

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.

FINAL TERMS



BARCLAYS BANK PLC

(Incorporated with limited liability in England and Wales)

Legal Entity Identifier (LEI): G5GSEF7VJP5I7OUK5573

**Up to EUR 30,000,000 Securities due June 2031 under the Global Structured Securities Programme (the Tranche 1 Securities)
Issue Price: 100 per cent**

This document constitutes the final terms of the Securities (the "Final Terms") described herein for the purposes of Article 8 of the (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 Base Prospectus 9 which constitutes a base prospectus drawn up as separate documents (including the Registration Document dated 23 March 2021, and the Securities Note relating to the GSSP Base Prospectus 9 dated 17 July 2020, as supplemented on the 23 December 2020, 29 January 2021 and 24 March 2021) for the purposes of Article 8(6) of the EU Prospectus Regulation. 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-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-securities-prospectuses/#registrationdocument> and <https://home.barclays/investor-relations/structured-securities-prospectuses/#registrationdocumentsupplement>.

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 dated 31 May 2021

PART A – CONTRACTUAL TERMS

Provisions relating to the Securities

1. (a) Series: NX000284178
(b) Tranche: 1
2. Currencies:
 - (a) Issue Currency: Euro (“EUR”)
 - (b) Settlement Currency: EUR
3. Securities: Notes
4. Notes: Applicable
 - (a) Aggregate Nominal Amount as at the Issue Date:
 - (i) Tranche: Up to EUR 30,000,000
 - (ii) Series: Up to EUR 30,000,000
 - (b) Specified Denomination: EUR 1,000
 - (c) Minimum Tradable Amount: EUR 1,000
5. Certificates: Not Applicable
6. Calculation Amount: EUR 1,000
7. Issue Price: 100% of the Aggregate Nominal Amount

The Issue Price includes a commission element payable to a third party which will be no more than 0.575% of the Issue Price.
8. Issue Date: 31 May 2021
9. Scheduled Settlement Date: 2 June 2031
10. Type of Security: Equity Index Linked Securities
11. Underlying Performance Type_(Interest): Single Asset
12. Underlying Performance Type_(Autocall): Single Asset
13. Underlying Performance Type_(Settlement): Single Asset

Provisions relating to interest (if any) payable

14. Interest Type: Snowball

General Condition 9 (*Interest*)

 - (a) Interest Payment Dates: Each of the dates set out in Table 1 below in the column entitled 'Interest Payment Date', subject to adjustment in accordance with the Business Day Convention.
 - (b) Interest Valuation Dates: Each of the dates set out in Table 1 below in the column entitled 'Interest Valuation Date'.

Table 1

T	Interest Valuation Date	Interest Barrier Percentage	Interest Payment Date
4	24 May 2022	100%	31 May 2022
5	24 August 2022	100%	31 August 2022
6	24 November 2022	100%	1 December 2022
7	24 February 2023	100%	3 March 2023
8	24 May 2023	100%	31 May 2023
9	24 August 2023	100%	31 August 2023
10	24 November 2023	100%	1 December 2023
11	26 February 2024	100%	4 March 2024
12	24 May 2024	100%	31 May 2024
13	26 August 2024	100%	2 September 2024
14	25 November 2024	100%	2 December 2024
15	24 February 2025	100%	3 May 2025
16	26 May 2025	100%	2 June 2025
17	25 August 2025	100%	1 September 2025
18	24 November 2025	100%	1 December 2025
19	24 February 2026	100%	3 March 2026
20	25 May 2026	100%	1 June 2026
21	24 August 2026	100%	31 August 2026
22	24 November 2026	100%	1 December 2026
23	24 February 2027	100%	3 March 2027
24	24 May 2027	100%	31 May 2027
25	24 August 2027	100%	31 August 2027
26	24 November 2027	100%	1 December 2027
27	24 February 2028	100%	2 March 2028
28	24 May 2028	100%	31 May 2028
29	24 August 2028	100%	31 August 2028
30	24 November 2028	100%	1 December 2028
31	26 February 2029	100%	5 March 2029
32	24 May 2029	100%	31 May 2029
33	24 August 2029	100%	31 August 2029
34	26 November 2029	100%	3 December 2029

35	25 February 2030	100%	4 March 2030
36	24 May 2030	100%	31 May 2030
37	26 August 2030	100%	2 September 2030
38	25 November 2030	100%	2 December 2030
39	24 February 2031	100%	3 March 2031
40	Final Valuation Date	70%	Redemption Date

- (c) Interest Commencement Date: Issue Date
- (d) (i) Fixed Interest Type: Not Applicable
- (ii) Fixed Interest Rate: 1.5375 per cent. per annum
- (e) Interest Barrier Percentage: Each of the percentages set out in Table 1 above in the column entitled 'Interest Barrier Percentage'.

Provisions relating to Automatic Settlement (Autocall)

15. Automatic Settlement (Autocall): Applicable
General Condition 10 (*Automatic Settlement (Autocall)*)
- (a) Autocall Observation Type: Discrete
- (b) Autocall Barrier Percentage: Each of the percentages set out in Table 2 below in the column entitled 'Autocall Barrier Percentage'.
- (c) Autocall Settlement Percentage: Each of the percentages set out in Table 2 below in the column entitled 'Autocall Settlement Percentage'.
- (d) Autocall Valuation Dates: Each of the dates set out in Table 2 below in the column entitled 'Autocall Valuation Date'.
- (e) Autocall Settlement Date: Each of the dates set out in Table 2 below in the column entitled 'Autocall Settlement Date'.

