

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 European Blue Chips

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

Date de constatation finale 26.02.2015; émis en EUR; 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	EUR 10'000'000 (peut être augmentée à tout moment)

Informations Générales

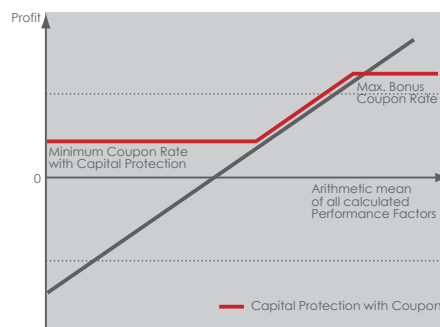
Numéro de valeur	10991480
ISIN	CH0109914801
Symbole SIX	CPUEU
Date de remboursement	05.03.2015 (sous réserve des dispositions en cas de perturbations de paiement)
Dénomination / Valeur nominale	EUR 1'000
Devise de paiement	EUR
Protection du capital	100.00%
Coupon Minimum	1.25%
Bonus Coupon Maximum	6.25%
Cotation/Bourse	SIX Swiss Exchange; négocié à Scoach Schweiz AG La cotation sera demandée.
Type de cotation	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%)*
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

* 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

TELECOM ITALIA SPA
 TELEFONICA SA
 TOTAL SA
 UNILEVER NV-CVA
 VIVENDI

Bourse de référence

Milan Stock Exchange
 Madrid Stock Exchange
 Euronext Paris
 Euronext Amsterdam
 Euronext Paris

Ticker Bloomberg

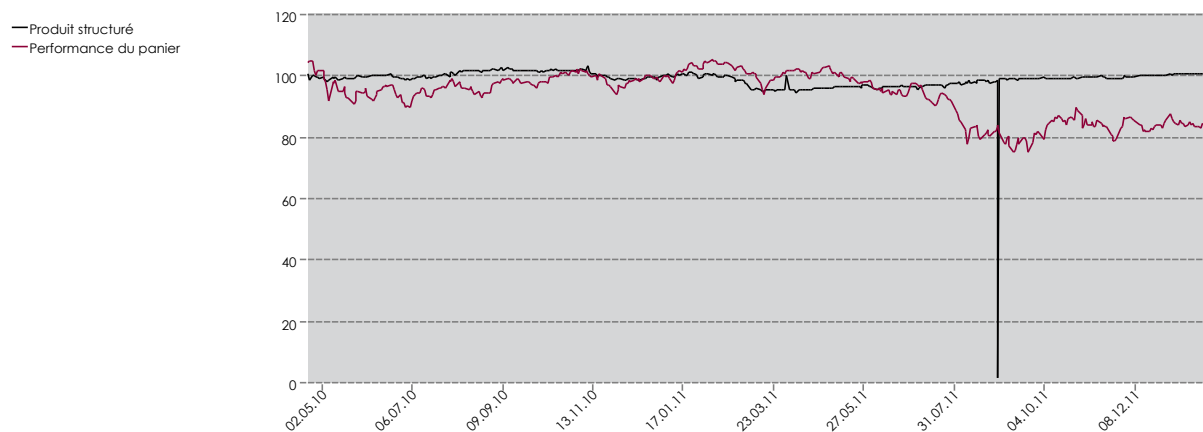
TIT IM
 TEF SQ
 FP FP
 UNA NA
 VIV FP

Fixation initiale (100%)*

EUR 1.046
 EUR 17.25
 EUR 40.98
 EUR 22.10
 EUR 18.50

Performance

	Dernier prix	Depuis le début de la semaine	Depuis le début du mois	Depuis le début de l'année	Depuis l'origine
Produit structuré	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%

Performance au cours du temps

Sensibilité

Produit structuré

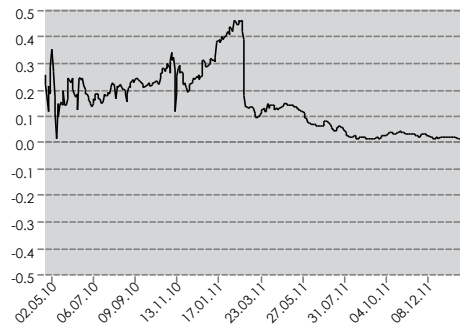
Produit structuré	Delta
CARREFOUR SA	0.00
DANONE	0.00
DEUTSCHE BOERSE AG	0.00
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	0.00
E.ON AG	0.00
ENEL SPA	0.00
FRANCE TELECOM SA	0.00
GDF SUEZ	0.00
IBERDROLA SA	0.00
L'OREAL	0.00
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	0.00
NOKIA OYJ	0.00
REPSOL YPF SA	0.00
RWE AG	0.00
SANOFI	0.00
TELECOM ITALIA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

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

0.02

—Produit structuré



Produit structuré

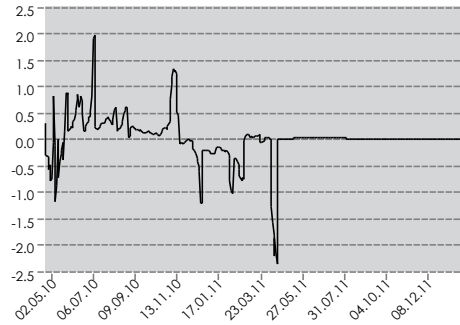
Produit structuré	Vega
CARREFOUR SA	0.00
DANONE	0.00
DEUTSCHE BOERSE AG	0.00
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	0.00
E.ON AG	0.00
ENEL SPA	0.00
FRANCE TELECOM SA	0.01
GDF SUEZ	0.00
IBERDROLA SA	0.00
L'OREAL	0.00
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	0.00
NOKIA OYJ	0.00
REPSOL YPF SA	0.00
RWE AG	0.01
SANOFI	0.00
TELECOM ITALIA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

