

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.

Neither the Base Prospectus nor these Final Terms or any other offering or marketing material relating to the Securities constitute a prospectus pursuant to the FinSA, and such documents may not be publicly distributed or otherwise made publicly available in Switzerland, unless the requirements of FinSA for such public distribution are complied with.

The Securities documented in these Final Terms are not being offered, sold or advertised, directly or indirectly, in Switzerland to retail clients (*Privatkundinnen und-kunden*) within the meaning of FinSA ("**Retail Clients**"). Neither these Final Terms nor any offering materials relating to the Securities may be available to Retail Clients in or from Switzerland. The offering of the Securities directly or indirectly, in Switzerland is only made by way of private placement by addressing the Securities (a) solely at investors classified as professional clients (*professionelle Kunden*) or institutional clients (*institutionelle Kunden*) within the meaning of FinSA ("**Professional or Institutional Clients**"), (b) at fewer than 500 Retail Clients, and/or (c) at investors acquiring securities to the value of at least CHF 100,000.

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.

FINAL TERMS



BARCLAYS BANK PLC

(Incorporated with limited liability in England and Wales)

Legal Entity Identifier (LEI): G5GSEF7VJP5I7OUK5573

**Up to EUR 3,000,000 Securities due June 2030 under the Global Structured Securities Programme (the "Securities")
Issue Price: 100.00 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 final terms of the Securities (the "**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 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**"). Full information on the Issuer and the offer of the Securities is only available on the basis of the combination of this Final Terms and the Base Prospectus. A summary of the individual issue of the Securities is annexed to this Final Terms.

The Base Prospectus, any supplements thereto are available for viewing at: <https://home.barclays/investor-relations/structured-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 are available for viewing at: <https://home.barclays/investor-relations/structured-income-investors/prospectus-and-documents/structured-securities-prospectuses/#registrationdocument> and <https://home.barclays/investor-relations/structured-income-investors/prospectus-and-documents/structured-securities-prospectuses/#registrationdocumentsupplement>.

These Notes are FinSA Exempt Securities as defined in the Base Prospectus.

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

BARCLAYS

Final Terms 7 May 2024

PART A – CONTRACTUAL TERMS

Provisions relating to the Securities

- | | | |
|-----|---|--|
| 1. | (a) Series: | NX00398016 |
| | (b) Tranche: | 1 |
| 2. | Settlement Currency: | |
| | (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: | Up to EUR 3,000,000 |
| | (ii) Series: | Up to EUR 3,000,000 |
| | (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 |
| 7. | Issue Price: | 100.00 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 5.00% per cent. 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: | 17 June 2024 |
| 9. | Scheduled Settlement Date: | 17 June 2030, subject to adjustment in accordance with the Business Day Convention |
| 10. | Type of Security: | Share Linked Securities |
| 11. | Relevant Annex(es) which apply to the Securities: | Equity Linked Annex |
| 12. | Underlying
Type _(Interest) : | Performance Worst-of |
| 13. | Underlying
Type _(Autocall) : | Performance Worst-of |
| 14. | Underlying
Type _(Settlement) : | Performance For the purpose of determination of the Final Performance:
Worst-of |

Provisions relating to interest (if any) payable

15. Interest Type: In respect of each Interest Payment Date, Phoenix with memory
General Condition 13 (*Interest or Coupon*)
- (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 Dates'.

Table 1:

Interest Valuation Dates	Interest Payment Dates
10 December 2024	17 December 2024
10 June 2025	17 June 2025
10 December 2025	17 December 2025
10 June 2026	17 June 2026
10 December 2026	17 December 2026
10 June 2027	17 June 2027
10 December 2027	17 December 2027
12 June 2028	19 June 2028
11 December 2028	18 December 2028
11 June 2029	18 June 2029
10 December 2029	17 December 2029
10 June 2030	17 June 2030

- (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: In respect of each Interest Payment Date, 70.00 per cent.
- (g) Fixed Interest Rates: Indicatively, 6.00 per cent., provided the Fixed Interest Rate will not be less than 5.00 per cent.

Provisions relating to Automatic Settlement (Autocall)

16. 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 of the percentages set out in Table 2 below in the column entitled 'Autocall Barrier Percentages'.
- (c) Autocall Barriers: Not Applicable
- (d) Autocall Lower Barriers: Not Applicable

- (e) Autocall Upper Barriers: Not Applicable
- (f) Autocall Settlement Percentages: Each of the percentages set out in Table 2 below in the column entitled 'Autocall Settlement Percentages'.
- (g) Autocall Valuation Dates: Each date set out in Table 2 below in the column entitled 'Autocall Valuation Dates'.
- (h) Autocall Settlement Dates: Each date set out in Table 2 below in the column entitled 'Autocall Settlement Dates', subject to adjustment in accordance with the Business Day Convention.
- (i) 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
- (j) Autocall Reset Event: Not Applicable
- (k) Worst-of Memorizer: Not Applicable

Table 2:

Autocall Valuation Dates:	Autocall Barrier Percentages:	Autocall Settlement Percentages:	Autocall Settlement Dates:
10 June 2025	100.00%	100.00%	17 June 2025
10 December 2025	100.00%	100.00%	17 December 2025
10 June 2026	100.00%	100.00%	17 June 2026
10 December 2026	100.00%	100.00%	17 December 2026
10 June 2027	100.00%	100.00%	17 June 2027
10 December 2027	100.00%	100.00%	17 December 2027
12 June 2028	100.00%	100.00%	19 June 2028
11 December 2028	100.00%	100.00%	18 December 2028
11 June 2029	100.00%	100.00%	18 June 2029
10 December 2029	100.00%	100.00%	17 December 2029

Provisions relating to Optional Early Settlement Event

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

Provisions relating to TARN Early Settlement Event

19. TARN Early Settlement Event: Not Applicable
General Condition 22 (*TARN Early Settlement Event*)

Provisions relating to Final Settlement

20. (a) Final Settlement Type: Capped
General Condition 16 (*Final Settlement*)
- (b) Settlement Method: Cash
- (c) Trigger Event Type: European (Final)
- (d) Strike Price Percentage: 100.00 per cent.
- (e) Knock-in Barrier Type: European
- (f) Knock-in Barrier Percentage: 70.00 per cent.
- (g) Downside: Not Applicable
- (h) Unleveraged Put: Not Applicable

Provisions relating to Drop Back

21. Drop Back Payout: General Condition 13.42 and General Condition 16.27 Not Applicable

Provisions relating to Nominal Call Event Settlement

22. Nominal Call Event Settlement: Not Applicable
General Condition 17 (*Nominal Call Event Settlement*)

Provisions relating to Instalment Notes

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

Provisions relating to the Underlying Asset(s)

24. Underlying Assets: A basket comprised of 2 Shares, each of which is set out in the Appendix (each, an "**Underlying Asset**" or a "**Share**" and together, the "**Underlying Assets**" or the "**Basket of Underlying Assets**" or the "**Shares**").
- (a) Initial Valuation Date: 10 June 2024 – Individual Pricing
- (b) Share(s): As further specified in the Appendix
- (i) Exchanges: In respect of each Share, as further specified in the Appendix
- (ii) Related Exchanges: In respect of each Share, as further specified in the Appendix
- (iii) Underlying Asset Currency: In respect of each Share, as further specified in the Appendix
- (iv) Bloomberg Screens: In respect of each Share, as further specified in the Appendix
- (v) Refinitiv Screens: Not Applicable
- (vi) Underlying Asset ISIN: In respect of each Share, as further specified in the Appendix

- | | | |
|-----|---|-------------------------------|
| | (vii) Weight: | Not Applicable |
| 25. | (a) Initial Price _(Settlement) : | Relevant Price: Closing Price |
| | (i) Averaging-in: | Not Applicable |
| | (ii) Min Lookback-in: | Not Applicable |
| | (iii) Max Lookback-in: | Not Applicable |
| | (b) Initial Valuation Date: | 10 June 2024 |
| 26. | (a) Final Valuation Price: | Relevant Price: Closing Price |
| | (i) Averaging-out: | Not Applicable |
| | (ii) Min Lookback-out: | Not Applicable |
| | (iii) Max Lookback-out: | Not Applicable |
| | (b) Final Valuation Date: | 10 June 2030 |
| 27. | Interim Valuation Price: | Not Applicable |

Provisions relating to disruption events

- | | | |
|-----|---|----------------|
| 28. | 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 |
| 29. | 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 Date</i>) | |
| | Omission: | Not Applicable |
| | Postponement: | Not Applicable |
| 30. | 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 |
| 31. | Additional Disruption Events: | |

