

Dokumentation ZKB Dataset Service XML-Format

Dokumentation File-Strukturen und fachlicher Kontext im ZKB Dataset Service

Änderungsnachweis

Datum	Version	Änderungen	Seiten
24.03.2023	1.0	Erstellung des Dokumentes	alle
15.06.2023	1.1	<ul style="list-style-type: none">Ergänzung Datumsart 'Transaktionsdatum' und 'Timestamp'Ergänzung Attribut 'balanceInChf' und 'balanceInChfCreditDebitIndicator' in der Struktur 'Konto und Darlehen' (Verfügbar ab Oktober 2023)Ergänzung Struktur 'OTC Positionen'	6 31, 32, 35 36 – 39
09.11.2023	1.2	<ul style="list-style-type: none">Ergänzung Definition 'dataType'Diverse kleinere fachliche Anpassungen	57 Alle
21.03.2023	1.3	<ul style="list-style-type: none">Ergänzung Triggering Quantity und Triggering Quantity Position Currency für Corporate Actions (3.3.1)Ergänzung Attribut für eine QR-Referenz aus einem Zahlungsauftrag und Kontonummern eines Zahlungsempfänger (3.3.3)	16 22
09.06.2024	1.4	<ul style="list-style-type: none">Ergänzung Struktur 'OTC-Transaktionen' (3.3.6)Ergänzung Detailbeschreibungen für OTC-Transaktionen (4.1.3 , 4.1.5 , 4.1.17 , 4.1.27 , 4.1.29 , 4.1.35)Ergänzung Erfüllungsart bei 'Positionen Wertschriften' aus Wertschriften Optionen (3.4.1.1)	26 - 28 53, 57, 61, 62 31
19.09.2024	1.5.1	<ul style="list-style-type: none">Ergänzung Pretty Strike für OTC PositionenLieferung von kumulierten Variation Margins bei WertschriftenpositionenErgänzung von Trade Date und Value Date in FX Positions	41 32 34

Inhaltsverzeichnis

1	Einführung	5
1.1	Zweck und Inhalt dieser Dokumentation	5
2	Hinweise ZKB Dataset	6
2.1	Verfügbarkeit von Daten	6
2.1.1	Fachliche Ausprägungen von Datenlieferungen	6
2.1.2	Aufbereitung der Daten	6
2.1.3	Datenverfügbarkeit	7
2.1.4	Einmalige Datenbestellungen	7
2.1.5	Wiederholende Datenbestellungen	7
2.1.6	Prüfung der Verfügungsrechte	7
2.1.7	Datenlieferung via SFTP-Server («Secure File Transfer Protocol»)	7
2.1.8	Ex-Brokerage / In-Custody	7
2.2	Fachliche Erklärungen	10
2.2.1	Berechnungsbeispiel Wertschriftenkauf	10
2.2.2	Berechnungsbeispiel für Kurse (Währungen mit Standard 100 zu Währungen mit Standard 1)	10
2.2.3	Erläuterung transactionSubtype Optionen und Futures	11
2.2.4	Depotarten innerhalb der Zürcher Kantonalbank	11
3	Spezifikation der Datenlieferungen im Native Format	12
3.1	Allgemeine Informationen	12
3.1.1	Mögliche Werte eines Attributs	12
3.1.2	List Attribute	12
3.1.3	Darstellung von Betragswerten	13
3.1.4	Statement, Reversal und Rektifikat	13
3.1.5	Deklaration der Transaktionsarten und Transaktionstypen	13
3.1.6	Definition von standardmässig gelieferten Attributen	13
3.2	Fachliche Definition allgemeiner Teil	14
3.3	Transaktionen	15
3.3.1	Wertschriften	15
3.3.2	Devisen und Edelmetall	19
3.3.3	Konto und Feste Vorschüsse	21
3.3.4	Geldmarkt- und Treuhandanlagen	23
3.3.5	Hypotheken und Darlehen	25
3.3.6	OTC-Derivate	26
3.4	Positionen	29
3.4.1	Wertschriften	29
3.4.2	Devisen und Edelmetall	33
3.4.3	Konto und feste Vorschüsse	35
3.4.4	Geldmarkt- und Treuhandanlagen	37
3.4.5	Hypotheken und Darlehen	39
3.4.6	OTC-Derivate	40
3.5	Bewertungen	44
3.5.1	Wertschriften	44
3.5.2	Devisen und Edelmetall	46
3.5.3	Geldmarkt- und Treuhandanlagen	47
3.6	Stammdaten	48
3.6.1	Wertschriften	48
3.6.2	Devisen und Edelmetall	50
3.6.3	Geldmarkt- und Treuhandanlagen	51

4	Detailbeschreibung	52
4.1	Beschreibung und mögliche Werte	52
4.1.1	unitOfQuantity	52
4.1.2	priceType	52
4.1.3	bookingType	52
4.1.4	interestFrequencyCode	53
4.1.5	interestPeriod	53
4.1.6	optionStyle	54
4.1.7	interestFrequencyCode (loan)	54
4.1.8	interestPeriod (loan)	54
4.1.9	creditDebitIndicator	54
4.1.10	inOutIndicator	54
4.1.11	product	54
4.1.12	moneyMarketType	54
4.1.13	valorStatus	55
4.1.14	optionType	55
4.1.15	valorTypeTelekurs	55
4.1.16	transactionType	56
4.1.17	transactionSubtype	56
4.1.18	buySellIndicator	58
4.1.19	statementType	58
4.1.20	valorIdentification	58
4.1.21	accountIndicator	58
4.1.22	reversalIndicator	58
4.1.23	fxType	58
4.1.24	valorTypeGroup	59
4.1.25	type	59
4.1.26	otclInstrumentTypeCode	59
4.1.27	otclInstrumentSubtypeCode	60
4.1.28	strikePriceType	61
4.1.29	settlementTypeCode	61
4.1.30	nominalChange	61
4.1.31	InterestType	61
4.1.32	interestDerivatTypeCodeTrading	61
4.1.33	interestDerivatSubtypeCodeTrading	61
4.1.34	dataType	62
4.1.35	barrierTypeCode	62

