

2018-08-10

## 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_1903	SE0011505643	2018-08-13	2019-03-18	2019-03-20	R 1047
SGB_5Y_1903	SE0011505650	2018-08-13	2019-03-18	2019-03-20	R 1057
SGB_10Y_1903	SE0011505668	2018-08-13	2019-03-18	2019-03-20	R 1061
NDH_2Y_1812	SE0011505965	2018-08-13	2018-12-17	2018-12-19	NBHYP 5532
NDH_5Y_1812	SE0011505973	2018-08-13	2018-12-17	2018-12-19	NBHYP 5533
SCBC_5Y_1812	SE0011505981	2018-08-13	2018-12-17	2018-12-19	SCBC 144
STH_2Y_1812	SE0011505924	2018-08-13	2018-12-17	2018-12-19	SHAB 1584
STH_5Y_1812	SE0011505932	2018-08-13	2018-12-17	2018-12-19	SHAB 1587
SWH_2Y_1812	SE0011505940	2018-08-13	2018-12-17	2018-12-19	SPINTAB 189
SWH_5Y_1812	SE0011505957	2018-08-13	2018-12-17	2018-12-19	SPINTAB 193
IMM_FRA_2109	SE0011506013	2018-09-05	2021-09-13	2021-09-15	
3STIB_FRA_2109	SE0011506021	2018-09-05	2021-09-13	2021-09-15	
RIBAU0_F	SE0011506039	2018-08-29	2020-09-14	2020-09-16	

## 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
SGB2YU8	SE0010837807	2018-02-15	2018-09-19	R 1047	35522
SGB2YZ8	SE0011192657	2018-05-17	2018-12-19	R 1047	35523
SGB2YH9	SE0011505643	2018-08-16	2019-03-20	R 1047	35520
SGB5YU8	SE0010837815	2018-02-15	2018-09-19	R 1057	35518
SGB5YZ8	SE0011192665	2018-05-17	2018-12-19	R 1057	35519
SGB5YH9	SE0011505650	2018-08-16	2019-03-20	R 1057	35516
SGB10YU8	SE0010837823	2018-02-15	2018-09-19	R 1060	35526
SGB10YZ8	SE0011192673	2018-05-17	2018-12-19	R 1060	35527
SGB10YH9	SE0011505668	2018-08-16	2019-03-20	R 1061	35524

### Mortgage Bond Future

Series	ISIN	Clearing date from	Expiration Settlement Day	Underlying loan	Underlying code for derivative
STH2YU8	SE0011188101	2018-05-17	2018-09-19	SHAB 1583	35530
STH2YZ8	SE0011505924	2018-08-16	2018-12-19	SHAB 1584	35531
STH5YU8	SE0011188119	2018-05-17	2018-09-19	SHAB 1587	35534
STH5YZ8	SE0011505932	2018-08-16	2018-12-19	SHAB 1587	35535
SWH2YU8	SE0011188127	2018-05-17	2018-09-19	SPINTAB 189	35550
SWH2YZ8	SE0011505940	2018-08-16	2018-12-19	SPINTAB 189	35551
SWH5YU8	SE0011188135	2018-05-17	2018-09-19	SPINTAB 193	35554
SWH5YZ8	SE0011505957	2018-08-16	2018-12-19	SPINTAB 193	35555
NDH2YU8	SE0011188143	2018-05-17	2018-09-19	NBHYP 5521	35546
NDH2YZ8	SE0011505965	2018-08-16	2018-12-19	NBHYP 5532	35547
NDH5YU8	SE0011188150	2018-05-17	2018-09-19	NBHYP 5533	35542
NDH5YZ8	SE0011505973	2018-08-16	2018-12-19	NBHYP 5533	35543
SCBC5YU8	SE0011188168	2018-05-17	2018-09-19	SCBC 143	35538
SCBC5YZ8	SE0011505981	2018-08-16	2018-12-19	SCBC 144	35539

### STIBOR-FRA Forward

Series	ISIN	Clearing date from	Expiration Settlement Day
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
FRA21R	SE0011192731	2018-06-11	2021-06-16
FRA21U	SE0011506013	2018-09-10	2021-09-15

### STIBOR-FRA Future

Series	ISIN	Clearing date from	Expiration Settlement Day
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
3STIBFRAM1	SE0011192723	2018-06-11	2021-06-16
3STIBFRAU1	SE0011506021	2018-09-10	2021-09-15

### NIBOR-FRA Future

Series	ISIN	Clearing date from	Expiration Settlement Day
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
3NIBFRAM1	SE0011192681	2018-06-18	2021-06-16
3NIBFRAU1	SE0011505999	2018-09-17	2021-09-15
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
6NIBFRAU9	SE0011192699	2018-09-17	2019-09-18
6NIBFRAZ9	SE0011506005	2018-12-17	2019-12-18

### Riksbank Future, RIBA

Series	ISIN	Clearing date from	Expiration Settlement Day
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
RIBAM0	SE0011192715	2018-06-04	2020-06-17
RIBAU0	SE0011506039	2018-09-03	2020-09-16

## CIBOR Future

<b>Series</b>	<b>ISIN</b>	<b>Clearing date from</b>	<b>Expiration Settlement Day</b>
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
CIBORU0	SE0011192707	2018-09-10	2020-09-16
CIBORZ0	SE0011506047	2018-12-10	2020-12-16