



DOCUMENTO CONTENENTE LE INFORMAZIONI CHIAVE

Il presente documento contiene le informazioni chiave relative a questo prodotto d'investimento. Non si tratta di un documento promozionale. Le informazioni, prescritte per legge, hanno lo scopo di aiutarvi a capire le caratteristiche, i rischi, i costi, i guadagni e le perdite potenziali di questo prodotto e di aiutarvi a fare un raffronto con altri prodotti d'investimento.

WARRANT SICILY BY CAR S.p.A. – WARRANT B (CODICE ISIN IT0005556599)

Nome del prodotto: Warrant Sicily by Car S.p.A. – Warrant B (Codice ISIN IT0005556599)

Nome dell'ideatore di PRIIP: Sicily by Car S.p.A. (l'“Emittente”)

Sito web dell'ideatore di PRIIP: <https://group.sbc.it>

Per ulteriori informazioni chiamare il numero: +39 0471406107

Autorità competente dell'ideatore di PRIIP per il documento contenente le informazioni chiave: Commissione Nazionale Società e Borsa

Data di realizzazione del documento contenente le informazioni chiave: 2 agosto 2023

ATTENZIONE: STATE PER ACQUISTARE UN PRODOTTO CHE NON È SEMPLICE E PUÒ ESSERE DI DIFFICILE COMPrensione

Cos'è questo prodotto?

Tipo: i Warrant Sicily by Car S.p.A. – Warrant B (i “**Warrant**”) sono strumenti finanziari della categoria delle opzioni su valori mobiliari (Allegato I, sezione C, punto 4 della Direttiva 2014/65/EU del Parlamento Europeo e del Consiglio del 15.5.2014). I Warrant sono al portatore e sono ammessi al sistema di amministrazione accentrata di Monte Titoli S.p.A. (“**Monte Titoli**”) in regime di dematerializzazione ai sensi del Decreto Legislativo 24 giugno 1998, n. 213. I Warrant circolano separatamente dalle azioni cui sono stati abbinati alla data di emissione e sono liberamente trasferibili.

Obiettivi: i Warrant propongono di assegnare all'acquirente il diritto, ma non l'obbligo, di acquistare una determinata quantità (il “**Rapporto di Esercizio**”) di azioni (le “**Azioni di Compendio**”) ad un prezzo prefissato (il “**Prezzo di Sottoscrizione Azioni**”) in qualsiasi momento.

Investitori al dettaglio a cui si intende commercializzare il prodotto: i Warrant sono stati emessi e assegnati gratuitamente ad alcuni azionisti dell'Emittente, in sede di aumento di capitale riservato. Tuttavia, i Warrant sono liberamente negoziabili sul sistema multilaterale di negoziazione Euronext Growth Milan (“**EGM**”) organizzato e gestito da Borsa Italiana S.p.A. e, pertanto, possono essere acquistati da altri investitori al dettaglio. In generale, i Warrant sono destinati ad investitori avanzati, con una buona conoscenza di tale tipologia di strumenti finanziari e con esperienza pregressa con i servizi di investimento. I Warrant sono compatibili con investitori che possono sopportare perdite sino all'ammontare del capitale investito e che hanno una tolleranza al rischio significativa, cioè che sono disposti ad accettare fluttuazioni significative dei prezzi in cambio dell'opportunità di rendimenti maggiori. I Warrant forniscono un'esposizione con leva finanziaria all'andamento del valore delle azioni ordinarie dell'Emittente (il “**Sottostante**”).

