

**Annonce du produit en date du 03.02.2012**  
COSI (Collateral Secured Instruments)

Protection du capital  
Gamme de produits de ASPS: 1140  
Produits Dérivés Nantis

## Capital Protection with Coupon on Swiss Blue Chips

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

Date de constatation finale 26.02.2015; émis en CHF; coté à SIX Swiss Exchange

**Ce produit est garanti selon les dispositions du «contrat-cadre pour les certificats garantis par nantissement» de la SIX Swiss Exchange SA («contrat-cadre»).**

Les hypothèses mentionnées ici sont fondées sur des données et des modèles que nous considérons fiables et corrects. Cependant EFG Financial Products SA ne fait nullement valoir ni ne garantit l'exactitude et/ou l'exhaustivité de ces hypothèses.

### Détails du produit

#### Données de l'émission

Date d'émission	12.03.2010
Premier jour de négociation à la bourse	12.03.2010
Prix d'émission	100.00%
Taille d'émission	CHF 10'000'000 (peut être augmentée à tout moment)

#### Informations Générales

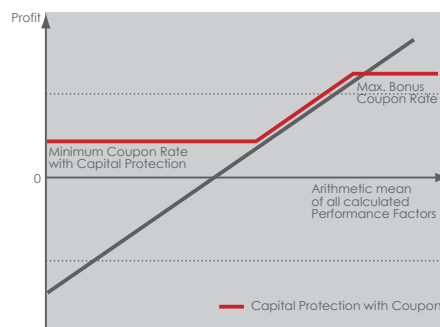
Numéro de valeur	10991479
ISIN	CH0109914793
Symbole SIX	CPUCH
Date de remboursement	05.03.2015 (sous réserve des dispositions en cas de perturbations de paiement)
Dénomination / Valeur nominale	CHF 1'000
Devise de paiement	CHF
Protection du capital	100.00%
Coupon Minimum	0.50%
Bonus Coupon Maximum	4.50%
Cotation/Bourse	SIX Swiss Exchange; négocié à Scoach Schweiz AG
Type de cotation	La cotation sera demandée. Les prix du marché secondaire sont cotés «dirty»; le montant couru du coupon est inclus dans les prix.
Type de cotation	Les prix du marché secondaire sont cotés en pourcentage.

#### Anticipation de l'investisseur

Hausse légère du Sous-jacent.  
D'important repli du cours du Sous-jacent est possible.

#### Description du Produit

Ce Produit offre à l'Investisseur, à la Date de remboursement, un Paiement en espèces égal à la Dénomination multipliée par la Protection du capital. De plus, l'Investisseur recevra à chaque Date de paiement de coupon un Paiement en espèces égal à la Dénomination multipliée par la plus grande valeur entre le Taux Bonus Coupon et le Coupon Minimum. Le Taux Bonus Coupon sera calculé en se basant sur la performance de chaque Sous-jacent et est limité au Bonus Coupon Maximum, comme décrit dans la rubrique "Remboursement".



### Sous-jacents

Sous-jacent	Bourse de référence	Ticker Bloomberg	Fixation initiale (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

