                                  | Siehe <a href="#">4.1.27</a>                         |
| clientIdentification              |   | string    | Eindeutige Identifikationsnummer des Partners (Besitzer des Geschäfts)       | Beispielwert:<br>"1.234.567-8"                       |
| portfolioIdentification           |   | string    | Identifikationsnummer des Anlageportfolios                                   | Beispielwert:<br>"9-4700-12345678"                   |
| portfolioReferenceCurrency        |   | string    | Referenzwährung des Anlageportfolios                                         | Beispielwert:<br>"CHF"                               |
| identificationSafeKeepingAccount  |   | string    | OTC-Derivedepot-Nummer                                                       | Beispielwert:<br>"1-7900-12345678"                   |
| descriptionSafeKeepingAccount     |   | String    | Rubrik des OTC-Derivedepots                                                  | Beispielwert:<br>"Vermögensverwaltung"               |
| financialInstrumentName           |   | string    | Name des Instruments                                                         | Beispielwert:<br>"IRS - EUR 05.04.2024 - 05.04.2027" |
| financialInstrumentIdentification |   | string    | Kontraktidentifikationsnummer                                                | Beispielwert:<br>"IRS.123456789"                     |
| positionIdentification            |   | string    | Identifikationsnummer der Position                                           | Beispielwert:<br>"12346578"                          |
| optionType                        |   | string    | Optionstyp                                                                   | Siehe <a href="#">4.1.14</a>                         |
| callAmount                        |   | decimal   | Callbetrag                                                                   | Beispielwert:<br>"1000000.15"                        |
| callCurrency                      |   | string    | Callwährung                                                                  | Beispielwert:<br>"CHF"                               |
| macIdentificationCall             |   | string    | Kontonummer / IBAN                                                           | Beispielwert:<br>"CH6500700123456789101"             |
| putAmount                         |   | decimal   | Putbetrag                                                                    | Beispielwert:<br>"1000000.15"                        |
| putCurrency                       |   | string    | Putwährung                                                                   | Beispielwert:<br>"EUR"                               |
| macIdentificationPut              |   | string    | Kontonummer / IBAN                                                           | Beispielwert:                                        |

| Feldname / Attribut              | M | Data type | Defintion                                                                                                          | Option / Beispiel             |
|----------------------------------|---|-----------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------|
|                                  |   |           |                                                                                                                    | "CH6500700123456789101"       |
| strikePrice                      |   | decimal   | Strikebetrag                                                                                                       | Beispielwert:<br>"1.025"      |
| strikePricePretty                |   | decimal   | Strikebetrag Pretty                                                                                                | Beispielwert:<br>"0.9756"     |
| strikeCurrency                   |   | string    | Strikewährung                                                                                                      | Beispielwert:<br>"CHF"        |
| strikePriceType                  |   | string    | Art des Strikepreises                                                                                              | Siehe <a href="#">4.1.28</a>  |
| optionStyle                      |   | string    | Optionsart                                                                                                         | Siehe <a href="#">4.1.7</a>   |
| settlementTypeCode               |   | string    | Lieferart                                                                                                          | Siehe <a href="#">4.1.29</a>  |
| upperBarrier                     |   | decimal   | Obere Barriere                                                                                                     | Beispielwert:<br>"1.05"       |
| upperBarrierTypeCode             |   | string    | Obere Barriere Typ                                                                                                 | Siehe <a href="#">4.1.35</a>  |
| lowerBarrier                     |   | decimal   | Untere Barriere                                                                                                    | Beispielwert:<br>"0.96"       |
| lowerBarrierTypeCode             |   | string    | Untere Barriere Typ                                                                                                | Siehe <a href="#">4.1.35</a>  |
| leg1nominalAdjustmentLeg         |   | decimal   | Veränderung Nominalbetrag<br>Leg 1 durch diese Transaktion                                                         | Beispielwert:<br>"5000000"    |
| leg1nominalAdjustmentLegCurrency |   | string    | Währung Leg1                                                                                                       | Beispielwert:<br>"CHF"        |
| leg1interestStartDate            |   | date      | Zins-Start-Datum Leg 1 ganze<br>Laufzeit; Ausnahme<br>Zinszahlungen = Zins-Start-Datum<br>abgerechnete Zinsperiode | Beispielwert:<br>"2024_01_20" |
| leg1interestEndDate              |   | date      | Zins-End-Datum Leg 1 ganze<br>Laufzeit; Ausnahme<br>Zinszahlungen = Zins-End-Datum<br>abgerechnete Zinsperiode     | Beispielwert:<br>"2024_01_20" |
| leg1calculatedInterestRate       |   | decimal   | Abgerechneter Zinssatz Leg 1 bei<br>Zinszahlungen. Zeigt<br>Nettozinssatz (Zins +/- Spread)                        | Beispielwert:<br>"2.125"      |
| leg2nominalAdjustmentLeg         |   | decimal   | Veränderung Nominalbetrag<br>Leg 2 durch diese Transaktion                                                         | Beispielwert:<br>"5000000"    |
| leg2nominalAdjustmentLegCurrency |   | string    | Währung Leg2                                                                                                       | Beispielwert:<br>"CHF"        |
| leg2interestStartDate            |   | date      | Zins-Start-Datum Leg 2 ganze<br>Laufzeit; Ausnahme<br>Zinszahlungen = Zins-Start-Datum<br>abgerechnete Zinsperiode | Beispielwert:<br>"2024_01_20" |
| leg2interestEndDate              |   | date      | Zins-End-Datum Leg 2 ganze<br>Laufzeit; Ausnahme<br>Zinszahlungen = Zins-End-Datum<br>abgerechnete Zinsperiode     | Beispielwert:<br>"2024_01_20" |
| leg2calculatedInterestRate       |   | decimal   | Abgerechneter Zinssatz Leg 2 bei<br>Zinszahlungen. Zeigt<br>Nettozinssatz (Zins +/- Spread)                        | Beispielwert:<br>"2.125"      |
| currency                         |   | string    | Abrechnungswährung                                                                                                 | Beispielwert:<br>"CHF"        |
| interest1Amount                  |   | decimal   | Effektiver Zinsbetrag oder<br>aufgelaufener Zinsbetrag in<br>Abrechnungswährung pro Leg                            | Beispielwert:<br>"1000000.15" |
| interest2Amount                  |   | decimal   | Effektiver Zinsbetrag oder<br>aufgelaufener Zinsbetrag in<br>Abrechnungswährung pro Leg                            | Beispielwert:<br>"1000000.15" |
| premiumAmount                    |   | decimal   | Prämienbetrag in<br>Abrechnungswährung                                                                             | Beispielwert:<br>"1000000.15" |

| Feldname / Attribut     | M | Data type | Defintion                                                                    | Option / Beispiel                        |
|-------------------------|---|-----------|------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------|
| unwindFeeAmount         |   | decimal   | Abgeltungsbetrag in Abrechnungswährung aus Gattstellung                      | Beispielwert:<br>"1000000.15"            |
| cashSettlementAmount    |   | decimal   | Barabgeltung in Abrechnungswährung                                           | Beispielwert:<br>"1000000.15"            |
| additionalPaymentAmount |   | decimal   | Zusatzzahlung in Abrechnungswährung (Upfront Fee, Balloon Fee, Novation Fee) | Beispielwert:<br>"1000000.15"            |
| netAmount               |   | decimal   | Netto-Abrechnungsbetrag in Abrechnungswährung                                | Beispielwert:<br>"1000000.15"            |
| macIdentification       |   | string    | Kontonummer / IBAN                                                           | Beispielwert:<br>"CH6500700123456789101" |
| descriptionMacc         |   | string    | Rubrik des Kontos                                                            | Beispielwert:<br>"Zahlungen"             |

