

Описание клирингового отчёта в отношении существующих операций



В настоящем документе представлено описание клирингового отчёта в отношении существующих операций (use-cases) по сделкам с СПФИ:

- 1. Новая сделка (узел ms:trade)
- 2. Изменение параметров по сделке (узел amendment)
- 3. Терминация (узел termination)
- 4. Завершение сделки

1. Новая сделка (узел ms:trade)

Если вы заключали сегодня новые сделки, то в отчете вам придет узел **ms:trade**, который содержит следующие параметры:

	Путь к параметру	Наименование	Формат данных
1	trade/id	Идентификатор сделки	string
2	tradeHeader/partyTradeIdentifier/partyReference	Ссылка на сторону сделки	string
3	tradeHeader/partyTradeIdentifier/accountReference	Ссылка на счёт стороны	string
4	tradeHeader/partyTradeIdentifier/tradeId	Идентификатор сделки (Trade ID)	URI
5	tradeHeader/partyTradeInformation/partyReference	Ссылка на участника сделки	string
6	tradeHeader/partyTradeInformation/relatedParty/partyReference	Ссылка на связанную сторону	string
7	tradeHeader/partyTradeInformation/relatedParty/role	Роль связанной стороны	URI
8	tradeHeader/partyTradeInformation/category	Категория сделки (например, ОТС)	URI
9	tradeHeader/partyTradeInformation/trader	Идентификатор трейдера	string
10	tradeHeader/partyTradeInformation/executionDateTime	Дата и время исполнения сделки	dateTime
11	tradeHeader/tradeDate	Дата сделки	date
12	tradeHeader/clearedDate	Дата клиринга	date
13	swap/productType	Тип продукта (например, OIS)	URI
14	swap/swapStream/payerPartyReference	Ссылка на плательщика	string
15	swap/swapStream/payerAccountReference	Ссылка на счёт плательщика	string
16	swap/swapStream/receiverPartyReference	Ссылка на получателя	string
17	swap/swapStream/calculationPeriodDates/effectiveDate/unadjustedDate	Начальная дата периода	date
18	swap/swapStream/calculationPeriodDates/terminationDate/unadjustedDate	Конечная дата периода	date
19	swap/swapStream/calculationPeriodDates/calculationPeriodDatesAdjustments/businessDayConvention	Правило корректировки дат	string
20	swap/swapStream/calculationPeriodDates/calculationPeriodDatesAdjustments/businessCenters/businessCenter	Центры торговли (массив)	string

21	swap/swapStream/calculationPeriodDates/calculationPeriodFrequency/periodMultiplier	Множитель периода	integer
22	swap/swapStream/calculationPeriodDates/calculationPeriodFrequency/period	Период (например, Т — день)	string
23	swap/swapStream/calculationPeriodDates/calculationPeriodFrequency/rollConvention	Конвенция отсчёта	string
24	swap/swapStream/paymentDates/calculationPeriodDatesReference	Ссылка на даты расчёта	string
25	swap/swapStream/paymentDates/paymentFrequency/periodMultiplier	Множитель периода выплат	integer
26	swap/swapStream/paymentDates/paymentFrequency/period	Период выплат	string
27	swap/swapStream/paymentDates/payRelativeTo	Относительная дата выплаты	string
28	swap/swapStream/paymentDates/paymentDaysOffset/periodMultiplier	Смещение дней выплаты	integer
29	swap/swapStream/paymentDates/paymentDaysOffset/period	Период смещения	string
30	swap/swapStream/paymentDates/paymentDaysOffset/dayType	Тип дня смещения	string
31	swap/swapStream/calculationPeriodAmount/calculation/notionalSchedule /notionalStepSchedule/initialValue	Номинальная сумма	decimal
32	swap/swapStream/calculationPeriodAmount/calculation/notionalSchedule /notionalStepSchedule/currency	Валюта номинала	string
33	swap/swapStream/calculationPeriodAmount/calculation/fixedRateSchedule/initialValue	Фиксированная ставка	decimal
34	swap/swapStream/calculationPeriodAmount/calculation/dayCountFraction	Схема подсчёта дней	URI
35	swap/swapStream/cashflows/cashflowsMatchParameters	Соответствие параметров потока	boolean
36	swap/swapStream/cashflows/paymentCalculationPeriod/adjustedPaymentDate	Корректированная дата выплаты	date
37	swap/swapStream/cashflows/paymentCalculationPeriod/calculationPeriod /adjustedStartDate	Корректированная начальная дата периода	date
38	swap/swapStream/cashflows/paymentCalculationPeriod/calculationPeriod /adjustedEndDate	Корректированная конечная дата периода	date
39	swap/swapStream/cashflows/paymentCalculationPeriod/calculationPeriod /notionalAmount	Номинальная сумма периода	decimal
40	swap/swapStream/cashflows/paymentCalculationPeriod/calculationPeriod/fixedRate	Фиксированная ставка периода	decimal
41	swap/swapStream/cashflows/paymentCalculationPeriod/forecastPaymentAmount /currency	Валюта прогнозируемой выплаты	string
42	swap/swapStream/cashflows/paymentCalculationPeriod/forecastPaymentAmount /amount	Сумма прогнозируемой выплаты	decimal
43	swap/swapStream/calculationPeriodAmount/calculation/floatingRateCalculation /floatingRateIndex	Индекс плавающей ставки	URI
44	swap/swapStream/cashflows/paymentCalculationPeriod/calculationPeriod /floatingRateDefinition/calculatedRate	Рассчитанная ставка	decimal
45	swap/swapStream/cashflows/paymentCalculationPeriod/calculationPeriod /floatingRateDefinition/rateObservation/resetDate	Дата рестра	date
46	swap/swapStream/cashflows/paymentCalculationPeriod/calculationPeriod /floatingRateDefinition/rateObservation/adjustedFixingDate	Корректированная дата фиксации	date
47	swap/swapStream/cashflows/paymentCalculationPeriod/calculationPeriod /floatingRateDefinition/rateObservation/observedRate	Наблюдаемая ставка	decimal
48	swap/swapStream/cashflows/paymentCalculationPeriod/calculationPeriod /floatingRateDefinition/rateObservation/observationWeight	Вес наблюдения	decimal
49	otherPartyPayment/payerPartyReference	Ссылка на плательщика (дополнительно)	URI
50	otherPartyPayment/payerAccountReference	Ссылка на счёт плательщика (дополнительно)	string
51	otherPartyPayment/receiverPartyReference	Ссылка на получателя (дополнительно)	string
52	otherPartyPayment/paymentAmount/currency	Валюта дополнительной выплаты	string
53	otherPartyPayment/paymentAmount/amount	Сумма дополнительной выплаты	decimal