\* les niveaux sont exprimés en pourcentage de la Fixation initiale

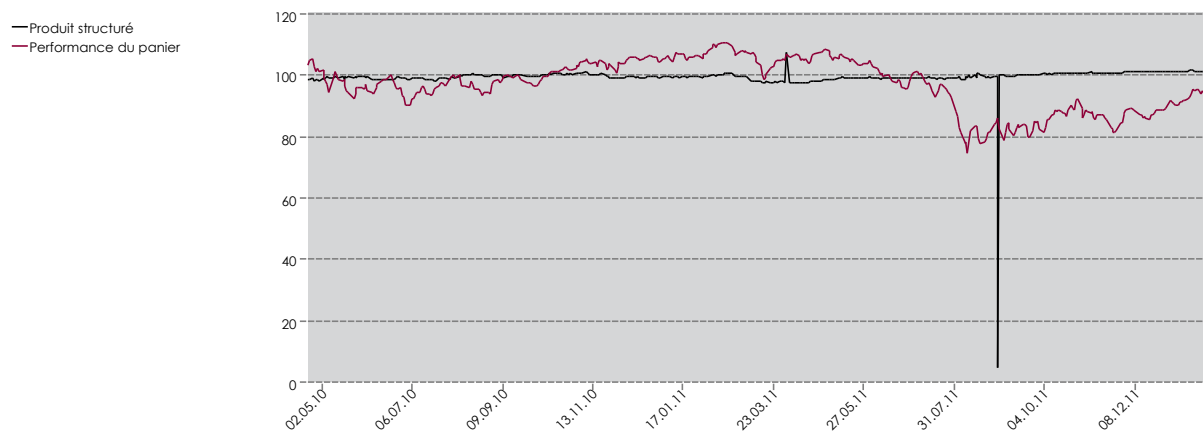
Fin de la souscription 26.02.2010	Premier jour de négociation à la bourse 12.03.2010	Montant du coupon 04.03.2011	Montant du coupon 05.03.2012	Montant du coupon 05.03.2013	Montant du coupon 05.03.2014	Montant du coupon 05.03.2015
Date de constatation finale 26.02.2015						

Sous-jacent	Bourse de référence	Ticker Bloomberg	Fixation initiale (100%)*
SWISSCOM AG-REG	SIX Swiss Exchange	SCMN VX	CHF 369.10
SYNGENTA AG-REG	SIX Swiss Exchange	SYNN VX	CHF 278.00
SYNTHES INC-144A/REGS	SIX Swiss Exchange	SYST VX	CHF 128.10
UBS AG-REG	SIX Swiss Exchange	UBSN VX	CHF 14.81
ZURICH FINANCIAL SERVICES AG	SIX Swiss Exchange	ZURN VX	CHF 259.00

## Performance

	Dernier prix	Depuis le début de la semaine	Depuis le début du mois	Depuis le début de l'année	Depuis l'origine
<b>Produit structuré</b>	<b>101.44%</b>	<b>0.09%</b>	<b>0.03%</b>	<b>0.29%</b>	<b>1.44%</b>
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%

## Performance au cours du temps



## Sensibilité

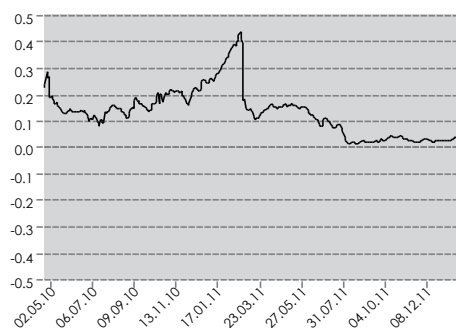
### Produit structuré

Produit structuré	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

Le Delta mesure la sensibilité du prix de l'option par rapport à la variation d'un actif sous-jacent auquel elle est associée. Si le Delta du Sous-jacent est égal à 0.1, cela signifie que 1% de variation du prix du Sous-jacent induit une variation de 0.1% du prix de l'option.

### Delta

—Produit structuré



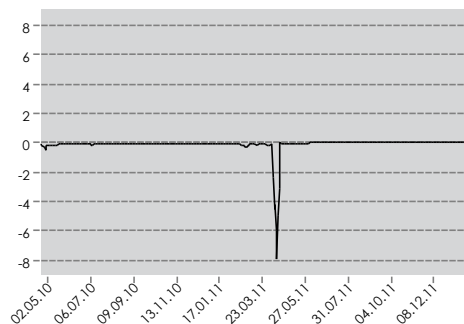
### Produit structuré

Produit structuré	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

Le Vega mesure la sensibilité du prix de l'option par rapport à la volatilité implicite d'un actif sous-jacent auquel elle est associée. Si le Vega du Sous-jacent est égal à 0.1, cela signifie que 1% de variation de la volatilité implicite du Sous-jacent induit une variation de 0.1% du prix de l'option.

