

PROHIBITION OF SALES TO UK RETAIL INVESTORS – The Securities are not intended to be offered, sold or otherwise made available to, and should not be offered, sold or otherwise made available to, any retail investor in the United Kingdom. For these purposes, a retail investor means a person who is one (or more) of: (i) a retail client, as defined in point (8) of Article 2 of Regulation (EU) No 2017/565 as it forms part of UK domestic law by virtue of the European Union (Withdrawal) Act 2018 (as amended, the "EUWA"); or (ii) a customer within the meaning of the provisions of the Financial Services and Markets Act 2000 (as amended, the "FSMA") and any rules or regulations made under the FSMA to implement Directive (EU) 2016/97, where that customer would not qualify as a professional client, as defined in point (8) of Article 2(1) of Regulation (EU) No 600/2014 as it forms part of UK domestic law by virtue of the EUWA; or (iii) not a qualified investor as defined in Article 2 of Regulation (EU) 2017/1129 as it forms part of UK domestic law by virtue of the EUWA (as amended, the "**UK Prospectus Regulation**"). Consequently, no key information document required by Regulation (EU) No 1286/2014 as it forms part of UK domestic law by virtue of the EUWA (as amended, the "**UK PRIIPs Regulation**") for offering or selling the Securities or otherwise making them available to retail investors in the United Kingdom has been prepared and therefore offering or selling the Securities or otherwise making them available to any retail investor in the United Kingdom may be unlawful under the UK PRIIPs Regulation.

PROHIBITION OF SALES TO SWISS RETAIL INVESTORS – The Securities are not intended to be offered, sold or otherwise made available to and may not be offered, sold or otherwise made available to any retail investor in Switzerland. For these purposes a "retail investor means a person who is not a professional or institutional client, as defined in article 4 para. 3, 4 and 5 and article 5 para. 1 and 2 of the Swiss Federal Act on Financial Services of 15 June 2018, as amended ("**FinSA**"). Consequently, no key information document required by FinSA for offering or selling the Securities or otherwise making them available to retail investors in Switzerland has been prepared and therefore, offering or selling the Securities or making them available to retail investors in Switzerland may be unlawful under FinSA.

None of the Securities constitute a participation in a collective investment scheme within the meaning of the Swiss Federal Act on Collective Investment Schemes ("**CISA**") and are neither subject to the authorisation nor the supervision by the Swiss Financial Market Supervisory Authority FINMA ("**FINMA**") and investors do not benefit from the specific investor protection provided under the CISA.

The Securities and, as applicable, the Entitlements have not been and will not be, at any time, registered under the U.S. Securities Act of 1933, as amended (the "**Securities Act**"), or with any securities regulatory authority of any state or other jurisdiction of the United States. The Securities may not be offered or sold within the United States or to, or for the account or benefit of, U.S. persons (as defined in Regulation S under the Securities Act ("**Regulation S**")) ("**U.S. persons**"), except in certain transactions exempt from the registration requirements of the Securities Act and applicable state securities laws. The Securities are being offered and sold outside the United States to non-U.S. persons in reliance on Regulation S. Trading in the Securities and, as applicable, the Entitlements has not been approved by the U.S. Commodity Futures Trading Commission under the U.S. Commodity Exchange Act of 1936, as amended (the "**Commodity Exchange Act**") and the rules and regulations promulgated thereunder.

There is currently no universally accepted, global framework or definition (legal, regulatory or otherwise) as to what constitutes, an "ESG" (Environmental, Social or Governance), "green", "social", "sustainable", "climate-friendly" or an equivalently-labelled product, or as to what precise attributes are required for a particular investment, product or asset to be defined as "ESG", "green", "social", "sustainable", "climate-friendly" or such other equivalent label; nor can any assurance be given that such a globally accepted definition or consensus will develop over time. Save for any certification, standard, guideline, taxonomy, label and/or other regulatory or index inclusion criteria or voluntary guidelines specified in "*Use of proceeds*" below, the Securities are not intended to satisfy, in whole or in part, any present or future "ESG", "green", "sustainable", "climate-friendly" or equivalently-labelled certification, standard, guideline, taxonomy, label and/or other regulatory or index inclusion criteria or voluntary guidelines with which an investor or its investments may be expected to comply or otherwise seeks to have. For example and without limitation, the Securities are not intended to qualify for the proposed EU Green Bond Standard label; do not take into account any of the EU criteria for environmentally sustainable investments, including as set out under the EU Taxonomy Regulation (Regulation (EU) 2020/852) (or any equivalent regime); or do not qualify as "sustainable investments" as defined under the Sustainable Finance Disclosure Regulations (Regulation (EU) 2019/2088) (or any equivalent regime).

AMENDED AND RESTATED FINAL TERMS



BARCLAYS BANK PLC

(Incorporated with limited liability in England and Wales)

Legal Entity Identifier (LEI): G5GSEF7VJP5I7OUK5573

**EUR 67,000,000 Securities due May 2031 under the Global Structured Securities Programme (the "Tranche 1 Securities")
Issue Price: 99.50 per cent**

The Securities are not intended to qualify as eligible debt securities for purposes of the minimum requirement for own funds and eligible liabilities ("MREL") as set out under the Bank Recovery and Resolution Directive (EU) 2014/59, as amended.

This document constitutes the amended and restated final terms of the Securities (the "**Final Terms**" or the "**Amended and Restated Final Terms**") described herein for the purposes of Article 8 of Regulation (EU) 2017/1129 (as amended, the "**EU Prospectus Regulation**") and is prepared in connection with the Global Structured Securities Programme established by Barclays Bank PLC (the "**Issuer**"). These Amended and Restated Final Terms complete and should be read in conjunction with GSSP EU Base Prospectus which constitutes a base prospectus drawn up as separate documents (including the Registration Document dated 3 April 2024 and the Securities Note relating to the GSSP EU Base Prospectus dated 12 April 2024) for the purposes of Article 8(6) of the EU Prospectus Regulation (the "**Base Prospectus**"), save in respect of the Terms and Conditions of the Securities which are extracted from the 2023 GSSP EU Base Prospectus dated 13 April 2023 (as supplemented on 26 September 2023, 17 October 2023, 16 November 2023 and on 13 December 2023) (the "**2023 GSSP EU Base Prospectus**"). Full information on the Issuer and the offer of the Securities is only available on the basis of the combination of this Amended and Restated Final Terms and the Base Prospectus. A summary of the individual issue of the Securities is annexed to this Amended and Restated Final Terms.

The Base Prospectus and any supplements to the Base Prospectus are available for viewing at: <https://home.barclays/investor-relations/fixed-income-investors/prospectus-and-documents/structured-securities-prospectuses/> and during normal business hours at the registered office of the Issuer and the specified office of the Issue and Paying Agent for the time being in London, and copies may be obtained from such office.

The Registration Document and the supplements thereto and the 2023 GSSP EU Base Prospectus are available for viewing at: <https://home.barclays/investor-relations/fixed-income-investors/prospectus-and-documents/structured-securities-prospectuses/#registrationdocument> and <https://home.barclays/investor-relations/fixed-income-investors/prospectus-and-documents/structured-securities-prospectuses/#registrationdocumentsupplement>.

The Base Prospectus expires on 13 April 2024. The new base prospectus (the "**2024 Base Prospectus**") will be valid from and including on or around 12 April 2024 and will be published on the website of the Issuer <https://home.barclays/investor-relations/fixed-income-investors/prospectus-and-documents/structured-securities-prospectuses/>. Following expiry of the Base Prospectus the offering of the Securities will continue under the 2024 Base Prospectus. The terms and conditions of the securities from the Base Prospectus will be incorporated by reference into the 2024 Base Prospectus and will continue to apply to the Securities.

Words and expressions defined in the Base Prospectus and not defined in the Amended and Restated Final Terms shall bear the same meanings when used herein.

BARCLAYS

Amended and Restated Final Terms dated 24 April 2024

(replacing the Final Terms dated 11 March 2024)

PART A – CONTRACTUAL TERMS

Provisions relating to the Securities

1	(a) Series:	NX00388974
	(b) Tranche:	1
2	Currencies:	
	(a) Issue Currency:	Euro (“ EUR ”)
	(b) Settlement Currency:	EUR
3	Securities:	Notes
4	Notes:	Applicable
	(a) Aggregate Nominal Amount as at the Issue Date:	
	(i) Tranche:	EUR 67,000,000
	(ii) Series:	EUR 67,000,000
	(b) Specified Denomination:	EUR 1,000
	(c) Minimum Tradable Amount:	EUR 1,000 (and EUR 1,000 thereafter)
5	Redeemable Certificates:	Not Applicable
6	Calculation Amount:	EUR 1,000 per Security
7	Issue Price:	99.50 per cent of the Specified Denomination The Issue Price includes a commission element payable by the Issuer to the Authorised Offeror which will be no more than 1.00 per cent. per annum of the Issue Price. Investors in the Securities intending to invest through an intermediary (including by way of introducing broker) should request details of any such commission or fee payment from such intermediary before making any purchase hereof.
8	Issue Date:	11 March 2024
9	Scheduled Settlement Date:	5 May 2031, subject to adjustment in accordance with the Business Day Convention
10	Type of Security:	Index Linked Securities
11	Relevant Annex(es) which apply to the Securities:	Equity Linked Annex
12	Underlying Performance Type _(Interest) :	Single Asset
13	Underlying Performance Type _(Autocall) :	Single Asset
14	Underlying Performance Type _(Settlement) :	For the purpose of determination of the Final Performance: Single Asset
15	Downside Underlying Performance Type _(Settlement) :	Not Applicable
<i>Provisions relating to interest (if any) payable</i>		
16	Interest Type: General Condition 13 (<i>Interest or Coupon</i>)	In respect of each Interest Valuation Date, Snowball
	(a) Interest Payment Dates:	Each of the dates set out in Table 1 below in the column entitled 'Interest Payment Date', subject to adjustment in accordance with the Business Day Convention.
	(b) Interest Valuation Dates:	Each of the dates set out in Table 1 below in the column entitled 'Interest Valuation Date'.

Table 1

T	Interest Valuation Date	Interest Payment Date	Interest Barrier Percentages
2	28 April 2025	05 May 2025	100.00 per cent.
3	27 October 2025	31 October 2025	100.00 per cent.
4	27 April 2026	04 May 2026	100.00 per cent.
5	26 October 2026	30 October 2026	100.00 per cent.
6	26 April 2027	30 April 2027	100.00 per cent.
7	26 October 2027	01 November 2027	100.00 per cent.
8	26 April 2028	03 May 2028	100.00 per cent.
9	26 October 2028	01 November 2028	100.00 per cent.
10	26 April 2029	03 May 2029	100.00 per cent.
11	26 October 2029	01 November 2029	100.00 per cent.
12	26 April 2030	03 May 2030	100.00 per cent.
13	28 October 2030	01 November 2030	100.00 per cent.
14	28 April 2031	05 May 2031	80.00 per cent.

- (c) (i) Fixed Interest Type: Not Applicable
(ii) Fixed Interest Rate: Not Applicable
- (d) Information relating to the Floating Rate: Not Applicable
- (e) Fixing Business Day: Not Applicable
- (f) Interest Barrier Percentages: Each of the percentages set out in Table 1 above in the column entitled 'Interest Barrier Percentages'.
- (g) Fixed Interest Rates: 3.00 per cent.

Provisions relating to Automatic Settlement (Autocall)

- 17 Automatic Settlement (Autocall) or Automatic Settlement (Autocall) (bearish): Automatic Settlement (Autocall) is Applicable
General Condition 14 (*Automatic Settlement (Autocall)*)
- (a) Autocall Observation Type: Discrete
- (b) Autocall Barrier Percentages: Each percentage set out in Table 2 below in the column entitled 'Autocall Barrier Percentage'.
- (c) Autocall Settlement Percentages: 100.00 per cent.
- (d) Autocall Valuation Dates: Each date set out in Table 2 below in the column entitled 'Autocall Valuation Date'.
- (e) Autocall Settlement Dates: Each date set out in Table 2 below in the column entitled 'Autocall Settlement Date', subject to adjustment in accordance with the Business Day Convention.
- (f) Autocall Valuation Price: The Valuation Price of the Underlying Asset on the Autocall Valuation Date.
(i) Averaging-out: Not Applicable
(ii) Min Lookback-out: Not Applicable
(iii) Max Lookback-out: Not Applicable
- (g) Autocall Reset Event: Not Applicable
- (h) Worst-of Memorizer: Not Applicable

Table 2

Autocall Valuation Date:	Autocall Settlement Date:	Autocall Barrier Percentage
28 April 2025	05 May 2025	100.00 per cent.
27 October 2025	31 October 2025	100.00 per cent
27 April 2026	04 May 2026	100.00 per cent
26 October 2026	30 October 2026	100.00 per cent
26 April 2027	30 April 2027	100.00 per cent
26 October 2027	01 November 2027	100.00 per cent
26 April 2028	03 May 2028	100.00 per cent
26 October 2028	01 November 2028	100.00 per cent
26 April 2029	03 May 2029	100.00 per cent
26 October 2029	01 November 2029	100.00 per cent
26 April 2030	03 May 2030	100.00 per cent
28 October 2030	01 November 2030	100.00 per cent

Provisions relating to Optional Early Settlement Event

- 18 Optional Early Settlement Event: Not Applicable
General Condition 15 (*Optional Early Settlement Event*)
- 19 Option Type: Not Applicable

Provisions relating to TARN Early Settlement Event

- 20 TARN Early Settlement Event: General Condition 22 Not Applicable
(*TARN Early Settlement Event*)

Provisions relating to Final Settlement

- 21 (a) Final Settlement Type: Capped
General Condition 16
(*Final Settlement*)
- (b) Settlement Method: Cash
- (c) Strike Price Percentage: 100.00 per cent
- (d) Knock-in Barrier Type: European
- (e) Knock-in Barrier Percentage: 60.00 per cent
- (f) Downside: Not Applicable

Provisions relating to Drop Back

- 22 Drop Back Payout: General Condition 13.42 and Not Applicable
General Condition 16.27

Provisions relating to Nominal Call Event Settlement

- 23 Nominal Call Event Settlement: Not Applicable
General Condition 17
(*Nominal Call Event Settlement*)

Provisions relating to Instalment Notes

- 24 Instalment Notes: General Condition 24 Not Applicable
(*Settlement by Instalments*)

Provisions relating to the Underlying Asset(s)

