

# 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, Cap/Floor, OIS, XCCY), 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.<br><br>Идентификатор сделки: клиринговый/торговый - в зависимости от partyReference: <ul style="list-style-type: none"><li>partyReference href="код фирмы" - торговый номер (совпадает с номером сделки в FIX сообщении)</li><li>partyReference href="NCCB" - клиринговый номер</li></ul> | 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. [XCCY](#)

## 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"><li>partyReference href="код фирмы" - торговый номер (совпадает с номером сделки в FIX сообщении)</li><li>partyReference href="NCCB" - клиринговый номер</li></ul> | 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"><li>partyReference href="код фирмы" - торговый номер (совпадает с номером сделки в FIX сообщении)</li><li>partyReference href="NCCB" - клиринговый номер</li></ul> | 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"> <li>partyReference href="код фирмы" - торговый номер (совпадает с номером сделки в FIX сообщении)</li> <li>partyReference href="NCCB" - клиринговый номер</li> </ul> | 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:<br>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"> <li>partyReference href="код фирмы" - торговый номер (совпадает с номером сделки в FIX сообщении)</li> <li>partyReference href="NCCB" - клиринговый номер</li> </ul> | 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"><li>partyReference href="код фирмы" - торговый номер (совпадает с номером сделки в FIX сообщении)</li><li>partyReference href="NCCB" - клиринговый номер</li></ul> | 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 |