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

0.02

—Produit structuré



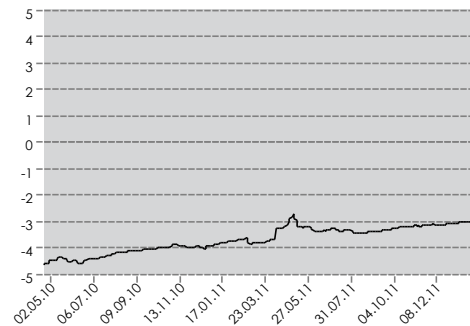
Produit structuré

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.

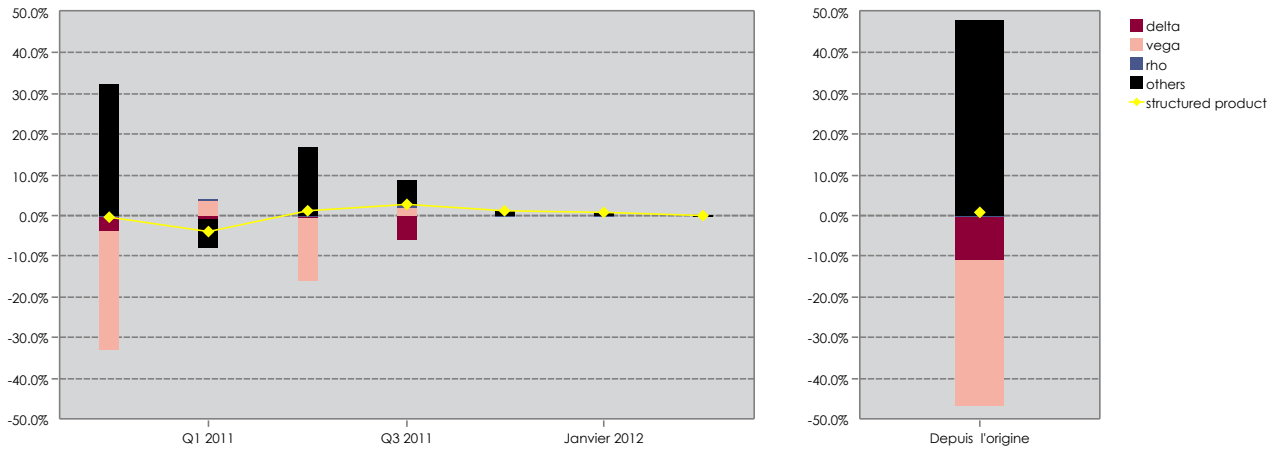
Rho

-2.98

—Produit structuré



Répartition de la performance



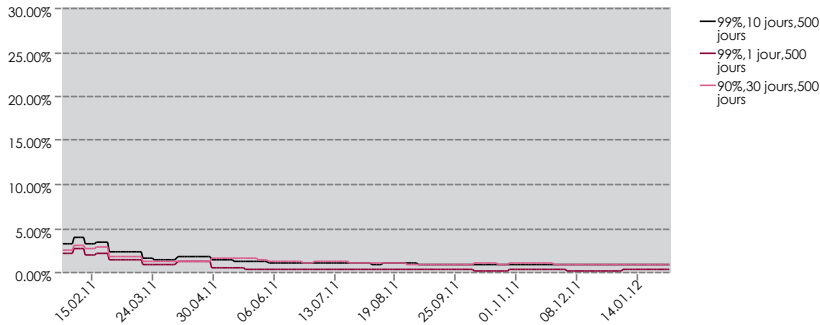
VaR au cours du temps

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.

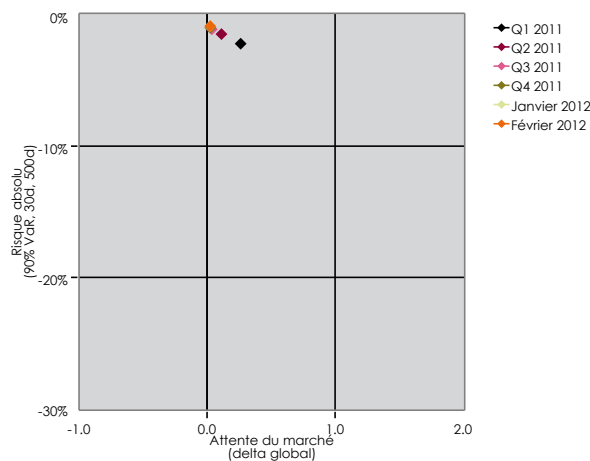
Catégorie de risque*	1	2	3	4	5	6
Intervalle VaR (%)	0 < VaR ≤ 5	5 < VaR ≤ 15	15 < VaR ≤ 30	30 < VaR ≤ 39	39 < VaR ≤ 50	50 < VaR ≤ 100
Risque	Faible	Modéré	Moyen	Accru	Elevé	Très élevé

*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)	1%
99.00%	1 jour(s)	500 jour(s)	%
99.00%	10 jour(s)	500 jour(s)	1%



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 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.

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).

