

Posición Mensual en Instrumentos Derivados
Cifras en nuevos soles

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

1 Detalle de Instrumentos Financieros Derivados

Instrumento Derivado	Finalidad	Monto Ncional (3)	Variable (4)	Moneda	Valor Razonable (S/)	
					Mes actual	Mes anterior
Forward	Negociacion	8,182,250	8,172,250	PEN	-54,549	
Forward	Negociacion	8,183,750	8,175,750	PEN	-53,195	
Forward	Negociacion	8,188,250	8,176,250	PEN	-54,944	
Forward	Negociacion	8,191,000	8,172,250	PEN	-55,067	
Forward	Negociacion	4,868,550	4,857,750	PEN		32,545
Forward	Negociacion	4,870,800	4,857,750	PEN		31,551
Forward	Negociacion	4,872,450	4,857,150	PEN		31,230
Forward	Negociacion	4,874,700	4,857,000	PEN		30,283
Forward	Negociacion	3,235,300	3,233,000	PEN		32,094
Forward	Negociacion	3,235,600	3,233,500	PEN		32,625
Total Monto Ncional		58,702,650	Total Valor Razonable		-217,754	190,329

- CONTRATOS VENCIDOS SEP.17 **-25,957,400**
VALOR NOMINAL CONTRATO A OCT.17 **32,745,250**

2 Ganancia/Pérdidas acumuladas

	Moneda	PEN
Importe de ganancia/ pérdida total acumulada en el año (GPT) por instrumentos financieros derivados declarados en el Activos		-3,286,625

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.
(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.