Table 2

Autocall Valuation Date	Autocall Barrier Percentage	Autocall Settlement Percentage	Autocall Settlement Date
24 May 2022	100%	100%	31 May 2022
24 August 2022	100%	100%	31 August 2022
24 November 2022	100%	100%	1 December 2022
24 February 2023	100%	100%	3 March 2023
24 May 2023	100%	100%	31 May 2023
24 August 2023	100%	100%	31 August 2023
24 November 2023	100%	100%	1 December 2023
26 February 2024	100%	100%	4 March 2024
24 May 2024	100%	100%	31 May 2024

26 August 2024	100%	100%	2 September 2024
25 November 2024	100%	100%	2 December 2024
24 February 2025	100%	100%	3 May 2025
26 May 2025	100%	100%	2 June 2025
25 August 2025	100%	100%	1 September 2025
24 November 2025	100%	100%	1 December 2025
24 February 2026	100%	100%	3 March 2026
25 May 2026	100%	100%	1 June 2026
24 August 2026	100%	100%	31 August 2026
24 November 2026	100%	100%	1 December 2026
24 February 2027	100%	100%	3 March 2027
24 May 2027	100%	100%	31 May 2027
24 August 2027	100%	100%	31 August 2027
24 November 2027	100%	100%	1 December 2027
24 February 2028	100%	100%	2 March 2028
24 May 2028	100%	100%	31 May 2028
24 August 2028	100%	100%	31 August 2028
24 November 2028	100%	100%	1 December 2028
26 February 2029	100%	100%	5 March 2029
24 May 2029	100%	100%	31 May 2029
24 August 2029	100%	100%	31 August 2029
26 November 2029	100%	100%	3 December 2029
25 February 2030	100%	100%	4 March 2030
24 May 2030	100%	100%	31 May 2030
26 August 2030	100%	100%	2 September 2030
25 November 2030	100%	100%	2 December 2030
24 February 2031	100%	100%	3 March 2031

(f) Autocall Valuation Price: The Valuation Price of the Underlying Asset on the Autocall Valuation Date

(i) Averaging-out: Not Applicable

(ii) Min Lookback-out: Not Applicable

(iii) Max Lookback-out: Not Applicable

16. Optional Early Settlement Event: Not Applicable
General Condition 11 (*Optional Early Settlement Event*)

Provisions relating to Final Settlement

17. (a) Final Settlement Type: Capped
General Condition 12 (*Final Settlement*)
- (b) Settlement Method: Cash
- (c) Strike Price Percentage: 100.00 per cent.
- (d) Knock-in Barrier Type: European
- (e) Knock-in Barrier Percentage: 55.00 per cent.

Provisions relating to Nominal Call Event Settlement

18. Nominal Call Event Settlement: Not Applicable
General Condition 13 (*Nominal Call Event Settlement*)
- (a) Nominal Call Threshold Percentage: Not Applicable

Provisions relating to Instalment Notes

19. Instalment Notes: Not Applicable
General Condition 15 (*Settlement by Instalments*)

Provisions relating to the Underlying Asset(s)

20. Underlying Asset:
- (a) Initial Valuation Date: 28 May 2021
- (b) Index: S&P Europe 50 ESG Select Equal Weight (BEL, DEU, FRA, NLD) 50 Point Decrement (Series 2) (EUR) TR
- (i) Exchange: Multi-exchange
- (ii) Related Exchange: All Exchanges
- (iii) Underlying Asset Currency: EUR
- (iv) Bloomberg Screen: SPCEEDET <Index>
- (v) Refinitiv Screen: .SPCEEDET
- (vi) Index Sponsor: S&P Dow Jones Indices LLC
- (vii) Weight: Not Applicable
- (viii) Pre-nominated Index: Not Applicable
21. (a) Initial Price_(Interest): The Valuation Price of the Underlying Asset on the Initial Valuation Date
- (i) Averaging-in: Not Applicable
- (ii) Min Lookback-in: Not Applicable
- (iii) Max Lookback-in: Not Applicable

- | | | |
|-------|---|--|
| (b) | Initial Price _(Settlement) : | The Valuation Price of the Underlying Asset on the Initial Valuation Date |
| (i) | Averaging-in: | Not Applicable |
| (ii) | Min Lookback-in: | Not Applicable |
| (iii) | Max Lookback-in: | Not Applicable |
| 22. | (a) | Final Valuation Price: The Valuation Price of the Underlying Asset on the Final Valuation Date |
| | (i) | Averaging-in: Not Applicable |
| | (ii) | Min Lookback-in: Not Applicable |
| | (iii) | Max Lookback-in: Not Applicable |
| | (b) | Final Valuation Date 26 May 2031 |

Provisions relating to disruption events

- | | | |
|-----|---|---|
| 23. | Consequences of a Disrupted Day (in respect of an Averaging Date or Lookback Date):
General Condition 18
<i>(Consequences of Disrupted Days)</i> | |
| | (a) Omission: | Not Applicable |
| | (b) Postponement: | Not Applicable |
| | (c) Modified Postponement: | Not Applicable |
| 24. | Consequences of a Disrupted Day (in respect of an Averaging Date or Lookback Date):
General Condition 25 (<i>Adjustments to Valuation Dates and Reference Date</i>) | |
| | (a) Omission: | Not Applicable |
| | (b) Postponement: | Not Applicable |
| 25. | Consequences of Disrupted Day (in respect of an Averaging Date or Lookback Date): General Condition 37 (<i>Consequences upon a Reference Date becoming a Disrupted Day</i>) | |
| | (a) Omission: | Not Applicable |
| | (b) Postponement: | Not Applicable |
| | (c) Modified Postponement: | Not Applicable |
| 26. | Additional Disruption Events:
General Condition 34 (<i>Adjustment, early redemption or early cancellation following an Additional Disruption Event</i>) | |
| | (a) Change in Law: | Applicable as per General Condition 65.1 (<i>Definitions</i>) |

