

**Rückzahlung pro Produkt: 19.08.2010**  
**Barauszahlung: EUR 1'000.00**  
**Coupon: EUR 100.00**

Termsheet vom 13.08.2010  
**COSI (Collateral Secured Instruments)**

Renditeoptimierungsprodukte  
Produkttyp nach SVSP: 1230 (340)  
Pfandbesicherte Derivate

## 10.00% (10.17% p.a.) Barrier Reverse Convertible on Allianz, BNP Paribas, Deutsche Bank

**Worst of style - Autocallable**

Verfall 11.02.2011; emittiert in EUR; kotiert an SIX Swiss Exchange

**Dieses Produkt ist nach den Bestimmungen des "Rahmenvertrages für Pfandbesicherte Zertifikate" der SIX Swiss Exchange besichert. Einzelheiten zur Pfandbesicherung sind im nachfolgenden Abschnitt aufgeführt: "Information zur Pfandbesicherung"**

Dieses Dokument enthält eine Zusammenfassung ausgewählter Produktinformationen und dient lediglich zu Informationszwecken. Die ausführlichen und rechtlich verbindlichen Produktinformationen (nur in englischer Sprache) sind ausschliesslich in der Product Documentation enthalten, die sich aus dem massgebenden „Final Termsheet“ sowie dem „Programme“ zusammensetzt.

### Markterwartung

Seitwärts tendierende bis leicht steigende Basiswerte.  
Die Basiswerte werden nicht gleich oder tiefer als die entsprechenden Barrier Levels fallen.

### Produktbeschreibung

Dieses Produkt bietet dem Anleger, unabhängig von der Kursentwicklung der Basiswerte, eine Couponzahlung sowie einen bedingten Kapitalschutz. Vorausgesetzt dass kein Barrier Event stattgefunden hat, erhält der Anleger am Rückzahlungsdatum eine Barauszahlung entsprechend der Denomination. Sofern ein Barrier Event stattgefunden hat, aber alle Basiswerte per Verfall über dem entsprechenden Anfangslevel schliessen, erhält der Anleger am Rückzahlungsdatum eine Barauszahlung entsprechend der Denomination. Andernfalls erhält der Anleger entweder eine Anzahl Basiswerte (gemäss Ausübungsverhältnis) mit der Schlechtesten Kursentwicklung oder gegebenenfalls eine Barauszahlung in der Auszahlungswährung, wie im Abschnitt "Rückzahlung" beschrieben.

Zudem kann das Produkt vorzeitig zurückbezahlt werden sofern an einem der vordefinierten Autocall Beobachtungstage die entsprechenden Voraussetzungen erfüllt sind.

### Basiswerte

Basiswert(e)	Referenz-börse	Bloomberg Ticker	Anfangslevel (100%)	Barrier Level (65.00%)	Autocall Trigger Level (100.00%)	Ausübungsverhältnis
ALLIANZ SE-REG	Xetra	ALV GY	EUR 78.94	EUR 51.31	EUR 78.94	12.6678
BNP PARIBAS-REG	Euronext Paris	BNP FP	EUR 47.60	EUR 30.94	EUR 47.60	21.0084
DEUTSCHE BANK AG-REG	Xetra	DBK GY	EUR 44.035	EUR 28.623	EUR 44.035	22.7092

### Produktdetails

Valorenummer	<b>10991413</b>
ISIN	<b>CH0109914132</b>
SIX Symbol	<b>EFGSI</b>
Ausgabepreis	100.00%
Emission	EUR 10'000'000 (mit Aufstockungsmöglichkeit)
Denomination	EUR 1'000
Auszahlungswährung	EUR
Bondfloor bei Ausgabe	100.00% (implizierter Zins: 1.20%)
Couponbetrag	10.00% (10.17% p.a.)
	Der Couponbetrag ist für steuerliche Zwecke in zwei Komponenten aufgeteilt:
	Zinsanteil 1.18% (1.20% p.a.)
	Prämienanteil 8.82% (8.97% p.a.)