54	otherPartyPayment/paymentDate/adjustedDate	Корректированная дата дополнительной выплаты	date
55	otherPartyPayment/paymentDate/dateAdjustments/businessDayConvention	Правило корректировки даты дополнительной выплаты	string
56	otherPartyPayment/paymentDate/dateAdjustments/businessCenters/businessCenter	Центры торговли (дополнительно)	string
57	otherPartyPayment/paymentType	Тип дополнительной выплаты	string
58	moexSpfiExt/tradeInfo/settlementCode	Код расчёта	string
59	moexSpfiExt/tradeInfo/csa	Валюта CSA	string
60	moexSpfiExt/npv/npvPoint/npvDate	Дата NPV	date
61	moexSpfiExt/npv/npvPoint/npvValue/npvCurrency	Валюта NPV	string
62	moexSpfiExt/npv/npvPoint/npvValue/npvAmount	Значение NPV	decimal
63	moexSpfiExt/npv/npvPoint/npvPayment/payerPartyReference	Ссылка на плательщика (NPV)	string
64	moexSpfiExt/npv/npvPoint/npvPayment/payerAccountReference	Ссылка на счёт плательщика (NPV)	string
65	moexSpfiExt/npv/npvPoint/npvPayment/receiverPartyReference	Ссылка на получателя (NPV)	string
66	moexSpfiExt/npv/npvPoint/npvPayment/paymentAmount/currency	Валюта NPV-выплаты	string
67	moexSpfiExt/npv/npvPoint/npvPayment/paymentAmount/amount	Сумма NPV-выплаты	decimal
68	moexSpfiExt/npv/npvPoint/npvPayment/paymentDate/adjustedDate	Корректированная дата NPV-выплаты	date
69	moexSpfiExt/npv/npvPoint/npvPayment/paymentType	Тип NPV-выплаты	string
70	moexSpfiExt/tradeComment	Комментарий к сделке	string

2. Изменение параметров по сделке (узел amendment)

Чтобы найти информацию по изменению параметров в сделке необходимо смотреть узел **amendment**.

	Параметр	Название параметра	Формат данных
1	amendment/trade/tradeHeader/partyTradeIdentifier/partyReference	Ссылка на сторону (Партия)	string
2	amendment/trade/tradeHeader/partyTradeIdentifier/accountReference	Ссылка на счёт стороны	string
3	amendment/trade/tradeHeader/partyTradeIdentifier/tradeId/tradeIdScheme	Схема идентификатора сделки	URI
4	amendment/trade/tradeHeader/partyTradeIdentifier/tradeId	Идентификатор сделки	string
5	amendment/trade/tradeHeader/partyTradeInformation/partyReference	Ссылка на основную сторону	string
6	amendment/trade/tradeHeader/partyTradeInformation/relatedParty/partyReference	Ссылка на связанную сторону	string
7	amendment/trade/tradeHeader/partyTradeInformation/relatedParty/role/partyRoleScheme	Схема роли связанной стороны	URI
8	amendment/trade/tradeHeader/partyTradeInformation/relatedParty/role	Роль связанной стороны	string
9	amendment/trade/tradeHeader/partyTradeInformation/category/tradeCategoryScheme	Категория сделки	URI
10	amendment/trade/tradeHeader/partyTradeInformation/category	Категория сделки	string
11	amendment/trade/tradeHeader/partyTradeInformation/trader	Идентификатор трейдера	string
12	amendment/trade/tradeHeader/partyTradeInformation/executiondateTime	Дата и время исполнения сделки	dateTime
13	amendment/trade/tradeHeader/tradeDate	Дата сделки	dateTime
14	amendment/trade/tradeHeader/clearedDate	Дата клиринга сделки	dateTime
15	amendment/trade/swap/productType/productTypeScheme	Схема типа продукта	URI
16	amendment/trade/swap/productType	Тип продукта (например, IRS)	string
17	amendment/trade/swap/swapStream/payerPartyReference	Ссылка на плательщика	string
18	amendment/trade/swap/swapStream/receiverPartyReference	Ссылка на получателя	string
19	amendment/trade/swap/swapStream/receiverAccountReference	Ссылка на счёт получателя	string

