

Report dei prodotti a partire dal 21.04.2010

Prodotti per l'incremento dei rendimenti
Tipo di prodotto SSPA: 1220 (330)

14.05% p.a. Reverse Convertible on Zurich Financial

Scadenza 21.04.2010; emissione in CHF; non quotato

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	28.04.2009
Prezzo di Emissione	100.00%
Importo di Emissione	CHF 5'000'000 (continua possibilità d'aumento)

Informazioni generali

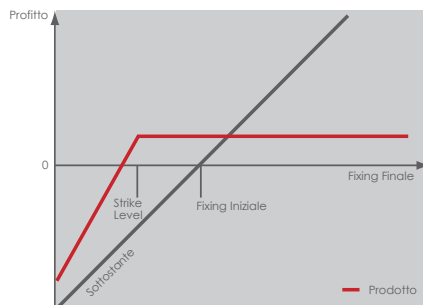
Numero di valore	10085486
ISIN	CH0100854865
Data di Rimborso	28.04.2010 (soggetta a previsioni di Perturbazioni di Settlement)
Denominazione	CHF 1'000
Moneta di Rimborso	CHF
Bond floor all'emissione	100.00% (implied Yield: 0.60%)
Convenzione conteggio del giorno di cedola	30/360; non corretto; maturato a partire dalla Data di Emissione (compresa), la rispettiva data di pagamento viene esclusa.
Quotazione	non quotato
Tipologia di quotazione	I prezzi dei mercati secondari sono quotati come «clean»; l'Importo della Cedola Maturata NON è incluso nei prezzi.
Metodologia di quotazione	I prezzi dei mercati secondari sono quotati in percentuale.
Ai fini del sistema fiscale svizzero, la Cedola è suddivisa in due componenti:	
Componente di interessi	0.60% p.a.
Componente di premio di opzione	13.45% p.a.

Aspettativa di mercato

Il prezzo del Sottostante evolve lateralmente rispetto al suo Fixing Iniziale o leggermente al rialzo. Il valore Sottostante non chiude alla Scadenza a un livello inferiore rispetto al Strike Level.

Descrizione del prodotto

Questo prodotto offre all'Investitore gli interessi di una Cedola indipendentemente dalla performance del Sottostante durante la vita del prodotto. Se il Fixing Finale del Sottostante alla Scadenza è superiore al Strike Level, l'Investitore riceverà la Denominazione alla Data di Rimborso. Oppure, l'Investitore riceverà alla Data di Rimborso o un Pagamento in contanti nella Moneta di Rimborso o una distribuzione di titoli Sottostanti, come descritto nel Scenario di Rimborso qui sotto.



Importo della/e Cedola/e e Data/e di Pagamento delle Cedole

Data di Pagamento della Cedola	Importo della Cedola	L'Importo della Cedola Maturata
28.04.2010	CHF 140.50	CHF 138.16

Sottostanti

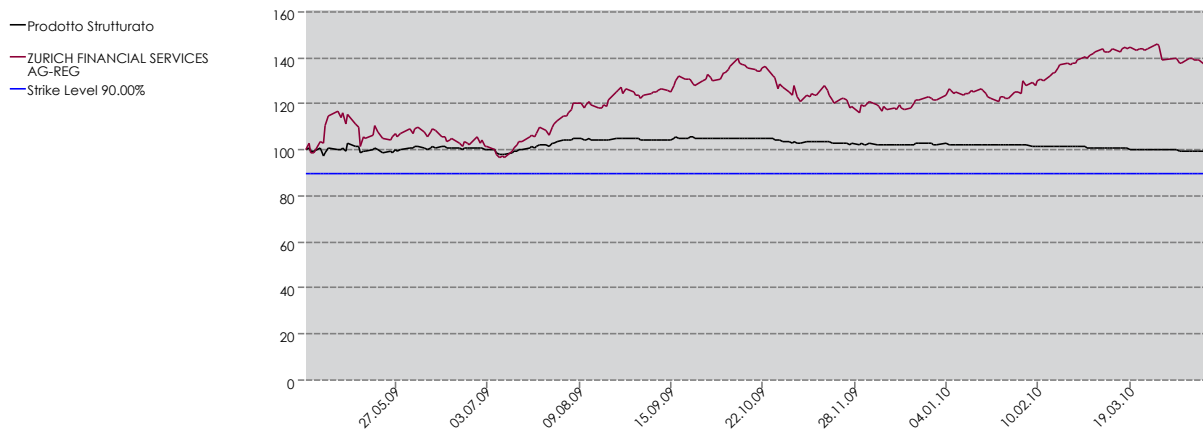
Sottostante/i	Borsa di Riferimento	Bloomberg Ticker	Fixing Iniziale (100%)	Strike Level (90.00%)	Rapporto di Conversione
ZURICH FINANCIAL SERVICES AG-REG	SIX Swiss Exchange	ZURN VX	CHF 185.80	CHF 167.22	5.9801

