

Produktreport vom 29.06.2011
COSI (Collateral Secured Instruments)

Kapitalschutzprodukte
Produkttyp nach SVSP: 1100
Pfandbesicherte Derivate

Uncapped Capital Protection on Nestle, Novartis, Roche

90.00% Capital Protection - 125.00% Participation - Worst of style

Verfall 29.06.2011; emittiert in CHF; 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	06.05.2010
Erster Börsenhandelstag	06.05.2010
Ausgabepreis	100.00%
Emissionsvolumen	CHF 10'000'000 (mit Aufstockungsmöglichkeit)

Generelle Information

Valorennummer	11209370
ISIN	CH0112093700
SIX Symbol	EFHFS
Rückzahlungsdatum	06.07.2011 (vorbehältlich Anpassung bei Abwicklungsstörungen)
Denomination	CHF 1'000
Auszahlungswährung	CHF
Kapitalschutz	90.00%
Partizipation	125.00%
Kotierung	SIX Swiss Exchange; gehandelt an Scoach Schweiz AG
	Die Kotierung wird beantragt.
Quotierungstyp	Sekundärmarktpreise werden in Prozent quotiert.

Markterwartung

Steigende Basiswerte.
Steigende Volatilität während der Laufzeit.
Grosse Kursrückschläge möglich.

Produktbeschreibung

Dieses Produkt bietet dem Anleger am Rückzahlungsdatum eine Barauszahlung in der Auszahlungswährung entsprechend der Denomination multipliziert mit dem Kapitalschutz. Zusätzlich kann der Anleger an einer Wertsteigerung des Basiswertes mit der Schlechtesten Kursentwicklung (unlimitiert) partizipieren, wie im Abschnitt "Rückzahlung" beschrieben.

Basiswerte

Basiswert(e)	Referenzbörse	Bloomberg Ticker	Anfangslevel (100%)*	Ausübungspreis (90.00%)*
NESTLE SA-REG	SIX Swiss Exchange	NESN VX	CHF 53.25	CHF 47.93
NOVARTIS AG-REG	SIX Swiss Exchange	NOVN VX	CHF 55.95	CHF 50.36
ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	SIX Swiss Exchange	ROG VX	CHF 172.40	CHF 155.16

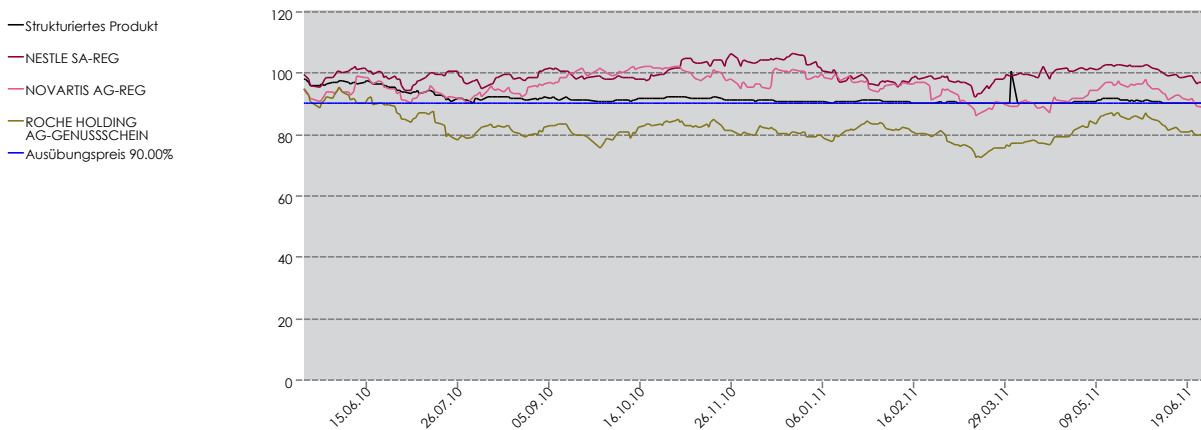
Wertentwicklung

	Letzter Preis	Diese Woche	Dieser Monat	Dieses Jahr	Seit Ausgabe
Strukturiertes Produkt	90.35%	0.00%	-1.04%	-0.42%	-9.65%
NESTLE SA-REG	CHF 51.75	0.00%	-5.48%	-5.48%	-2.82%
NOVARTIS AG-REG	CHF 50.55	1.22%	-8.09%	-8.01%	-9.65%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	CHF 140.00	2.04%	-6.67%	2.19%	-18.79%

* Levels sind in Prozent des Anfangslevels ausgedrückt

Zeichnungsschluss 23.04.2010	Erster Börsenhandelstag 06.05.2010	Verfall 29.06.2011				
VORBEI	HANDELT	VERFALLEN				

Wertentwicklung im Zeitablauf



Sensitivität

Strukturiertes Produkt

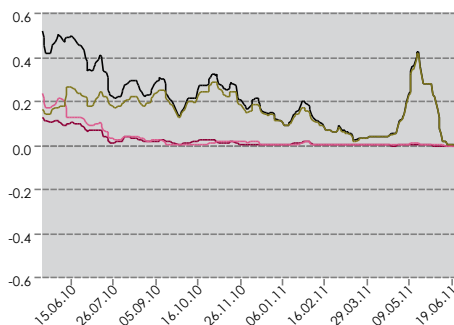
Delta
0.00

NESTLE SA-REG
NOVARTIS AG-REG
ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN

0.00
0.00
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.

