

DOCUMENTO CONTENENTE LE INFORMAZIONI CHIAVE

Scopo

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

Prodotto

Si segnala che alla data del presente documento non vi è certezza che i Diritti di Opzione (come di seguito definiti) costituiscano un "prodotto di investimento al dettaglio preassemblato" ("PRIIP") e siano, pertanto, soggetti al Regolamento (UE) n. 1286/2014 e alla relativa normativa di attuazione. Ciononostante, CleanBnB S.p.A. (l'"Emittente") in via prudenziale ha deciso di trattare i Diritti di Opzione come PRIIP, di assumerne il ruolo di ideatore e di redigere conseguentemente il presente documento.

Nome: Diritti di Opzione su azioni di nuova emissione dell'Emittente ("Diritti di Opzione"). **Codice ISIN Diritti di Opzione:** IT0005451296. **Codice ISIN per l'Offerta dell'Inoptato:** IT0005451312

Emittente e Ideatore del Prodotto: CleanBnB S.p.A., con sede legale a Milano (MI), Piazza Velasca n. 7/9, codice fiscale, partita IVA e numero di iscrizione al Registro delle Imprese di Milano-Monza-Brianza-Lodi n. 09365370965, REA n. MI-2085782, telefono: +39 342 8658065 e sito web: www.cleanbnb.net.

Autorità Competente: Commissione Nazionale per le Società e la Borsa (CONSOB)

Data di produzione del documento: 28 giugno 2021

STATE PER ACQUISTARE UN PRODOTTO CHE NON È SEMPLICE E PUÒ ESSERE DI DIFFICILE COMPrensIONE

Cos'è questo Prodotto?

Tipo: i Diritti di Opzione su azioni sono strumenti finanziari derivati che attribuiscono al possessore (investitore) un'opzione di tipo "call" e, in particolare, il diritto, ma non l'obbligo, di sottoscrivere una quantità di azioni di nuova emissione (attività sottostante) a un prezzo predefinito in un periodo prestabilito e secondo un determinato rapporto.

I Diritti di Opzione oggetto del presente documento spettano agli azionisti dell'Emittente e sono da esercitarsi in proporzione alle azioni dagli stessi possedute nell'ambito dell'aumento di capitale a pagamento in via scindibile e in opzione deliberato dal Consiglio di Amministrazione del 23 giugno 2021 in esercizio della delega conferita dall'Assemblea straordinaria dei soci in data 11 giugno 2021. In particolare, tale aumento di capitale concerne massime n. 1.657.330 azioni ordinarie di nuova emissione ("Nuove Azioni"), prive di valore nominale, aventi le stesse caratteristiche delle azioni ordinarie dell'Emittente in circolazione e con godimento regolare, da offrire in opzione agli aventi diritto al prezzo di sottoscrizione pari a Euro 1,20 per ciascuna Nuova Azione ("Prezzo di Offerta"), nel rapporto di n. 5 Nuove Azioni ogni n. 21 azioni possedute (controvalore massimo dell'offerta in opzione pari a Euro 1.988.796,00), previa rinuncia da parte dell'azionista di maggioranza al numero di diritti di opzione necessario alla quadratura dell'operazione ("Aumento di Capitale").

I Diritti di Opzione saranno negoziabili sul sistema multilaterale di negoziazione AIM Italia organizzato e gestito da Borsa Italiana S.p.A. ("AIM Italia") dal 28 giugno 2021 al 12 luglio 2021 compresi ("Periodo di Negoziazione"), con le modalità di seguito indicate. I Diritti di Opzione potranno essere esercitati, a titolo di decadenza, dal 28 giugno 2021 al 16 luglio 2021 compresi ("Periodo di Opzione") ai sensi dell'art. 2441, comma 1, del Codice Civile.