### 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                        | Attributsbezeichnung in eDL        |
|--------------------------------------------|---|-----------|------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------|------------------------------------|
| positionIdentification                     | x | string    | Identifikationsnummer der Position                                                       | Beispielwert:<br>"WS_12346578"           | -                                  |
| clientIdentification                       |   | string    | Eindeutige Identifikationsnummer des Partners (Besitzer des Geschäfts)                   | Beispielwert:<br>"1.234.567-8"           | -                                  |
| portfolioIdentification                    |   | string    | Identifikationsnummer des Anlageportfolios                                               | Beispielwert:<br>"9470012345678"         | PORTFOLIONR                        |
| portfolioReferenceCurrency                 |   | string    | Referenzwährung des Anlageportfolios (ISO 4217)                                          | Beispielwert:<br>"CHF"                   | -                                  |
| accountIdentification                      | x | string    | Geschäftsnummer / IBAN                                                                   | Beispielwert:<br>"CH6500700123456789101" | APPLNR + HBNR + ZWNR + GESCHNRKURZ |
| descriptionAccount                         |   | string    | Rubrik des Kontos                                                                        | Beispielwert:<br>"Zahlungen"             | DEPRUB1                            |
| positionCurrency                           | x | string    | Positionswährung (ISO 4217)                                                              | Beispielwert:<br>"CHF"                   | POSWHG                             |
| aggregatedQuantity                         | x | decimal   | Summe von penderter und gebuchter Menge                                                  | Beispielwert:<br>"600000"                |                                    |
| bookedQuantity                             | x | decimal   | Gebuchte Menge                                                                           | Beispielwert:<br>"400000"                | BSTDSTCKNOM                        |
| pendingExBrokerageQuantity                 | x | decimal   | Pendente Buchung aus Ex-Brokerage Transaktion                                            | Beispielwert:<br>"200000"                |                                    |
| unitOfQuantity                             | x | string    | Art der Menge                                                                            | Siehe <a href="#">4.1.1</a>              | -                                  |
| safeKeepingPlace                           | x | integer   | Code der Depotstelle der Position                                                        | Beispielwert:<br>"CHASU544XXX"           | DEPSTEL2                           |
| safeKeepingAccountRefCurrency              | x | string    | Referenzwährung des Wertschriftendepots (ISO 4217)                                       | Beispielwert:<br>"EUR"                   | DEPOTREF_WHRG                      |
| costPriceInPositionCurrency                |   | decimal   | Einstandspreis in Positionswährung                                                       | Beispielwert:<br>"22.18"                 | EINSTKURSPOSWHG                    |
| costPriceInSafeKeepingAccountRefCurrency   |   | decimal   | Einstandspreis in Wertschriftendepot Referenzwährung                                     | Beispielwert:<br>"23.06"                 | -                                  |
| costPriceType                              |   | string    | Art des Preises                                                                          | Siehe <a href="#">4.1.2</a>              | -                                  |
| costPriceFxRate                            |   | decimal   | Devisenkurs der Positionswährung zu Wertschriftendepot Referenzwährung zum Kaufzeitpunkt | Beispielwert:<br>"1.2867"                | EINSTDEVK                          |
| costValueInPositionCurrency                |   | decimal   | Einstandswert in Positionswährung                                                        | Beispielwert:<br>"80056.84"              | EINSTWERTPOSWHG                    |
| costValueInSafeKeepingAccountRefCurrency   |   | decimal   | Einstandswert in Depotreferenzwährung                                                    | Beispielwert:<br>"90001.08"              | EINSTWDRW                          |
| lastBookingDate                            |   | date      | Buchungsdatum der letzten Bestandesveränderung (ISO 8601)                                | Beispielwert:<br>"11.09.2023"            | BUCHDAT                            |
| marketValueInPositionCurrency              |   | decimal   | Aktueller Wert in Positionswährung                                                       | Beispielwert:<br>"120056.84"             | KURSWERTPOSWHG                     |
| marketValueInSafeKeepingAccountRefCurrency |   | decimal   | Aktueller Wert in Wertschriftendepot-Referenzwährung                                     | Beispielwert:<br>"126085.12"             | KURSWDEPWHG                        |
| marketPrice                                |   | decimal   | Marktpreis der Position                                                                  | Beispielwert:<br>"28.95"                 | BOEKURS                            |
| marketPriceCurrency                        |   | string    | Währung des Kurses (ISO 4217)                                                            | Beispielwert:<br>"EUR"                   | KURSWAEHRCD                        |