20	amendment/trade/swap/swapStream/calculationPeriodDates/effectiveDate/unadjustedDate	Нескорректированная дата начала периода	dateTime
21	amendment/trade/swap/swapStream/calculationPeriodDates/effectiveDate/dateAdjustments/businessDayConvention	Конвенция рабочего дня для даты начала периода	string
22	amendment/trade/swap/swapStream/calculationPeriodDates/effectiveDate/dateAdjustments/businessCenters/businessCenter	Центры бизнес-дней для даты начала периода	string
23	amendment/trade/swap/swapStream/calculationPeriodDates/terminationDate/unadjustedDate	Нескорректированная дата окончания периода	dateTime
24	amendment/trade/swap/swapStream/calculationPeriodDates/terminationDate/dateAdjustments/businessDayConvention	Конвенция рабочего дня для даты окончания периода	string
25	amendment/trade/swap/swapStream/calculationPeriodDates/terminationDate/dateAdjustments/businessCenters/businessCenter	Центры бизнес-дней для даты окончания периода	string
26	amendment/trade/swap/swapStream/calculationPeriodDates/calculationPeriodDatesAdjustments/businessDayConvention	Конвенция рабочего дня для коррекции дат периода	string
27	amendment/trade/swap/swapStream/calculationPeriodDates/calculationPeriodDatesAdjustments/businessCenters/businessCenter	Центры бизнес-дней для коррекции дат периода	string
28	amendment/trade/swap/swapStream/calculationPeriodDates/calculationPeriodFrequency/periodMultiplier	Множитель периода	integer
29	amendment/trade/swap/swapStream/calculationPeriodDates/calculationPeriodFrequency/period	Период (например, Т)	string
30	amendment/trade/swap/swapStream/calculationPeriodDates/calculationPeriodFrequency/rollConvention	Конвенция прокрутки дат	string
31	amendment/trade/swap/swapStream/paymentDates/calculationPeriodDatesReference	Ссылка на расчётные даты	string
32	amendment/trade/swap/swapStream/paymentDates/paymentFrequency/periodMultiplier	Множитель частоты платежей	integer
33	amendment/trade/swap/swapStream/paymentDates/paymentFrequency/period	Период частоты платежей	string
34	amendment/trade/swap/swapStream/paymentDates/payRelativeTo	Относительная дата платежа	string
35	amendment/trade/swap/swapStream/paymentDates/paymentDatesAdjustments/businessDayConvention	Конвенция рабочего дня для дат платежей	string
36	amendment/trade/swap/swapStream/paymentDates/paymentDatesAdjustments/businessCenters/businessCenter	Центры бизнес-дней для дат платежей	string
37	amendment/trade/swap/swapStream/calculationPeriodAmount/calculation/notionalSchedule/notionalStepSchedule/initialValue	Начальное значение номинала	integer
38	amendment/trade/swap/swapStream/calculationPeriodAmount/calculation/notionalSchedule/notionalStepSchedule/currency	Валюта номинала	string
39	amendment/trade/swap/swapStream/calculationPeriodAmount/calculation/fixedRateSchedule/initialValue	Начальная фиксированная ставка	integer
40	amendment/trade/swap/swapStream/calculationPeriodAmount/calculation/dayCountFraction/dayCountFractionScheme	Схема метода начисления процентов	URI
41	amendment/trade/swap/swapStream/calculationPeriodAmount/calculation/dayCountFraction	Метод начисления процентов	string
42	amendment/trade/swap/swapStream/cashflows/cashflowsMatchParameters	Флаг совпадения потоков платежей	boolean
43	amendment/trade/swap/swapStream/cashflows/paymentCalculationPeriod/adjustedPaymentDate	Скорректированная дата платежа	dateTime
44	amendment/trade/swap/swapStream/cashflows/paymentCalculationPeriod/calculationPeriod/adjustedStartDate	Скорректированная дата начала периода	dateTime
45	amendment/trade/swap/swapStream/cashflows/paymentCalculationPeriod/calculationPeriod/adjustedEndDate	Скорректированная дата окончания периода	dateTime
46	amendment/trade/swap/swapStream/cashflows/paymentCalculationPeriod/calculationPeriod/notionalAmount	Номинальная сумма	integer
47	amendment/trade/swap/swapStream/cashflows/paymentCalculationPeriod/calculationPeriod/fixedRate	Фиксированная ставка	integer

48	amendment/trade/swap/swapStream/cashflows/paymentCalculationPeriod/forecastPaymentAmount/currency	Валюта прогнозируемого платежа	string
49	amendment/trade/swap/swapStream/cashflows/paymentCalculationPeriod/forecastPaymentAmount/amount	Прогнозируемая сумма платежа	integer
50	amendment/trade/swap/swapStream/resetDates/calculationPeriodDatesReference	Ссылка на расчётные даты для резета	string
51	amendment/trade/swap/swapStream/resetDates/resetRelativeTo	Относительная дата резета	string
52	amendment/trade/swap/swapStream/resetDates/resetFrequency/periodMultiplier	Множитель частоты резета	integer
53	amendment/trade/swap/swapStream/resetDates/resetFrequency/period	Период частоты резета	string
54	amendment/trade/swap/swapStream/resetDates/resetDatesAdjustments/businessDayConvention	Конвенция рабочего дня для дат резета	string
55	amendment/trade/swap/swapStream/resetDates/resetDatesAdjustments/businessCenters/businessCenter	Центры бизнес-дней для дат резета	string
56	amendment/trade/swap/swapStream/resetDates/fixingDates/periodMultiplier	Множитель периода фиксинга	integer
57	amendment/trade/swap/swapStream/resetDates/fixingDates/period	Период фиксинга	string
58	amendment/trade/swap/swapStream/resetDates/fixingDates/businessDayConvention	Конвенция рабочего дня для фиксинга	string
59	amendment/trade/swap/swapStream/resetDates/fixingDates/businessCenters/businessCenter	Центры бизнес-дней для фиксинга	string
60	amendment/trade/swap/swapStream/resetDates/fixingDates/dateRelativeTo	Относительная дата фиксинга	URI
61	amendment/trade/swap/swapStream/calculationPeriodAmount/calculation/floatingRateCalculation/floatingRateIndex/floatingRateIndexScheme	Схема индекса плавающей ставки	URI
62	amendment/trade/swap/swapStream/calculationPeriodAmount/calculation/floatingRateCalculation/floatingRateIndex	Индекс плавающей ставки (например, RUB-CBR-KEY-RATE)	string
63	amendment/trade/swap/swapStream/calculationPeriodAmount/calculation/floatingRateCalculation/indexTenor/periodMultiplier	Множитель срока индекса	integer
64	amendment/trade/swap/swapStream/calculationPeriodAmount/calculation/floatingRateCalculation/indexTenor/period	Период срока индекса	string
65	amendment/trade/swap/swapStream/calculationPeriodAmount/calculation/floatingRateCalculation/averagingMethod	Метод усреднения ставки	string
66	amendment/trade/swap/swapStream/cashflows/paymentCalculationPeriod/calculationPeriod/floatingRateDefinition/calculatedRate	Рассчитанная плавающая ставка	integer
67	amendment/trade/swap/swapStream/cashflows/paymentCalculationPeriod/calculationPeriod/floatingRateDefinition/rateObservation/resetDate	Дата резета	dateTime
68	amendment/trade/swap/swapStream/cashflows/paymentCalculationPeriod/calculationPeriod/floatingRateDefinition/rateObservation/adjustedFixingDate	Скорректированная дата фиксинга	dateTime
69	amendment/trade/swap/swapStream/cashflows/paymentCalculationPeriod/calculationPeriod/floatingRateDefinition/rateObservation/observedRate	Наблюдаемая ставка	integer
70	amendment/trade/swap/swapStream/cashflows/paymentCalculationPeriod/calculationPeriod/floatingRateDefinition/rateObservation/observationWeight	Вес наблюдения	integer
71	amendment/trade/otherPartyPayment/payerPartyReference	Ссылка на плательщика	string
72	amendment/trade/otherPartyPayment/receiverPartyReference	Ссылка на получателя	string
73	amendment/trade/otherPartyPayment/paymentAmount/currency	Валюта платежа	string
74	amendment/trade/otherPartyPayment/paymentAmount/amount	Сумма платежа	integer
75	amendment/trade/otherPartyPayment/paymentDate/adjustedDate	Скорректированная дата платежа	dateTime
76	amendment/trade/otherPartyPayment/paymentDate/dateAdjustments/businessDayConvention	Конвенция рабочего дня для даты платежа	string
77	amendment/trade/otherPartyPayment/paymentDate/dateAdjustments/businessCenters/businessCenter	Центры бизнес-дней для даты платежа	string
78	amendment/trade/otherPartyPayment/paymentType	Тип платежа	string
79	amendment/trade/payment/payerPartyReference	Ссылка на плательщика	string

