

**PERÚ****Ministerio
de Economía y Finanzas****SMV**
Superintendencia del Mercado
de Valores

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

**ANEXO
POSICIÓN MENSUAL EN INSTRUMENTOS DERIVADOS**

Emisor:	Saga Falabella S.A.
Al cierre del:	30 de Septiembre de 2016

DETALLE DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS

Instrumento Derivado (1)	Finalidad (2)	Monto Ncional (3)	Variable (4)	Moneda (5)	Valor Razonable	
					Mes actual	Mes anterior
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	104,491
Forward	Negociacion	6,859,505	6,840,850	PEN		101,754
Forward	Negociacion	6,867,090	6,840,850	PEN		99,998
Forward	Negociacion	6,873,650	6,840,850	PEN		102,013
Forward	Negociacion	6,876,725	6,840,850	PEN		
		47,893,320			36,082	408,256
- CONTRATOS VENCIDOS SET.16		-27,476,970				
VALOR NOMINAL CONTRATO A SET.1€		20,416,350				

GANANCIA/PÉRDIDAS ACUMULADAS

	Moneda(5)	Soles
Importe de ganancia/pérdida total acumulada en el año por instrumentos Financieros Derivados(6):		-3,259,199

Información 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.
(ii) el total de variación acumulada al cierre del período de los instrumentos derivados que se registran en Otros Resultados Integrales.