Nel caso in cui si verifichi l'evento (la “**Condizione di Esercizio**”) per cui la media aritmetica dei Prezzi Medi Giornalieri del Sottostante nel mese di calendario precedente rispetto al mese di esercizio dei Warrant (il “**Prezzo Medio Mensile**”) sia superiore ad almeno Euro 12,00 (“**Prezzo Soglia**”), i portatori dei Warrant dovranno richiedere di sottoscrivere, al Prezzo di Sottoscrizione Azioni, le Azioni di Compendio entro e non oltre 60 (sessanta) giorni dalla Comunicazione di Esercizio, a pena di decadenza, in ragione del seguente Rapporto di Esercizio:

$$\text{numero Warrant B} \times 0,23$$

Nel caso di avveramento della Condizione di Esercizio, la Comunicazione di Esercizio sarà effettuata dalla Società senza indugio e comunque entro il 2° (secondo) giorno di mercato aperto successivo al termine del mese di riferimento. Le richieste di sottoscrizione dovranno essere presentate secondo i tempi e le modalità previste dal Regolamento dei Warrant.

Nel caso in cui Borsa Italiana S.p.A. disponga la revoca dalle negoziazioni delle azioni della Società e dei Warrant da EGM (la “**Prima Condizione di Accelerazione**”), i portatori dei Warrant potranno richiedere di sottoscrivere Azioni di Compendio, al Prezzo di Sottoscrizione Azioni (Euro 0,10), in qualsiasi momento entro e non oltre la prima data tra (i) il 30° giorno di calendario dalla pubblicazione sul sito della Società del comunicato stampa relativa all'Avveramento della Prima Condizione di Accelerazione (la “**Comunicazione di Accelerazione**”), e (ii) la prima tra le seguenti date (il “**Termine di Decadenza**”): (a) il 5° anno dalla data di efficacia della relativa Operazione Rilevante; e (b) il 30° giorno successivo alla Comunicazione di Esercizio o alla Comunicazione di Accelerazione, a seconda del caso, restando inteso che ove la suddetta data non fosse un giorno di Borsa aperta si intenderà il primo giorno di Borsa aperta successivo. Il Rapporto di Esercizio (numero anche frazionario da arrotondarsi per difetto alla quarta cifra decimale), a condizione che il Prezzo Medio Mensile sia maggiore di Euro 9,263 (il “**Prezzo Strike**”) è calcolato come segue:

$$\frac{\text{Prezzo Medio Mensile} - \text{Prezzo Strike}}{\text{Prezzo Medio Mensile} - \text{Prezzo di Sottoscrizione Azioni}}$$

Allo scadere del 59° (cinquantanovesimo) mese successivo alla data di efficacia dell'Operazione Rilevante in assenza del verificarsi della Condizione di Esercizio e/o della Prima Condizione di Accelerazione (“**Seconda Condizione di Accelerazione**”), i portatori dei Warrant potranno richiedere di sottoscrivere al Prezzo di Sottoscrizione Azioni in qualsiasi momento, a partire dal mese successivo alla data di efficacia dell'Operazione Rilevante, per un numero N di Warrant, Azioni di Compendio in ragione del Rapporto di Esercizio sopra menzionato, a condizione che il Prezzo Medio Mensile sia maggiore del Prezzo Strike.

Nel caso di avveramento della Prima Condizione di Accelerazione o della Seconda Condizione di Accelerazione, la Comunicazione di Accelerazione sarà effettuata dalla Società senza indugio e comunque entro il 2° (secondo) giorno di mercato aperto successivo al verificarsi della Prima Condizione di Accelerazione o della Seconda Condizione di Accelerazione tramite comunicato stampa pubblicato sul sito internet della stessa. Le richieste di sottoscrizione dovranno essere presentate secondo i tempi e le modalità previste dal Regolamento dei Warrant.

Per l'investitore che acquista i Warrant sul mercato, il profitto (o perdita) dell'acquirente sarà pari al prodotto tra l'intero inferiore del Rapporto di Esercizio ("R") e il maggiore tra 0 e la differenza tra il valore del Sottostante e il Prezzo di Sottoscrizione Azioni, nettato del capitale inizialmente investito per l'acquisto dei Warrant ("Capitale Investito") come di seguito illustrato:

$$\text{Profitto (o perdita)} = (R \cdot \max\{0; \text{Valore del Sottostante} - \text{Prezzo di sottoscrizione Azioni}\}) - \text{Capitale Investito}$$