Le Nuove Azioni sottoscritte entro la fine del Periodo di Opzione saranno accreditate sui conti degli intermediari autorizzati aderenti al sistema di gestione accentrata di Monte Titoli S.p.A. al termine della fase di regolamento dell'ultimo giorno del Periodo di Opzione con disponibilità in pari data. I Diritti di Opzione che risulteranno eventualmente non esercitati al termine del Periodo di Opzione saranno offerti su AIM Italia dall'Emittente, ai sensi dell'art. 2441, comma 3, del Codice Civile, entro il mese successivo al termine di quest'ultimo ("Offerta dell'Inoptato").

Data di emissione dei Diritti di Opzione: 23 giugno 2021. **Valuta:** Euro. **Data di stacco dei Diritti di Opzione e di inizio negoziazioni:** 28 giugno 2021. **Lotto minimo di negoziazione:** 1 (uno)

Attività sottostante: azioni ordinarie CleanBnB S.p.A. ("Azioni") – ISIN: IT0005377277. **Valuta:** Euro.

Obiettivi: l'obiettivo del Prodotto è quello di attribuire al possessore (investitore) il diritto di sottoscrivere, nel Periodo di Opzione, le Nuove Azioni nel rapporto di n. 5 Nuove Azioni ogni n. 21 Azioni possedute, al prezzo unitario di Euro 1,20 per Nuova Azione ("Prezzo d'Offerta"). Nel caso in cui non vengano esercitati entro il termine del Periodo di Opzione, i Diritti di Opzione decadranno dal proprio valore. In caso di mancata vendita sul mercato e/o mancato esercizio dei Diritti di Opzione entro, rispettivamente, il termine del Periodo di Negoziazione (i.e. 12 luglio 2021) e il termine del Periodo di Opzione (i.e. 16 luglio 2021), l'azionista dell'Emittente decadrà dalla possibilità di vendere sul mercato e/o esercitare ciascun Diritto di Opzione rimasto non venduto e/o inoptato a tali date, senza che gli venga riconosciuto alcun indennizzo, rimborso delle spese ovvero beneficio economico di qualsivoglia natura.

Questa tipologia di prodotto fornisce un'esposizione con leva finanziaria legata all'andamento del valore di mercato delle azioni ordinarie dell'Emittente. L'avente diritto potrà decidere di sottoscrivere, al Prezzo d'Offerta, le Nuove Azioni esercitando i Diritti di Opzione acquistati sul mercato.

Posizione del possessore (investitore) del Diritto di Opzione acquistato sul mercato (AIM Italia)

Il profitto (o la perdita) per coloro che acquisteranno i Diritti di Opzione sul mercato sarà pari al prodotto tra il numero di Nuove Azioni sottoscritte ("N") a fronte dell'esercizio dei Diritti di Opzione acquistati ("M") e il maggiore tra zero e la differenza tra (a) il prezzo di mercato delle azioni dell'Emittente (il "Sottostante") al momento dell'esercizio dei Diritti di Opzione e (b) il Prezzo d'Offerta, al netto del prezzo pagato per l'acquisto degli M Diritti di Opzione (il "Premio") e dei costi totali sostenuti su di essi (i "Costi"), come mostrato nella seguente formula:

$$\text{Profitto} = [N \times \max(0, \text{Sottostante} - \text{Prezzo d'Offerta})] - \text{Premio} - \text{Costi, dove } N=M*5/21$$

Come mostrato nella sezione "Scenari di Performance", l'investimento è pari a Euro 10.000 e corrisponde all'importo complessivo investito sia per l'acquisto dei Diritti di Opzione che, nel caso di esercizio di tali Diritti di Opzione, per il pagamento del Prezzo d'Offerta per ogni Nuova Azione sottoscritta. Pertanto, in caso di mancato esercizio, la perdita deriva esclusivamente dal prezzo pagato per l'acquisto dei Diritti di Opzione, quest'ultimo ottenuto come prodotto tra il numero di Diritti di Opzione acquistati e il prezzo di mercato dei Diritti di Opzione (il "Valore Teorico Iniziale"). Come descritto nella sezione "Scenari di Performance", il Valore Teorico Iniziale è stato comunicato da Borsa Italiana il 25 giugno 2021 (pari a Euro 0,0595).

