

**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 American Blue Chips

**100.00% Capital Protection - 1.00% Minimum Coupon Rate - 6.00% Maximum Bonus Coupon Rate**

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

#### Informations Générales

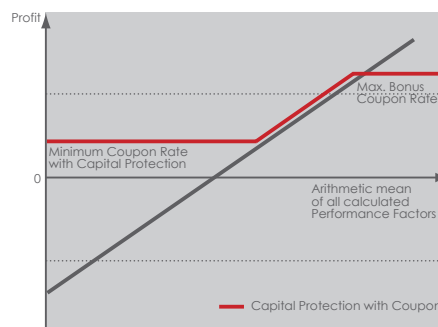
Numéro de valeur	10991481
ISIN	CH0109914819
Symbole SIX	CPUUS
Date de remboursement	05.03.2015 (sous réserve des dispositions en cas de perturbations de paiement)
Dénomination / Valeur nominale	USD 1'000
Devise de paiement	USD
Protection du capital	100.00%
Coupon Minimum	1.00%
Bonus Coupon Maximum	6.00%
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%)*
3M CO	NYSE	MMM UN	USD 80.15
AT T INC-REG	NYSE	T UN	USD 24.81
BOEING CO	NYSE	BA UN	USD 63.16
CATERPILLAR INC	NYSE	CAT UN	USD 57.05
CHEVRON CORP	NYSE	CVX UN	USD 72.30
COCA-COLA CO/THE	NYSE	KO UN	USD 52.72
DU PONT (E.I.) DE NEMOURS-REG	NYSE	DD UN	USD 33.72
EXXON MOBIL CORP-REG	NYSE	XOM UN	USD 65.00
GENERAL ELECTRIC CO-REG	NYSE	GE UN	USD 16.06
HOME DEPOT INC	NYSE	HD UN	USD 31.20
INTEL CORP-REG	Nasdaq	INTC UQ	USD 20.53
JOHNSON & JOHNSON-REG	NYSE	JNJ UN	USD 63.00
KRAFT FOODS INC-CLASS A-REG	NYSE	KFT UN	USD 28.43
MCDONALD'S CORP-REG	NYSE	MCD UN	USD 63.85
MERCK CO. INC.	NYSE	MRK UN	USD 36.88

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

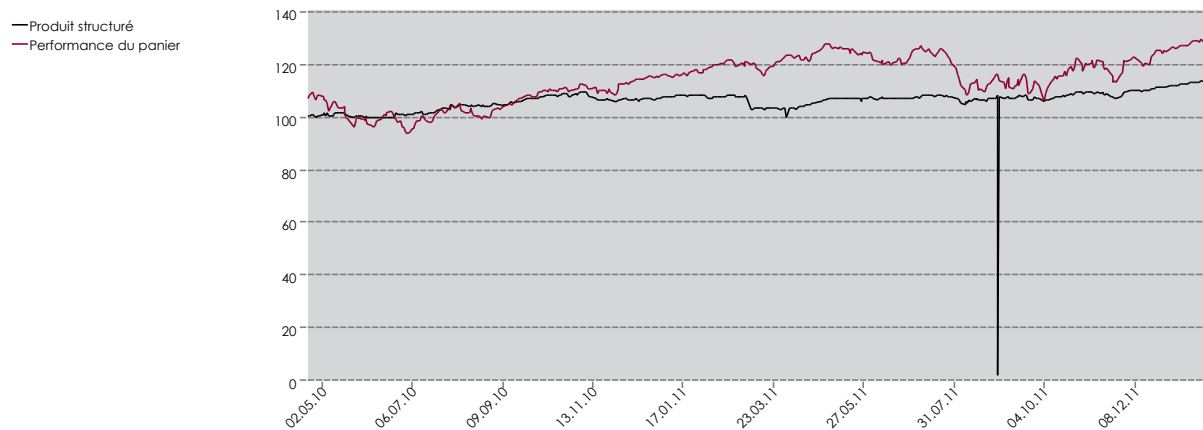
Fin de la souscription 26.02.2010	Premier jour de négociation à la bourse 12.03.2010	Montant du coupon 04.03.2011	Montant du coupon 05.03.2012	Montant du coupon 05.03.2013	Montant du coupon 05.03.2014	Montant du coupon 05.03.2015
Date de constatation finale 26.02.2015						

Sous-jacent	Bourse de référence	Ticker Bloomberg	Fixation initiale (100%)*
PFIZER INC-REG	NYSE	PFE UN	USD 17.55
PROCTER GAMBLE CO	NYSE	PG UN	USD 63.28
UNITED TECHNOLOGIES CORP	NYSE	UTX UN	USD 68.65
VERIZON COMMUNICATIONS INC-REG	NYSE	VZ UN	USD 27.03
WAL-MART STORES INC	NYSE	WMT UN	USD 54.07

