

Posición Mensual en Instrumentos Derivados
Cifras en nuevos soles

Emisor Saga Falabella S.A.
 Al cierre 31 de Agosto de 2017

1 Detalle de Instrumentos Financieros Derivados

Instrumento Derivado	Finalidad	Monto Nocial (3)	Variable (4)	Moneda	Valor Razonable (5/)	
					Mes actual	Mes anterior
Forward	Negociacion	6,504,400	6,485,600	PEN	-18,369	
Forward	Negociacion	6,508,800	6,486,000	PEN	-19,882	
Forward	Negociacion	6,514,200	6,487,000	PEN	-22,398	
Forward	Negociacion	6,520,800	6,490,000	PEN	-26,091	
Forward	Negociacion	5,212,000	5,198,720	PEN		-24,318
Forward	Negociacion	5,215,680	5,198,240	PEN		-24,536
Forward	Negociacion	5,219,680	5,198,400	PEN		-25,113
Forward	Negociacion	5,225,280	5,200,000	PEN		-27,172
Forward	Negociacion	5,228,480	5,200,320	PEN		-26,032
Total Monto Nocial		52,149,320	Total Valor Razonable		-86,741	-127,171

- CONTRATOS VENCIDOS JUL.17 -26,101,120
 VALOR NOMINAL CONTRATO A AGO.17 26,048,200

2 Ganancia/Pérdidas acumuladas

	Moneda	PEN
Importe de ganancia/ pérdida total acumulada en el año (GPT) por instrumentos financieros derivados declarados en el Activos		-3,133,113

INFORMACION ADICIONAL

- (3) Monto Nominal expresado en Soles según el T.C. pactado según cada contrato.
 (4) Monto Nominal expresado en Soles según el T.C SPOT de la fecha de negociacion.

Notas:

- (1) Forward, Futuro, Opción, Swap, entre otras.
 (2) De acuerdo a las Normas Internacionales de Información Financiera (NIIF) califican de Cobertura o Negociación.
 (3) Monto nocial o Valor nominal del contrato.
 (4) En caso de derivados de cobertura representa el Activo o Pasivo que se está coberturando y en caso de derivados de negociación es la variable de referencia.
 (5) Moneda de presentación de la información financiera intermedia individual.
 (6) Representa el total de ingresos y/o gastos de todos sus instrumentos financieros derivados, lo que incluye: (i) los ingresos y/o gastos por instrumentos derivados acumulado en el año que se registran en el Estado de Resultados; y, (ii) el total de variación acumulada al cierre del período de los instrumentos derivados que se registran en Otros Resultados Integrales.