Posizione del possessore (investitore) del Diritto di Opzione già detenuto in quanto già azionista dell'Emittente

La posizione di coloro, invece, che sono già azionisti dell'Emittente, in conseguenza dell'emissione delle Nuove Azioni, si modifica sia in caso di integrale esercizio dei Diritti di Opzione sia in caso di mancato esercizio.

Il profitto (o la perdita) per il singolo azionista che deciderà di sottoscrivere integralmente i Diritti di Opzione conferitigli dipenderà dai seguenti fattori: il numero di vecchie azioni ordinarie detenute, il numero di Nuove Azioni acquistate mediante tali Diritti di Opzione al Prezzo d'Offerta, il prezzo di mercato del Sottostante successivamente alla data di avvio dell'Aumento di Capitale e il prezzo



di mercato del Sottostante prima della data di avvio dell'Aumento di Capitale. Pertanto, il profitto (o la perdita) sarà pari al controvalore di mercato del Sottostante successivamente alla data di avvio dell'Aumento di Capitale al netto dell'esborso sostenuto per l'esercizio delle Nuove Azioni al Prezzo d'Offerta e della posizione economica dell'azionista prima della data di avvio dell'Aumento di Capitale.

Il profitto (o la perdita) per il singolo azionista che deciderà di non esercitare nessun Diritto di Opzione per l'acquisto di Nuove Azioni dipenderà dai seguenti fattori: il prezzo di mercato del Sottostante successivamente alla data di avvio dell'Aumento di Capitale, il prezzo di mercato del Sottostante prima della data di avvio dell'Aumento di Capitale, il valore di mercato dei Diritti di Opzione. Pertanto, il profitto (o la perdita) è pari alla differenza tra il prezzo di mercato del Sottostante successivamente alla data di avvio dell'Aumento di Capitale e il prezzo di mercato del Sottostante prima della data di avvio dell'Aumento di Capitale moltiplicato per il numero delle vecchie azioni ordinarie possedute.

Si noti che a tale profitto (o perdita) si aggiunge l'effetto economico derivante dalla possibile vendita dei Diritti di Opzione non esercitati che sono stati riconosciuti gratuitamente dall'Emittente ai possessori di azioni ordinarie.

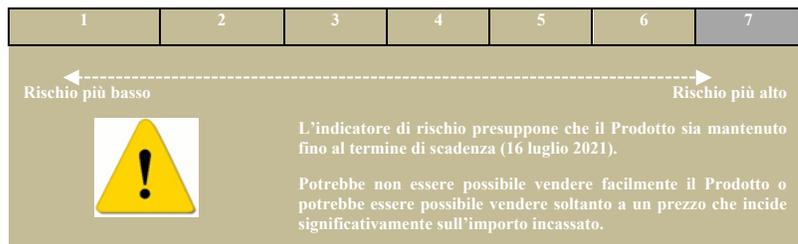
Esercizio dei Diritti: i Diritti di Opzione dovranno essere esercitati, a pena di decadenza, presentando la richiesta di sottoscrizione delle Nuove Azioni, entro il 16 luglio 2021 (compreso) ("Termine Ultimo per l'Esercizio"). Pertanto, a partire dalla data successiva al Termine Ultimo per l'Esercizio, i Diritti di Opzione per i quali non sia stata presentata una richiesta di sottoscrizione diverranno privi di effetto. Nel Periodo di Opzione l'adesione all'offerta di sottoscrizione dovrà avvenire mediante apposito modulo di adesione, reso disponibile sul sito web dell'Emittente, da compilare, sottoscrivere e consegnare presso l'intermediario autorizzato, aderente al sistema di gestione accentrata gestito da Monte Titoli. Il Prezzo di Offerta delle Nuove Azioni dovrà essere integralmente versato presso l'intermediario autorizzato presso il quale è stata presentata la richiesta di sottoscrizione, secondo termini e modalità indicati nel modulo di adesione.

