

Описание параметров fpml на рынке СПФИ



Назначение документа

Данный документ разработан с целью систематизации и структурирования информации о параметрах, используемых в FPML-схемах (Financial Product Markup Language) для продуктов Московской биржи.

Таблица в документе предоставляет четкое разделение наименований параметров FPML-схем по типам продуктов (Basis, IRS, OIS, ХССУ), что позволяет участникам рынка быстро находить необходимую информацию без необходимости изучать множество технических спецификаций.

История изменений:

| № п /п | Версия документа | Внесенные изменения | Дата внесения изменений |
|--------|------------------|--|-------------------------|
| 1 | 0.2 | Изменено описание параметра tradeId. Идентификатор сделки: клиринговый/торговый - в зависимости от partyReference: <ul style="list-style-type: none">partyReference href="код фирмы" - торговый номер (совпадает с номером сделки в FIX сообщении)partyReference href="NCCB" - клиринговый номер | 22.07.2025 |
| 2 | 0.3 | Добавлен раздел с описанием типа сделки Cap/Floor | 29.08.2025 |

Оглавление:

- 1. [Basis](#)
- 2. [IRS](#)
- 3. [Cap/Floor](#)
- 4. [OIS](#)
- 5. [ХССУ](#)

1. Basis

| Параметр | Описание параметра | Тип параметра | Примечание |
|-------------------------------|---|---------------|--------------------|
| accountReference | Ссылка на счёт | string | |
| adjustedDate | Скорректированная дата | date | Пример: 2025-01-27 |
| adjustedEndDate | Скорректированная дата окончания | date | Пример: 2025-02-27 |
| adjustedFixingDate | Скорректированная дата фиксации | date | Пример: 2024-12-10 |
| adjustedPaymentDate | Скорректированная дата платежа | date | Пример: 2025-02-27 |
| adjustedPrincipalExchangeDate | Скорректированная дата обмена основными суммами | date | Пример: 2025-01-27 |

| | | | |
|-----------------------------------|--|---------|-----------------------------|
| adjustedStartDate | Скорректированная дата начала | date | Пример: 2025-01-27 |
| amount | Сумма | decimal | Пример: 15287.67 |
| averagingMethod | Метод усреднения | string | Пример: Weighted |
| businessCenter | Финансовый центр | string | Пример: CNBE |
| businessCenters | Финансовые центры | string | |
| businessDayConvention | Конвенция рабочего дня | string | Пример: FOLLOWING |
| calculatedRate | Расчётная ставка | decimal | Пример: 0.02655 |
| calculation | Расчёт | string | |
| calculationPeriod | Расчётный период | string | |
| calculationPeriodAmount | Сумма за расчётный период | string | |
| calculationPeriodDates | Даты расчётного периода | string | |
| calculationPeriodDatesAdjustments | Корректировки дат расчётного периода | string | |
| calculationPeriodDatesReference | Ссылка на даты расчётного периода | string | |
| calculationPeriodFrequency | Частота расчётного периода | string | |
| cashflows | Денежные потоки | string | |
| cashflowsMatchParameters | Параметры совпадают с денежными потоками | boolean | Пример: true |
| category | Категория | string | Пример: OTC |
| categoryScheme | Схема классификации | string | Атрибут |
| clearedDate | Дата клиринга | date | Пример: 2025-01-27 |
| csa | CSA (соглашение о кредитном обеспечении) | string | Пример: RUB |
| currency | Валюта | string | Пример: CNY |
| dateAdjustments | Корректировки даты | string | |
| dateRelativeTo | Дата относительно | string | |
| dayCountFraction | Дробь подсчета дней | string | Пример: ACT/ACT. ISDA |
| dayCountFractionScheme | Стандарт или схемы, которая определяет, как рассчитывается дневная доля (day count fraction) для финансовых инструментов | string | Атрибут |
| dayType | Тип дня | string | Пример: Calendar |
| effectiveDate | Дата вступления в силу | string | |
| executionDateTime | Дата и время исполнения | date | Пример: 2025-01-27T11:10:52 |
| finalExchange | Окончательный обмен | boolean | Пример: true |
| firstPeriodStartDate | Дата начала первого расчетного периода | string | |
| fixedRate | Фиксированная ставка | decimal | Пример: 0.12 |
| fixedRateSchedule | Расписание фиксированных ставок | string | |
| fixingDates | Даты, на которых устанавливаются (фиксируются) ставки | string | |
| floatingRateCalculation | Расчёт плавающей ставки | string | |
| floatingRateDefinition | Описание параметров плавающей ставки (индекс, даты, корректировки) | string | |
| floatingRateIndex | Индекс плавающей ставки | string | Пример: EUR-EURIBOR-Act/365 |
| floatingRateIndexScheme | Стандарт или схема, определяющая индекс плавающей ставки | string | Атрибут |