| Feldname / Attribut                         | M | Data type | Defintion                                                              | Option / Beispiel                               | Attributsbezeichnung in eDL |
|---------------------------------------------|---|-----------|------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------|-----------------------------|
| marketPriceFxRate                           |   | decimal   | Devisenkurs der Positionswährung zu Wertschriftendepot Referenzwährung | Beispielwert:<br>"0.9856"                       | DEVKURS                     |
| marketPriceType                             |   | string    | Art des Preises                                                        | Siehe <a href="#">4.1.2</a>                     | -                           |
| marketPriceDate                             |   | date      | Datum des Kurses (ISO 8601)                                            | Beispielwert:<br>"11.09.2023"                   | LETHANDDAT                  |
| accruedInterestInPositionCurrency           |   | decimal   | Marchzins in Positionswährung                                          | Beispielwert:<br>"400.12"                       | -                           |
| accruedInterestInSafeKeepingAccountCurrency |   | decimal   | Marchzins in Wertschriftendepot Referenzwährung                        | Beispielwert:<br>"685.32"                       | -                           |
| valorIdentification                         | x | string    | Valorennummer mit führenden Nullen                                     | Siehe <a href="#">4.1.20</a>                    | VALONR                      |
| valorIdentificationTelekurs                 |   | string    | SIX Valorennummer                                                      | Beispielwert:<br>"23862714"                     | -                           |
| valorTickerTelekurs                         |   | string    | Ticker Telekurs des Valors                                             | Beispielwert:<br>"BOSN"                         | -                           |
| valorIsin                                   |   | string    | ISIN des Valors                                                        | Beispielwert:<br>"CH0238627142"                 | ISINVALONR                  |
| valorTextShort                              |   | string    | Text kurz des Valors auf 20 Zeichen beschränkt                         | Beispielwert:<br>"Bossard Hldg N"               | TITKURZTEXT                 |
| valorTextLong                               |   | string    | Text lang des Valors                                                   | Beispielwert:<br>"Namen-Akt Bossard Holding AG" | -                           |
| valorTypeGroup                              |   | string    | Titelart-Gruppe des Valors                                             | Siehe <a href="#">4.1.24</a>                    | INSTINVGRP                  |
| valorTypeTelekurs                           |   | string    | Titelart-Telekurs des Valors                                           | Siehe <a href="#">4.1.15</a>                    | -                           |
| valorStatus                                 | x | string    | Status des Valors                                                      | Siehe <a href="#">4.1.13</a>                    | -                           |
| valorOpeningDate                            |   | date      | Eröffnungsdatum des Instruments (ISO 8601)                             | Beispielwert:<br>"11.04.2014"                   | -                           |
| valorEndDate                                |   | date      | Endverfalldatum des Instruments (ISO 8601)                             | Beispielwert:<br>"05.01.2024"                   | FAELLIGK                    |
| valorInterestRate                           |   | decimal   | Zinssatz                                                               | Beispielwert:<br>"8.5"                          | ZINSSATZ                    |
| valorInterestFrequencyCode                  |   | string    | Zinsusanz                                                              | Siehe <a href="#">4.1.5</a>                     | ZINSUSTXT                   |
| valorFirstInterestPaymentDate               |   | date      | erster Zinszahlungstermin (ISO 8601)                                   | Beispielwert:<br>"05.07.2012"                   | -                           |
| valorInterestPeriod                         |   | string    | Periodizität der Zinsgutschrift                                        | Siehe <a href="#">4.1.6</a>                     | -                           |
| valorOptionType                             |   | string    | Valor Optionstyp                                                       | Siehe <a href="#">4.1.14</a>                    | OPTION_CONTRACT_TYPE        |
| valorOptionStyle                            |   | string    | Valor Optionsstil                                                      | Siehe <a href="#">4.1.7</a>                     | -                           |
| valorContractAmount                         |   | decimal   | Kontraktgrösse des Valors                                              | Beispielwert:<br>"100"                          | CONTRACT_SIZE               |
| valorSmallestDenomination                   |   | decimal   | kleinste Stückelung des Valors                                         | Beispielwert:<br>"1"                            | -                           |
| valorMinimumTradeVolume                     |   | decimal   | Mindesthandelsmenge des Valors                                         | Beispielwert:<br>"100000"                       | -                           |
| numberOfUnderlyingValors                    | x | integer   | Anzahl der Basisvaloren des Valors                                     | Beispielwert:<br>"1"                            | -                           |
| settlementTypeCode                          |   | String    | Erfüllungsart Option                                                   | Siehe <a href="#">4.1.29</a>                    | -                           |
| accumVarMarginInPositionCurrency            |   | decimal   | Kumulierte Variation Margins in Position Currency                      | Beispielwert:<br>"500.50"                       | -                           |
| accumVarMarginInSafeKeepingRefCurrency      |   | decimal   | Kumulierte Variation Margins in Wertschriftendepot Referenzwährung     | Beispielwert:<br>"500.50"                       | -                           |

### 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                                             | Attributsbezeichnung in eDL |
|-----------------------------------------|---|-----------|-----------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------|-----------------------------|
| positionIdentification                  | x | string    | Identifikationsnummer der Position                                          | Beispielwert:<br>"WS_86035105"                                | -                           |
| clientIdentification                    |   | string    | Eindeutige Identifikationsnummer des Partners (Besitzer des Geschäfts)      | Beispielwert:<br>"1.234.567-8"                                | CIFSTNR                     |
| portfolioIdentification                 |   | string    | Identifikationsnummer des Anlageportfolios                                  | Beispielwert:<br>"9470012345678"                              | PORTFOLIONR                 |
| portfolioReferenceCurrency              |   | string    | Referenzwährung des Anlageportfolios (ISO 4217)                             | Beispielwert:<br>"CHF"                                        | -                           |
| accountIdentification                   | x | string    | Geschäftsnummer / IBAN                                                      | Beispielwert:<br>"CH6500700123456789101"                      | -                           |
| descriptionAccount                      |   | string    | Rubrik des Kontos                                                           | Beispielwert:<br>"Zahlungen"                                  | -                           |
| positionCurrency                        | x | string    | Positionswährung (ISO 4217)                                                 | Beispielwert:<br>"CHF"                                        | -                           |
| currentPrice                            | x | decimal   | aktueller Bewertungskurs                                                    | Beispielwert:<br>"123654.98"                                  | -                           |
| priceDate                               | x | date      | Datum der Bewertung (ISO 8601)                                              | Beispielwert:<br>"11.09.2023"                                 | -                           |
| valuation                               | x | decimal   | Wiederbeschaffungswert in Fremdwährung                                      | Beispielwert:<br>"200000.35"                                  | -                           |
| valuationCurrency                       | x | string    | Währung des Wiederbeschaffungswertes in Fremdwährung (ISO 4217)             | Beispielwert:<br>"EUR"                                        | -                           |
| swapReference                           |   | string    | Swap Referenz                                                               | Beispielwert:<br>"FXSW.4591234"                               | -                           |
| fxType                                  | x | string    | Art des Devisen Kontrakts inklusive Information über die Kontraktentstehung | Siehe <a href="#">4.1.23</a>                                  | -                           |
| instrumentName                          | x | string    | Kontraktname                                                                | Beispielwert:<br>"Forex Forward Far Leg - EUR/CHF 06.09.2021" | -                           |
| instrumentIdentification                | x | string    | Kontraktidentifikationsnummer                                               | Beispielwert:<br>"131778726"                                  | KONTRAKTNR                  |
| nominalCurrency                         | x | string    | Nominalwährung / gehandelte Währung (ISO 4217)                              | Beispielwert:<br>"EUR"                                        | -                           |
| buySellIndicator                        | x | string    | Indikator, ob es sich aus Sicht Kunde um einen Kauf oder Verkauf handelt    | Siehe <a href="#">4.1.18</a>                                  | KAUF_VERKAUF                |
| buyAmount                               | x | decimal   | Kaufbetrag Kunde                                                            | Beispielwert:<br>"900000"                                     | BETRAG                      |
| buyCurrency                             | x | string    | Währung des Kaufbetrag Kunde (ISO 4217)                                     | Beispielwert:<br>"USD"                                        | WAEHRUNG                    |
| sellAmount                              | x | decimal   | Verkaufbetrag Kunde                                                         | Beispielwert:<br>"800000"                                     | GEGENBETRAG                 |
| sellCurrency                            | x | string    | Währung des Verkaufbetrag Kunde (ISO 4217)                                  | Beispielwert:<br>"EUR"                                        | GEGENWAEHRUNG               |
| fxRateNominalCurrencyToCo unterCurrency | x | decimal   | Devisenkurs von einer Einheit der gehandelten Währung zu Gegenwährung       | Beispielwert:<br>"1.086071"                                   | KASSAKURS                   |
| fxRateTraded                            | x | decimal   | Effektiv gehandelter Devisenkurs                                            | Beispielwert:<br>"1.086071"                                   | TERMINKURS                  |

| Feldname / Attribut    | M | Data type | Defintion                                                                                                | Option / Beispiel             | Attributsbezeichnung in eDL |
|------------------------|---|-----------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------|-----------------------------|
| ndfFixingCurrency      |   | string    | Fixingwährung eines NDF-Geschäfts (ISO 4217)                                                             | Beispielwert:<br>"EUR"        | -                           |
| ndfFixingDate          |   | date      | Fixingdatum eines NDF-Geschäfts (ISO 8601)                                                               | Beispielwert:<br>"11.09.2023" | -                           |
| ndfFixingFxRateSource1 |   | string    | Quelle des Fixingkurses 1                                                                                | Beispielwert:<br>"BRL09"      | -                           |
| ndfFixingFxRateSource2 |   | string    | Quelle des Fixingkurses 2                                                                                | Beispielwert:<br>"WMR03"      | -                           |
| ndfFixingFxRate        |   | decimal   | Fixierter Devisenkurs am Fixingdatum zwischen der Fixingwährung und der nichtlieferbaren zweiten Währung | Beispielwert:<br>"1.086071"   | -                           |
| ndfFixingAmount        |   | decimal   | Fixingbetrag in NDF Fixingwährung "EUR"                                                                  | Beispielwert:<br>"500000"     | -                           |
| tradeDate              |   | date      | Transaktionsdatum                                                                                        | Beispielwert:<br>"11.09.2023" | -                           |
| maturityDate           |   | date      | Fälligkeitsdatum                                                                                         | Beispielwert:<br>"11.09.2023" | -                           |

