

Posición Mensual en Instrumentos Derivados
Cifras en nuevos soles

Emisor Saga Falabella S.A.
Al cierre 28 de Febrero de 2017

1 Detalle de Instrumentos Financieros Derivados

Instrumento Derivado	Finalidad	Monto Nominal (3)	Variable (4)	Moneda	Valor Razonable (S/)	
					Mes actual	Mes anterior
Forward	Negociacion	4,881,450	4,863,750	PEN	16,729	
Forward	Negociacion	4,881,000	4,862,550	PEN	20,856	
Forward	Negociacion	4,888,200	4,863,000	PEN	17,373	
Forward	Negociacion	4,891,950	4,863,000	PEN	17,440	
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
		53,400,850			72,399	-923,471
- CONTRATOS VENCIDOS FEB.17		-33,858,250				
VALOR NOMINAL CONTRATO A FEB.17		19,542,600				

2 Ganancia/Pérdidas acumuladas

	Moneda	PEN
Importe de ganancia/ pérdida total acumulada en el año (GPT) por instrumentos financieros derivados declarados en el Activos		-1,914,643

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 nominal 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 periodo de los instrumentos derivados que se registran en Otros Resultados Integrales.