1 Einführung

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

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

1.1 Zweck und Inhalt dieser Dokumentation

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

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

2 Hinweise ZKB Dataset

2.1 Verfügbarkeit von Daten

2.1.1 Fachliche Ausprägungen von Datenlieferungen

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

Transaktionen:

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

Positionen:

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

Stammdaten und Bewertungen:

- Wertschriften
- Devisen und Edelmetall
- Geldmarkt- und Treuhandanlagen

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 für Positionen, Stammdaten und Bewertungen ausgeliefert. Für Transaktionen wird über den gesamten abgefragten Zeitraum ein 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 diese Information am Datenbezüger in der File-Lieferung mitgeteilt (warningList, siehe Kapitel 3.2):

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

Hinweis

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

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

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

2.1.8 Ex-Brokerage / In-Custody

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

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

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

Eine Ex-Brokerage Transaktion hat Auswirkungen auf das

- Wertschriften-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
transactionList transaction statement statementType transactionIdentification bookingDate 2023-03-01 valueDate 2023-03-03 transactionDate 2023-03-01 exBrokerageIndicator true brokerName xy brokerIdentification 123456 transactionType securitiesExchange transactionSubtype sell ... netAmountInMaccCurrency 10000 netAmountCreditDebitIndicator credit ... bookings bookingSecurityList bookingSecurity inOutIndicator out quantity 100	transactionList transaction statement statementType transactionIdentification bookingDate 2023-03-01 valueDate 2023-03-03 transactionDate 2023-03-01 exBrokerageIndicator false brokerName brokerIdentification transactionType securitiesExchange transactionSubtype sell ... netAmountInMaccCurrency 20000 netAmountCreditDebitIndicator credit ... bookings bookingSecurityList bookingSecurity inOutIndicator out quantity 200

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

Kontoauszug

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

Depotbestand

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

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

2.2 Fachliche Erklärungen

2.2.1 Berechnungsbeispiel Wertschriftenkauf

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

Beispiel Abrechnung:

Kauf 100 Stk. AAPL

Abrechnung

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

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

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

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

Beispiel:

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

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

2.2.3 Erläuterung transactionSubtype Optionen und Futures

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

BuyToOpen: Es wird eine Longposition eingegangen.

SellToClose: Es wird eine Longposition glattgestellt.

SellToOpen: Es wird eine Shortposition eingegangen.

BuyToClose: Es wird eine Shortposition glattgestellt.

2.2.4 Depotarten innerhalb der Zürcher Kantonalbank

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

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

3.1 Allgemeine Informationen

3.1.1 Mögliche Werte eines Attributs

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

3.1.2 List Attribute

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

Beispiel:

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

transactionList

transaction

statement

grossAmountInReferenceCurrency 15001
netAmountInReferenceCurrency 15139.09
netAmountInMaccCurrency 14684.90
netAmountCreditDebitIndicator debit
fxRateReferenceCurrencyToMaccCurrency 0.97

bookings

bookingSecurityList

bookingSecurity

bookingType security

inOutIndicator in

quantity 100

unitOfQuantity

positionCurrency USD

valorIdentification

valorIdentification US0378331005

bookingCashList

bookingCash

bookingType courtage

amount 111.29

currency USD

creditDebitIndicator debit

bookingCash

bookingType stampDuty

amount 23.98

currency USD

creditDebitIndicator debit

bookingCash

bookingType exChangeFee

amount 2.82

currency USD

creditDebitIndicator debit

Ausnahme:

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

3.1.3 Darstellung von Betragswerten

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

3.1.4 Statement, Reversal und Rektifikat

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

3.1.5 Deklaration der Transaktionsarten und Transaktionstypen

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

3.1.6 Definition von standardmässig gelieferten Attributen

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

3.2 Fachliche Definition allgemeiner Teil

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

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

3.3 Transaktionen

3.3.1 Wertschriften

3.3.1.1 Fachliche Beschreibung

Bereitstellung von Transaktionsdaten zu Wertschriftentransaktionen

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

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

Feldname / Attribut	M	Data type	Defintion	Option / Beispiel
averagePricelnTradingCurrency		decimal	Durchschnittspreis in Handelswahrung	Beispielwert: "1241.99"
averagePriceType		string	Art des Preises	Siehe 4.1.2
marketValueInReferenceCurrency		decimal	Kurswert in Referenzwahrung	Beispielwert: "68242.28"
accruedInterestInReferenceCurrency		decimal	Marchzins in Referenzwahrung	Beispielwert: "1241.99"
triggeringValorIdentification			In den folgenden Attributen wird der auslosende Valor einer Corporate Action identifiziert	
valorIdentification		string	Valorennummer mit fuhrenden Nullen	Siehe 4.1.20
valorIdentificationTelekurs		string	SIX Valorennummer	Beispielwert: "23862714"
valorTickerTelekurs		string	Ticker Telekurs des Valors	Beispielwert: "BOSN"
valorIsin		string	ISIN des Valors	Beispielwert: "CH0238627142"
valorTextShort		string	Text kurz des Valors auf 20 Zeichen beschrankt	Beispielwert: "Bossard Hldg N"
valorTextLong		string	Text lang des Valors	Beispielwert: "Namen-Akt Bossard Holding AG"
valorTypeGroup		string	Titelart-Gruppe des Valors	Siehe 4.1.24
valorTypeTelekurs		string	Titelart-Telekurs des Valors	Siehe 4.1.15
transactionAdditionalDetails		string	Abrechnungstext zu Lieferspesen	Freitext bis 600 Zeichen Beispielwert: "Externe Referenz 5284532742"
bookings				
bookingSecurityList				
bookingSecurity				
identificationSafeKeepingAccount	x	string	Wertschriftendepot-Nummer Die Wertschriftendepot-Nummer wird ohne Bindestriche abgefullt. Im gewohnten Format sieht sie wie folgt aus: 1-2600-12345678	Beispielwert: "1260012345678"
bookingIdentification	x	string	Identifikationsnummer der Titelbuchung	Beispielwert: "WS_123456789_3"
reversalIndicator	x	boolean	Storno-Indikator	Siehe 0
positionIdentification		string	Identifikationsnummer der Position	Beispielwert: "WS_12346578"
referenceToReversedBooking		string	Identifikationsnummer der ursprunglichen Buchung, im Falle eines Stornos	Beispielwert: "WS_123456789_4"
bookingType	x	string	Buchungstyp	Siehe 4.1.3
inOutIndicator	x	string	Eingang- und Ausgang-Indikator fur die Wertschriften im Depot	Siehe 4.1.10
quantity	x	decimal	Menge	Beispielwert: "400000"
unitOfQuantity	x	string	Art der Menge	Siehe 4.1.1
positionCurrency	x	string	Positionswahrung (ISO 4217)	Beispielwert: "CHF"
valorIdentification				
valorIdentification	x	string	Valorennummer mit fuhrenden Nullen	Siehe 4.1.20

Feldname / Attribut	M	Data type	Defintion	Option / Beispiel
valorIdentificationTelekurs		string	SIX Valorennummer	Beispielwert: "23862714"
valorTickerTelekurs		string	Ticker Telekurs des Valors	Beispielwert: "BOSN"
valorIsin		string	ISIN des Valors	Beispielwert: "CH0238627142"
valorTextShort	x	string	Text kurz des Valors auf 20 Zeichen beschränkt	Beispielwert: "Bossard Hldg N"
valorTextLong	x	string	Text lang des Valors	Beispielwert: "Namen-Akt Bossard Holding AG"
valorTypeGroup	x	string	Titelart-Gruppe des Valors	Siehe 4.1.24
valorTypeTelekurs		string	Titelart-Telekurs des Valors	Siehe 4.1.15
transactionPriceInPositionCurrency		decimal	Transaktionspreis in Positionswährung	Beispielwert: "1241.99"
transactionPriceType		string	Art des Preises	Siehe 4.1.2
fundsReferenceCurrency		string	Fonds-Referenzwährung (ISO 4217)	Beispielwert: "EUR"
fxRatePositionCurrencyToFundsReferenceCurrency		decimal	Devisenkurs der Positionswährung zur Fonds-Referenzwährung	Beispielwert: "0.722037"
bookingCashList				
bookingCash				
bookingType	x	string	Buchungstyp	Siehe 4.1.3
macIdentification		string	Kontonummer / IBAN	Beispielwert: "CH6500700123456789101"
amount	x	decimal	Abrechnungsbetrag	Beispielwert: "25876.12"
currency		string	Referenzwährung (ISO 4217)	Beispielwert: "USD"
creditDebitIndicator	x	string	Soll- und Haben-Indikator	Siehe 4.1.9

3.3.2 Devisen und Edelmetall

3.3.2.1 Fachliche Beschreibung

Bereitstellung von Transaktionsdaten zu Devisen- und Edelmetalltransaktionen.

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

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

3.3.3 Konto und Feste Vorschüsse

3.3.3.1 Fachliche Beschreibung

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

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

Feldname / Attribut	M	Data type	Defintion	Option / Beispiel
zvIdentification	x	string	interne Identifikationsnummer des Teilauftrags	Beispielwert: "AM210906A3336565"
amountInReferenceCurrency	x	decimal	Betrag des Teilauftrags	Beispielwert: "750.35"
referenceCurrency	x	string	Vergütungswährung (ISO 4217)	Beispielwert: "CHF"
transactionAdditionalDetails		string	Vertriebstext Detail	Beispielwert: "Max Muster, Musterstrasse 1, 8001 Zürich"
qrReference		decimal	QR Referenz eines Zahlungsauftrags	Beispielwert "9894984035064689"
accountIdentificationBeneficialOwner		string	Account number of beneficial owner	"CH6500700123456789101"
reasonForPayment		String	Zahlungszweck eines Zahlungsauftrags	"Rechnung 123"

3.3.4 Geldmarkt- und Treuhandanlagen

3.3.4.1 Fachliche Beschreibung

Bereitstellung von Transaktionsdaten zu Geldmarkt- und Treuhandanlagen-Transaktionen.

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

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

3.3.5 Hypotheken und Darlehen

3.3.5.1 Fachliche Beschreibung

Bereitstellung von Transaktionsdaten zu Hypotheken- und Darlehen-Transaktionen.

