

## Exención intragrupo

### Información sobre la exención a las obligaciones de intercambio de garantías para operaciones OTC intragrupo en virtud del Reglamento sobre la Infraestructura del Mercado Europeo (EMIR)

Según el artículo 11(11) del Reglamento (UE) No 648/2012 (tal y como haya sido modificado) (en adelante, “EMIR”) y el artículo 20 del Reglamento Delegado (UE) No 149/2013, la contraparte de la operación intragrupo que haya quedado exenta del requisito de intercambio de garantías hará pública la información sobre la exención.

CaixaBank, S.A. y Banco BPI, S.A. han sido autorizadas por sus respectivas autoridades locales (CNMV {España} y Banco de Portugal {Portugal}) para aplicar la exención de las obligaciones de intercambio de garantías para operaciones OTC intragrupo. A continuación, se detalla un resumen de las contrapartes para las que es aplicable la exención, la relación entre estas contrapartes, indicando el tipo de exención y los nominales agregados de los contratos de derivados OTC entre ambas partes:

Contraparte 1	Identificador de Entidad Legal (LEI) de la Contraparte 1	Contraparte 2	Identificador de Entidad Legal (LEI) de la Contraparte 2	Relación de las contrapartes (con respecto a la Contraparte 2)	Tipo de exención	Nominal agregado (en mill. EUR) a partir de 24/11/2021
CAIXABANK, S.A.	7CUNS533WID6K7DGF187	BANCO BPI, S.A.	3DM5DPGI3W6OU6GJ4N92	Filial	Completa	Derivados FX: 1.500 Derivados de Tipo de Interés: 15 Renta Variable: 180

CaixaBank, S.A. y Banco BPI, S.A. podrán suscribir periódicamente un Credit Support Annex (CSA) e intercambiar margen de variación.