

Posición Mensual en Instrumentos Derivados
Cifras en nuevos soles

Emisor Saga Falabella S.A.
Al cierre 30 de Setiembre de 2017

1 Detalle de Instrumentos Financieros Derivados

Instrumento Derivado	Finalidad	Monto Nocial (3)	Variable (4)	Moneda	Valor Razonable (\$/)	
					Mes actual	Mes anterior
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	
Forward	Negociacion	6,504,400	6,485,600	PEN		-18,369
Forward	Negociacion	6,508,800	6,486,000	PEN		-19,882
Forward	Negociacion	6,514,200	6,487,000	PEN		-22,398
Forward	Negociacion	6,520,800	6,490,000	PEN		-26,091
Total Monto Nocial		52,005,600	Total Valor Razonable		190,329	-86,741

- CONTRATOS VENCIDOS AGO.17

-26,048,200

VALOR NOMINAL CONTRATO A SET.17

25,957,400

2 Ganancia/Pérdidas acumuladas

	Moneda	PEN
Importe de ganancia/ pérdida total acumulada en el año (GPT) por instrumentos financieros derivados declarados en el Activos		-2,865,043

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