80	amendment/trade/payment/receiverPartyReference	Ссылка на получателя	string
81	amendment/trade/payment/paymentAmount/currency	Валюта платежа	string
82	amendment/trade/payment/paymentAmount/amount	Сумма платежа	integer
83	amendment/trade/payment/paymentDate/adjustedDate	Скорректированная дата платежа	dateTime
84	amendment/trade/payment/paymentDate/dateAdjustments/businessDayConvention	Конвенция рабочего дня для даты платежа	string
85	amendment/trade/payment/paymentDate/dateAdjustments/businessCenters/businessCenter	Центры бизнес-дней для даты платежа	string
86	amendment/trade/payment/paymentType	Тип платежа	string
87	amendment/trade/moexSpfiExt/tradeInfo/settlementCode	Код расчёта	string
88	amendment/trade/moexSpfiExt/tradeInfo/csa	Валюта соглашения (CSA)	string
89	amendment/trade/moexSpfiExt/npv/npvPoint/npvDate	Дата оценки NPV	dateTime
90	amendment/trade/moexSpfiExt/npv/npvPoint/npvValue/npvCurrency	Валюта NPV	string
91	amendment/trade/moexSpfiExt/npv/npvPoint/npvValue/npvAmount	Значение NPV	integer
92	amendment/trade/moexSpfiExt/npv/npvPoint/npvPayment/payerPartyReference	Ссылка на плательщика NPV	string
93	amendment/trade/moexSpfiExt/npv/npvPoint/npvPayment/receiverPartyReference	Ссылка на получателя NPV	string
94	amendment/trade/moexSpfiExt/npv/npvPoint/npvPayment/receiverAccountReference	Ссылка на счёт получателя NPV	string
95	amendment/trade/moexSpfiExt/npv/npvPoint/npvPayment/paymentAmount/currency	Валюта платежа NPV	string
96	amendment/trade/moexSpfiExt/npv/npvPoint/npvPayment/paymentAmount/amount	Сумма платежа NPV	integer
97	amendment/trade/moexSpfiExt/npv/npvPoint/npvPayment/paymentDate/adjustedDate	Скорректированная дата платежа NPV	dateTime
98	amendment/trade/moexSpfiExt/npv/npvPoint/npvPayment/paymentType	Тип платежа NPV	string
99	amendment/trade/moexSpfiExt/tradeComment	Комментарий к сделке	string
100	amendment/effectiveDate	Действующая дата сделки	dateTime

3. Терминация (узел termination)

Чтобы найти в отчете терминированную сделку необходимо искать узел **termination**. Каждый блок termination содержит данные об одной терминированной сделке за отчетный день.

	Путь к параметру	Название параметра	Формат данных
1	termination/originalTrade/	Идентификатор первоначальной сделки	string
2	termination/originalTrade/tradeHeader/partyTradeIdentifier/partyReference/	Ссылка на сторону в идентификаторе сделки	string
3	termination/originalTrade/tradeHeader/partyTradeIdentifier/accountReference/	Ссылка на счёт в идентификаторе сделки	string
4	termination/originalTrade/tradeHeader/partyTradeIdentifier/tradeId/tradeIdScheme	Схема идентификатора сделки	URI
5	termination/originalTrade/tradeHeader/partyTradeIdentifier/tradeId	Идентификатор сделки	string
6	termination/originalTrade/tradeHeader/partyTradeInformation/partyReference/	Ссылка на сторону в информации о сделке	string
7	termination/originalTrade/tradeHeader/partyTradeInformation/category/categoryScheme	Схема категории сделки	URI
8	termination/originalTrade/tradeHeader/partyTradeInformation/category	Категория сделки	string
9	termination/originalTrade/tradeHeader/partyTradeInformation/trader	Идентификатор трейдера	string
10	termination/originalTrade/tradeHeader/partyTradeInformation/executionDateTime	Дата и время исполнения сделки	dateTime
11	termination/originalTrade/tradeHeader/tradeDate	Дата сделки	dateTime
12	termination/originalTrade/tradeHeader/clearedDate	Дата клиринга	dateTime

