

Produktreport vom 03.02.2012
COSI (Collateral Secured Instruments)

Kapitalschutzprodukte
Produkttyp nach SVSP: 1140
Pfundbesicherte Derivate

Capital Protection with Coupon on Swiss Blue Chips

100.00% Capital Protection - 0.50% Minimum Coupon Rate - 4.50% Maximum Bonus Coupon Rate

Verfall 26.02.2015; emittiert in CHF; kotiert an SIX Swiss Exchange

Dieses Produkt ist nach den Bestimmungen des "Rahmenvertrages für Pfandbesicherte Zertifikate" der SIX Swiss Exchange AG besichert.

Annahmen in diesem Dokument basieren auf Angaben und Modellen die wir für zuverlässig und korrekt halten. Gleichwohl macht EFG Financial Products AG weder Zusicherungen noch Gewährleistungen zur Vollständigkeit und Korrektheit der Annahmen, die in diesem Dokument gemacht werden.

Produktdetails

Emissionsdaten

Liberierung	12.03.2010
Erster Börsenhandelstag	12.03.2010
Ausgabepreis	100.00%
Emissionsvolumen	CHF 10'000'000 (mit Aufstockungsmöglichkeit)

Generelle Information

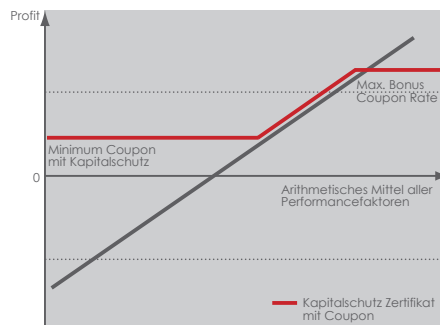
Valorennummer	10991479
ISIN	CH0109914793
SIX Symbol	CPUCH
Rückzahlungsdatum	05.03.2015 (vorbehältlich Anpassung bei Abwicklungsstörungen)
Denomination	CHF 1'000
Auszahlungswährung	CHF
Kapitalschutz	100.00%
Minimum Coupon Rate	0.50%
Maximum Bonus Coupon Rate	4.50%
Kotierung	SIX Swiss Exchange; gehandelt an Scoach Schweiz AG
Quotierungsart	Die Kotierung wird beantragt. Sekundärmarktpreise werden dirty quotiert. Die Marchzinsen (Stückzinsen) sind im Preis enthalten.
Quotierungstyp	Sekundärmarktpreise werden in Prozent quotiert.

Markterwartung

Leicht steigende Basiswerte.
Ein starker Kursverfall des Basiswertes ist möglich.

Produktbeschreibung

Dieses Produkt bietet dem Anleger am Rückzahlungsdatum eine Barauszahlung entsprechend der Denomination multipliziert mit dem Kapitalschutz. Zudem erhält der Anleger am/an den Couponzahlungstag/en eine Couponzahlung entsprechend der Denomination multipliziert mit dem Grösseren zwischen der Bonus Coupon Rate und der Minimum Coupon Rate. Die Bonus Coupon Rate wird basierend auf der Wertentwicklung jedes Basiswertes berechnet und ist auf die Maximum Coupon Rate limitiert, wie unter "Rückzahlung" beschrieben.



Basiswerte

Basiswert(e)	Referenzbörse	Bloomberg Ticker	Anfangslevel (100%)*
ABB LTD-REG	SIX Swiss Exchange	ABBN VX	CHF 21.73
ACTELION LTD-REG	SIX Swiss Exchange	ATLN VX	CHF 54.75
ADECCO SA-REG	SIX Swiss Exchange	ADEN VX	CHF 53.40
CIE FINANCIERE RICHEMON-BR A	SIX Swiss Exchange	CFR VX	CHF 36.22
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	SIX Swiss Exchange	CSGN VX	CHF 47.70
HOLCIM LTD-REG	SIX Swiss Exchange	HOLN VX	CHF 71.05
JULIUS BAER GROUP LTD	SIX Swiss Exchange	BAER VX	CHF 33.42
LONZA GROUP AG-REG	SIX Swiss Exchange	LONN VX	CHF 84.60
NESTLE SA-REG	SIX Swiss Exchange	NESN VX	CHF 53.45
NOVARTIS AG-REG	SIX Swiss Exchange	NOVN VX	CHF 59.75
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	SIX Swiss Exchange	ROG VX	CHF 179.40
SGS SA-REG	SIX Swiss Exchange	SGSN VX	CHF 1404.74
SWATCH GROUP AG/THE-BR	SIX Swiss Exchange	UHR VX	CHF 298.70
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	SIX Swiss Exchange	SLHN VX	CHF 135.40
SWISS RE AG	SIX Swiss Exchange	SREN VX	CHF 48.28
SWISSCOM AG-REG	SIX Swiss Exchange	SCMN VX	CHF 369.10
SYNGENTA AG-REG	SIX Swiss Exchange	SYNN VX	CHF 278.00