(b) Currency Disruption Event:	Applicable as per General Condition 65.1 (<i>Definitions</i>)
(c) Hedging Disruption:	Not Applicable
(d) Issuer Tax Event:	Applicable as per General Condition 65.1 (<i>Definitions</i>)
(e) Extraordinary Market Disruption:	Applicable as per General Condition 65.1 (<i>Definitions</i>)
(f) Increased Cost of Hedging:	Not Applicable as per General Condition 65.1 (<i>Definitions</i>)
(g) Affected Jurisdiction Hedging Disruption:	Not Applicable as per General Condition 65.1 (<i>Definitions</i>)
(h) Affected Jurisdiction Increased Cost of Hedging:	Not Applicable as per General Condition 65.1 (<i>Definitions</i>)
(i) Increased Cost of Stock Borrow:	Not Applicable as per General Condition 65.1 (<i>Definitions</i>)
(j) Loss of Stock Borrow:	Not Applicable as per General Condition 65.1 (<i>Definitions</i>)
(k) Foreign Ownership Event:	Not Applicable as per General Condition 65.1 (<i>Definitions</i>)
(l) Fund Disruption Event:	Not Applicable as per General Condition 65.1 (<i>Definitions</i>)
(m) Fund Event:	Not Applicable
(n) Potential Adjustment of Payment Events:	Not Applicable
(o) Barclays Index Disruption:	Not Applicable
27. Early Cash Settlement Amount:	Market Value
28. Early Settlement Notice Period Number:	As specified in General Condition 65.1 (<i>Definitions</i>)
29. Substitution of Shares:	Not Applicable
30. Entitlement Substitution:	Not Applicable
31. FX Disruption Event:	Not Applicable
32. Disruption Fallbacks: General Condition 17 (<i>Consequences of FX Disruption Events (FX)</i>)	Not Applicable
33. Unwind Costs:	Not Applicable
34. Settlement Expenses:	Not Applicable
35. Consequences of a Fund Event: General Condition 27 (<i>Consequences of a Fund Event</i>)	Not Applicable
36. Local Jurisdiction Taxes and Expenses:	Not Applicable

General provisions

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

	NGN Form: Not Applicable
	Held under the NSS: Not Applicable
	CGN Form: Applicable
	CDIs: Not Applicable
38. Trade Date:	9 April 2021
39. 871(m) Securities:	The Issuer has determined that Section 871(m) of the US Internal Revenue Code is not applicable to the Securities.
40. (i) Prohibition of Sales to EEA Retail Investors:	Not Applicable
(ii) Prohibition of Sales to UK Retail Investors:	Applicable – see the cover page of these Final Terms
41. Prohibition of Offer to Private Clients in Switzerland:	Applicable
42. Additional Business Centre(s):	Not Applicable
43. Business Day Convention:	Modified Following
44. Determination Agent:	Barclays Bank PLC
45. Registrar:	Not Applicable
46. CREST Agent:	Not Applicable
47. Transfer Agent:	Not Applicable
48. (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
49. Registration Agent:	Not Applicable
50. <i>Masse</i> Category	<p>Full <i>Masse</i> The Representative shall be: MASSQUOTES.A.S.U. RCS 529 065 880 Nanterre 7bis rue de Neuilly F-92110 Clichy Mailing address: 33, rue Anna Jacquin 92100 Boulogne Billancourt France Represented by its Chairman</p> <p>The Representative will be entitled to a remuneration of €350 (VAT excluded) per year, payable on each Interest Payment Date with the first payment at the Issue date.</p> <p>The Representative will exercise its duty until its dissolution, resignation or termination of its duty by a general assembly of Noteholders or until it becomes unable to act. Its appointment</p>

shall automatically cease on the Maturity Date, or total redemption prior to the Maturity Date.

51. Governing Law: French law
52. Relevant Benchmark: Amounts payable under the Securities are calculated by reference to S&P Europe 50 ESG Select Equal Weight (BEL, DEU, FRA, NLD) 50 Point Decrement (Series 2) (EUR) TR, which is provided by S&P Dow Jones Indices LLC or its affiliates ("**SPDJ**") (the "**Administrator**"). As at the date of this Final Terms, the Administrator appears on the register of administrators and benchmarks established and maintained by the European Securities and Markets Authority ("**ESMA**") pursuant to Article 36 of Regulation (EU) 2016/1011 (as amended, the "**EU Benchmarks Regulation**").

PART B – OTHER INFORMATION

1. LISTING AND ADMISSION TO TRADING

- | | |
|---|--|
| (a) Listing and Admission to Trading: | Application is expected to be made by the Issuer (or on its behalf) for the Securities to be listed on the official list and admitted to trading on the regulated market of the Luxembourg Stock Exchange on or around the Issue Date. |
| (b) Estimate of total expenses related to admission to trading: | EUR 3,600 |
| (c) Renouncement Notice Cut-off Time: | 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 | Not Applicable |

4. YIELD

Not Applicable

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

Bloomberg Screen: SPCEEDET <Index>

Index Disclaimer: See Schedule hereto

6. OPERATIONAL INFORMATION

- | | |
|---|--|
| (a) ISIN: | FR0014003011 |
| (b) Common Code: | 233289949 |
| (c) Relevant Clearing System(s): | Euroclear, Clearstream |
| (d) Delivery: | Delivery free of payment |
| (e) Intended to be held in a manner which would allow Eurosystem eligibility: | No. Whilst the designation is specified as "no" at the date of these Final Terms, should the Eurosystem eligibility criteria be amended in the future such that the Notes are capable of meeting them the Notes may then be deposited with one of the International Central Securities Depositories ("ICSDs") as common safekeeper. Note that this does not necessarily mean that the Notes will then be recognised as eligible collateral for Eurosystem monetary policy and intra day credit operations by the Eurosystem at any time during their life. Such recognition will depend upon the ECB being satisfied that Eurosystem eligibility criteria have been met. |

7. TERMS AND CONDITIONS OF THE OFFER

7.1 Authorised Offer(s)

- (a) Public Offer: An offer of the Securities 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 Directive 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:** UBS (France) S.A. (the "**Initial Authorised Offeror(s)**") and each financial intermediary expressly named as an Authorised Offeror on the Issuer's website (<https://home.barclays/investor-relations/fixed-income-investors/prospectus-and-documents/structured-securities-final-terms>); and
- (ii) **General consent:** Not Applicable
- (c) Jurisdiction(s) where the offer may take place (together, the "Public Offer Jurisdiction(s)"): France
- (d) Offer period for which use of the Base Prospectus is authorised by the Authorised Offeror(s) (the "Offer Period"): From and including 21 April 2021 to but excluding 28 May 2021
- (e) Other conditions for use of the Base Prospectus by the Authorised Offeror(s): Not Applicable

7.2

Other terms and conditions of the offer

- (a) Offer Price: The Issue Price
- (b) Total amount of offer: Up to EUR 30,000,000
- (c) 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.
- (d) Time period, including any possible amendments, during which the offer will be open and description of the application process: From and including 21 April 2021 to but excluding 28 May 2021.