### 3.4.3 Konto und Darlehen

#### 3.4.3.1 Fachliche Beschreibung

Bereitstellung von Positionsdaten zu Positionen von Konten und Darlehen.

| Feldname / Attribut                          | M | Data type | Defintion                                                                         | Option / Beispiel                        | Attributsbezeichnung in eDL |
|----------------------------------------------|---|-----------|-----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------|-----------------------------|
| positionIdentification                       | x | string    | Identifikationsnummer der Position                                                | Beispielwert:<br>"WS_86035105"           | -                           |
| clientIdentification                         |   | string    | Eindeutige Identifikationsnummer des Partners (Besitzer des Geschäfts)            | Beispielwert:<br>"1.234.567-8"           | CIFSTNR                     |
| portfolioIdentification                      |   | string    | Identifikationsnummer des Anlageportfolios                                        | Beispielwert:<br>"9470012345678"         | PORTFOLIONR                 |
| portfolioReferenceCurrency                   |   | string    | Referenzwährung des Anlageportfolios (ISO 4217)                                   | Beispielwert:<br>"CHF"                   | -                           |
| accountIdentification                        | x | string    | Geschäftsnummer / IBAN                                                            | Beispielwert:<br>"CH6500700123456789101" | IBANNR                      |
| descriptionAccount                           |   | string    | Rubrik des Kontos                                                                 | Beispielwert:<br>"Zahlungen"             | RUB                         |
| positionCurrency                             | x | string    | Positionswährung (ISO 4217)                                                       | Beispielwert:<br>"CHF"                   | WAEHR / WHGENH              |
| balance                                      | x | decimal   | Buchsaldo                                                                         | Beispielwert:<br>"1000000"               | SALDOFRW /<br>MENGEMESNH    |
| balanceInclUnbookedTransactions              | x | decimal   | Saldo angepasst um kontoseitig noch nicht verbuchte Transaktionen                 | Beispielwert:<br>"1010000"               | -                           |
| amountInclUnbookedTransactionsInMaccCurrency | x | decimal   | Saldo angepasst um kontoseitig noch nicht verbuchte Transaktionen in Kontowährung | Beispielwert:<br>"1010000"               | -                           |
| pendingExBrokerageAmount                     | x | decimal   | Pendente Buchung aus Ex-Brokerage Transaktion                                     | Beispielwert:<br>"10000"                 | -                           |
| product                                      |   | string    | Produktbezeichnung für Hypotheken und Darlehen                                    | Siehe <a href="#">4.1.11</a>             | -                           |
| interestRate                                 |   | decimal   | Zinssatz                                                                          | Beispielwert:<br>"1.5"                   | -                           |
| interestFrequencyCode                        |   | string    | Zinsusanz                                                                         | Siehe <a href="#">4.1.8</a>              | -                           |
| nextInterestPaymentDate                      |   | date      | Nächster Zinszahlungstermin (ISO 8601)                                            | Beispielwert:<br>"31.03.2022"            | -                           |
| interestPeriod                               |   | string    | Periodizität der Zinsbelastung                                                    | Siehe <a href="#">4.1.9</a>              | -                           |
| termStart                                    |   | date      | Laufzeit Beginn (ISO 8601)                                                        | Beispielwert:<br>"01.01.2018"            | -                           |
| termEnd                                      |   | date      | Laufzeit Ende (ISO 8601)                                                          | Beispielwert:<br>"01.01.2025"            | -                           |
| balanceInChf                                 |   | decimal   | Buchsaldo in CHF                                                                  | Beispielwert:<br>"1000000"               | SALDOCHF                    |

### 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                                                     | Attributsbezeichnung in eDL |
|-----------------------------------|---|-----------|------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------|-----------------------------|
| positionIdentification            | x | string    | Identifikationsnummer der Position                                     | Beispielwert:<br>"WS_86035105"                                        | POSNR                       |
| clientIdentification              |   | string    | Eindeutige Identifikationsnummer des Partners (Besitzer des Geschäfts) | Beispielwert:<br>"1.234.567-8"                                        | CIFSTNR                     |
| portfolioIdentification           |   | string    | Identifikationsnummer des Anlageportfolios                             | Beispielwert:<br>"9470012345678"                                      | PORTFOLIONR                 |
| portfolioReferenceCurrency        |   | string    | Referenzwährung des Anlageportfolios (ISO 4217)                        | Beispielwert:<br>"CHF"                                                | -                           |
| accountIdentification             | x | string    | Geschäftsnummer / IBAN                                                 | Beispielwert:<br>"CH6500700123456789101"                              | IBANNR                      |
| descriptionAccount                |   | string    | Rubrik des Kontos                                                      | Beispielwert:<br>"Zahlungen"                                          | -                           |
| positionCurrency                  | x | string    | Positionswährung (ISO 4217)                                            | Beispielwert:<br>"CHF"                                                | WAEHRCDCGMT                 |
| balance                           | x | decimal   | Aktueller Anlagebetrag in Positionswährung                             | Beispielwert:<br>"15000000"                                           | AKTLBETRFRW                 |
| moneymarketType                   | x | string    | Typ der Geldmarkt- oder Treuhandanlage                                 | Siehe <a href="#">4.1.12</a>                                          | -                           |
| financialInstrumentName           | x | string    | Kontraktname                                                           | Beispielwert:<br>"Money Market Time USD,<br>1.33%, 13.09.21-15.09.21" | -                           |
| financialInstrumentIdentification | x | string    | Kontraktidentifikationsnummer                                          | Beispielwert:<br>"131778743"                                          | -                           |
| valueFromDate                     | x | date      | Start Valutadatum der Geldmarkt- oder Treuhandanlage (ISO 8601)        | Beispielwert:<br>"13.09.2021"                                         | VALDATVON                   |
| valueToDate                       |   | date      | Verfallsdatum der Geldmarkt- oder Treuhandanlage (ISO 8601)            | Beispielwert:<br>"15.09.2021"                                         | VALDATBIS                   |
| interestRate                      |   | decimal   | Zinssatz                                                               | Beispielwert:<br>"1.36"                                               | AKTLZSSATZ                  |
| interestFrequencyCode             | x | string    | Zinsusanz                                                              | Siehe <a href="#">4.1.5</a>                                           | -                           |
| interestPeriod                    |   | string    | Periodizität der Zinsgutschrift                                        | Siehe <a href="#">4.1.6</a>                                           | -                           |
| nextInterestPaymentDate           |   | date      | Nächster Zinszahlungstermin (ISO 8601)                                 | Beispielwert:<br>"15.09.2021"                                         | -                           |
| commissionRate                    |   | decimal   | Kommissionssatz bei Treuhandanlagen                                    | Beispielwert:<br>"0.3"                                                | KOMMISSIONSZUSATZ           |
| noticePeriod                      |   | integer   | Kündigungsfrist bei Geldmarkt- oder Treuhandcallgeld in Tagen          | Beispielwert:<br>"30"                                                 | KUENDFRIST                  |
| investmentBank                    |   | string    | Anlagebank bei Treuhandanlagen<br>Zürcher Kantonalbank bei Geldmarkt   | Beispielwert:<br>"L.M.T. Bank"                                        | -                           |
| accruedInterestInPositionCurrency |   | decimal   | Marchzins in Positionswährung                                          | Beispielwert:<br>"200"                                                | -                           |
| accruedInterestEvalDate           |   | date      | Datum, bis zu welchem der Marchzins berechnet ist (ISO 8601)           | Beispielwert:<br>"08.09.2021"                                         | -                           |