13	termination/originalTrade/swap/productType/productTypeScheme	Схема типа продукта	URI
14	termination/originalTrade/swap/productType	Тип продукта	string
15	termination/originalTrade/swap/swapStream/payerPartyReference/	Ссылка на плательщика	string
16	termination/originalTrade/swap/swapStream/receiverPartyReference/	Ссылка на получателя	string
17	termination/originalTrade/swap/swapStream/receiverAccountReference/	Ссылка на счёт получателя	string
18	termination/originalTrade/swap/swapStream/calculationPeriodDates/effectiveDate/unadjustedDate	Нескорректированная дата начала	dateTime
19	termination/originalTrade/swap/swapStream/calculationPeriodDates/effectiveDate/dateAdjustments/businessDayConvention	Конвенция рабочего дня (для даты начала)	string
20	termination/originalTrade/swap/swapStream/calculationPeriodDates/effectiveDate/dateAdjustments/businessCenters/businessCenter	Центры расчета (для даты начала)	string
21	termination/originalTrade/swap/swapStream/calculationPeriodDates/terminationDate/unadjustedDate	Нескорректированная дата окончания	dateTime
22	termination/originalTrade/swap/swapStream/calculationPeriodDates/terminationDate/dateAdjustments/businessDayConvention	Конвенция рабочего дня (для даты окончания)	string
23	termination/originalTrade/swap/swapStream/calculationPeriodDates/terminationDate/dateAdjustments/businessCenters/businessCenter	Центры расчета (для даты окончания)	string
24	termination/originalTrade/swap/swapStream/calculationPeriodDates/calculationPeriodDatesAdjustments/businessDayConvention	Конвенция рабочего дня (для корректировки дат расчета)	string
25	termination/originalTrade/swap/swapStream/calculationPeriodDates/calculationPeriodDatesAdjustments/businessCenters/businessCenter	Центры расчета (для корректировки дат расчета)	string
26	termination/originalTrade/swap/swapStream/calculationPeriodDates/calculationPeriodFrequency/periodMultiplier	Множитель периода расчета	integer
27	termination/originalTrade/swap/swapStream/calculationPeriodDates/calculationPeriodFrequency/period	Период расчета (Y, M, D и т.д.)	string
28	termination/originalTrade/swap/swapStream/calculationPeriodDates/calculationPeriodFrequency/rollConvention	Конвенция прокрутки дат	string
29	termination/originalTrade/swap/swapStream/paymentDates/calculationPeriodDatesReference/	Ссылка на даты расчета	string
30	termination/originalTrade/swap/swapStream/paymentDates/paymentFrequency/periodMultiplier	Множитель периода выплат	integer
31	termination/originalTrade/swap/swapStream/paymentDates/paymentFrequency/period	Период выплат (Y, M, D и т.д.)	string
32	termination/originalTrade/swap/swapStream/paymentDates/payRelativeTo	Относительная дата выплаты	string
33	termination/originalTrade/swap/swapStream/paymentDates/paymentDatesAdjustments/businessDayConvention	Конвенция рабочего дня (для корректировки дат выплат)	string
34	termination/originalTrade/swap/swapStream/paymentDates/paymentDatesAdjustments/businessCenters/businessCenter	Центры расчета (для корректировки дат выплат)	string
35	termination/originalTrade/swap/swapStream/calculationPeriodAmount/notionalSchedule/notionalStepSchedule/initialValue	Начальное значение номинала	number
36	termination/originalTrade/swap/swapStream/calculationPeriodAmount/notionalSchedule/notionalStepSchedule/currency	Валюта номинала	string
37	termination/originalTrade/swap/swapStream/calculationPeriodAmount/fixedRateSchedule/initialValue	Начальное значение фиксированной ставки	integer
38	termination/originalTrade/swap/swapStream/calculationPeriodAmount/dayCountFraction/dayCountFractionScheme	Схема метода начисления процентов	URI
39	termination/originalTrade/swap/swapStream/calculationPeriodAmount/dayCountFraction	Метод начисления процентов	string
40	termination/originalTrade/swap/swapStream/cashflows/cashflowsMatchParameters	Совпадение параметров потоков	boolean
41	termination/originalTrade/swap/swapStream/cashflows/paymentCalculationPeriod/adjustedPaymentDate	Скорректированная дата выплаты	dateTime
42	termination/originalTrade/swap/swapStream/cashflows/paymentCalculationPeriod/calculationPeriod/adjustedStartDate	Скорректированная дата начала периода	dateTime

