

Posición Mensual en Instrumentos Derivados
Cifras en nuevos soles

Emisor Saga Falabella S.A.
Al cierre 31 de Marzo 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	4,292,860	4,277,000	PEN	-67,532	
Forward	Negociacion	4,294,940	4,273,100	PEN	-66,766	
Forward	Negociacion	4,294,810	4,271,800	PEN	-63,922	
Forward	Negociacion	4,299,100	4,271,800	PEN	-65,395	
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
		36,724,310			-263,615	72,399
- CONTRATOS VENCIDOS MAR.17		-19,542,600				
VALOR NOMINAL CONTRATO A MAR.17		17,181,710				

2 Ganancia/Pérdidas acumuladas

	Moneda	PEN
Importe de ganancia/ pérdida total acumulada en el año (GPT) por instrumentos financieros derivados declarados en el Activos		-2,431,356

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.