| | | | |
|--------------------------|--|---------|----------------------------------|
| forecastAmount | Прогнозная сумма | string | |
| forecastPaymentAmount | Прогнозируемая сумма выплаты | string | |
| initialExchange | Начальный обмен | boolean | Пример: true |
| initialValue | Начальное значение | decimal | Пример: 1500000.0 |
| intermediateExchange | Промежуточный обмен | boolean | Пример: false |
| moexSpfiExt | Расширение для продукта, связанного с индексом MOEX | string | |
| notionalAmount | Номинальная сумма | decimal | Пример: 1500000.0 |
| notionalSchedule | Расписание изменений номинальной суммы | string | |
| notionalStepSchedule | Шаги изменения номинала | string | |
| npv | Чистая приведённая стоимость (NPV) | string | |
| npvAmount | Сумма NPV | decimal | Пример: 141766444.99 |
| npvCurrency | Валюта, в которой рассчитывается текущая стоимость | string | Пример: RUB |
| npvDate | Дата NPV | date | Пример: 2025-02-05 |
| npvPayment | Выплата текущей стоимости | string | |
| npvPoint | Точка в расчете текущей стоимости | string | |
| npvValue | Значение текущей стоимости | string | |
| observationWeight | Вес наблюдения | decimal | Пример: 28 |
| observedRate | Фактическая ставка, полученная на основе наблюдения | decimal | Пример: 0.02655 |
| otherPartyPayment | Платёж другой стороны | string | |
| partyReference | Ссылка на сторону | string | |
| partyRoleScheme | Схема, определяющая роль участника сделки | string | Атрибут |
| partyTradeIdentifier | Идентификатор сделки стороны | string | |
| partyTradeInformation | Информация о сделке, относящаяся к конкретному участнику | string | |
| payRelativeTo | Относительная дата, к которой привязывается выплата | string | Пример: CalculationPeriodEndDate |
| payerAccountReference | Ссылка на банковский аккаунт плательщика | string | |
| payerPartyReference | Ссылка на участника-плательщика | string | |
| paymentAmount | Сумма платежа | string | |
| paymentCalculationPeriod | Период расчёта платежа | string | |
| paymentDate | Дата платежа | string | |
| paymentDates | Даты выплат | string | |
| paymentDatesAdjustments | Корректировки дат выплат | string | |
| paymentDaysOffset | Смещение дней для выплаты | string | |
| paymentFrequency | Частота платежей | string | |
| paymentType | Тип и период выплаты | string | Пример: SCMC2 |
| period | Временной период | string | Пример: M |
| periodMultiplier | Коэффициент, умножающий временной период | decimal | Пример: 3 |
| principalExchange | Обмен основной суммы (номинала) между сторонами | string | |
| principalExchangeAmount | Сумма, подлежащая обмену (номинал) | decimal | Пример: -1500000.0 |

| | | | |
|-------------------------------|--|---------|------------------------------------|
| principalExchanges | Список всех обменов номинала в рамках сделки | string | |
| productType | Тип финансового продукта | string | Пример: ХССУ |
| productTypeScheme | Стандарт или схема, определяющая productType | string | Атрибут |
| rateObservation | Наблюдение за процентной ставкой | string | |
| receiverAccountReference | Ссылка на банковский аккаунт получателя | string | |
| receiverPartyReference | Ссылка на участника-получателя | string | |
| relatedParty | Связанный участник сделки | string | |
| resetDate | Дата перерасчета | date | Пример: 2024-12-12 |
| resetDates | Даты перерасчёта | string | |
| resetDatesAdjustments | Корректировки дат пересчёта ставок | string | |
| resetFrequency | Частота пересчёта ставок | string | |
| resetRelativeTo | Перерасчёт относительно | string | Пример: CalculationPeriodStartDate |
| role | Роль участника в сделке | string | Пример: CounterpartyForSecondTrade |
| rollConvention | Правило определения даты выплаты в зависимости от дня месяца | string | Пример: NONE |
| settlementCode | Код, определяющий тип поставки/расчёта | decimal | Пример: 10800 |
| spread | Спред | decimal | Пример: 0.01 |
| spreadSchedule | Расписание премий (spread) к плавающей ставке | string | |
| swap | Основной элемент, описывающий структуру свопа | string | |
| swapStream | Поток (ножка) свопа | string | |
| terminationDate | Дата окончания действия продукта или сделки | string | |
| trade | Сделка | string | |
| tradeComment | Комментарий к сделке | string | |
| tradeDate | Дата сделки | date | Пример: 2025-01-27 |
| tradeId | Идентификатор сделки: клиринговый/торговый - в зависимости от partyReference: <ul style="list-style-type: none">partyReference href="код фирмы" - торговый номер (совпадает с номером сделки в FIX сообщении)partyReference href="NCCB" - клиринговый номер | decimal | Пример: 624 |
| tradeIdScheme | Схема, определяющая уникальный идентификатор сделки | string | Атрибут |
| tradeInfo | Блок с общей информацией о сделке | string | |
| trader | Участник, инициировавший или заключивший сделку | string | Пример: MT1080000001 |
| unadjustedDate | Некорректированная дата | date | Пример: 2025-01-27 |
| averagingMethod | Метод усреднения | string | Пример: Weighted |
| adjustedPrincipalExchangeDate | Скорректированная дата обмена основными суммами | date | Пример: 2025-01-27 |

2. IRS

| Параметр | Описание параметра | Тип параметра | Примечание |
|------------------|--------------------|---------------|------------|
| accountReference | Ссылка на счёт | string | |

