

2019-02-07

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

Trading code	ISIN Clearing	Start date for indicative pricing	Last date for indicative pricing	Expiration Settlement day of Forwards/Futures	Underlying loan
SGB_2Y_1909	SE0012224277	2019-02-11	2019-09-16	2019-09-18	R 1054
SGB_5Y_1909	SE0012224293	2019-02-11	2019-09-16	2019-09-18	R 1058
SGB_10Y_1909	SE0012224319	2019-02-11	2019-09-16	2019-09-18	R 1061
NDH_2Y_1906	SE0012224236	2019-02-11	2019-06-17	2019-06-19	NBHYP 5532
NDH_5Y_1906	SE0012224244	2019-02-11	2019-06-17	2019-06-19	NBHYP 5534
SCBC_5Y_1906	SE0012224251	2019-02-11	2019-06-17	2019-06-19	SCBC 144
STH_2Y_1906	SE0012225696	2019-02-11	2019-06-17	2019-06-19	SHAB 1584
STH_5Y_1906	SE0012224160	2019-02-11	2019-06-17	2019-06-19	SHAB 1588
SWH_2Y_1906	SE0012224178	2019-02-11	2019-06-17	2019-06-19	SPINTAB 190
SWH_5Y_1906	SE0012224228	2019-02-11	2019-06-17	2019-06-19	SPINTAB 194
IMM_FRA_2203	SE0012225720	2019-03-06	2022-03-14	2022-03-16	
RIBAH1_F	SE0012224269	2019-02-27	2021-03-15	2021-03-17	

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
SGB2YH9	SE0011505643	2018-08-16	2019-03-20	R 1047	35520
SGB2YM9	SE0011935378	2018-11-15	2019-06-19	R 1047	35521
SGB2YU9	SE0012224277	2019-02-14	2019-09-18	R 1054	35522
SGB5YH9	SE0011505650	2018-08-16	2019-03-20	R 1056	35516
SGB5YM9	SE0011935386	2018-11-15	2019-06-19	R 1057	35517
SGB5YU9	SE0012224293	2019-02-14	2019-09-18	R 1058	35518
SGB10YH9	SE0011505668	2018-08-16	2019-03-20	R 1061	35524
SGB10YM9	SE0011935394	2018-11-15	2019-06-19	R 1061	35525
SGB10YU9	SE0012224319	2019-02-14	2019-09-18	R 1061	35526

Mortgage Bond Future

Series	ISIN	Clearing date from	Expiration Settlement Day	Underlying loan	Underlying code for derivative
STH2YH9	SE0011935360	2018-11-15	2019-03-20	SHAB 1584	35528
STH2YM9	SE0012225696	2019-02-14	2019-06-19	SHAB 1584	35529
STH5YH9	SE0011935402	2018-11-15	2019-03-20	SHAB 1588	35532
STH5YM9	SE0012224160	2019-02-14	2019-06-19	SHAB 1588	35533
SWH2YH9	SE0011935436	2018-11-15	2019-03-20	SPINTAB 189	35548
SWH2YM9	SE0012224178	2019-02-14	2019-06-19	SPINTAB 190	35549
SWH5YH9	SE0011935444	2018-11-15	2019-03-20	SPINTAB 193	35552
SWH5YM9	SE0012224228	2019-02-14	2019-06-19	SPINTAB 194	35553
NDH2YH9	SE0011935451	2018-11-15	2019-03-20	NBHYP 5532	35544
NDH2YM9	SE0012224236	2019-02-14	2019-06-19	NBHYP 5532	35545
NDH5YH9	SE0011935428	2018-11-15	2019-03-20	NBHYP 5533	35540
NDH5YM9	SE0012224244	2019-02-14	2019-06-19	NBHYP 5534	35541
SCBC5YH9	SE0011935410	2018-11-15	2019-03-20	SCBC 144	35536
SCBC5YM9	SE0012224251	2019-02-14	2019-06-19	SCBC 144	35537

Forward and Futures for tradable Fixed Income derivatives

STIBOR-FRA Forward

Series	ISIN	Clearing date from	Expiration Settlement Day
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
FRA21X	SE0011938083	2018-12-10	2021-12-15
FRA22O	SE0012225720	2019-03-11	2022-03-16

NIBOR-FRA Future

Series	ISIN	Clearing date from	Expiration Settlement Day
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
3NIBFRAZ1	SE0011938042	2018-12-17	2021-12-15
3NIBFRAH2	SE0012224301	2019-03-18	2022-03-16
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

6NIBFRAH0	SE0011938059	2019-03-18	2020-03-18
6NIBFRAM0	SE0012224327	2019-06-17	2020-06-17

Riksbank Future, RIBA

Series	ISIN	Clearing date from	Expiration Settlement Day
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
RIBAZ0	SE0011938067	2018-12-03	2020-12-16
RIBAH1	SE0012224269	2019-03-04	2021-03-17

CIBOR Future

Series	ISIN	Clearing date from	Expiration Settlement Day
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
CIBORH1	SE0011938075	2019-03-11	2021-03-17
CIBORM1	SE0012224285	2019-06-10	2021-06-16