

Posición Mensual en Instrumentos Derivados
Cifras en nuevos soles

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

1 Detalle de Instrumentos Financieros Derivados

Instrumento Derivado	Finalidad	Monto Nominal (3)	Variable (4)	Moneda	Valor Razonable (\$/)	
					Mes actual	Mes anterior
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	
Forward	Negociacion	6,590,800	6,574,000	PEN		-42,079
Forward	Negociacion	6,590,400	6,577,000	PEN		-39,860
Forward	Negociacion	4,918,500	4,907,250	PEN		-4,444
Forward	Negociacion	4,920,750	4,908,750	PEN		-5,408
Forward	Negociacion	9,831,300	9,812,400	PEN		-5,538
Forward	Negociacion	6,536,000	6,529,000	PEN		12,706
Forward	Negociacion	6,539,000	6,529,000	PEN		13,047
Forward	Negociacion	6,541,200	6,528,600	PEN		12,547
Forward	Negociacion	6,545,200	6,532,600	PEN		12,362
Forward	Negociacion	8,206,250	8,195,000	PEN		-16,143
Forward	Negociacion	9,824,400	9,807,300	PEN		14,600
Forward	Negociacion	9,828,600	9,803,100	PEN		13,047
Forward	Negociacion	6,554,400	6,536,000	PEN		8,456
Forward	Negociacion	4,917,900	4,906,500	PEN		2,941
Forward	Negociacion	4,917,750	4,905,000	PEN		4,402
		204,927,700			-44,867	-19,364
- CONTRATOS VENCIDOS JUN.18		-103,262,450				
VALOR NOMINAL CONTRATO A JUL.18		101,665,250				

2 Ganancia/Pérdidas acumuladas

	Moneda	PEN
Importe de ganancia/ pérdida total acumulada en el año (GPT) por instrumentos financieros derivados declarados en el Activos		395,315

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 notional 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.