| | | | |
|-----------------------------------|---|---------|-----------------------------|
| adjustedDate | Скорректированная дата | date | Пример: 2025-01-27 |
| adjustedEndDate | Скорректированная дата окончания | date | Пример: 2025-02-27 |
| adjustedFixingDate | Скорректированная дата фиксации | date | Пример: 2024-12-10 |
| adjustedPaymentDate | Скорректированная дата платежа | date | Пример: 2025-02-27 |
| adjustedPrincipalExchangeDate | Скорректированная дата обмена основными суммами | date | Пример: 2025-01-27 |
| adjustedStartDate | Скорректированная дата начала | date | Пример: 2025-01-27 |
| amount | Сумма | decimal | Пример: 15287.67 |
| averagingMethod | Метод усреднения | string | Пример: Weighted |
| businessCenter | Финансовый центр | string | Пример: CNBE |
| businessCenters | Финансовые центры | string | |
| businessDayConvention | Конвенция рабочего дня | string | Пример: FOLLOWING |
| calculatedRate | Расчётная ставка | decimal | Пример: 0.02655 |
| calculation | Расчёт | string | |
| calculationPeriod | Расчётный период | string | |
| calculationPeriodAmount | Сумма за расчётный период | string | |
| calculationPeriodDates | Даты расчётного периода | string | |
| calculationPeriodDatesAdjustments | Корректировки дат расчётного периода | string | |
| calculationPeriodDatesReference | Ссылка на даты расчётного периода | string | |
| calculationPeriodFrequency | Частота расчётного периода | string | |
| cashflows | Денежные потоки | string | |
| cashflowsMatchParameters | Параметры совпадают с денежными потоками | boolean | Пример: true |
| category | Категория | string | Пример: OTC |
| categoryScheme | Схема классификации, определяющая значение атрибута category | string | Атрибут |
| clearedDate | Дата клиринга | date | Пример: 2025-01-27 |
| csa | CSA (соглашение о кредитном обеспечении) | string | Пример: RUB |
| currency | Валюта | string | Пример: CNY |
| dateAdjustments | Корректировки даты | string | |
| dateRelativeTo | Дата относительно | string | |
| dayCountFraction | Дробь подсчета дней | string | Пример: ACT/ACT.ISDA |
| dayCountFractionScheme | Стандарт, по которому интерпретируется метод расчета дневной доли | string | Атрибут |
| dayType | Тип дня | string | Пример: Calendar |
| effectiveDate | Дата вступления в силу | string | |
| executionDateTime | Дата и время исполнения | date | Пример: 2025-01-27T11:10:52 |
| finalExchange | Окончательный обмен | boolean | Пример: true |
| firstPeriodStartDate | Дата начала первого расчетного периода | string | |
| fixedRate | Фиксированная ставка | decimal | Пример: 0.12 |
| fixedRateSchedule | Расписание фиксированных ставок | string | |
| fixingDates | Даты, на которых устанавливаются (фиксируются) ставки | string | |
| floatingRateCalculation | Расчёт плавающей ставки | string | |
| floatingRateDefinition | Описание параметров плавающей ставки | string | |

| | | | |
|--------------------------|--|---------|----------------------------------|
| floatingRateIndex | Индекс плавающей ставки | string | Пример: EUR-EURIBOR-Act/365 |
| floatingRateIndexScheme | Стандарт, определяющий индекс плавающей ставки | string | Атрибут |
| forecastAmount | Прогнозная сумма | string | |
| forecastPaymentAmount | Прогнозируемая сумма выплаты (до фактического расчета) | string | |
| initialExchange | Начальный обмен | boolean | Пример: true |
| initialValue | Начальное значение | decimal | Пример: 1500000.0 |
| intermediateExchange | Промежуточный обмен | boolean | Пример: false |
| moexSpfiExt | Расширение для продукта, связанного с Московской биржей | string | |
| notionalAmount | Номинальная сумма | decimal | Пример: 1500000.0 |
| notionalSchedule | Расписание изменений номинальной суммы | string | |
| notionalStepSchedule | Шаги изменения номинала | string | |
| npv | Чистая приведённая стоимость (NPV) | string | |
| npvAmount | Сумма NPV | decimal | Пример: 141766444.99 |
| npvCurrency | Валюта, в которой рассчитывается текущая стоимость (NPV) | string | Пример: RUB |
| npvDate | Дата NPV | date | Пример: 2025-02-05 |
| npvPayment | Выплата текущей стоимости (NPV) | string | |
| npvPoint | Точка в расчете текущей стоимости (NPV) | string | |
| npvValue | Значение текущей стоимости (NPV) | string | |
| observationWeight | Вес наблюдения | decimal | Пример: 28 |
| observedRate | Фактическая ставка, полученная на основе наблюдения | decimal | Пример: 0.02655 |
| otherPartyPayment | Платёж другой стороны | string | |
| partyReference | Ссылка на сторону | string | |
| partyRoleScheme | Схема, определяющая роль участника сделки | string | Атрибут |
| partyTradeIdentifier | Идентификатор сделки стороны | string | |
| partyTradeInformation | Информация о сделке, относящаяся к конкретному участнику | string | |
| payRelativeTo | Относительная дата, к которой привязывается выплата | string | Пример: CalculationPeriodEndDate |
| payerAccountReference | Ссылка на банковский аккаунт плательщика | string | |
| payerPartyReference | Ссылка на участника-плательщика | string | |
| paymentAmount | Сумма платежа | string | |
| paymentCalculationPeriod | Период расчёта платежа | string | |
| paymentDate | Дата платежа | string | |
| paymentDates | Даты выплат | string | |
| paymentDatesAdjustments | Корректировки дат выплат | string | |
| paymentDaysOffset | Смещение дней для выплаты | string | |
| paymentFrequency | Частота платежей | string | |
| paymentType | Тип выплаты | string | Пример: SCMC2 |
| period | Временной период | string | Пример: М |
| periodMultiplier | Коэффициент, умножающий временной период | decimal | Пример: 3 |
| principalExchange | Обмен номинальной суммы | string | |
| principalExchangeAmount | Сумма, подлежащая обмену | decimal | Пример: -1500000.0 |
| principalExchanges | Список всех обменов номинала в рамках сделки | string | |