### 3.4.5 OTC (over the counter)

#### 3.4.5.1 Fachliche Beschreibung

Bereitstellung von Positionsdaten zu OTC-Positionen.

Die Attribute aus eDL stammen aus den Tabellen TERMBESTDERIVATE und ZINSBEWERTUNGTMP. Die jeweilige Tabelle ist jeweils unter dem betreffenden eDL Attribut angegeben. Wenn keine Tabelle angegeben ist, dann ist das Attribut in beiden Tabellen zu finden.

| Feldname / Attribut        | M | Data type | Defintion                                                                | Option / Beispiel                                       | Attributsbezeichnung in eDL                                                                       |
|----------------------------|---|-----------|--------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------|
| positionIdentification     | x | string    | Identifikationsnummer der Position                                       | Beispielwert:<br>"WS_86035105"                          |                                                                                                   |
| clientIdentification       |   | string    | Eindeutige Identifikationsnummer des Partners (Besitzer des Geschäfts)   | Beispielwert:<br>"1.234.567-8"                          | CIFSTNR<br>(ZINSBEWERTUNGTMP)<br><br>PARTNERNR<br>(TERMBESTDERIVATE)                              |
| portfolioIdentification    |   | string    | Identifikationsnummer des Anlageportfolios                               | Beispielwert:<br>"9470012345678"                        | PORTFOLIONR                                                                                       |
| portfolioReferenceCurrency |   | string    | Referenzwährung des Anlageportfolios (ISO 4217)                          | Beispielwert:<br>"CHF"                                  | -                                                                                                 |
| accountIdentification      | x | string    | Geschäftsnummer / IBAN                                                   | Beispielwert:<br>"CH6500700123456789101"                | GESCHNR<br>(TERMBESTDERIVATE)<br>/<br>APPLNR + HBNR + ZWNR +<br>GESCHNRKURZ<br>(ZINSBEWERTUNGTMP) |
| descriptionAccount         |   | string    | Rubrik des Kontos                                                        | Beispielwert:<br>"Zahlungen"                            | -                                                                                                 |
| positionCurrency           | x | string    | Positionswährung (ISO 4217)                                              | Beispielwert:<br>"CHF"                                  | CURR<br>(ZINSBEWERTUNGTMP)                                                                        |
| instrumentIdentification   | x | string    | Kontraktidentifikationsnummer                                            | Beispielwert:<br>"IRS.419200500"                        |                                                                                                   |
| instrumentName             | x | string    | Kontraktname                                                             | Beispielwert:<br>"IRS - CHF 31.03.2021 -<br>31.12.2036" |                                                                                                   |
| derivatReference           | x | string    | Derivatreferenz                                                          | Beispielwert:<br>"FX0000102290656"                      | KONTRAKTNR<br>(TERMBESTDERIVATE)                                                                  |
| otcInstrumentTypeCode      | x | string    | OTC Kontaktart                                                           | Siehe <a href="#">4.1.26</a>                            |                                                                                                   |
| orderOpeningIdentification |   | string    | Eröffnungsnummer Kontrakt                                                | Beispielwert:<br>"628704483"                            | ORDERNR<br>(ZINSBEWERTUNGTMP)                                                                     |
| transcationDate            | x | date      | Transaktionsdatum (ISO 8601)                                             | Beispielwert:<br>"11.09.2023"                           | ABSCHLDAT<br>(TERMBESTDERIVATE)                                                                   |
| openingDate                | x | date      | Eröffnungsdatum (ISO 8601)                                               | Beispielwert:<br>"11.09.2023"                           | BEGINN<br>(TERMBESTDERIVATE)                                                                      |
| maturityDate               |   | date      | Verfalldatum (ISO 8601)                                                  | Beispielwert:<br>"26.04.2026"                           | VERFALL<br>(TERMBESTDERIVATE)                                                                     |
| buySellIndicator           |   | string    | Indikator, ob es sich aus Sicht Kunde um einen Kauf oder Verkauf handelt | Siehe <a href="#">4.1.18</a>                            | CLIENTBUYSELL<br>(TERMBESTDERIVATE)                                                               |
| optionType                 |   | string    | Optionstyp                                                               | Siehe <a href="#">4.1.14</a>                            | PUTCALL<br>(TERMBESTDERIVATE)                                                                     |
| callAmount                 |   | decimal   | Callbetrag                                                               | Beispielwert:<br>"10000.55"                             |                                                                                                   |
| callCurrency               |   | string    | Callwährung (ISO 4217)                                                   | Beispielwert:<br>"CHF"                                  | CALLWAEHRUNG<br>(TERMBESTDERIVATE)                                                                |
| putAmount                  |   | decimal   | Putbetrag                                                                | Beispielwert:<br>"10000.55"                             |                                                                                                   |
| putCurrency                |   | string    | Putwährung (ISO 4217)                                                    | Beispielwert:<br>"CHF"                                  | PUTWAEHRUNG<br>(TERMBESTDERIVATE)                                                                 |

