



PERÚ

Ministerio  
de Economía y FinanzasSMV  
Superintendencia del Mercado  
de Valores

DECENIO DE LAS PERSONAS CON DISCAPACIDAD EN EL PERÚ - AÑO DE LA CONSOLIDACIÓN DEL MAR DE GRAU

ANEXO  
POSICION MENSUAL EN INSTRUMENTOS DERIVADOS

Emisor	Saga Falabella S.A.
Al cierre	31 de Julio 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	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	-27,270
Forward	Negociacion	1,350,400	1,335,200	PEN	-5,131	-27,861
Forward	Negociacion	1,351,280	1,334,440	PEN	-5,020	-27,735
Forward	Negociacion	1,352,680	1,334,400	PEN	-5,431	-28,124
Forward	Negociacion	1,353,240	1,334,040	PEN	-5,173	-27,820
Forward	Negociacion	1,949,769	1,925,250	PEN		-84,628
Forward	Negociacion	1,945,918	1,925,250	PEN		-79,339
Forward	Negociacion	1,953,336	1,926,949	PEN		-85,274
Forward	Negociacion	1,954,412	1,924,684	PEN		-84,890
Forward	Negociacion	2,190,825	2,174,900	PEN		-49,854
Forward	Negociacion	2,192,710	2,174,900	PEN		-50,119
Forward	Negociacion	2,194,725	2,174,900	PEN		-50,481
Forward	Negociacion	2,196,675	2,174,900	PEN		-50,793
Forward	Negociacion	2,683,120	2,672,000	PEN		-48,086
Forward	Negociacion	2,685,200	2,672,400	PEN		-48,184
Forward	Negociacion	2,688,400	2,671,600	PEN		-49,360
Forward	Negociacion	2,690,320	2,672,400	PEN		-49,276
		<b>58,858,660</b>			<b>438,574</b>	<b>-869,095</b>
		<b>-27,325,410</b>				
		<b>31,533,250</b>				

- CONTRATOS VENCIDOS JUL.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		-3,418,368

## 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.  
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.