

Produktreport vom 03.02.2012
COSI (Collateral Secured Instruments)

Kapitalschutzprodukte
Produkttyp nach SVSP: 1140
Pfundbesicherte Derivate

Capital Protection with Coupon on European Blue Chips

100.00% Capital Protection - 1.25% Minimum Coupon Rate - 6.25% Maximum Bonus Coupon Rate

Verfall 26.02.2015; emittiert in EUR; 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	EUR 10'000'000 (mit Aufstockungsmöglichkeit)

Generelle Information

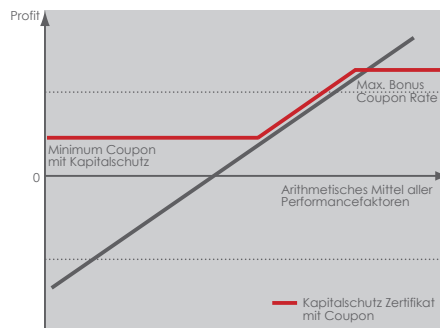
Valorennummer	10991480
ISIN	CH0109914801
SIX Symbol	CPUEU
Rückzahlungsdatum	05.03.2015 (vorbehältlich Anpassung bei Abwicklungsstörungen)
Denomination	EUR 1'000
Auszahlungswährung	EUR
Kapitalschutz	100.00%
Minimum Coupon Rate	1.25%
Maximum Bonus Coupon Rate	6.25%
Kotierung	SIX Swiss Exchange; gehandelt 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%)*
CARREFOUR SA	Euronext Paris	CA FP	EUR 29.427
DANONE	Euronext Paris	BN FP	EUR 42.95
DEUTSCHE BOERSE AG	Xetra	DB1 GY	EUR 51.08
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	Xetra	DTE GY	EUR 9.45
E.ON AG	Xetra	EOAN GY	EUR 26.155
ENEL SPA	Milan Stock Exchange	ENEL IM	EUR 3.9825
FRANCE TELECOM SA	Euronext Paris	FTE FP	EUR 17.225
GDF SUEZ	Euronext Paris	GSZ FP	EUR 26.97
IBERDROLA SA	Madrid Stock Exchange	IBE SQ	EUR 5.91
L'OREAL	Euronext Paris	OR FP	EUR 76.02
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	Xetra	MUV2 GY	EUR 113.65
NOKIA OYJ	OMX Helsinki	NOK1V FH	EUR 9.895
REPSOL YPF SA	Madrid Stock Exchange	REP SQ	EUR 16.64
RWE AG	Xetra	RWE GY	EUR 62.07
SANOFI	Euronext Paris	SAN FP	EUR 53.72
TELECOM ITALIA SPA	Milan Stock Exchange	TIT IM	EUR 1.046
TELEFONICA SA	Madrid Stock Exchange	TEF SQ	EUR 17.25

* Levels sind in Prozent des Anfangslevels ausgedrückt

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

Basiswert(e)