| Feldname / Attribut        | M | Data type | Defintion                                              | Option / Beispiel                | Attributsbezeichnung in eDL                       |
|----------------------------|---|-----------|--------------------------------------------------------|----------------------------------|---------------------------------------------------|
| strikePrice                |   | decimal   | Strikebetrag                                           | Beispielwert:<br>"22.50"         | STRIKE<br>(TERMBESTDERIVATE)                      |
| strikeCurrency             |   | string    | Strikewährung<br>(ISO 4217)                            | Beispielwert:<br>"CHF"           |                                                   |
| strikePriceType            |   | string    | Art des Strikepreises                                  | Siehe <a href="#">4.1.28</a>     |                                                   |
| upperBarrier               |   | decimal   | Obere Barriere                                         | Beispielwert:<br>"1100.00"       |                                                   |
| lowerBarrier               |   | decimal   | Untere Barriere                                        | Beispielwert:<br>"200.00"        |                                                   |
| optionStyle                |   | string    | Optionsart                                             | Siehe <a href="#">4.1.7</a>      | OPTAUSUEBART<br>(TERMBESTDERIVATE)                |
| settlementTypeCode         |   | string    | Lieferart                                              | Siehe <a href="#">4.1.29</a>     |                                                   |
| startPremiumAmount         |   | decimal   | Prämienbetrag bei Laufzeitbeginn                       | Beispielwert:<br>"20000.00"      | EINSTANDSPREIS<br>(TERMBESTDERIVATE)              |
| startPremiumCurrency       |   | string    | Prämienbetragswährung bei Laufzeitbeginn<br>(ISO 4217) | Beispielwert:<br>"CHF"           |                                                   |
| startPremiumDate           |   | date      | Prämienlaufzeitbeginn<br>(ISO 8601)                    | Beispielwert:<br>"11.09.2023"    | VALPRAEM<br>(TERMBESTDERIVATE)                    |
| endPremiumAmount           |   | decimal   | Prämienbetrag bei Laufzeitende                         | Beispielwert:<br>"5'000.00"      | EINSTANDSPREIS<br>(TERMBESTDERIVATE)              |
| endPremiumCurrency         |   | string    | Prämienbetragswährung bei Laufzeitende<br>(ISO 4217)   | Beispielwert:<br>"CHF"           |                                                   |
| endPremiumDate             |   | date      | Prämienbetrag bei Laufzeitende<br>(ISO 8601)           | Beispielwert:<br>"26.04.2026"    | VALPRAEM<br>(TERMBESTDERIVATE)                    |
| valorIdentification        |   | string    | Valorennummer mit führenden Nullen                     | Beispielwert:<br>"IRS.552283956" | UNDERLYING<br>(TERMBESTDERIVATE)                  |
| valorStartDate             |   | date      | Valorlaufzeitbeginn<br>(ISO 8601)                      | Beispielwert:<br>"11.09.2023"    |                                                   |
| valorEndDate               |   | date      | Valorlaufzeitende<br>(ISO 8601)                        | Beispielwert:<br>"26.04.2026"    |                                                   |
| referenceEntity            |   | string    | Bezugsreferenz                                         | Beispielwert:<br>"ITRXEUR34/5"   |                                                   |
| interestFixingDate         |   | date      | Zinsfixierungsdatum<br>(ISO 8601)                      | Beispielwert:<br>"11.09.2023"    |                                                   |
| referenceInterestRateCurve |   | string    | Referenzzinskurve                                      | Beispielwert:<br>"EUREURIBOR03M" |                                                   |
| nominalChange              |   | boolean   | Änderungen im Nominal erlaubt                          | Siehe <a href="#">4.1.30</a>     |                                                   |
| otclnstrumentSubtypeCode   |   | string    | Erweitert die OTC Kontraktart                          | Siehe <a href="#">4.1.27</a>     | TRADKLACD und<br>CAPFLOORKZ<br>(TERMBESTDERIVATE) |
| ccsCurrentFx               |   | string    | Aktueller Devisenkurs Cross Currency Swap              | Beispielwert:<br>"0.901713"      |                                                   |
| leg1NominalAmount          |   | decimal   | Nominalbetrag Leg 1                                    | Beispielwert:<br>"50000000.00"   | NOMINAL                                           |
| leg1NominalCurrency        |   | string    | Nominalwährung Leg 1<br>(ISO 4217)                     | Beispielwert:<br>"CHF"           |                                                   |
| leg1InterestType           |   | string    | Zinsart Leg 1                                          | Siehe <a href="#">4.1.31</a>     | FIX_FLOAT_1<br>(TERMBESTDERIVATE)                 |
| leg1InterestPeriod         |   | string    | Zinsperiode Leg 1                                      | Siehe <a href="#">4.1.6</a>      |                                                   |
| leg1InterestRate           |   | decimal   | Zinssatz Leg 1                                         | Beispielwert:<br>"2.1725"        | ZSSSATZ1<br>(TERMBESTDERIVATE)                    |
| leg1InterestFrequencyCode  |   | string    | Zinsusanz Leg 1                                        | Siehe <a href="#">4.1.5</a>      |                                                   |

| Feldname / Attribut             | M | Data type | Defintion                                                          | Option / Beispiel                  | Attributsbezeichnung in eDL          |
|---------------------------------|---|-----------|--------------------------------------------------------------------|------------------------------------|--------------------------------------|
| leg1Index                       |   | string    | Index Leg 1                                                        | Beispielwert:<br>"CHFSARON"        |                                      |
| leg1Spread                      |   | decimal   | Zinsaufschlag Leg 1                                                | Beispielwert:<br>"0.074"           |                                      |
| leg1NextInterestPaymentAmount   |   | decimal   | Betrag nächste Zinszahlung Leg 1                                   | Beispielwert:<br>"-74841.53"       |                                      |
| leg1NextInterestPaymentCurrency |   | string    | Währung nächste Zinszahlung Leg 1<br>(ISO 4217)                    | Beispielwert:<br>"CHF"             | ZINSWAEHRUNG1<br>(TERMBESTDERIVATE)  |
| leg1NextInterestPaymentDate     |   | date      | Termin nächste Zinszahlung Leg 1<br>(ISO 8601)                     | Beispielwert:<br>"11.09.2023"      |                                      |
| leg1PayerReceiver               |   | string    | Indikator, ob die Zahlung für Leg 1<br>bezahlt oder empfangen wird | Beispielwert:<br>"CLIENT_PAYS"     | PAYRECEIVELEG1<br>(TERMBESTDERIVATE) |
| leg2NominalAmount               |   | decimal   | Nominalbetrag Leg 2                                                | Beispielwert:<br>"127795527.16"    | NOMINAL                              |
| leg2NominalCurrency             |   | string    | Nominalwährung Leg 2<br>(ISO 4217)                                 | Beispielwert:<br>"CHF"             |                                      |
| leg2InterestType                |   | string    | Zinsart Leg 2                                                      | Siehe <a href="#">4.1.31</a>       | FIX_FLOAT_2<br>(TERMBESTDERIVATE)    |
| leg2InterestPeriod              |   | string    | Zinsperiode Leg 2                                                  | Siehe <a href="#">4.1.6</a>        |                                      |
| leg2InterestRate                |   | decimal   | Zinssatz Leg 2                                                     | Beispielwert:<br>"3.385"           | ZSSSATZ2<br>(TERMBESTDERIVATE)       |
| leg2InterestFrequencyCode       |   | string    | Zinsusanz Leg 2                                                    | Siehe <a href="#">4.1.5</a>        |                                      |
| leg2Index                       |   | string    | Index Leg 2                                                        | Beispielwert:<br>"EUREURIBOR03M"   |                                      |
| leg2Spread                      |   | decimal   | Zinsaufschlag Leg 2                                                | Beispielwert:<br>"0.48"            |                                      |
| leg2NextInterestPaymentAmount   |   | decimal   | Betrag nächste Zinszahlung Leg 2                                   | Beispielwert:<br>"1089.56"         |                                      |
| leg2NextInterestPaymentCurrency |   | string    | Währung nächste Zinszahlung Leg 2<br>(ISO 4217)                    | Beispielwert:<br>"CHF"             | ZINSWAEHRUNG2<br>(TERMBESTDERIVATE)  |
| leg2NextInterestPaymentDate     |   | date      | Termin nächste Zinszahlung Leg 2<br>(ISO 8601)                     | Beispielwert:<br>"11.09.2023"      |                                      |
| leg2PayerReceiver               |   | string    | Indikator, ob die Zahlung für Leg 2<br>bezahlt oder empfangen wird | Beispielwert:<br>"CLIENT_RECEIVES" | PAYRECEIVELEG2<br>(TERMBESTDERIVATE) |
| valuationRate                   |   | decimal   | Kurs Wiederbeschaffungswert                                        | Beispielwert:<br>"21.002759"       |                                      |
| valuationAmount                 |   | decimal   | Betrag Wiederbeschaffungswert                                      | Beispielwert:<br>"30212.888603"    | WBWMTM<br>(TERMBESTDERIVATE)         |
| valuationCurrency               |   | string    | Währung Wiederbeschaffungswert<br>(ISO 4217)                       | Beispielwert:<br>"CHF"             |                                      |
| spotValuationAmount             |   | decimal   | Spot Betrag Wiederbeschaffungswert                                 | Beispielwert:<br>"30216.858161"    | WBWSPOT<br>(TERMBESTDERIVATE)        |
| spotValuationCurrency           |   | string    | Spot Währung Wiederbeschaffungswert<br>(ISO 4217)                  | Beispielwert:<br>"CHF"             | WAEHRUNGWBW<br>(TERMBESTDERIVATE)    |
| valuationOriginalAmount         |   | decimal   | Originalbetrag Wiederbeschaffungswert                              | Beispielwert:<br>"31500.00"        |                                      |
| valuationInOriginalCurrency     |   | string    | Originalwährung<br>Wiederbeschaffungswert<br>(ISO 4217)            | Beispielwert:<br>"USD"             |                                      |
| tradingReference                |   | string    | Handelsreferenz                                                    | Beispielwert:<br>"MW_29629518"     | BOTRDNR<br>(ZINSBEWERTUNGTMP)        |
| createDate                      |   | date      | Erstellungsdatum<br>(ISO 8601)                                     | Beispielwert:<br>"11.09.2023"      | CREATEDAY<br>(ZINSBEWERTUNGTMP)      |