(e) 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 Directive in France (the “Public Offer Jurisdiction”) during the Offer Period. Applications for the Securities can be made in the Public Offer Jurisdiction through the Authorised Offeror during the Offer Period. The Securities will be placed into the Public Offer Jurisdiction by the Authorised Offeror. Distribution will be in accordance with the Authorised Offeror’s usual procedures, notified to investors by the Authorised Offeror.
(f) 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.
(g) Description of possibility to reduce subscriptions and manner for refunding excess amount paid by applicants:	Not Applicable
(h) 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.
(i) 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.
(j) Procedure for exercise of any right of pre-emption, negotiability of subscription rights and treatment of subscription rights not exercised:	Not Applicable
(k) 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 Directive as implemented in such countries to publish a prospectus.
(l) 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.
(m) 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.
(n) Name(s) and address(es), to the extent known to the Issuer, of the placers in the various countries where the offer takes place:	UBS (France) SA with its address at 69 BD Hausmann, 75008 Paris, France (telephone number: +33 1 44 56 45 45) and its LEI is 9695007NQ9E3N5VPW317.

Schedule

The S&P Europe 50 ESG Select Equal Weight (BEL, DEU, FRA, NLD) 50 Point Decrement (Series 2) (EUR) TR (the "Index") is a product of S&P Dow Jones Indices LLC or its affiliates ("SPDJI"), and has been licensed for use by Barclays. Standard & Poor's® and S&P® are registered trademarks of Standard & Poor's Financial Services LLC ("S&P"); Dow Jones® is a registered trademark of Dow Jones Trademark Holdings LLC ("Dow Jones"); and these trademarks have been licensed for use by SPDJI and sublicensed for certain purposes by Barclays. It is not possible to invest directly in an index. The Notes are not sponsored, endorsed, sold or promoted by SPDJI, Dow Jones, S&P, any of their respective affiliates (collectively, "S&P Dow Jones Indices"). S&P Dow Jones Indices do not make any representation or warranty, express or implied, to the owners of The Notes or any member of the public regarding the advisability of investing in securities generally or in The Notes particularly or the ability of the Index to track general market performance. Past performance of an index is not an indication or guarantee of future results. S&P Dow Jones Indices' only relationship to Barclays with respect to the Index is the licensing of the Index and certain trademarks, service marks and/or trade names of S&P Dow Jones Indices and/or its licensors. The Index is determined, composed and calculated by S&P Dow Jones Indices without regard to Barclays or The Notes. S&P Dow Jones Indices have no obligation to take the needs of Barclays or the owners of The Notes into consideration in determining, composing or calculating the Index. S&P Dow Jones Indices are not responsible for and have not participated in the determination of the prices, and amount of The Notes or the timing of the issuance or sale of The Notes or in the determination or calculation of the equation by which The Notes is to be converted into cash, surrendered or redeemed, as the case may be. S&P Dow Jones Indices have no obligation or liability in connection with the administration, marketing or trading of The Notes. There is no assurance that investment products based on the Index will accurately track index performance or provide positive investment returns. S&P Dow Jones Indices LLC is not an investment or tax advisor. A tax advisor should be consulted to evaluate the impact of any tax-exempt securities on portfolios and the tax consequences of making any particular investment decision. Inclusion of a security within an index is not a recommendation by S&P Dow Jones Indices to buy, sell, or hold such security, nor is it considered to be investment advice.

NEITHER S&P DOW JONES INDICES NOR THIRD PARTY LICENSOR GUARANTEES THE ADEQUACY, ACCURACY, TIMELINESS AND/OR THE COMPLETENESS OF THE INDEX OR ANY DATA RELATED THERETO OR ANY COMMUNICATION, INCLUDING BUT NOT LIMITED TO, ORAL OR WRITTEN COMMUNICATION (INCLUDING ELECTRONIC COMMUNICATIONS) WITH RESPECT THERETO. S&P DOW JONES INDICES SHALL NOT BE SUBJECT TO ANY DAMAGES OR LIABILITY FOR ANY ERRORS, OMISSIONS, OR DELAYS THEREIN. S&P DOW JONES INDICES MAKES NO EXPRESS OR IMPLIED WARRANTIES, AND EXPRESSLY DISCLAIMS ALL WARRANTIES, OF MERCHANTABILITY OR FITNESS FOR A PARTICULAR PURPOSE OR USE OR AS TO RESULTS TO BE OBTAINED BY THE ISSUER, OWNERS OF THE SECURITIES, OR ANY OTHER PERSON OR ENTITY FROM THE USE OF THE INDEX OR WITH RESPECT TO ANY DATA RELATED THERETO. WITHOUT LIMITING ANY OF THE FOREGOING, IN NO EVENT WHATSOEVER SHALL S&P DOW JONES INDICES BE LIABLE FOR ANY INDIRECT, SPECIAL, INCIDENTAL, PUNITIVE, OR CONSEQUENTIAL DAMAGES INCLUDING BUT NOT LIMITED TO, LOSS OF PROFITS, TRADING LOSSES, LOST TIME OR GOODWILL, EVEN IF THEY HAVE BEEN ADVISED OF THE POSSIBILITY OF SUCH DAMAGES, WHETHER IN CONTRACT, TORT, STRICT LIABILITY, OR OTHERWISE. THERE ARE NO THIRD PARTY BENEFICIARIES OF ANY AGREEMENTS OR ARRANGEMENTS BETWEEN S&P DOW JONES INDICES AND THE ISSUER, OTHER THAN THE LICENSORS OF S&P DOW JONES INDICES.