General Condition 43.1
(Definitions)

(a) Change in Law:	Applicable as per General Condition 43.1 (Definitions)
(b) Currency Disruption Event:	Applicable as per General Condition 43.1 (Definitions)
(c) Hedging Disruption:	Applicable as per General Condition 43.1 (Definitions)
(d) Issuer Tax Event:	Applicable as per General Condition 43.1 (Definitions)
(e) Extraordinary Market Disruption:	Applicable as per General Condition 43.1 (Definitions)
(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 Events:	Not Applicable
(o) Barclays Index Disruption:	Not Applicable
32. Unlawfulness and Impracticability:	Limb (b) of Condition 32 of the General Conditions: Applicable
33. Early Cash Settlement Amount:	Market Value
34. Early Settlement Notice Period Number:	As specified in General Condition 43.1 (Definitions)
35. Substitution of Shares:	Substitution of Shares – Standard
36. Entitlement Substitution:	Not Applicable
37. FX Disruption Event:	Not Applicable
38. Disruption Fallbacks: FX Linked Condition 1 (Consequences of FX Disruption Events (FX Linked Annex))	Not Applicable
39. Unwind Costs:	Applicable
40. Settlement Expenses:	Not Applicable
41. Local Jurisdiction Taxes and Expenses:	Not Applicable

42. Consequences of a Fund Event:
Equity Linked Condition 3
(*Consequences of a Fund Event*) Not Applicable

General provisions

43. Form of Securities: Global Bearer Securities: Permanent Global Security
TEFRA: Not Applicable

44. Trade Date: 10 June 2024

45. Taxation Gross Up: Applicable

46. 871(m) Securities: The Issuer has determined that Section 871(m) of the U.S. Internal Revenue Code of 1986, as amended, is not applicable to the Securities.

47. (a) Prohibition of Sales to EEA Retail Investors: Not Applicable

(b) Prohibition of Sales to UK Retail Investors: Applicable – see cover page of these Final Terms

(c) Prohibition of Sales to Swiss Retail Investors: Applicable – see cover page of these Final Terms

48. Business Days: As specified in General Condition 43.1 (*Definitions*).

49. Business Day Convention: Modified Following, subject to adjustment for Unscheduled Business Day Holiday.

50. Determination Agent: Barclays Bank PLC

51. Registrar: Not Applicable

52. Transfer Agent: Not Applicable

53. (a) Names and addresses 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

54. Registration Agent: Not Applicable

55. Governing Law: English law

56. Relevant Benchmarks: Not Applicable

PART B – OTHER INFORMATION

1. LISTING AND ADMISSION TO TRADING

- (a) Listing and Admission to Trading: Application will be made to the Irish Stock Exchange plc trading as Euronext Dublin for the securities to be admitted to the official list and trading on its regulated market with effect from the Issue Date
- (b) Estimate of total expenses related to admission to trading: EUR 1,000
- (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

2. RATINGS

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: Up to EUR 3,000,000
- (d) Estimated total expenses: 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.

4. YIELD

Not Applicable

5. PAST AND FUTURE PERFORMANCE OF UNDERLYING ASSET, AND OTHER INFORMATION CONCERNING THE UNDERLYING ASSET

Details of the past and future performance and volatility of the Underlying Asset may be obtained from Bloomberg Screen: In respect of each Share, as specified in the Appendix under the column entitled “*Bloomberg Code (for identification purposes only)*”.

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: XS2761955900
- (b) Common Code: 276195590
- (c) Relevant Clearing System(s) Euroclear Bank S.A./N.V. and Clearstream Banking société anonyme
- (d) Delivery: Delivery free of payment
- (e) Name and address of additional Paying Agent(s): Not Applicable

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:** Alexandria Group Oyj (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/fixe-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)**"): Finland
- (d) Offer period for which use of the Base Prospectus is authorised by the Authorised Offeror(s): From and including 7 May 2024 to and including 31 May 2024 (the "**Offer Period**")
- (e) Other conditions for use of the Base Prospectus by the Authorised Offeror(s): Not Applicable

Other terms and conditions of the offer

- (f) Offer Price: The Issue Price
- (g) Total amount of offer: Up to EUR 3,000,000

- (h) 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.
- (i) Time period, including any possible amendments, during which the offer will be open and description of the application process: The Offer Period
- (j) 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 Finland (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.
- (k) 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.
- (l) Description of possibility to reduce subscriptions and manner for refunding excess amount paid by applicants: Not Applicable
- (m) 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.
- (n) 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.
- (o) Procedure for exercise of any right of pre-emption, negotiability of subscription rights and treatment of subscription rights not exercised: Not Applicable
- (p) 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.

- (q) 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.
- (r) 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.
- (s) Name(s) and address(es), to the extent known to the Issuer, of the placers in the various countries where the offer takes place: Alexandria Group Oyj, Eteläesplanadi 22 A, 00130 Helsinki, Finland

APPENDIX

i	Underlying Asset	Type	Bloomberg Code (for identification purposes only)	Exchange	ISIN	Related Exchange	Underlying Asset Currency
1	NESTE OYJ	Share	NESTE FH	Nasdaq Helsinki LTD	FI0009013296	All Exchanges	EUR
2	ORION OYJ-CLASS B	Share	ORNBV FH	Nasdaq Helsinki LTD	FI0009014377	All Exchanges	EUR

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: Up to EUR 3,000,000 Securities due June 2030 pursuant to the Global Structured Securities Programme (**ISIN:** XS2761955900) (the "**Securities**").

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 Alexandria Group Oyj with its address at Eteläesplanadi 22 A, 00130 Helsinki, Finland (telephone number: +358 9 41351300) and its LEI is 7437002ONTEZT59NA993.

Competent authority: The Base Prospectus was approved on 12 April 2024 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

Barclays is a diversified bank with five operating divisions comprising: Barclays UK, Barclays UK Corporate Bank, Barclays Private Bank and Wealth Management, Barclays Investment Bank and Barclays US Consumer Bank, supported by Barclays Execution Services Limited, the Group-wide service company providing technology, operations and functional services to business across the Group. 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, private bank and wealth management, 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 2023 and 31 December 2022 from the annual consolidated financial statements of the Issuer for the years ended 31 December 2023 and 2022 (the "**Financial Statements**"), which have each been audited with an unmodified opinion provided by KPMG.

Consolidated Income Statement

	As at 31 December	
	2023	2022
	(€m)	
Net interest income.....	6,653	5,398
Net fee and commission income.....	5,461	5,426
Credit impairment charges / (releases)	(1,57)	(933)
	8)	7,624
Net trading income.....	5,980	4,867
Profit before tax.....	4,223	4,382
Profit after tax	3,561	

Consolidated Balance Sheet

	As at 31 December	
	2023	2022
	(£m)	
Total assets.....	1,185,166	1,203,537
Debt securities in issue.....	45,653	60,012
Subordinated liabilities.....	35,903	38,253
Loans and advances, debt securities at amortised cost.....	185,247	182,507
Deposits at amortised cost.....	301,798	291,579
Total equity.....	60,504	58,953

Certain Ratios from the Financial Statements

	As at 31 December	
	2023	2022
	(%)	
Common Equity Tier 1 capital.....	12.1	12.7
Total regulatory capital.....	19.2	20.8
UK leverage ratio (BBPLC sub-consolidated) ^{1,2}	6.0	

1 No comparatives are provided for leverage as this is the first reporting year for Barclays Bank PLC sub-consolidated.

2 Although the leverage ratio is expressed in terms of T1 capital, the countercyclical leverage ratio buffer (CCLB) and 75% of the minimum requirement must be covered solely with CET1 capital. The CET1 capital held against the 0.2% CCLB was £1.8bn.

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) interest rate changes on the Barclays Bank Group's profitability; (iii) the competitive environments of the banking and financial services industry; (iv) the regulatory change agenda and impact on business model; (v) the impact of benchmark interest rate reforms on the Barclays Bank Group; and (vi) change delivery and execution risks.
- **Climate risk:** Climate risk is the impact on financial (credit, market, treasury and capital) and operational risks arising from climate change through physical risks, risks associated with transitioning to a lower carbon economy.
- **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. Market risk is the risk of loss arising from potential adverse changes 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) capital risk – the risk that the Barclays Bank Group has an insufficient level or composition of capital to support its normal business activities and to meet its regulatory capital requirements under normal operating environments and stressed conditions; (2) 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; 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.
- **Compliance, reputation and legal risks and legal, competition and regulatory matters:** Compliance 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 (conduct risk) and the risk to Barclays, its clients, customers or markets from a failure to comply with the laws, rules and regulations applicable to the firm. 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, rules 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 applicable laws,

rules, regulations or contractual requirements or to assert or defend their intellectual property rights. Legal risk may arise in relation to any number of the material existing and emerging risks summarised above.

