

Posición Mensual en Instrumentos Derivados
Cifras en nuevos soles

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

1 Detalle de Instrumentos Financieros Derivados

Instrumento Derivado	Finalidad	Monto Ncional (3)	Variable (4)	Moneda	Valor Razonable (\$/)	
					Mes actual	Mes anterior
Forward	Negociacion	5,212,000	5,198,720	PEN	-24,318	
Forward	Negociacion	5,215,680	5,198,240	PEN	-24,536	
Forward	Negociacion	5,219,680	5,198,400	PEN	-25,113	
Forward	Negociacion	5,225,280	5,200,000	PEN	-27,172	
Forward	Negociacion	5,228,480	5,200,320	PEN	-26,032	
Forward	Negociacion	6,564,200	6,543,600	PEN		-51,553
Forward	Negociacion	6,570,400	6,548,000	PEN		-52,988
Forward	Negociacion	6,576,000	6,543,000	PEN		-54,171
Forward	Negociacion	6,582,000	6,546,000	PEN		-55,424
TOTAL MONTO NOCIONAL		47,181,720	TOTAL VALOR RAZONABLE		-102,853	-214,137
- CONTRATOS VENCIDOS JUN.17		-26,292,600				
VALOR NOMINAL CONTRATO A JUL.17		20,889,120				

2 Ganancia/Pérdidas acumuladas

	Moneda	PEN
Importe de ganancia/ pérdida total acumulada en el año (GPT) por instrumentos financieros derivados declarados en el Activos		-2,987,963

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.