* Levels sind in Prozent des Anfangslevels ausgedrückt

Zeichnungsschluss 26.02.2015	Erster Börsenhandelstag 12.03.2010	Couponzahlung 04.03.2010	Couponzahlung 05.03.2012	Couponzahlung 05.03.2013	Couponzahlung 05.03.2014	Couponzahlung 05.03.2015
Verfall 26.02.2015						

Basiswert(e)

SYNTHES INC-144A/REGS
 UBS AG-REG
 ZURICH FINANCIAL SERVICES AG

Referenzbörse

SIX Swiss Exchange
 SIX Swiss Exchange
 SIX Swiss Exchange

Bloomberg Ticker

SYST VX
 UBSN VX
 ZURN VX

Anfangslevel (100%)*

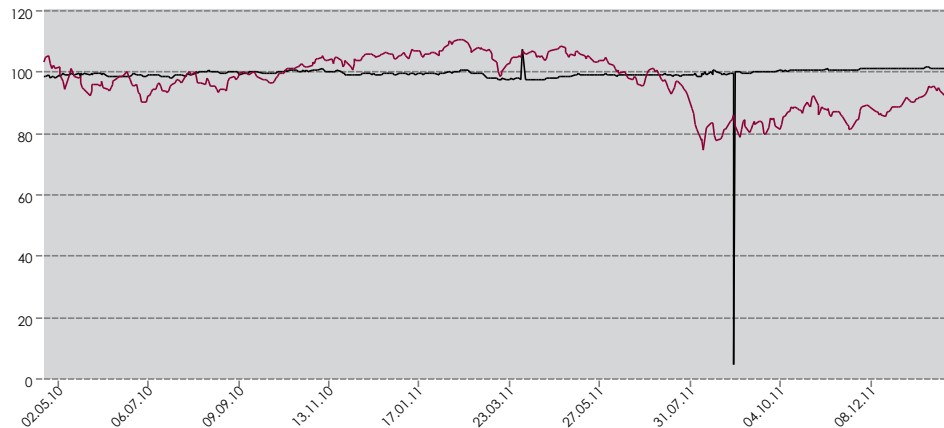
CHF 128.10
 CHF 14.81
 CHF 259.00

Wertentwicklung

Strukturiertes Produkt	Letzter Preis	Diese Woche	Dieser Monat	Dieses Jahr	Seit Ausgabe
	101.44%	0.09%	0.03%	0.29%	1.44%
ABB LTD-REG	CHF 20.12	3.55%	4.68%	13.80%	-7.41%
ACTELION LTD-REG	CHF 36.37	2.02%	3.18%	12.78%	-33.57%
ADECCO SA-REG	CHF 48.43	10.04%	11.00%	23.07%	-9.31%
CIE FINANCIERE RICHEMON-BR A	CHF 55.55	5.61%	6.62%	16.92%	53.37%
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	CHF 25.71	5.11%	7.66%	16.49%	-46.10%
HOLCIM LTD-REG	CHF 56.10	0.99%	6.96%	11.64%	-21.04%
JULIUS BAER GROUP LTD	CHF 37.85	-1.56%	1.20%	3.02%	13.26%
LONZA GROUP AG-REG	CHF 50.10	-3.38%	0.83%	-9.73%	-40.78%
NESTLE SA-REG	CHF 53.15	0.09%	0.76%	-1.57%	-0.56%
NOVARTIS AG-REG	CHF 51.35	3.11%	3.11%	-4.38%	-14.06%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	CHF 156.90	-0.13%	0.71%	-1.44%	-12.54%
SGS SA-REG	CHF 1'699.00	3.53%	2.85%	9.26%	20.95%
SWATCH GROUP AG/THE-BR	CHF 417.70	5.88%	7.71%	18.83%	39.84%
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	CHF 96.25	2.72%	5.31%	11.40%	-28.91%
SWISS RE AG	CHF 52.60	2.14%	5.35%	9.88%	8.95%
SWISSCOM AG-REG	CHF 371.90	2.42%	2.37%	4.50%	0.76%
SYNGENTA AG-REG	CHF 290.00	1.79%	4.17%	5.45%	4.32%
SYNTHES INC-144A/REGS	CHF 157.60	0.83%	0.51%	0.06%	23.03%
UBS AG-REG	CHF 13.45	4.51%	7.34%	20.30%	-9.18%
ZURICH FINANCIAL SERVICES AG	CHF 227.60	1.29%	2.99%	7.11%	-12.12%