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:** NX00398016; Tranche number: 1; ISIN: XS2761955900; Common Code: 276195590.

The Securities will be cleared and settled through Euroclear Bank S.A./N.V. and Clearstream Banking société anonyme.

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 up to EUR 3,000,000. The issue price is 100.00% of the Specified Denomination.

The issue date is 17 June 2024 (the "**Issue Date**"). Subject to early termination, the Securities are scheduled to redeem on 17 June 2030 (the "**Scheduled Settlement Date**").

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 form 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 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.

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 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, unless the Issuer gives notice to the holders that they may elect to receive such whole number of the disrupted Underlying Asset which may be acquired by the Issuer in the open market with the Early Cash Settlement Amount and the relevant holder returns to the Issuer a duly completed settlement election notice requesting physical settlement by the applicable cut-off time.

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 English 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 Assets:

Underlying Assets _(Interest) /Underlying Assets _(Autocall Settlement) /Underlying Assets _(Final Settlement)	Type	Initial Price	Initial Valuation Date
NESTE OYJ	Share	The closing price of the Underlying Asset on the Initial Valuation Date	10 June 2024
ORION OYJ-CLASS B	Share	The closing price of the Underlying Asset on the Initial Valuation Date	10 June 2024

For the purposes of determining an interest amount, Underlying Assets shall mean the Underlying Assets_(Interest), for the purposes of determining Automatic Settlement (Autocall) Event, Underlying Assets shall mean the Underlying Assets_(Autocall Settlement) and for the purposes of determining the Final Cash Settlement Amount, Underlying Assets shall mean the Underlying Assets_(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.

Indicative amounts: If the Securities are being offered by way of a public offer and any specified product values are not fixed or determined at the commencement of the public offer (including any amount, level, percentage, price, rate or other value in relation to the terms of the Securities which has not been fixed or determined by the commencement of the public offer), these specified product values will specify an indicative amount, an indicative minimum amount, an indicative maximum amount or any combination thereof. In such case, the relevant specified product value(s) shall be the value determined based on market conditions by the Issuer on or around the end of the public offer. Notice of the relevant specified product value will be published prior to the Issue Date.

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

A – Interest

During the term of the Securities, the Securities pay Phoenix with memory interest.

Each Security will only pay interest in respect of an Interest Valuation Date if the closing level of the Underlying Asset on such Interest Valuation Date is greater than or equal to its corresponding Interest Barrier. If this occurs, the amount of interest payable with respect to that Interest Valuation Date is calculated by adding the sum of (1) and (2) below:

- (1) the fixed rate of (indicatively) 6.00% (provided the Fixed Interest Rate will not be less than 5.00%) multiplied by EUR 1,000; and
- (2) the number of previous Interest Valuation Dates in respect of which no interest was payable (since the last time interest was payable) multiplied by the fixed rate of (indicatively) 6.00% (provided the Fixed Interest Rate will not be less than 5.00%) multiplied by EUR 1,000.

Interest will be payable on the corresponding Interest Payment Date set out in the table below. Each Interest Valuation Date and Interest Barrier(s) is as follows:

Interest Valuation Dates	Interest Payment Dates	Interest Barrier
10 December 2024	17 December 2024	70.00% of the Initial Price
10 June 2025	17 June 2025	70.00% of the Initial Price
10 December 2025	17 December 2025	70.00% of the Initial Price
10 June 2026	17 June 2026	70.00% of the Initial Price
10 December 2026	17 December 2026	70.00% of the Initial Price
10 June 2027	17 June 2027	70.00% of the Initial Price
10 December 2027	17 December 2027	70.00% of the Initial Price
12 June 2028	19 June 2028	70.00% of the Initial Price
11 December 2028	18 December 2028	70.00% of the Initial Price
11 June 2029	18 June 2029	70.00% of the Initial Price
10 December 2029	17 December 2029	70.00% of the Initial Price
10 June 2030	17 June 2030	70.00% of the Initial Price

B – Automatic Settlement (Autocall)

The Securities will automatically redeem if the closing price or level of the worst-performing Underlying Asset divided by its Initial Price is at or above its corresponding Autocall Barrier Percentage. If this occurs, you will receive an "**Autocall Cash Settlement Amount**" equal to the Calculation Amount multiplied by 100.00% 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
10 June 2025	17 June 2025	100.00%
10 December 2025	17 December 2025	100.00%
10 June 2026	17 June 2026	100.00%
10 December 2026	17 December 2026	100.00%
10 June 2027	17 June 2027	100.00%
10 December 2027	17 December 2027	100.00%
12 June 2028	19 June 2028	100.00%
11 December 2028	18 December 2028	100.00%
11 June 2029	18 June 2029	100.00%
10 December 2029	17 December 2029	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 a Knock-in Trigger Event has not occurred 100.00% multiplied by the Calculation Amount;
- (ii) otherwise, an amount calculated by dividing the Final Performance by the Strike Price Percentage (being 100.00%) and multiplying the result by the Calculation Amount.

Where:

"Final Valuation Date" means 10 June 2029 subject to adjustment.

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

"Knock-in Trigger Event" shall be deemed to have occurred if the closing price of any Underlying Asset in respect of the Trigger Event Observation Date (being 10 June 2030) is below the Knock-in Barrier Price (the Initial Price(Settlement) multiplied by the Knock-in Barrier Percentage (being 70.00%) of such Underlying Asset.

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 Irish Stock Exchange Trading plc as Euronext Dublin.

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 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 you will not be paid any amount to compensate for such deferral and it is possible that you will not receive any interest at all over the lifetime of the Securities.

The interest amount is either a higher pre-determined interest amount, zero or a lower interest amount, depending on whether the performance criteria are met. 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.

The Securities reference a basket of Underlying Assets, each of which demonstrates unique risk characteristics. If the Underlying Assets are correlated, the performance of the Underlying Asset(s) in the basket can be expected to move in the same direction. If the performance of a basket gives a greater 'weight' to a basket constituent as compared to other basket constituents, the basket performance will be more affected by changes in the value of that particular basket constituent than a basket which apportions an equal weight to each basket constituent. The performance of basket constituents may be moderated or offset by one another. This means that, even in the case of a positive performance of one or more constituents, the performance of the basket as a whole may be negative if the performance of the other constituents is negative to a greater extent.
- **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 Assets, substituting the

Underlying Assets, 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 or impracticability 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 common shares:** The performance of common shares is dependent upon macroeconomic factors, such as interest and price levels on the capital markets, currency developments and political factors as well as company-specific factors such as earnings, market position, risk situation, shareholder structure and distribution policy. Any relevant share issuer may take actions without regard to the interests of any holders of the Securities, which could have a negative effect on the value of the Securities.
- **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 Finland during the period from (and including) 7 May 2024 to (and including) 31 May 2024 (the "Offer Period") and such offer is subject to the following conditions:

- Offer price: The Issue Price
- 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 (which is Barclays Bank Ireland PLC) or the Authorised Offeror other than pursuant to Article 1(4) of the EU Prospectus Regulation in Finland (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.
- 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

Estimated total expenses of the issue and/or offer including expenses charged to investor by issuer/offeree

The estimated total expenses of the issue and/or offer are 5.00%.

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.

Who is the offeror and/or the person asking for admission to trading?

The Issuer is the entity offering and requesting for admission to trading of the Securities.

See also the item entitled "The Authorised Offeror(s)" above.

Why is the Prospectus being produced?

Use and estimated net amount 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.

The estimated net proceeds is 100.00% per cent. of the issue size.

Underwriting agreement on a firm commitment basis

The offer of the Securities is not subject to an underwriting agreement on a firm commitment basis

Description of any interest material to the issue/offer, including conflicting interests

The Authorised Offeror will be paid aggregate commissions equal to 5.00% 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 Assets.