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

3.3.6 OTC-Derivate

3.3.6.1 Fachliche Beschreibung

Bereitstellung von Transaktionsdaten zu OTC-Derivaten.

Feldname / Attribut	M	Data type	Defintion	Option / Beispiel
transactionList				
transaction				
statement				
statementType	x	string	Abrechnungstyp	Siehe 4.1.19
transactionIdentification	x	string	Identifikationsnummer der Transaktion	Beispielwert: "WS_123456789"
reversedTransactionIdentification		string	Identifikationsnummer der ursprünglichen Transaktion, im Falle eines Stornos	Beispielwert: "WS_123456789S"
bookingDate	x	date	Buchungsdatum (ISO 8601)	Beispielwert: "2024-01-20"
valueDate	x	date	Valutadatum (ISO 8601)	Beispielwert: "2024-01-20"
transactionDate	x	date	Transaktionsdatum (ISO 8601)	Beispielwert: "2024-01-20"
transactionType	x	string	Die Transaktionsart beschreibt die Art des Auftrags	Beispielwert: "otc"
transactionSubtype	x	string	Erweitert die Transaktionsart	Siehe 4.1.17
otcInstrumentTypCode	x	string	Art des OTC-Instrumentes	Siehe 4.1.26
otcInstrumentSubtypCode	x	String	Subtyp des OTC-Instrumentes	Siehe 4.1.27
clientIdentification		string	Eindeutige Identifikationsnummer des Partners (Besitzer des Geschäfts)	Beispielwert: "1.234.567-8"
portfolioidentification		string	Identifikationsnummer des Anlageportfolios	Beispielwert: "9-4700-12345678"
portfolioReferenceCurrency		string	Referenzwährung des Anlageportfolios	Beispielwert: "CHF"
identificationSafeKeepingAccount		string	OTC-Derivatedepot-Nummer	Beispielwert: "1-7900-12345678"
descriptionSafeKeepingAccount		String	Rubrik des OTC-Derivatedepots	Beispielwert: "Vermögensverwaltung"
netAmount		decimal	Netto-Abrechnungsbetrag in Abrechnungswährung	Beispielwert: "1000000.15"
netAmountCreditDebitIndicator		string	Soll- und Haben-Indikator	Siehe 4.1.9
netAmountCurrency		string	Abrechnungswährung	Beispielwert: "CHF"
macIdentification		string	Kontonummer / IBAN	Beispielwert: "CH6500700123456789101"
descriptionMacc		string	Rubrik des Kontos	Beispielwert: "Zahlungen"
financialInstrumentName		string	Name des Instruments	Beispielwert: "IRS - EUR 05.04.2024 - 05.04.2027"
financialInstrumentIdentification		string	Kontraktidentifikationsnummer	Beispielwert: "IRS.123456789"
positionIdentification		string	Identifikationsnummer der Position	Beispielwert: "12346578"
optionType		string	Optionstyp	Siehe 4.1.14
callAmount		decimal	Callbetrag	Beispielwert: "1000000.15"
callAmountCreditDebitIndicator		string	Soll- und Haben-Indikator	Siehe 4.1.9
callCurrency		string	Callwährung	Beispielwert: "CHF"

Feldname / Attribut	M	Data type	Defintion	Option / Beispiel
maccdentificationCall		string	Kontonummer / IBAN	Beispielwert: "CH6500700123456789101"
putAmount		decimal	Putbetrag	Beispielwert: "1000000.15"
putAmountCreditDebitIndicator		string	Soll- und Haben-Indikator	Siehe 4.1.9
putCurrency		string	Putwährung	Beispielwert: "EUR"
maccdentificationPut		string	Kontonummer / IBAN	Beispielwert: "CH6500700123456789101"
strikePrice		decimal	Strikebetrag	Beispielwert: "1.025"
strikePricePretty		decimal	Strikebetrag Pretty	Beispielwert: "0.9756"
strikeCurrency		string	Strikewährung	Beispielwert: "CHF"
strikePriceType		string	Art des Strikepreises	Siehe 4.1.28
optionStyle		string	Optionsart	Siehe 4.1.6
settlementTypeCode		string	Lieferart	Siehe 4.1.29
upperBarrier		decimal	Obere Barriere	Beispielwert: "1.05"
upperBarrierTypeCode		string	Obere Barriere Typ	Siehe 4.1.35
lowerBarrier		decimal	Untere Barriere	Beispielwert: "0.96"
lowerBarrierTypeCode		string	Untere Barriere Typ	Siehe 4.1.35
leg1				
nominalAdjustmentLeg		decimal	Veränderung Nominalbetrag Leg 1 durch diese Transaktion	Beispielwert: "5000000"
nominalAdjustmentCreditDebitIndicator		string	Soll- und Haben-Indikator	Siehe 4.1.9
nominalAdjustmentLegCurrency		string	Währung Leg1	Beispielwert: "CHF"
interestStartDate		date	Zins-Start-Datum Leg 1 ganze Laufzeit; Ausnahme Zinszahlungen = Zins-Start-Datum abgerechnete Zinsperiode	Beispielwert: "2024_01_20"
interestEndDate		date	Zins-End-Datum Leg 1 ganze Laufzeit; Ausnahme Zinszahlungen = Zins-End-Datum abgerechnete Zinsperiode	Beispielwert: "2024_01_20"
calculatedInterestRate		decimal	Abgerechneter Zinssatz Leg 1 bei Zinszahlungen. Zeigt Nettozinssatz (Zins +/- Spread)	Beispielwert: "2.125"
leg2				
nominalAdjustmentLeg		decimal	Veränderung Nominalbetrag Leg 2 durch diese Transaktion	Beispielwert: "5000000"
nominalAdjustmentCreditDebitIndicator		string	Soll- und Haben-Indikator	Siehe 4.1.9
nominalAdjustmentLegCurrency		string	Währung Leg 2	Beispielwert: "CHF"
interestStartDate		date	Zins-Start-Datum Leg 2 ganze Laufzeit; Ausnahme Zinszahlungen = Zins-Start-Datum abgerechnete Zinsperiode	Beispielwert: "2024_01_20"
interestEndDate		date	Zins-End-Datum Leg 2 ganze Laufzeit; Ausnahme Zinszahlungen = Zins-End-Datum abgerechnete Zinsperiode	Beispielwert: "2024_01_20"

