

Produktreport vom 03.02.2012

Partizipationsprodukte
Produkttyp nach SVSP: 1320

Bonus Certificate on Swiss Market Index®

Bonus Level 100.00% - Continuous Barrier Observation

Verfall 19.07.2012; emittiert in CHF; kotiert an SIX Swiss Exchange

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	26.05.2010
Erster Börsenhandelstag	26.05.2010
Ausgabepreis	100.00%
Emissionsvolumen	CHF 10'000'000 (mit Aufstockungsmöglichkeit)

Generelle Information

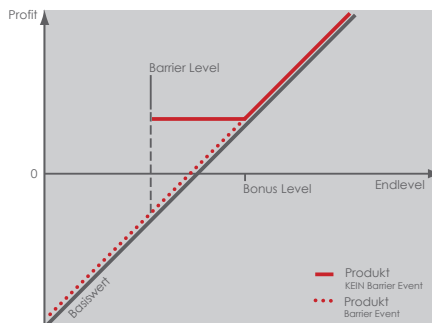
Valorennummer	11288170
ISIN	CH0112881708
SIX Symbol	EFHJB
Rückzahlungsdatum	26.07.2012 (vorbehältlich Anpassung bei Abwicklungsstörungen)
Denomination	CHF 1'000
Auszahlungswährung	CHF
Bonus Level	100.00% (CHF 1'000.00)
Kotierung	SIX Swiss Exchange; gehandelt an Scoach Schweiz AG Die Kotierung wird beantragt.
Quotierungstyp	Sekundärmarktpreise werden in Prozent quotiert.

Markterwartung

Basiswert handelt seitwärts oder steigt / fällt moderat. Der Barrier Event wird nicht stattfinden.

Produktbeschreibung

Dieses Produkt bietet dem Anleger am Rückzahlungsdatum eine Barauszahlung in der Auszahlungswährung entsprechend der Denomination multipliziert mit dem Bonus Level (in %), es sei denn ein Barrier Event hat stattgefunden. Zudem hat der Anleger - unabhängig davon, ob ein Barrier Event stattgefunden hat - die Möglichkeit, über dem Bonus Level (in %), an der Wertentwicklung des Basiswertes zu partizipieren. Sofern ein Barrier Event stattgefunden hat, erhält der Anleger entweder eine vordefinierte Anzahl der Basiswerte geliefert oder gegebenenfalls eine Barauszahlung, wie im Abschnitt "Rückzahlung" beschrieben.



Basiswerte

Basiswert(e)	Index Sponsor	Bloomberg Ticker	Anfangslevel (100%)*	Barrier Level (69.00%)*
Swiss Market Index®	SIX Swiss Exchange	SMI	CHF 6374.43	CHF 4398.36

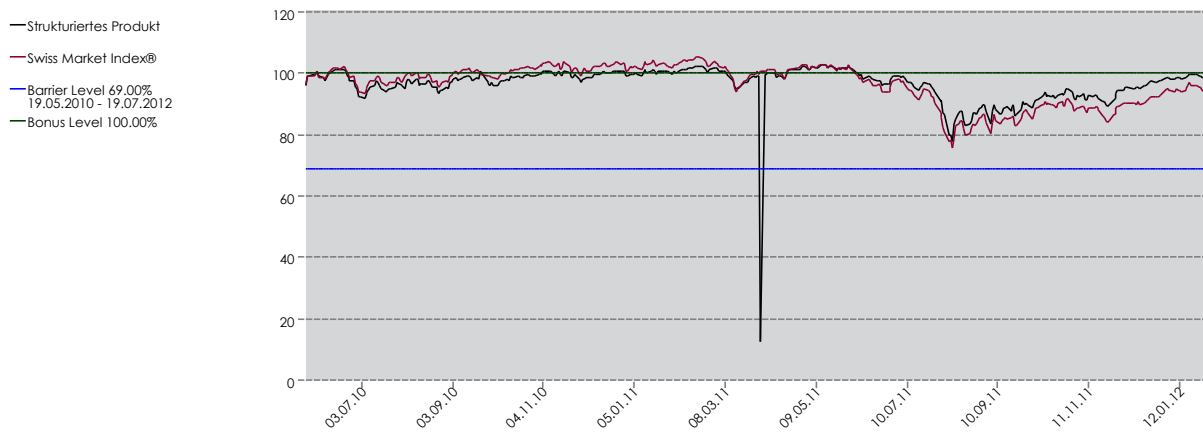
Wertentwicklung

	Letzter Preis	Diese Woche	Dieser Monat	Dieses Jahr	Seit Ausgabe	Abstand zum Barrier Level
Strukturiertes Produkt	99.85%	1.09%	1.36%	2.18%	-0.15%	
Swiss Market Index®	CHF 6'153.31	1.99%	3.06%	3.66%	-3.47%	28.52%