TOTAL SA
UNILEVER NV-CVA
VIVENDI

Referenzbörse

Euronext Paris
Euronext Amsterdam
Euronext Paris

Bloomberg Ticker

FP FP
UNA NA
VIV FP

Anfangslevel (100%)*

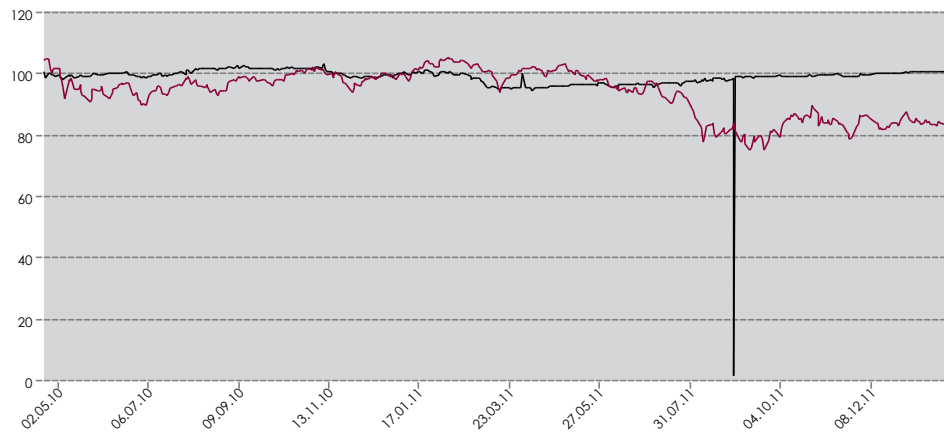
EUR 40.98
EUR 22.10
EUR 18.50

Wertentwicklung

Strukturiertes Produkt	Letzter Preis	Diese Woche	Dieser Monat	Dieses Jahr	Seit Ausgabe
	100.97%	0.22%	-0.02%	0.63%	0.97%
CARREFOUR SA	EUR 18.385	0.68%	5.36%	4.37%	-37.52%
DANONE	EUR 48.63	3.60%	3.05%	0.11%	13.21%
DEUTSCHE BOERSE AG	EUR 47.20	3.06%	5.33%	9.46%	-7.60%
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	EUR 8.83	0.72%	2.68%	-0.42%	-6.58%
E.ON AG	EUR 17.105	4.39%	4.65%	2.61%	-34.60%
ENEL SPA	EUR 3.08	-1.09%	-1.47%	-2.04%	-22.66%
FRANCE TELECOM SA	EUR 11.535	1.05%	0.61%	-4.94%	-33.03%
GDF SUEZ	EUR 21.56	3.85%	3.90%	2.08%	-20.06%
IBERDROLA SA	EUR 4.67	2.66%	3.78%	-3.45%	-21.00%
L'OREAL	EUR 82.06	1.16%	0.92%	1.69%	7.95%
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	EUR 106.45	5.55%	6.88%	12.31%	-6.34%
NOKIA OYJ	EUR 3.88	-1.02%	1.62%	2.86%	-60.79%
REPSOL YPF SA	EUR 21.15	-3.23%	0.69%	-10.91%	27.11%
RWE AG	EUR 31.59	9.63%	8.02%	16.34%	-49.12%
SANOFI	EUR 55.95	0.21%	-0.92%	-1.41%	4.15%
TELECOM ITALIA SPA	EUR 0.773	-1.40%	-0.58%	-6.98%	-26.10%
TELEFONICA SA	EUR 13.47	1.16%	1.05%	0.64%	-21.89%
TOTAL SA	EUR 41.00	2.28%	1.47%	3.80%	0.05%
UNILEVER NV-CVA	EUR 25.26	-0.47%	-0.77%	-4.95%	14.28%
VIVENDI	EUR 16.20	2.53%	1.25%	-4.26%	-12.43%

Wertentwicklung im Zeitablauf

— Strukturiertes Produkt
— Basket Performance



Sensitivität

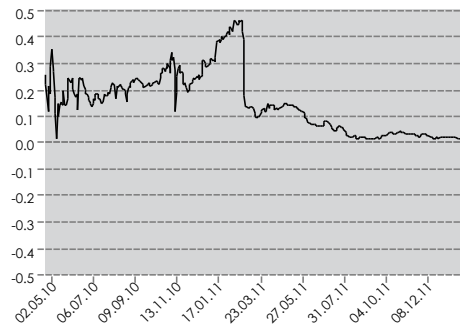
Strukturiertes Produkt

Strukturiertes Produkt	Delta
CARREFOUR SA	0.00
DANONE	0.00
DEUTSCHE BOERSE AG	0.00
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	0.00
E.ON AG	0.00
ENEL SPA	0.00
FRANCE TELECOM SA	0.00
GDF SUEZ	0.00
IBERDROLA SA	0.00
L'OREAL	0.00
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	0.00
NOKIA OYJ	0.00
REPSOL YPF SA	0.00
RWE AG	0.00
SANOFI	0.00
TELECOM ITALIA SPA	0.00
TELEFONICA SA	0.00
TOTAL SA	0.00
UNILEVER NV-CVA	0.00
VIVENDI	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
0.02

— Strukturiertes Produkt



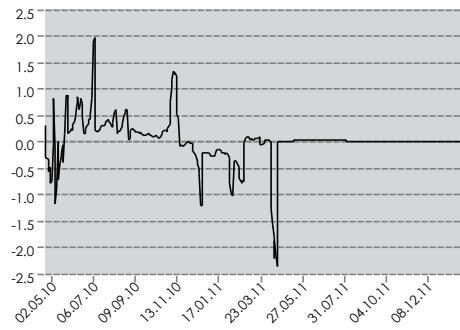
Strukturiertes Produkt

Strukturiertes Produkt	Vega
CARREFOUR SA	0.00
DANONE	0.00
DEUTSCHE BOERSE AG	0.00
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	0.00
E.ON AG	0.00
ENEL SPA	0.00
FRANCE TELECOM SA	0.01
GDF SUEZ	0.00
IBERDROLA SA	0.00
L'OREAL	0.00
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	0.00
NOKIA OYJ	0.00
REPSOL YPF SA	0.00
RWE AG	0.01
SANOFI	0.00
TELECOM ITALIA SPA	0.00
TELEFONICA SA	0.00
TOTAL SA	0.00
UNILEVER NV-CVA	0.00
VIVENDI	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