Feldname / Attribut	M	Data type	Defintion	Option / Beispiel
calculatedInterestRate		decimal	Abgerechneter Zinssatz Leg 2 bei Zinszahlungen. Zeigt Nettozinssatz (Zins +/- Spread)	Beispielwert: "2.125"
Bookings				
bookingCashList				
bookingCash				
bookingType		string	Buchungstyp	Siehe 4.1.3
macIdentification		string	Kontonummer / IBAN	Beispielwert: "CH6500700123456789101"
amount		decimal	Abrechnungsbetrag in Abrechnungswährung	Beispielwert: "1000000.15"
creditDebitIndicator		string	Soll- und Haben-Indikator	Siehe 4.1.9
currency		string	Abrechnungswährung	Beispielwert: "CHF"

3.4 Positionen

3.4.1 Wertschriften

3.4.1.1 Fachliche Beschreibung

Bereitstellung von Positionsdaten zu Wertschriftenpositionen.

Feldname / Attribut	M	Data type	Defintion	Option / Beispiel
positionList				
position				
positionIdentification	x	string	Identifikationsnummer der Position	Beispielwert: "WS_12346578"
clientIdentification		string	Eindeutige Identifikationsnummer des Partners (Besitzer des Geschäfts)	Beispielwert: "1.234.567-8"
portfolioIdentification		string	Identifikationsnummer des Anlageportfolios	Beispielwert: "9470012345678"
portfolioReferenceCurrency		string	Referenzwährung des Anlageportfolios	Beispielwert: "CHF"
accountIdentification	x	string	Kontonummer / IBAN	Beispielwert: "CH650070012345678910"
descriptionAccount		string	Rubrik des Kontos	Beispielwert: "Zahlungen"
positionCurrency	x	string	Positions­währung (ISO 4217)	Beispielwert: "CHF"
positionSecurity				
aggregatedQuantity	x	decimal	Summe von pendenter und gebuchter Menge	Beispielwert: "600000"
aggregatedQuantityCreditDebitIndicator	x	string	Soll- und Haben-Indikator des Abrechnungsbetrags	Siehe 4.1.9
bookedQuantity	x	decimal	Gebuchte Menge	Beispielwert: "400000"
bookedQuantityCreditDebitIndicator	x	string	Soll- und Haben-Indikator des Abrechnungsbetrags	Siehe 4.1.9
pendingExBrokerageQuantity	x	decimal	Pendente Buchung aus Ex-Brokerage Transaktion	Beispielwert: "200000"
pendingExBrokerageCreditDebitIndicator	x	string	Soll- und Haben-Indikator des Abrechnungsbetrags	Siehe 4.1.9
unitOfQuantity	x	string	Art der Menge	Siehe 4.1.1
safeKeepingPlace	x	integer	Code der Depotstelle der Position	Beispielwert: "CHASUS44XXX"
safeKeepingAccountRefCurrency	x	string	Referenzwährung des Wertschriftendepots (ISO 4217)	Beispielwert: "EUR"
costPriceInPositionCurrency		decimal	Einstandspreis in Positions­währung	Beispielwert: "22.18"
costPriceInSafeKeepingAccountRefCurrency		decimal	Einstandspreis in Wertschriftendepot Referenzwährung	Beispielwert: "23.06"
costPriceCreditDebitIndicator		string	Soll- und Haben-Indikator des Einstandspreises	Siehe 4.1.9
costPriceType		string	Art des Preises	Siehe 4.1.2