* Levels sind in Prozent des Anfangslevels ausgedrückt

Zeichnungsschluss 19.05.2012 VORBEI	Erster Börsenhandelstag 26.05.2010 HANDELT	Barrier Beobachtung 19.05.2010 - 19.07.2012 AM	Barrier Level Swiss Market Index® (69.00%)	Bonus Level 100.00% (CHF 1'000.00)	Verfall 19.07.2012	

Wertentwicklung im Zeitablauf



Sensitivität

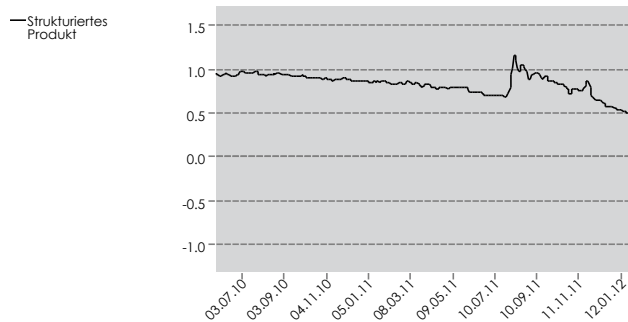
Strukturiertes Produkt

Delta
0.45

Swiss Market Index®

0.45

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.



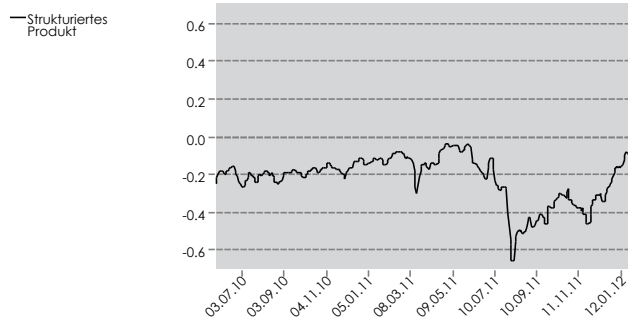
Strukturiertes Produkt

Vega
-0.07

Swiss Market Index®

-0.07

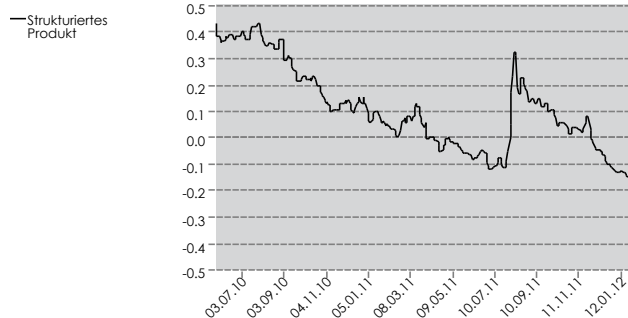
Vega ist die Sensitivität des Preises eines Derivates bezüglich der impliziten Volatilität eines Basiswertes. Wenn das Vega eines Basiswertes 0.1 ist, bedeutet dies bei einer Bewegung von 1% der impliziten Volatilität des Basiswertes, dass sich der Preis des Strukturierten Produktes um 0.1% verändert.



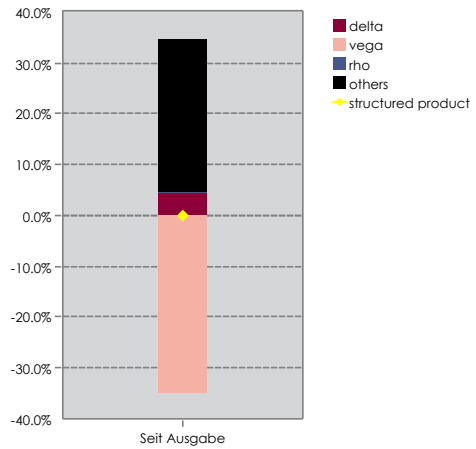
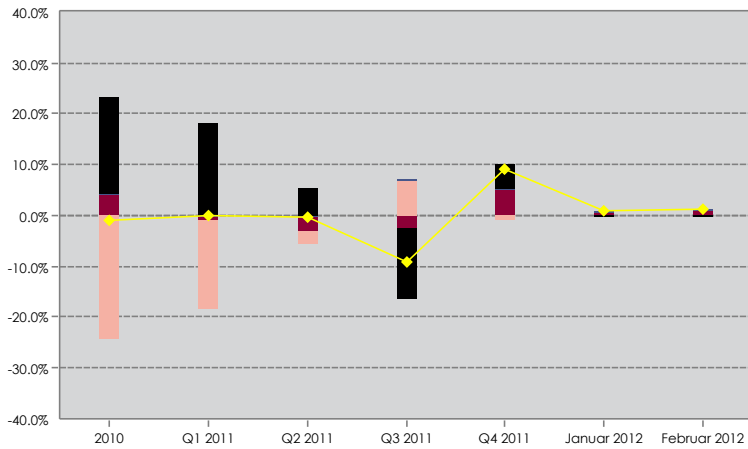
Strukturiertes Produkt

Rho
-0.17

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.