Il valore delle Azioni Ordinarie dell'Emittente al momento di esercizio del Warrant è calcolato sulla base di regole predefinite dall'EGM. La relazione tra il valore dei Warrant e il valore del Sottostante non è lineare. Il valore del contratto dipende dal valore e dalle aspettative sulla volatilità del Sottostante, dividendi, tassi d'interesse e dal Prezzo Soglia. L'esercizio dei Warrant sarà in ogni caso sospeso nel Periodo Ristretto, come previsto nel Regolamento Warrant. Per ulteriori informazioni relative alle condizioni di esercizio dei Warrant, si faccia riferimento al Regolamento dei Warrant.

QUALI SONO I RISCHI E QUAL È IL POTENZIALE RENDIMENTO?

Indicatore sintetico di rischio

1	2	3	4	5	6	7
---	---	---	---	---	---	---

←—————→
 Rischio più basso Rischio più alto

L'indicatore sintetico di rischio presuppone che il prodotto sia mantenuto fino alla data di esercizio del Warrant. L'indicatore sintetico di rischio è un'indicazione orientativa del livello di rischio dei Warrant rispetto ad altri prodotti. Esso esprime la probabilità che il prodotto subisca perdite monetarie a causa di movimenti del mercato di riferimento.

Abbiamo classificato questo prodotto al livello 7 su 7 che corrisponde alla classe di rischio più alta.

Ciò significa che le perdite potenziali dovute alla *performance* futura del Warrant sono classificate nel livello molto alto e che è molto probabile che le cattive condizioni di mercato influenzino la nostra capacità di pagarvi quanto dovuto.

Questo prodotto non comprende alcuna protezione dalla *performance* futura del mercato; pertanto, potreste perdere il vostro investimento o parte di esso.

Scenari di performance: Ai fini della rappresentazione degli scenari di performance questa sezione fa riferimento a una posizione aperta che prevede un investimento pari a Euro 10.000 a cui corrispondono n.17.241 Warrant acquistati ad un prezzo di mercato rilevato al 02/08/2023 (il "**Prezzo di mercato**"), pari ad Euro 0,58.



Questo grafico mostra la possibile *performance* dell'investimento e include il profitto (perdita) atteso dell'investitore in considerazione degli andamenti del Sottostante e delle condizioni legate al realizzo dei Warrant detenuti, così come descritte del paragrafo "**Cos'è questo prodotto?**". Può essere confrontato con il *payoff* di altri derivati. Il grafico presentato mostra una serie di possibili risultati all'esercizio del Warrant e non è un'indicazione esatta dell'importo del possibile risultato. L'importo del risultato varia a seconda del valore del Sottostante. Per ciascun valore del Sottostante, il grafico mostra quale sarebbe il profitto (o la perdita) del prodotto. L'asse orizzontale mostra i diversi valori possibili del Sottostante, mentre l'asse verticale mostra il profitto (o la perdita).

Se acquistate questo prodotto vuol dire che secondo voi il prezzo del Sottostante aumenterà. La vostra perdita massima sarebbe la perdita di tutto il vostro investimento.

Le cifre riportate comprendono tutti i costi del prodotto in quanto tale, ma possono non comprendere tutti i costi da voi pagati al consulente o al distributore. Le cifre non tengono conto della vostra situazione fiscale personale, che può incidere anch'essa sull'importo del rimborso. Nel caso in cui i Warrant non siano esercitati entro il termine di decadenza del contratto, indicato nella sezione "**Per quanto tempo devo detenerlo? Posso ritirare il capitale prematuramente?**", i Warrant decadranno da ogni diritto divenendo privi di validità ad ogni effetto. In tal caso, la perdita dell'investitore al dettaglio sarà pari all'intero capitale investito.

COSA ACCADE SE SICILY BY CAR S.P.A. NON È IN GRADO DI CORRISPONDERE QUANTO DOVUTO?