Wertentwicklung im Zeitablauf

— Strukturiertes Produkt
 — Basket Performance



Sensitivität

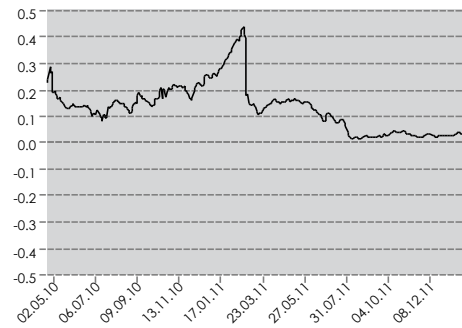
Strukturiertes Produkt

Strukturiertes Produkt	Delta
ABB LTD-REG	0.00
ACTELION LTD-REG	0.00
ADECCO SA-REG	0.00
CIE FINANCIERE RICHEMON-BR A	0.00
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	0.01
HOLCIM LTD-REG	0.00
JULIUS BAER GROUP LTD	0.00
LONZA GROUP AG-REG	0.01
NESTLE SA-REG	0.00
NOVARTIS AG-REG	0.00
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	0.00
SGS SA-REG	0.00
SWATCH GROUP AG/THE-BR	0.00
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	0.00
SWISS RE AG	0.00
SWISSCOM AG-REG	0.00
SYNGENTA AG-REG	0.00
SYNTHES INC-144A/REGS	0.00
UBS AG-REG	0.00
ZURICH FINANCIAL SERVICES AG	0.00

Delta ist die Sensitivität des Preises eines Derivates bezüglich der Preisveränderung des zugrundeliegenden Basiswertes. Wenn das Delta für einen Basiswert 0.1 ist, bedeutet dies bei einer Preisveränderung des Basiswertes von 1%, dass sich der Preis des Strukturierten Produktes um 0.1% verändert.

Delta
0.04

— Strukturiertes Produkt



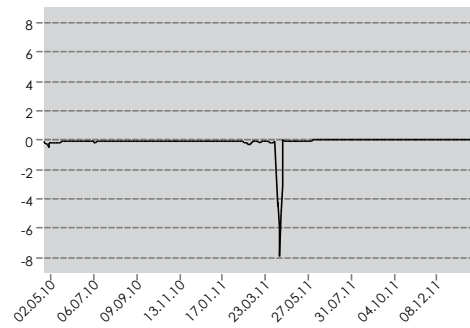
Strukturiertes Produkt

Strukturiertes Produkt	Vega
ABB LTD-REG	0.00
ACTELION LTD-REG	0.00
ADECCO SA-REG	0.00
CIE FINANCIERE RICHEMON-BR A	0.00
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	0.01
HOLCIM LTD-REG	0.00
JULIUS BAER GROUP LTD	0.00
LONZA GROUP AG-REG	0.01
NESTLE SA-REG	0.00
NOVARTIS AG-REG	0.00
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	0.00
SGS SA-REG	0.00
SWATCH GROUP AG/THE-BR	0.00
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	0.00
SWISS RE AG	0.00
SWISSCOM AG-REG	0.00
SYNGENTA AG-REG	0.00
SYNTHES INC-144A/REGS	0.00
UBS AG-REG	0.00
ZURICH FINANCIAL SERVICES AG	0.00

Vega ist die Sensitivität des Preises eines Derivates bezüglich der impliziten Volatilität eines Basiswertes. Wenn das Vega eines Basiswertes 0.1 ist, bedeutet dies bei einer Bewegung von 1% der impliziten Volatilität des Basiswertes, dass sich der Preis des Strukturierten Produktes um 0.1% verändert.