Investitori al dettaglio a cui si intende commercializzare il Prodotto: i Diritti di Opzione sono assegnati dall'Emittente a coloro che risultano titolari di azioni ordinarie dell'Emittente alla data di avvio dell'Aumento di Capitale e di stacco dei Diritti di Opzione, ai sensi delle norme di legge e regolamentari applicabili alle società con azioni quotate su AIM Italia. I Diritti di Opzione saranno compravendibili su AIM Italia dai relativi titolari e dagli investitori durante il periodo sopra indicato, tuttavia non saranno oggetto di una specifica attività di commercializzazione in considerazione della disciplina di cui all'art. 2441 del Codice Civile agli stessi applicabile. In caso di dubbi sulla compatibilità dei Diritti di Opzione con le proprie conoscenze finanziarie, profilo di rischio e obiettivi di investimento, l'investitore deve contattare il proprio broker ovvero il proprio consulente finanziario per ottenere i necessari chiarimenti. In ogni caso i Diritti di Opzione sono strumenti adatti ad investitori che siano disposti a subire perdite in conto capitale fino al 100% del loro investimento o che abbiano una propensione al rischio molto alta o che non ricerchino una garanzia di redditività o rendita certa. Al termine del Periodo di Opzione, infatti, i Diritti di Opzione potrebbero anche risultare *out of the money*, con la conseguenza che il loro esercizio potrebbe non essere economicamente conveniente. In tal caso gli investitori perderebbero l'intero valore del loro investimento effettuato nei Diritti di Opzione.

Quali sono i rischi e qual è il potenziale rendimento?

Indicatori di rischio

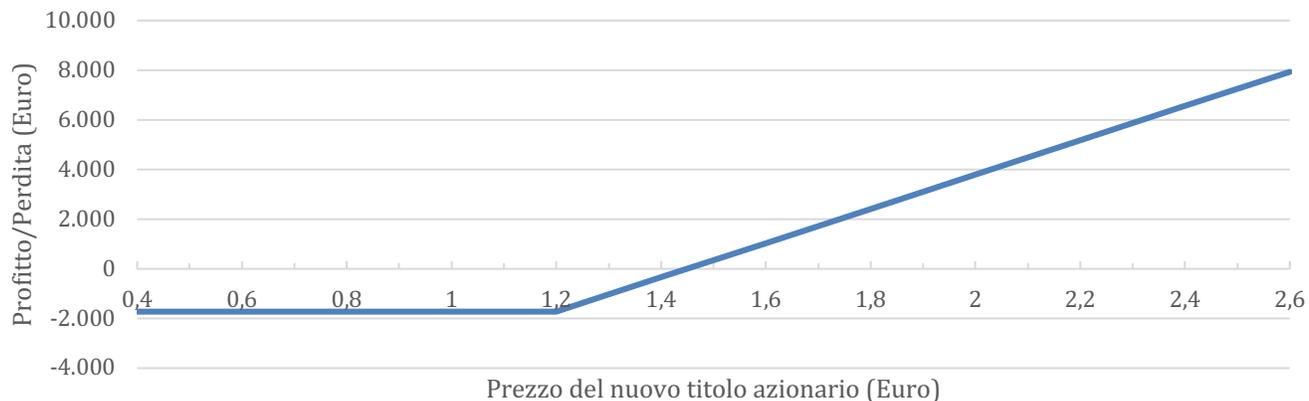
L'indicatore sintetico di rischio è un'indicazione orientativa del livello di rischio di questo Prodotto rispetto ad altri prodotti. Esso esprime la probabilità che il Prodotto subisca perdite monetarie a causa di movimenti sul mercato. Abbiamo classificato questo prodotto al livello 7 su 7, che corrisponde alla classe di rischio più alta. Questo Prodotto non comprende alcuna protezione dalla performance futura del mercato; pertanto potreste perdere l'intero controvalore dei Diritti di Opzione e/o il vostro intero investimento o parte di esso (nel caso in cui il prezzo dell'attività sottostante sul mercato sia inferiore al Prezzo di Offerta).