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 Base 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 30,000,000 Securities due June 2031 pursuant to the Global Structured Securities Programme (ISIN: FR0014003011) (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 G5GSEF7VJP517OUK5573

The Authorised Offeror: The Authorised Offeror is UBS (France) SA with its address at 69 BD Haussmann, 75008 Paris, France (telephone number: +33 1 44 56 45 45) and its LEI is 9695007NQ9E3N5VPW317

Competent authority: The Base Prospectus was approved on 17 July 2020 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 OF 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 G5GSEF7VJP517OUK5573.

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

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

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

Identity of the key managing directors of the Issuer: The key managing directors of the Issuer are James Staley (Chief Executive Officer and Executive Director) and Tushar Morzaria (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 2020 and 31 December 2019 from the annual consolidated financial statements of the Issuer for the years ended 31 December 2020 and 2019 (the "Financial Statements"), which have each been audited with an unmodified opinion provided by KPMG.

Consolidated Income Statement

	As at 31 December	
	2020	2019
		(£m)
Net interest income.....	3,160	3,901
Net fee and commission income.....	5,659	5,671
Credit impairment charges	(3,377)	(1,202)
Net trading income	7,076	4,071
Profit before tax.....	3,075	3,111
Profit/(loss) after tax.....	2,451	2,780

Consolidated Balance Sheet

	As at 31 December	
	2020	2019
		(£m)
Total assets.....	1,059,731	876,672
Debt securities in issue.....	29,423	33,536
Subordinated liabilities	32,005	33,425
Loans and advances at amortised cost	134,267	141,636
Deposits at amortised cost	244,696	213,881
Total equity.....	53,710	50,615

Certain Ratios from the Financial Statements

	As at 31 December	
	2020	2019
		(%)
Common Equity Tier 1 capital	14.2	13
Total regulatory capital.....	21.0	22
CRR leverage ratio	3.9	3

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 terrorism or global conflicts, 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) the impact of COVID-19; (ii) potentially unfavourable global and local economic and market conditions, as well as geopolitical developments; (iii) the UK's withdrawal from the EU; (iv) the impact of interest rate changes on the Barclays Bank Group's profitability; (v) the competitive environments of the banking and financial services industry; (vi) the regulatory change agenda and impact on business model; (vii) the impact of climate change on the Barclays Bank Group's business; and (viii) the impact of benchmark interest rate reforms on the Barclays Bank Group.
- **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 of loans and advances due from borrowers and counterparties in any specific portfolio. Market risk is the risk of loss arising from potential adverse change in the value of the Barclays Bank Group's assets and liabilities from fluctuation in market variables.
- **Treasury and capital risk and the risk that the Issuer and the Barclays Bank Group are subject to substantial resolution powers:** There are three primary types of treasury and capital risk faced by the Barclays Bank Group which are (1) liquidity risk – the risk that the Barclays Bank Group is unable to meet its contractual or contingent obligations or that it does not have the appropriate amount of stable funding and liquidity to support its assets, which may also be impacted by credit rating changes; (2) capital risk – the risk that the Barclays Bank Group has an insufficient level or composition of capital; and (3) interest rate risk in the banking book – the risk that the Barclays Bank Group is exposed to capital or income volatility because of a mismatch between the interest rate exposures of its (non-traded) assets and liabilities. Under the Banking Act 2009, substantial powers are granted to the Bank of England (or, in certain circumstances, HM Treasury), in consultation with the United Kingdom Prudential Regulation Authority, the UK Financial Conduct Authority and HM Treasury, as appropriate as part of a special resolution regime. These powers enable the Bank of England (or any successor or replacement thereto and/or such other authority in the United Kingdom with the ability to exercise the UK Bail-in Power) (the "Resolution Authority") to implement various resolution measures and stabilisation options (including, but not limited to, the bail-in tool) with respect to a UK bank or investment firm and certain of its affiliates (as at the date of the Registration Document, including the Issuer) in circumstances in which the Resolution Authority is satisfied that the relevant resolution conditions are met.
- **Operational and model risks:** Operational risk is the risk of loss to the Barclays Bank Group from inadequate or failed processes or systems, human factors or due to external events where the root cause is not due to credit or market risks. Model risk is the risk of potential adverse consequences from financial assessments or decisions based on incorrect or misused model outputs and reports.
- **Conduct, reputation and legal risks and legal, competition and regulatory matters:** Conduct risk is the risk of detriment to customers, clients, market integrity, effective competition or the Barclays Bank Group from the inappropriate supply of financial services, including instances of wilful or negligent misconduct. 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 competence. The Barclays Bank Group conducts activities in a highly regulated market which exposes it and its employees to legal risk arising from (i) the multitude of laws and regulations that apply to the businesses it operates, which are highly dynamic, may vary between jurisdictions, and are often unclear in their application to particular circumstances especially in new and emerging areas; and (ii) the diversified and evolving nature of the Barclays Bank Group's businesses and business practices. In each case, this exposes the Barclays Bank Group and its employees to the risk of loss or the imposition of penalties, damages or fines from the failure of members of the Barclays Bank Group to meet their respective legal obligations, including legal or contractual requirements. Legal risk may arise in relation to any number of the material existing and emerging risks summarised above.

KEY INFORMATION OF 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: NX000284178; Tranche Number: 1; ISIN: FR00140030I1; Common Code: 233289949.

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

Currency, specified denomination, calculation amount, 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 calculation amount is EUR 1,000 per Security (the "Calculation Amount"). The issue size is up to EUR 30,000,000. The issue price is 100% of the Specified Denomination.

