

Posición Mensual en Instrumentos Derivados
Cifras en nuevos soles

Emisor Saga Falabella S.A.
 Al cierre 30 de Noviembre 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	10,030,500	10,012,500	PEN	116,656	
Forward	Negociacion	10,034,100	10,012,200	PEN	115,361	
Forward	Negociacion	6,689,600	6,673,000	PEN	78,351	
Forward	Negociacion	6,706,200	6,695,000	PEN	58,577	
Forward	Negociacion	6,708,200	6,695,000	PEN	58,126	
Forward	Negociacion	6,710,000	6,695,000	PEN	57,985	
Forward	Negociacion	6,712,400	6,695,000	PEN	57,240	
Forward	Negociacion	6,750,800	6,736,000	PEN	18,933	
Forward	Negociacion	6,755,000	6,746,000	PEN	15,630	
Forward	Negociacion	6,757,000	6,744,000	PEN	14,842	
Forward	Negociacion	6,760,000	6,745,000	PEN	13,262	
Forward	Negociacion	6,762,400	6,746,000	PEN	12,284	
Forward	Negociacion	6,764,000	6,746,000	PEN	12,110	
Forward	Negociacion	5,068,500	5,062,500	PEN	9,480	
Forward	Negociacion	5,069,250	5,061,750	PEN	9,637	
Forward	Negociacion	6,761,200	6,747,600	PEN	12,067	
Forward	Negociacion	9,912,600	9,892,500	PEN		190,613
Forward	Negociacion	9,922,800	9,903,000	PEN		183,247
Forward	Negociacion	9,927,900	9,904,500	PEN		181,115
Forward	Negociacion	10,024,200	10,006,200	PEN		81,977
Forward	Negociacion	10,029,000	10,006,500	PEN		82,677
Forward	Negociacion	6,662,800	6,652,000	PEN		76,631
Forward	Negociacion	6,666,000	6,653,000	PEN		75,065
Forward	Negociacion	10,030,500	10,012,500	PEN		82,496
Forward	Negociacion	10,034,100	10,012,200	PEN		81,375
Forward	Negociacion	6,689,600	6,673,000	PEN		55,695
Forward	Negociacion	6,706,200	6,695,000	PEN		35,861
Forward	Negociacion	6,708,200	6,695,000	PEN		35,525
Forward	Negociacion	6,710,000	6,695,000	PEN		35,390
Forward	Negociacion	6,712,400	6,695,000	PEN		34,898
Forward	Negociacion	6,750,800	6,736,000	PEN		-3,292
		234,526,250			660,540	1,229,272
- CONTRATOS VENCIDOS NOV.18		-123,487,100				
VALOR NOMINAL CONTRATO A NOV.18		111,039,150				

2. Ganancia/Pérdidas acumuladas

	Moneda	PEN
Importe de ganancia/ pérdida total acumulada en el año (GPT) por instrumentos financieros derivados declarados en el Activos		3,497,872

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.