

Posición Mensual en Instrumentos Derivados
Cifras en nuevos soles

Emisor Saga Falabella S.A.
Al cierre 31 de Agosto de 2018

1 Detalle de Instrumentos Financieros Derivados

Instrumento Derivado	Finalidad	Monto Nominal (3)	Variable (4)	Moneda	Valor Razonable (S/)	
					Mes actual	Mes anterior
Forward	Negociacion	6,562,200	6,548,000	PEN	37,086	
Forward	Negociacion	6,559,800	6,548,000	PEN	37,288	
Forward	Negociacion	6,559,800	6,548,000	PEN	39,483	
Forward	Negociacion	6,562,000	6,545,000	PEN	39,291	
Forward	Negociacion	6,562,000	6,551,600	PEN	37,285	
Forward	Negociacion	6,567,000	6,548,000	PEN	36,250	
Forward	Negociacion	9,830,400	9,813,600	PEN	71,515	
Forward	Negociacion	9,833,700	9,814,200	PEN	71,134	
Forward	Negociacion	6,587,000	6,585,000	PEN	10,099	
Forward	Negociacion	6,596,400	6,583,000	PEN	8,031	
Forward	Negociacion	9,893,700	9,881,400	PEN	15,704	
Forward	Negociacion	9,905,100	9,882,600	PEN	7,113	
Forward	Negociacion	6,545,200	6,532,600	PEN		4,581
Forward	Negociacion	9,824,400	9,807,300	PEN		3,248
Forward	Negociacion	9,828,600	9,803,100	PEN		1,899
Forward	Negociacion	6,554,400	6,536,000	PEN		1,226
Forward	Negociacion	4,917,900	4,906,500	PEN		-2,644
Forward	Negociacion	4,917,750	4,905,000	PEN		-1,025
Forward	Negociacion	4,933,650	4,923,750	PEN		-18,363
Forward	Negociacion	4,933,950	4,924,950	PEN		-17,182
Forward	Negociacion	3,277,800	3,274,500	PEN		-1,913
Forward	Negociacion	6,558,800	6,549,000	PEN		-3,162
Forward	Negociacion	6,562,200	6,548,000	PEN		-2,627
Forward	Negociacion	6,559,800	6,548,000	PEN		-2,157
Forward	Negociacion	6,559,800	6,548,000	PEN		-237
Forward	Negociacion	6,562,000	6,545,000	PEN		-511
Forward	Negociacion	6,562,000	6,551,600	PEN		-2,428
Forward	Negociacion	6,567,000	6,548,000	PEN		-3,571
		193,684,350			410,278	-44,867
- CONTRATOS VENCIDOS JUL.18		-101,665,250				
VALOR NOMINAL CONTRATO A AGO.18		92,019,100				

2 Ganancia/Pérdidas acumuladas

	Moneda	PEN
Importe de ganancia/ pérdida total acumulada en el año (GPT) por instrumentos financieros derivados declarados en el Activos		1,107,811

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 periodo de los instrumentos derivados que se registran en Otros Resultados Integrales.