The issue date is 31 May 2021 (the "Issue Date"). Subject to early termination, the Securities are scheduled to redeem on 2 June 2031 (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 forms of: (i) one or more Interest Amounts and (ii) an Auto call 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 days, or, in the case of interest, 14 days), 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, taxation or the relevant currency of the Securities, or if it determines that the performance of any of its obligations under the Securities is unlawful or physically impracticable. If this occurs, investors will receive an "Early Cash Settlement Amount" equal to the fair market value of the Securities prior to their redemption.

Certain additional limitations:

- Notwithstanding that the Securities are linked to the performance of the Underlying Asset, holders do not have any rights in respect of the Underlying Asset.
- 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, (where applicable) to postpone valuation of the Underlying Asset or scheduled payments under the Securities, to change the currency in which the Securities are denominated, to substitute the Underlying Asset, 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.
- The Securities contain provisions for calling meetings of holders to consider matters affecting their interests generally and these provisions permit defined majorities to bind all holders, including holders who did not attend and vote at the relevant meeting and holders who voted in a manner contrary to the majority.

Governing law

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

Description of the calculation of potential return on the Securities

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

Underlying Asset	Type	Initial Price	Initial Valuation Date
------------------	------	---------------	------------------------

S&P Europe 50 ESG Select Equal Weight (BEL, DEU, FRA, NLD) 50 Point Decrement (Series 2) (EUR) TR (Bloomberg Code: SPCEDET <Index>	Equity Index	The closing price of the Underlying Asset on the Initial Valuation Date	28 May 2021
--	--------------	---	-------------

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, indicative minimum amount, an indicative maximum amount or indicative 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

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

- (1) multiplying the fixed rate of 1.5375% by the Calculation Amount; and then
- (2) multiplying the result by the number corresponding to that Interest Valuation Date (i.e. the number in the column headed 'T' in the table below).

Each Interest Payment Date, corresponding Interest Valuation Date, T and Interest Barrier is as follows:

T	Interest Valuation Date	Interest Payment Date	Interest Barrier
4	24 May 2022	31 May 2022	100% of the Initial Price
5	24 August 2022	31 August 2022	100% of the Initial Price
6	24 November 2022	1 December 2022	100% of the Initial Price
7	24 February 2023	3 March 2023	100% of the Initial Price
8	24 May 2023	31 May 2023	100% of the Initial Price
9	24 August 2023	31 August 2023	100% of the Initial Price
10	24 November 2023	1 December 2023	100% of the Initial Price
11	26 February 2024	4 March 2024	100% of the Initial Price
12	24 May 2024	31 May 2024	100% of the Initial Price
13	26 August 2024	2 September 2024	100% of the Initial Price
14	25 November 2024	2 December 2024	100% of the Initial Price
15	24 February 2025	3 May 2025	100% of the Initial Price
16	26 May 2025	2 June 2025	100% of the Initial Price
17	25 August 2025	1 September 2025	100% of the Initial Price
18	24 November 2025	1 December 2025	100% of the Initial Price
19	24 February 2026	3 March 2026	100% of the Initial Price
20	25 May 2026	1 June 2026	100% of the Initial Price
24	24 May 2027	31 May 2027	100% of the Initial Price
25	24 August 2027	31 August 2027	100% of the Initial Price
26	24 November 2027	1 December 2027	100% of the Initial Price
27	24 February 2028	2 March 2028	100% of the Initial Price
28	24 May 2028	31 May 2028	100% of the Initial Price
29	24 August 2028	31 August 2028	100% of the Initial Price
30	24 November 2028	1 December 2028	100% of the Initial Price
31	26 February 2029	5 March 2029	100% of the Initial Price
32	24 May 2029	31 May 2029	100% of the Initial Price
33	24 August 2029	31 August 2029	100% of the Initial Price
34	26 November 2029	3 December 2029	100% of the Initial Price
35	25 February 2030	4 March 2030	100% of the Initial Price
36	24 May 2030	31 May 2030	100% of the Initial Price
37	26 August 2030	2 September 2030	100% of the Initial Price
38	25 November 2030	2 December 2030	100% of the Initial Price
39	24 February 2031	3 March 2031	100% of the Initial Price
40	Final Valuation Date	Redemption Date	70% of the Initial Price

B – Automatic Settlement (Autocall)

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

Autocall Valuation Date	Autocall Barrier Percentage	Autocall Settlement Percentage	Autocall Settlement Date
24 May 2022	100%	100%	31 May 2022
24 August 2022	100%	100%	31 August 2022
24 November 2022	100%	100%	1 December 2022
24 February 2023	100%	100%	3 March 2023
24 May 2023	100%	100%	31 May 2023
24 August 2023	100%	100%	31 August 2023
24 November 2023	100%	100%	1 December 2023
26 February 2024	100%	100%	4 March 2024
24 May 2024	100%	100%	31 May 2024
26 August 2024	100%	100%	2 September 2024
25 November 2024	100%	100%	2 December 2024
24 February 2025	100%	100%	3 May 2025
26 May 2025	100%	100%	2 June 2025
25 August 2025	100%	100%	1 September 2025
24 November 2025	100%	100%	1 December 2025
24 February 2026	100%	100%	3 March 2026
25 May 2026	100%	100%	1 June 2026
24 August 2026	100%	100%	31 August 2026
24 November 2026	100%	100%	1 December 2026
24 February 2027	100%	100%	3 March 2027
24 May 2027	100%	100%	31 May 2027