Scenari di Performance

Ai fini della rappresentazione grafica degli scenari di performance al momento dell'esercizio dei Diritti di Opzione, questa sezione fa riferimento ad un ipotetico investimento massimo di Euro 10.000 effettuato da un investitore che acquisti i Diritti di Opzione su AIM Italia. Si precisa ulteriormente che, soltanto come finalità espositiva e di rappresentazione grafica, il numero dei Diritti di Opzione è stato arrotondato all'intero più vicino. Il Prezzo di Equilibrio delle Azioni necessario per il calcolo del Valore Teorico Iniziale, pari a Euro 0,0595, è stato comunicato da Borsa Italiana il 25 giugno alle ore 18.05 ed è pari ad Euro 1,45. In questa rappresentazione, tale Valore Teorico Iniziale è ipotizzato costante, ma durante il Periodo di trattazione del Diritto di Opzione potrà essere soggetto a variazioni di prezzo. L'investimento iniziale di Euro 10.000 comprende un Premio pari a Euro 1.724 che permette di acquistare n. 28.968 Diritti di Opzione al Valore Teorico Iniziale e di esercitare, in condizioni di convenienza (prezzo di mercato del Sottostante maggiore del Prezzo di Sottoscrizione incrementato del prezzo dei Diritti di Opzione), n. 6.897 Nuove Azioni CleanBnB S.p.A. al Prezzo di Sottoscrizione il cui controvalore è pari alla data di esercizio a Euro 8.276. La Somma dei due importi corrisponde a circa Euro 10.000. È possibile aprire la posizione pagando un Premio dei Diritti di Opzione diverso da quanto presentato, a seconda delle condizioni dei mercati e delle caratteristiche specifiche del contratto negoziato. Questo grafico mostra la possibile performance del prodotto al momento dell'esercizio dei Diritti di Opzione da parte dell'acquirente di tali Diritti di Opzione su AIM Italia. Può essere confrontato con il payoff di altri derivati. Il grafico presentato mostra una serie di possibili risultati all'esercizio 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). Chi acquista questo prodotto ritiene, ragionevolmente, che il prezzo del Sottostante sarà, al momento dell'esercizio, al di sopra di: Prezzo di Sottoscrizione + Premio (per unità di Diritti di Opzione acquisiti) + Costi totali sostenuti (per unità di Diritti di Opzione acquisiti). La perdita massima sarebbe la perdita di tutto l'investimento, ovvero il premio relativo all'acquisto dei Diritti di Opzione. 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 disinvestito. Nel caso in cui i Diritti di Opzione non siano esercitati entro il termine del Periodo di Opzione, i Diritti di Opzione decadranno da ogni diritto divenendo privi di validità ad ogni effetto. In tal caso, la perdita dell'investitore al dettaglio sarà pari al Premio. Come descritto nel paragrafo Obiettivi della sezione "Cos'è questo prodotto?", la posizione dell'azionista, in virtù dell'emissione delle Nuove Azioni CleanBnB, si modifica sia in caso di integrale esercizio dei Diritti di Opzione sia in caso di mancato esercizio e in questa sezione non vengono rappresentati i relativi scenari di performance.

Profitto/Perdita derivante dall'esercizio dei Diritti di Opzione



Cosa accade se l'Emittente non è in grado di corrispondere quanto dovuto?

I Diritti di Opzione non danno diritto alla corresponsione di alcuna somma di denaro da parte dell'Emittente, né a titolo di capitale o interessi né a qualsivoglia altro titolo. I Diritti di Opzione conferiscono ai rispettivi portatori esclusivamente il diritto di sottoscrivere Nuove Azioni nel rapporto e nei termini suindicati. Ad ogni modo, questo prodotto non è coperto da alcun sistema di indennizzo o garanzia dell'investitore.