Feldname / Attribut	M	Data type	Defintion	Option / Beispiel
costPriceFxRate		decimal	Devisenkurs der Positionswährung zu Wertschriftendepot Referenzwährung zum Kaufzeitpunkt	Beispielwert: " 1.2867 "
costValueInPositionCurrency		decimal	Einstandswert in Positionswährung	Beispielwert: " 80056.84 "
costValueInSafeKeepingAccountRefCurrency		decimal	Einstandswert in Depotreferenzwährung	Beispielwert: " 90001.08 "
costValueCreditDebitIndicator		string	Soll- und Haben-Indikator des Einstandswerts	Siehe 4.1.9
lastBookingDate		date	Buchungsdatum der letzten Bestandesveränderung (ISO 8601)	Beispielwert: " 2022-05-05 "
marketValueInPositionCurrency		decimal	Aktueller Wert in Positionswährung	Beispielwert: " 120056.84 "
marketValueInSafeKeepingAccountRefCurrency		decimal	Aktueller Wert in Wertschriftendepot-Referenzwährung	Beispielwert: " 126085.12 "
marketValueCreditDebitIndicator		string	Soll- und Haben-Indikator des aktuellen Werts	Siehe 4.1.9
marketPrice		decimal	Marktpreis der Position	Beispielwert: " 28.95 "
marketPriceCreditDebitIndicator		string	Soll- und Haben-Indikator des Kurses	Siehe 4.1.9
marketPriceCurrency		string	Währung des Kurses (ISO 4217)	Beispielwert: " EUR "
marketPriceFxRate		decimal	Devisenkurs der Positionswährung zu Wertschriftendepot Referenzwährung	Beispielwert: " 0.9856 "
marketPriceType		string	Art des Preises	Siehe 4.1.2
marketPriceDate		date	Datum des Kurses (ISO 8601)	Beispielwert: " 2022-05-18 "
marketPriceMktPlace		string	Börsenplatz des Marktpreises	
mktPlaceCode		string	Börsenplatz Telekurs-Code	Beispielwert: " 4 "
mktPlaceIsoCode		string	Börsenplatz ISO-Code (ISO 10383)	Beispielwert: " XSWX "
mktPlaceNameShort		string	Börsenplatz Name kurz	Beispielwert: " SIX Swiss Excha "
mktPlaceNameLong		string	Börsenplatz Name lang	Beispielwert: " SIX Swiss Exchange "
accruedInterestInPositionCurrency		decimal	Marchzins in Positionswährung	Beispielwert: " 400.12 "
accruedInterestCreditDebitIndicator		string	Soll- und Haben-Indikator des Marchzins	Siehe 4.1.9
accruedInterestInSafeKeepingAccountCurrency		decimal	Marchzins in Wertschriftendepot Referenzwährung	Beispielwert: " 685.32 "

Feldname / Attribut	M	Data type	Defintion	Option / Beispiel
valorIdentification				
valorIdentification	x	string	Valorenummer mit führenden Nullen	Siehe 4.1.20
valorIdentificationTelekurs		string	SIX Valorenummer	Beispielwert: "23862714"
valorTickerTelekurs		string	Ticker Telekurs des Valors	Beispielwert: "BOSN"
valorIsin		string	ISIN des Valors	Beispielwert: "CH0238627142"
valorTextShort		string	Text kurz des Valors auf 20 Zeichen beschränkt	Beispielwert: "Bossard Hldg N"
valorTextLong		string	Text lang des Valors	Beispielwert: "Namen-Akt Bossard Holding AG"
valorTypeGroup		string	Titelart-Gruppe des Valors	Siehe 4.1.24
valorTypeTelekurs		string	Titelart-Telekurs des Valors	Siehe 4.1.15
valorStatus	x	string	Status des Valors	Siehe 4.1.13
valorOpeningDate		date	Eröffnungsdatum des Instruments (ISO 8601)	Beispielwert: "2014-04-11"
valorEndDate		date	Endverfalldatum des Instruments (ISO 8601)	Beispielwert: "2024-01-05"
valorInterestRate		decimal	Zinssatz	Beispielwert: "8.5"
valorInterestFrequencyCode		string	Zinsusanz	Siehe 4.1.4
valorFirstInterestPaymentDate		date	erster Zinszahlungstermin (ISO 8601)	Beispielwert: "2012-07-05"
valorInterestPeriod		string	Periodizität der Zinsgutschrift	Siehe 4.1.5
valorOptionType		string	Valor Optionstyp	Siehe 4.1.14
valorOptionStyle		string	Valor Optionsstil	Siehe 4.1.6
settlementTypeCode		String	Erfüllungsart Option	Siehe 4.1.29
valorContractAmount		decimal	Kontraktgrösse des Valors	Beispielwert: "100"
valorSmallestDenomination		decimal	kleinste Stückelung des Valors	Beispielwert: "1"
valorMinimumTradeVolume		decimal	Mindesthandelsmenge des Valors	Beispielwert: "100000"
numberOfUnderlyingValors	x	integer	Anzahl der Basisvaloren des Valors	Beispielwert: "1"
underlyingList				
underlying				
priceOfUnderlying		decimal	Basispreis	Beispielwert: "1241.99"
creditDebitIndicator		string	Vorzeichen des Basispreises	Siehe 4.1.9
priceOfUnderlyingCurrency		string	Währung des Basispreises (ISO 4217)	Beispielwert: "USD"
priceOfUnderlyingPriceType		string	Art des Preises	Siehe 4.1.2
valorIdentification				

Feldname / Attribut	M	Data type	Defintion	Option / Beispiel
valorIdentification		string	Valorenummer mit führenden Nullen des unterliegenden Titels	Siehe 4.1.20
valorIdentificationTelekurs		string	SIX Valorenummer des unterliegenden Titels	Beispielwert: "23862714"
valorTickerTelekurs		string	Ticker Telekurs des unterliegenden Valors	Beispielwert: "BOSN"
valorIsin		string	ISIN des unterliegenden Valors	Beispielwert: "CH0238627142"
valorTextShort		string	Text kurz des Valors auf 20 Zeichen beschränkt	Beispielwert: "Bossard Hldg N"
valorTextLong		string	Text lang des unterliegenden Valors	Beispielwert: "Namen-Akt Bossard Holding AG"
valorTypeGroup		string	Titelart-Gruppe des unterliegenden Valors	Siehe 4.1.24
valorTypeTelekurs		string	Titelart-Telekurs des unterliegenden Valors	Siehe 4.1.15
mktplace			Börsenplatz, über welchen die Position gehandelt wurde	
mktplaceCode		string	Börsenplatz Telekurs-Code	Beispielwert: "4"
mktplaceIsoCode		string	Börsenplatz ISO-Code (ISO 10383)	Beispielwert: "XSWX"
mktplaceNameShort		string	Börsenplatz Name kurz	Beispielwert: "SIX Swiss Excha"
mktplaceNameLong		string	Börsenplatz Name lang	Beispielwert: "SIX Swiss Exchange"
accumVarMarginInPositionCurrency		decimal	Kumulierte Variation Margins in Position Currency	Beispielwert: "200.20"
accumVarMarginInPositionCurrencyCreditDebitIndicator		String	Vorzeichen Kumulierte Variation Margins in Position Currency	Siehe 4.1.9
accumVarMarginInSafeKeepingAccountRefCurrency		decimal	Kumulierte Variation Margins in Wertschriftendepot Referenzwährung	Beispielwert: "200.20"
accumVarMarginInSafeKeepingAccountRefCurrencyCreditDebitIndicator		string	Vorzeichen Kumulierte Variation Margins in Wertschriftendepot Referenzwährung	Siehe 4.1.9