SAMMANFATTNING

INLEDNING OCH VARNINGAR

Denna Sammanfattning ska läsas som en introduktion till Prospektet. Varje beslut om att investera i Värdepapperen ska baseras på en bedömning av Prospektet i dess helhet av investeraren. Under vissa omständigheter kan investeraren förlora hela eller delar av det investerade kapitalet. Om ett krav hänförligt till informationen i Prospektet anförts vid domstol, kan den investerare som är kärande enligt nationell lagstiftning bli tvungen att svara för kostnaderna för översättning av Prospektet innan de rättsliga förfarandena inleds. Civilrättsligt ansvar kan åläggas de personer som lagt fram Sammanfattningen, inklusive översättningar därav, men endast om Sammanfattningen är vilseledande, felaktig eller oförenlig med de andra delarna av Prospektet eller om den inte, tillsammans med de andra delarna av Prospektet, ger nyckelinformation för att hjälpa investerare när de överväger att investera i Värdepapperen.

Du står i begrepp att köpa en produkt som inte är enkel och som kan vara svår att förstå.

Värdepapperen: Upp till EUR 3 000 000 Värdepapperen med förfallodag juni 2030 i enlighet med det Globala Programmet för Strukturerade Värdepapper (ISIN: XS2761955900) ("Värdepapperen").

Emittenten: Emittenten är Barclays Bank PLC. Dess säte är 1 Churchill Place, London, E14 5HP, Storbritannien (telefonnummer: +44 (0)20 7116 1000) och dess identifieringskod för juridiska personer ("LEI") är G5GSEF7VJP517OUK5573.

Auktoriserad Erbjudare: Den Auktoriserade Erbjudaren är Alexandria Group Oyj med säte Eteläesplanadi 22 A, 00130 Helsinki, Finland (telefonnummer +358 9 41351300) och dess identifieringskod för juridiska personer (LEI) är 7437002ONTEZT59NA993.

Behörig myndighet: Grundprospektet godkändes den 12 april 2024 av Irlands Centralbank (*Central Bank of Ireland*), Wapping Street, North Wall Quay, Dublin 1, D01 F7X3, Irland (telefonnummer: +353 (0)1 224 6000).

HUVUDINFORMATION OM EMITTENTEN

Vem är Emittenten av Värdepapperen?

Emittentens hemvist och juridiska form

Barclays Bank PLC ("**Emittenten**") är ett publikt aktiebolag som är registrerat i England och Wales under nummer 1026167. Skyldigheten hos medlemmar i Emittenten är begränsad. Dess säte och huvudkontor är 1 Churchill Place, London, E14 5HP, Storbritannien (telefonnummer +44 (0)20 7116 1000). Emittentens identifieringskod för juridiska personer (LEI) är G5GSEF7VJP517OUK5573.

Emittentens huvudverksamhet

Barclays är en diversifierad bank med fem verksamhetsdivisioner bestående av: Barclays UK, Barclays UK Corporate Bank, Barclays Private Bank and Wealth Management, Barclays Investment Bank och Barclays US Consumer Bank, vilka stöds av Barclays Execution Services Limited, det Koncerntäckande servicebolaget som tillhandahåller teknologi-, drifts- och funktionstjänster till verksamheter inom hela Koncernen. Koncernen består av Barclays PLC och dess dotterföretag, inbegripet Emittenten. Emittentens främsta verksamhet är att erbjuda produkter och tjänster avsedda för klienter som är större företag, klienter inom private banking och förmögenhetsförvaltning, och klienter inom grossist- och internationell bankverksamhet. Termen "**Koncernen**" betyder Barclays PLC och dess dotterbolag och termen "**Barclays Bankkoncern**" betyder Barclays Bank PLC och dess dotterbolag.

Emittentens större aktieägare

Hela av det emitterade ordinarie aktiekapitalet i Emittenten ägs ytterst av Barclays PLC. Barclays PLC är det yttersta holdingbolaget i Koncernen.

Identitet för Emittentens viktigaste befattningshavare

De viktigaste befattningshavarna i Emittenten är C.S. Venkatakrishnan (Chief Executive Officer och Executive Director) och Anna Cross (Executive Director).

Identitet för Emittentens lagstadgade revisorer

De lagstadgade revisorerna för Emittenten är KPMG LLP ("**KPMG**"), auktoriserade revisorer och registrerade revisorer (medlemmar av Institute of Chartered Accountants i England och Wales), 15 Canada Square, London E14 5GL, Storbritannien.

Vilken är den viktigaste finansiella informationen om Emittenten?

Emittenten har härlett den utvalda konsoliderade finansiella informationen i tabellen nedan för åren som slutade den 31 december 2023 och den 31 december 2022 från de konsoliderade finansiella årsrapporterna för Emittenten för åren som slutade den 31 december 2023 och 2022 (de "**Finansiella Rapporterna**"), vilka har reviderats med ett uttalande enligt standardutformningen tillhandahållet av KPMG.

Konsoliderad resultaträkning

	Per den 31 december	
	2023	2022
	(£m)	
Nettoränteintäkt	6 653	5 398
Nettointäkt avgifter och courtage.....	5 461	5 426
Kreditförlustreservering ökning / (nedsättning)	(1 578)	(933)
Nettohandelsintäkt	5 980	7 624
Vinst före skatt	4 223	4 867
Vinst efter skatt	3 561	4 382

Konsoliderad balansräkning

Per den 31 december

	2023	2022
	(£m)	
Totala tillgångar.....	1 185 166	1 203 537
Utestående skuldinstrument.....	45 653	60 012
Efterställda skulder.....	35 903	38 253
Lån och förskott, skuldinstrument till amorteringskostnad.....	185 247	182 507
Insättningar till amorteringskostnad.....	301 798	291 579
Totalt eget kapital.....	60 504	58 953
Vissa förhållanden från de Finansiella Rapporterna¹		
	Per den 31 december	
	2023	2022
	(%)	
Kärnprimärkapital (CET1).....	12,1	12,7
Totalt regulatoriskt kapital.....	19,2	20,8
Hävstångsratio i Storbritannien ^{1, 2}	6,0	-
¹ Inga jämförelsetal ges för hävstång eftersom detta är det första rapporteringsåret för Barclays Bank PLC underkonsoliderad. ² Även om hävstångsratio uttrycks i termerna av T1 kapital, så måste den kontracykliska hävstångsbufferen (CCLB) och 75% av minimikravet täckas av CET1 kapital. CET1 kapitalet som hålls gentemot 0,2% CCLB var £1,8mdr.		
Vilka är de huvudsakliga riskerna som är specifika för Emittenten?		
<p>Barclays Bankkoncernen har identifierat ett brett spektrum av risker för vilka dess verksamhet är exponerad mot. Väsentliga risker är de som den högsta ledningen ägnar särskild uppmärksamhet åt och som kan leda till att leveransen av Barclays Bankkoncernens strategi, resultat av verksamheten, finansiella ställning och/eller utsikter skiljer sig väsentligt från förväntningarna. Tillväxtrisker är sådana som har okända komponenter, vars påverkan kan kristalliseras under en längre tidsperiod. Dessutom kan vissa andra faktorer utanför Barclays Bankkoncernens kontroll, inklusive upptrappning av globala konflikter, terrorismhändelser, naturkatastrofer, pandemier och liknande händelser, även om de inte beskrivs nedan, ha en liknande inverkan på Barclays Bankkoncernen.</p>		
<ul style="list-style-type: none"> • Väsentliga befintliga och framväxande risker som potentiellt påverkar mer än en huvudrisk: Förutom väsentliga och framväxande risker som påverkar de huvudsakliga riskerna som anges nedan, finns det även väsentliga befintliga och framväxande risker som potentiellt påverkar mer än en av dessa huvudsakliga risker. Dessa risker är: (i) potentiellt ogynnsamma globala och lokala ekonomiska och marknadsmässiga förhållanden samt geopolitisk utveckling; (ii) effekterna av ränteförändringar på Barclays Bankkoncernens lönsamhet; (iii) konkurrensmiljöerna inom bank- och finanssektorn; (iv) agendan för regleringsändring och påverkan på affärsmodellen; (v) effekterna av reform av referensvärden på Barclays Bankkoncern; och (vi) förändringar i leverans- och genomföranderisker. • Klimatrisk: Klimatrisk är inverkan på finansiella (kredit, marknads- och treasury) och operativa risker som uppstår till följd av klimatförändringar genom fysiska risker och risker förknippade med övergången till en ekonomi med lägre koldioxidutsläpp. • Kredit- och Marknadsrisk: Kreditrisk är risken för förluster för Barclays Bankkoncernen genom klienters, kunders eller motparter oförmåga att fullfölja sina åtaganden gentemot medlemmarna i Barclays Bankkoncernen. Barclays Bankkoncernen är utsatt för risker som uppstår på grund av förändringar i kreditkvaliteten och återbetalningsgraden av lån och förskott som betalas av låntagare och motparter. Marknadsrisk är risken för förluster som uppstår från potentiella negativa förändringar i värdet på Barclays Bankkoncernens tillgångar och skulder från fluktuationer i marknadsvariabler. • Treasury och kapitalrisk samt risken för att Emittenten och Barclays Bankkoncernen är föremål för betydande resolutionsåtgärder: Det finns tre primära typer av treasury- och kapitalrisk för Barclays Bankkoncernen, som är (1) kapitalrisk – risken för att Barclays Bankkoncernen har en otillräcklig nivå eller sammansättning av kapital för att stödja dess normala affärsverksamheter och att möta dessa regulatoriska kapitalkrav under normala verksamhetsförhållanden och under stressade förutsättningar; (2) likviditetsrisk – risken för att Barclays Bankkoncernen inte kan möta sina kontraktuella eller implicita åtaganden eller att den inte har lämpligt belopp av stabil finansiering och likviditet för att stödja sina tillgångar, vilket även kan påverkas av förändringar i kreditvärdighetsbetyg; och (3) ränterisk i bankboken – risken för att Barclays Bankkoncernen är exponerad mot kapital- eller inkomstvolatilitet på grund av en missmatchning mellan ränteeponeringar i dess (icke-handlade) tillgångar och skulder. Enligt viss engelsk lagstiftning (<i>Banking Act</i>) ges Bank of England betydande befogenheter (eller, under vissa omständigheter, HM Treasury), i samråd med Storbritanniens tillsynsmyndigheter Prudential Regulation Authority, Financial Conduct Authority och HM Treasury, efter vad som är tillämpligt som en del av en särskild resolutionsregim. Dessa befogenheter gör det möjligt för Bank of England (eller varje efterföljare eller ersättare och/eller sådan annan myndighet i Storbritannien med förmågan att utöva Storbritanniens Resolutionsbefogenheter) ("Resolutionsmyndigheten") för att genomföra olika resolutionsåtgärder och stabiliseringsalternativ (inklusive, men inte begränsat till, nedskrivningsverktyget) med avseende på en brittisk bank eller värdepappersföretag och vissa av dess dotterföretag (per dagen för detta Registreringsdokument, inklusive Emittenten) under omständigheter där Resolutionsmyndigheten anser att de relevanta resolutionsvillkoren är uppfyllda. • Operationella risker och modellrisker: Operationell risk är risken för förluster för Barclays Bankkoncernen genom opassande eller fallerade processer eller system, mänsklig faktor eller på grund av externa händelser där orsaken inte beror på kredit- eller marknadsrisker. Modellrisk är potentialen för potentiella negativa konsekvenser från beslut baserade på inkorrekt eller felaktigt använd modelldata och rapporter. • Regelefterlevnadsrisk, ryktesrisk samt juridisk risk och rättsliga konkurrens- och regleringsfrågor: Regelefterlevnadsrisk är risken för dåliga utfall för, eller skada för kunder, klienter och marknader, som uppstår ur leveransen av Barclays Bankkoncernens produkter och tjänster (uppföranderisk) och 		