- 25 Underlying Asset(s)_(Interest)/ Underlying Asset(s)_(Autocall) EUR STX 50 ESG (EUR)P (the "**Underlying Asset**")
Settlement)/ Underlying Asset(s)_(Final Settlement)
- (a) Initial Valuation Date: 26 April 2024
- (b) Index: EUR STX 50 ESG (EUR)P
- (i) Exchange: Multi-exchange Index
- (ii) Related Exchange: All Exchanges
- (iii) Underlying Asset Currency: EUR
- (iv) Bloomberg Screen: SX5EESG
- (v) Refinitiv Screen: .SX5EESG
- (vi) Index Sponsor: STOXX Limited
- (vii) Weight: Not Applicable
- (viii) Pre-nominated Index: Not Applicable
- 26 (a) Initial Price_(Interest): The Valuation Price of the Underlying Asset on the Initial Valuation Date
- (i) Averaging-in: Not Applicable
- (ii) Min Lookback-in: Not Applicable
- (iii) Max Lookback-in: Not Applicable
- (b) Initial Price_(Settlement): The Valuation Price of the Underlying Asset on the Initial Valuation Date.
- (i) Averaging-in: Not Applicable
- (ii) Min Lookback-in: Not Applicable
- (iii) Max Lookback-in: Not Applicable

	(c)	Initial Valuation Date:	26 April 2024
27	(a)	Final Valuation Price:	The Valuation Price of the Underlying Asset on the Final Valuation Date.
	(i)	Averaging-out:	Not Applicable
	(ii)	Min Lookback-out:	Not Applicable
	(iii)	Max Lookback-out:	Not Applicable
	(b)	Final Valuation Date:	28 April 2031
28		Interim Valuation Price:	Not Applicable
<i>Provisions relating to the disruption events</i>			
29		Consequences of a Disrupted Day (in respect of an Averaging Date or Lookback Date): Equity Linked Condition 3 (<i>Consequences of Disrupted Days</i>)	
	(a)	Omission:	Not Applicable
	(b)	Postponement:	Not Applicable
	(c)	Modified Postponement:	Not Applicable
30		Consequences of a Disrupted Day (in respect of an Averaging Date or Lookback Date): Fund linked Condition 1 (<i>Adjustments to Valuation Dates and Reference Dates</i>)	
	(a)	Omission:	Not Applicable
	(b)	Postponement:	Not Applicable
	(c)	Modified Postponement:	Not Applicable
31		Consequences of a Disrupted Day (in respect of an Averaging Date or Lookback Date): Barclays Index Linked Condition 4 (<i>Consequences upon a Reference Date becoming a Disrupted Day</i>)	
	(a)	Omission:	Not Applicable
	(b)	Postponement:	Not Applicable
	(c)	Modified Postponement:	Not Applicable
32		Additional Disruption Events: General Condition 43.1 (<i>Definitions</i>)	
	(a)	Change in Law:	Applicable as per General Condition 43.1 (<i>Definitions</i>)
	(b)	Currency Disruption Event:	Applicable as per General Condition 43.1 (<i>Definitions</i>)
	(c)	Hedging Disruption:	Applicable as per General Condition 43.1 (<i>Definitions</i>)
	(d)	Issuer Tax Event:	Applicable as per General Condition 43.1 (<i>Definitions</i>)
	(e)	Extraordinary Market Disruption:	Applicable as per General Condition 43.1 (<i>Definitions</i>)
	(f)	Increased Cost of Hedging:	Not Applicable
	(g)	Affected Jurisdiction Hedging Disruption:	Not Applicable
	(h)	Affected Jurisdiction Increased Cost of Hedging:	Not Applicable
	(i)	Increased Cost of Stock Borrow:	Not Applicable
	(j)	Loss of Stock Borrow:	Not Applicable
	(k)	Foreign Ownership Event:	Not Applicable
	(l)	Fund Disruption Event:	Not Applicable
	(m)	Fund Event:	Not Applicable
	(n)	Potential Adjustment of Payment Event:	Not Applicable
	(o)	Barclays Index Disruption:	Not Applicable
33		Unlawfulness and Impracticability:	Limb (b) of Condition 32 of the General Conditions: Applicable
34		Early Cash Settlement Amount:	Market Value
35		Early Settlement Notice Period Number:	As specified in General Condition 43.1 (<i>Definitions</i>)

36	Substitution of Shares:	Standard is applicable
37	Entitlement Substitution:	Not Applicable
38	FX Disruption Event:	Not Applicable
39	Disruption Fallbacks: FX Linked Condition 11 (<i>Consequences of FX Disruption Events (FX Linked Annex)</i>)	Not Applicable
40	Unwind Costs:	Applicable
41	Settlement Expenses:	Not Applicable
42	Local Jurisdiction Taxes and Expenses:	Applicable
43	Consequences of a Fund Event: Equity Linked Condition 3 (<i>Consequences of a Fund Event</i>)	Not Applicable
General provisions		
44	Form of Securities:	Book-entry Securities in bearer form (<i>au porteur</i>) deposited with Euroclear France
45	Trade Date:	12 February 2024
46	Taxation Gross Up:	Applicable
47	871(m) Securities:	The Issuer has determined that the Securities (without regard to any other transactions) should not be subject to U.S. withholding tax under Section 871(m) of the U.S. Internal Revenue Code and regulations promulgated thereunder
48	(i) Prohibition of Sales to EEA Retail Investors:	Not Applicable
	(ii) Prohibition of Sales to UK Retail Investors:	Applicable – see the cover page of these Final Terms
	(iii) Prohibition of Sales to Swiss Retail Investors:	Applicable – see the cover page of these Final Terms
49	Business Day:	As defined in General Condition 43.1
50	Business Day Convention:	Modified Following, subject to adjustment for Unscheduled Business Day Holiday.
51	Determination Agent:	Barclays Bank PLC
52	Registrar:	Not Applicable
53	Transfer Agent:	Not Applicable
54	(a) Name of Manager:	Barclays Bank Ireland PLC
	(b) Date of underwriting agreement:	Not Applicable
	(c) Names and addresses of secondary trading intermediaries and main terms of commitment:	Not Applicable
55	Registration Agent:	Not Applicable
56	Masse Category:	Full Masse The Representative shall be: MASSQUOTE S.A.S.U. RCS 529 065 880 Nanterre 33 Rue Anna Jacquin 92100 Boulogne Billancourt France Represented by its Chairman The Representative will receive Euro 350 per year.
	Identification information of Holders in relation to French Securities (General Condition 5.1 (e)):	Applicable
57	Governing Law:	French law
58	Relevant Benchmarks:	Amounts payable under the Securities are calculated by reference to EUR STX 50 ESG (EUR)P, which is provided by STOXX Limited (the " Administrator "). As at the date of this Final Terms, the Administrator appears on the register of administrators and benchmarks

established and maintained by the European Securities and Markets Authority ("**ESMA**") pursuant to Article 36 of Regulation (EU) 2016/1011 (as amended, the "**EU Benchmarks Regulation**").

PART B – OTHER INFORMATION

1 LISTING AND ADMISSION TO TRADING

- (a) Listing and Admission to Trading: Application will be made by the Issuer (or on its behalf) for the Securities to be listed on the official list and admitted to trading on the regulated market of the Luxembourg Stock Exchange with effect from the Issue Date.
- (b) Estimate of total expenses related to admission to trading: EUR 600 + EUR 350 per year
- (c) Name and address of the entities which have a firm commitment to act as intermediaries in secondary trading, providing liquidity through bid and offer rates and a description of the main terms of their commitment: Not Applicable

RATINGS

- 2 Ratings: The Securities have not been individually rated.

3 REASONS FOR THE OFFER, ESTIMATED NET PROCEEDS AND TOTAL EXPENSES

- (a) Reasons for the offer: General funding
- (b) Use of proceeds: The net proceeds from each issue of Securities will be applied by the Issuer for its general corporate purposes, which include making a profit and/or hedging certain risks.
- (c) Estimated net proceeds: EUR 67,000,000
- (d) Estimated total expenses: An amount of funding equal to the net proceeds of the issue of the Securities (as at the date of issuance) will be allocated as funding for the financing and/or re-financing of assets ("**Eligible Assets**") within the Green Eligible Asset Pool and Social Eligible Asset Pool, as described in Barclays Green & Social Notes Framework (which is provided on the Barclays investor relations website (<https://home.barclays/investor-relations/fixed-income-investors/funding-and-liquidity/green-and-social-bonds>) (or its successor website))
- Eligible Assets are those which fall into the relevant eligible activity categories set out in the Green & Social Notes Framework, and which were originated or refinanced up to 36 months prior to inclusion in the Green Eligible Asset Pool and Social Eligible Asset Pool.
- The Eligible Assets criteria have been designed by or on behalf of the Issuer to meet the 2021 International Capital Market Association ("**ICMA**") Green Bond Principles (as updated in June 2021) and Social Bond Principles and, be compliant with the Climate Bonds Initiative's Climate Bond Standard (version 3.0) as at the date of issuance of the Securities. The Issuer has obtained confirmation from Climate Bonds Initiative that the certified Programme would be compliant with v4.0 and expects to transition to the latest version of the Climate Bond Standard.
- The Issuer will invest all of the net proceeds from Green and/or Social Notes in the financing and/or refinancing of Eligible Assets as soon as reasonably practicable. However, if it is unable to, any shortfall will be invested (at the Issuer's own discretion) in cash and short-term and liquid investments in accordance with its liquidity policy until additional Eligible Assets are available. The amount and asset types invested in will be disclosed on the Barclays investor relations website (<https://home.barclays/investor->

[relations/fixed-income-investors/funding-and-liquidity/green-and-social-bonds/](#)(or its successor website)).

Sustainalytics GmbH has provided a second party opinion dated 31 January 2023 in which they have stated their belief that the Green & Social Notes Framework complies with the core principles and key recommendations of the 2021 ICMA Green Bond Principles, Social Bond Principles and Sustainability Bond Guidelines (applicable as at the date of issuance of the Securities).

ISS Corporate Solutions has produced an independent limited assurance engagement verifier's report dated 13 September 2022 in relation to conformance of the proposed issuance of Securities and the Programme and the Green & Social Notes Framework with the pre-issuance requirements of the Climate Bonds Standard (Version 3.0). The Issuer has obtained confirmation from Climate Bonds Initiative that the certified Programme would be compliant with v4.0 and expects to transition to the latest version of the Climate Bond Standard. On the basis of this report, a Pre-Issuance Certification dated 14 February 2024 has been obtained from the Climate Bonds Initiative. Such certification is solely in relation to the proposed use of proceeds and does not apply in respect of the payoff terms of the Securities.

All opinions and assurance reports will be made available on the Barclays investor relations website (<https://home.barclays/investor-relations/fixed-income-investors/funding-and-liquidity/green-and-social-bonds/> (or its successor website)).

4 **YIELD**

Not Applicable

5 **PAST AND FUTURE PERFORMANCE OF UNDERLYING ASSET(S), AND OTHER INFORMATION CONCERNING THE UNDERLYING ASSET(S)**

Details of the past and future performance and volatility of the Underlying Asset(s) may be obtained from:

Bloomberg Screen: SX5EESG

Refinitiv Screen Page: .SX5EESG

Index Disclaimer: See Schedule hereto

6 **POST ISSUANCE INFORMATION**

The Issuer will not provide any post-issuance information with respect to the Underlying Asset, unless required to do so by applicable law or regulation.

7 **OPERATIONAL INFORMATION**

(a) ISIN: FR00140003B9

(b) Common Code: 276988620

(c) Relevant Clearing System(s) and the relevant identification number(s): Euroclear France
The Securities are French Securities

(d) Delivery: Delivery free of payment

8 **GREEN AND/OR SOCIAL NOTES AND/OR BARCLAYS ESG INDEX LINKED SECURITIES:**

(a) Green Notes: No

- (b) Social Notes: No
- (c) Green & Social Notes: Yes
- (d) Barclays ESG Index Linked Securities: No

8 TERMS AND CONDITIONS OF THE OFFER

8.1 Authorised Offer(s)

- (a) Public Offer: An offer of the Notes may be made, subject to the conditions set out below by the Authorised Offeror(s) (specified in (b) immediately below) other than pursuant to Article 1(4) of the EU Prospectus Regulation in the Public Offer Jurisdiction(s) (specified in (c) immediately below) during the Offer Period (specified in (d) immediately below) subject to the conditions set out in the Base Prospectus and in (e) immediately below
- (b) Name(s) and address(es), to the extent known to the Issuer, of the placers in the various countries where the offer takes place (together the "Authorised Offeror(s)"): Each financial intermediary specified in (i) and (ii) below:
 - (i) **Specific consent:** ABN AMRO Bank NV, Paris Branch (the "Initial Authorised Offeror(s)" and each financial intermediary expressly named as an Authorised Offeror on the Issuer's website (<https://home.barclays/investor-relations/fixed-income-investors/prospectus-and-documents/structured-securities-final-terms>); and
 - (ii) **General consent:** Not Applicable
- (c) Jurisdiction(s) where the offer may take place (together, the "Public Offer Jurisdictions(s)"): France
- (d) Offer period for which use of the Base Prospectus is authorised by the Authorised Offeror(s): From and including 11 March 2024 to and including 26 April 2024 (the "Offer Period")
- (e) Other conditions for use of the Base Prospectus by the Authorised Offeror(s): Not Applicable
- (f) Other terms and conditions of the offer
- (g) Offer Price: Between 99.50% and 100% of the Specified Denomination, as set out in the table below for the relevant segment of the Offer Period:

Offer Period	Offer Price
From (and including) 11 March 2024 to (and including) 15 March 2024	99.50% of the Specified Denomination
From (and including) 18 March 2024 to (and including) 22 March 2024	99.58% of the Specified Denomination
From (and including) 25 March 2024 to (and including) 29 March 2024	99.67% of the Specified Denomination
From (and including) 01 April 2024 to (and including) 05 April 2024	99.75% of the Specified Denomination
From (and including) 08 April 2024 to (and including) 12 April 2024	99.83% of the Specified Denomination
From (and including) 15 April 2024 to (and including) 19 April 2024	99.92% of the Specified Denomination
From (and including) 22 April 2024 to (and including) 26 April 2024	100.00% of the Specified Denomination