43	termination/originalTrade/swap/swapStream/cashflows/paymentCalculationPeriod/calculationPeriod/adjustedEndDate	Скорректированная дата окончания периода	dateTime
44	termination/originalTrade/swap/swapStream/cashflows/paymentCalculationPeriod/calculationPeriod/notionalAmount	Номинальная сумма периода	number
45	termination/originalTrade/swap/swapStream/cashflows/paymentCalculationPeriod/calculationPeriod/fixedRate	Фиксированная ставка периода	integer
46	termination/originalTrade/swap/swapStream/cashflows/paymentCalculationPeriod/forecastPaymentAmount/currency	Валюта прогнозируемой выплаты	string
47	termination/originalTrade/swap/swapStream/cashflows/paymentCalculationPeriod/forecastPaymentAmount/amount	Сумма прогнозируемой выплаты	integer
48	termination/originalTrade/swap/swapStream/resetDates/calculationPeriodDatesReference/	Ссылка на даты пересчета	string
49	termination/originalTrade/swap/swapStream/resetDates/resetRelativeTo	Относительная дата пересчета	string
50	termination/originalTrade/swap/swapStream/resetDates/fixingDates/periodMultiplier	Множитель периода фиксации	integer
51	termination/originalTrade/swap/swapStream/resetDates/fixingDates/period	Период фиксации	string
52	termination/originalTrade/swap/swapStream/resetDates/fixingDates/businessDayConvention	Конвенция рабочего дня (для фиксации)	string
53	termination/originalTrade/swap/swapStream/resetDates/fixingDates/businessCenters/businessCenter	Центры расчета (для фиксации)	string
54	termination/originalTrade/swap/swapStream/resetDates/resetFrequency/periodMultiplier	Множитель периода пересчета	integer
55	termination/originalTrade/swap/swapStream/resetDates/resetFrequency/period	Период пересчета	string
56	termination/originalTrade/swap/swapStream/resetDates/resetDatesAdjustments/businessDayConvention	Конвенция рабочего дня (для корректировки дат пересчета)	string
57	termination/originalTrade/swap/swapStream/resetDates/resetDatesAdjustments/businessCenters/businessCenter	Центры расчета (для корректировки дат пересчета)	string
58	termination/originalTrade/swap/swapStream/calculationPeriodAmount/floatingRateCalculation/floatingRateIndex/floatingRateIndexScheme	Схема индекса плавающей ставки	URI
59	termination/originalTrade/swap/swapStream/calculationPeriodAmount/floatingRateCalculation/floatingRateIndex	Индекс плавающей ставки	string
60	termination/originalTrade/swap/swapStream/calculationPeriodAmount/floatingRateCalculation/indexTenor/periodMultiplier	Множитель срока индекса	integer
61	termination/originalTrade/swap/swapStream/calculationPeriodAmount/floatingRateCalculation/indexTenor/period	Период срока индекса	string
62	termination/originalTrade/swap/swapStream/calculationPeriodAmount/floatingRateCalculation/averagingMethod	Метод усреднения ставки	string
63	termination/originalTrade/swap/swapStream/cashflows/paymentCalculationPeriod/calculationPeriod/floatingRateDefinition/calculatedRate	Рассчитанная ставка	integer
64	termination/originalTrade/swap/swapStream/cashflows/paymentCalculationPeriod/calculationPeriod/floatingRateDefinition/rateObservation/resetDate	Дата пересчета	dateTime
65	termination/originalTrade/swap/swapStream/cashflows/paymentCalculationPeriod/calculationPeriod/floatingRateDefinition/rateObservation/adjustedFixingDate	Скорректированная дата фиксации	dateTime
66	termination/originalTrade/swap/swapStream/cashflows/paymentCalculationPeriod/calculationPeriod/floatingRateDefinition/rateObservation/observedRate	Наблюдаемая ставка	integer
67	termination/originalTrade/swap/swapStream/cashflows/paymentCalculationPeriod/calculationPeriod/floatingRateDefinition/rateObservation/observationWeight	Вес наблюдения за ставкой	integer
68	termination/originalTrade/otherPartyPayment/payerPartyReference/	Ссылка на плательщика (другой платеж)	string
69	termination/originalTrade/otherPartyPayment/payerAccountReference/	Ссылка на счёт плательщика (другой платеж)	string
70	termination/originalTrade/otherPartyPayment/receiverPartyReference/	Ссылка на получателя (другой платеж)	string
71	termination/originalTrade/otherPartyPayment/paymentAmount/currency	Валюта другого платежа	string
72	termination/originalTrade/otherPartyPayment/paymentAmount/amount	Сумма другого платежа	integer

73	termination/originalTrade/otherPartyPayment/paymentDate/adjustedDate	Скорректированная дата другого платежа	dateTime
74	termination/originalTrade/otherPartyPayment/paymentDate/dateAdjustments/businessDayConvention	Конвенция рабочего дня (для другого платежа)	string
75	termination/originalTrade/otherPartyPayment/paymentDate/dateAdjustments/businessCenters/businessCenter	Центры расчета (для другого платежа)	string
76	termination/originalTrade/otherPartyPayment/paymentType	Тип другого платежа	string
77	termination/originalTrade/moexSpfiExt/tradeInfo/settlementCode	Код расчета (расширение MOEX SPFI)	string
78	termination/originalTrade/moexSpfiExt/tradeInfo/csa	Соглашение о защите от рисков (CSA)	string
79	termination/originalTrade/moexSpfiExt/npv/npvPoint/npvDate	Дата NPV	dateTime
80	termination/originalTrade/moexSpfiExt/npv/npvPoint/npvValue/npvCurrency	Валюта NPV	string
81	termination/originalTrade/moexSpfiExt/npv/npvPoint/npvValue/npvAmount	Сумма NPV	integer
82	termination/originalTrade/moexSpfiExt/npv/npvPoint/npvPayment/	Идентификатор платежа NPV	string
83	termination/originalTrade/moexSpfiExt/npv/npvPoint/npvPayment/payerPartyReference/	Ссылка на плательщика (платеж NPV)	string
84	termination/originalTrade/moexSpfiExt/npv/npvPoint/npvPayment/payerAccountReference/	Ссылка на счёт плательщика (платеж NPV)	string
85	termination/originalTrade/moexSpfiExt/npv/npvPoint/npvPayment/receiverPartyReference/	Ссылка на получателя (платеж NPV)	string
86	termination/originalTrade/moexSpfiExt/npv/npvPoint/npvPayment/paymentAmount/currency	Валюта платежа NPV	string
87	termination/originalTrade/moexSpfiExt/npv/npvPoint/npvPayment/paymentAmount/amount	Сумма платежа NPV	integer
88	termination/originalTrade/moexSpfiExt/npv/npvPoint/npvPayment/paymentDate/adjustedDate	Скорректированная дата платежа NPV	dateTime
89	termination/originalTrade/moexSpfiExt/npv/npvPoint/npvPayment/paymentType	Тип платежа NPV	string
90	termination/originalTrade/moexSpfiExt/tradeComment	Комментарий к сделке	string
91	termination/effectiveDate	Дата вступления в силу	dateTime

4. Завершение сделки

Данные по завершению сделки необходимо смотреть в узле **trade**.

