

Posición Mensual en Instrumentos Derivados
Cifras en nuevos soles

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

1 Detalle de Instrumentos Financieros Derivados

Instrumento Derivado	Finalidad	Monto Nocial (3)	Variable (4)	Moneda	Valor Razonable (S/)	
					Mes actual	Mes anterior
Forward	Negociacion	5,212,160	5,198,400	PEN	-17,444	
Forward	Negociacion	5,216,000	5,198,400	PEN	-17,286	
Forward	Negociacion	5,221,120	5,198,720	PEN	-18,607	
Forward	Negociacion	5,225,120	5,199,040	PEN	-18,708	
Forward	Negociacion	5,228,320	5,198,720	PEN	-18,092	
Forward	Negociacion	4,292,860	4,277,000	PEN		-67,532
Forward	Negociacion	4,294,940	4,273,100	PEN		-66,766
Forward	Negociacion	4,294,810	4,271,800	PEN		-63,922
Forward	Negociacion	4,299,100	4,271,800	PEN		-65,395
TOTAL MONTO NOCIONAL		43,284,430	TOTAL VALOR RAZONABLE		-90,137	-263,615
- CONTRATOS VENCIDOS ABR.17		-17,181,710				
VALOR NOMINAL CONTRATO A ABR.17		26,102,720				

2 Ganancia/Pérdidas acumuladas

	Moneda	PEN
Importe de ganancia/ pérdida total acumulada en el año (GPT) por instrumentos financieros derivados declarados en el Activos		-2,574,328

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.