### Vega

—Produit structuré



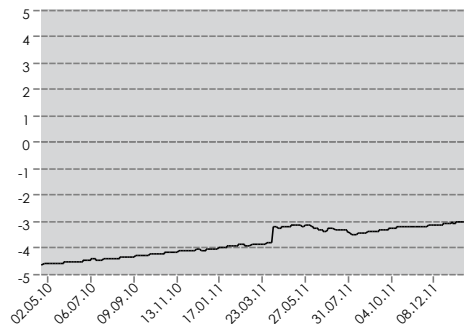
### Produit structuré

Le Rhô mesure la sensibilité du prix de l'option par rapport au taux d'intérêt et à la maturité. Si le Rhô est égal à 0.1, cela signifie que 1% de variation du taux d'intérêt induit une variation de 0.1% du prix de l'option.

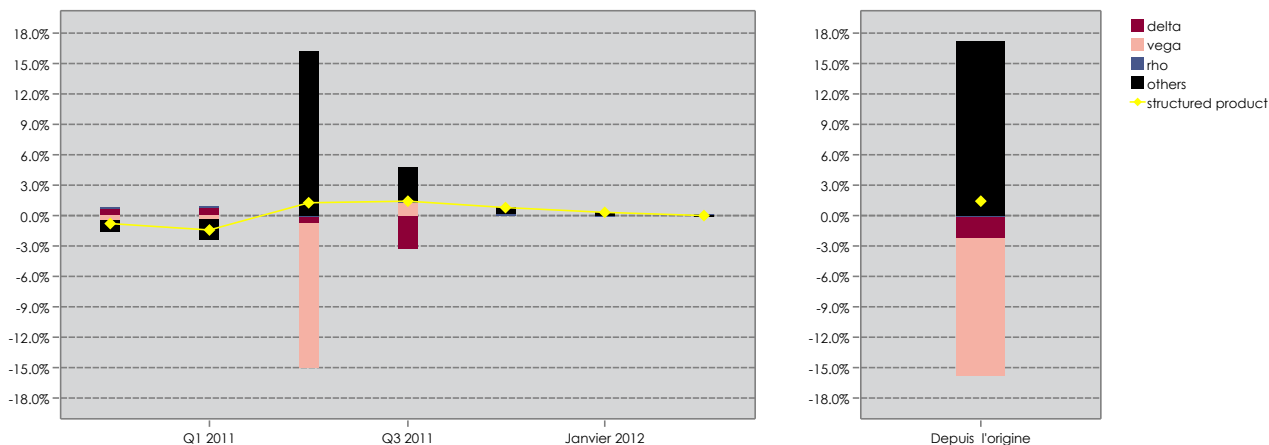
### Rho

-2.94

—Produit structuré



## Répartition de la performance



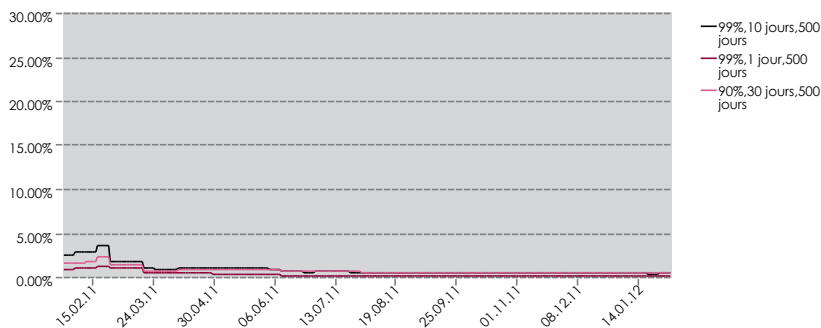
## VaR au cours du temps

La Valeur à Risque (VaR) est la perte maximale espérée sur un certain horizon et avec un certain niveau de confiance prédéfini. La VaR est calculée à partir des données historiques et est exprimée en pourcentage de la valeur du produit. L'agent de Calcul a déterminé cette classification de VaR selon les critères 99%, 10 jours. Elle peut être différente de la classification de l'ASPS.

