Posición Mensual en Instrumentos Derivados
Cifras en nuevos soles

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

1 Detalle de Instrumentos Financieros Derivados

Instrumento Derivado	Finalidad	Monto Nocional (3)	Variable (4)	Moneda	Valor Razonable (S/)	
					Mes actual	Mes anterior
Forward	Negociacion	3,428,100	3,415,800	PEN	-66,883	
Forward	Negociacion	3,431,600	3,415,900	PEN	-67,382	
Forward	Negociacion	3,435,000	3,416,500	PEN	-67,716	
Forward	Negociacion	5,138,850	5,107,500	PEN	-83,490	
Forward	Negociacion	5,143,350	5,108,100	PEN	-83,618	
Forward	Negociacion	5,096,850	5,078,550	PEN		26,477
Forward	Negociacion	5,101,050	5,078,250	PEN		26,757
Forward	Negociacion	5,106,150	5,079,450	PEN		26,165
Forward	Negociacion	5,110,500	5,079,750	PEN		26,344
Forward	Negociacion	4,447,040	4,434,300	PEN		-6,798
Forward	Negociacion	4,451,590	4,434,300	PEN		-7,436
Forward	Negociacion	4,455,100	4,434,300	PEN		-7,012
Forward	Negociacion	4,459,260	4,434,300	PEN		-7,216
		58,804,440			**-369,090**	**77,282**
- CONTRATOS VENCIDOS DIC.16		**-38,227,540**				
VALOR NOMINAL CONTRATO A DIC.16		**20,576,900**				

2 Ganancia/Pérdidas acumuladas

	Moneda	PEN
Importe de ganancia/ pérdida total acumulada en el año (GPT) por instrumentos financieros derivados declarados en el Activos	-4,364,701	

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.