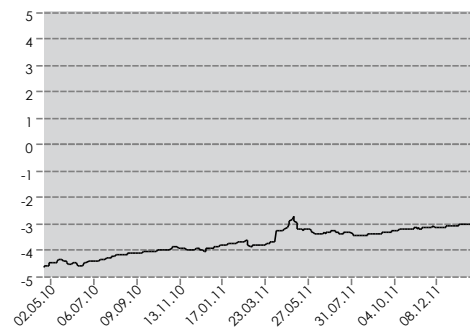


Strukturiertes Produkt

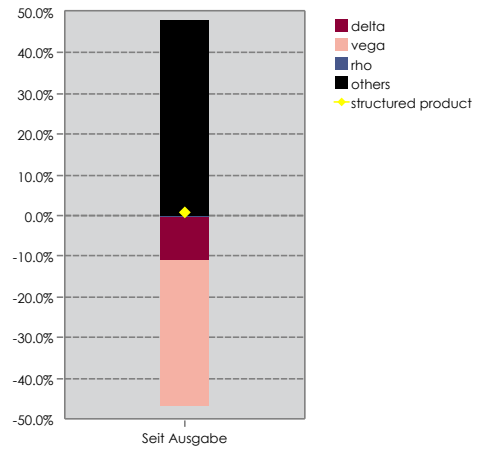
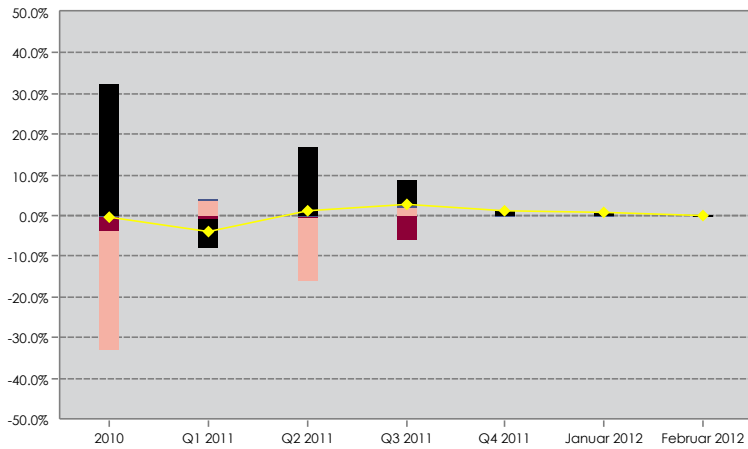
Rho ist die Sensitivität des Preises eines Derivates bezüglich des fristenkongruenten Zinssatzes. Wenn das Rho 0.1 ist, bedeutet dies bei einer Bewegung von 1% im Zinssatz, dass sich der Preis des Strukturierten Produktes um 0.1% verändert.

Rho
-2.98

— Strukturiertes Produkt



Attribution der Wertentwicklung



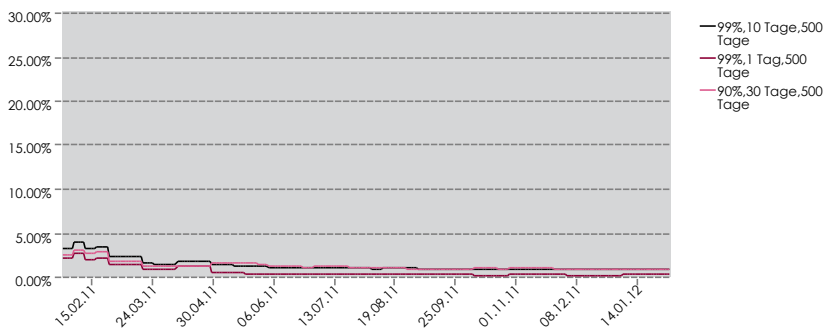
VaR im Zeitablauf

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.

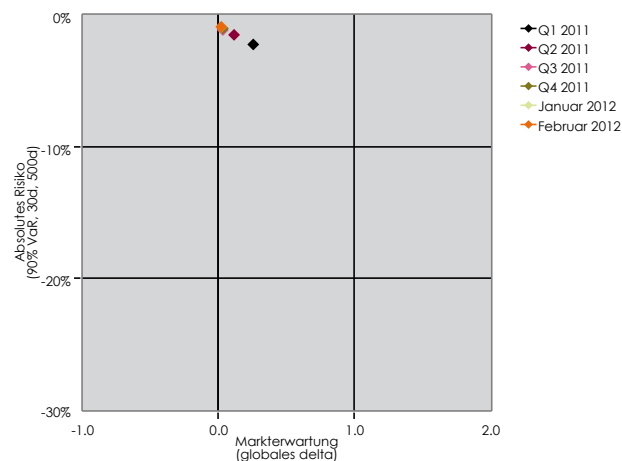
Risiko Klasse*	1	2	3	4	5	6
VaR Intervall (in % Risiko)	$0 < VaR \leq 5$	$5 < VaR \leq 15$	$15 < VaR \leq 30$	$30 < VaR \leq 39$	$39 < VaR \leq 50$	$50 < VaR \leq 100$
Risiko	Tief	Moderat	Mittel	Erhöht	Hoch	Sehr Hoch

*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)	1%
99.00%	1 Tag(e)	500 Tag(e)	%
99.00%	10 Tag(e)	500 Tag(e)	1%



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.