Zeichnungsschluss 12.02.2010 <b>VORBEI</b>	Erster Börsenhandelstag 21.02.2010 <b>HANDELT</b>	Barrier Beobachtung 12.02.2010 - 11.02.2011 <b>ABLAUF</b>	Barrier Level Allianz (65.00%)	Barrier Level BNP Paribas (65.00%)	Barrier Level Deutsche Bank (65.00%)	Beobachtungstag 12.08.2010 <b>AUTOCALLED</b>
Couponzahlung EUR 100.00 18.02.2011	Couponzahlung EUR	Verfall 11.02.2011				

Couponzahlung(-en) und  
Couponzahlungstag(e)

Das Folgende findet Anwendung sofern keine Vorzeitige Rückzahlung  
stattgefunden hat. Die Couponzahlung wird an den entsprechenden  
Couponzahlungstagen in der Auszahlungswährung gezahlt. Die „Following  
Business Day“ Konvention findet Anwendung.

EUR 100.00 wird ausbezahlt am 18.02.2011

## Daten

Zeichnungsschluss	12.02.2010 14.00 CET
Fixierung	12.02.2010
Liberierung	24.02.2010
Erster Börsenhandelstag	24.02.2010
Letzte/r Handelstag/-zeit	11.02.2011 / Börsenschluss
Verfall	11.02.2011 (vorbehältlich Anpassung bei Marktstörungen)
Rückzahlungsdatum	18.02.2011 (vorbehältlich Anpassung bei Abwicklungsstörungen)
Autocall Beobachtungstage / Vorzeitige Rückzahlungstage	<b>Autocall Beobachtungstag</b> <b>Vorzeitiger Rückzahlungstag</b> <b>Couponzahlung bei Vorzeitiger Rückzahlung</b>

1	12.08.2010	19.08.2010	EUR 100.00
---	------------	------------	------------

Sofern einer der oben genannten Autocall Beobachtungstage kein  
Börsenhandelstag ist, wird der nächstfolgende Börsenhandelstag der  
entsprechende Autocall Beobachtungstag sein. Die General Terms and  
Conditions 9.1 finden für die Autocall Beobachtungstage identisch Anwendung  
wie für den Verfall. Sofern einer der obgenannten Vorzeitigen Rückzahlungstage  
kein Arbeitstag ist, wird der entsprechende Vorzeitige Rückzahlungstag auf  
den nächstfolgenden Arbeitstag verschoben.

## Rückzahlung

Das Folgende findet Anwendung sofern keine Vorzeitige Rückzahlung stattgefunden hat. Die Couponzahlung  
wird in jedem Fall am (an den) entsprechenden Couponzahlungstag(en) ausbezahlt. Zusätzlich erhält der  
Anleger am Rückzahlungsdatum von der Emittentin pro Produkt:

### Rückzahlungsszenario 1

Falls kein Barrier Event eingetreten ist, erhält der Anleger eine Barauszahlung  
in der Auszahlungswährung, entsprechend:  
Denomination

### Rückzahlungsszenario 2

Falls ein Barrier Event eingetreten ist und

- Sofern der Endlevel desjenigen Basiswertes mit der schlechtesten  
Kursentwicklung bei oder unter dem entsprechenden Anfangslevel  
liegt, erhält der Anleger eine Anzahl (entspricht dem  
Ausübungsverhältnis) des Basiswertes pro Produkt, welcher die  
Schlechteste Kursentwicklung aufweist. Allfällige Fraktionen pro Produkt  
werden basierend auf dem Endlevel ausbezahlt.
- Sofern der Endlevel desjenigen Basiswertes mit der schlechtesten  
Kursentwicklung über dem entsprechenden Anfangslevel liegt, erhält  
der Anleger eine Barauszahlung in der Auszahlungswährung,  
entsprechend:  
Denomination

Anfangslevel      Der offizielle Schlusskurs des Basiswertes an der entsprechenden Referenzbörse  
bei Fixierung, festgelegt durch die Berechnungsstelle.

Endlevel      Der offizielle Schlusskurs des Basiswertes an der entsprechenden Referenzbörse  
bei Verfall, festgelegt durch die Berechnungsstelle.

Schlechteste Kursentwicklung      Die schlechteste Kursentwicklung der entsprechenden Basiswerte, wobei die  
Kursentwicklung jedes Basiswertes durch Division des entsprechenden Endlevels  
durch das entsprechende Anfangslevel berechnet wird. Die Schlechteste  
Kursentwicklung wird von der Berechnungsstelle festgestellt.

