

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 Healthcare Blue Chips

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

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

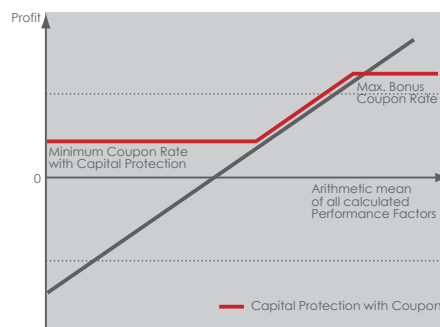
Numéro de valeur	10991482
ISIN	CH0109914827
Symbole SIX	CPUHC
Date de remboursement	05.03.2015 (sous réserve des dispositions en cas de perturbations de paiement)
Dénomination / Valeur nominale	EUR 1'000
Devise de paiement	EUR
Protection du capital	100.00%
Coupon Minimum	1.00%
Bonus Coupon Maximum	6.00%
Protection de la devise	Quanto EUR
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%)*
AMGEN INC	Nasdaq GM	AMGN UQ	USD 56.61
BAYER AG-REG	Xetra	BAYN GY	EUR 48.67
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & GLAXOSMITHKLINE PLC	Xetra	FME GY	EUR 38.35
JOHNSON & JOHNSON-REG	London Stock Exchange	GSK LN	GBP 1214.00
LONZA GROUP AG-REG	NYSE	JNJ UN	USD 63.00
MERCK CO. INC.	SIX Swiss Exchange	LONN VX	CHF 84.60
NOVARTIS AG-REG	NYSE	MRK UN	USD 36.88
PFIZER INC-REG	SIX Swiss Exchange	NOVN VX	CHF 59.75
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	NYSE	PFE UN	USD 17.55
SANOFI	SIX Swiss Exchange	ROG VX	CHF 179.40
SYNGENTA AG-REG	Euronext Paris	SAN FP	EUR 53.72
	SIX Swiss Exchange	SYNN VX	CHF 278.00

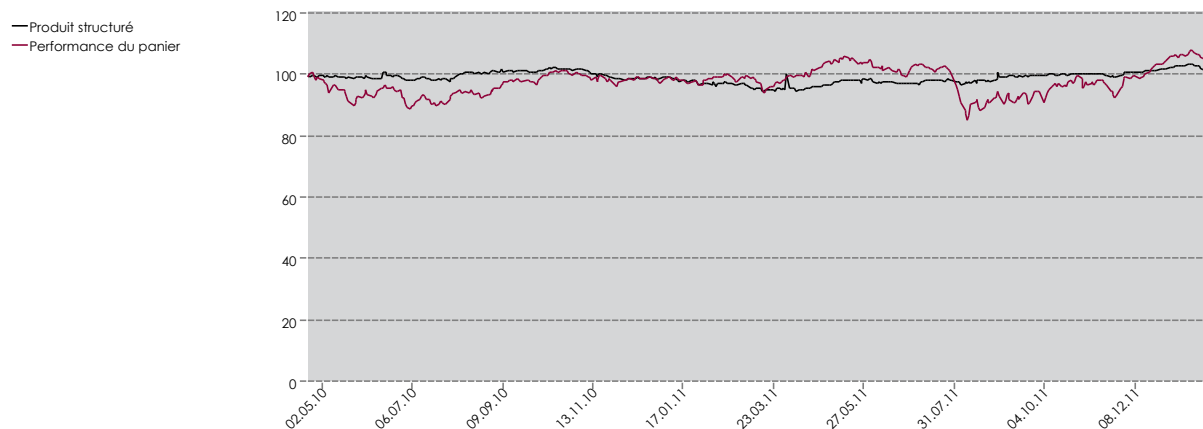
* les niveaux sont exprimés en pourcentage de la Fixation initiale