Vega
0.02

— Strukturiertes Produkt

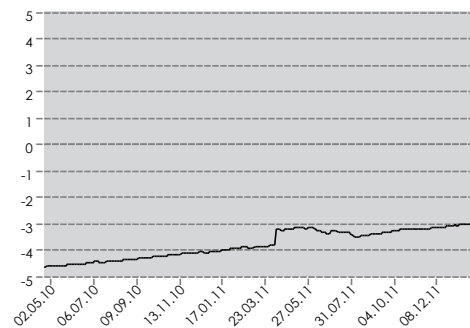


Strukturiertes Produkt

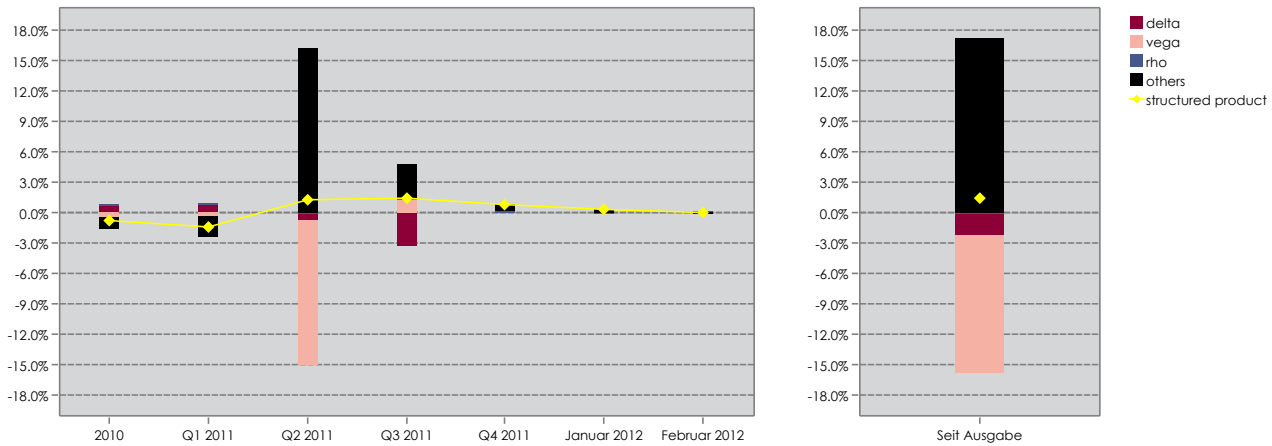
Rho ist die Sensitivität des Preises eines Derivates bezüglich des fristenkongruenten Zinssatzes. Wenn das Rho 0.1 ist, bedeutet dies bei einer Bewegung von 1% im Zinssatz, dass sich der Preis des Strukturierten Produktes um 0.1% verändert.

Rho
-2.94

— Strukturiertes Produkt



Attribution der Wertentwicklung



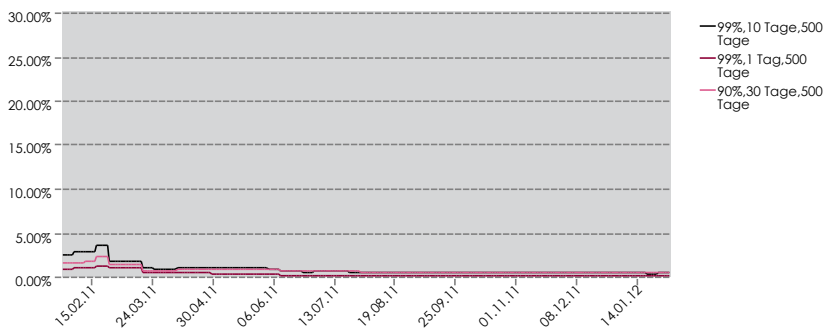
VaR im Zeitablauf

Der Value at Risk (VaR) ist der maximale Verlust über eine bestimmte Zeitperiode, welcher mit einer gegebenen Wahrscheinlichkeit (Konfidenzlevel) nicht überschritten wird. Die VaR-Berechnung beruht auf historischen Daten, wird prozentual ausgegeben und bezieht sich auf den aktuellen Preis des Produktes. Die Berechnungstelle hat diese VaR Klassifikation basierend auf 99%, 10 Tage festgelegt. Sie kann von der SSPA Klassifikation abweichen.