| | | | |
|--------------------------|--|---------|------------------------------------|
| productType | Тип финансового продукта | string | Пример: ХССУ |
| productTypeScheme | Стандарт, определяющий productType | string | Атрибут |
| rateObservation | Наблюдение за процентной ставкой | string | |
| receiverAccountReference | Ссылка на банковский аккаунт получателя | string | |
| receiverPartyReference | Ссылка на участника-получателя | string | |
| relatedParty | Связанный участник сделки | string | |
| resetDate | Дата перерасчета | date | Пример: 2024-12-12 |
| resetDates | Даты перерасчёта | string | |
| resetDatesAdjustments | Корректировки дат пересчёта ставок | string | |
| resetFrequency | Частота пересчёта ставок | string | |
| resetRelativeTo | Перерасчёт относительно | string | Пример: CalculationPeriodStartDate |
| role | Роль участника в сделке | string | Пример: CounterpartyForSecondTrade |
| rollConvention | Правило определения даты выплаты в зависимости от дня месяца | string | Пример: NONE |
| settlementCode | Код, определяющий тип поставки/расчёта | decimal | Пример: 10800 |
| spread | Спред | decimal | Пример: 0.01 |
| spreadSchedule | Расписание премий (spread) к плавающей ставке | string | |
| swap | Основной элемент, описывающий структуру свопа | string | |
| swapStream | Поток (ножка) свопа (например, фиксированная или плавающая) | string | |
| terminationDate | Дата окончания действия продукта или сделки | string | |
| trade | Сделка | string | |
| tradeComment | Комментарий к сделке | string | |
| tradeDate | Дата сделки | date | Пример: 2025-01-27 |
| tradeId | Идентификатор сделки: клиринговый/торговый - в зависимости от partyReference: <ul style="list-style-type: none">partyReference href="код фирмы" - торговый номер (совпадает с номером сделки в FIX сообщении)partyReference href="NCCB" - клиринговый номер | decimal | Пример: 624 |
| tradeIdScheme | Схема, определяющая уникальный идентификатор сделки | string | Атрибут |
| tradeInfo | Блок с общей информацией о сделке | string | |
| trader | Участник, инициировавший или заключивший сделку | string | Пример: MT1080000001 |
| unadjustedDate | Некорректированная дата | date | Пример: 2025-01-27 |
| averagingMethod | Метод усреднения | string | Пример: Weighted |
| fixedRate | Фиксированная ставка | decimal | Пример: 0.12 |

3. Cap/Floor

| Параметр | Описание параметра | Тип параметра | Примечание |
|------------------|----------------------------------|---------------|--------------------|
| accountReference | Ссылка на счёт | string | |
| adjustedDate | Скорректированная дата | date | Пример: 2025-01-27 |
| adjustedEndDate | Скорректированная дата окончания | date | Пример: 2025-02-27 |

| | | | |
|-----------------------------------|---|---------|-----------------------------|
| adjustedFixingDate | Скорректированная дата фиксации | date | Пример: 2024-12-10 |
| adjustedPaymentDate | Скорректированная дата платежа | date | Пример: 2025-02-27 |
| adjustedPrincipalExchangeDate | Скорректированная дата обмена основными суммами | date | Пример: 2025-01-27 |
| adjustedStartDate | Скорректированная дата начала | date | Пример: 2025-01-27 |
| amount | Сумма | decimal | Пример: 15287.67 |
| averagingMethod | Метод усреднения | string | Пример: Weighted |
| businessCenter | Финансовый центр | string | Пример: CNBE |
| businessCenters | Финансовые центры | string | |
| businessDayConvention | Конвенция рабочего дня | string | Пример: FOLLOWING |
| calculatedRate | Расчётная ставка | decimal | Пример: 0.02655 |
| calculation | Расчёт | string | |
| calculationPeriod | Расчётный период | string | |
| calculationPeriodAmount | Сумма за расчётный период | string | |
| calculationPeriodDates | Даты расчётного периода | string | |
| calculationPeriodDatesAdjustments | Корректировки дат расчётного периода | string | |
| calculationPeriodDatesReference | Ссылка на даты расчётного периода | string | |
| calculationPeriodFrequency | Частота расчётного периода | string | |
| capRateSchedule | Начальное значение ставки потолка (cap rate) в контексте процентных деривативов, таких как опционы-потолки (interest rate caps) | decimal | Пример: 0.05 |
| cashflows | Денежные потоки | string | |
| cashflowsMatchParameters | Параметры совпадают с денежными потоками | boolean | Пример: true |
| category | Категория | string | Пример: OTC |
| categoryScheme | Схема классификации, определяющая значение атрибута category | string | Атрибут |
| clearedDate | Дата клиринга | date | Пример: 2025-01-27 |
| csa | CSA (соглашение о кредитном обеспечении) | string | Пример: RUB |
| currency | Валюта | string | Пример: CNY |
| dateAdjustments | Корректировки даты | string | |
| dateRelativeTo | Дата относительно | string | |
| dayCountFraction | Дробь подсчета дней | string | Пример: ACT/ACT. ISDA |
| dayCountFractionScheme | Стандарт, по которому интерпретируется метод расчета дневной доли | string | Атрибут |
| dayType | Тип дня | string | Пример: Calendar |
| effectiveDate | Дата вступления в силу | string | |
| executionDateTime | Дата и время исполнения | date | Пример: 2025-01-27T11:10:52 |
| finalExchange | Окончательный обмен | boolean | Пример: true |
| firstPeriodStartDate | Дата начала первого расчетного периода | string | |

