

Posición Mensual en Instrumentos Derivados
Cifras en nuevos soles

Emisor Saga Falabella S.A.
Al cierre 31 de Mayo 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	6,556,400	6,528,000	PEN	-8,583	
Forward	Negociacion	6,561,800	6,530,000	PEN	-9,546	
Forward	Negociacion	6,569,000	6,530,600	PEN	-12,311	
Forward	Negociacion	6,573,200	6,532,000	PEN	-12,036	
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
TOTAL MONTO NOCIONAL		52,363,120	TOTAL VALOR RAZONABLE		-42,476	-90,137
- CONTRATOS VENCIDOS MAY.17		-26,102,720				
VALOR NOMINAL CONTRATO A MAY.17		26,260,400				

2 Ganancia/Pérdidas acumuladas

	Moneda	PEN
Importe de ganancia/ pérdida total acumulada en el año (GPT) por instrumentos financieros derivados declarados en el Activos		-2,460,507

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.