

Posición Mensual en Instrumentos Derivados
Cifras en nuevos soles

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

1 Detalle de Instrumentos Financieros Derivados

Instrumento Derivado	Finalidad	Monto Nocial (3)	Variable (4)	Moneda	Valor Razonable (5/)	
					Mes actual	Mes anterior
Forward	Negociación	842,025	833,500	PEN	2,207	-19,989
Forward	Negociación	4,546,664	4,496,286	PEN	6,011	-113,979
Forward	Negociación	845,000	835,000	PEN	706	-21,646
Forward	Negociación	846,600	836,225	PEN	-128	-22,582
Forward	Negociación	3,005,464	2,975,280	PEN	-33,729	-111,702
Forward	Negociación	3,008,192	2,975,280	PEN	-33,840	-112,092
Forward	Negociación	3,010,832	2,975,280	PEN	-33,841	-112,390
Forward	Negociación	3,013,560	2,975,280	PEN	-33,847	-112,771
Forward	Negociación	1,552,050	1,535,850	PEN	-32,398	-72,214
Forward	Negociación	1,553,535	1,535,850	PEN	-32,530	-72,489
Forward	Negociación	1,555,155	1,535,850	PEN	-32,785	-72,897
Forward	Negociación	1,556,640	1,535,850	PEN	-32,862	-73,168
Forward	Negociación	1,949,769	1,925,250	PEN	-30,578	-81,623
Forward	Negociación	1,945,918	1,925,250	PEN	-25,024	-76,294
Forward	Negociación	1,953,336	1,926,949	PEN	-30,669	-82,113
Forward	Negociación	1,954,412	1,924,684	PEN	-30,011	-81,506
Forward	Negociación	2,190,825	2,174,900	PEN	11,986	
Forward	Negociación	2,192,710	2,174,900	PEN	12,048	
Forward	Negociación	2,194,725	2,174,900	PEN	11,982	
Forward	Negociación	2,196,675	2,174,900	PEN	11,982	
Forward	Negociación	1,348,800	1,334,800	PEN	11,537	
Forward	Negociación	1,350,400	1,335,200	PEN	11,138	
Forward	Negociación	1,351,280	1,334,440	PEN	11,452	
Forward	Negociación	1,352,680	1,334,400	PEN	11,245	
Forward	Negociación	1,353,240	1,334,040	PEN	11,617	
Forward	Negociación	1,974,161	1,955,471	PEN		-146,870
Forward	Negociación	424,649	419,350	PEN		-34,019
Forward	Negociación	5,980,397	5,918,301	PEN		-498,499
Forward	Negociación	1,995,697	1,972,767	PEN		-166,818
Forward	Negociación	984,890	977,595	PEN		-23,749
Forward	Negociación	2,040,420	2,028,600	PEN		-75,302
Forward	Negociación	2,042,100	2,028,600	PEN		-75,376
Forward	Negociación	2,043,780	2,028,600	PEN		-75,516
Forward	Negociación	2,045,580	2,028,600	PEN		-75,724
Forward	Negociación	2,047,380	2,028,600	PEN		-75,952
Forward	Negociación	1,990,908	1,979,540	PEN		-91,287
Forward	Negociación	1,992,822	1,979,540	PEN		-91,631
Forward	Negociación	1,994,736	1,979,540	PEN		-92,040
Forward	Negociación	1,996,592	1,979,540	PEN		-92,340
Forward	Negociación	1,998,506	1,979,540	PEN		-92,718
		80,223,104			-268,331	-2,947,298
		-31,552,618				
		48,670,486				

- CONTRATOS VENCIDOS MAY.16
VALOR NOMINAL CONTRATO A MAY.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		-2,620,194

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 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.