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						

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	101.52%	0.15%	0.09%	-0.28%	1.52%
AMGEN INC	USD 69.28	1.39%	2.02%	7.90%	22.38%
BAYER AG-REG	EUR 55.09	3.16%	2.90%	11.52%	13.19%
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	EUR 54.98	2.33%	0.79%	4.72%	43.36%
GLAXOSMITHKLINE PLC	GBP 1'416.25	-0.32%	0.46%	-3.74%	16.66%
JOHNSON & JOHNSON-REG	USD 65.64	0.11%	-0.24%	0.01%	4.19%
LONZA GROUP AG-REG	CHF 50.10	-3.38%	0.83%	-9.73%	-40.78%
MERCK CO. INC.	USD 38.37	-0.39%	0.29%	1.78%	4.04%
NOVARTIS AG-REG	CHF 51.35	3.11%	3.11%	-4.38%	-14.06%
PFIZER INC-REG	USD 21.18	-1.53%	-1.19%	-1.99%	20.68%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	CHF 156.90	-0.13%	0.71%	-1.44%	-12.54%
SANOFI	EUR 55.95	0.21%	-0.92%	-1.41%	4.15%
SYNGENTA AG-REG	CHF 290.00	1.79%	4.17%	5.45%	4.32%

Performance au cours du temps



Sensibilité

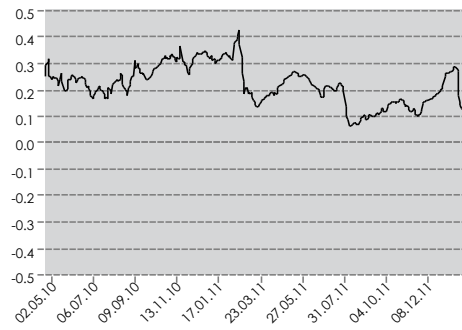
Produit structuré

Produit structuré	Delta
AMGEN INC	0.00
BAYER AG-REG	0.00
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	0.00
GLAXOSMITHKLINE PLC	0.00
JOHNSON & JOHNSON-REG	0.00
LONZA GROUP AG-REG	0.04
MERCK CO. INC.	0.00
NOVARTIS AG-REG	0.04
PFIZER INC-REG	0.00
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	0.03
SANOFI	0.00
SYNGENTA AG-REG	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.

Delta
0.14

—Produit structuré



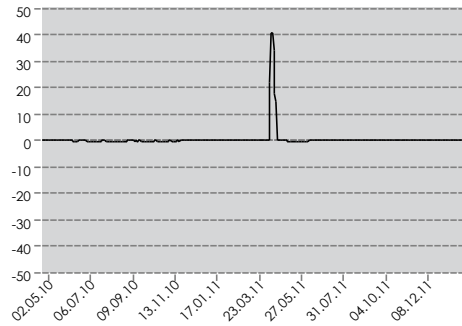
Produit structuré

Produit structuré	Vega
AMGEN INC	0.00
BAYER AG-REG	0.00
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	0.00
GLAXOSMITHKLINE PLC	0.00
JOHNSON & JOHNSON-REG	0.00
LONZA GROUP AG-REG	0.03
MERCK CO. INC.	0.00
NOVARTIS AG-REG	0.02
PFIZER INC-REG	0.00
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	0.01
SANOFI	0.00
SYNGENTA AG-REG	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
0.04

