

Report dei prodotti a partire dal 03.02.2012  
COSI (Collateral Secured Instruments)

Prodotti a Capitale Garantito  
Tipo di prodotto SSPA: 1140  
Derivati Garantiti

## Capital Protection with Coupon on Swiss Blue Chips

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

Scadenza 26.02.2015; emissione in CHF; quotato alla borsa SIX Swiss Exchange

**Il Prodotto è salvaguardato ai sensi delle disposizioni del «Contratto quadro per Strumenti con Garanzia Collaterale» del SIX Swiss Exchange AG.**

*I presupposti di questo documento sono basati su dati e modelli considerati affidabili e precisi. Ciononostante EFG Financial Products AG non garantisce né si fa carico di alcuna rimostranza riguardo alla completezza o correttezza di tali assunzioni.*

### Dettagli del prodotto

#### Dati Emissione

Data di Emissione	12.03.2010
Primo Giorno di Contrattazione in Borsa	12.03.2010
Prezzo di Emissione	100.00%
Importo di Emissione	CHF 10'000'000 (continua possibilità d'aumento)

#### Informazioni generali

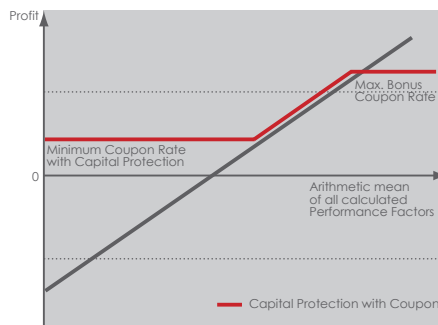
Numero di valore	10991479
ISIN	CH0109914793
Simbolo SIX	CPUCH
Data di Rimborso	05.03.2015 (soggetta a modifiche in caso di irregolarità nel settlement)
Denominazione	CHF 1'000
Moneta di Rimborso	CHF
Protezione del Capitale	100.00%
Cedola Minima	0.50%
Cedola Bonus Massima	4.50%
Quotazione	SIX Swiss Exchange; negoziato alla borsa Scoach Schweiz AG Viene richiesta la quotazione.
Tipologia di quotazione	I prezzi dei mercati secondari sono quotati come «dirty»; l'Importo della Cedola Maturata è incluso nei prezzi.
Metodologia di quotazione	I prezzi dei mercati secondari sono quotati in percentuale.

#### Aspettativa di mercato

Moderato aumento di prezzo del valore Sottostante.  
Possibile forte contrazione dei corsi del valore Sottostante.

#### Descrizione del prodotto

Questo Prodotto offre all'Investitore in Data di Rimborso un Pagamento in contanti equivalente alla Denominazione moltiplicata per la Protezione del Capitale. Inoltre, l'Investitore riceverà ad ogni Data di Pagamento della Cedola un Pagamento in contanti uguale alla Denominazione moltiplicata per la maggiore fra la Cedola Bonus e la Cedola Minima. La Cedola Bonus sarà calcolata sulla base del rendimento di ogni Sottostante e si limiterà alla Cedola Bonus Massima, come descritto nello Scenario di Rimborso qui più.



### Sottostanti

Sottostante/i	Borsa di Riferimento	Bloomberg Ticker	Fixing Iniziale (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

\* i livelli sono espressi in percentuale del Fixing iniziale

Termine di sottoscrizione	Primo Giorno di Contrattazione in Borsa	Importo della Cedola 04.03.2011	Importo della Cedola 05.03.2012	Importo della Cedola 05.03.2013	Importo della Cedola 05.03.2014	Importo della Cedola 05.03.2015
26.02.2010	12.03.2010					
Scadenza						
26.02.2015						