- (h) Total amount of offer: EUR 67,000,000
- (i) Conditions to which the offer is subject: The Issuer reserves the right to withdraw the offer for Securities at any time prior to the end of the Offer Period. Following withdrawal of the offer, if any application has been made by any potential investor, each such potential investor shall not be entitled to subscribe or otherwise acquire the Securities and any applications will be

- automatically cancelled and any purchase money will be refunded to the applicant by the Authorised Offeror in accordance with the Authorised Offeror's usual procedures.
- (j) Time period, including any possible amendments, during which the offer will be open and description of the application process: The Offer Period
- (k) Description of the application process: An offer of the Securities may be made by the Manager or the Authorised Offeror other than pursuant to Article 1(4) of the EU Prospectus Regulation in France (the “**Public Offer Jurisdiction**”) during the Offer Period. Applications for the Securities can be made in the Public Offer Jurisdiction through the Authorised Offeror during the Offer Period. The Securities will be placed into the Public Offer Jurisdiction by the Authorised Offeror. Distribution will be in accordance with the Authorised Offeror's usual procedures, notified to investors by the Authorised Offeror.
- (l) Details of the minimum and/or maximum amount of application: The minimum and maximum amount of application from the Authorised Offeror will be notified to investors by the Authorised Offeror.
- (m) Description of possibility to reduce subscriptions and manner for refunding excess amount paid by applicants: Not Applicable
- (n) Details of method and time limits for paying up and delivering the Securities: Investors will be notified by the Authorised Offeror of their allocations of Securities and the settlement arrangements in respect thereof.
- (o) Manner in and date on which results of the offer are to be made public: Investors will be notified by the Authorised Offeror of their allocations of Securities and the settlement arrangements in respect thereof.
- (p) Procedure for exercise of any right of pre-emption, negotiability of subscription rights and treatment of subscription rights not exercised: Not Applicable
- (q) Whether tranche(s) have been reserved for certain countries: Offers may be made through the Authorised Offeror in the Public Offer Jurisdiction to any person. Offers (if any) in other EEA countries will only be made through the Authorised Offeror pursuant to an exemption from the obligation under the EU Prospectus Regulation to publish a prospectus.
- (r) Process for notification to applicants of the amount allotted and indication whether dealing may begin before notification is made: Applicants will be notified directly by the Authorised Offeror of the success of their application. No dealings in the Securities may take place prior to the Issue Date.
- (s) Amount of any expenses and taxes specifically charged to the subscriber or purchaser: Prior to making any investment decision, investors should seek independent professional advice as they deem necessary.
- (t) Name(s) and address(es), to the extent known to the Issuer, of the placers in the various countries where the offer takes place: ABN AMRO Bank NV, Paris Branch
3 avenue Hoche
Paris
75008
Paris
France

Schedule¹

Climate Bonds Initiative Disclaimer

The certification of the EUR 67,000,000 Securities due May 2031 under the Global Structured Securities Programme (the “**Securities**”) as Climate Bonds by the Climate Bonds Initiative is based solely on the Climate Bond Standard and does not, and is not intended to, make any representation or give any assurance with respect to any other matter relating to the Securities or any Nominated Project, including but not limited to the Base Prospectus, the transaction documents, the Issuer or the management of the Issuer.

The certification of the Securities as Climate Bonds by the Climate Bonds Initiative was addressed solely to the board of directors of the Issuer and is not a recommendation to any person to purchase, hold or sell the Securities and such certification does not address the market price or suitability of the Securities for a particular investor. The certification also does not address the merits of the decision by the Issuer or any third party to participate in any Nominated Project and does not express and should not be deemed to be an expression of an opinion as to the Issuer or any aspect of any Nominated Project (including but not limited to the financial viability of any Nominated Project) other than with respect to conformance with the Climate Bond Standard.

In issuing or monitoring, as applicable, the certification, the Climate Bonds Initiative has assumed and relied upon and will assume and rely upon the accuracy and completeness in all material respects of the information supplied or otherwise made available to the Climate Bonds Initiative. The Climate Bonds Initiative does not assume or accept any responsibility to any person for independently verifying (and it has not verified) such information or to undertake (and it has not undertaken) any independent evaluation of any Nominated Project or the Issuer. In addition, the Climate Bonds Initiative does not assume any obligation to conduct (and it has not conducted) any physical inspection of any Nominated Project. The certification may only be used with the Securities and may not be used for any other purpose without the Climate Bonds Initiative’s prior written consent.

The certification does not and is not in any way intended to address the likelihood of timely payment of interest when due on the Securities and/or the payment of principal at maturity or any other date.

The certification may be withdrawn at any time in the Climate Bonds Initiative’s sole and absolute discretion and there can be no assurance that such certification will not be withdrawn.

¹ Amended by the Amended and Restated Final terms dated 24 April 2024.

SUMMARY

INTRODUCTION AND WARNINGS

The Summary should be read as an introduction to the Prospectus. Any decision to invest in the Securities should be based on consideration of the Prospectus as a whole by the investor. In certain circumstances, the investor could lose all or part of the invested capital. Where a claim relating to the information contained in the Prospectus is brought before a court, the plaintiff investor might, under the national law, have to bear the costs of translating the Prospectus before the legal proceedings are initiated. Civil liability attaches only to those persons who have tabled the Summary, including any translation thereof, but only where the Summary is misleading, inaccurate or inconsistent when read together with the other parts of the Prospectus or it does not provide, when read together with the other parts of the Prospectus, key information in order to aid investors when considering whether to invest in the Securities.

You are about to purchase a product that is not simple and may be difficult to understand.

Securities: EUR 67,000,000 Securities due May 2031 pursuant to the Global Structured Securities Programme pursuant to the Global Structured Securities Programme) and its Legal Entity Identifier ("LEI") is G5GSEF7VJP5I7OUK5573

The Issuer: The Issuer is Barclays Bank PLC. Its registered office is at 1 Churchill Place, London, E14 5HP, United Kingdom (telephone number: +44 (0)20 7116 1000) and its Legal Entity Identifier ("LEI") is G5GSEF7VJP5I7OUK5573

The Authorised Offeror: The Authorised Offeror is Offeror is ABN AMRO Bank NV, Paris Branch with its address at 3 avenue Hoche, Paris, 75008, France (telephone number: +33 (0)1 56 21 97 82) and its LEI is 894500815L0L04M5QL67.

Competent authority: The Base Prospectus was approved on 13 April 2023 by the Central Bank of Ireland of New Wapping Street, North Wall Quay, Dublin 1, D01 F7X3, Ireland (telephone number: +353 (0)1 224 6000).

KEY INFORMATION ON THE ISSUER

Who is the Issuer of the Securities?

Domicile and legal form of the Issuer

Barclays Bank PLC (the "**Issuer**") is a public limited company registered in England and Wales under number 1026167. The liability of the members of the Issuer is limited. It has its registered and head office at 1 Churchill Place, London, E14 5HP, United Kingdom (telephone number +44 (0)20 7116 1000). The Legal Entity Identifier (LEI) of the Issuer is G5GSEF7VJP5I7OUK5573.

Principal activities of the Issuer

The Group's businesses include consumer banking and payments operations around the world, as well as a global corporate and investment bank. The Group comprises of Barclays PLC together with its subsidiaries, including the Issuer. The Issuer's principal activity is to offer products and services designed for larger corporate, wholesale and international banking clients.

The term the "**Group**" mean Barclays PLC together with its subsidiaries and the term "**Barclays Bank Group**" means Barclays Bank PLC together with its subsidiaries.

Major shareholders of the Issuer

The whole of the issued ordinary share capital of the Issuer is beneficially owned by Barclays PLC. Barclays PLC is the ultimate holding company of the Group.

Identity of the key managing directors of the Issuer

The key managing directors of the Issuer are C.S. Venkatakrisnan (Chief Executive and Executive Director) and Anna Cross (Executive Director).

Identity of the statutory auditors of the Issuer

The statutory auditors of the Issuer are KPMG LLP ("**KPMG**"), chartered accountants and registered auditors (a member of the Institute of Chartered Accountants in England and Wales), of 15 Canada Square, London E14 5GL, United Kingdom.

What is the key financial information regarding the Issuer?

The Issuer has derived the selected consolidated financial information included in the table below for the years ended 31 December 2022 and 31 December 2021 from the annual consolidated financial statements of the Issuer for the years ended 31 December 2022 and 2021 (the "**Financial Statements**"), which have each been audited with an unmodified opinion provided by KPMG. The selected financial information included in the table below for the six months ended 30 June 2023 and 30 June 2022 was derived from the unaudited condensed consolidated interim financial statements of the Issuer in respect of the six months ended 30 June 2023 (the "**Interim Results Announcement**"). Certain of the comparative financial metrics included in the table below for the six months ended 30 June 2022 were restated in the Interim Results Announcement.

Consolidated Income Statement

	As at 30 June (unaudited)		As at 31 December	
	2023	2022	2022	2021
	(£m)		(£m)	
Net interest income	3,120	2,233	5,398	3,073
Net fee and commission income	2,806	2,839	5,426	6,587
Credit impairment (charge)/release	(688)	(293)	(933)	277
Net trading income	3,853	5,026	7,624	5,788
Profit before tax	3,132	2,605	4,867	5,418
Profit after tax	2,607	2,129	4,382	4,588

Consolidated Balance Sheet

	As at 30 June (unaudited)		As at 31 December	
	2023	2022	2022	2021

	(£m)	(£m)	
Total assets	1,246,636	1,203,537	1,061,778
Debt securities in issue	58,377	60,012	48,388
Subordinated liabilities	36,325	38,253	32,185
Loans and advances at amortised cost	183,237	182,507	145,259
Deposits at amortised cost	307,820	291,579	262,828
Total equity.....	58,348	58,953	56,317

Certain Ratios from the Financial Statements¹

	As at 30 June		As at 31 December	
	(unaudited)			
	2023	2022	2021	
	(%)		(%)	
Common Equity Tier 1 capital	12.5	12.7	12.9	
Total regulatory capital.....	20.1	20.8	20.5	
UK leverage ratio (sub-consolidated) ²	5.9			

¹ Capital, RWAs and leverage are calculated applying the transitional arrangements of the CRR as amended by CRR II. This includes IFRS 9 transitional arrangements and the grandfathering of CRR II non-compliant capital instruments.

² Leverage minimum requirements for Barclays Bank PLC were set at a sub-consolidated level effective from 1 January 2023. No comparatives are provided as this is the first reporting period for Barclays Bank PLC sub-consolidated leverage.

What are the key risks that are specific to the Issuer?

The Barclays Bank Group has identified a broad range of risks to which its businesses are exposed. Material risks are those to which senior management pay particular attention and which could cause the delivery of the Barclays Bank Group's strategy, results of operations, financial condition and/or prospects to differ materially from expectations. Emerging risks are those which have unknown components, the impact of which could crystallise over a longer time period. In addition, certain other factors beyond the Barclays Bank Group's control, including escalation of global conflicts, acts of terrorism, natural disasters, pandemics and similar events, although not detailed below, could have a similar impact on the Barclays Bank Group.

- **Material existing and emerging risks potentially impacting more than one principal risk:** In addition to material and emerging risks impacting the principal risks set out below, there are also material existing and emerging risks that potentially impact more than one of these principal risks. These risks are: (i) potentially unfavourable global and local economic and market conditions, as well as geopolitical developments; (ii) the impact of COVID-19; (iii) the impact of interest rate changes on the Barclays Bank Group's profitability; (iv) the competitive environments of the banking and financial services industry; (v) the regulatory change agenda and impact on business model; (vi) the impact of benchmark interest rate reforms on the Barclays Bank Group; and (vii) change delivery and execution risks.
- **Climate risk:** Climate risk is the impact on financial and operational risks arising from climate change through physical risks, risks associated with transitioning to a lower carbon economy and connected risks arising as a result of second order impacts of these two drivers on portfolios.
- **Credit and Market risks:** Credit risk is the risk of loss to the Barclays Bank Group from the failure of clients, customers or counterparties, to fully honour their obligations to members of the Barclays Bank Group. The Barclays Bank Group is subject to risks arising from changes in credit quality and recovery rates for loans and advances due from borrowers and counterparties. Market risk is the risk of loss arising from potential adverse change in the value of the Barclays Bank Group's assets and liabilities from fluctuation in market variables.
- **Treasury and capital risk and the risk that the Issuer and the Barclays Bank Group are subject to substantial resolution powers:** There are three primary types of treasury and capital risk faced by the Barclays Bank Group which are (1) liquidity risk – the risk that the Barclays Bank Group is unable to meet its contractual or contingent obligations or that it does not have the appropriate amount of stable funding and liquidity to support its assets, which may also be impacted by credit rating changes; (2) capital risk – the risk that the Barclays Bank Group has an insufficient level or composition of capital; and (3) interest rate risk in the banking book – the risk that the Barclays Bank Group is exposed to capital or income volatility because of a mismatch between the interest rate exposures of its (non-traded) assets and liabilities. Under the Banking Act 2009, substantial powers are granted to the Bank of England (or, in certain circumstances, HM Treasury), in consultation with the United Kingdom Prudential Regulation Authority, the UK Financial Conduct Authority and HM Treasury, as appropriate as part of a special resolution regime. These powers enable the Bank of England (or any successor or replacement thereto and/or such other authority in the United Kingdom with the ability to exercise the UK Bail-in Power) (the "**Resolution Authority**") to implement various resolution measures and stabilisation options (including, but not limited to, the bail-in tool) with respect to a UK bank or investment firm and certain of its affiliates (as at the date of the Registration Document, including the Issuer) in circumstances in which the Resolution Authority is satisfied that the relevant resolution conditions are met.
- **Operational and model risks:** Operational risk is the risk of loss to the Barclays Bank Group from inadequate or failed processes or systems, human factors or due to external events where the root cause is not due to credit or market risks. Model risk is the potential for adverse consequences from decisions based on incorrect or misused model outputs and reports.
- **Conduct, reputation and legal risks and legal, competition and regulatory matters:** Conduct risk is the risk of poor outcomes for, or harm to customers, clients and markets, arising from the delivery of the Barclays Bank Group's products and services. Reputation risk is the risk that an action, transaction, investment, event, decision or business relationship will reduce trust in the Barclays Bank Group's integrity and/or competence. The Barclays Bank Group conducts activities in a highly regulated global market which exposes it and its employees to legal risk arising from (i) the multitude of laws and regulations that apply to the businesses it operates, which are highly dynamic, may vary between jurisdictions and/or conflict, and may be unclear in their application to particular circumstances especially in new and emerging areas; and (ii) the diversified and evolving nature of the Barclays Bank Group's businesses and business practices. In each case, this exposes the Barclays Bank Group and its employees to the risk of loss or the imposition of penalties, damages or fines from the failure of members of the Barclays Bank Group to meet their respective obligations, including legal, regulatory or contractual requirements. Legal risk may arise in relation to any number of the material existing and emerging risks summarised above.