3.4.2 Devisen und Edelmetall

3.4.2.1 Fachliche Beschreibung

Bereitstellung von Positionsdaten zu Devisen- und Edelmetall-Positionen.

- Spots werden nicht als Position angezeigt

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

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

3.4.3 Konto und feste Vorschüsse

3.4.3.1 Fachliche Beschreibung

Bereitstellung von Positionsdaten zu Positionen von Konten und festen Vorschüssen.

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

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

3.4.4 Geldmarkt- und Treuhandanlagen

3.4.4.1 Fachliche Beschreibung

Bereitstellung von Positionsdaten zu Geldmarkt- und Treuhandanlagen-Positionen.

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

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

3.4.5 Hypotheken und Darlehen

3.4.5.1 Fachliche Beschreibung

Bereitstellung von Positionsdaten zu Positionen von Hypotheken und Darlehen.

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

3.4.6 OTC-Derivate

3.4.6.1 Fachliche Beschreibung

Bereitstellung von Positionsdaten zu OTC-Positionen.

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

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

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

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

3.5 Bewertungen

3.5.1 Wertschriften

3.5.1.1 Fachliche Beschreibung

Bereitstellung von Bewertungen zu Wertschriftenpositionen.

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

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

3.5.2 Devisen und Edelmetall

3.5.2.1 Fachliche Beschreibung

Bereitstellung von Bewertungen zu Devisen- und Edelmetallpositionen.

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

3.5.3 Geldmarkt- und Treuhandanlagen

3.5.3.1 Fachliche Beschreibung

Bereitstellung von Bewertungen zu Geldmarkt- und Treuhandanlagen-Positionen.

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

3.6 Stammdaten

3.6.1 Wertschriften

3.6.1.1 Fachliche Beschreibung

Bereitstellung von Stammdaten zu Wertschriftenpositionen.

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

Feldname / Attribut	M	Data type	Defintion	Option / Beispiel
			(ISO 4217)	"USD"
priceOfUnderlyingPriceType		string	Art des Preises	Siehe 4.1.2
valoridentification				
valorIdentification		string	Valorennummer mit führenden Nullen des unterliegenden Titels	Siehe 4.1.20
valorIdentificationTelekurs		string	SIX Valorennummer des unterliegenden Titels	Beispielwert: "23862714"
valorTickerTelekurs		string	Ticker Telekurs des unterliegenden Valors	Beispielwert: "BOSN"
valorIsin		string	ISIN des unterliegenden Valors	Beispielwert: "CH0238627142"
valorTextShort		string	Text kurz des Valors auf 20 Zeichen beschränkt	Beispielwert: "Bossard Hldg N"
valorTextLong		string	Text lang des unterliegenden Valors	Beispielwert: "Namen-Akt Bossard Holding AG"
valorTypeGroup		string	Titelart-Gruppe des unterliegenden Valors	Siehe 4.1.24
valorTypeTelekurs		string	Titelart-Telekurs des unterliegenden Valors	Siehe 4.1.15
mktplace				
mktplaceCode		string	Börsenplatz Telekurs-Code	Beispielwert: "4"
mktplaceIsoCode		string	Börsenplatz ISO-Code (ISO 10383)	Beispielwert: "XSWX"
mktplaceNameShort		string	Börsenplatz Name kurz	Beispielwert: "SIX Swiss Excha"
mktplaceNameLong		string	Börsenplatz Name lang	Beispielwert: "SIX Swiss Exchange"

3.6.2 Devisen und Edelmetall

3.6.2.1 Fachliche Beschreibung

Bereitstellung von Stammdaten zu Devisen- und Edelmetallpositionen.

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

3.6.3 Geldmarkt- und Treuhandanlagen

3.6.3.1 Fachliche Beschreibung

Bereitstellung von Stammdaten zu Geldmarkt- und Treuhandanlagen-Positionen.

