

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 Healthcare Blue Chips

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

Scadenza 26.02.2015; emissione in EUR; 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	EUR 10'000'000 (continua possibilità d'aumento)

Informazioni generali

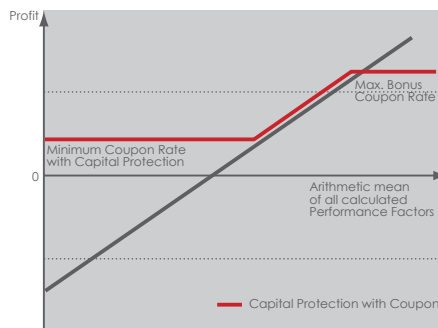
Numero di valore	10991482
ISIN	CH0109914827
Simbolo SIX	CPUHC
Data di Rimborso	05.03.2015 (soggetta a modifiche in caso di irregolarità nel settlement)
Denominazione	EUR 1'000
Moneta di Rimborso	EUR
Protezione del Capitale	100.00%
Cedola Minima	1.00%
Cedola Bonus Massima	6.00%
Protezione della Moneta	Quanto EUR
Quotazione	SIX Swiss Exchange; negoziato alla borsa Scaach 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%)*
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	NYSE	NOVN VX	CHF 59.75
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	SIX Swiss Exchange	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

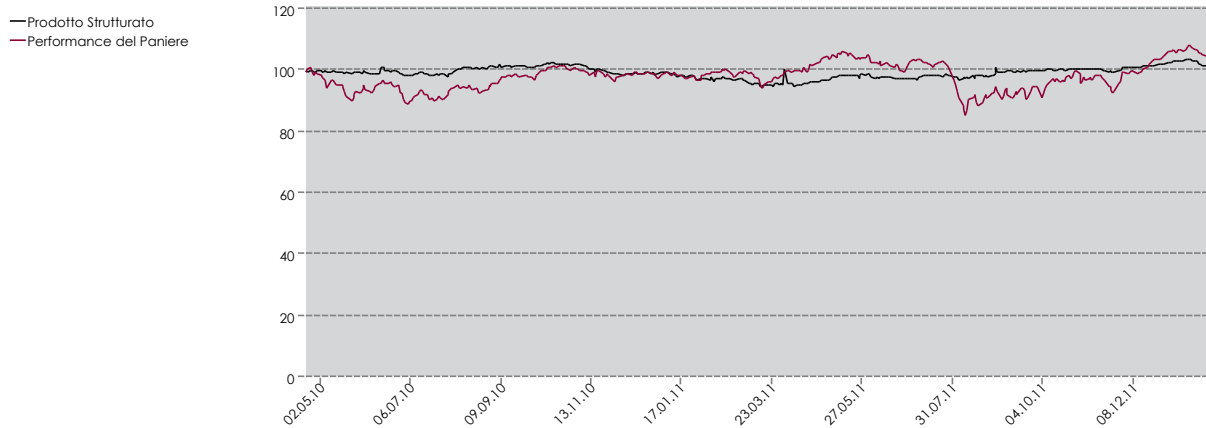
* i livelli sono espressi in percentuale del Fixing iniziale

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						

Performance

	Ultimo prezzo	Questa settimana	Questa Mese	Questianno	Dall inizio
Prodotto Strutturato	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	CHF 156.90	-0.13%	0.71%	-1.44%	-12.54%
AG-GENUSSCHEIN					
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 nel tempo



Sensitività

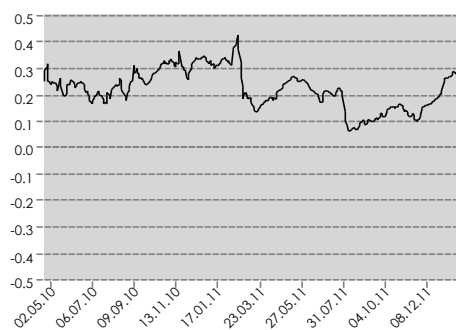
Prodotto Strutturato

Prodotto Strutturato	Delta
AMGEN INC	0.00
BAYER AG-REG	0.00
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & 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

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%.

Delta
0.14

— Prodotto Strutturato



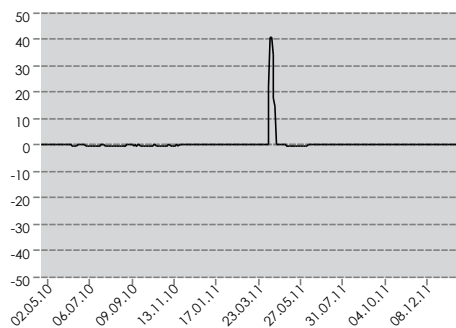
Prodotto Strutturato

Prodotto Strutturato	Vega
AMGEN INC	0.00
BAYER AG-REG	0.00
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & 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

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%.