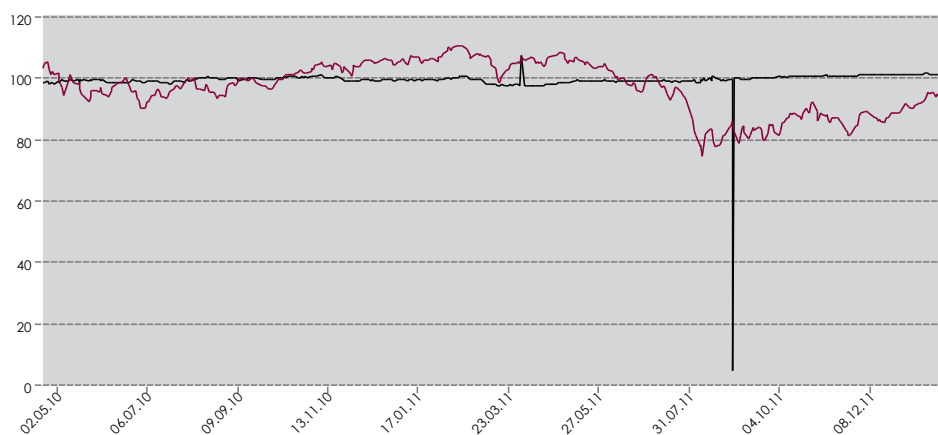
Sottostante/i	Borsa di Riferimento	Bloomberg Ticker	Fixing Iniziale (100%)*
SYNGENTA AG-REG	SIX Swiss Exchange	SYNN VX	CHF 278.00
SYNTHES INC-144A/REGS	SIX Swiss Exchange	SYST VX	CHF 128.10
UBS AG-REG	SIX Swiss Exchange	UBSN VX	CHF 14.81
ZURICH FINANCIAL SERVICES AG	SIX Swiss Exchange	ZURN VX	CHF 259.00

## Performance

	Ultimo prezzo	Questa settimana	Questa Mese	Quest'anno	Dall'inizio
<b>Prodotto Strutturato</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 nel tempo

— Prodotto Strutturato  
— Performance del Paniere



## Sensitività

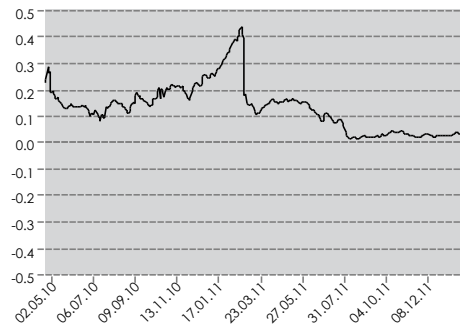
### Prodotto Strutturato

**Delta**  
**0.04**

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
SYNTHE INC-144A/REGS	0.00
UBS AG-REG	0.00
ZURICH FINANCIAL SERVICES AG	0.00

Delta è il coefficiente che indica la sensibilità del prezzo di uno strumento derivato rispetto alle variazioni del prezzo del Sottostante. Uno Delta di 0.1 significa che una variazione del prezzo del Sottostante del 1% implica una variazione del prezzo del Prodotto Strutturato del 0.1%.

— Prodotto Strutturato



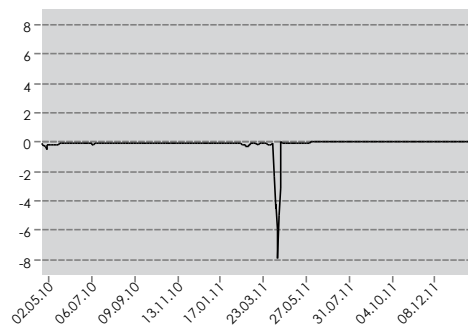
### Prodotto Strutturato

**Vega**  
**0.02**

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
SYNTHE INC-144A/REGS	0.00
UBS AG-REG	0.00
ZURICH FINANCIAL SERVICES AG	0.00

Vega è il coefficiente che indica la sensibilità del prezzo di uno strumento derivato rispetto alle variazioni della volatilità implicita del Sottostante. Uno Vega del Sottostante di 0.1 significa che una variazione del prezzo del Sottostante del 1% implica una variazione del prezzo del Prodotto Strutturato del 0.1%.

