

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

EMISOR:	Alicorp S.A.A.
Información al cierre de:	30 de setiembre 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	12,140,102	13,330,523
Cross Swap	Cobertura	\$50,000,000	Pasivo registrado en dólares por los cupones de los bonos internacionales	PEN	2,689,300	3,293,026
Forwards de tipo de cambio	Cobertura	\$81,679,118	Pasivo registrado en dólares por obligaciones con proveedores	PEN	1,889,554	40,051
Opciones de materia prima	Negociación (b)	\$817,700	Inventarios de materia prima	PEN	4,526	-
Opciones de materia prima	Cobertura	\$36,382,032	Inventarios de materia prima	PEN	2,176,510	1,723,614
Posición Pasiva:						
Forwards de tipo de cambio	Cobertura	\$81,679,118	Pasivo registrado en dólares por obligaciones con proveedores	PEN	1,183,208	1,148,597
Opciones de materia prima	Negociación (b)	\$5,000,000	Inventarios de materia prima	PEN	46,176	-
Opciones de materia prima	Cobertura	\$946,950	Inventarios de materia prima	PEN	118,023	244,983

(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:	(26,950,612) (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	941,739
Otras ganancias (pérdidas)	<u>(6,290,497)</u>
Total ganancia (pérdida)	(5,348,759)

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

Ingresos financieros, neto	14,200
Diferencia de cambio, neto	<u>(22,471,369)</u>
Total ganancia (pérdida)	(22,457,169)

Componentes de Otro Resultado Integral

Variación neta de coberturas de flujo de efectivo	855,316
---	---------

(b) Estos derivados son coberturas económicas efectivas bajo las posiciones de gestión de riesgo de la compañía, que no califican como coberturas contables según las reglas específicas de la NIC 39.