Vega
0.04

— Prodotto Strutturato

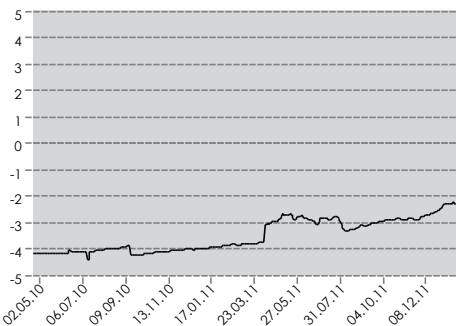


Prodotto Strutturato

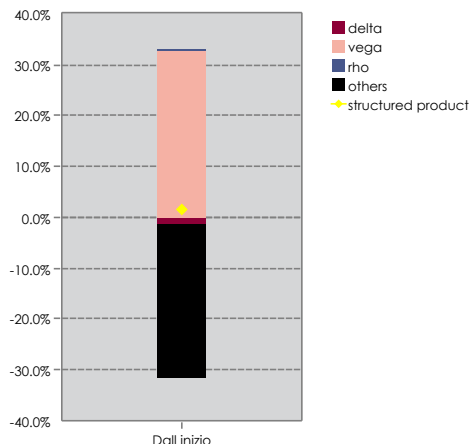
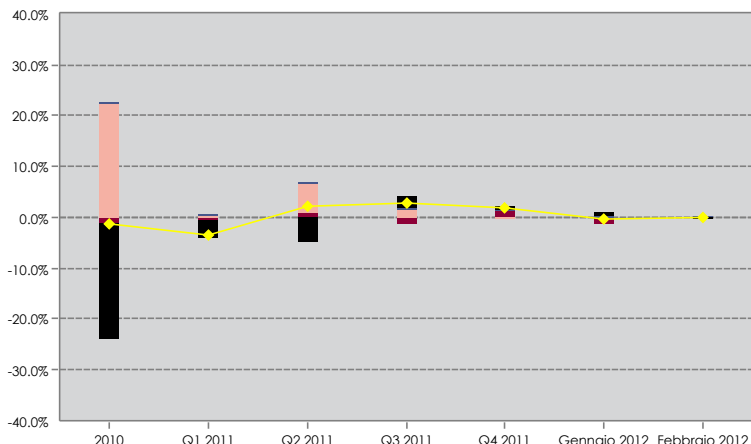
Rhò è il coefficiente che indica la sensibilità del prezzo di uno strumento derivato rispetto al tasso d'interesse privo di rischio. Uno Rhò di 0.1 significa che una variazione del tasso d'interesse privo di rischio del 1% implica una variazione del prezzo del Prodotto Strutturato del 0.1%.

Rho
-2.65

— Prodotto Strutturato



Performance attribution



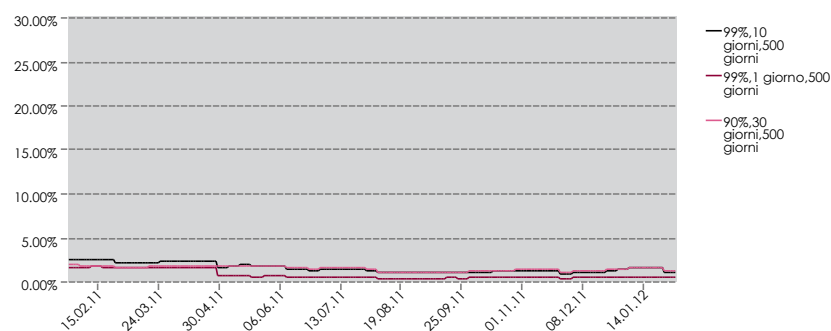
Value at Risk - VaR

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.

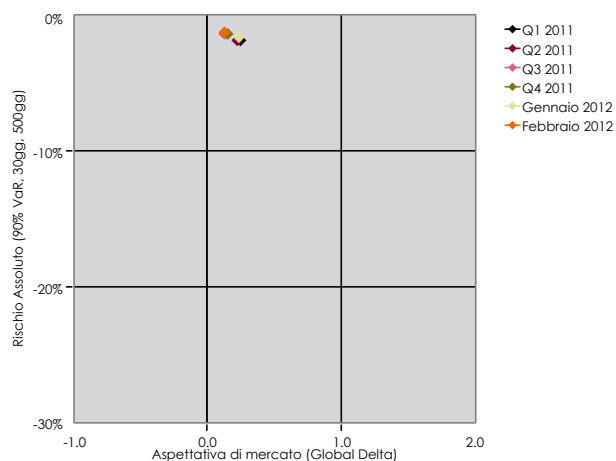
Categoria di rischio*	1	2	3	4	5	6
Intervallo VaR (%)	0 < VaR ≤ 5	5 < VaR ≤ 15	15 < VaR ≤ 30	30 < VaR ≤ 39	39 < VaR ≤ 50	50 < VaR ≤ 100
Rischio	Basso	Moderato	Medio	Medio-Alto	Alto	Molto Alto

*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)	1%
99.00%	1 giorno(i)	500 giorno(i)	%
99.00%	10 giorno(i)	500 giorno(i)	1%



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 realtiva Termsheet al sito dell'emittente 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.

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).