

2018-02-09

Forwards and Futures listed on STO Fixed Income Derivatives for indicative pricing

Trading code	ISIN	Start date for indicative pricing	Last date for indicative pricing	Expiration Settlement day of Forwards/Futures	Underlying loan
SGB_2Y_1809	SE0010837807	2018-02-12	2018-09-17	2018-09-19	R 1047
SGB_5Y_1809	SE0010837815	2018-02-12	2018-09-17	2018-09-19	R 1057
SGB_10Y_1809	SE0010837823	2018-02-12	2018-09-17	2018-09-19	R 1060
NDH_2Y_1806	SE0010842625	2018-02-12	2018-06-18	2018-06-20	NBHYP 5521
NDH_5Y_1806	SE0010842633	2018-02-12	2018-06-18	2018-06-20	NBHYP 5533
SCBC_5Y_1806	SE0010842641	2018-02-12	2018-06-18	2018-06-20	SCBC 143
STH_2Y_1806	SE0010842591	2018-02-12	2018-06-18	2018-06-20	SHAB 1583
STH_5Y_1806	SE0010842583	2018-02-12	2018-06-18	2018-06-20	SHAB 1587
SWH_2Y_1806	SE0010842609	2018-02-12	2018-06-18	2018-06-20	SPINTAB 180
SWH_5Y_1806	SE0010842617	2018-02-12	2018-06-18	2018-06-20	SPINTAB 192
IMM_FRA_2103	SE0010842476	2018-03-07	2021-03-15	2021-03-17	
3STIB_FRA_2103	SE0010842492	2018-03-07	2021-03-15	2021-03-17	
RIBAH0_F	SE0010842534	2018-02-28	2020-03-16	2020-03-18	

Forward and Futures for tradable Fixed Income derivatives

Government Bond Future

Series	ISIN	Clearing date from	Expiration Settlement Day	Underlying loan	Underlying code for derivative
SGB2YH8	SE0010207993	2017-08-17	2018-03-21	R 1047	35520
SGB2YM8	SE0010524330	2017-11-16	2018-06-20	R 1047	35521
SGB2YU8	SE0010837807	2018-02-15	2018-09-19	R 1047	35522
SGB5YH8	SE0010208017	2017-08-17	2018-03-21	R 1057	35516
SGB5YM8	SE0010524348	2017-11-16	2018-06-20	R 1057	35517
SGB5YU8	SE0010837815	2018-02-15	2018-09-19	R 1057	35518
SGB10YH8	SE0010208025	2017-08-17	2018-03-21	R 1060	35524
SGB10YM8	SE0010525246	2017-11-16	2018-06-20	R 1060	35525
SGB10YU8	SE0010837823	2018-02-15	2018-09-19	R 1060	35526

Mortgage Bond Future

Series	ISIN	Clearing date from	Expiration Settlement Day	Underlying loan	Underlying code for derivative
STH2YH8	SE0010525253	2017-11-16	2018-03-21	SHAB 1583	35528
STH2YM8	SE0010842591	2018-02-15	2018-06-20	SHAB 1583	35529
STH5YH8	SE0010525261	2017-11-16	2018-03-21	SHAB 1586	35532
STH5YM8	SE0010842583	2018-02-15	2018-06-20	SHAB 1587	35533
SWH2YH8	SE0010525279	2017-11-16	2018-03-21	SPINTAB 180	35548
SWH2YM8	SE0010842609	2018-02-15	2018-06-20	SPINTAB 180	35549
SWH5YH8	SE0010525295	2017-11-16	2018-03-21	SPINTAB 192	35552
SWH5YM8	SE0010842617	2018-02-15	2018-06-20	SPINTAB 192	35553
NDH2YH8	SE0010528232	2017-11-16	2018-03-21	NBHYP 5521	35544
NDH2YM8	SE0010842625	2018-02-15	2018-06-20	NBHYP 5521	35545
NDH5YH8	SE0010528240	2017-11-16	2018-03-21	NBHYP 5533	35540
NDH5YM8	SE0010842633	2018-02-15	2018-06-20	NBHYP 5533	35541
SCBC5YH8	SE0010528257	2017-11-16	2018-03-21	SCBC 143	35536
SCBC5YM8	SE0010842641	2018-02-15	2018-06-20	SCBC 143	35537

