

Annonce du produit en date du 29.06.2011
COSI (Collateral Secured Instruments)

Protection du capital
Gamme de produits de ASPS: 1100
Produits Dérivés Nantis

Uncapped Capital Protection on Nestle, Novartis, Roche

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

Date de fixation finale 29.06.2011; émis en CHF; 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 sur le produit

Données de l'émission

| | |
|------------------------------------|----------------------------------------------------|
| Date d'émission | 06.05.2010 |
| Premier Jour de négoce à la bourse | 06.05.2010 |
| Prix d'émission | 100.00% |
| Taille d'émission | CHF 10'000'000 (peut être augmentée à tout moment) |

Informations Générales

| | |
|-----------------------|--------------------------------------------------------------------------------|
| Numéro de valeur | 11209370 |
| ISIN | CH0112093700 |
| Symbole SIX | EFHFS |
| Date de remboursement | 06.07.2011 (sous réserve des dispositions en cas de perturbations de paiement) |
| Dénomination | CHF 1'000 |
| Devise de paiement | CHF |
| Protection du capital | 90.00% |
| Participation | 125.00% |
| Cotation/Bourse | SIX Swiss Exchange; négocié à Scoach Schweiz AG |
| | La cotation sera demandée. |
| Type de cotation | Les prix du marché secondaire sont cotés en pourcentage. |

Anticipation de l'évolution des marchés

Hausse des Sous-jacents.
Hausse de la volatilité des Sous-jacents.
Repli éventuel des cours plus important.

Description du Produit

Ce produit offre à l'Investisseur à la Date de remboursement, un Paiement en espèces dans la Devise de paiement, d'un montant égal à la Dénomination multipliée par la Protection du Capital. En plus, l'Investisseur peut participer à la hausse du Sous-jacent avec la plus Mauvaise performance (non-limité), comme décrit dans la rubrique "Remboursement".

Sous-jacents

| Sous-jacent | Bourse de réference | Bloomberg Ticker | Fixation initiale (100%)* | Prix d'exercice (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 |

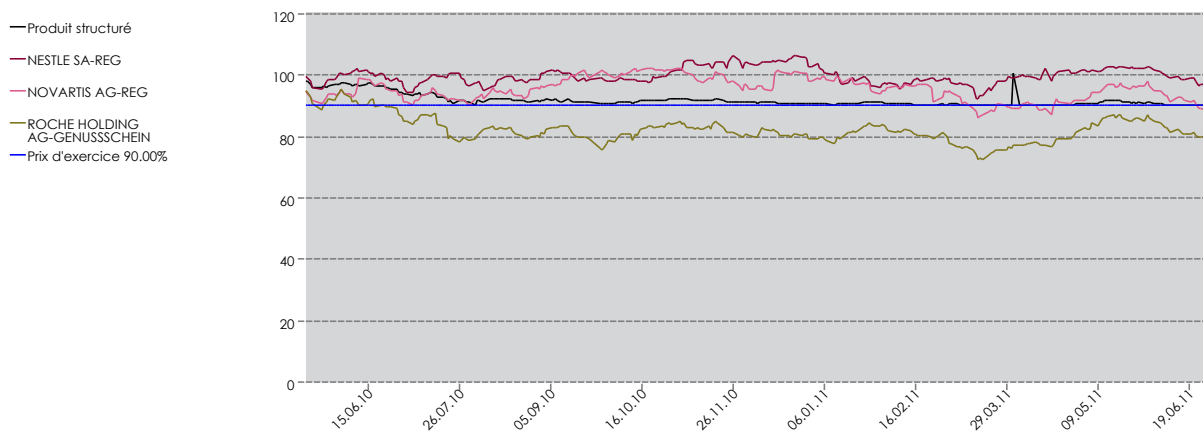
Performance

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

* les niveaux sont exprimés en pourcentage de la Fixation initiale

| | | | | | |
|--------------------------------------|--------------------------------------------------|---------------------------------------|--|--|--|
| Fin de la souscription 23.04.2010 | Premier Jour de négoce à la bourse 06.05.2010 | Date de fixation finale 29.06.2011 | | | |
| | | | | | |

Performance au cours du temps



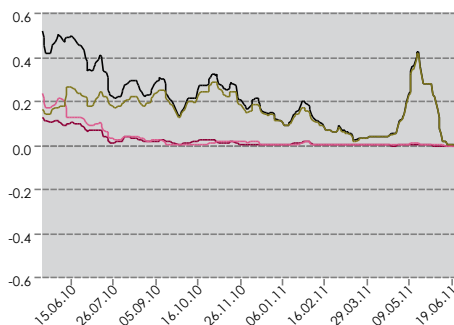
Sensibilité

Produit structuré

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

Delta
0.00

—Produit structuré
—NESTLE SA-REG
—NOVARTIS AG-REG
—ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN



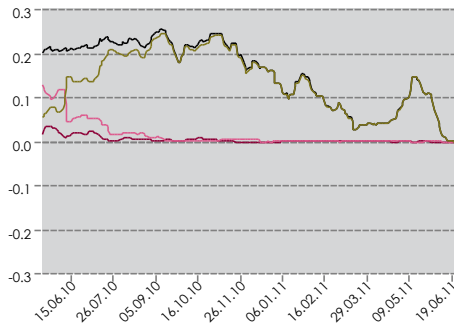
Le Delta mesure la sensibilité du prix de l'option par rapport à la variation d'un actif sous-jacent auquel elle est associée. Si le Delta du Sous-jacent est égal à 0.1, cela signifie que 1% de variation du prix du Sous-jacent induit une variation de 0.1% du prix de l'option.