Autocall Valuation Date	Autocall Barrier Percentage	Autocall Settlement Percentage	Autocall Settlement Date
24 November 2027	100%	100%	1 December 2027
24 February 2028	100%	100%	2 March 2028
24 May 2028	100%	100%	31 May 2028
24 August 2028	100%	100%	31 August 2028
24 November 2028	100%	100%	1 December 2028
26 February 2029	100%	100%	5 March 2029
24 May 2029	100%	100%	31 May 2029
24 August 2029	100%	100%	31 August 2029
26 November 2029	100%	100%	3 December 2029
25 February 2030	100%	100%	4 March 2030
24 May 2030	100%	100%	31 May 2030
26 August 2030	100%	100%	2 September 2030
25 November 2030	100%	100%	2 December 2030
24 February 2031	100%	100%	3 March 2031
24 May 2027	100%	100%	31 May 2027
24 August 2027	100%	100%	31 August 2027
24 November 2027	100%	100%	1 December 2027
24 February 2028	100%	100%	2 March 2028
24 May 2028	100%	100%	31 May 2028
24 August 2028	100%	100%	31 August 2028
24 November 2028	100%	100%	1 December 2028

C – Final Settlement

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

The Final Cash Settlement Amount is calculated as follows:

- (i) If the Final Performance is greater than or equal to the Knock-in Barrier Percentage (being 55%), 100% multiplied by the Calculation Amount;
- (ii) otherwise, an amount calculated by dividing the Final Performance by the Strike Price Percentage (being 100%) and multiplying the result by the Calculation Amount.

"**Final Performance**" means the Final Valuation Price divided by the Initial Price.

"**Final Valuation Date**" means 26 May 2031

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

Status of the Securities

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

Description of restrictions on free transferability of the Securities

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

Where will the Securities be traded?

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

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

The Securities are subject to the following key risks:

- **You may lose some or all of your investment in the Securities:** The terms of your Securities do not provide for a scheduled minimum payment at maturity and as such, depending on the performance of the Underlying Asset, 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 or level of the Underlying Asset 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 Securities bear interest at a rate that is contingent upon the performance of the Underlying Assets and may vary from one Interest Payment Date to the next. You may not receive any interest payments if the Underlying Asset does not perform as anticipated.

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 Final Cash Settlement Amount is based on the performance of the Underlying Asset 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 level of the Underlying Asset 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 level 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 level of the Underlying Asset(s) crosses or reaches (as applicable) a barrier, than if it comes close to the barrier but does not reach or cross it (as applicable), and in certain cases you might receive no interest or coupon payments and/or could lose some or all of your investment.
- **Your Securities are subject to adjustments and early redemption:** Pursuant to the terms and conditions of the Securities, following the occurrence of certain disruption events or extraordinary events concerning the Issuer, its hedging arrangements, the Underlying Asset, taxation or the relevant currency of the Securities, the Determination Agent or the Issuer may take a number of remedial actions, including estimating the level of the Underlying Asset, substituting the Underlying Asset, and making adjustments to the terms and conditions of the Securities. Any of such remedial action may change the economic characteristics of the Securities and have a material adverse effect on the value of and return on the Securities. If no remedial action can be taken, or it is determined that the performance of any of the Issuer's obligations under the Securities is unlawful or physically impracticable, 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 level 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 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.
- **Risks relating to the Underlying Asset that are equity indices:** Equity indices are composed of a synthetic portfolio of shares and provide investment diversification opportunities, but will be subject to the risk of fluctuations in both equity prices and the value and volatility of the relevant equity index. The Securities are linked to equity indices, and as such may not participate in dividends or any other distributions paid on the shares which make up such indices. Accordingly, you may receive a lower return on the Securities than you would have received if you had invested directly in those shares. The index sponsor can add, delete or substitute the components of an equity index at its discretion, and may also alter the methodology used to calculate the level of such index. These events may have a detrimental impact on the level of that index, which in turn could have a negative impact on [the level of the Barclays Index and in turn] the value of and return on the Securities.

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

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

Terms and conditions of the offer

The terms and conditions of any offer of Securities to the public may be determined by agreement between the Issuer and the Authorised Offeror at the time of each issue.

The Securities are offered for subscription in France during the period from (and including) 21 April 2021 to (but excluding) 28 May 2021 (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 other than pursuant to Article 1(4) of the EU Prospectus Directive may be made by the Manager or the Authorised Offeror in the Sweden (the "Public Offer Jurisdiction") during the Offer Period.
- 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 Directive as implemented in such countries 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: UBS (France) SA with its address at 69 BD Haussmann, 75008 Paris, France (telephone number: +33 1 44 56 45 45) and its LEI is 9695007NQ9E3N5VPW317.

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

The estimated total expenses of the issue and/or offer are EUR 3,000.

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

See 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.

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 may be paid fees in relation to the offer of Securities. Potential conflicts of interest may exist between the Issuer, Determination Agent, Authorised Offeror or their affiliates (who may have interests in transactions in derivatives related to the Underlying Asset which may, but are not intended to, adversely affect the market price, liquidity or value of the Securities) and holders.

The Authorised Offeror will be paid aggregate commissions equal to no more than 0.575%. Any Authorised Offeror and its affiliates may engage, and may in the future engage, in hedging transactions with respect to the Underlying Asset.

RÉSUMÉ

INTRODUCTION ET AVERTISSEMENTS

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

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

Titres : Jusqu'à 30.000.000 EUR de titres échéant en juin 2031 dans le cadre du Programme mondial de titres structurés (ISIN : FR0014003011) (les « **Titres** »).

L'Émetteur : L'Émetteur est Barclays Bank PLC. Son siège social est situé au 1 Churchill Place, Londres, E14 5HP, Royaume-Uni (numéro de téléphone : +44 (0)20 71 16 1000) et son Identifiant d'entité juridique (« LEI ») est G5GSEF7VJP517OUK5573

L'Offrant Autorisé : L'Offrant Autorisé est UBS (France) SA et son adresse est 69 BD Haussmann, 75008 Paris, France (numéro de téléphone : +33 1 44 56 45 45) et son LEI est 9695007NQ9E3N5VPW317

Autorité compétente : Le Prospectus de Base a été approuvé le 17 juillet 2020 par la Banque Centrale d'Irlande de New Wapping Street, North Wall Quay, Dublin 1, D01 F7X3, Irlande (numéro de téléphone : +353 (0)1 224 6000).