STIBOR-FRA Forward

Series	ISIN	Clearing date from	Expiration Settlement Day
FRA18O	SE0006734547	2015-03-09	2018-03-21
FRA18R	SE0007051370	2015-06-08	2018-06-20
FRA18U	SE0007359062	2015-09-07	2018-09-19
FRA18X	SE0007671623	2015-12-07	2018-12-19
FRA19O	SE0008189872	2016-03-29	2019-03-20
FRA19R	SE0008296982	2016-06-07	2019-06-19
FRA19U	SE0008692339	2016-09-12	2019-09-18
FRA19X	SE0009251366	2016-12-12	2019-12-18
FRA20O	SE0009684954	2017-03-13	2020-03-18
FRA20R	SE0009887698	2017-06-12	2020-06-17
FRA20U	SE0010216887	2017-09-11	2020-09-16
FRA20X	SE0010528281	2017-12-11	2020-12-16
FRA21O	SE0010842476	2018-03-12	2021-03-17

STIBOR-FRA Future

Series	ISIN	Clearing date from	Expiration Settlement Day
3STIBFRAH8	SE0007588017	2015-11-02	2018-03-21
3STIBFRAM8	SE0007588025	2015-11-02	2018-06-20
3STIBFRAU8	SE0007588033	2015-11-02	2018-09-19
3STIBFRAZ8	SE0007588041	2015-12-07	2018-12-19
3STIBFRAH9	SE0007975701	2016-03-07	2019-03-20
3STIBFRAM9	SE0008296990	2016-06-07	2019-06-19
3STIBFRAU9	SE0008692347	2016-09-12	2019-09-18
3STIBFRAZ9	SE0009250939	2016-12-12	2019-12-18
3STIBFRAH0	SE0009559032	2017-03-06	2020-03-18
3STIBFRAM0	SE0009871528	2017-06-12	2020-06-17
3STIBFRAU0	SE0010216846	2017-09-11	2020-09-16
3STIBFRAZ0	SE0010528273	2017-12-11	2020-12-16
3STIBFRAH1	SE0010842492	2018-03-12	2021-03-17

NIBOR-FRA Future

Series	ISIN	Clearing date from	Expiration Settlement Day
3NIBFRAH8	SE0007588116	2016-03-14	2018-03-21
3NIBFRAM8	SE0007975719	2016-06-13	2018-06-20
3NIBFRAU8	SE0008297006	2016-09-19	2018-09-19
3NIBFRAZ8	SE0008692354	2016-12-19	2018-12-19
3NIBFRAH9	SE0009250947	2017-03-13	2019-03-20
3NIBFRAM9	SE0009559040	2017-06-19	2019-06-19
3NIBFRAU9	SE0009871536	2017-09-18	2019-09-18
3NIBFRAZ9	SE0010215939	2017-12-18	2019-12-18
3NIBFRAH0	SE0010528299	2017-12-18	2020-03-18
3NIBFRAM0	SE0010539676	2017-12-18	2020-06-17
3NIBFRAU0	SE0010539684	2017-12-18	2020-09-16
3NIBFRAZ0	SE0010539692	2017-12-18	2020-12-16
3NIBFRAH1	SE0010842500	2018-03-19	2021-03-17
6NIBFRAH8	SE0009250954	2017-03-13	2018-03-21
6NIBFRAM8	SE0009559057	2017-06-19	2018-06-20
6NIBFRAU8	SE0009874381	2017-09-18	2018-09-19
6NIBFRAZ8	SE0010216853	2017-12-18	2018-12-19
6NIBFRAH9	SE0010528307	2018-03-19	2019-03-20
6NIBFRAM9	SE0010842518	2018-06-18	2019-06-19

Riksbank Future, RIBA

Series	ISIN	Clearing date from	Expiration Settlement Day
RIBAH8	SE0007975735	2016-02-29	2018-03-21
RIBAM8	SE0008297022	2016-05-30	2018-06-20
RIBAU8	SE0008692370	2016-09-05	2018-09-19
RIBAZ8	SE0009250962	2016-12-05	2018-12-19
RIBAH9	SE0009559065	2017-02-27	2019-03-20
RIBAM9	SE0009886989	2017-06-05	2019-06-19
RIBAU9	SE0010216861	2017-09-04	2019-09-18
RIBAZ9	SE0010525287	2017-12-04	2019-12-18
RIBAH0	SE0010842534	2018-03-05	2020-03-18

CIBOR Future

Series	ISIN	Clearing date from	Expiration Settlement Day
CIBORH8	SE0007671672	2016-03-07	2018-03-21
CIBORM8	SE0007975743	2016-06-06	2018-06-20
CIBORU8	SE0008297030	2016-09-12	2018-09-19
CIBORZ8	SE0008692388	2016-12-12	2018-12-19
CIBORH9	SE0009250970	2017-03-06	2019-03-20
CIBORM9	SE0009559073	2017-06-12	2019-06-19
CIBORU9	SE0009886971	2017-09-11	2019-09-18
CIBORZ9	SE0010216879	2017-12-11	2019-12-18
CIBORH0	SE0010525303	2018-03-12	2020-03-18
CIBORM0	SE0010842542	2018-06-11	2020-06-17