Quali sono i costi?

Andamento dei costi nel tempo: la diminuzione del rendimento (**Reduction in Yield – RIY**) esprime l'impatto dei costi totali sostenuti (diversi dal costo implicito di uscita) sul possibile rendimento dell'investimento. I costi totali tengono conto dei costi *una tantum*, correnti e accessori. La persona che vende questo Prodotto o fornisce consulenza riguardo ad esso potrebbe addebitare altri costi, nel qual caso deve fornire informazioni su tali costi e illustrare l'impatto di tutti i costi sull'investimento nel corso del tempo.

Composizione dei costi: l'Emittente non applica costi per l'acquisto o l'esercizio dei Diritti di Opzione. Gli intermediari potrebbero applicare costi o richiedere commissioni sia ai fini dell'acquisto dei Diritti di Opzione sia sul mercato che per il loro successivo esercizio. I costi richiesti da tali soggetti non sono in alcun modo sotto il controllo dell'Emittente.

Per quanto tempo devo detenerlo? Posso ritirare il capitale prematuramente?

I Diritti di Opzione hanno una durata limitata nel tempo e danno diritto esclusivamente a sottoscrivere Nuove Azioni nel rapporto suindicato. Coloro, pertanto, che non avranno esercitato i Diritti di Opzione dagli stessi posseduti entro il 16 luglio 2021, perderanno i propri Diritti di Opzione, senza avere diritto al pagamento di alcun importo in denaro da parte dell'Emittente. Del pari, coloro che acquisteranno i Diritti di Opzione dovranno esercitare tali diritti entro lo stesso termine. I Diritti di Opzione non esercitati entro il 16 luglio 2021 torneranno automaticamente nella disponibilità dell'Emittente, che li offrirà sul mercato AIM Italia di Borsa Italiana S.p.A., entro il mese successivo alla fine del Periodo di Opzione, per almeno due sedute, ai sensi dell'art. 2441, comma 3, del Codice Civile nell'ambito dell'Offerta dell'Inoptato. Coloro che acquisteranno i Diritti di Opzione nell'ambito dell'offerta sul mercato AIM Italia dovranno esercitare tali diritti entro il termine che sarà comunicato dall'Emittente. Scaduto tale termine senza che siano esercitati, i Diritti di Opzione saranno annullati e nulla sarà dovuto dall'Emittente ai rispettivi portatori. In normali condizioni di mercato il prodotto è negoziato su AIM Italia. Pur essendo scambiati su tale mercato in negoziazione continua non è possibile garantire che si formi o si mantenga un mercato liquido per le opzioni emesse dall'Emittente. Tale circostanza potrebbe comportare un rischio di liquidità rilevante, indipendentemente dall'andamento dell'Emittente in quanto le richieste di vendita potrebbero non trovare adeguate e tempestive contropartite, nonché essere soggette a fluttuazioni anche significative del prezzo.

Come presentare reclami?

Qualora vogliate presentare un reclamo riguardante i Diritti di Opzione o la condotta dell'Emittente quale Emittente ed Ideatore del Prodotto, potrete presentare tale reclamo con una delle seguenti modalità: (i) raccomandata A/R da trasmettere all'indirizzo: CleanBnB S.p.A., Piazza Velasca n. 7/9, 20122 Milano (MI); (ii) email all'indirizzo: equity@cleanbnb.it. Eventuali reclami relativi alla condotta del consulente o distributore, se presenti, andranno inviati al consulente o al distributore, secondo le procedure da questi previste.

Altre informazioni rilevanti

Per maggiori informazioni in merito ai Diritti di Opzione e alle Nuove Azioni si rinvia al sito internet dell'Emittente, sezione Investor Relations, www.cleanbnb.net.

