Posición Mensual en Instrumentos Derivados
Cifras en nuevos soles

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

1 Detalle de Instrumentos Financieros Derivados

Instrumento Derivado	Finalidad	Monto Nocional (3)	Variable (4)	Moneda	Valor Razonable (S/)	
					Mes actual	Mes anterior
Forward	Negociacion	5,474,080	5,457,600	PEN	-88,768	
Forward	Negociacion	5,478,240	5,458,400	PEN	-88,802	
Forward	Negociacion	5,463,360	5,441,120	PEN	-69,344	
Forward	Negociacion	5,468,160	5,440,800	PEN	-69,504	
Forward	Negociacion	5,472,640	5,442,240	PEN	-69,687	
Forward	Negociacion	3,367,800	3,361,000	PEN	538	
Forward	Negociacion	3,371,000	3,361,000	PEN	172	
Forward	Negociacion	3,374,200	3,362,000	PEN	-168	
Forward	Negociacion	5,097,000	5,080,500	PEN		9,834
Forward	Negociacion	5,103,000	5,082,000	PEN		8,058
Forward	Negociacion	5,106,300	5,082,000	PEN		8,904
Forward	Negociacion	5,110,050	5,082,000	PEN		9,287
		57,885,830			**-385,564**	**36,082**
- CONTRATOS VENCIDOS OCT.16		**-20,416,350**				
VALOR NOMINAL CONTRATO A OCT.16		**37,469,480**				

2 Ganancia/Pérdidas acumuladas

	Moneda	PEN
Importe de ganancia/ pérdida total acumulada en el año (GPT) por instrumentos financieros derivados declarados en el Activos	-4,173,615	

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.