

Posición Mensual en Instrumentos Derivados
Cifras en nuevos soles

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

1 Detalle de Instrumentos Financieros Derivados

Instrumento Derivado	Finalidad	Monto Nocional (3)	Variable (4)	Moneda	Valor Razonable (S/)	
					Mes actual	Mes anterior
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	
Forward	Negociacion	6,556,400	6,528,000	PEN		-17,444
Forward	Negociacion	6,561,800	6,530,000	PEN		-17,286
Forward	Negociacion	6,569,000	6,530,600	PEN		-18,607
Forward	Negociacion	6,573,200	6,532,000	PEN		-18,708
TOTAL MONTO NOCIONAL		52,553,000	TOTAL VALOR RAZONABLE		-214,137	-72,044
- CONTRATOS VENCIDOS MAY.17		-26,260,400				
VALOR NOMINAL CONTRATO A MAY.17		26,292,600				

2 Ganancia/Pérdidas acumuladas

	Moneda	PEN
Importe de ganancia/ pérdida total acumulada en el año (GPT) por instrumentos financieros derivados declarados en el Activos		-2,759,428

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 nocional 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.