—Produit structuré

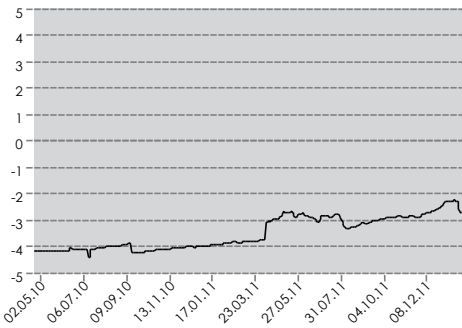


Produit structuré

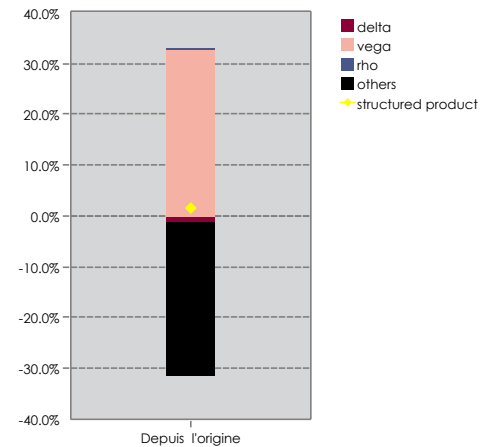
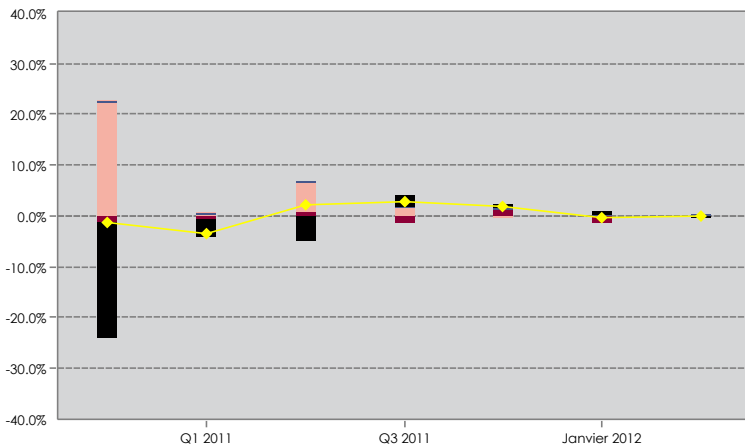
Le Rhô mesure la sensibilité du prix de l'option par rapport au taux d'intérêt et à la maturité. Si le Rhô est égal à 0.1, cela signifie que 1% de variation du taux d'intérêt induit une variation de 0.1% du prix de l'option.

Rho
-2.65

—Produit structuré



Répartition de la performance



■ delta
■ vega
■ rho
■ others
◆ structured product

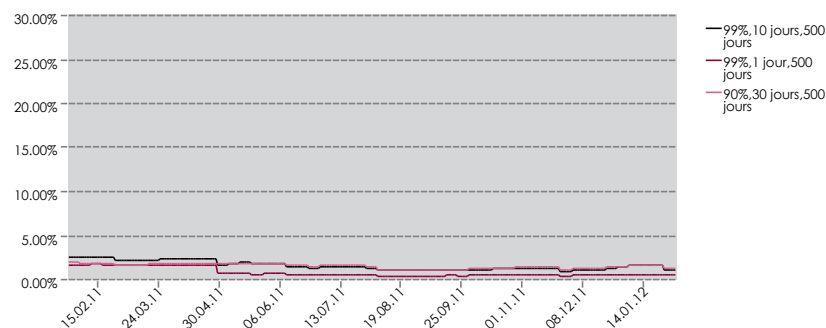
VaR au cours du temps

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.

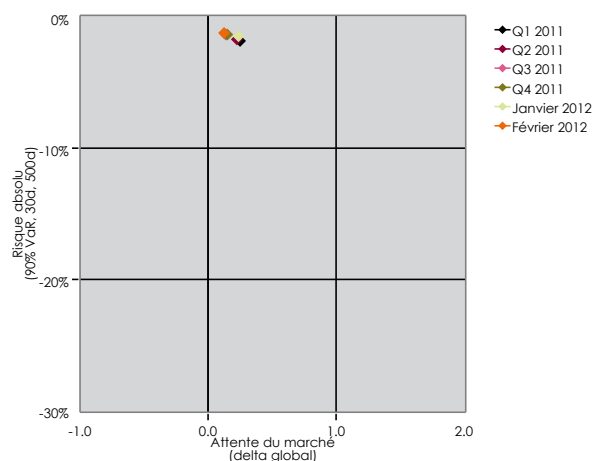
Catégorie de risque*	1	2	3	4	5	6
Intervalle VaR (%)	0 < VaR ≤ 5	5 < VaR ≤ 15	15 < VaR ≤ 30	30 < VaR ≤ 39	39 < VaR ≤ 50	50 < VaR ≤ 100
Risque	Faible	Modéré	Moyen	Accru	Elevé	Très élevé

*Source Catégories: SVSP
Source Calculs: EFGFP

Niveau de confiance	délagi	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).