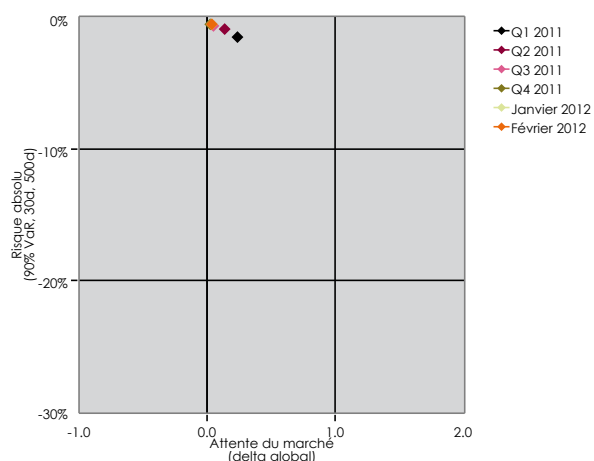
Catégorie de risque*	1	2	3	4	5	6
Intervalle VaR (%)	0 < VaR ≤ 5	5 < VaR ≤ 15	15 < VaR ≤ 30	30 < VaR ≤ 39	39 < VaR ≤ 50	50 < VaR ≤ 100
Risque	Faible	Modéré	Moyen	Accru	Elevé	Très élevé

\*Source Catégories: SVSP  
Source Calculs: EFGFP

Niveau de confiance	délai	Historique du prix	VaR (Perte max. en %)
90.00%	30 jour(s)	500 jour(s)	%
99.00%	1 jour(s)	500 jour(s)	%
99.00%	10 jour(s)	500 jour(s)	%



## Risque - Attente du marché



En tant qu'instruments dérivés de marchés de capitaux, les produits structurés changent leurs profils risque-rendement pendant leur durée de vie en fonction des conditions de marché changeantes. Notre classification dynamique du risque et du rendement doit vous aider à illustrer ces changements. La Valeur à Risque (VaR) du produit structuré sert de mesure du risque avec un Niveau de confiance de 90% sur 30 jours et un historique de 500 jours. L'attente implicite du marché sera signifiée à travers le delta global.

## Documentation du produit

---

Seule la Final Termsheet en anglais, accompagné du Programme contenant tous les termes et conditions dans sa dernière version (le "Programme") forment la documentation complète relative au produit (la "documentation du produit"). Ainsi, la Final Termsheet doit toujours être lu avec le Programme. Les termes utilisés dans la Final Termsheet, mais qui n'y sont pas définis, ont le sens que leur donne le Programme.

Veuillez vous référer à la Termsheet liée au Programme pour tout risque associé à ce produit.

Les informations concernant le produit sont valablement données aux investisseurs, conformément aux termes et conditions du Programme. De plus, tout changement concernant les termes et conditions du produit sera publié sur la Termsheet appropriée sur le site web de l'Émetteur [www.efgfp.com](http://www.efgfp.com) dans la section « Produits » ou, pour les produits listés, sous toute autre forme autorisée par les règles et régulations de la SIX Swiss Exchange SA. Les avis aux investisseurs concernant l'Émetteur et/ou le Garant et/ou le Garant additionnel seront publiés dans la section « Présentation » sur le site web de l'Émetteur [www.efgfp.com](http://www.efgfp.com).

Pendant toute la durée du produit, la documentation relative peut être commandée gratuitement auprès du Chef de file, Brandschenkestrasse 90, P.O. Box 1686, CH-8027 Zurich (Suisse), via téléphone (+41-(0)58-800 1000), fax (+41-(0)58-800 1010) ou via e-mail ([termsheet@efgfp.com](mailto:termsheet@efgfp.com)).