Barrier Event      Ein Barrier Event ist eingetreten, wenn der Level mindestens eines Basiswerts an  
irgendeinem Börsentag während der Barrier Beobachtungsperiode bei oder  
unter dem entsprechenden Barrier Level quotiert und / oder gehandelt wurde,  
festgelegt durch die Berechnungsstelle.

Vorzeitige Rückzahlung      Unter der Voraussetzung, dass an einem der im Voraus festgesetzten Autocall  
Beobachtungstage der offizielle Schlusskurs aller Basiswerte über dem  
entsprechenden Autocall Trigger Level liegt, wird eine Vorzeitige Rückzahlung  
stattfinden und das Produkt verfällt mit sofortiger Wirkung.  
Der Anleger erhält am entsprechenden Vorzeitigen Rückzahlungstag eine  
Barauszahlung, die sich wie folgt berechnet: Denomination plus Couponzahlung  
bei Vorzeitiger Rückzahlung für den entsprechenden Autocall

Beobachtungstag, wie in obiger Tabelle definiert. Es erfolgen keine weiteren Zahlungen.

Barrier Beobachtungsperiode 12.02.2010 - 11.02.2011

## Generelle Information

---

Emittentin	EFG Financial Products (Guernsey) Ltd., St Peter-Port, Guernsey
Garantin	EFG International AG, Zürich, Schweiz (Rating: Fitch A mit stabilem Ausblick, Moody's A3 mit stabilem Ausblick)
Sicherungsgeber	EFG Financial Products AG, Zürich, Schweiz
Lead Manager	EFG Financial Products AG, Zürich, Schweiz
Berechnungsstelle	EFG Financial Products AG, Zürich, Schweiz
Zahlstelle	EFG Financial Products AG, Zürich, Schweiz
Vertriebsentschädigungen	Relevant Fees (definiert in Ziffer 25 der "General Terms and Conditions", welche Bestandteil des Programmes sind)
Kotierung	SIX Swiss Exchange; gehandelt an Scoach Schweiz AG Die Kotierung wird beantragt.
Sekundärmarkt	Veröffentlichungen täglicher Preisindikationen zwischen 09:15 und 17:15 CET unter <a href="http://www.efgfp.com">www.efgfp.com</a> , Thomson Reuters [ISIN] und Bloomberg [ISIN] Corp oder EFGZ.
Quotierungsart	Sekundärmarktpreise werden dirty quotiert. Die Marchzinsen sind im Preis enthalten.
Quotierungstyp	Sekundärmarktpreise werden in Prozent quotiert.
Zinsberechnungsmethode	30/360; nicht adjustiert; auflaufend während jeder Couponperiode (einschliesslich Start- und ausschliesslich Enddatum).
Abwicklungsart	Barabwicklung oder Lieferung eines Basiswertes
Minimaler Anlagebetrag	EUR 1'000
Kleinste Handelsmenge	EUR 1'000
Verkaufsrückstellungen	USA, US persons, UK, EEA, Hong Kong, Singapore
Clearing	SIX SIS AG, Euroclear, Clearstream
Verwahrungsstelle	SIX SIS AG
Verbriefung	Wertrechte
Anwendbares Recht/Gerichtsstand	Schweizerisches Recht/Zürich

## Steuern

---

Stempelsteuer	Sekundärmarkttransaktionen unterliegen nicht der schweizerischen Umsatzabgabe. Die mögliche Lieferung des Basiswertes unterliegt grundsätzlich der schweizerischen Umsatzabgabe.
Einkommenssteuer	Dieses Produkt ist als transparent und überwiegend einmalverzinslich (IUP) zu qualifizieren. Dementsprechend unterliegt bei natürlichen, in der Schweiz ansässigen Personen, welche das Produkt im Privatvermögen halten, der Zinsanteil des Coupons bei Auszahlung und der (aufgrund der modifizierten Differenzbesteuerung zu ermittelnde) Wertzuwachs auf dem Obligationenteil im Zeitpunkt des Verkaufs bzw. der Rückzahlung der Direkten Bundessteuer. Der Wert des Obligationenteils im Emissionszeitpunkt entspricht dem Bondfloor bei Ausgabe per Einheit. Für einen Investor, der das Produkt bei Emission kauft und bis Verfall hält, ist die Wertdifferenz zwischen dem Bondfloor bei Liberierung und dem Bondfloor am Rückzahlungsdatum steuerrelevant. Demgegenüber stellt der Prämienteil des Coupons einen Kapitalgewinn dar und unterliegt bei den vorstehend erwähnten Investoren nicht der Direkten Bundessteuer. Die kantonale und kommunale einkommenssteuerliche Behandlung kann von der steuerlichen Behandlung bei der Direkten Bundessteuer abweichen. Generell ist die einkommenssteuerliche Behandlung jedoch gleich.
Verrechnungssteuer	Dieses Produkt unterliegt nicht der schweizerischen Verrechnungssteuer.
EU Zinsbesteuerung	Für schweizerische Zahlstellen unterliegt der Zinsanteil des Couponbetrages dem EU Steuerrückbehalt (TK6).