— Prodotto Strutturato

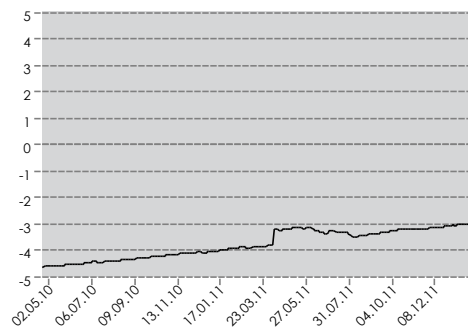


### Prodotto Strutturato

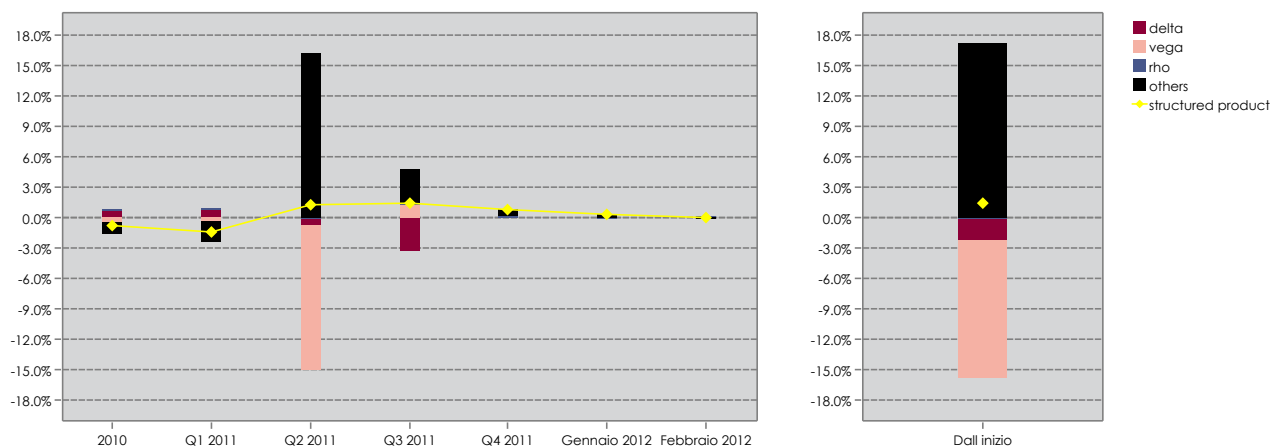
**Rho**  
**-2.94**

Rhò è il coefficiente che indica la sensibilità del prezzo di uno strumento derivato rispetto al tasso d'interesse privo di rischio. Uno Rhò di 0.1 significa che una variazione del tasso d'interesse privo di rischio del 1% implica una variazione del prezzo del Prodotto Strutturato del 0.1%.

— Prodotto Strutturato



## Performance attribution



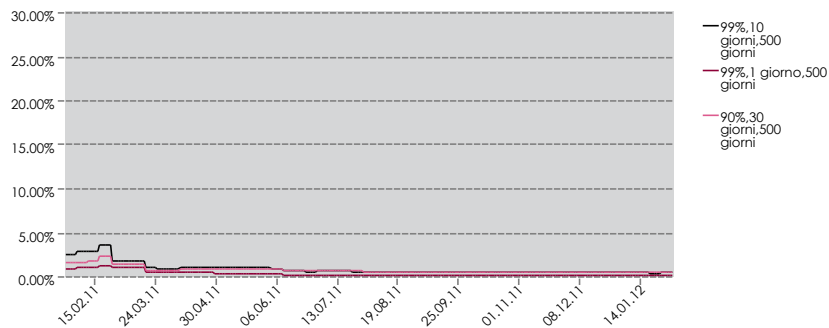
## Value at Risk - VaR

Il Value at Risk (VaR) viene definito come la massima perdita possibile in uno specifico orizzonte temporale e con un determinato livello di probabilità. Il VaR viene calcolato sulla base di dati storici ed è espresso in percentuale del valore del prodotto. Questa classificazione VaR (riferita a 99%, 10 giorni) è determinata dall'Agente di calcolo e può differire dalla classificazione dell'ASPS.

