

Posición Mensual en Instrumentos Derivados
Cifras en nuevos soles

Emisor Saga Falabella S.A.
Al cierre 31 de Agosto de 2016

1 Detalle de Instrumentos Financieros Derivados

Instrumento Derivado	Finalidad	Monto Nocial (3)	Variable (4)	Moneda	Valor Razonable (S/)	
					Mes actual	Mes anterior
Forward	Negociacion	6,859,505	6,840,850	PEN	104,491	
Forward	Negociacion	6,867,090	6,840,850	PEN	101,754	
Forward	Negociacion	6,873,650	6,840,850	PEN	99,998	
Forward	Negociacion	6,876,725	6,840,850	PEN	102,013	
Forward	Negociacion	4,947,300	4,929,000	PEN		93,740
Forward	Negociacion	4,951,200	4,929,000	PEN		93,439
Forward	Negociacion	4,955,400	4,929,000	PEN		92,867
Forward	Negociacion	4,959,450	4,929,000	PEN		92,431
Forward	Negociacion	4,963,500	4,929,000	PEN		91,369
Forward	Negociacion	1,348,800	1,334,800	PEN		-4,516
Forward	Negociacion	1,350,400	1,335,200	PEN		-5,131
Forward	Negociacion	1,351,280	1,334,440	PEN		-5,020
Forward	Negociacion	1,352,680	1,334,400	PEN		-5,431
Forward	Negociacion	1,353,240	1,334,040	PEN		-5,173
		59,010,220			408,256	438,574
		-31,533,250				
		27,476,970				

- CONTRATOS VENCIDOS AGO.16

VALOR NOMINAL CONTRATO A JUL.16

2 Ganancia/Pérdidas acumuladas

	Moneda	PEN
Importe de ganancia/ pérdida total acumulada en el año (GPT) por instrumentos financieros derivados declarados en el Activos		-3,191,155

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 negociación.

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.