Diese Steuerinformationen gewähren nur einen generellen Überblick über die möglichen Steuerfolgen, die zum Zeitpunkt der Emission mit diesem Produkt verbunden sind. Steuergesetze und die Praxis der Steuerverwaltung können sich - möglicherweise rückwirkend - jederzeit ändern.

Anlegern und potenziellen Anlegern von Produkten wird geraten, ihren persönlichen Steuerberater bzgl. der für die schweizerische Besteuerung relevanten Auswirkungen von Erwerb, Eigentum, Verfügung, Verfall oder Ausübung bzw. Rückzahlung der Produkte angesichts ihrer eigenen besonderen Umstände zu konsultieren. Die Emittentin, die Garantin sowie der Lead Manager lehnen jegliche Haftung im Zusammenhang mit möglichen Steuerfolgen ab.

## 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.

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](http://www.efgfp.com) in der Rubrik „Produkte“, oder für kofierte Produkte in irgend einer anderen Form, die gemäss den Bestimmungen und Regularien der SIX Swiss Exchange zulässig ist, veröffentlicht. Mitteilungen an Anleger, welche die Emittentin und/oder die Garantin betreffen, werden in der Rubrik „Über uns“ auf der Website der Emittentin ([www.efgfp.com](http://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](mailto:termsheet@efgfp.com)) bestellt werden.

## Produktspezifische Risiken

---

Das Verlustrisiko des Produkts ist ähnlich einer Investition in den sich am schlechtesten entwickelnden Basiswert. Wenn daher ein Barrier Event stattgefunden hat und der Basiswert mit der Schlechtesten Kursentwicklung auf Null fällt, kann der Anleger den gesamten investierten Betrag verlieren. Bei Lieferung des Basiswertes kann die Depotbank des Anlegers eine Transaktionsgebühr verlangen.

## Zusätzliche Risikofaktoren

---

Anleger sollten sich vergewissern, dass sie die Natur des Produkts sowie das Risiko, das sie beabsichtigen einzugehen, verstehen. Ob ein Produkt für einen bestimmten Anleger geeignet ist, sollte dieser aufgrund seiner eigenen Umstände und seiner eigenen finanziellen Situation beurteilen. Die Produkte beinhalten wesentliche Risiken, inklusive dem Risiko, dass sie wertlos verfallen können. Anleger sollten in der Lage sein, unter gewissen Umständen einen Totalverlust ihres investierten Geldes zu verkraften. Anleger sollten die folgenden wichtigen Risikofaktoren sowie das Kapitel "Risikofaktoren" des Programmes (Seiten 5 ff.) beachten.

Das Produkt qualifiziert als derivatives Finanzinstrument und nicht als Anteil an einer kollektiven Kapitalanlage im Sinne des Kollektivanlagegesetzes ("KAG"); das Produkt ist nicht bei der FINMA registriert. Das Produkt unterliegt daher weder dem KAG, noch ist es von der Eidgenössische Finanzmarktaufsicht (FINMA) beaufsichtigt. Entsprechend profitieren Anleger nicht von den spezifischen Schutzbestimmungen des KAG.

Die Produkte-Bedingungen können während der Laufzeit des Produkts gemäss den Bestimmungen des Programmes angepasst werden.

Anleger, deren Referenzwährung nicht die Abrechnungswährung des Produkts ist, sollten sich des möglichen Währungsrisikos bewusst sein. Der Wert des Produkts korreliert allenfalls nicht mit demjenigen des Basiswerts.