## 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>113.76%</b>	<b>0.25%</b>	<b>0.14%</b>	<b>2.03%</b>	<b>13.76%</b>
3M CO	USD 87.81	0.13%	1.58%	7.46%	9.56%
AT T INC-REG	USD 29.95	2.71%	1.84%	-0.96%	20.72%
BOEING CO	USD 76.34	2.40%	2.91%	4.08%	20.87%
CATERPILLAR INC	USD 113.78	2.37%	4.32%	25.47%	99.44%
CHEVRON CORP	USD 105.50	1.48%	2.35%	-0.85%	45.92%
COCA-COLA CO/THE	USD 68.00	0.64%	0.80%	-2.97%	28.97%
DU PONT (E.I.) DE NEMOURS-REG	USD 52.01	2.54%	2.20%	13.61%	54.24%
EXXON MOBIL CORP-REG	USD 84.90	-1.18%	1.41%	0.13%	30.62%
GENERAL ELECTRIC CO-REG	USD 19.01	-0.21%	1.39%	5.79%	18.34%
HOME DEPOT INC	USD 45.17	0.67%	1.76%	7.45%	44.78%
INTEL CORP-REG	USD 26.74	-0.04%	1.21%	10.27%	30.25%
JOHNSON & JOHNSON-REG	USD 65.64	0.11%	-0.24%	0.01%	4.19%
KRAFT FOODS INC-CLASS A-REG	USD 38.94	1.20%	1.94%	4.19%	36.95%
MCDONALD'S CORP-REG	USD 100.01	1.34%	0.97%	-0.32%	56.63%
MERCK CO. INC.	USD 38.37	-0.39%	0.29%	1.78%	4.04%
PFIZER INC-REG	USD 21.18	-1.53%	-1.19%	-1.99%	20.68%
PROCTER GAMBLE CO	USD 62.77	-2.38%	-0.43%	-5.91%	-0.81%
UNITED TECHNOLOGIES CORP	USD 81.05	4.42%	3.45%	10.89%	18.06%
VERIZON COMMUNICATIONS INC-REG	USD 37.84	1.69%	0.48%	-5.68%	39.98%
WAL-MART STORES INC	USD 62.03	2.17%	1.09%	3.80%	14.72%

## Performance au cours du temps



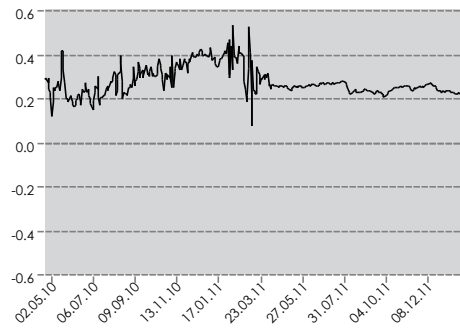
## Sensibilité

### Produit structuré

	Delta
<b>Produit structuré</b>	<b>0.22</b>
3M CO	0.01
AT T INC-REG	0.01
BOEING CO	0.01
CATERPILLAR INC	0.00
CHEVRON CORP	0.00
COCA-COLA CO/THE	0.00
DU PONT (E.I.) DE NEMOURS-REG	0.00
EXXON MOBIL CORP-REG	0.01
GENERAL ELECTRIC CO-REG	0.01
HOME DEPOT INC	0.00
INTEL CORP-REG	0.01
JOHNSON & JOHNSON-REG	0.02
KRAFT FOODS INC-CLASS A-REG	0.00
MCDONALD'S CORP-REG	0.00
MERCK CO. INC.	0.03
PFIZER INC-REG	0.01
PROCTER GAMBLE CO	0.05
UNITED TECHNOLOGIES CORP	0.01
VERIZON COMMUNICATIONS INC-REG	0.01
WAL-MART STORES INC	0.01

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.

—Produit structuré

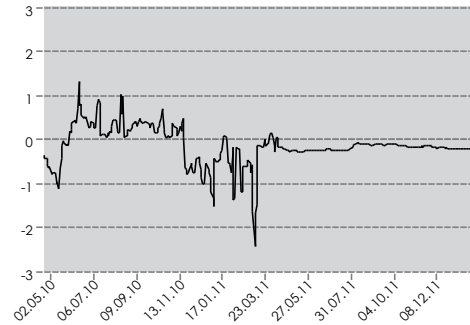


### Produit structuré

	Vega
<b>Produit structuré</b>	<b>-0.20</b>
3M CO	-0.01
AT T INC-REG	-0.02
BOEING CO	-0.01
CATERPILLAR INC	0.00
CHEVRON CORP	0.00
COCA-COLA CO/THE	0.00
DU PONT (E.I.) DE NEMOURS-REG	0.00
EXXON MOBIL CORP-REG	-0.01
GENERAL ELECTRIC CO-REG	-0.01
HOME DEPOT INC	0.00
INTEL CORP-REG	-0.01
JOHNSON & JOHNSON-REG	-0.01
KRAFT FOODS INC-CLASS A-REG	0.00
MCDONALD'S CORP-REG	0.00
MERCK CO. INC.	-0.02
PFIZER INC-REG	-0.01
PROCTER GAMBLE CO	-0.03
UNITED TECHNOLOGIES CORP	-0.01
VERIZON COMMUNICATIONS INC-REG	-0.01
WAL-MART STORES INC	-0.02

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.

