

Posición Mensual en Instrumentos Derivados
Cifras en nuevos soles

Emisor Saga Falabella S.A.
Al cierre 30 de Junio de 2019

1 Detalle de Instrumentos Financieros Derivados

Instrumento Derivado	Finalidad	Monto Nominal (3)	Variable (4)	Moneda	Valor Razonable (S/)	
					Mes actual	Mes anterior
Forward	Negociacion	6,652,200	6,623,200	PEN	-69,666	100,199
Forward	Negociacion	4,990,650	4,967,400	PEN	-51,910	75,320
Forward	Negociacion	6,661,000	6,623,200	PEN	-69,335	102,547
Forward	Negociacion	5,329,760	5,298,560	PEN	-54,939	82,875
Forward	Negociacion	10,946,100	10,893,960	PEN	-77,498	202,492
Forward	Negociacion	11,291,400	11,224,080	PEN	-79,453	214,231
Forward	Negociacion	11,660,250	11,600,400	PEN	-108,374	196,253
Forward	Negociacion	11,678,450	11,609,500	PEN	-108,171	193,800
Forward	Negociacion	9,364,880	9,303,000	PEN	-105,534	136,346
Forward	Negociacion	15,180,750	15,073,650	PEN	-284,029	
Forward	Negociacion	15,204,150	15,089,850	PEN	-302,427	
Forward	Negociacion	3,686,430	3,662,780	PEN	-46,481	
Forward	Negociacion	15,793,410	15,681,550	PEN	-225,900	
Forward	Negociacion	6,677,400	6,648,400	PEN		66,463
Forward	Negociacion	8,825,030	8,787,400	PEN		118,073
Forward	Negociacion	8,303,250	8,273,750	PEN		123,274
Forward	Negociacion	8,305,000	8,273,750	PEN		124,775
Forward	Negociacion	8,971,290	8,935,650	PEN		137,136
Forward	Negociacion	8,822,380	8,788,725	PEN		117,407
		178,343,780			-1,583,716	1,991,191
		-49,904,350				
		128,439,430				

- CONTRATOS VENCIDOS JUN.19

VALOR NOMINAL CONTRATO A JUN.19

2 Ganancia/Pérdidas acumuladas

	Moneda	PEN
Importe de ganancia/ pérdida total acumulada en el año (GPT) por instrumentos financieros derivados declarados en el Activos		-4,204,939

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.