

Posición Mensual en Instrumentos Derivados
Cifras en nuevos soles

Emisor Saga Falabella S.A.
 Al cierre 28 de Febrero de 2018

1 Detalle de Instrumentos Financieros Derivados

Instrumento Derivado	Finalidad	Monto Ncional (3)	Variable (4)	Moneda	Valor Razonable (S/)	
					Mes actual	Mes anterior
Forward	Negociacion	8,060,000	8,044,500	PEN	94,460	
Forward	Negociacion	6,449,600	6,432,800	PEN	75,741	
Forward	Negociacion	4,830,600	4,818,750	PEN	64,686	
Forward	Negociacion	4,831,500	4,818,000	PEN	65,141	
Forward	Negociacion	6,444,800	6,436,000	PEN	78,766	
Forward	Negociacion	6,446,800	6,436,000	PEN	78,538	
Forward	Negociacion	8,060,250	8,045,250	PEN	98,575	
Forward	Negociacion	11,288,200	11,263,000	PEN	137,328	
Forward	Negociacion	6,512,000	6,497,000	PEN	20,793	
Forward	Negociacion	6,507,400	6,498,400	PEN	27,207	
Forward	Negociacion	11,175,800	11,148,600	PEN		-235,141
Forward	Negociacion	17,488,718	17,435,476	PEN		-167,746
Forward	Negociacion	8,052,000	8,040,500	PEN		-5,137
Forward	Negociacion	8,053,750	8,040,000	PEN		-4,544
Forward	Negociacion	8,060,000	8,044,500	PEN		-5,850
Forward	Negociacion	6,449,600	6,432,800	PEN		-4,363
Forward	Negociacion	4,830,600	4,818,750	PEN		4,734
Forward	Negociacion	4,831,500	4,818,000	PEN		5,263
		138,373,118			741,233	-412,784

- CONTRATOS VENCIDOS ENE.18

-68,941,968

VALOR NOMINAL CONTRATO A FEB.18

69,431,150

2 Ganancia/Pérdidas acumuladas

	Moneda	PEN
Importe de ganancia/ pérdida total acumulada en el año (GPT) por instrumentos financieros derivados declarados en el Activos		395,616

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 ncional 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.

<p