

ALICORP S.A.A.
ANEXO: POSICION MENSUAL DE INSTRUMENTOS DERIVADOS

EMISOR:	Alicorp S.A.A.
Información al cierre de:	28 de febrero de 2017

1. Detalle de Instrumentos Financieros Derivados:

Instrumento Derivado (1)	Finalidad (2)	Monto (3)	Activo o Variable (4)	Moneda	Valor Razonable	
					Mes actual S/.	Mes anterior S/.
Posición Activa:						
Call Spread	Cobertura	\$62,382,000	Pasivo registrado en dólares por el principal de los bonos internacionales	PEN	13,954,627	13,340,783
Cross Swap	Cobertura	\$50,000,000	Pasivo registrado en dólares por los cupones de los bonos internacionales	PEN	5,041,034	4,866,450
Forwards de tipo de cambio	Cobertura	\$122,265,376	Pasivo registrado en dólares por obligaciones con proveedores	PEN	681,366	418,316
Opciones de materia prima	Cobertura	\$25,350,000	Inventarios de materia prima	PEN	2,147,707	1,462,715
Posición Pasiva:						
Forwards de tipo de cambio	Cobertura	\$122,265,376	Pasivo registrado en dólares por obligaciones con proveedores	PEN	10,261,887	12,215,400
Opciones de materia prima	Cobertura	\$24,180,000	Inventarios de materia prima	PEN	934,115	592,482

(1) Forward, Futuro, Opción, Swap, entre otras.

(2) Cobertura, Negociación

(3) Monto Nocional o Valor Nominal del Contrato

(4) Activo a coberturar, o variable de referencia en caso de instrumentos derivados con fines de negociación

2. Ganancia / Pérdidas acumuladas y Valor Razonable:

	Moneda: PEN
1. Importe de ganancia/pérdida total acumulado (GPT) por Instrumentos Financieros Derivados:	(16,076,313) (a)

4. Información adicional:

(a) Este importe se encuentra registrado en los siguientes rubros del Estado de Resultados Integrales:

Resultados de Operaciones con Instrumentos Financieros Derivados de Materia Prima

Costo de ventas	842
Otras ganancias (pérdidas)	13,084
Total ganancia (pérdida)	<u>13,926</u>

Resultados de Operaciones con Instrumentos Financieros Derivados de Tipo de Cambio y Tasa

Ingresos financieros, neto	4,867,967
Diferencia de cambio, neto	(19,260,793)
Total ganancia (pérdida)	<u>(14,392,826)</u>

Componentes de Otro Resultado Integral

Variación neta de coberturas de flujo de efectivo	(1,697,413)
---	-------------