| | | | |
|--------------------------|---|---------|----------------------------------|
| fixedRate | Фиксированная ставка | decimal | Пример: 0.12 |
| fixedRateSchedule | Расписание фиксированных ставок | string | |
| fixingDates | Даты, на которых устанавливаются (фиксируются) ставки | string | |
| fixedRate | Фиксированная ставка | decimal | Пример: 0.12 |
| floatingRateCalculation | Расчёт плавающей ставки | string | |
| floatingRateDefinition | Описание параметров плавающей ставки | string | |
| floatingRateIndex | Индекс плавающей ставки | string | Пример: EUR-EURIBOR-Act/365 |
| floatingRateIndexScheme | Стандарт, определяющий индекс плавающей ставки | string | Атрибут |
| floorRateSchedule | Начальное значение ставки пола (floor rate) в контексте процентных деривативов, таких как опционы-полы (interest rate floors) | decimal | Пример: 0.06 |
| forecastAmount | Прогнозная сумма | string | |
| forecastPaymentAmount | Прогнозируемая сумма выплаты (до фактического расчета) | string | |
| initialExchange | Начальный обмен | boolean | Пример: true |
| initialValue | Начальное значение | decimal | Пример: 1500000.0 |
| intermediateExchange | Промежуточный обмен | boolean | Пример: false |
| moexSpfiExt | Расширение для продукта, связанного с Московской биржей | string | |
| notionalAmount | Номинальная сумма | decimal | Пример: 1500000.0 |
| notionalSchedule | Расписание изменений номинальной суммы | string | |
| notionalStepSchedule | Шаги изменения номинала | string | |
| npv | Чистая приведённая стоимость (NPV) | string | |
| npvAmount | Сумма NPV | decimal | Пример: 141766444.99 |
| npvCurrency | Валюта, в которой рассчитывается текущая стоимость (NPV) | string | Пример: RUB |
| npvDate | Дата NPV | date | Пример: 2025-02-05 |
| npvPayment | Выплата текущей стоимости (NPV) | string | |
| npvPoint | Точка в расчете текущей стоимости (NPV) | string | |
| npvValue | Значение текущей стоимости (NPV) | string | |
| observationWeight | Вес наблюдения | decimal | Пример: 28 |
| observedRate | Фактическая ставка, полученная на основе наблюдения | decimal | Пример: 0.02655 |
| otherPartyPayment | Платёж другой стороны | string | |
| partyReference | Ссылка на сторону | string | |
| partyRoleScheme | Схема, определяющая роль участника сделки | string | Атрибут |
| partyTradeIdentifier | Идентификатор сделки стороны | string | |
| partyTradeInformation | Информация о сделке, относящаяся к конкретному участнику | string | |
| payRelativeTo | Относительная дата, к которой привязывается выплата | string | Пример: CalculationPeriodEndDate |
| payerAccountReference | Ссылка на банковский аккаунт плательщика | string | |
| payerPartyReference | Ссылка на участника-плательщика | string | |
| paymentAmount | Сумма платежа | string | |
| paymentCalculationPeriod | Период расчёта платежа | string | |

| | | | |
|--------------------------|---|---------|------------------------------------|
| paymentDate | Дата платежа | string | |
| paymentDates | Даты выплат | string | |
| paymentDatesAdjustments | Корректировки дат выплат | string | |
| paymentDaysOffset | Смещение дней для выплаты | string | |
| paymentFrequency | Частота платежей | string | |
| paymentType | Тип выплаты | string | Пример: SCMC2 |
| period | Временной период | string | Пример: M |
| periodMultiplier | Коэффициент, умножающий временной период | decimal | Пример: 3 |
| principalExchange | Обмен номинальной суммы | string | |
| principalExchangeAmount | Сумма, подлежащая обмену | decimal | Пример: -1500000.0 |
| principalExchanges | Список всех обменов номинала в рамках сделки | string | |
| productType | Тип финансового продукта | string | Пример: XCCY |
| productTypeScheme | Стандарт, определяющий productType | string | Атрибут |
| rateObservation | Наблюдение за процентной ставкой | string | |
| receiverAccountReference | Ссылка на банковский аккаунт получателя | string | |
| receiverPartyReference | Ссылка на участника-получателя | string | |
| relatedParty | Связанный участник сделки | string | |
| resetDate | Дата перерасчета | date | Пример: 2024-12-12 |
| resetDates | Даты перерасчёта | string | |
| resetDatesAdjustments | Корректировки дат пересчёта ставок | string | |
| resetFrequency | Частота пересчёта ставок | string | |
| resetRelativeTo | Перерасчёт относительно | string | Пример: CalculationPeriodStartDate |
| role | Роль участника в сделке | string | Пример: CounterpartyForSecondTrade |
| rollConvention | Правило определения даты выплаты в зависимости от дня месяца | string | Пример: NONE |
| settlementCode | Код, определяющий тип поставки/расчёта | decimal | Пример: 10800 |
| spread | Спред | decimal | Пример: 0.01 |
| spreadSchedule | Расписание премий (spread) к плавающей ставке | string | |
| swap | Основной элемент, описывающий структуру свопа | string | |
| swapStream | Поток (ножка) свопа (например, фиксированная или плавающая) | string | |
| terminationDate | Дата окончания действия продукта или сделки | string | |
| trade | Сделка | string | |
| tradeComment | Комментарий к сделке | string | |
| tradeDate | Дата сделки | date | Пример: 2025-01-27 |
| tradeId | Идентификатор сделки: клиринговый/торговый - в зависимости от partyReference: <ul style="list-style-type: none"> partyReference href="код фирмы" - торговый номер (совпадает с номером сделки в FIX сообщении) partyReference href="NCCB" - клиринговый номер | decimal | Пример: 624 |

| | | | |
|-----------------|---|--------|-------------------------|
| tradeIdScheme | Схема, определяющая уникальный идентификатор сделки | string | Атрибут |
| tradeInfo | Блок с общей информацией о сделке | string | |
| trader | Участник, инициировавший или заключивший сделку | string | Пример: MT1080000001 |
| unadjustedDate | Некорректированная дата | date | Пример: 2025-01-27 |
| averagingMethod | Метод усреднения | string | Пример: Weighted |