riskan för Barclays, dess klienter, kunder eller marknader från ett misslyckande att efterleva lagarna, reglerna och förordningar tillämpliga för företaget. Ryktesrisk är risken för att en åtgärd, transaktion, investering, händelse, beslut eller affärsrelation minskar förtroendet för Barclays Bankkoncernens integritet och/eller kompetens. Barclays Bankkoncernen bedriver verksamhet på en mycket reglerad global marknad som exponerar den för juridisk risk som uppstår till följd av (i) mängden lagar, regler och förordningar som gäller för den verksamhet den bedriver, som är mycket dynamiska, kan variera och/eller stå i konflikt mellan jurisdiktioner, och kan vara oklara i sin tillämpning beträffande särskilda omständigheter, särskilt i nya och nya områden; och (ii) Barclays Bankkoncernens diversifierade och utvecklande karaktär och affärsmetoder. I samtliga fall utsätter detta Barclays Bankkoncernen för risken för förlust eller sanktioner, skadestånd eller böter från misslyckandet av medlemmar i Barclays Bankgruppen att uppfylla tillämpliga lagar, regler, förordningar eller avtalade krav eller att genomdriva eller försvara deras immateriella rättigheter. Juridisk risk kan uppstå i förhållande till ett antal riskfaktorer som sammanfattats ovan.

HUVUDINFORMATION OM VÄRDEPAPPEREN

Vilka är Värdepapperens viktigaste egenskaper?

Typ och klass av Värdepapper som erbjuds och som tas upp till handel och värdepappersidentifikationsnummer

Värdepapperen kommer vara obligationer och kommer identifieras unikt av: Serienummer: NX00398016; Tranche-nummer: 1; ISIN: XS2761955900 Common-kod: 276195590.

Värdepapperen kommer clearas och avvecklas genom Euroclear Bank S.A./N.V. och Clearstream Banking société anonyme.

Valuta, angiven denominering, emissionens storlek och Värdepapperens löptid:

Valutan för Värdepapperen kommer vara Euro ("EUR") ("Emissionsvalutan") och avvecklas i samma valuta ("Avvecklingsvalutan"). Värdepapperen kan handlas i nominellt och den angivna valören per Värdepapper är EUR 1 000. Emissionens storlek är upp till EUR 3 000 000. Emissionskursen är 100 % av den Angivna Valören.

Emissionsdagen är 17 juni mars 2024 ("Emissionsdagen"). Med förbehåll för förtida avslut, är Värdepapperen planerade att lösas in den 17 juni 2030 ("Planerade Avvecklingsdagen").

Rättigheter förknippade med Värdepapperen

Potentiell avkastning: Värdepapperen kommer ge varje innehavare av Värdepapper rätt att erhålla en potentiell avkastning på Värdepapperen, tillsammans med vissa förknippade rättigheter såsom rätten att erhålla meddelande om vissa fastställelser och händelser och rätten att rösta vid några (men inte alla) förändringar av Värdepapperens villkor. Den potentiella avkastningen kommer bestå av: (i) en eller flera räntebelopp, (ii) ett Kontant Avvecklingsbelopp (Autocall), och/eller (iii) ett Kontant Slutligt Avvecklingsbelopp, förutsatt att om Värdepapperen avslutas i förtid, så kan den potentiella avkastningen bestå av ett Kontant Förtida Avvecklingsbelopp i stället.

Beskattning: Alla betalningar avseende Värdepapperen ska göras utan innehållande eller avdrag för eller på grund av några brittiska skatter såvida inte sådant innehållande eller avdrag krävs enligt lag. I händelse av att sådant innehållande eller avdrag krävs enligt lag, kommer Emittenten, med undantag för vissa begränsade omständigheter, att betala ytterligare belopp för att täcka de belopp som sålunda innehålls eller dras av.

Uppsägningsgrundande Händelser: Om Emittenten misslyckas att erlägga betalning under Värdepapperen eller bryter mot några andra villkor för Värdepapperen på ett sätt som är väsentligen negativt för innehavarnas intressen (och sådant misslyckande inte upphör inom 30 kalenderdagar, eller, avseende ränta, inte betalas inom 14 kalenderdagar inom förfallodatum), eller om Emittenten är föremål för ett beslut om avveckling, då (vid fall, avseende ränta, är Emittenten förhindrad att utföra betalningar på grund av tvingande lagregler) så kommer Värdepapperen att omedelbart förfalla till betalning, efter att meddelande lämnats av investeraren.

Begränsningar av rättigheter

Förtida inlösen efter vissa störmingshändelser eller på grund av olaglighet eller opraktiskhet: Emittenten kan lösa in Värdepapperen innan deras Planerade Avvecklingsdag efter inträffandet av vissa störmingshändelser eller extraordinära händelser rörande Emittenten, dess hedgningsarrangemang, de(n) Underliggande Tillgången(arna), beskattningen eller Värdepapperens relevanta valuta, eller om det fastställs att fullgörandet av någon av sina skyldigheter enligt Värdepapperen är olagligt. Om detta inträffar kommer investerare att få ett "Kontant Förtida Avvecklingsbelopp" lika med Värdepapperens rimliga marknadsvärde före dessas inlösen om inte Emittenten meddelar innehavarna att de kan välja att erhålla sådant helt antal av den störda Underliggande Tillgången som kan köpas av Emittenten på den öppna marknaden med det Kontanta Förtida Avvecklingsbeloppet och den relevanta innehavaren till Emittenten returnerar ett komplett och korrekt valmeddelande som efterfrågar fysisk avveckling vid den tillämpliga tidsfristen.

