ALLEGATO 1
Quantificazione dei livelli di quota minima

Ultimo aggiornamento: 3 febbraio 2026

GRUPPO Banco BPM – Il contenuto del presente documento costituisce materiale riservato e soggetto a copyright. Ogni violazione sarà perseguita ai sensi di legge.

Classificazione tipologia prodotti			
Prodotti di tipologia a) Prodotti che investono in attività ecosostenibili			
GRADIENTE	**BASSO**	**MEDIO**	**ALTO**
Emittenti corporate: percentuali di Revenue / Capex / Opex allineate alla Tassonomia EU	Revenue / Capex / Opex ecosostenibili maggiori o uguali di 5% e minori di 10%	Revenue / Capex / Opex ecosostenibili maggiori o uguali di 10% e minori di 15%	Revenue / Capex / Opex ecosostenibili maggiori o uguali di 15%
Prodotti di risparmio gestito: percentuali di investimento in strumenti allineati alla Tassonomia EU	Maggiore o uguale di 5% e minore di 10%	Maggiore o uguale di 10% e minore di 15%	Maggiore o uguale di 15%
Prodotti di tipologia b) Prodotti che investono in imprese che rispettano pratiche di buona governance le cui attività economiche contribuiscono a un obiettivo ambientale e/o sociale			
GRADIENTE	**BASSO**	**MEDIO**	**ALTO**
Emittenti corporate: percentuali di Revenue Sostenibili (RS) ed ESG Risk Score[1]	RS maggiori o uguali di 6% e minori di 23% se ESG Risk Basso / Medio	RS maggiori o uguali di 6% e minori di 23% se ESG Risk Molto Basso OPPURE RS maggiori o uguali di 23% e minori di 63% OPPURE RS maggiori o uguali di 63% se ESG Risk Medio	RS maggiori o uguali di 63% se ESG Risk Molto Basso / Basso
Prodotti di risparmio gestito: percentuali di investimento in strumenti sostenibili (IS)	IS maggiori o uguali di 10% e minori di 20%	IS maggiori o uguali di 20% e minori di 50% OPPURE IS maggiori o uguali di 50% senza esclusioni Climate Transition (CBT) o Paris Alligned (PAB)	IS maggiori o uguali di 50% con esclusioni Climate Transition (CBT) o Paris Alligned (PAB)

[1] Valori e classi di Rischio riferiti alla scala dell'Info Provider di dati ESG Morningstar / Sustainalytics

GRUPPO Banco BPM – Il contenuto del presente documento costituisce materiale riservato e soggetto a copyright. Ogni violazione sarà perseguita ai sensi di legge.

Prodotti di tipologia c) Prodotti finanziari adottano strategie per gestire gli impatti negativi (*Principal Adverse Impact – PAI*) che le scelte di investimento effettuate possono arrecare all'ambiente e alla società			
GRADIENTE	**BASSO**	**MEDIO**	**ALTO**
Solo per i Prodotti di risparmio gestito: Numerosità minima di PAI gestiti	Prodotti articolo 8 ex SFDR con indicatore PAI* < 0,5	Prodotti articolo 8 ex SFDR con indicatore PAI >= 0,5 OPPURE Prodotti articolo 9 ex SFDR con indicatore PAI < 0,5	Prodotti articolo 9 ex SFDR con indicatore PAI >= 0,5 OPPURE Prodotti articolo 9 ex SFDR con politiche di engagement oppure esclusioni CTB e PAB e indicatore PAI* >= 0,25

***INDICATORE PAI** Indicatore calcolato come media aritmetica dei due seguenti indicatori:

- PAI SCORE Banca Aletti: indicatore con range 0-1, che misura l'allineamento dei PAI considerati dal prodotto con quelli prioritizzati dalla Banca. Il peso assegnato nel calcolo della media è pari a 50%
- % PAI CONSIDERATI: indicatore con range 0-1, calcolato come rapporto tra il numero considerati dal prodotto rispetto al numero totale di PAI. Il peso assegnato nel calcolo della media è pari a 50%

L'indicatore può dunque assumere punteggi tra 0 e 1

GRUPPO Banco BPM – Il contenuto del presente documento costituisce materiale riservato e soggetto a copyright. Ogni violazione sarà perseguita ai sensi di legge.