### Emittenten-/Garanten-Risiko

Das Verlustrisiko des Anlegers aufgrund des Ausfalls der Emittentin und der Garantin des Produkts ist durch die Pfandbesicherung vermindert. Zur Besicherung dieses Produktes wurden Sicherheiten bei der SIX Swiss Exchange hinterlegt. Nach Insolvenz des Emittenten und des Garanten werden die hinterlegten Sicherheiten zur Rückzahlung dieses Produktes herangezogen.

### Sekundärmarkt

Die Emittenten und/oder der Lead Manager oder irgendeine von den Emittenten damit beauftragte Drittpartei beabsichtigen, unter normalen Marktverhältnissen, gemäss den COSI Market Making Pflichten Angebots- und Nachfragepreise für die Produkte zu stellen. Doch die Emittenten und/oder der Lead Manager behalten sich das Recht vor, das Stellen von Angebots- und Nachfragepreisen für die Dauer des Auftretens von aussergewöhnlichen Marktverhältnissen einzustellen. Bei speziellen Marktsituationen, wenn die Emittenten und/oder der Lead Manager nicht in der Lage sind, Absicherungsgeschäfte zu tätigen, oder wenn es sehr schwierig ist, solche Geschäfte abzuschliessen, kann sich der Spread zwischen Angebots- und Nachfragepreisen zwischenzeitlich vergrössern, um das wirtschaftliche Risiko des Emittenten und/oder des Lead Manager zu begrenzen.

## Zusätzliche Informationen

---

### Prudentielle Aufsicht

EFG International AG, Zürich, wird auf konsolidierter Basis von der FINMA reguliert. EFG Financial Products AG, Zürich, verfügt über eine von der FINMA erteilte Effekthändlerbewilligung und wird auch von der FINMA überwacht. EFG Financial Products (Guernsey) Ltd. unterliegt der konsolidierten Aufsicht von EFG International AG durch die FINMA und ist von keiner Behörde von Guernsey lizenziert oder beaufsichtigt. Für die Emission wurde eine Genehmigung gemäss der "Kreditaufnahme-Verordnungen" (Bailiwick of Guernsey) eingeholt. Weder die Guernsey Financial Services Commission noch der States of Guernsey Policy Council übernimmt Verantwortung für die Bonität der Emission oder für die Korrektheit irgendwelcher gemachter Aussagen.

### Interessenskonflikte

Der Emittent und/oder der Garant und/oder Lead Manager können von Zeit zu Zeit, auf eigene Rechnung oder auf Rechnung eines Dritten, Positionen in Wertschriften, Währungen, Finanzinstrumenten oder anderen Anlagen, welche den Produkten dieses Dokuments als Basiswerte dienen, eingehen, können diese Anlagen kaufen oder verkaufen, können als Market Maker auftreten und gleichzeitig auf der Angebots- wie auch der Nachfrageseite aktiv sein. Die Handels- oder Absicherungsgeschäfte des Emittenten können den Preis des Basiswerts beeinflussen und können einen Einfluss darauf haben, ob der relevante Barrier Level, falls es einen solchen gibt, erreicht wird.

### Vergütungen an Dritte

Unter Umständen verkaufen der Emittent und/oder Lead Manager dieses Produkt an Finanzinstitutionen oder Zwischenhändler mit einem Discount zum Verkaufspreis, oder sie erstatten einen gewissen Betrag an diese Käufer zurück (es wird auf den Abschnitt „Generelle Information“ verwiesen, wo allfällige Vertriebsentschädigungen offengelegt werden).

Zusätzlich können der Emittent und/oder Lead Manager für erbrachte Leistungen zur Qualitätssteigerung und im Zusammenhang mit zusätzlichen Dienstleistungen in Bezug auf die von der EFG Financial Products AG oder EFG Financial Products (Guernsey) Ltd. emittierten Produkten, periodische Entschädigungen („trailer fees“) an Vertriebspartner bezahlen.

Weitere Informationen können verlangt werden.

#### Kein Angebot

Das indikative Termsheet sollte nicht als ein Angebot oder als eine Empfehlung oder Aufforderung, ein Geschäft abzuschliessen, betrachtet werden; auch kann es nicht als Anlageempfehlung verstanden werden.

#### Keine Gewähr

Der Emittent kann keine Gewähr leisten für irgendwelche Informationen in diesem Dokument, welche er von unabhängigen Quellen bezogen hat oder die von solchen Quellen abgeleitet sind.