4. OIS

| Параметр | Описание параметра | Тип параметра | Примечание |
|-----------------------------------|--|---------------|--------------------|
| accountReference | Ссылка на счёт | string | |
| adjustedDate | Скорректированная дата | date | Пример: 2025-01-27 |
| adjustedEndDate | Скорректированная дата окончания | date | Пример: 2025-02-27 |
| adjustedFixingDate | Скорректированная дата фиксации | date | Пример: 2024-12-10 |
| adjustedPaymentDate | Скорректированная дата платежа | date | Пример: 2025-02-27 |
| adjustedPrincipalExchangeDate | Скорректированная дата обмена основными суммами | date | Пример: 2025-01-27 |
| adjustedStartDate | Скорректированная дата начала | date | Пример: 2025-01-27 |
| amount | Сумма | decimal | Пример: 15287.67 |
| averagingMethod | Метод усреднения | string | Пример: Weighted |
| businessCenter | Финансовый центр | string | Пример: CNBE |
| businessCenters | Финансовые центры | string | |
| businessDayConvention | Конвенция рабочего дня | string | Пример: FOLLOWING |
| calculatedRate | Расчётная ставка | decimal | Пример: 0.02655 |
| calculation | Расчёт | string | |
| calculationPeriod | Расчётный период | string | |
| calculationPeriodAmount | Сумма за расчётный период | string | |
| calculationPeriodDates | Даты расчётного периода | string | |
| calculationPeriodDatesAdjustments | Корректировки дат расчётного периода | string | |
| calculationPeriodDatesReference | Ссылка на даты расчётного периода | string | |
| calculationPeriodFrequency | Частота расчётного периода | string | |
| cashflows | Денежные потоки | string | |
| cashflowsMatchParameters | Параметры совпадают с денежными потоками | boolean | Пример: true |
| category | Категория | string | Пример: OTC |
| categoryScheme | Схема классификации, определяющая значение атрибута category | string | Атрибут |
| clearedDate | Дата клиринга | date | Пример: 2025-01-27 |
| csa | CSA (соглашение о кредитном обеспечении) | string | Пример: RUB |
| currency | Валюта | string | Пример: CNY |
| dateAdjustments | Корректировки даты | string | |
| dateRelativeTo | Дата относительно | string | |

| | | | |
|-------------------------|---|---------|----------------------------------|
| dayCountFraction | Дробь подсчета дней | string | Пример: ACT/ACT.ISDA |
| dayCountFractionScheme | Стандарт, по которому интерпретируется метод расчета дневной доли | string | Атрибут |
| dayType | Тип дня | string | Пример: Calendar |
| effectiveDate | Дата вступления в силу | string | |
| executionDateTime | Дата и время исполнения | date | Пример: 2025-01-27T11:10:52 |
| finalExchange | Окончательный обмен | boolean | Пример: true |
| firstPeriodStartDate | Дата начала первого расчетного периода | | |
| fixedRate | Фиксированная ставка | decimal | Пример: 0.12 |
| fixedRateSchedule | Расписание фиксированных ставок | | |
| fixingDates | Даты, на которых устанавливаются (фиксируются) ставки | | |
| floatingRateCalculation | Расчёт плавающей ставки | string | |
| floatingRateDefinition | Описание параметров плавающей ставки | | |
| floatingRateIndex | Индекс плавающей ставки | string | Пример: EUR-EURIBOR-Act/365 |
| floatingRateIndexScheme | Стандарт, определяющий индекс плавающей ставки | | Атрибут |
| forecastAmount | Прогнозная сумма | string | |
| forecastPaymentAmount | Прогнозируемая сумма выплаты (до фактического расчета) | string | |
| initialExchange | Начальный обмен | boolean | Пример: true |
| initialValue | Начальное значение | decimal | Пример: 1500000.0 |
| intermediateExchange | Промежуточный обмен | boolean | Пример: false |
| moexSpfiExt | Расширение для продукта, связанного с Московской биржей | | |
| notionalAmount | Номинальная сумма | decimal | Пример: 1500000.0 |
| notionalSchedule | Расписание изменений номинальной суммы | | |
| notionalStepSchedule | Шаги изменения номинала | | |
| npv | Чистая приведённая стоимость (NPV) | string | |
| npvAmount | Сумма NPV | decimal | Пример: 141766444.99 |
| npvCurrency | Валюта, в которой рассчитывается текущая стоимость (NPV) | string | Пример: RUB |
| npvDate | Дата NPV | date | Пример: 2025-02-05 |
| npvPayment | Выплата текущей стоимости (NPV) | | |
| npvPoint | Точка в расчете текущей стоимости (NPV) | | |
| npvValue | Значение текущей стоимости (NPV) | | |
| observationWeight | Вес наблюдения | | Пример: 28 |
| observedRate | Фактическая ставка, полученная на основе наблюдения | | Пример: 0.02655 |
| otherPartyPayment | Платёж другой стороны | string | |
| partyReference | Ссылка на сторону | string | |
| partyRoleScheme | Схема, определяющая роль участника сделки | | Атрибут |
| partyTradeIdentifier | Идентификатор сделки стороны | string | |
| partyTradeInformation | Информация о сделке, относящаяся к конкретному участнику | | |
| payRelativeTo | Относительная дата, к которой привязывается выплата | | Пример: CalculationPeriodEndDate |
| payerAccountReference | Ссылка на банковский аккаунт плательщика | | |
| payerPartyReference | Ссылка на участника-плательщика | | |
| paymentAmount | Сумма платежа | string | |