| Feldname / Attribut               | M | Data type | Defintion                                         | Option / Beispiel                                   | Attributsbezeichnung in eDL           |
|-----------------------------------|---|-----------|---------------------------------------------------|-----------------------------------------------------|---------------------------------------|
| tradingInstrumentName             |   | string    | Handelsinstrumentname                             | Beispielwert:<br>"CHF/IRS/SS-F/210914-230426/0.995" | INSTRUMENT<br>(ZINSBEWERTUNGTMP)      |
| interestRateCurveTrading          |   | string    | Handelszinskurve                                  | Beispielwert:<br>"CHF-SSAR-ON"                      | LIBOR<br>(ZINSBEWERTUNGTMP)           |
| interestDerivatTypeCodeTrading    |   | string    | Zinsderivatart                                    | Siehe <a href="#">4.1.32</a>                        | INSTYPE<br>(ZINSBEWERTUNGTMP)         |
| interestDerivatSubtypeCodeTrading |   | string    | Erweitert die Zinsderivatart                      | Siehe <a href="#">4.1.33</a>                        | TYPE<br>(ZINSBEWERTUNGTMP)            |
| lastFixedInterestRate             |   | decimal   | Letzter fixierter Zinssatz                        | Beispielwert:<br>"-0.7066, 0"                       | LASTFIXING<br>(ZINSBEWERTUNGTMP)      |
| marketPriceInPercent              |   | decimal   | Marktkurs in Prozent                              | Beispielwert:<br>"0.4742"                           | MARKETRATE<br>(ZINSBEWERTUNGTMP)      |
| tradedPriceInPercent              |   | decimal   | Handelskurs in Prozent                            | Beispielwert:<br>"1.3"                              | TRADEPRICE<br>(ZINSBEWERTUNGTMP)      |
| strikeInPercent                   |   | decimal   | Strike in Prozent                                 | Beispielwert:<br>"0.155"                            | STRIKE<br>(ZINSBEWERTUNGTMP)          |
| markToMarketAmount                |   | decimal   | Markt zu Markt Betrag                             | Beispielwert:<br>"5450718.00"                       | MTM<br>(ZINSBEWERTUNGTMP)             |
| deltaAmount                       |   | decimal   | Delta Betrag                                      | Beispielwert:<br>"102763.39.00"                     | DELTA<br>(ZINSBEWERTUNGTMP)           |
| volatilityInPercent               |   | decimal   | Volatilität in Prozent                            | Beispielwert:<br>"1.28"                             | VOLATILITY<br>(ZINSBEWERTUNGTMP)      |
| interestStartDate                 |   | date      | Zinslaufzeitbeginn<br>(ISO 8601)                  | Beispielwert:<br>"11.09.2023"                       | BEGINN<br>(ZINSBEWERTUNGTMP)          |
| interestEndDate                   |   | date      | Zinslaufzeitende<br>(ISO 8601)                    | Beispielwert:<br>"26.04.2026"                       | INSTREXP / ENDE<br>(ZINSBEWERTUNGTMP) |
| strikePricePretty                 |   | decimal   | Strikebetrag von der Nominal- zur<br>Gegenwährung | Beispielwert:<br>"22.50"                            |                                       |

## 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 und bei Rückzahlungen)  |
| percentagePerAnnum | Preis in Prozenten des Nennwerts aufs Jahr gerechnet (z.B. Zinszahlungen) |

#### 4.1.3 bookingType

| Mögliche Werte | Beschreibung / Verwendungszweck |          |                        |
|----------------|---------------------------------|----------|------------------------|
|                | Steuern                         | Gebühren | Diverse Geldebuchungen |
| cash           |                                 |          | x Gutschrift           |
| custodyFee     |                                 | x        | Depotgebühren          |
| managementFee  |                                 | x        | Verwaltungsgebühr      |
| otherFee       |                                 | x        | übrige Gebühren        |
| other          |                                 |          | x übrige Buchungen     |
| revenue        |                                 |          | x Ertrag               |
| withholdingTax | x                               |          | Quellensteuer          |

#### 4.1.4 bookingTypeSecurity

| Mögliche Werte | Beschreibung / Verwendungszweck |
|----------------|---------------------------------|
| metal          | Menge gebuchtem Metall          |
| security       | Titelbuchung                    |
| others         | übrige Buchungen                |

#### 4.1.5 interestFrequencyCode

| Mögliche Werte | Beschreibung / Verwendungszweck                                                                              |
|----------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| u30E_360Isda   | 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                                                        |

#### 4.1.6 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                      |
| quarterlyEndOfMonth     | Zinstermin quartalsweise am Ende des Monats             |
| quarterly3rdWednesday   | Zinstermin quartalsweise am dritten Mittwoch des Monats |
| annualRollingEndOfMonth | Zinstermin jährlich am Ende des Monats                  |
| semiAnnualEndOfMonth    | Zinstermin halbjährlich am Ende des Monats              |
| semiAnnual3rdWednesday  | Zinstermin halbjährlich am dritten Mittwoch des Monats  |