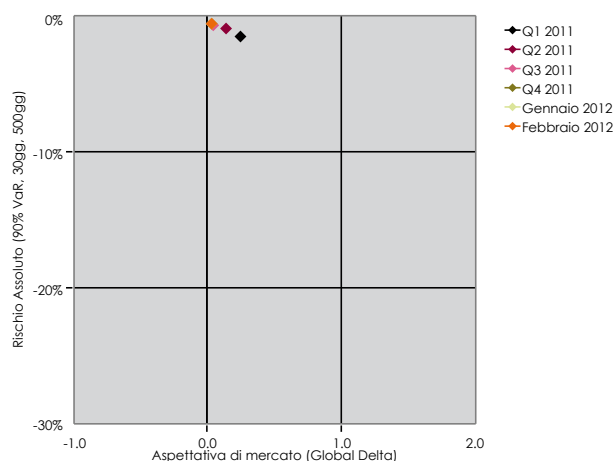
Categoria di rischio*	1	2	3	4	5	6
Intervallo VaR (%)	0 < VaR ≤ 5	5 < VaR ≤ 15	15 < VaR ≤ 30	30 < VaR ≤ 39	39 < VaR ≤ 50	50 < VaR ≤ 100
Rischio	Basso	Moderato	Medio	Medio-Alto	Alto	Molto Alto

\*Fonte Categorie: SVSP  
Fonte Calcoli: EFGFP

Livello di Confidenza	periodo di tempo	Prezzi Storici	VaR (Perdita massima in %)
90.00%	30 giorno(i)	500 giorno(i)	%
99.00%	1 giorno(i)	500 giorno(i)	%
99.00%	10 giorno(i)	500 giorno(i)	%



## Rischio – Aspettativa di Mercato



In quanto strumenti derivati sul mercato dei capitali, i Prodotti Strutturati durante il loro ciclo di vita cambiano le proprie caratteristiche di rischio-rendimento, in relazione alle differenti condizioni di mercato. La nostra classificazione dinamica basata su rischio e rendimento dovrebbe aiutare ad illustrare questi cambiamenti. Il VaR (Value at Risk) del Prodotto Strutturato serve come misura di rischio con un livello di confidenza del 90% su 30 giorni e una durata di 500 giorni. L'implicita aspettativa di mercato del Prodotto Strutturato sarà indicata con l'aiuto del Global Delta.

## Documentazione del prodotto

---

Il Final Termsheet in lingua inglese e il programma, che comprende tutte le ulteriori condizioni (il "Programme"), costituiscono le uniche fonti di documentazione del prodotto ("Product Documentation"); se ne raccomanda quindi sempre la lettura accurata. I termini utilizzati nel Final Termsheet, ma ivi non definiti, assumono significato in funzione del contenuto del programma.

Si prega di fare riferimento alla Termsheet per qualsiasi chiarimento riferito ai rischi connessi a questo prodotto.

Gli Investitori verranno debitamente informati circa le condizioni espresse dal programma in tale materia. Inoltre, qualsiasi cambiamento concernente le condizioni di tale prodotto verrà reso noto nella relativa Termsheet al sito dell'emittente [www.efgfp.com](http://www.efgfp.com) nella sezione "Products" o, per i prodotti quotati, secondo le regole del SIX Swiss Exchange AG. Gli Investitori troveranno informazioni sull'Emittente e/o il Garante e/o il Garante addizionale nella sezione "About us" del sito dell'emittente [www.efgfp.com](http://www.efgfp.com).

Per tutta la durata del prodotto, è possibile ordinare gratuitamente la documentazione ad esso relativa dal Lead Manager al seguente indirizzo: Brandschenkestrasse 90, casella postale, 1686, CH-8027 Zurigo (Svizzera), oppure via telefono (+41-(0)58-800 1000), fax (+41-(0)58-800 1010) oppure via e-mail ([termsheet@efgfp.com](mailto:termsheet@efgfp.com)).