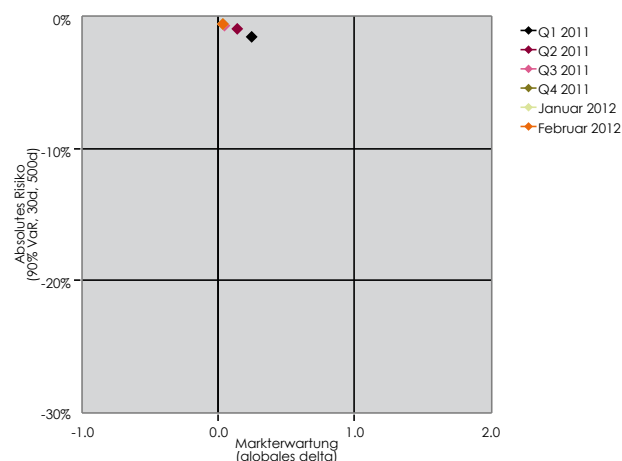
Risiko Klasse*	1	2	3	4	5	6
VaR Intervall (in %)	$0 < VaR \leq 5$	$5 < VaR \leq 15$	$15 < VaR \leq 30$	$30 < VaR \leq 39$	$39 < VaR \leq 50$	$50 < VaR \leq 100$
Risiko	Tief	Moderat	Mittel	Erhöht	Hoch	Sehr Hoch

*Quelle der Kategorien: SVSP
Herkunft der Berechnungen: EFGFP

Konfidenzniveau	Zeitspanne	Länge der Preishistorie	VaR (Maximaler Verlust in %)
90.00%	30 Tag(e)	500 Tag(e)	%
99.00%	1 Tag(e)	500 Tag(e)	%
99.00%	10 Tag(e)	500 Tag(e)	%



Risiko - Markterwartung



Strukturierte Produkte als derivative Kapitalmarktprodukte verändern ihre Risiko-Rendite-Eigenschaften im Zeitablauf mit den sich verändernden Marktbedingungen. Unsere dynamische Einteilung bezüglich Risiko und Rendite soll helfen, diese Veränderungen darzustellen. Als Risikomass dient der Value at Risk des strukturierten Produktes mit einem Konfidenzniveau von 90% über 30 Tage und einer Historie von 500 Tagen. Die implizite Markterwartung des strukturierten Produktes wird mit Hilfe des Gesamtdeltas zum Ausdruck gebracht.

Produktdokumentation

Einzig das Final Termsheet in englischer Sprache, zusammen mit dem Programm, welches alle weiteren Bedingungen enthält (das "Programm"), gelten als Dokumentation des Produkts ("Product Documentation"); entsprechend sollte das Final Termsheet immer zusammen mit dem Programm gelesen werden. Begriffe, welche im Final Termsheet verwendet, dort aber nicht definiert werden, haben die Bedeutung, welche ihnen gemäss des Programmes zukommt.

Für jegliche Informationen zu Risiken im Zusammenhang mit diesem Produkt beziehen Sie sich bitte auf das Termsheet zusammen mit dem "Programm".

Anleger werden in der Art und Weise rechtsgültig informiert, wie dies in den Bedingungen des Programmes vorgesehen ist. Zudem werden sämtliche Änderungen, die die Bedingungen dieses Produkts betreffen im entsprechenden Termsheet auf der Homepage der Emittentin www.efgfp.com in der Rubrik „Produkte“, oder für kotierte Produkte in irgend einer anderen Form, die gemäss den Bestimmungen und Regularien der SIX Swiss Exchange AG zulässig ist, veröffentlicht. Mitteilungen an Anleger, welche die Emittentin und/oder die Garantin und/oder die Zahlungsverpflichtete betreffen, werden in der Rubrik „Über uns“ auf der Website der Emittentin (www.efgfp.com) veröffentlicht.

Während der gesamten Laufzeit des Produkts kann die Product Documentation kostenlos vom Lead Manager an der Brandschenkestrasse 90, Postfach 1686, CH-8027 Zürich (Schweiz), oder via Telefon (+41-(0)58-800 1000), Fax (+41-(0)58-800 1010) oder Email (termsheet@efgfp.com) bestellt werden.