In Q2 2023, the "**Conduct Risk**" principal risk was expanded to include "**Laws, Rules and Regulations (LRR) Risk**" and consequently renamed "**Compliance Risk**". Reflecting this, the definition of compliance risk is: "The risk of poor outcomes for, or harm to, customers, clients and markets, arising from the delivery of the firm's products and services (also known as "**Conduct Risk**") and the risk to Barclays Bank Group, its clients, customers or markets from a failure to comply with the laws, rules and regulations

applicable to the firm (also known as Laws, Rules and Regulations Risk "*LRR Risk*")." The definition of the "*Legal Risk*" principal risk was updated to: "The risk of loss or imposition of penalties, damages or fines from the failure of the firm to meet applicable laws, rules and regulations or contractual requirements or to assert or defend its intellectual property rights." The revised framework is in force from June 2023."

KEY INFORMATION ON THE SECURITIES

What are the main features of the Securities?

Type and class of Securities being offered and admitted to trading, including security identification numbers

The Securities will be in the form of notes and will be uniquely identified by: Series number: NX00388974; Tranche number: 1; ISIN: FR00140003B9; Common Code: 276988620.

The Securities will be cleared and settled through Euroclear France S.A..

Currency, specified denomination, issue size and term of the Securities

The Securities will be issued in Euro ("**EUR**") (the "**Issue Currency**") and settled in the same currency (the "**Settlement Currency**"). The Securities are tradable in nominal and the specified denomination per Security is EUR 1,000. The issue size is EUR 67,000,000. The issue price is 99.50% of the Specified Denomination per Security.

The issue date is 11 March 2024 (the "**Issue Date**"). Subject to early termination, the Securities are scheduled to redeem on 5 May 2031 (the "**Scheduled Settlement Date**").

The Securities are Green and Social Notes and may satisfy certain "green", "sustainable", "social", "ESG" or similar objectives.

Rights attached to the Securities

Potential return: The Securities will give each holder of Securities the right to receive potential return on the Securities, together with certain ancillary rights such as the right to receive notice of certain determinations and events and the right to vote on some (but not all) amendments to the terms and conditions of the Securities. The potential return will be in the forms of: (i) one or more Interest Amounts, (ii) an Autocall Cash Settlement Amount, and/or (iii) a Final Cash Settlement Amount, provided that if the Securities are early terminated, the potential return may be in the form of (i) an Early Cash Settlement Amount instead.

Taxation: All payments in respect of the Securities shall be made without withholding or deduction for or on account of any UK taxes unless such withholding or deduction is required by law. In the event that any such withholding or deduction is required by law, the Issuer will, save in limited circumstances, be required to pay additional amounts to cover the amounts so withheld or deducted.

Events of default: If the Issuer fails to make any payment due under the Securities or breaches any other term and condition of the Securities in a way that is materially prejudicial to the interests of the holders (and such failure is not remedied within 30 calendar days, or, in the case of interest has not been paid within 14 calendar days of the due date), or the Issuer is subject to a winding-up order, then (subject, in the case of interest, to the Issuer being prevented from payment for a mandatory provision of law) the Securities will become immediately due and payable, upon notice being given by the holder the representative of the holders where the holders are grouped in a '*Masse*'.

Limitations on rights

Early redemption following certain disruption events or due to unlawfulness or impracticability: The Issuer may redeem the Securities prior to their Scheduled Settlement Date following the occurrence of certain disruption events or extraordinary events concerning the Issuer, its hedging arrangements, the Underlying Asset(s), taxation or the relevant currency of the Securities, or if it determines that an unlawfulness or impracticability event has occurred. In such case, investors will receive an "**Early Cash Settlement Amount**" equal to the fair market value of the Securities prior to their redemption (adjusted to take into account relevant costs, losses and expenses).

Certain additional limitations:

- Notwithstanding that the Securities are linked to the performance of the Underlying Asset(s), holders do not have any rights in respect of the Underlying Asset(s).
- The terms and conditions of the Securities permit the Issuer and the Determination Agent (as the case may be), on the occurrence of certain events and in certain circumstances, without the holders' consent, to make adjustments to the terms and conditions of the Securities, to redeem the Securities prior to maturity, to monetise the Securities, to postpone or obtain alternative valuation of the Underlying Asset(s) or to postpone scheduled payments under the Securities, to change the currency in which the Securities are denominated, to substitute the Underlying Asset(s), to substitute the Issuer with another permitted entity subject to certain conditions, and to take certain other actions with regard to the Securities and the Underlying Asset(s).
- The Securities contain provisions for calling meetings of holders to consider matters affecting their interests generally and these provisions permit defined majorities to bind all holders, including holders who did not attend and vote at the relevant meeting and holders who voted in a manner contrary to the majority.

Governing law

The Securities will be governed by French law and the rights thereunder will be construed accordingly.

Description of the calculation of potential return on the Securities

Underlying Assets: The return on and value of the Securities is dependent on the performance of the following Underlying Asset:

Underlying Asset _(Interest) / Underlying Asset _{(Autocall)/ Underlying Asset_(Final Settlement)}	Type	Initial Price _(Interest) / Initial Price _(Autocall) / Initial Price _(Settlement)	Initial Valuation Date
EUR STX 50 ESG (EUR)P	Index	The Valuation Price of the Underlying Asset on the Initial Valuation Date	26 April 2024

For the purposes of determining an Interest Amount, Underlying Asset shall mean the Underlying Asset_(Interest), for the purposes of determining Automatic Settlement (Autocall) Event, Underlying Asset shall mean the Underlying Asset_(Autocall Settlement) and for the purposes of determining the Final Cash Settlement Amount, Underlying Asset shall mean the Underlying Asset_(Final Settlement).

Calculation Amount: Calculations in respect of amounts payable under the Securities are made by reference to the "**Calculation Amount**", being EUR 1,000 per Security.

Determination Agent: Barclays Bank PLC will be appointed to make calculations and determinations with respect to the Securities.

A – Interest

Each Security will only pay interest on an Interest Payment Date if the closing price or level of the Underlying Asset on the corresponding Interest Valuation Date is greater than or equal to its corresponding Interest Barrier. If this occurs, the amount of interest payable is calculated by:

- (1) multiplying the fixed rate of 3.00% by EUR 1,000; and then

(2) multiplying the result by the number corresponding to that Interest Valuation Date (i.e. the number in the column headed "T" in the table below).
Each Interest Payment Date, corresponding Interest Valuation Date, T and Interest Barrier is as follows:

T	Interest Valuation Date	Interest Payment Date	Interest Barrier Percentages
2	28 April 2025	05 May 2025	100.00%
3	27 October 2025	31 October 2025	100.00%
4	27 April 2026	04 May 2026	100.00%
5	26 October 2026	30 October 2026	100.00%
6	26 April 2027	30 April 2027	100.00%
7	26 October 2027	01 November 2027	100.00%
8	26 April 2028	03 May 2028	100.00%
9	26 October 2028	01 November 2028	100.00%
10	26 April 2029	03 May 2029	100.00%
11	26 October 2029	01 November 2029	100.00%
12	26 April 2030	03 May 2030	100.00%
13	28 October 2030	01 November 2030	100.00%
14	28 April 2031	05 May 2031	80.00%

B – Automatic Settlement (Autocall)

The Securities will automatically redeem if the closing price or level of the Underlying Asset divided by its Initial Price is at or above its corresponding Autocall Barrier Percentage in respect of any Autocall Valuation Date. If this occurs, you will receive an Autocall Cash Settlement Amount equal to the Calculation Amount multiplied by 100% payable on the Autocall Settlement Date corresponding to such Autocall Valuation Date. The relevant Autocall Settlement Date may be postponed following the postponement of an Autocall Valuation Date due to a disruption event.

Autocall Valuation Date:	Autocall Settlement Date:	Autocall Barrier Percentage:
28 April 2025	05 May 2025	100.00%
27 October 2025	31 October 2025	100.00%
27 April 2026	04 May 2026	100.00%
26 October 2026	30 October 2026	100.00%
26 April 2027	30 April 2027	100.00%
26 October 2027	01 November 2027	100.00%
26 April 2028	03 May 2028	100.00%
26 October 2028	01 November 2028	100.00%
26 April 2029	03 May 2029	100.00%
26 October 2029	01 November 2029	100.00%
26 April 2030	03 May 2030	100.00%
28 October 2030	01 November 2030	100.00%

C – Final Settlement

If the Securities have not otherwise redeemed, each Security will be redeemed on the Scheduled Settlement Date by payment of the Final Cash Settlement Amount. The Scheduled Settlement Date may be postponed following the postponement of the Final Valuation Date due to a disruption event.

The Final Cash Settlement Amount is calculated as follows:

- (i) if the Final Performance is greater than or equal to the Knock-in Barrier Percentage (being 60%), 100% multiplied by the Calculation Amount;
- (ii) otherwise, an amount calculated by dividing the Final Performance by the Strike Price Percentage (being 100%) and multiplying the result by the Calculation Amount).

Where:

"Final Performance" means the Final Valuation Price divided by the Initial Price_(Settlement).

"Final Valuation Date" means 28 April 2031 subject to adjustment.

"Final Valuation Price" means, in respect of the Underlying Asset, the closing price in respect of the Underlying Asset on the Final Valuation Date.

Status of the Securities

The Securities are direct, unsubordinated and unsecured obligations of the Issuer and rank equally among themselves.

Description of restrictions on free transferability of the Securities

The Securities are offered and sold outside the United States to non-U.S. persons in reliance on Regulation S under the Securities Act and must comply with transfer restrictions with respect to the United States. Securities held in a clearing system will be transferred in accordance with the rules, procedures and regulations of that clearing system. Subject to the foregoing, the Securities will be freely transferable.

Where will the Securities be traded?

Application is expected to be made by the Issuer (or on its behalf) for the Securities to be admitted to trading on the regulated market of the Luxembourg Stock Exchange.

What are the key risks that are specific to the Securities?

The Securities are subject to the following key risks:

- **You may lose some or all of your investment in the Securities:** Investors are exposed to the credit risk of Barclays Bank PLC. As the Securities do not constitute a deposit and are not insured or guaranteed by any government or agency or under the UK Government credit guarantee scheme, all payments or deliveries to be made by Barclays Bank PLC as Issuer under the Securities are subject to its financial position and its ability to meet its obligations. The Securities constitute unsubordinated and unsecured obligations of the Issuer and rank *pari passu* with each and all other current and future unsubordinated and unsecured obligations of the Issuer. The terms of the Securities do not provide for a scheduled minimum payment at maturity and as such, depending on the performance of the Underlying Asset(s), you may lose some or all of your investment. You may also lose some or all of your investment if: (a) you sell your Securities before their scheduled maturity or expiry; (b) your Securities are early redeemed in certain extraordinary circumstances; or (c) the terms and conditions of your Securities are adjusted such that the amount payable or property deliverable to you is less than your initial investment.
- **There are risks associated with the valuation, liquidity and offering of the Securities:** The market value of your Securities may be significantly lower than the issue price since the issue price may take into account the Issuer's and/or distributor's profit margin and costs in addition to the fair market value of the Securities. The market value of your Securities may be affected by the volatility, level, value or price of the Underlying Asset(s) at the relevant time, changes in interest rates, the Issuer's financial condition and credit ratings, the supply of and demand for the Securities, the time remaining until the maturity or expiry of the Securities and other factors. The price, if any, at which you will be able to sell your Securities prior to maturity may be substantially less than the amount you originally invested. Your Securities may not have an active trading market and the Issuer may not be under any obligation to make a market or repurchase the Securities prior to redemption. The Issuer may withdraw the public offer at any time. In such case, where you have already paid or delivered subscription monies for the relevant Securities, you will be entitled to reimbursement of such amounts, but will not receive any remuneration that may have accrued in the period between their payment or delivery of subscription monies and the reimbursement of the Securities.
- **You are subject to risks associated with the determination of amount payable under the Securities:**

The Interest Amount is conditional on the performance of Underlying Asset(s) and may be zero where the performance criteria are not met. In such case the Interest Amount may be deferred to the next interest payment that may be made, but it is possible that you will not receive any interest at all over the lifetime of the Securities. The Final Cash Settlement Amount is based on the performance of the Underlying Asset(s) as at the final valuation date only (rather than in respect of multiple periods throughout the term of the Securities). This means you may not benefit from any movement in price of the Underlying Asset(s) during the term of the Securities that is not maintained in the final performance as at the final valuation date.

As the Final Cash Settlement Amount is subject to a cap, the value of or return on your Securities may be significantly less than if you had purchased the Underlying Asset(s) directly.