#### Verkaufsrestriktion

In keiner Jurisdiktion, in welcher eine Verkaufsrestriktion besteht, ist irgendetwas unternommen worden oder wird irgendetwas unternommen, was den öffentlichen Vertrieb der Produkte erlauben würde, es sei denn, dies sei explizit in der Produkte Dokumentation erwähnt. Die Produkte müssen in Übereinstimmung mit sämtlichen anwendbaren Verkaufsbeschränkungen in den jeweiligen Jurisdiktionen verkauft werden.

## Information zur Pfandbesicherung

---

Dieses Produkt (im Folgenden «Pfandbesichertes Produkt») ist nach den Vorschriften des «Rahmenvertrages für Pfandbesicherte Zertifikate» der SIX Swiss Exchange («Rahmenvertrag») besichert.

Der Emittent hat den Rahmenvertrag zusammen mit der EFG Financial Products AG («Sicherungsgeber») am 15. September 2009 abgeschlossen, und der Sicherungsgeber ist zur Sicherstellung des jeweiligen Wertes der Pfandbesicherten Produkte zu Gunsten von SIX Swiss Exchange verpflichtet. Die Rechte der Anleger im Zusammenhang mit der Besicherung der Produkte ergeben sich aus dem Rahmenvertrag. Die Grundzüge der Besicherung sind in einem Informationsblatt der SIX Swiss Exchange zusammengefasst, welches auf «[www.six-swissexchange.com](http://www.six-swissexchange.com)» verfügbar ist. Der Rahmenvertrag wird den Anlegern auf Verlangen vom Emittenten kostenlos in deutscher Fassung oder in englischer Übersetzung zur Verfügung gestellt. Der Rahmenvertrag kann über den Lead Manager an der Brandschenkestrasse 90, Postfach 1686, CH-8027 Zürich (Schweiz), oder via Telefon (+41-(0)58-800 1000), Fax (+41-(0)58-8001010) oder Email ([termsheet@efgfp.com](mailto:termsheet@efgfp.com)) bezogen werden.

Die Kosten für die Dienstleistung der SIX Swiss Exchange zur Besicherung von Pfandbesicherten Produkten, welche derzeit bis zu 15 Basispunkte (0.15%) des Gesamtwertes der hinterlegten Sicherheiten betragen, wie auch die Finanzierungskosten dieser Sicherheiten können in die Preisfindung für ein Pfandbesichertes Produkt einfließen und sind daher allenfalls vom Anleger zu tragen.

Die Auszahlung an die Anleger kann sich aus tatsächlichen oder rechtlichen Gründen verzögern.

Sofern sich die Berechnung des Aktuellen Wertes eines Pfandbesicherten Produktes als fehlerhaft erweist, kann die Besicherung des Pfandbesicherten Produktes ungenügend sein.

Der Emittent kann neben der Primärkotierung der Pfandbesicherten Produkte an der SIX Swiss Exchange eine Sekundärkotierung an weiteren Börsen anstreben. Sämtliche mit einer Sekundärkotierung der Pfandbesicherten Produkte verbundenen Aspekte und Ereignisse sind unter dem Rahmenvertrag unbeachtlich. Insbesondere stellen Ereignisse, welche mit einer Sekundärkotierung der Pfandbesicherten Produkte zusammenhängen, wie die Aussetzung des Market Making an einer Sekundärbörse oder die Dekotierung der Pfandbesicherten Produkte von einer Sekundärbörse, unter dem Rahmenvertrag keinen Verwertungsfall dar. SIX Swiss Exchange ist nach eigenem freien Ermessen berechtigt, den Eintritt eines Verwertungsfallendes sowie die Fälligkeit der Pfandbesicherten Produkte nach dem Rahmenvertrag in den Ländern, in denen eine Sekundärkotierung der Pfandbesicherten Produkte besteht, öffentlich bekannt zu machen sowie die Sekundärbörsen oder sonstigen Stellen darüber zu informieren.

Der aktuelle Wert dieses COSI Produktes wird nach Methode «A (Fair Value)» berechnet. Informationen zur Berechnungsmethode sind auf «[www.six-swissexchange.com](http://www.six-swissexchange.com)» verfügbar.