

Posición Mensual en Instrumentos Derivados
Cifras en nuevos soles

Emisor Saga Falabella S.A.
 Al cierre 31 de Enero 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	8,456,250	8,422,000	PEN	-232,312	
Forward	Negociacion	8,460,750	8,417,500	PEN	-230,339	
Forward	Negociacion	8,467,750	8,418,500	PEN	-230,844	
Forward	Negociacion	8,473,500	8,415,000	PEN	-229,976	
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
		54,435,150			-923,471	-369,090
- CONTRATOS VENCIDOS ENE.17		-20,576,900				
VALOR NOMINAL CONTRATO A ENE.17		33,858,250				

2 Ganancia/Pérdidas acumuladas

	Moneda	PEN
Importe de ganancia/ pérdida total acumulada en el año (GPT) por instrumentos financieros derivados declarados en el Activos		-1,780,181

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.