The calculation of amount payable depends on the level, value or price of the Underlying Asset(s) reaching or crossing a 'barrier' during a specified period or specified dates during the term of the Securities. This means you may receive less (or, in certain cases, more) if the level, value or price of the Underlying Asset(s) crosses or reaches (as applicable) a barrier, than if it comes close to the barrier but does not reach or cross it (as applicable), and in certain cases you might receive no interest or coupon payments and/or could lose some or all of your investment.
- **Your Securities are subject to adjustments and early redemption:** Pursuant to the terms and conditions of the Securities, following the occurrence of certain disruption events or extraordinary events concerning the Issuer, its hedging arrangements, the Underlying Asset(s), taxation or the relevant currency of the Securities, the Determination Agent or the Issuer may take a number of remedial actions, including estimating the price of the Underlying Asset, substituting the Underlying Asset, and making adjustments to the terms and conditions of the Securities. Any of such remedial action may change the economic characteristics of the Securities and have a material adverse effect on the value of and return on the Securities. If no remedial action can be taken, or it is determined that an unlawfulness event has occurred, the Issuer may early redeem the Securities by payment of an Early Cash Settlement Amount. If early redemption occurs, you may lose some or all of your investment because the Early Cash Settlement Amount may be lower than the price at which you purchase the Securities, or may even be zero. You will also lose the opportunity to participate in any subsequent positive performance of the Underlying Asset(s) and be unable to realise any potential gains in the value of the Securities. You may not be able to reinvest the proceeds from an investment at a comparable return and/or with a comparable interest or coupon rate for a similar level of risk.
- **Settlement is subject to conditions and may be impossible in certain circumstances:** Payment of the amount payable to you will not take place until all conditions to settlement have been satisfied in full. No additional amounts will be payable to you by the Issuer because of any resulting delay or postponement. Certain settlement disruption events may occur which could restrict the Issuer's ability to make payments, and the date of settlement could be delayed accordingly.
- **Risks relating to Underlying Asset(s) that are equity indices:** Equity indices are composed of a synthetic portfolio of shares and provide investment diversification opportunities, but will be subject to the risk of fluctuations in both equity prices and the value and volatility of the relevant equity index. The Securities are linked to equity indices, and as such may not participate in dividends or any other distributions paid on the shares which make up such indices. Accordingly, you may receive a lower return on the Securities than you would have received if you had invested directly in those shares. The index sponsor can add, delete or substitute the components of an equity index at its discretion, and may also alter the methodology used to calculate the level of such index. These events may have a detrimental impact on the level of that index, which in turn could have a negative impact on [the level of the Barclays Index and in turn] the value of and return on the Securities. Additionally, the name of an index and/or the marketing of Securities linked to such index may describe the index as having "green", "sustainable", "social", "ESG" or similar objectives. There are a variety of approaches taken in respect of climate sensitive index and socially responsible construction methodologies which may each have their own respective merits however may lack the breadth and diversity of impact desired by certain investors. Therefore, the objectives of the index may not meet investor objectives, expectations or requirements as regarding investments which are "green", "sustainable", "social", "ESG" or similar label.
- **The Underlying Asset(s) are 'benchmarks' for the purposes of the EU Benchmarks Regulation (Regulation (EU) 2016/1011, as amended):** Pursuant to the EU Benchmarks Regulation, an Underlying Asset may not be used in certain ways by an EU supervised entity after 31 December 2025 if its administrator does not obtain authorisation or registration (or, if a non-EU entity, does not satisfy the "equivalence" conditions and is not "recognised" pending an equivalence decision or is not "endorsed" by an EU supervised entity). If this happens, [the Underlying Asset will be replaced by a pre-nominated substitute Underlying Asset, and the economic characters of the Securities may change in a materially negative manner][a disruption event will occur and the Securities may be early [redeemed][cancelled]. Further, the methodology or other terms of an Underlying Asset could be changed in order to comply with the requirements of the EU Benchmarks Regulation, and such changes could reduce or increase the level or affect the volatility of the published level of such Underlying Asset, which may in turn lead to adjustments to the terms of the Securities or early [redemption][cancellation].]
- **Risks relating to Securities labelled as "Green and/or Social Notes":** Any allocation of the proceeds to the relevant eligible asset(s) in respect of Green and/or Social Notes (or any failure to do so) may not meet investor objectives, expectations or requirements with regards to sustainable investment and therefore there is a risk that an investment in "Green and/or Social Notes" may not achieve your investment goals. Additionally, whilst the Issuer intends to allocate an amount equal to

the net proceeds of the Green and/or Social Notes to the relevant eligible asset(s), there may not be sufficient eligible asset(s) for such amount to be fully utilised and any unallocated net proceeds will be invested in cash and short-term liquid investments until sufficient eligible asset(s) become available. There may also occur (a) withdrawal or amendment of any external party opinion or certification and/or de-listing in respect of the Green and/or Social Notes; and/or (b) criticism by activist groups or other stakeholders on investments made by the Group or other aspects of its business. Such events herein may result in adverse consequences for investors with portfolio mandates to invest in Securities to be used for a particular purpose. For example, you may be obliged to divest such Securities potentially at a loss and/or not be able to count such Securities towards your relevant portfolio, which could also result in a loss.

- **Risks associated with Barclays ESG Index Linked Securities or other Securities linked to an index that is marketed as having "green", "sustainable", "social", "ESG" or similar objectives:** The methodology applied in respect of a Barclays ESG Index or other index that is marketed as having "green", "sustainable", "social", "ESG" or similar objectives (as applicable) may not satisfy investor expectations or requirements with regards to sustainable investment and therefore there is a risk that an investment in the Securities may not achieve your investment goals. This could result in adverse consequences for certain investors with portfolio mandates to invest in securities to be used for a particular purpose, for example, you may be required to divest such Securities potentially at a loss
- **Taxation risks:** The levels and basis of taxation on the Securities and any reliefs for such taxation will depend on your individual circumstances and could change at any time over the life of the Securities. This could have adverse consequences for you and you should therefore consult your own tax advisers as to the tax consequences to you of transactions involving the Securities.
- **Potential conflicts of interest:** Conflicts of interest may exist where Barclays Bank PLC or its affiliate: (i) acts in multiple capacities with respect to the Securities (e.g. acting as issuer, manager and determination agent); (ii) enters into hedging transactions to cover the Issuer's exposure to the relevant cash amounts to be paid or assets to be delivered under the Securities as these fall due; and (iii) uses price contributions from its trading desks as a pricing source for an Underlying Asset. In light of such conflicts, the actions taken or determinations made by Barclays Bank PLC in relation to the Securities may not always be in the best interest of the holders. In addition to hedging transactions, Barclays Bank PLC may trade on the Underlying Asset(s) in the ordinary course of its business. Such trading could affect the market price of the Underlying Asset(s), which may in turn materially adversely affect the value and return on your Securities.

KEY INFORMATION ON THE OFFER OF SECURITIES TO THE PUBLIC AND/OR THE ADMISSION TO TRADING ON A REGULATED MARKET

Under which conditions and timetable can I invest in these Securities?

Terms and conditions of the offer

The terms and conditions of any offer of Securities to the public may be determined by agreement between the Issuer and the Authorised Offeror at the time of each issue. The Securities are offered for subscription in France during the period from (and including) 11 March 2024 to (and including) 26 April 2024 (the "Offer Period") and such offer is subject to the following conditions:

- Offer Price: Between 99.50% and 100% of the Specified Denomination, as set out in the table below for the relevant segment of the Offer Period:

Offer Period	Offer Price
From (and including) 11 March 2024 to (and including) 15 March 2024	99.50% of the Specified Denomination
From (and including) 18 March 2024 to (and including) 22 March 2024	99.58% of the Specified Denomination
From (and including) 25 March 2024 to (and including) 29 March 2024	99.67% of the Specified Denomination
From (and including) 01 April 2024 to (and including) 05 April 2024	99.75% of the Specified Denomination
From (and including) 08 April 2024 to (and including) 12 April 2024	99.83% of the Specified Denomination
From (and including) 15 April 2024 to (and including) 19 April 2024	99.92% of the Specified Denomination
From (and including) 22 April 2024 to (and including) 26 April 2024	100.00% of the Specified Denomination

- Conditions to which the offer is subject: Conditions to which the offer is subject: The Issuer reserves the right to withdraw the offer for Securities at any time prior to the end of the Offer Period. Following withdrawal of the offer, if any application has been made by any potential investor, each such potential investor shall not be entitled to subscribe or otherwise acquire the Securities and any applications will be automatically cancelled and any purchase money will be refunded to the applicant by the Authorised Offeror in accordance with the Authorised Offeror's usual procedures.
- Description of the application process: An offer of the Securities may be made by the Manager or the Authorised Offeror other than pursuant to Article 1(4) of the EU Prospectus Regulation in France (the "Public Offer Jurisdiction") during the Offer Period. Applications for the Securities can be made in the Public Offer Jurisdiction through the Authorised Offeror during the Offer Period. The Securities will be placed into the Public Offer Jurisdiction by the Authorised Offeror. Distribution will be in accordance with the Authorised Offeror's usual procedures, notified to investors by the Authorised Offeror.
- Details of the minimum and/or maximum amount of application: The minimum and maximum amount of application from the Authorised Offeror will be notified to investors by the Authorised Offeror.
- Description of possibility to reduce subscriptions and manner for refunding excess amount paid by applicants: Not Applicable
- Details of the method and time limits for paying up and delivering the Securities: Investors will be notified by the Authorised Offeror of their allocations of Securities and the settlement arrangements in respect thereof.
- Manner in and date on which results of the offer are to be made public: Investors will be notified by the Authorised Offeror of their allocations of Securities and the settlement arrangements in respect thereof.
- Procedure for exercise of any right of pre-emption, negotiability of subscription rights and treatment of subscription rights not exercised: Not Applicable.
- Categories of holders to which the Securities are offered and whether Tranche(s) have been reserved for certain countries: Offers may be made through the Authorised Offeror in the Public Offer Jurisdiction to any person. Offers (if any) in other EEA countries will only be made through the Authorised Offeror pursuant to an exemption from the obligation under the Prospectus Regulation to publish a prospectus.
- Process for notification to applicants of the amount allotted and indication whether dealing may begin before notification is made: Applicants will be notified directly by the Authorised Offeror of the success of their application. No dealings in the Securities may take place prior to the Issue Date.

<ul style="list-style-type: none"> Name(s) and address(es), to the extent known to the Issuer, of the placers in the various countries where the offer takes place: the Authorised Offeror
<p><i>Estimated total expenses of the issue and/or offer including expenses charged to investor by issuer/offeror</i></p> <p>The Issuer will not charge any expenses to holders in connection with any issue of Securities. Offerors may, however, charge expenses to holders. Such expenses (if any) will be determined by agreement between the offeror and the holders at the time of each issue.</p>
<p align="center">Who is the offeror and/or the person asking for admission to trading?</p>
<p>The Issuer is the entity requesting for admission to trading of the Securities.</p>
<p align="center">Why is the Prospectus being produced?</p>
<p><i>Use and estimated net amount of proceeds</i></p> <p>The net proceeds from each issue of Securities will be applied by the Issuer for its general corporate purposes, which include making a profit and/or hedging certain risks. The estimated net proceeds is between 99.50% and 100% of the issue size.</p>
<p><i>Underwriting agreement on a firm commitment basis</i></p> <p>Not Applicable</p>
<p><i>Description of any interest material to the issue/offer, including conflicting interests</i></p> <p>The Authorised Offeror will be paid aggregate commissions equal to no more than 1.00% per annum of the Issue Price. Any Authorised Offeror and its affiliates may engage, and may in the future engage, in hedging transactions with respect to the Underlying Asset.</p>

RÉSUMÉ

INTRODUCTION ET AVERTISSEMENTS

Le présent Résumé doit être lu comme une introduction au Prospectus. Toute décision d'investir dans les Titres doit être fondée sur un examen exhaustif du Prospectus par l'investisseur. Dans certaines circonstances, l'investisseur pourrait perdre tout ou partie du capital investi. Lorsqu'une action concernant les informations contenues dans le Prospectus est intentée devant un tribunal, l'investisseur plaignant peut, selon le droit national, avoir à supporter les coûts de traduction du Prospectus avant le début de la procédure judiciaire. Seule la responsabilité civile des personnes qui ont présenté le Résumé, y compris toute traduction de celui-ci, peut être engagée pour autant que le Résumé soit trompeur, inexact ou incohérent, lorsqu'il est lu conjointement avec les autres parties du Prospectus, ou qu'il ne fournisse pas, lorsqu'il est lu en combinaison avec les autres parties du Prospectus, les informations clés permettant d'aider les investisseurs lorsqu'ils envisagent d'investir dans ces Titres.

Vous êtes sur le point d'acheter un produit qui n'est pas simple et qui peut être difficile à comprendre.

Titres : 67 000 000 EUR de Titres échus en mai 2031 dans le cadre du Global Structured Securities Programme (ISIN : FR00140003B9) (les "Titres").

L'Émetteur : L'Émetteur est Barclays Bank PLC. Son siège social est situé au 1 Churchill Place, Londres, E14 5HP, Royaume-Uni (numéro de téléphone : +44 (0)20 7116 1000) et son *Legal Entity Identifier* ("LEI") est G5GSEF7VJP5I7OUK5573

L'Offrant Autorisé : L'Offrant Autorisé est ABN AMRO Bank NV, Paris Branch et son adresse est 3 avenue Hoche, Paris, 75008, Paris, France (numéro de téléphone : +33 (0)1 56 21 97 82) et son LEI est 894500815LOLO4M5QL67.

Autorité compétente : Le Prospectus de Base a été approuvé le 13 avril 2023 par la Banque Centrale d'Irlande de New Wapping Street, North Wall Quay, Dublin 1, D01 F7X3, Irlande (numéro de téléphone : +353 (0)1 224 6000).

INFORMATIONS CLÉS SUR L'ÉMETTEUR

Qui est l'Émetteur des Titres?

Domicile et forme juridique de l'Émetteur

Barclays Bank PLC (l'"Émetteur") est une société publique à responsabilité limitée immatriculée en Angleterre et au Pays de Galles sous le numéro 1026167. La responsabilité des membres de l'Émetteur est limitée. Son siège social et principal est sis à 1 Churchill Place, Londres, E14 5HP, Royaume-Uni (numéro de téléphone +44 (0)20 7116 1000). Le *Legal Entity Identifier* (LEI) de l'Émetteur est G5GSEF7VJP5I7OUK5573.

Activités principales de l'Émetteur

Les activités du Groupe comprennent les services bancaires aux consommateurs et les opérations de paiement dans le monde entier, ainsi qu'une banque mondiale d'affaires et d'investissement de premier plan, offrant un service complet. Le Groupe comprend Barclays PLC avec ses filiales, en ce compris l'Émetteur. La principale activité de l'Émetteur est d'offrir des produits et des services destinés aux grands clients, qu'il s'agisse de grandes entreprises, de banque de gros ou de clients bancaires internationaux.

Le terme "**Groupe**" désigne Barclays PLC avec ses filiales et le terme "**Groupe Bancaire Barclays**" désigne Barclays Bank PLC avec ses filiales.

Principaux actionnaires de l'Émetteur

La totalité des actions ordinaires émises par l'Émetteur est la propriété effective de Barclays PLC. Barclays PLC est la société holding finale du Groupe.

Identité des principaux directeurs généraux de l'Émetteur

Les principaux directeurs généraux de l'Émetteur sont C.S. Venkatakrishnan (Chief Executive and Executive Director) et Anna Cross (Executive Director).

Identité des commissaires aux comptes de l'Émetteur

Les commissaires aux comptes de l'Émetteur sont KPMG LLP ("KPMG"), experts comptables et commissaires aux comptes agréés (membre de l'*Institute of Chartered Accountants* en Angleterre et au Pays de Galles), à l'adresse 15 Canada Square, Londres E14 5GL, Royaume-Uni.