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

4 Detailbeschreibung

4.1 Beschreibung und mögliche Werte

4.1.1 unitOfQuantity

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

4.1.2 priceType

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

4.1.3 bookingType

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

Mögliche Werte	Kategorie	Beschreibung / Verwendungszweck
revenue		Ertrag
secFeeUSA	x	Börsengebühr
security		Titelbuchung
settlementFee	x	Settlement Gebühr
stampDuty	x	Stempelsteuern
stampDutyUK_IR	x	Stempelsteuern UK und Irland
subscriptionFee	x	Ausgabekommission Fonds
thirdPartyFee	x	Fremde Gebühren: EUREX
transactionFee	x	Transaktionsgebühren
USWithholdingTax	x	US-Quellensteuer
valueAddedTax	x	Mehrwertsteuer
variationMargin		Variation Margin
withholdingTax	x	Quellensteuer
withholdingTaxCH	x	Verrechnungssteuer
additionalPaymentAmount		Zusätzliche Zahlungen während der Laufzeit (Upfront Fee, Balloon Fee)
cashSettlementAmount		Barabgeltung
interestAmount		Zinsbetrag
premiumAmount		Prämienzahlung
unwindFeeAmount		Abgeltung aus Glattstellung

4.1.4 interestFrequencyCode

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

4.1.5 interestPeriod

Mögliche Werte	Beschreibung / Verwendungszweck
byClosing	Zinstermin bei der Schliessung des Valors
accordingToDateList	Zinstermin gemäss der Datenliste
endOfMonth	Zinstermin am Ende des Monats
onEvent	Zinstermin auf ein Ereignis
atMaturity	Zinstermin bei Verfall des Valors
monthlyRolling	Zinstermin monatlich rollierend
quarterlyRolling	Zinstermin quartalsweise rollierend
quarterlyEndOfMonth	Zinstermin quartalsweise am Ende des Monats
quarterly3rdWednesday	Zinstermin quartalsweise am dritten Mittwoch des Monats
quarterlyOn20th	Zinstermin quartalsweise am 20. des Monats
Years2	Zinstermin zwei-jährlich
endOfQuarter	Zinstermin am Ende des Quartals
annualRolling	Zinstermin jährlich rollierend
annualRollingEndOfMonth	Zinstermin jährlich am Ende des Monats
semiAnnualRolling	Zinstermin halbjährlich rollierend
semiAnnualEndOfMonth	Zinstermin halbjährlich am Ende des Monats
semiAnnual3rdWednesday	Zinstermin halbjährlich am dritten Mittwoch des Monats

4.1.6 optionStyle

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

4.1.7 interestFrequencyCode (loan)

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

4.1.8 interestPeriod (loan)

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

4.1.9 creditDebitIndicator

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

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	Versicherungspolicen
structuredProduct	Strukturierte Produkte
trustShare	Trust-Shares
interestRate	Zinssätze
residualQuotaCertificate	Restquotenbescheinigungen
entitlement	Anrechte, Bezugsrechte
nationalCurrency	Nationale Währungen
trustCertificate	Trust-Zertifikate
shareCertificate	Anteilscheine
savingDeposit	Einlage, Depositen und Sparhefte
repoTransaction	REPO
technicalValor	Technische Valoren
floatingRateNote	Floating Rate Notes, variable Obligationen
warrant	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
otc	OTC Derivate

4.1.17 transactionSubtype

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

Mögliche Werte	Beschreibung / Verwendungszweck
fees	Gebühren (Die Unterscheidung der Gebührenarten erfolgt innerhalb des Attributs "bookingType")
inflowOutflowDigital	Eingehende und ausgehende Zahlungen im Zusammenhang mit dem Geldkonto. 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)
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 (in transactionType 'otc')	Kauf
creditEvent	Credit Event bei CDS
decrease (in transactionType 'otc')	Teilweise Glättstellung CDS-Position
exerciseCash (in transactionType 'otc')	Bar Ausübung
exercisePhysical (in transactionType 'otc')	Physische Ausübung
expiration (in transactionType 'otc')	Endverfall
fees (in transactionType 'otc')	Glättstellungs-Betrag (TRS)
Interest (in transactionType 'otc')	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 (in transactionType 'otc')	Eröffnung Position (CCS und Accu/Decu)
openPayerSwap	Eröffnung Payer Swap
openReceiverSwap	Eröffnung Receiver Swap
payment	Zahlung aus Accu/Decu)
premium	Prämien-Zahlung
resetPayment	Periodische Zahlung TRS (Zins + Performance)
Sell (in transactionType 'otc')	Verkauf

Mögliche Werte	Beschreibung / Verwendungszweck
Unwind (in transactionType 'otc')	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	Storno: Im Falle eines Stornos wird ein nicht korrektes Geschäft zu den vergangenen Bedingungen erneut ausgelöst
rectificat	Rektifikat: Im Falle eines Rektifikats wird ein nicht korrektes Geschäft zu den aktuellen Bedingungen erneut ausgelöst

4.1.20 valorIdentification

Beschreibung und Verwendungszweck

Die 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	Beschreibung / Verwendungszweck
true	wahr (z.B. metalAccountIndicator = true – Es ist ein Metallkonto)
false	falsch (z.B. metalAccountIndicator = false – Es ist kein Metallkonto)

4.1.22 reversalIndicator

Mögliche Werte	Beschreibung / Verwendungszweck
true	wahr (z.B. reversalIndicator = true – Storno)
false	falsch (z.B. reversalIndicator = false – kein Storno)

4.1.23 fxType

Mögliche Werte	Beschreibung / Verwendungszweck
fxSpot	FX Spot
fxSpotSwapLeg	FX Spot Swap Leg
fxForward	FX Forward
fxForwardSwapLeg	FX Forward Swap Leg
fxForwardNdf	FX Forward NDF

4.1.24 valorTypeGroup

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

4.1.25 type

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

4.1.26 otclInstrumentTypeCode

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

4.1.27 otclInstrumentSubtypeCode

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

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	Transaktionen
positions	Positionen
prices	Bewertungen
static_data	Stammdaten

4.1.35 barrierTypeCode

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