Vissa ytterligare begränsningar:

- Oavsett att Värdepapperen relateras till utvecklingen av den underliggande tillgången, har inte innehavarna några rättigheter avseende den underliggande tillgången
- Villkoren för Värdepapperen tillåter Emittenten och Bestämmningsagenten (som fallet må vara), vid inträffandet av vissa händelser och under vissa omständigheter, utan innehavarnas samtycken, att justera villkoren för Värdepapperen, att inlösa Värdepapperen före förfallodagen, att omvandla Värdepapperen till likvida medel (där tillämpligt) att uppskjuta eller erhålla alternativ värdering av den underliggande tillgången eller skjuta upp planerade utbetalningar under Värdepapperen, att ändra valutan i vilken Värdepapperen är denominerade för att ersätta de underliggande tillgångarna, att substituera Emittenten med någon annan tillåten enhet på vissa villkor, och att vidta vissa andra åtgärder med avseende på Värdepapperen och de underliggande tillgångarna (om några).
- Värdepapperen innehåller regler för sammankallande av möten för innehavare att överväga angelägenheter som påverkar deras intressen generellt och dessa regler tillåter vissa definierade majoriteter att binda samtliga innehavare, inklusive innehavare som inte närvarade eller röstade på mötet och innehavare som röstade annorlunda än majoriteten.

Tillämplig rätt

Värdepapperen kommer vara underkastade engelsk rätt och rättigheterna därunder kommer konstrueras därefter.

Beskrivning av beräkning av potentiell avkastning

Underliggande Tillgångar: Avkastningen på och värdet på Värdepapperen är beroende av utvecklingen för följande Underliggande Tillgång

Underliggande Tillgångar _(Ränta) /Underliggande Tillgångar _{(Avveckling (Autocall))} /Underliggande Tillgångar _(Slutlig Avveckling)	Typ	Initial Kurs	Initial Värderingsdag

NESTE OYJ	Share	Slutkursen för den underliggande tillgången på den första värderingsdagen	10 juni 2024
ORION OYJ-CLASS B	Share	Slutkursen för den underliggande tillgången på den första värderingsdagen	10 juni 2024

I syfte att fastställa ett räntebelopp ska Underliggande Tillgångar betyda Underliggande Tillgångar_(Ränta), i syfte att fastställa en Händelse för Automatisk Avveckling (Autocall), Ska Underliggande Tillgångar betyda Underliggande Tillgångar_{(Avveckling (autocall))} och i syfte att fastställa Kontant Slutligt Avvecklingsbelopp, ska Underliggande Tillgång betyda Underliggande Tillgång_(Slutlig Avveckling)

Beräkningsbelopp: Beräkningar av belopp som förfaller till betalning under Värdepapperen görs utifrån **“Beräkningsbeloppet”**, som är EUR 1 000 per Värdepapper.

Indikativa belopp: Om Värdepapperen erbjuds genom ett publikt erbjudande och något specifikt produktvärde inte har fastställts eller bestämts vid påbörjandet av det publika erbjudandet (inklusive något belopp, nivå, procent, pris, kurs eller annat värde i relation till villkoren för Värdepapperen vilka inte har fastställts eller bestämts vid påbörjandet av det publika erbjudandet), dessa specificerade produktvärden kommer specificera ett indikativt belopp, indikativt minimibelopp, ett indikativt maximibelopp eller en kombination därav. I sådana fall, ska det relevanta specificerade produktvärdet vara värdet som bestäms av Emittenten på basis av marknadsförhållanden på eller omkring slutet av det publika erbjudandet. Meddelande om det relevanta specificerade produktvärdet kommer att publiceras innan Emissionsdagen.

Fastställelseagent: Barclays Bank PLC kommer att anlitas för att beräkna och fatta beslut avseende Värdepapperen.

A – Ränta

Under Värdepapperens löptid betalar Värdepapperen Phoenix med minne

Ränta (Phoenix med minnesfunktion): Respektive Värdepapper kommer endast betala ränta avseende en Räntevärderingsdag om stängningskursen för varje Underliggande Tillgången på sådan Räntevärderingsdag är högre än eller lika med dess motsvarande Räntebarrär. Om detta inträffar så kommer det räntebelopp som förfaller till betalning avseende den Räntevärderingsdagen beräknas genom att addera summan av (1) och (2) nedan:

- (1) den fasta nivån om (indikativt) 6.00% (förutsatt att den fasta räntan inte är lägre än 5.00%) multiplicerat med EUR 1 000; och
- (2) det antal föregående Räntevärderingsdagar där ingen ränta har betalats ut (sedan den senaste gången ränta betalades ut) multiplicerat med den fasta räntenivån om (indikativt) 6.00% (förutsatt att den fasta räntan inte är lägre än 5.00%) multiplicerat med EUR 1 000.

Räntevärderingsdag	Ränte-betalningsdag	Ränte-barrär
10 december 2024	17 december 2024	70.00% av den Initiala Kursen
10 juni 2025	17 juni 2025	70.00% av den Initiala Kursen
10 december 2025	17 december 2025	70.00% av den Initiala Kursen
10 juni 2026	17 juni 2026	70.00% av den Initiala Kursen
10 december 2026	17 december 2026	70.00% av den Initiala Kursen
10 juni 2027	17 juni 2027	70.00% av den Initiala Kursen
10 december 2027	17 december 2027	70.00% av den Initiala Kursen
12 juni 2028	19 juni 2028	70.00% av den Initiala Kursen
11 december 2028	18 december 2028	70.00% av den Initiala Kursen
11 juni 2029	18 juni 2029	70.00% av den Initiala Kursen
10 december 2029	17 december 2029	70.00% av den Initiala Kursen
10 juni 2030	17 juni 2030	70.00% av den Initiala Kursen

B – Automatisk Avveckling (Autocall)

Värdepapperen kommer bli automatiskt inlösta om den stängningskursen eller nivån för Underliggande Tillgång delat med dess Initiala Kurs är lika med eller högre än dess motsvarande Barrärprocent för Automatisk Inlösen. Om detta inträffar kommer du erhålla ett **“Kontant Avvecklingsbelopp (Autocall)”** som är lika med Beräkningsbeloppet multiplicerat med 100% som ska betalas på Avvecklingsdagen vid Automatisk Inlösen motsvarande sådan Värderingsdag för Automatisk Inlösen. Den relevanta Avvecklingsdagen (Autocall) kan bli uppskjuten efter uppskjutandet av en Värderingsdag (Autocall) på grund av en störningshändelse.

Värderingsdag för Automatisk Inlösen	Inlösendag vid Automatisk Avveckling	Barrärprocent för Automatisk Inlösen
10 juni 2025	17 juni 2025	100.00%
10 december 2025	17 december 2025	100.00%
10 juni 2026	17 juni 2026	100.00%
10 december 2026	17 december 2026	100.00%
10 juni 2027	17 juni 2027	100.00%
10 december 2027	17 december 2027	100.00%
12 juni 2028	19 juni 2028	100.00%
11 december 2028	18 december 2028	100.00%

11 juni 2029	18 juni 2029	100.00%
10 december 2029	17 december 2029	100.00%

C – Slutlig Avveckling

Om Värdepapperen inte annars har lösts in kommer varje Värdepapper att lösas in på Planerade Avvecklingsdagen genom betalning av det Slutliga Kontanta avvecklingsbeloppet.

Den Planerade Avvecklingsdagen kan bli uppskjuten efter uppskjutandet av en Slutlig Värderingsdag på grund av en störningshändelse.

Det Slutliga "Kontantavvecklingsbeloppet" beräknas som följer:

- (i) om en Aktiverande Händelse (Knock-in) inte har inträffat, 100.00% multiplicerat med Beräkningsbeloppet.
- (ii) annars ett belopp som beräknas genom att dela den Slutliga Utvecklingen med Procentandelen av Startkursen (som är 100.00%) och multiplicera resultatet med Beräkningsbeloppet

"Slutlig Värderingsdag" betyder 10 juni 2029, med förbehåll för justering

"Slutlig Värderingskurs" betyder, avseende den Underliggande Tillgång, avseende den Slutliga Värderingsdagen.