Performance

	Ultimo prezzo	Questa settimana	Questa Mese	Quest'anno	Dall inizio
Prodotto Strutturato	99.30%	-0.20%	-0.20%	-3.12%	-0.70%
ZURICH FINANCIAL SERVICES AG-REG	CHF 251.50	-2.71%	3.63%	11.04%	35.36%

Termine di Sottoscrizione 21.04.2009	Importo della Cedola CHF 140.50 28.04.2010	Importo della Cedola CHF	Scadenza 21.04.2010		

Performance nel tempo



Sensitività

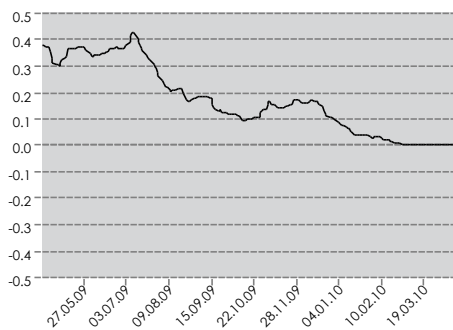
Prodotto Strutturato

ZURICH FINANCIAL SERVICES AG-REG

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
0.00

— Prodotto Strutturato



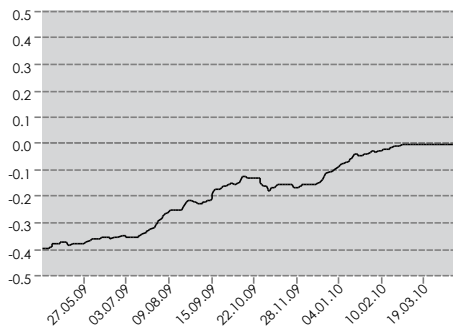
Prodotto Strutturato

ZURICH FINANCIAL SERVICES AG-REG

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
0.00

— Prodotto Strutturato

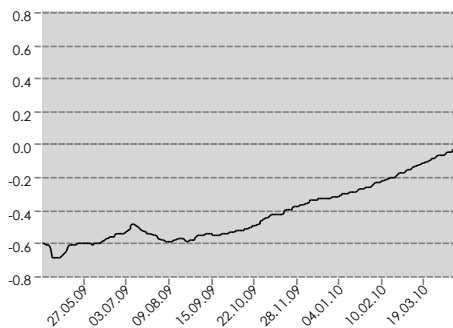


Prodotto Strutturato

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%.

Rhò
0.00

— Prodotto Strutturato



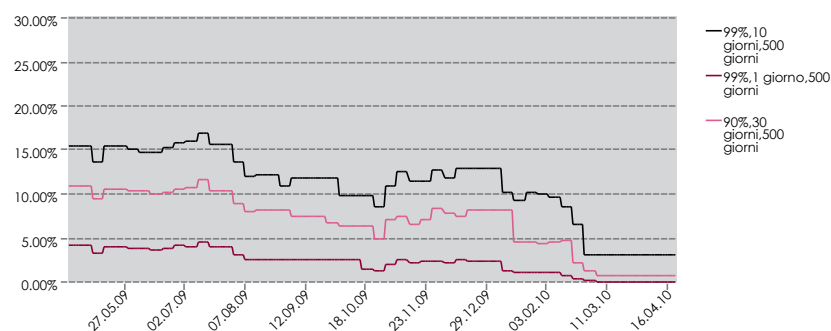
Value at Risk - VaR

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.

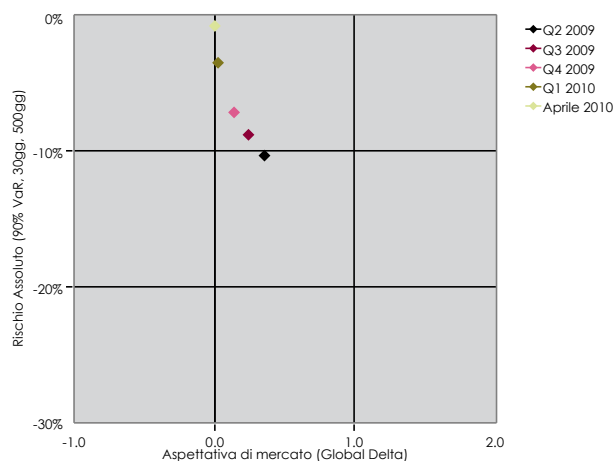
Categoria di rischio*	1	2	3	4	5	6
Intervallo VaR (%)	0 < VaR ≤ 5	5 < VaR ≤ 15	15 < VaR ≤ 30	30 < VaR ≤ 39	39 < VaR ≤ 50	50 < VaR ≤ 100
Rischio	Basso	Moderato	Medio	Medio-Alto	Alto	Molto Alto

*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)	0%
99.00%	10 giorno(i)	500 giorno(i)	3%



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. Gli Investitori troveranno informazioni sull'Emittente e/o il Garante 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).