In caso di insolvenza o assoggettamento della Società a procedura fallimentare o altra procedura concorsuale, l'investitore potrebbe perdere l'intero capitale investito. La Società non è controparte di alcuna transazione sui Warrant e non è pertanto responsabile per conto del relativo compratore. I contratti negoziati sul mercato sono garantiti sulla controparte centrale del mercato (i.e., Cassa di Compensazione e garanzia S.p.A., denominata anche "Euronext Clearing"). Il sistema di garanzia gestito da Euronext Clearing ha l'obiettivo di eliminare il rischio di controparte, proteggendo acquirenti e venditori dall'impossibilità di onorare gli obblighi derivanti dai contratti stipulati.

QUALI SONO I COSTI?

Andamento dei costi nel tempo

Scenari	In caso di esercizio del Warrant
Costi totali	0,00
Impatto sul rendimento (RIY) per anno	0,0%

Composizione dei costi

La seguente tabella presenta:

- l'impatto, per ciascun anno, dei differenti tipi di costi sul possibile rendimento dell'investimento alla fine del periodo di detenzione raccomandato,
- il significato delle differenti categorie di costi.

Questa tabella presenta l'impatto dei costi sul rendimento dell'investimento

Costi una tantum	Costi di ingresso	0,0%	Impatto dei costi da sostenere al momento della sottoscrizione dell'investimento.
	Costi di uscita	0,0%	Impatto dei costi di uscita dall'investimento.
Costi correnti	Costi di transazione del portafoglio	0,0%	Impatto dei nostri costi di acquisto e vendita degli investimenti sottostanti per il prodotto.
	Altri costi correnti	0,0%	Impatto che tratteniamo ogni anno per gestire i vostri investimenti.
Costi accessori	Commissioni di performance	0,0%	Impatto della commissione di <i>performance</i> . Tratteniamo questa commissione dal vostro investimento se la <i>performance</i> del prodotto supera il suo parametro di riferimento.
	Carried interests (commissioni di overperformance)	0,0%	Impatto dei <i>carried interests</i> . Tratteniamo questa commissione se l'investimento ha ottenuto una <i>performance</i> superiore a una percentuale stabilita. Dopo l'uscita dall'investimento sarà effettuato un pagamento pari a una percentuale del rendimento finale.

I soggetti che agiscono come distributori o consulenti dell'investitore al dettaglio possono richiedere costi correlati a transazioni sullo strumento. I costi richiesti da tali soggetti non sono in alcun modo sotto il controllo dei Warrant.

PER QUANTO TEMPO DEVO DETENERLO? POSSO RITIRARE IL CAPITALE PREMATURAMENTE?

Questo prodotto non prevede un periodo di investimento minimo o raccomandato da parte della Società. Tuttavia, il termine di decadenza del contratto è la prima tra le seguenti date: (i) il quinto anno dalla data di efficacia della relativa Operazione Rilevante, (ii) il trentesimo giorno successivo alla Comunicazione di Esercizio o alla Comunicazione di Accelerazione, a seconda del caso (fatto salvo quanto previsto ai paragrafi 3.2 e 3.5 del Regolamento del Warrant), restando inteso che ove la suddetta data non fosse un giorno di Borsa aperta si intenderà il primo giorno di Borsa aperta successivo.

COME PRESENTARE I RECLAMI?

Per reclami sul contenuto del presente documento o sulle informazioni fornite dalla Società in merito a questo prodotto è possibile contattare l'Emittente al seguente indirizzo di posta elettronica sicilybycar@pec.it. Per reclami in merito alle informazioni e ai servizi offerti dal proprio intermediario, è necessario rivolgersi direttamente al proprio intermediario.

ALTRE INFORMAZIONI RILEVANTI

Informazioni più dettagliate sul prodotto sono contenute nel Regolamento dei Warrant, disponibile nella sezione Investor Relations del sito *internet*: <https://group.sbc.it>. Tutte le comunicazioni della Società ai portatori dei Warrant verranno effettuate, ove non diversamente disposto dalla legge, mediante comunicato stampa pubblicato sul medesimo sito *internet*.