—Produit structuré



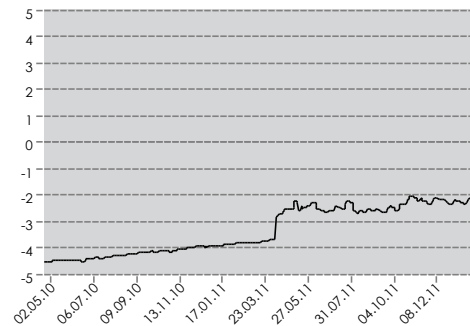
### Produit structuré

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.

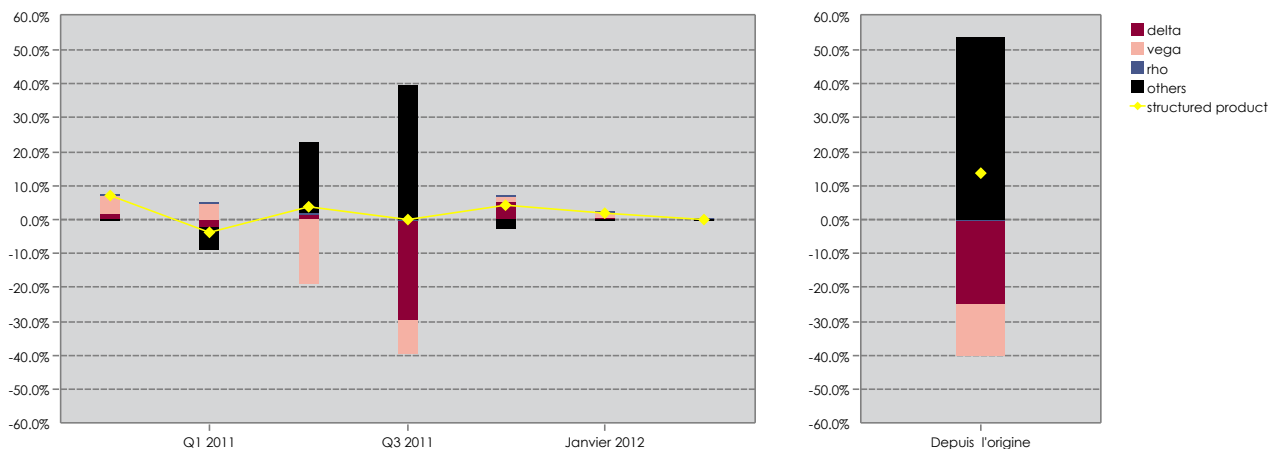
**Rho**

**-2.22**

—Produit structuré



## Répartition de la performance



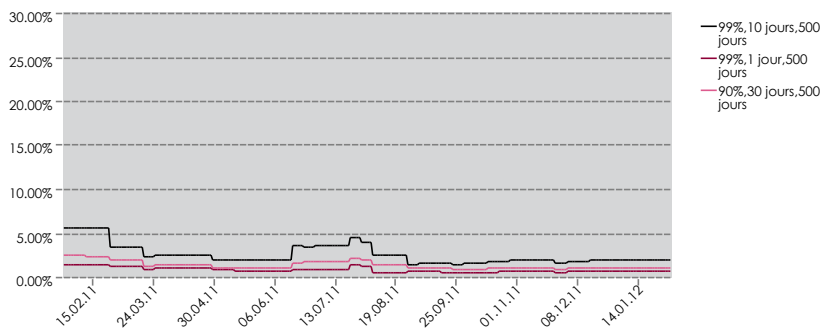
## VaR au cours du temps

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.

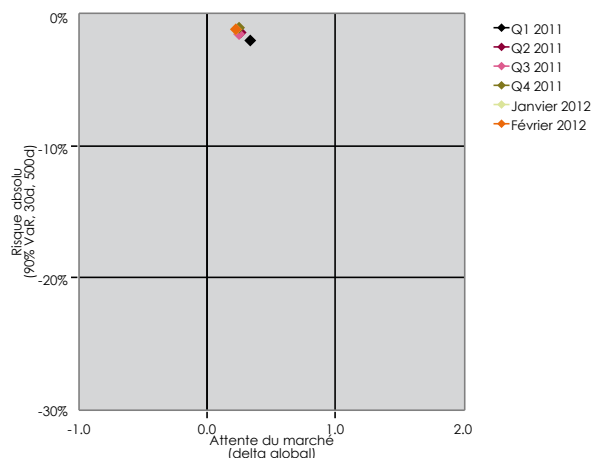
Catégorie de risque*	1	2	3	4	5	6
Intervalle VaR (%)	0 < VaR ≤ 5	5 < VaR ≤ 15	15 < VaR ≤ 30	30 < VaR ≤ 39	39 < VaR ≤ 50	50 < VaR ≤ 100
Risque	Faible	Modéré	Moyen	Accru	Elevé	Très élevé

\*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)	1%
99.00%	10 jour(s)	500 jour(s)	2%



## 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)).