"Aktiverande Händelse (Knock-in)" ska anses ha inträffat om stängningskursen för någon Underliggande Tillgång avseende Observationsdagen (Aktiverande Händelse) (som är 10 juni 2030) är under Knock-in Barriär Priset (det Initiala Priset(settlement)) multiplicerat med Knock-in Barriär procenten (som är 70.00%) av sådan Underliggande Tillgång"

Värdepapperens status

Värdepapperen är direkta, icke efterställda och icke säkerställda förpliktelser för Emittenten och kommer att rangordnas lika sinsemellan (*pari-passu*).

Beskrivning av restriktioner avseende fri överlåtbarhet av Värdepapperen: Värdepapperen erbjuds och säljs utanför Amerika till non-US-persons i enlighet med Regulation S under Securities Act och måste följa de överlåtbarhetsrestriktioner som gäller avseende USA. Värdepapper som hålls i ett clearingsystem kommer överföras i enlighet med de regler, processer och förordningar som gäller för clearingsystemet. Med förbehåll för ovan är Värdepapperen fritt överlåtbara.

Var kommer Värdepapperen handlas?

Ansökan förväntas göras av Emittenten (eller å dess vägnar) om att uppta Värdepapperen till handel på den reglerade marknaden Irish Stock Exchange Trading plc as Euronext Dublin

Vilka huvudrisker är specifika för Värdepapperen?

ärdepapperen är föremål för följande huvudrisker:

- Du kan förlora en del av eller hela dina investering i Värdepapperen:** Investerares exponering mot Barclays Bank PLC:s kreditrisk. Eftersom Värdepapperen inte utgör en insättning och inte är försäkrade eller garanterade av någon regering eller byrå eller under den brittiska regeringens kreditgarantisystem, är alla betalningar eller leveranser som ska göras av Barclays Bank PLC som Emittent under Värdepapperen beroende av dess finansiella ställning och dess förmåga att uppfylla sina skyldigheter. Värdepapperen utgör icke efterställda och icke säkerställda obligationer för Emittenten och rangordnas lika (*pari-passu*) med alla andra nuvarande och framtida icke efterställda och icke säkerställda förpliktelser för Emittenten. Villkoren för Värdepapperen ger inte en planerad minimibetalning vid förfallodagen och som sådan, beroende på utvecklingen för de(n) Underliggande Tillgången(arna), kan du förlora en del av eller hela din investering. Du kan också förlora en del av eller hela din investering om: (a) du säljer dina Värdepapper innan den planerade förfallodagen eller avslutandedagen; (b) dina Värdepapper blir förtida inlösta under vissa extraordinära omständigheter; eller (c) villkoren för dina Värdepapper justeras så att det belopp som ska betalas eller den egendom som levereras till dig är mindre än din initiala investering.
- Det finns risker i samband med värderingen, likviditeten och erbjudandet av Värdepapperen:** Marknadsvärdet på dina Värdepapper kan vara lägre än emissionskursen eftersom emissionskursen kan ta hänsyn till Emittentens och/eller distributörens vinstmarginal och kostnader utöver Värdepapperens rimliga marknadsvärde. Marknadsvärdet på dina Värdepapper kan påverkas av volatiliteten, nivån, värdet eller kursen på de(n) Underliggande Tillgången(arna) vid den aktuella tidpunkten, ränteförändringar, Emittentens finansiella tillstånd och kreditbetyg, utbudet och efterfrågan på Värdepapper, den återstående tiden fram till förfallodagen eller avslutandedagen för Värdepapperen och andra faktorer. Kursen, i förekommande fall, till vilken du kommer att kunna sälja dina Värdepapper före förfallodagen kan vara väsentligt mindre än det belopp du ursprungligen investerade. Dina Värdepapper kanske inte har en aktiv handelsmarknad och Emittenten är inte skyldig att skapa en marknad eller återköpa värdepapperen före förfallodagen. Emittenten kan när som helst dra tillbaka det offentliga erbjudandet. I sådant fall, om du redan har betalat eller levererat teckningsbeloppet för de relevanta Värdepapperen, har du rätt till återbetalning av sådant belopp, men kommer inte att få någon ersättning som kan ha uppstått under perioden mellan deras betalning eller leverans av teckningsbelopp och återbetalningen av Värdepapperen.
- Du är föremål för risker förknippade med fastställandet av betalningsbara belopp under Värdepapperen:** räntebeloppet är villkorat av utvecklingen för Underliggande Tillgång(ar) och kan vara noll där utvecklingskriterierna inte uppfylls. I sådant fall kan räntebeloppet skjutas upp till nästa räntebetalning som kan göras, men du får inte ut något belopp för att kompensera för sådan uppskjutning och det är möjligt att du inte kommer att få någon ränta över Värdepapperens hela löptid. räntebeloppet är antingen ett högre förutbestämt räntebelopp eller noll eller ett lägre räntebelopp, beroende på om utvecklingskriterierna uppfylls. Det är möjligt att du inte får någon ränta alls under Värdepapperens löptid. Det Kontanta Slutliga Avvecklingsbeloppet är baserat på utvecklingen för de Underliggande Tillgångarna endast vid den slutliga värderingsdagen (snarare än för flera perioder under Värdepapperens löptid). Detta innebär att du inte får dra nytta av någon rörelse i pris på de Underliggande Tillgångarna under Värdepapperens löptid som inte bibehålls i den slutliga utvecklingen vid den slutliga värderingsdagen. Eftersom det Kontanta Slutliga Avvecklingsbeloppet är föremål för ett tak, kan värdet på eller avkastningen på dina Värdepapper vara betydligt mindre än om du hade köpt de(n) Underliggande Tillgången(arna) direkt. Beräkningen av det belopp som ska betalas beror på nivån, värdet eller kursen på de(n) Underliggande Tillgången(arna) som når eller passerar en "barriär" under en viss period eller specificerade dagar under Värdepapperens löptid. Detta innebär att du kan få mindre (eller i vissa fall mer) om nivån, värdet eller kursen på de(n) Underliggande Tillgången(arna) passerar eller når (i tillämpliga fall) en barriär, än om den kommer nära barriären men inte når eller passerar den (i förekommande fall), och i vissa fall kanske du inte får några ränte- eller kupongbetalningar och/eller kan förlora en del av eller hela din investering. Värdepapperen refererar till en hybrid korg med Underliggande Tillgångar, som var och en visar unika riskegenskaper. Om de Underliggande Tillgångarna är korrelerade, kan utvecklingen för de Underliggande Tillgångarna i korgen förväntas röra sig i samma riktning. Om utvecklingen för en korg ger en större 'vikt' till en korgbeståndsdel jämfört med andra korgbeståndsdelar, kommer korgens utveckling att påverkas mer av förändringar i värdet för den specifika korgbeståndsdel än en korg som fördelar en lika stor vikt till varje korgbeståndsdel. Korgbeståndsdelarnas utveckling kan modereras eller kompenseras av

varandra. Detta innebär att även i fallet med en positiv utveckling för en eller flera beståndsdelar, kan korgens utveckling som helhet vara negativ om utvecklingen för de andra beståndsdelarna är negativa i större utsträckning