Quelles sont les informations financières clés concernant l'Émetteur?

L'Émetteur a extrait les informations financières consolidées sélectionnées figurant dans le tableau ci-dessous pour les exercices clos les 31 décembre 2022 et 31 décembre 2021 des états financiers consolidés annuels de l'Émetteur pour les exercices clos les 31 décembre 2022 et 2021 (les "**États Financiers**"), qui ont chacun été audités avec une opinion non-modifiée fournie par KPMG. Les informations financières sélectionnées incluses dans le tableau ci-dessous pour les semestres clos le 30 juin 2023 et le 30 juin 2022 proviennent des états financiers intermédiaires consolidés condensés non audités de l'Émetteur pour le semestre clos le 30 juin 2023 (l'"**Annonce des Résultats Intermédiaires**"). Certains indicateurs financiers comparatifs inclus dans le tableau ci-dessous pour le semestre clos le 30 juin 2022 ont été révisés dans l'Annonce des Résultats Intermédiaires.

	Résultats consolidés			
	Au 30 juin (non audité)		Au 31 décembre	
	2023	2022	2022	2021
	(en millions de livres sterling)		(en millions de livres sterling)	
Revenu net d'intérêt	3.120	2.233	5.398	3.073
Commissions et honoraires nets.....	2.806	2.839	5.426	6.587
Charges de dépréciation des crédits/(reprises)	(688)	(293)	(933)	277
Résultat net des opérations de négoce	3.853	5.026	7.624	5.788
Bénéfice avant impôt	3.132	2.605	4.867	5.418
Bénéfice après impôt	2.607	2.129	4.382	4.588
	Bilan consolidé			
	Au 30 juin (non audité)		Au 31 décembre	
	2023	2022	2022	2021
	(en millions de livres sterling)		(en millions de livres sterling)	

Total des actifs.....	1.246.636	1.203.537	1.061.778
Titres de créance en circulation	58.377	60.012	48.388
Passif subordonné	36.325	38.253	32.185
Prêts et avances au coût amorti	183.237	182.507	145.259
Dépôts au coût amorti.....	307.820	291.579	262.828
Total des fonds propres.....	58.348	58.953	56.317
Certain Ratios des États Financiers²			
	Au 30 juin (non audité)	Au 31 décembre	
	2023	2022	2021
	(%)	(%)	
Capital Common Equity Tier 1	12,5	12,7	12,9
Capital réglementaire.....	20,1	20,8	20,5
Ratio de levier du Royaume-Uni (sous-consolidé) ³ .	5,9		

Quels sont les principaux risques spécifiques à l'Émetteur ?

Le Groupe Bancaire Barclays a identifié un large éventail de risques auxquels ses activités sont exposées. Les risques matériels sont ceux auxquels l'équipe de direction accorde une attention particulière et qui pourraient entraîner un écart important entre la stratégie, les résultats d'exploitation, la situation financière et/ou les perspectives du Groupe Bancaire Barclays et les attentes. Les risques émergents sont ceux qui ont des composantes inconnues, dont l'impact pourrait se cristalliser sur une période plus longue. En outre, certains autres facteurs échappant au contrôle du Groupe Bancaire Barclays, notamment l'intensification des conflits mondiaux, les actes de terrorisme, les catastrophes naturelles, les pandémies et autres événements similaires, bien que non détaillés ci-dessous, pourraient avoir un impact similaire sur le Groupe Bancaire Barclays.

- **Risques importants existants et émergents pouvant avoir un impact sur plus d'un risque principal:** Outre les risques matériels et émergents ayant un impact sur les principaux risques exposés ci-dessous, il faut également tenir compte des risques matériels existants et émergents qui peuvent avoir un impact sur plus d'un de ces principaux risques. Ces risques sont les suivants : (i) des conditions économiques et de marché mondiales et locales potentiellement défavorables, ainsi que des développements géopolitiques ; (ii) l'impact de la COVID-19; (iii) l'impact des changements de taux d'intérêt sur la rentabilité du Groupe Bancaire Barclays ; (iv) l'environnement concurrentiel dans le secteur des services bancaires et financiers ; (v) le programme de changement réglementaire et son impact sur le modèle d'entreprise ; (vi) l'impact des réformes des taux d'intérêt de référence sur le Groupe Bancaire Barclays et (vii) les risques liés à la mise en œuvre et à l'exécution des changements.
- **Risque climatique:** le risque climatique est l'impact sur les risques financiers et opérationnels découlant du changement climatique à travers les risques physiques, les risques associés à la transition vers une économie à plus faible émission de carbone et les risques connexes découlant des impacts de second ordre de ces deux facteurs sur les portefeuilles.
- **Risques de crédit et de marché :** Le risque de crédit est le risque de perte pour le Groupe Bancaire Barclays résultant de la défaillance de clients ou contreparties, d'honorer pleinement leurs obligations envers les membres du Groupe Bancaire Barclays. Le Groupe Bancaire Barclays est exposé aux risques liés aux changements de qualité du crédit et des taux de recouvrement des prêts et avances dus par les emprunteurs et les contreparties. Le risque de marché est le risque de perte résultant d'une éventuelle évolution défavorable dans la valeur des actifs et des passifs du Groupe Bancaire Barclays résultant de la fluctuation dans les variables du marché.
- **Risques de trésorerie et de capital et le risque que l'Émetteur et le Groupe Bancaire Barclays soient soumis à d'importants pouvoirs de résolution:** Le Groupe Bancaire Barclays est confronté à trois principaux types de risques de trésorerie et de capital qui sont (1) le risque de liquidité – le risque que le Groupe Bancaire Barclays ne soit pas en mesure de remplir ses obligations contractuelles ou contingentes ou qu'il n'ait pas le montant approprié de financement stable et de liquidité pour soutenir ses actifs, qui peuvent également être affectés par un changement de la notation de crédit ; (2) le risque de capital – le risque que le Groupe Bancaire Barclays ait un niveau ou une composition de capital insuffisant ; et (3) le risque de taux d'intérêt dans le portefeuille bancaire - le risque que le Groupe Bancaire Barclays soit exposé à la volatilité des capitaux ou des revenus en raison d'une inadéquation entre les expositions aux taux d'intérêt de ses actifs et passifs (non négociés). En vertu de la Loi Bancaire de 2009 (*Banking Act 2009*), des pouvoirs importants sont accordés à la Banque d'Angleterre (ou, dans certaines circonstances, au Trésor de Sa Majesté (*HM Treasury*)), en consultation avec l'Autorité de Régulation Prudentielle du Royaume-Uni (*United Kingdom Prudential Regulation Authority*), l'Autorité de Conduite Financière du Royaume-Uni (*Financial Conduct Authority*) et le Trésor de Sa Majesté, selon le cas, dans le cadre d'un régime de résolution spéciale. Ces pouvoirs permettent à la Banque d'Angleterre (ou à tout successeur ou remplaçant de celle-ci et/ou à toute autre autorité du Royaume-Uni compétente pour exercer le Pouvoir de Renflouement du Royaume-Uni (*UK Bail-in Power*)) (l'"**Autorité de Résolution**") de mettre en œuvre diverses mesures de résolution et options de stabilisation (y compris, mais sans s'y limiter, l'outil de renflouement) à l'égard d'une banque ou d'une entreprise d'investissement du Royaume-Uni et certaines de ses filiales (y compris l'Émetteur à la date du Document d'Enregistrement) dans des circonstances où l'Autorité de Résolution est satisfaite que les conditions de résolution pertinentes sont remplies.
- **Risques opérationnels et de modèle :** Le risque opérationnel est le risque de perte pour le Groupe Bancaire Barclays résultant de processus ou de systèmes inadéquats ou défaillants, de facteurs humains ou d'événements externes dont la cause profonde n'est pas due à des risques de crédit ou de marché. Le risque de modèle est le potentiel de conséquences négatives dérivant de décisions fondées sur des résultats et des rapports obtenus à partir de modèles incorrects ou mal utilisés.

² Les fonds propres, les actifs pondérés en fonction des risques et l'effet de levier sont calculés en appliquant les dispositions transitoires de la CRR telles que modifiées par la CRR II. Cela inclut les dispositions transitoires de l'IFRS 9 et la protection des droits acquis des instruments de capital non conformes à la CRR II.

³ Les exigences minimales en matière d'effet de levier pour Barclays Bank PLC ont été fixées à un niveau sous-consolidé à compter du 1er janvier 2023. Aucun élément de comparaison n'est fourni car il s'agit de la première période de reporting pour l'effet de levier sous-consolidé de Barclays Bank PLC.

- **Risque lié au comportement, risques réputationnel et juridique et aspects juridiques, concurrentiels et réglementaires** : Le risque lié au comportement est le risque de résultats insuffisants, ou de préjudice pour les consommateurs, les clients et les marchés, provenant de la fourniture de produits et services du Groupe Bancaire Barclays. Le risque réputationnel est le risque qu'une action, une transaction, un investissement, un événement, une décision ou une relation d'affaire réduise la confiance dans l'intégrité et/ou la compétence du Groupe Bancaire Barclays. Le Groupe Bancaire Barclays exerce des activités sur un marché global très réglementé qui l'expose ainsi que ses employés au risque juridique découlant (i) de la multitude de lois et de règlements qui s'appliquent aux activités qu'il exerce, qui sont très dynamiques, qui peuvent varier selon les juridictions et/ou le conflit, et peuvent être peu claires dans leur application à des circonstances particulières, notamment dans les domaines nouveaux et émergents ; et (ii) de la nature diversifiée et évolutive des activités du Groupe Bancaire Barclays et de ses pratiques commerciales. Dans chaque cas, le Groupe Bancaire Barclays et ses employés sont confrontés au risque de perte ou à l'imposition de pénalités, de dommages et intérêts ou d'amendes suite au non-respect par les membres du Groupe Bancaire Barclays de leurs obligations légales, y compris les exigences légales, réglementaires ou contractuelles. Le risque juridique peut survenir en relation avec un certain nombre de facteurs de risque résumés ci-dessus.

Au deuxième trimestre 2023, le risque principal "Risque lié au Comportement" a été élargi pour inclure le "Risque lié aux Lois, Règles et Réglementations (LRR)" et a par conséquent été renommé en "Risque de Conformité". Afin de refléter ceci, la définition du risque de conformité est la suivante : "Le risque de mauvais résultats ou de préjudice pour les clients et les marchés, découlant de la fourniture des produits et services de l'entreprise (également connu sous le nom de "Risque lié au Comportement") et le risque pour le Groupe Barclays Bank, ses clients, ses usagers ou ses marchés de ne pas se conformer aux lois, règles et réglementations applicables à l'entreprise (également connu sous le nom de Risque lié aux Lois, Règles et Réglementations, "Risque LRR)". La définition du risque principal "Risque Juridique" a été mise à jour : "Le risque de perte ou d'imposition de pénalités, de dommages ou d'amendes résultant de l'incapacité de l'entreprise à respecter les lois, règles et réglementations applicables ou les exigences contractuelles, ou à faire valoir ou défendre ses droits de propriété intellectuelle". Le cadre révisé entrera en vigueur en juin 2023.

INFORMATIONS CLES SUR LES TITRES

Quelles sont les principales caractéristiques des Titres ?

Type et catégorie de Titres offerts et admis à la négociation, y compris les numéros d'identification des Titres

Les Titres se présenteront sous la forme de notes et seront identifiés de manière unique par : numéro de Série : NX00388974 ; Numéro de la tranche : 1 ; ISIN : FR00140003B9 ; Code commun : 276988620.

Les Titres seront compensés et réglés par Euroclear France S.A..

Devise, dénomination spécifiée, taille de l'émission et durée des Titres

Les Titres seront émis en Euros ("EUR") (la "Devise d'Emission") et réglés dans la même devise (la "Devise de Règlement"). Les Titres sont négociables en valeur nominale et la dénomination spécifiée par Titre est 1 000 EUR. La taille de l'émission est de 67 000 000 EUR. Le prix d'émission est de 99,50 % de la Dénomination Spécifiée par Titre.

La date d'émission est le 11 mars 2024 (la "Date d'Emission"). Sous réserve d'une résiliation anticipée, il est prévu que les Titres soient remboursés le 5 mai 2031 (la "Date de Règlement Prévue").

Les Titres sont des Notes Vertes et Sociales et peuvent satisfaire certains objectifs "verts", "durables", "sociaux", "ESG" ou similaires.

Droits attachés aux Titres

Rendement potentiel : Les Titres donneront à chaque détenteur de Titres le droit de recevoir un rendement potentiel sur les Titres, ainsi que certains droits accessoires tels que le droit de recevoir un avis concernant certaines décisions et événements et le droit de voter sur certaines (mais pas toutes) modifications des conditions des Titres. Le rendement potentiel prendra la forme de : (i) un ou plusieurs Montants d'Intérêt, (ii) un Montant de Règlement Autocall en Espèces, et/ou (iii) un Montant de règlement final en espèces, étant entendu que si les Titres sont résiliés de manière anticipée, le rendement potentiel peut prendre la forme (i) d'un Montant de Règlement en Espèces Anticipé.

Fiscalité : Tous les paiements relatifs aux Titres seront effectués sans retenue ou déduction au titre des impôts britanniques, à moins qu'une telle retenue ou déduction ne soit exigée par la loi. Dans le cas où une telle retenue ou déduction est exigée par la loi, l'Emetteur devra, sauf dans des circonstances limitées, payer des montants supplémentaires pour couvrir les montants ainsi retenus ou déduits.

Les cas de défaillance : Si l'Emetteur n'effectue pas un paiement dû en vertu des Titres ou viole toute autre condition des Titres d'une manière qui porte préjudice aux intérêts des détenteurs (et s'il n'est pas remédié à ce manquement dans les 30 jours calendaires ou, dans le cas des intérêts si le paiement n'a pas été effectué dans les 14 jours calendaires suivant la date d'échéance), ou si l'Emetteur fait l'objet d'une ordonnance de liquidation, alors (sous réserve, dans le cas des intérêts, de l'impossibilité pour l'Emetteur de payer en vertu d'une provision légale impérative) les Titres deviendront immédiatement dus et payables, sur avis donné par le représentant des détenteurs lorsque les détenteurs sont regroupés dans la "Masse".