Produit structuré

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

Vega
0.00

—Produit structuré
—NESTLE SA-REG
—NOVARTIS AG-REG
—ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN



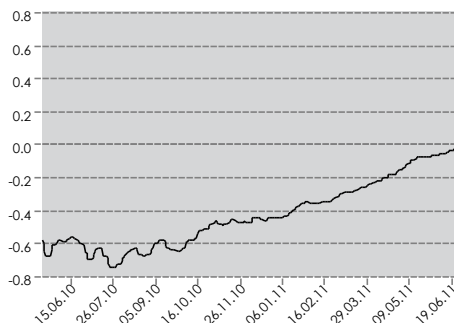
Le Vega mesure la sensibilité du prix de l'option par rapport à la volatilité implicite d'un actif sous-jacent auquel elle est associée. Si le Vega du Sous-jacent est égal à 0.1, cela signifie que 1% de variation de la volatilité implicite du Sous-jacent induit une variation de 0.1% du prix de l'option.

Produit structuré

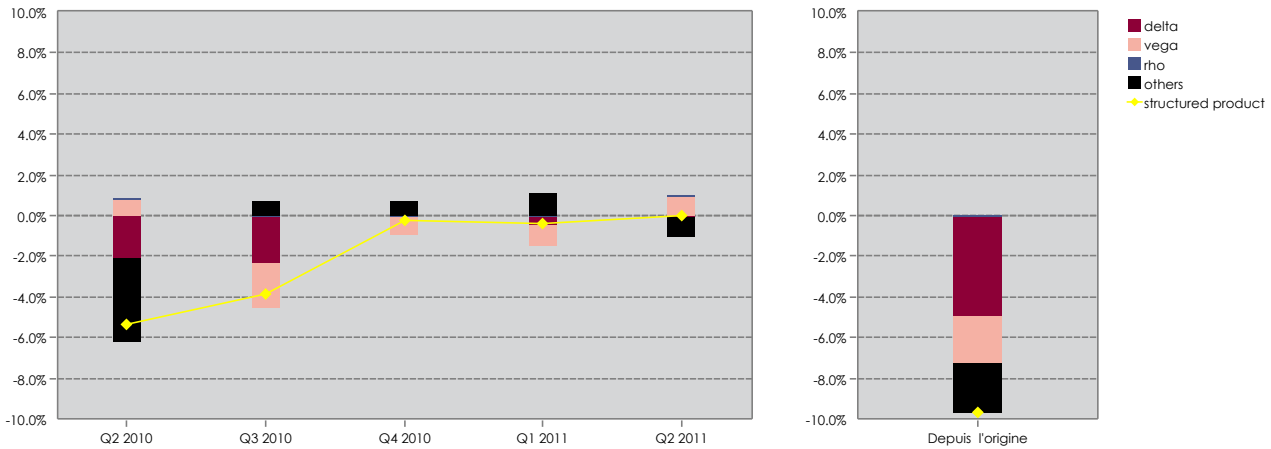
Le Rhô mesure la sensibilité du prix de l'option par rapport au taux d'intérêt et à la maturité. Si le Rhô est égal à 0.1, cela signifie que 1% de variation du taux d'intérêt induit une variation de 0.1% du prix de l'option.

Rho
-0.01

—Produit structuré



Répartition de la performance



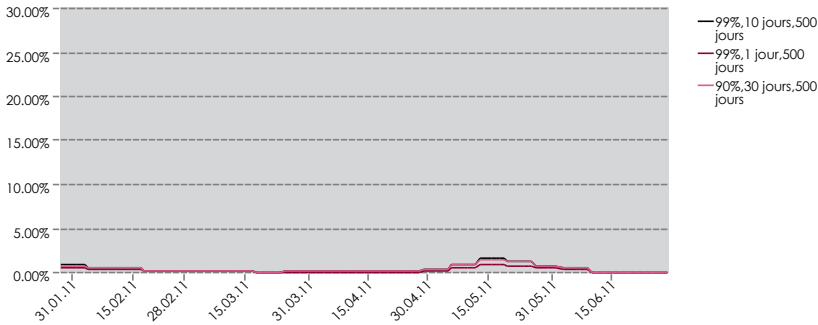
VaR au cours du temps

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.

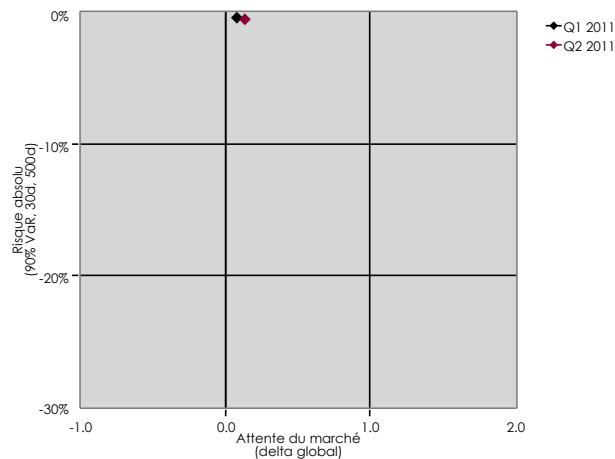
| Catégorie de risque* | 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 |
|----------------------|-------------|--------------|---------------|---------------|---------------|----------------|
| Intervalle VaR (%) | 0 < VaR ≤ 5 | 5 < VaR ≤ 15 | 15 < VaR ≤ 30 | 30 < VaR ≤ 39 | 39 < VaR ≤ 50 | 50 < VaR ≤ 100 |
| Risque | Faible | 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) | % |
| 99.00% | 1 jour(s) | 500 jour(s) | % |
| 99.00% | 10 jour(s) | 500 jour(s) | % |



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.

Veillez 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 Lead Manager, 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).