В зависимости от продукта атрибут, указывающий на завершение сделки, разный:

для fxSingleLeg - это valueDate

для fxSwap - это farLeg/valueDate

для swap - это максимальный swapStream/cashflows/paymentCalculationPeriod/adjustedPaymentDate

	Путь к параметру	Название на русском	Формат данных
1	trade/id	Идентификатор сделки	string
2	tradeHeader/partyTradeIdentifier/partyReference/	Ссылка на сторону сделки	string
3	tradeHeader/partyTradeIdentifier/accountReference/	Ссылка на счёт стороны сделки	string
4	tradeHeader/partyTradeIdentifier/tradeId/tradeIdScheme	Схема идентификатора сделки	URI
5	tradeHeader/partyTradeIdentifier/tradeId	Идентификатор сделки	string
6	tradeHeader/partyTradeInformation/partyReference/	Ссылка на сторону сделки	string
7	tradeHeader/partyTradeInformation/relatedParty/partyReference/	Ссылка на связанную сторону	string
8	tradeHeader/partyTradeInformation/relatedParty/role/partyRoleScheme	Схема роли связанной стороны	URI

9	tradeHeader/partyTradeInformation/relatedParty/role	Роль связанной стороны	string
10	tradeHeader/partyTradeInformation/category/categoryScheme	Схема категории сделки	URI
11	tradeHeader/partyTradeInformation/category	Категория сделки	string
12	tradeHeader/partyTradeInformation/trader	Идентификатор трейдера	string
13	tradeHeader/partyTradeInformation/executionDateTime	Дата и время исполнения сделки	dateTime
14	tradeHeader/tradeDate	Дата сделки	dateTime
15	tradeHeader/clearedDate	Дата клиринга	dateTime
16	swap/productType/productTypeScheme	Схема типа продукта	URI
17	swap/productType	Тип продукта	string
18	swap/swapStream/payerPartyReference/	Ссылка на плательщика (поток обмена)	string
19	swap/swapStream/payerAccountReference/	Ссылка на счёт плательщика (поток обмена)	string
20	swap/swapStream/receiverPartyReference/	Ссылка на получателя (поток обмена)	string
21	swap/swapStream/calculationPeriodDates/id	Идентификатор расчётов периодов	string
22	swap/swapStream/calculationPeriodDates/effectiveDate/unadjustedDate	Нескорректированная дата начала периода	dateTime
23	swap/swapStream/calculationPeriodDates/effectiveDate/dateAdjustments/businessDayConvention	Конвенция даты (начало периода)	string
24	swap/swapStream/calculationPeriodDates/effectiveDate/dateAdjustments/businessCenters/businessCenter	Центры бизнес-дней (начало периода)	string
25	swap/swapStream/calculationPeriodDates/terminationDate/unadjustedDate	Нескорректированная дата окончания периода	dateTime
26	swap/swapStream/calculationPeriodDates/terminationDate/dateAdjustments/businessDayConvention	Конвенция даты (окончание периода)	string
27	swap/swapStream/calculationPeriodDates/terminationDate/dateAdjustments/businessCenters/businessCenter	Центры бизнес-дней (окончание периода)	string
28	swap/swapStream/calculationPeriodDates/calculationPeriodDatesAdjustments/businessDayConvention	Конвенция даты (расчёт периодов)	string
29	swap/swapStream/calculationPeriodDates/calculationPeriodDatesAdjustments/businessCenters/businessCenter	Центры бизнес-дней (расчёт периодов)	string
30	swap/swapStream/calculationPeriodDates/calculationPeriodFrequency/periodMultiplier	Множитель периода (расчёт периодов)	integer
31	swap/swapStream/calculationPeriodDates/calculationPeriodFrequency/period	Период (расчёт периодов)	string
32	swap/swapStream/calculationPeriodDates/calculationPeriodFrequency/rollConvention	Ролл-конвенция (расчёт периодов)	string
33	swap/swapStream/paymentDates/calculationPeriodDatesReference/	Ссылка на расчёты периодов (платежи)	string
34	swap/swapStream/paymentDates/paymentFrequency/periodMultiplier	Множитель периода (платежи)	integer
35	swap/swapStream/paymentDates/paymentFrequency/period	Период (платежи)	string
36	swap/swapStream/paymentDates/payRelativeTo	Относительная дата платежа	string
37	swap/swapStream/paymentDates/paymentDatesAdjustments/businessDayConvention	Конвенция даты (платежи)	string
38	swap/swapStream/paymentDates/paymentDatesAdjustments/businessCenters/businessCenter	Центры бизнес-дней (платежи)	string
39	swap/swapStream/calculationPeriodAmount/calculation/notionalSchedule/notionalStepSchedule/initialValue	Начальное значение номинала	decimal
40	swap/swapStream/calculationPeriodAmount/calculation/notionalSchedule/notionalStepSchedule/currency	Валюта номинала	string