Limitations des droits

Remboursement anticipé suite à certains événements perturbateurs ou pour cause d'illégalité ou d'impossibilité pratique : L'Emetteur peut racheter les Titres avant leur Date de Règlement Prévue à la suite de la survenance de certains événements perturbateurs ou extraordinaires concernant l'Emetteur, ses dispositifs de couverture, le(s) Actif(s) Sous-Jacent(s), la fiscalité ou la devise concernée des Titres, ou s'il détermine que l'exécution de l'une de ses obligations en vertu des Titres est illégale ou physiquement impossible. Dans ce cas, les investisseurs recevront un "Montant de Règlement Anticipé en Espèces" égal à la juste valeur marchande des Titres avant leur rachat (ajusté pour tenir compte des coûts, pertes et frais pertinents).

Certaines limitations supplémentaires:

- Bien que les Titres soient liés à la performance du/des Actif(s) Sous-Jacent(s), les détenteurs n'ont aucun droit sur le(s) Actif(s) Sous-Jacent(s).
- Les conditions des Titres permettent à l'Emetteur et à l'Agent de Détermination (selon le cas), à la survenance de certains événements et dans certaines circonstances, sans le consentement des détenteurs, d'apporter des ajustements aux conditions des Titres, de racheter les Titres avant l'échéance, de monétiser les Titres, de reporter ou obtenir une valorisation alternative des Actif(s) Sous-Jacent(s) de reporter paiements prévus en vertu des Titres, de changer la devise dans laquelle les Titres sont libellés, de remplacer le(s) Actif(s) Sous-Jacent(s), de remplacer l'Emetteur par une autre entité autorisée sous certaines conditions, et de prendre certaines autres mesures concernant les Titres et le(s) Actif(s) Sous-Jacent(s).
- Les Titres contiennent des dispositions relatives à la convocation d'assemblées de détenteurs pour examiner des questions affectant leurs intérêts en général et ces dispositions permettent à des majorités définies de lier tous les détenteurs, y compris les détenteurs qui n'ont pas assisté et voté à l'assemblée concernée et les détenteurs qui ont voté d'une manière contraire à la majorité.

Droit applicable

Les Titres seront régis par le droit français et les droits qui en découlent seront interprétés en conséquence.

Description du calcul du rendement potentiel des Titres

Actifs Sous-Jacents: Le rendement et la valeur des Titres sont liés à la performance de l'Actif Sous-Jacent suivant :

Actif Sous-jacent _(Intérêts) / Actif Sous-jacent _(Règlement Autocall) / Actif Sous-jacent _(Règlement Final)	Type	Prix Initial _(Intérêts) / Prix Initial _(Règlement Autocall) / Prix Initial _(Règlement)	Date de Valorisation Initiale
EUR STX 50 ESG (EUR)P	Indice	Le Prix de Valorisation de l'Actif Sous-Jacent à la Date de Valorisation Initiale	26 avril 2024

Aux fins de la détermination d'un Montant d'Intérêt, l'Actif Sous-Jacent désigne l'Actif Sous-Jacent_(Intérêts) et, aux fins de la détermination d'un Evénement de Règlement Automatique (Autocall), l'Actif Sous-Jacent désigne l'Actif Sous-Jacent_(Règlement Autocall) et aux fins de la détermination du Montant Final de Règlement en Espèces, l'Actif Sous-Jacent désigne l'Actif Sous-Jacent_(Règlement Final).

Montant de Calcul: Les calculs des sommes payables en vertu des Titres sont effectués par référence au "**Montant de Calcul**", soit 1 000 EUR par Titre.

Agent de Détermination : Barclays Bank PLC sera nommée pour effectuer des calculs et prendre des décisions à l'égard des Titres.

A – Intérêts

Chaque Titre ne paiera des intérêts à une Date de Paiement d'Intérêts que si le prix ou le niveau de clôture de l'Actif Sous-jacent à la Date de Valorisation d'Intérêts correspondante est supérieur ou égal à sa Barrière d'Intérêts correspondante. Dans un tel cas, le montant des intérêts à verser est calculé :

- (1) en multipliant le taux fixe de 3.00 % par 1 000 EUR; puis
- (2) en multipliant le résultat par le nombre correspondant à cette Date de Valorisation d'Intérêts - c. à d. le nombre figurant dans la colonne « T » du tableau ci-dessous).

Chaque Date de Paiement d'Intérêts, Date de Valorisation d'Intérêts correspondante, T et la (les) Barrière(s) d'Intérêts sont comme suit :

T	Date de Valorisation d'Intérêts	Dates de Paiement d'Intérêts	Barrière d'Intérêts
2	28 avril 2025	05 mai 2025	100,00 %
3	27 octobre 2025	31 octobre 2025	100,00 %
4	27 avril 2026	04 mai 2026	100,00 %
5	26 octobre 2026	30 octobre 2026	100,00 %
6	26 avril 2027	30 avril 2027	100,00 %
7	26 octobre 2027	01 novembre 2027	100,00 %
8	26 avril 2028	03 mai 2028	100,00 %
9	26 octobre 2028	01 novembre 2028	100,00 %
10	26 avril 2029	03 mai 2029	100,00 %
11	26 octobre 2029	01 novembre 2029	100,00 %
12	26 avril 2030	03 mai 2030	100,00 %
13	28 octobre 2030	01 novembre 2030	100,00 %
14	28 avril 2031	05 mai 2031	80,00 %

B – Règlement Automatique (Autocall)

Les Titres seront automatiquement remboursés si le cours de clôture ou le niveau de l'Actif Sous-jacent divisé par son Prix Initial est égal ou supérieur à son Pourcentage de la Barrière Autocall correspondant à l'égard d'une quelconque Date de Valorisation Autocall. Si cela se produit, vous recevrez un Montant de Règlement Autocall en Espèces égal au Montant de Calcul multiplié par 100 % payable à la Date de Règlement Autocall correspondant à cette Date de Valorisation Autocall. La Date de Règlement Autocall concernée peut être reportée à la suite du report d'une Date de Valorisation Autocall en raison d'un événement perturbateur.

Date de Valorisation Autocall	Date de Règlement Autocall	Pourcentage de la Barrière Autocall
28 avril 2025	05 mai 2025	100,00 %
27 octobre 2025	31 octobre 2025	100,00 %
27 avril 2026	04 mai 2026	100,00 %
26 octobre 2026	30 octobre 2026	100,00 %
26 avril 2027	30 avril 2027	100,00 %
26 octobre 2027	01 novembre 2027	100,00 %
26 avril 2028	03 mai 2028	100,00 %
26 octobre 2028	01 novembre 2028	100,00 %
26 avril 2029	03 mai 2029	100,00 %
26 octobre 2029	01 novembre 2029	100,00 %
26 avril 2030	03 mai 2030	100,00 %
28 octobre 2030	01 novembre 2030	100,00 %

C – Règlement Final

Si les Titres ne sont pas remboursés autrement, chaque Titre sera remboursé à la Date de Règlement Prévüe par le paiement du Montant du Règlement en Espèces Final.

La Date de Règlement Prévüe peut être reportée à la suite du report de la Date de Valorisation Finale en raison d'un événement perturbateur.

Le Montant de Règlement en Espèces Final est calculé comme suit :

- (i) si le Rendement Final est supérieur ou égal au Pourcentage de la Barrière *Knock-in* (soit 60 %), 100 % multiplié par le Montant de Calcul;

(ii) à défaut, un montant calculé en divisant le Rendement Final par le Pourcentage du Prix d'Exercice (soit 100 %) et en multipliant le résultat par le Montant de Calcul.
Le " Rendement Final " désigne le Prix de Valorisation Final divisé par le Prix Initial _(Règlement)
La " Date de Valorisation Finale " désigne le 28 avril 2031, sous réserve d'ajustements.
Le " Prix de Valorisation Final " désigne, à l'égard de l'Actif Sous-jacent, le prix de clôture de l'Actif Sous-jacent à la Date de Valorisation Finale.
Statut des Titres
Les Titres sont des obligations directes, non subordonnées et non garanties de l'Émetteur et sont de rang égal entre elles.
Description des restrictions au libre transfert des Titres:
Les Titres sont offerts et vendus en dehors des États-Unis à des personnes n'ayant pas la nationalité américaine, en s'appuyant sur le règlement S de la Loi sur les Valeurs Mobilières et doivent se conformer aux restrictions de transfert en ce qui concerne les États-Unis. Les Titres détenus dans un système de compensation seront transférés conformément aux règles, procédures et règlements de ce système de compensation. Sous réserve de ce qui précède, les Titres seront librement transférables.
Où les Titres seront-ils négociés ?
Une demande est censée être faite par l'Émetteur (ou en son nom) pour que les Titres soient admis à la négociation sur le marché réglementé de la Bourse du Luxembourg.
Quels sont les risques clés spécifiques aux Titres?
Les Titres sont soumis aux principaux risques suivants:
<ul style="list-style-type: none"> • Vous pouvez perdre tout ou partie de votre investissement dans les Titres : Les investisseurs sont exposés au risque de crédit de Barclays Bank PLC. Comme les Titres ne constituent pas une caution et ne sont assurés ou garantis par aucun gouvernement ou aucune agence ou en vertu du système de garantie de crédit du gouvernement britannique, tous paiements ou toutes livraisons à effectuer par Barclays Bank PLC en tant qu'Émetteur en vertu des Titres dépendent de sa position financière et de sa capacité à remplir ses obligations. Les Titres constituent des obligations non subordonnées et non garanties de l'Émetteur et sont de même rang que toutes les autres obligations non subordonnées et non garanties actuelles et futures de l'Émetteur. Les conditions des Titres ne prévoient pas de paiement minimum prévu à l'échéance et, à ce titre, en fonction de la performance du ou des Actif(s) Sous-Jacent(s), vous pouvez perdre tout ou partie de votre investissement. Vous pouvez également perdre tout ou une partie de votre investissement si : (a) vous vendez vos Titres avant leur échéance ou leur expiration prévue ; (b) vos Titres sont remboursés par anticipation dans certaines circonstances extraordinaires ; ou (c) les modalités de vos Titres sont ajustées de telle sorte que le montant payable ou le bien qui vous est livré est inférieur à votre investissement initial. • Il existe des risques liés à l'évaluation, à la liquidité et à l'offre des Titres : La valeur marchande de vos Titres peut être considérablement inférieure au prix d'émission, car le prix d'émission peut tenir compte de la marge bénéficiaire et des coûts de l'Émetteur et/ou du distributeur, en plus de la juste valeur marchande des Titres. La valeur marchande de vos Titres peut être affectée par la volatilité, le niveau, la valeur ou le prix du (des) Actif(s) Sous-Jacent(s) au moment considéré, les changements de taux d'intérêt, la situation financière et les notations de crédit de l'Émetteur, l'offre et la demande de Titres, le temps restant jusqu'à l'échéance ou l'expiration des Titres et d'autres facteurs. Le prix auquel vous pourrez, le cas échéant, vendre vos Titres avant l'échéance peut être sensiblement inférieur au montant que vous avez investi initialement. Vos Titres peuvent ne pas avoir un marché actif et l'Émetteur ne peut être tenu de créer un marché ou de racheter les Titres avant le rachat. L'Émetteur peut retirer l'offre publique à tout moment. Dans ce cas, si vous avez déjà payé ou livré des fonds de souscription pour les Titres concernés, vous aurez droit au remboursement de ces montants, mais vous ne recevrez aucune rémunération qui aurait pu être accumulée dans la période entre leur paiement ou livraison des fonds de souscription et le remboursement des Titres. • Vous êtes soumis aux risques liés à la détermination du montant à payer dans le cadre des Titres : Le Montant d'Intérêts dépend de la performance du (des) Actif(s) Sous-Jacent(s) et peut être égal à zéro si les critères de performance ne sont pas satisfaits. Dans ce cas, le Montant d'Intérêts peut être reporté au prochain paiement d'intérêt qui peut être effectué, mais vous ne recevrez aucun montant pour compenser ce report et il est possible que vous ne receviez aucun intérêt pendant toute la durée de vie des Titres. Le Montant Final de Règlement en Espèces est basé sur la performance de l' (des) Actif(s) Sous-Jacent(s) à la date de Valorisation finale uniquement (plutôt que sur plusieurs périodes tout au long de la durée des Titres). Cela signifie que vous ne pouvez bénéficier d'aucun mouvement du prix de l'Actif Sous-Jacent pendant la durée des Titres qui ne soit pas maintenu dans la performance finale à la date de Valorisation finale. Comme le Montant Final de Règlement en Espèces est soumis à un plafond, la valeur ou le rendement de vos Titres peut être sensiblement inférieur à celui que vous auriez obtenu si vous aviez acheté directement le ou les Actif(s) Sous-Jacent(s). Le calcul du montant à payer dépend du niveau, de la valeur ou du prix du ou des Actif(s) Sous-jacent(s) qui atteignent ou franchissent une "barrière" pendant une période déterminée ou à des dates déterminées pendant la durée des Titres. Cela signifie que vous pouvez recevoir moins (ou, dans certains cas, plus) si le niveau, la valeur ou le prix du ou des Actif(s) Sous-Jacent(s) franchit ou atteint (selon le cas) une barrière, que s'il s'approche de la barrière mais ne l'atteint pas ou ne la franchit pas (selon le cas), et dans certains cas, vous pouvez ne recevoir aucun paiement d'intérêt ou de coupon et/ou perdre tout ou partie de votre investissement. • Vos Titres peuvent faire l'objet d'ajustements et d'un remboursement anticipé : Conformément aux modalités des Titres, à la suite de la survenance de certains événements perturbateurs ou extraordinaires concernant l'Émetteur, ses dispositifs de couverture, le ou les Actif(s) Sous-Jacent(s), la fiscalité ou la devise concernée des Titres, l'Agent de Détermination ou l'Émetteur peut prendre un certain nombre de mesures correctives, y compris l'estimation du prix de l'Actif Sous-Jacent, le remplacement de l'Actif Sous-Jacent et les ajustements des modalités des Titres. Chacune de ces mesures correctives peut modifier les caractéristiques économiques des Titres et avoir un effet négatif important sur la valeur et le rendement des Titres. Si aucune mesure corrective ne peut être prise, ou s'il est déterminé que l'exécution de l'une des obligations de l'Émetteur en vertu des Titres est illégale, l'Émetteur peut racheter les Titres par anticipation en payant un Montant de Règlement Anticipé en Espèces. En cas de rachat anticipé, vous pouvez perdre tout ou partie de votre investissement car le Montant de Règlement Anticipé en Espèces peut être inférieur au prix auquel vous avez acheté les Titres, voire être nul. Vous perdrez également la possibilité de participer à toute performance positive ultérieure du ou des Actif(s) Sous-Jacent(s) et ne pourrez réaliser aucun gain potentiel de la valeur des Titres. Il se peut que vous ne puissiez pas réinvestir le produit d'un investissement à un rendement comparable et/ou avec un taux d'intérêt ou un coupon comparable pour un niveau de risque similaire. • Le règlement est soumis à des conditions et peut être impossible dans certaines circonstances : Le paiement du montant à payer n'aura pas lieu tant que toutes les conditions du règlement n'auront pas été entièrement satisfaites. Aucune somme supplémentaire ne vous sera payable par l'Émetteur en raison d'un retard ou d'un report qui en résulterait. Certains événements de perturbation du règlement peuvent survenir, ce qui pourrait restreindre la capacité de l'Émetteur à effectuer des paiements, et la date de règlement pourrait être retardée en conséquence. • Risques liés à l' (aux) Actif(s) Sous-Jacent(s) qui sont des indices d'actions : Les indices d'actions sont composés d'un portefeuille synthétique d'actions et offrent des possibilités de diversification des investissements, mais sont soumis au risque de fluctuations des prix des actions ainsi que de la valeur et de la volatilité de l'indice d'actions concerné. Les Titres sont liés à indices d'actions et, en tant que tels, ne peuvent pas participer aux dividendes ou à toute autre