| | | | |
|--------------------------|---|---------|------------------------------------|
| paymentCalculationPeriod | Период расчёта платежа | string | |
| paymentDate | Дата платежа | string | |
| paymentDates | Даты выплат | | |
| paymentDatesAdjustments | Корректировки дат выплат | | |
| paymentDaysOffset | Смещение дней для выплаты | | |
| paymentFrequency | Частота платежей | string | |
| paymentType | Тип выплаты | | Пример: SCMC2 |
| period | Временной период | | Пример: М |
| periodMultiplier | Коэффициент, умножающий временной период | | Пример: 3 |
| principalExchange | Обмен номинальной суммы | | |
| principalExchangeAmount | Сумма, подлежащая обмену | decimal | Пример: -1500000.0 |
| principalExchanges | Список всех обменов номинала в рамках сделки | | |
| productType | Тип финансового продукта | | Пример: ХССУ |
| productTypeScheme | Стандарт, определяющий productType | | Атрибут |
| rateObservation | Стандарт, определяющий productType | | |
| receiverAccountReference | Ссылка на банковский аккаунт получателя | | |
| receiverPartyReference | Ссылка на участника-получателя | | |
| relatedParty | Связанный участник сделки | | |
| resetDate | Дата перерасчета | date | Пример: 2024-12-12 |
| resetDates | Даты перерасчёта | string | |
| resetDatesAdjustments | Корректировки дат пересчёта ставок | | |
| resetFrequency | Частота пересчёта ставок | | |
| resetRelativeTo | Перерасчёт относительно | string | Пример: CalculationPeriodStartDate |
| role | Роль участника в сделке | | Пример: CounterpartyForSecondTrade |
| rollConvention | Правило определения даты выплаты в зависимости от дня месяца | | Пример: NONE |
| settlementCode | Код, определяющий тип поставки/расчёта | | Пример: 10800 |
| spread | Спред | decimal | Пример: 0.01 |
| spreadSchedule | Расписание премий (spread) к плавающей ставке | | |
| swap | Основной элемент, описывающий структуру свопа | | |
| swapStream | Поток (ножка) свопа (например, фиксированная или плавающая) | | |
| terminationDate | Дата окончания действия продукта или сделки | | |
| trade | Сделка | string | |
| tradeComment | Комментарий к сделке | | |
| tradeDate | Дата сделки | date | Пример: 2025-01-27 |
| tradeId | Идентификатор сделки: клиринговый/торговый - в зависимости от partyReference: <ul style="list-style-type: none"> partyReference href="код фирмы" - торговый номер (совпадает с номером сделки в FIX сообщении) partyReference href="NCCB" - клиринговый номер | decimal | Пример: 624 |
| tradeIdScheme | Схема, определяющая уникальный идентификатор сделки | | Атрибут |
| tradeInfo | Блок с общей информацией о сделке | | |

| | | | |
|----------------|---|---------|----------------------|
| trader | Участник, инициировавший или заключивший сделку | | Пример: MT1080000001 |
| unadjustedDate | Некорректированная дата | date | Пример: 2025-01-27 |
| fixedRate | Фиксированная ставка | decimal | Пример: 0.12 |

5. XCCY

| Параметр | Описание параметра | Тип параметра | Примечание |
|----------------------------------|--|---------------|-----------------------|
| accountReference | Ссылка на счёт | string | |
| adjustedDate | Скорректированная дата | date | Пример: 2025-01-27 |
| adjustedEndDate | Скорректированная дата окончания | date | Пример: 2025-02-27 |
| adjustedFixingDate | Скорректированная дата фиксации | date | Пример: 2024-12-10 |
| adjustedPaymentDate | Скорректированная дата платежа | date | Пример: 2025-02-27 |
| adjustedPrincipalExchangeDate | Скорректированная дата обмена основными суммами | date | Пример: 2025-01-27 |
| adjustedStartDate | Скорректированная дата начала | date | Пример: 2025-01-27 |
| amount | Сумма | decimal | Пример: 15287.67 |
| averagingMethod | Метод усреднения | string | Пример: Weighted |
| businessCenter | Финансовый центр | string | Пример: CNBE |
| businessCenters | Финансовые центры | string | |
| businessDayConvention | Конвенция рабочего дня | string | Пример: FOLLOWING |
| calculatedRate | Расчётная ставка | decimal | Пример: 0.02655 |
| calculation | Расчёт | string | |
| calculationPeriod | Расчётный период | string | |
| calculationPeriodAmount | Сумма за расчётный период | string | |
| calculationPeriodDates | Даты расчётного периода | string | |
| calculationPeriodDateAdjustments | Корректировки дат расчётного периода | string | |
| calculationPeriodDatesReference | Ссылка на даты расчётного периода | string | |
| calculationPeriodFrequency | Частота расчётного периода | string | |
| cashflows | Денежные потоки | string | |
| cashflowsMatchParameters | Параметры совпадают с денежными потоками | boolean | Пример: true |
| category | Категория | string | Пример: OTC |
| categoryScheme | Схема классификации, определяющая значение атрибута category | | Атрибут |
| clearedDate | Дата клиринга | date | Пример: 2025-01-27 |
| csa | CSA (соглашение о кредитном обеспечении) | string | Пример: RUB |
| currency | Валюта | string | Пример: CNY |
| dateAdjustments | Корректировки даты | string | |
| dateRelativeTo | Дата относительно | string | |
| dayCountFraction | Дробь подсчета дней | string | Пример: ACT/ACT. ISDA |