— Strukturiertes Produkt
— NESTLE SA-REG
— NOVARTIS AG-REG
— ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN



Strukturiertes Produkt

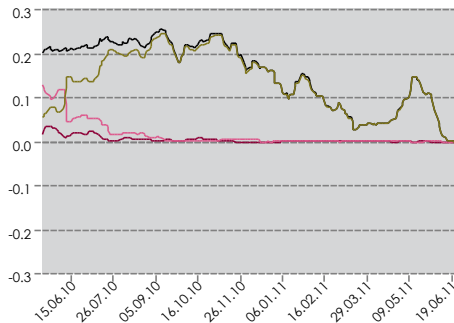
Vega
0.00

NESTLE SA-REG
NOVARTIS AG-REG
ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN

0.00
0.00
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.

— Strukturiertes Produkt
— NESTLE SA-REG
— NOVARTIS AG-REG
— ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN

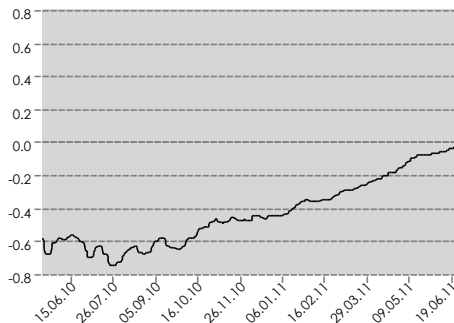


Strukturiertes Produkt

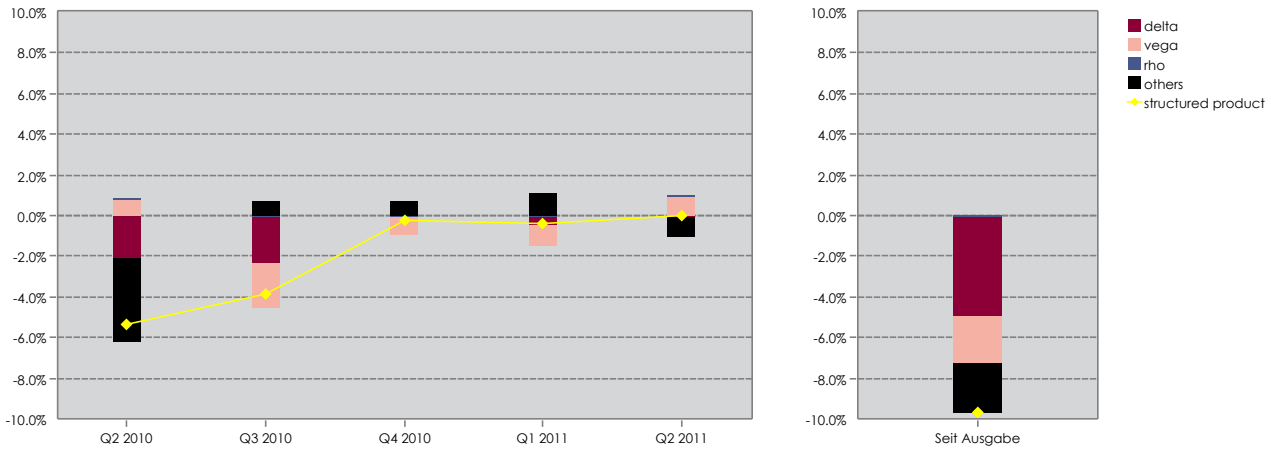
Rho
-0.01

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.

— Strukturiertes Produkt



Attribution der Wertentwicklung



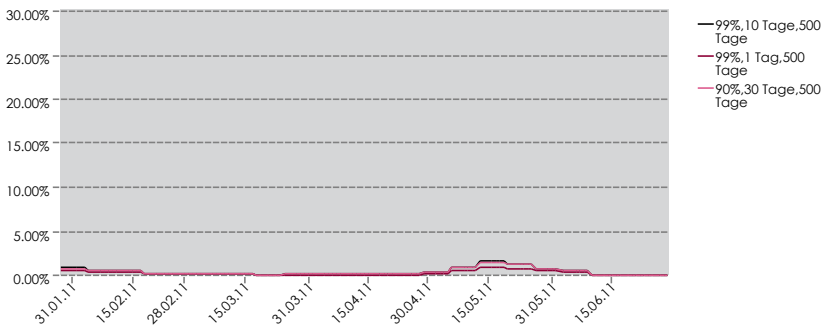
VaR im Zeitablauf

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.

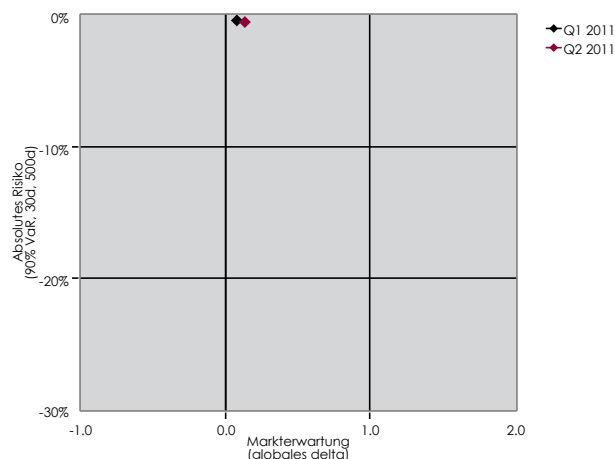
Risiko Klasse*	1	2	3	4	5	6
VaR Intervall (in %)	$0 < VaR \leq 5$	$5 < VaR \leq 15$	$15 < VaR \leq 30$	$30 < VaR \leq 39$	$39 < VaR \leq 50$	$50 < VaR \leq 100$
Risiko	Tief	Moderat	Mittel	Erhöht	Hoch	Sehr Hoch

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



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.