41	swap/swapStream/calculationPeriodAmount/calculation/fixedRateSchedule/initialValue	Начальная фиксированная ставка	decimal
42	swap/swapStream/calculationPeriodAmount/calculation/dayCountFraction/dayCountFractionScheme	Схема метода расчёта дней	URI
43	swap/swapStream/calculationPeriodAmount/calculation/dayCountFraction	Метод расчёта дней	string
44	swap/swapStream/cashflows/cashflowsMatchParameters	Соответствие потоков	boolean
45	swap/swapStream/cashflows/paymentCalculationPeriod/id	Идентификатор расчёта платежа	string
46	swap/swapStream/cashflows/paymentCalculationPeriod/adjustedPaymentDate	Скорректированная дата платежа	dateTime
47	swap/swapStream/cashflows/paymentCalculationPeriod/calculationPeriod/adjustedStartDate	Скорректированная дата начала периода	dateTime
48	swap/swapStream/cashflows/paymentCalculationPeriod/calculationPeriod/adjustedEndDate	Скорректированная дата окончания периода	dateTime
49	swap/swapStream/cashflows/paymentCalculationPeriod/calculationPeriod/notionalAmount	Номинальная сумма	decimal
50	swap/swapStream/cashflows/paymentCalculationPeriod/calculationPeriod/fixedRate	Фиксированная ставка	decimal
51	swap/swapStream/cashflows/paymentCalculationPeriod/forecastPaymentAmount/currency	Валюта прогнозируемого платежа	string
52	swap/swapStream/cashflows/paymentCalculationPeriod/forecastPaymentAmount/amount	Сумма прогнозируемого платежа	decimal
53	swap/swapStream/resetDates/id	Идентификатор дат рестарта	string
54	swap/swapStream/resetDates/calculationPeriodDatesReference/	Ссылка на расчёты периодов (рестарт)	string
55	swap/swapStream/resetDates/resetRelativeTo	Относительная дата рестарта	string
56	swap/swapStream/resetDates/fixingDates/periodMultiplier	Множитель периода (фиксинг)	integer
57	swap/swapStream/resetDates/fixingDates/period	Период (фиксинг)	string
58	swap/swapStream/resetDates/fixingDates/businessDayConvention	Конвенция даты (фиксинг)	string
59	swap/swapStream/resetDates/fixingDates/businessCenters/businessCenter	Центры бизнес-дней (фиксинг)	string
60	swap/swapStream/resetDates/fixingDates/dateRelativeTo/	Ссылка на дату фиксинга	string
61	swap/swapStream/resetDates/resetFrequency/periodMultiplier	Множитель периода рестарта	integer
62	swap/swapStream/resetDates/resetFrequency/period	Период рестарта	string
63	swap/swapStream/resetDates/resetDatesAdjustments/businessDayConvention	Конвенция даты (даты рестарта)	string
64	swap/swapStream/resetDates/resetDatesAdjustments/businessCenters/businessCenter	Центры бизнес-дней (даты рестарта)	string
65	swap/swapStream/calculationPeriodAmount/calculation/floatingRateCalculation/floatingRateIndex/floatingRateIndexScheme	Схема индекса плавающей ставки	URI
66	swap/swapStream/calculationPeriodAmount/calculation/floatingRateCalculation/floatingRateIndex	Индекс плавающей ставки	string
67	swap/swapStream/calculationPeriodAmount/calculation/floatingRateCalculation/indexTenor/periodMultiplier	Множитель срока индекса	integer
68	swap/swapStream/calculationPeriodAmount/calculation/floatingRateCalculation/indexTenor/period	Срок индекса	string
69	swap/swapStream/calculationPeriodAmount/calculation/floatingRateCalculation/averagingMethod	Метод усреднения	string
70	swap/swapStream/cashflows/paymentCalculationPeriod/calculationPeriod/floatingRateDefinition/calculatedRate	Рассчитанная ставка	decimal
71	swap/swapStream/cashflows/paymentCalculationPeriod/calculationPeriod/floatingRateDefinition/rateObservation/resetDate	Дата рестарта (плавающая ставка)	dateTime
72	swap/swapStream/cashflows/paymentCalculationPeriod/calculationPeriod/floatingRateDefinition/rateObservation/adjustedFixingDate	Скорректированная дата фиксинга	dateTime

73	swap/swapStream/cashflows/paymentCalculationPeriod/calculationPeriod/floatingRateDefinition/rateObservation/observedRate	Наблюдаемая ставка	decimal
74	swap/swapStream/cashflows/paymentCalculationPeriod/calculationPeriod/floatingRateDefinition/rateObservation/observationWeight	Вес наблюдения	decimal
75	otherPartyPayment/id	Идентификатор стороннего платежа	string
76	otherPartyPayment/payerPartyReference/	Ссылка на плательщика (другой платеж)	string
77	otherPartyPayment/payerAccountReference/	Ссылка на счёт плательщика (другой платеж)	string
78	otherPartyPayment/receiverPartyReference/	Ссылка на получателя (другой платеж)	string
79	otherPartyPayment/paymentAmount/currency	Валюта платежа (другой платеж)	string
80	otherPartyPayment/paymentAmount/amount	Сумма платежа (другой платеж)	decimal
81	otherPartyPayment/paymentDate/adjustedDate	Скорректированная дата платежа	dateTime
82	otherPartyPayment/paymentDate/dateAdjustments/businessDayConvention	Конвенция даты (другой платеж)	string
83	otherPartyPayment/paymentDate/dateAdjustments/businessCenters/businessCenter	Центры бизнес-дней (другой платеж)	string
84	otherPartyPayment/paymentType	Тип платежа (другой платеж)	string
85	moexSpfiExt/tradeInfo/settlementCode	Код расчёта	string
86	moexSpfiExt/tradeInfo/csa	Соглашение о валюте (CSA)	string
87	moexSpfiExt/npv/npvPoint/npvDate	Дата NPV	dateTime
88	moexSpfiExt/npv/npvPoint/npvValue/npvCurrency	Валюта NPV	string
89	moexSpfiExt/npv/npvPoint/npvValue/npvAmount	Значение NPV	decimal
90	moexSpfiExt/npv/npvPoint/npvPayment/id	Идентификатор платежа NPV	string
91	moexSpfiExt/npv/npvPoint/npvPayment/payerPartyReference/	Ссылка на плательщика (платеж NPV)	string
92	moexSpfiExt/npv/npvPoint/npvPayment/receiverPartyReference/	Ссылка на получателя (платеж NPV)	string
93	moexSpfiExt/npv/npvPoint/npvPayment/receiverAccountReference/	Ссылка на счёт получателя (платеж NPV)	string
94	moexSpfiExt/npv/npvPoint/npvPayment/paymentAmount/currency	Валюта платежа NPV	string
95	moexSpfiExt/npv/npvPoint/npvPayment/paymentAmount/amount	Сумма платежа NPV	decimal
96	moexSpfiExt/npv/npvPoint/npvPayment/paymentDate/adjustedDate	Скорректированная дата платежа NPV	dateTime
97	moexSpfiExt/npv/npvPoint/npvPayment/paymentType	Тип платежа NPV	string
98	moexSpfiExt/tradeComment	Комментарий к сделке	string