| | | | |
|-------------------------|--|---------|----------------------------------|
| dayCountFractionScheme | Стандарт или схемы, которая определяет, как рассчитывается дневная доля (day count fraction) для финансовых инструментов | | Атрибут |
| dayType | Тип дня | string | Пример: Calendar |
| effectiveDate | Дата вступления в силу | string | |
| executionDateTime | Дата и время исполнения | date | Пример: 2025-01-27T11:10:52 |
| finalExchange | Окончательный обмен | boolean | Пример: true |
| firstPeriodStartDate | Дата начала первого расчетного периода | | |
| fixedRate | Фиксированная ставка | decimal | Пример: 0.12 |
| fixedRateSchedule | Расписание фиксированных ставок | | |
| fixingDates | Даты, на которых устанавливаются (фиксируются) ставки | | |
| floatingRateCalculation | Расчёт плавающей ставки | string | |
| floatingRateDefinition | Описание параметров плавающей ставки (индекс, даты, корректировки) | | |
| floatingRateIndex | Индекс плавающей ставки | string | Пример: EUR-EURIBOR-Act/365 |
| floatingRateIndexScheme | Стандарт или схема, определяющая индекс плавающей ставки | | Атрибут |
| forecastAmount | Прогнозная сумма | string | |
| forecastPaymentAmount | Прогнозируемая сумма выплаты | | |
| initialExchange | Начальный обмен | boolean | Пример: true |
| initialValue | Начальное значение | decimal | Пример: 1500000.0 |
| intermediateExchange | Промежуточный обмен | boolean | Пример: false |
| moexSpfiExt | Расширение для продукта, связанного с индексом MOEX | | |
| notionalAmount | Номинальная сумма | decimal | Пример: 1500000.0 |
| notionalSchedule | Расписание изменений номинальной суммы | | |
| notionalStepSchedule | Шаги изменения номинала | | |
| npv | Чистая приведённая стоимость (NPV) | string | |
| npvAmount | Сумма NPV | decimal | Пример: 141766444.99 |
| npvCurrency | Валюта, в которой рассчитывается текущая стоимость | | Пример: RUB |
| npvDate | Дата NPV | date | Пример: 2025-02-05 |
| npvPayment | Выплата текущей стоимости | | |
| npvPoint | Точка в расчете текущей стоимости | | |
| npvValue | Значение текущей стоимости | | |
| observationWeight | Вес наблюдения | | Пример: 28 |
| observedRate | Фактическая ставка, полученная на основе наблюдения | | Пример: 0.02655 |
| otherPartyPayment | Платёж другой стороны | string | |
| partyReference | Ссылка на сторону | string | |
| partyRoleScheme | Схема, определяющая роль участника сделки | | Атрибут |
| partyTradeIdentifier | Идентификатор сделки стороны | string | |
| partyTradeInformation | Информация о сделке, относящаяся к конкретному участнику | | |
| payRelativeTo | Относительная дата, к которой привязывается выплата | | Пример: CalculationPeriodEndDate |
| payerAccountReference | Ссылка на банковский аккаунт плательщика | | |

| | | | |
|--------------------------|--|---------|------------------------------------|
| payerPartyReference | Ссылка на участника-плательщика | | |
| paymentAmount | Сумма платежа | string | |
| paymentCalculationPeriod | Период расчёта платежа | string | |
| paymentDate | Дата платежа | string | |
| paymentDates | Даты выплат | | |
| paymentDatesAdjustments | Корректировки дат выплат | | |
| paymentDaysOffset | Смещение дней для выплаты | | |
| paymentFrequency | Частота платежей | string | |
| paymentType | Тип выплаты | | Пример: SCMC2 |
| period | Временной период | | Пример: М |
| periodMultiplier | Коэффициент, умножающий временной период | | Пример: 3 |
| principalExchange | Обмен номинальной суммы | | |
| principalExchangeAmount | Сумма, подлежащая обмену | | Пример: -1500000.0 |
| principalExchanges | Список всех обменов номинала в рамках сделки | | |
| productType | Тип финансового продукта | | Пример: ХССУ |
| productTypeScheme | Стандарт, определяющий productType | | Атрибут |
| rateObservation | Наблюдение за процентной ставкой | | |
| receiverAccountReference | Ссылка на банковский аккаунт получателя | | |
| receiverPartyReference | Ссылка на участника-получателя | | |
| relatedParty | Связанный участник сделки | | |
| resetDate | Дата перерасчета | date | Пример: 2024-12-12 |
| resetDates | Даты перерасчёта | string | |
| resetDatesAdjustments | Корректировки дат пересчёта ставок | | |
| resetFrequency | Частота пересчёта ставок | | |
| resetRelativeTo | Перерасчёт относительно | string | Пример: CalculationPeriodStartDate |
| role | Роль участника в сделке | | Пример: CounterpartyForSecondTrade |
| rollConvention | Правило определения даты выплаты в зависимости от дня месяца | | Пример: NONE |
| settlementCode | Код, определяющий тип поставки/расчёта | | Пример: 10800 |
| spread | Спред | decimal | Пример: 0.01 |
| spreadSchedule | Расписание премий (spread) к плавающей ставке | | |
| swap | Основной элемент, описывающий структуру свопа | | |
| swapStream | Поток (ножка) свопа (например, фиксированная или плавающая) | | |
| terminationDate | Дата окончания действия продукта или сделки | | |
| trade | Сделка | string | |
| tradeComment | Комментарий к сделке | | |
| tradeDate | Дата сделки | date | Пример: 2025-01-27 |

| | | | |
|-------------------------------|--|---------|----------------------|
| tradeId | Идентификатор сделки: клиринговый/торговый - в зависимости от partyReference: <ul style="list-style-type: none">partyReference href="код фирмы" - торговый номер (совпадает с номером сделки в FIX сообщении)partyReference href="NCCB" - клиринговый номер | decimal | Пример: 624 |
| tradeIdScheme | Схема, определяющая уникальный идентификатор сделки | | Атрибут |
| tradeInfo | Блок с общей информацией о сделке | | |
| trader | Участник, инициировавший или заключивший сделку | | Пример: MT1080000001 |
| unadjustedDate | Некорректированная дата | date | Пример: 2025-01-27 |
| averagingMethod | Метод усреднения | string | Пример: Weighted |
| adjustedPrincipalExchangeDate | Скорректированная дата обмена основными суммами | date | Пример: 2025-01-27 |
| principalExchange | Обмен номинальной суммы | | |
| principalExchangeAmount | Сумма, подлежащая обмену | | Пример: -1500000.0 |
| fixedRate | Фиксированная ставка | decimal | Пример: 0.12 |
| fixedRateSchedule | Расписание фиксированных ставок | | |
| firstPeriodStartDate | Дата начала первого расчетного периода | | |

| | | |
|---------------------|-------------------------------------|--------|
| | | |
| tradeCategoryScheme | Категория сделки | URI |
| originalTrade | Идентификатор первоначальной сделки | string |