- **Dina Värdepapper är föremål för justeringar och förtida inlösen:** I enlighet med villkoren för Värdepapperen, efter inträffandet av vissa störingshändelser eller extraordinära händelser som rör Emittenten, dess hedgningsarrangemang, de(n) Underliggande Tillgången(arna), beskattning eller Värdepappers relevanta valuta, kan Fastställandeagenten eller Emittenten vidta ett antal korrigerande åtgärder, inklusive uppskattning av kurs för de(n) Underliggande Tillgången(arna), ersätta de(n) Underliggande Tillgången(arna) och göra justeringar av villkoren för Värdepapperen. Alla sådana korrigerande åtgärder kan ändra Värdepappers ekonomiska egenskaper och ha en väsentlig negativ inverkan på värdet på och avkastningen på Värdepapperen. Om inga korrigerande åtgärder kan vidtas, eller det fastställs att fullgörandet av någon av Emittentens skyldigheter enligt Värdepapperen är olagligt kan Emittenten lösa in Värdepapperen i förtid genom betalning av ett förtida belopp för kontant avveckling. Om förtida inlösen inträffar, kan du förlora en del av eller hela din investering eftersom det Kontanta Förtida Avvecklingsbeloppet kan vara lägre än den kurs du köpte Värdepapperen för, eller till och med vara noll. Du kommer också att förlora möjligheten att delta i all efterföljande positiva utveckling för de(n) Underliggande Tillgången(arna) och inte kunna realisera några potentiella vinster i värdet på Värdepapperen. Du kanske inte kan återinvestera intäkterna från en investering till en jämförbar avkastning och/eller med en jämförbar ränta eller kupongränta för en liknande risknivå.
- **Avveckling är föremål för villkor och kan vara omöjlig under vissa omständigheter:** Betalning av det belopp som ska betalas till dig kommer inte att ske förrän alla villkor för avveckling har uppfyllts i sin helhet. Inget ytterligare belopp kommer att betalas till dig av Emittenten på grund av eventuella förseningar eller uppskjutningar. Vissa händelser i avvecklingsstörningar kan inträffa som kan begränsa Emittentens förmåga att göra betalningar och dag för avveckling kan försenas i enlighet därmed.
- **Risker relaterade till Underliggande Tillgång(ar) som är vanliga aktier:** Utvecklingen för vanliga aktier är beroende av makroekonomiska faktorer, såsom ränta och prisnivåer på kapitalmarknaderna, valutakursutveckling och politiska faktorer samt företagsspecifika faktorer som resultat, marknadsposition, riskläge, aktieägarstruktur och distributionspolicy. Alla relevanta aktieemitter kan vidta åtgärder utan hänsyn till intresset för innehavare av Värdepapper, vilket kan ha en negativ effekt på värdet på Värdepapperen.
- **Beskattningsrisker:** Nivåerna som emittent, förvaltare och fastställelseagent; (ii) ingår säkringstransaktioner för att täcka Emittentens exponering för de relevanta kontantbelopp som ska betalas eller tillgångar som ska levereras under Värdepapper när dessa förfaller; och (iii) använder prisbidrag från sina handelsbord som prissättningskälla för en underliggande tillgång. Mot bakgrund av sådana konflikter kan de åtgärder som Barclays Bank PLC har vidtagit eller fastställt i förhållande till Värdepapperen inte alltid vara i innehavarnas intresse. Förutom säkringstransaktioner kan Barclays Bank PLC handla med de underliggande tillgångarna under sin vanliga verksamhet. Sådan handel kan påverka marknadspriset på de underliggande tillgångarna, vilket i sin tur kan väsentligt påverka värdet och avkastningen på dina Värdepapper.
- **Potentiella intressekonflikter:** Intressekonflikter kan existera där Barclays Bank PLC eller dess dotterbolag: (i) agerar i flera kapaciteter med avseende på Värdepapperen (t.ex. fungerar som emittent, förvaltare och fastställelseagent); (ii) ingår säkringstransaktioner för att täcka Emittentens exponering för de relevanta kontantbelopp som ska betalas eller tillgångar som ska levereras under Värdepapper när dessa förfaller; och (iii) använder prisbidrag från sina handelsbord som prissättningskälla för en underliggande tillgång. Mot bakgrund av sådana konflikter kan de åtgärder som Barclays Bank PLC har vidtagit eller fastställt i förhållande till Värdepapperen inte alltid vara i innehavarnas intresse. Förutom säkringstransaktioner kan Barclays Bank PLC handla med de underliggande tillgångarna under sin vanliga verksamhet. Sådan handel kan påverka marknadspriset på de underliggande tillgångarna, vilket i sin tur kan väsentligt påverka värdet och avkastningen på dina Värdepapper.

HUVUDINFORMATION OM ERBJUDANDET AV VÄRDEPAPPER OCH/ELLER UPPTAGANDET TILL HANDEL PÅ EN REGLERAD MARKNAD

På vilka villkor och enligt vilken tidplan kan jag investera i detta Värdepapper?

Villkor för erbjudandet

Villkoren för ett offentligt erbjudande av Värdepapperen kan fastställas genom överenskommelse mellan Emittenten och den Auktoriserade Erbjudaren vid tidpunkten för respektive emission.

Värdepapperen erbjuds till teckning i Finland under perioden från (och inkluderat) 7 maj 2024 till (och inkluderat) 31 maj 2024 ("Erbjudandeperioden") och sådant erbjudande är föremål för följande villkor:

- Erbjudandekurs: Emissionskursen
- Villkor vilka erbjudandet är underkastade: Emittenten förbehåller sig rätten att dra tillbaka erbjudandet för Värdepapper när som helst före slutet av Erbjudandeperioden. Om erbjudandet dras tillbaka och en ansökan har lämnats in av potentiella investerare, är varje investerare inte berättigad att prenumerera eller på annat sätt tillskansa sig Värdepappererna och ansökningarna avslutas och eventuella kontanta medel för inköp återbetalas till den sökande av Auktoriserad Erbjudare i enlighet med den Auktoriserade Erbjudarens standardprocedurer.
- Beskrivning av ansökningsprocessen: Ett erbjudande av Värdepappererna kan lämnas till chef (vilket är Barclays Bank Ireland PLC) eller Auktoriserad Erbjudare utan att detta följer Artikel 1(4) i EU:s prospektförordning i Finland (Jurisdiktionen för offentligt erbjudande) under Erbjudandeperioden. Ansökningar för Värdepapperen kan göras i Jurisdiktionen för offentligt erbjudande via den Auktoriserade Erbjudaren under Erbjudandeperioden. Värdepapperen placeras i Jurisdiktionen för offentligt erbjudande av den Auktoriserade Erbjudaren. Utdelningen sker i enlighet med den Auktoriserade Erbjudarens standardprocedurer, som meddelats till investerare av den Auktoriserade Erbjudaren.
- Information om minimi- och maxbelopp för ansökan: Minimi- och maxbelopp för ansökan från den Auktoriserade Erbjudaren meddelas till investerare av den Auktoriserade Erbjudaren.
- Beskrivning av möjligheten att minska teckningar och sätt för återbetalning av överflödiga belopp som erlagts av sökande: Ej tillämpligt.
- Information om metoden och tidsgränser för betalning och leverans av Värdepapperen: Investerare meddelas av den Auktoriserade Erbjudaren om sina allokeringar av Värdepapper och tillhörande avveckling.
- Sätt på och vilket datum resultatet av erbjudandet kommer göras publikt: Investerare meddelas av den Auktoriserade Erbjudaren om sina allokeringar av Värdepapper och tillhörande avveckling.
- Process för utövande av förköpsrätter, förhandling av teckningsrätter och behandling av icke utövade teckningsrätter: Ej tillämpligt.
- Kategorier av innehavare till vilka Värdepapperen erbjuds och om Tranche(r) har reserverats för vissa länder: Erbjudanden kan göras genom den Auktoriserade Erbjudaren i Jurisdiktionen för offentligt erbjudande till alla personer. Erbjudanden (om några) i andra EEA-länder görs endast genom den Auktoriserade Erbjudaren enligt ett undantag från skyldigheten under Prospektförordningen om att publicera ett prospekt.
- Process för meddelande till sökande om tilldelat belopp och indikation om huruvida handel kan påbörjas innan meddelande har lämnats: Sökanden meddelas direkt av den Auktoriserade Erbjudaren om huruvida ansökan har godkänts. Ingen handel med Värdepapper får ske innan Utfärdandedatumet.
- Namn och adress, i den utsträckning det är känt för Emittenten, för placerare i olika länder där erbjudandet äger rum: Auktoriserad Erbjudare

Uppskattade totala kostnader för emissionen inklusive uppskattade avgifter som debiteras investeraren av Emittenten/erbjudaren

De uppskattade kostnaderna för emissionen och/eller erbjudandet är 5.00%.

Emittenten debiterar inte innehavare några kostnader i samband med emission av Värdepapperen. Erbjudarna kan dock debitera innehavarna kostnader. Sådana kostnader (om sådana finns) kommer att bestämmas genom överenskommelse mellan erbjudaren och innehavarna vid varje emission.

Vem är erbjudaren och/eller den person som ansöker om upptagande till handel?

Emittenten är enheten som erbjuder och som ansöker om upptagande till handel av Värdepapperen.

Varför upprättas detta Prospekt?

Skäl för erbjudandet, förväntade intäkter och användning av intäkter:

Nettointäkterna från emissionen av Värdepapper kommer användas av Emittenten för dess generella bolagsändamål, vilket inkluderar att göra vinst och/eller hedgningsarrangemang för vissa risker.

Uppskattade nettointäkter är 100 procent av emissionsstorleken.

Fast åtagande att placera värdepapper

Betydande intressen i emissionen/erbjudandet, inklusive intressekonflikter:

Den Auktoriserade Erbjudaren kommer att betalas sammanlagda provisioner lika med 5% av Emissionskursen. Vardera av den Auktoriserade Erbjudaren och dess dotterbolag kan engagera sig och i framtiden kunna delta i hedgningstransaktioner med avseende på Underliggande Tillgångar.