Attribution der Wertentwicklung



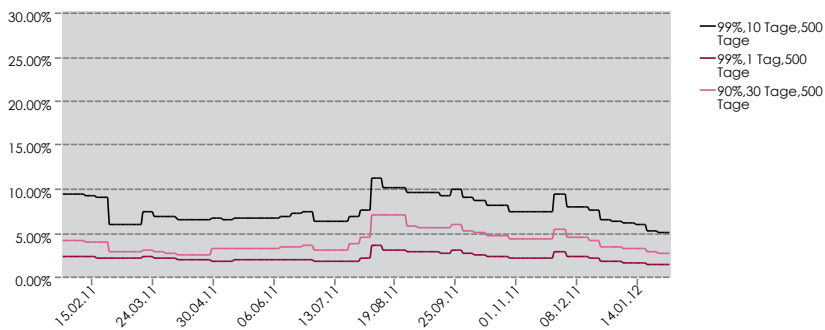
VaR im Zeitablauf

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.

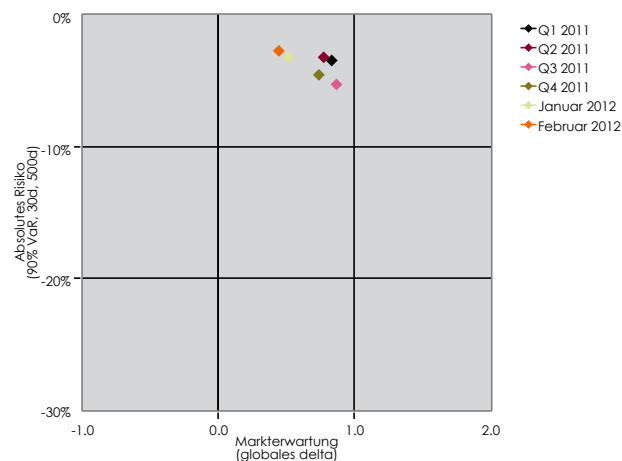
Risiko Klasse*	1	2	3	4	5	6
VaR Intervall (in %)	$0 < \text{VaR} \leq 5$	$5 < \text{VaR} \leq 15$	$15 < \text{VaR} \leq 30$	$30 < \text{VaR} \leq 39$	$39 < \text{VaR} \leq 50$	$50 < \text{VaR} \leq 100$
Risiko	Tief	Moderat	Mittel	Erhöht	Hoch	Sehr Hoch

*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)	3%
99.00%	1 Tag(e)	500 Tag(e)	1%
99.00%	10 Tag(e)	500 Tag(e)	5%



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.

Index Disclaimer

Diese Produkte werden in keiner Weise von der SIX Swiss Exchange AG unterstützt, abgetreten, verkauft oder beworben und die SIX Swiss Exchange AG leistet in keiner Weise (weder ausdrücklich noch stillschweigend) Gewähr für die Ergebnisse, welche durch den Gebrauch des SMI®-Index (der "Index") erzielt werden können, und/oder für die Höhe des Indexes zu einer bestimmten Zeit an einem bestimmten Datum. Die SIX Swiss Exchange AG ist nicht haftbar (weder aus fahrlässigem noch aus anderem Verhalten) für irgendwelche Fehler, die der Index aufweist, und die SIX Swiss Exchange AG ist in keiner Weise verpflichtet, auf solche Fehler aufmerksam zu machen.

® SIX®, SIX Swiss Exchange®, SPI®, Swiss Performance Index (SPI)®, SPI EXTRA®, SPI ex SLI®, SMI®, Swiss Market Index (SMI)®, SMIM®, SMI MID (SMIM)®, SMI Expanded®, SXI®, SXI LIFE SCIENCES®, SXI Bio+Medtech®, SLI®, SLI Swiss Leader Index®, SBI®, SBI Swiss Bond Index®, VSMI® und SWX Immobilienfonds Index® sind in der Schweiz und/oder im Ausland eingetragene Marken der SIX Swiss Exchange, deren Verwendung lizenzpflichtig ist.