distribution versés sur les actions qui composent ces indices. En conséquence, vous pouvez recevoir un rendement inférieur à celui que vous auriez reçu si vous aviez investi directement dans ces actions. Le sponsor de l'indice peut ajouter, supprimer ou remplacer les composantes d'un indice d'actions à sa discrétion, et peut également modifier la méthodologie utilisée pour calculer le niveau de cet indice. Ces événements peuvent avoir un impact préjudiciable sur le niveau de cet indice qui, à son tour, pourrait avoir un impact négatif sur la valeur et le rendement des Titres. En outre, le nom d'un indice et/ou la commercialisation de titres liés à cet indice peuvent décrire l'indice comme ayant des objectifs "verts", "durables", "sociaux", "ESG" ou similaires. Il existe une variété d'approches en ce qui concerne les indices sensibles au climat et les méthodologies de construction socialement responsables qui peuvent chacune avoir leurs propres mérites respectifs, mais qui peuvent ne pas avoir l'ampleur et la diversité d'impact souhaitées par certains investisseurs. Par conséquent, les objectifs de l'indice peuvent ne pas répondre aux objectifs, attentes ou exigences des investisseurs en matière d'investissements "verts", "durables", "sociaux", "ESG" ou autres labels similaires.

- **Le ou les Actif(s) Sous-Jacent(s) sont des "benchmarks" au sens du règlement de l'UE sur les indices de référence (règlement (UE) 2016/1011, tel que modifié)** : En vertu du règlement de l'UE sur les indices de référence, un Actif Sous-Jacent ne peut pas être utilisé de certaines manières par une entité soumise à la surveillance de l'UE après le 31 décembre 2023 si son administrateur n'obtient pas d'autorisation ou d'enregistrement (ou, s'il s'agit d'une entité non européenne, ne remplit pas les conditions d'"équivalence" et n'est pas "reconnue" dans l'attente d'une décision d'équivalence ou n'est pas "avalisée" par une entité soumise à la surveillance de l'UE). Si cela se produit, l'Actif Sous-Jacent sera remplacé par un Actif Sous-Jacent de substitution prénommé, et les caractéristiques économiques des Titres pourraient changer négativement de manière importante [un événement de perturbation se produira et les Titres pourraient être rachetés par anticipation. En outre, la méthodologie ou d'autres conditions d'un Actif Sous-Jacent pourraient être modifiées afin de se conformer aux exigences du règlement de l'UE sur les indices de référence, et ces modifications pourraient réduire ou augmenter le niveau ou affecter la volatilité du niveau publié de cet Actif Sous-Jacent, ce qui pourrait à son tour entraîner des ajustements des conditions des Titres ou un remboursement anticipé.
- **Risques liés aux Titres labellisés "Notes Vertes et/ou Sociales"**: Toute affectation des produits à(aux) actif(s) éligible(s) concerné(s) en ce qui concerne les Notes Vertes et/ou Sociales (ou tout manquement à cet égard) peut ne pas atteindre les objectifs, attentes ou exigences des investisseurs en ce qui concerne l'investissement durable et, par conséquent, il existe un risque qu'un investissement dans les "Notes Vertes et/ou Sociales" ne permette pas d'atteindre vos objectifs d'investissement. En outre, bien que l'Émetteur ait l'intention d'allouer un montant égal au produit net des Notes Vertes et/ou Sociales au(x) actif(s) éligible(s) concerné(s), il se peut qu'il n'y ait pas suffisamment d'actif(s) éligible(s) pour que ce montant soit entièrement utilisé et tout produit net non alloué sera investi dans des liquidités et des investissements liquides à court terme jusqu'à ce que suffisamment d'actif(s) éligible(s) devienne(nt) disponible(s). Il peut également y avoir (a) le retrait ou la modification de tout avis ou certification d'une partie externe et/ou la radiation concernant les Notes Vertes et/ou Sociales; et/ou (b) des critiques formulées par des groupes d'activistes ou d'autres parties prenantes sur les investissements réalisés par le Groupe ou sur d'autres aspects de ses activités. Ces événements peuvent entraîner des conséquences négatives pour les investisseurs dont le portefeuille a pour mandat d'investir dans des Titres destinés à être utilisés dans un but particulier. Par exemple, vous pourriez être obligé de vous défaire de ces Titres potentiellement à perte et/ou ne pas être en mesure de comptabiliser ces Titres dans votre portefeuille, ce qui pourrait également entraîner une perte.
- **Risques associés aux Titres liés à l'Indice ESG Barclays ou à d'autres Titres liés à un indice qui est commercialisé comme ayant des objectifs "verts", "durables", "sociaux", "ESG" ou similaires** : La méthodologie appliquée à l'égard d'un indice ESG Barclays ou d'un autre indice commercialisé comme ayant des objectifs "verts", "durables", "sociaux", "ESG" ou similaires (le cas échéant) peut ne pas satisfaire les attentes ou exigences des investisseurs en matière d'investissement durable et il existe donc un risque qu'un investissement dans les Titres n'atteigne pas vos objectifs d'investissement. Cela pourrait entraîner des conséquences négatives pour certains investisseurs dont le portefeuille a pour mandat d'investir dans des titres destinés à être utilisés dans un but particulier, par exemple, vous pourriez être tenu de céder ces Titres, éventuellement à perte.
- **Risques fiscaux** : Les niveaux et la base d'imposition des Titres et tout allègement de cette imposition dépendront de votre situation personnelle et pourraient changer à tout moment pendant la durée de vie des Titres. Cela pourrait avoir des conséquences négatives pour vous et vous devriez donc consulter vos propres conseillers fiscaux quant aux conséquences fiscales pour vous des transactions portant sur les Titres.
- **Conflits d'intérêts potentiels** : Des conflits d'intérêts peuvent exister lorsque la Barclays Bank PLC ou sa filiale : (i) agit à plusieurs titres en ce qui concerne les Titres (par exemple, en tant qu'Émetteur, gestionnaire et agent de détermination) ; (ii) conclut des opérations de couverture pour couvrir l'exposition de l'Émetteur aux montants en espèces à payer ou aux actifs à livrer en vertu des Titres à l'échéance ; et (iii) utilise les contributions de ses bureaux de négociation comme source de prix pour un Actif Sous-Jacent. À la lumière de ces conflits, les mesures prises ou les décisions prises par Barclays Bank PLC en rapport avec les Titres peuvent ne pas toujours être dans le meilleur intérêt des détenteurs. En plus des opérations de couverture, Barclays Bank PLC peut négocier les Actif(s) Sous-Jacent(s) dans le cadre de ses activités ordinaires. Ces opérations peuvent affecter le prix du marché du ou des Actif(s) Sous-Jacent(s), ce qui peut avoir un effet négatif sur la valeur et le rendement de vos Titres.

INFORMATIONS CLÉS SUR L'OFFRE DES TITRES AU PUBLIC ET/OU L'ADMISSION À LA NÉGOCIATION SUR UN MARCHÉ RÉGLEMENTÉ

Dans quelles conditions et selon quel calendrier puis-je investir dans ces Titres?

Modalités de l'offre

Les modalités de toute offre de Titres au public peuvent être déterminées par un accord entre l'Émetteur et l'Offrant Autorisé au moment de chaque émission. Les Titres sont offerts à la souscription en France pendant la période allant du 11 mars 2024 (inclus) au 26 avril 2024 (inclus) (la "Période d'Offre"), et cette offre est soumise aux conditions suivantes:

- Prix de l'Offre: Entre 99,50% et 100,00% de la Valeur Nominale, tel que précisé dans le tableau ci-dessous, pour un segment donné de la Période d'Offre:

Période d'Offre	Prix de l'Offre
Du 11/03/2024 (inclus) au 15/03/2024 (inclus)	99,50% de la Valeur Nominale
Du 18/03/2024 (inclus) au 22/03/2024 (inclus)	99,58% de la Valeur Nominale
Du 25/03/2024 (inclus) au 29/03/2024 (inclus)	99,67% de la Valeur Nominale
Du 01/04/2024 (inclus) au 05/04/2024 (inclus)	99,75% de la Valeur Nominale
Du 08/04/2024 (inclus) au 12/04/2024 (inclus)	99,83% de la Valeur Nominale
Du 15/04/2024 (inclus) au 19/04/2024 (inclus)	99,92% de la Valeur Nominale
Du 22/04/2024 (inclus) au 26/04/2024 (inclus)	100,00% de la Valeur Nominale

<ul style="list-style-type: none"> • Conditions auxquelles l'offre est soumise: L'Émetteur se réserve le droit de retirer l'offre de Titres à tout moment avant la fin de la Période d'Offre. Suite au retrait de l'offre, si toute demande a été effectuée par tout investisseur potentiel, aucun desdits investisseurs potentiels ne pourra souscrire à ou autrement acquérir les Titres, et toutes demandes seront automatiquement annulées et l'argent de l'achat sera remboursé au demandeur par l'Offrant Autorisé conformément aux procédures habituelles de l'Offrant Autorisé. • Description de la procédure de candidature: Une offre des Titres peut être effectuée par le Gestionnaire ou l'Offrant Autorisé autrement qu'en vertu de l'Article 1(4) du Règlement (UE) concernant le prospectus en France (le "Pays de l'Offre Publique") pendant la Période d'Offre. Les demandes portant sur les Titres peuvent être soumises dans le Pays de l'Offre Publique par l'intermédiaire de l'Offrant Autorisé pendant la Période d'Offre. Les Titres seront placés dans le Pays de l'Offre Publique par l'Offrant Autorisé. La distribution s'effectuera conformément aux procédures habituelles de l'Offrant Autorisé, indiquées aux investisseurs par l'Offrant Autorisé. • Détails du montant minimum et/ou maximum de la demande : Le montant minimum et/ou maximum de la demande de l'Offrant Autorisé sera communiqué aux investisseurs par l'Offrant Autorisé. • Description de la possibilité de réduire les abonnements et des modalités de remboursement du montant excédentaire payé par les demandeurs: Non Applicable. • Détails du mode et des délais de libération et de livraison des Titres: Les investisseurs seront informés par l'Offrant Autorisé de leurs attributions de Titres et des dispositifs de règlement se rapportant à celles-ci. • Modalités et date auxquelles les résultats de l'offre doivent être rendus publics: Les investisseurs seront informés par l'Offrant Autorisé de leurs attributions de Titres et des dispositifs de règlement se rapportant à celles-ci. • Procédure d'exercice de tout droit de préemption, négociabilité des droits de souscription et traitement des droits de souscription non exercés: Non Applicable. • Catégories de détenteurs auxquelles les Titres sont offerts et si la ou les Tranche(s) ont été réservée(s) pour certains pays: Les offres peuvent être adressées à toute personne par l'intermédiaire de l'Offrant Autorisé dans le Pays de l'Offre Publique. Les offres (le cas échéant) dans les autres pays de l'EEE seront uniquement effectuées par l'intermédiaire de l'Offrant Autorisé en vertu d'une exemption de l'obligation de publication d'un prospectus prévue par le Règlement concernant le prospectus. • Procédure de notification aux demandeurs du montant alloué et indication du fait que la négociation peut commencer avant la notification: Les demandeurs seront informés directement par l'Offrant Autorisé du succès de leur demande. Aucune négociation des Titres ne peut avoir lieu avant la Date d'Emission. • Nom(s) et adresse(s), dans la mesure où ils sont connus de l'Émetteur, des placeurs dans les différents pays où l'offre a lieu : le ou les Offrant(s) Autorisé(s).
<p><i>Estimation des frais totaux de l'émission et/ou de l'offre, y compris les frais imputés à l'investisseur par l'émetteur/l'offreur</i></p> <p>L'Émetteur ne facturera aucun frais aux détenteurs en relation avec une émission de Titres. Les offrants peuvent toutefois facturer des frais aux détenteurs. Ces frais (le cas échéant) seront déterminés par un accord entre l'offrant et les détenteurs au moment de chaque émission.</p>
<p align="center">Qui est l'offrant et/ou la personne qui demande l'admission à la négociation sur un marché réglementé ?</p>
<p>L'Émetteur est l'entité qui demande l'admission à la négociation des Titres.</p>
<p align="center">Pourquoi le Prospectus est-il produit ?</p>
<p><i>Utilisation et montant net estimé des recettes</i></p> <p>Le produit net de chaque émission de Titres sera affecté par l'Émetteur à ses objectifs généraux, qui comprennent la réalisation d'un bénéfice et/ou la couverture de certains risques.</p> <p>Le produit net estimé est de entre 99,50% et 100,00% de la taille de l'émission.</p>
<p><i>Accord de souscription sur une base d'engagement ferme</i></p> <p>Non Applicable</p>
<p><i>Description de tout intérêt important pour l'émission/l'offre, y compris les intérêts conflictuels</i></p> <p>L'Offrant Autorisé recevra des commissions globales n'excédant pas 1,0 % par an du Prix d'Emission. Tout Offrant Autorisé et ses affiliés peuvent s'engager, et peuvent s'engager à l'avenir, dans des opérations de couverture concernant l'Actif Sous-Jacent.</p>