#### 4.1.7 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)     |

#### 4.1.8 interestFrequencyCode (loan)

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

#### 4.1.9 interestPeriod (loan)

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

#### 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           |
| variableMortgage          | ZKB Variable Hypothek             |
| homegateFixedRateMortgage | homegate.ch Festhypothek          |
| 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                      | Versicherungspolice                        |
| structuredProduct           | Strukturierte Produkte                     |
| trustShare                  | Trust-Shares                               |
| interestRate                | Zinssätze                                  |
| residualQuotaCertificate    | Restquotenbescheinigungen                  |
| entitlement                 | Anrechte, Bezugsrechte                     |
| nationalCurrency            | Nationale Währungen                        |
| trustCertificate            | Trust-Zertifikate                          |
| shareCertificate            | Anteilsscheine                             |
| savingDeposit               | Einlage, Depositen und Sparhefte           |
| repoTransaction             | REPO                                       |
| technicalValor              | Technische Valoren                         |
| floatingRateNote            | Floating Rate Notes, variable Obligationen |
| warrant                     | Optionsscheine, 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 Geldebuchungen 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.<br>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")                                                                                                                                                                                                                        |
| inflowOutflowDigital     | Eingehende und ausgehende Zahlungen im Zusammenhang mit dem Geldkonto.<br>Darunter fallen z.B. die Bezahlung von Rechnungen, bankenübergreifende Kontoüberträge, kunden-/bankübergreifende Daueraufträge, "LSV".                                                                                                     |
| inflowOutflowPhysical    | Bargeldbezüge, Kartenzahlungen                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
| internalTransfer         | Kontoübertrag 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)                                                                                                                                                                                                                                                                                   |

| Mögliche Werte           | Beschreibung / Verwendungszweck                                                        |
|--------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------|
| 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                                                             |
| additionalPayment        | Zusätzliche Zahlungen während der Laufzeit (Upfront Fee, Balloon Fee)                  |
| adjustNotional           | Anpassungen Nominal während Laufzeit (Aufstockung, Amortisation, TRS Value Adjustment) |
| buy                      | Kauf                                                                                   |
| creditEvent              | Credit Event bei CDS                                                                   |
| decrease                 | Teilweise Glattstellung CDS-Position                                                   |
| exerciseCash             | Bar Ausübung                                                                           |
| exercisePhysical         | Physische Ausübung                                                                     |
| expiration               | Endverfall                                                                             |
| fees                     | Glattstellungs-Betrag (TRS)                                                            |
| Interest                 | Zinszahlung                                                                            |
| knockIn                  | Barrier-Hit "Knock In"                                                                 |
| knockOut                 | Barrier-Hit "Knock Out"                                                                |
| markToMarket             | Fixing Devisenkurs + Nominal-Anpassung MtM-CCS                                         |
| markToMarket Cashflow    | Barausgleich aus Nominal-Anpassung MtM-CCS                                             |
| open                     | Eröffnung Position (CCS und Accu/Decu)                                                 |
| openPayerSwap            | Eröffnung Payer Swap                                                                   |
| openReceiverSwap         | Eröffnung Receiver Swap                                                                |
| other                    | Anderer Wert                                                                           |
| payment                  | Zahlung aus Accu/Decu)                                                                 |
| premium                  | Prämien-Zahlung                                                                        |
| resetPayment             | Periodische Zahlung TRS (Zins + Performance)                                           |
| sell                     | Verkauf                                                                                |
| unwind                   | Teilweise oder vollständige Glattstellung Position                                     |

#### 4.1.18 buySellIndicator

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

#### 4.1.19 statementType

| Mögliche Werte | Beschreibung / Verwendungszweck                                                                                        |
|----------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| statement      | Abrechnung                                                                                                             |
| reversal       | Sorno: 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 Valorennummer 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.

Valorennummer Aktie

**Bsp. 023862714**

Valorennummer Obligation

**Bsp. 018433913**

Valorennummer Kassenobligation

**Bsp. 000138826**

Valorennummer Option

**Bsp. 069003312.20220121**

#### 4.1.21 accountIndicator

##### Mögliche Werte

true

false

##### Beschreibung / Verwendungszweck

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

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

#### 4.1.22 reversalIndicator

##### Mögliche Werte

true

false

##### Beschreibung / Verwendungszweck

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

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

#### 4.1.23 fxType

##### Mögliche Werte

fxSpot

fxSpotSwapLeg

fxForward

fxForwardSwapLeg

fxForwardNdf

##### Beschreibung / Verwendungszweck

FX Spot

FX Spot Swap Leg

FX Forward

FX Forward Swap Leg

FX Forward NDF

#### 4.1.24 valueTypeGroup

##### Mögliche Werte

bonds

shares

futures

funds

swap

commodities

options

structuredProducts

insurancePolicies

documents

indices

cash

others

metal

rights

warrants

entitlement

currency

foreignExchange

moneyMarket

fiduciary

##### Beschreibung / Verwendungszweck

Obligationen

Aktien

Futures

Fonds

Swap

Commodities

Optionen

Strukturierte Produkte

Versicherungspolicen

Dokumente

Indizes

Cash

Andere

Metall

Anrechte

Warrants

Ansprüche

Währungen

Devisenhandel

Geldmarktanlagen

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 |

| Mögliche Werte                                        | Beschreibung / Verwendungszweck                               |
|-------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------|
| financingTotalReturnSwapStraightBondBasket            | Financing Total Return Swap Straight-Bond-Basket              |
| financingTotalReturnSwapCocoBond                      | Financing Total Return Swap CoCo-Bond                         |
| financingTotalReturnSwapCocoBondBasket                | Financing Total Return Swap CoCo-Bond-Basket                  |
| financingTotalReturnSwapConvertibleBondexklCoco       | Financing Total Return Swap Convertible Bond exkl Coco        |
| financingTotalReturnSwapConvertibleBondBasketExclCoco | Financing Total Return Swap Convertible Bond-Basket exkl 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                                                |
| accumulatorShares                                     | Accumulator auf Aktien                                        |
| accumulatorShareIndex                                 | Accumulator auf Aktien-Index                                  |
| accumulatorFunds                                      | Accumulator auf Fonds                                         |
| decumulatorShares                                     | Decumulator auf Aktien                                        |
| decumulatorShareIndex                                 | Decumulator auf Aktien-Index                                  |
| decumulatorFunds                                      | Decumulator auf Fonds                                         |

#### 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                          |
| physicalOrCashSettlement | Physische Lieferung oder 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_stex    | Transaktionen - Wertschriften                  |
| transactions_ca      | Transaktionen - Verwaltungshandlungen          |
| transactions_mmkt    | Transaktionen - Geldmarkt- und Treuhandanlagen |
| transactions_fx      | Transaktionen - Devisen und Edelmetall         |
| transactions_account | Transaktionen - Konto und Darlehen             |
| transactions_otc     | Transaktionen – OTC (over the counter)         |
| positions_stex       | Positionen - Wertschriften                     |
| positions_mmkt       | Positionen - Geldmarkt- und Treuhandanlagen    |
| positions_fx         | Positionen - Devisen und Edelmetall            |
| positions_account    | Positionen - Konto und Darlehen                |
| positions_otc        | Positionen - OTC (over the counter)            |

#### 4.1.35 barrierTypeCode

| Mögliche Werte | Beschreibung / Verwendungszweck |
|----------------|---------------------------------|
| downAndOut     | Down and Out                    |
| downAndIn      | Down and In                     |
| upAndOut       | Up and Out                      |
| upAndIn        | Up and In                       |