INFORMATIONS CLÉS SUR L'ÉMETTEUR

Qui est l'Émetteur des Titres ?

Domicile et forme juridique de l'Émetteur : Barclays Bank PLC (« l'Émetteur ») est une société publique à responsabilité limitée immatriculée en Angleterre et au Pays de Galles sous le numéro 1026167. La responsabilité des membres de l'Émetteur est limitée. Son siège social et principal est sis à 1 Churchill Place, Londres, E14 5HP, Royaume-Uni (numéro de téléphone +44 (0)20 7116 1000). L'identifiant d'entité juridique (LEI) de l'Émetteur est G5GSEF7VJP517OUK5573.

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

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

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

Identité des principaux directeurs généraux de l'Émetteur : Les principaux directeurs généraux de l'Émetteur sont James Staley (Président Directeur Général) et Tushar Morzarria (Directeur exécutif).

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

Quelles sont les informations financières clés concernant l'Émetteur ?

L'Émetteur a obtenu les informations financières consolidées et sélectionnées dans le tableau ci-dessous pour les exercices clos le 31 décembre 2020 et le 31 décembre 2019 à partir des États financiers consolidés annuels de l'Émetteur pour les exercices clos les 31 décembre 2020 et 2019 (les "**États financiers**"), qui ont chacun été approuvés sans réserve par KPMG.

Compte de résultat consolidé

	Au 31 décembre	
	2020	2019
	(£m)	
Revenus d'intérêts nets.....	3,160	3,907
Revenus nets des honoraires et commissions.....	5,659	5,672
Charges pour dépréciation de crédit.....	(3,377)	(1,202)
Revenus nets des opérations commerciales.....	7,076	4,073

Bénéfice avant impôt.....	3,075	3,112
Bénéfice/ (perte) après impôt.....	2,451	2,780

Bilan consolidé

Au 31 décembre

2020 2019

(£m)

Total des actifs.....	1,059,731	876,672
Titres de créance en circulation.....	29,423	33,536
Dettes subordonnées.....	32,005	33,425
Prêts et avances au coût amorti.....	134,267	141,636
Dépôts au coût amorti.....	244,696	213,881
Total Fonds propres.....	53,710	50,615

Certains ratios issus des États financiers

As at 31 décembre

2020 2019

(%)

Ratio de capital CET1.....	14.2	13.9
Total des capitaux réglementaires.....	21.0	22.1
Ratio de levier CRR.....	3.9	3.9

Quels sont les principaux risques spécifiques à l'Émetteur ?

Le Barclays Bank Group a identifié un large éventail de risques auxquels ses activités sont exposées. Les risques matériels sont ceux auxquels la direction supérieure accorde une attention particulière et qui pourraient forcer des différences indésirables au niveau de la stratégie, des résultats d'exploitation, la situation financière et/ou les perspectives du Barclays Bank Group, par rapport aux attentes. Les risques émergents incluent des composantes inconnues, dont l'impact pourrait se cristalliser sur une période prolongée. En outre, certains facteurs échappant au contrôle du Barclays Bank Group, notamment l'escalade du terrorisme ou les conflits mondiaux, les catastrophes naturelles, les épidémies et autres événements similaires, bien que non détaillés ci-dessous, pourraient avoir un impact similaire sur le Barclays Bank Group.

- Risques matériels existants et émergents pouvant avoir un impact potentiel sur plus d'un risque principal** : Outre les risques matériels et émergents ayant un impact sur les principaux risques exposés ci-dessous, des risques matériels existants et émergents peuvent aussi avoir un impact sur plus d'un de ces principaux risques. Ces risques sont : (i) l'impact de la pandémie du COVID-19 ; (ii) les conditions économiques et de marché mondiales et locales potentiellement défavorables, ainsi que les développements géopolitiques ; (iii) le processus de retrait du Royaume-Uni de l'UE ; (iv) l'impact des changements de taux d'intérêt sur la rentabilité du Barclays Bank Group ; (v) les environnements concurrentiels dans le secteur des services bancaires et financiers ; (vi) le programme de changement réglementaire et son impact sur le modèle commercial ; (vii) l'impact du changement climatique sur les activités du Barclays Bank Group ; et (viii) l'impact des réformes des taux d'intérêt de référence sur le Barclays Bank Group.
- Risques de crédit et de marché** : Le risque de crédit est un risque de perte pour le Barclays Bank Group résultant du défaut des clients privés et professionnels, ou des contreparties, à honorer pleinement leurs obligations envers les membres du Barclays Bank Group. Le Barclays Bank Group est exposé à des risques de variations de la qualité du crédit et des taux de recouvrement des prêts et des avances dus par les emprunteurs et les contreparties dans des portefeuilles spécifiques. Le risque de marché est un risque de perte résultant d'une évolution défavorable potentielle de la valeur des actifs et des passifs du Barclays Bank Group, résultant de fluctuation des variables du marché.
- Risque de trésorerie et de capital, et risque que l'Émetteur et le Barclays Bank Group soient soumis à d'importants pouvoirs de résolution** : Le Barclays Bank Group est confronté à trois principaux types de risque de trésorerie et de capital, à savoir (1) le risque de liquidité – le risque que le Barclays Bank Group ne soit pas en mesure de tenir ses obligations contractuelles ou éventuelles ou qu'il ne dispose pas du niveau approprié de financement stable et de liquidité pour soutenir ses actifs, pouvant également subir des changements de notation de crédit ; (2) le risque de capital – le risque que le Barclays Bank Group ait un niveau ou une composition de capital insuffisante ; et (3) le risque de taux d'intérêt dans le portefeuille bancaire – le risque que le Groupe Barclays Bank soit exposé à la volatilité du capital ou des revenus en raison d'une inadéquation entre les expositions aux taux d'intérêt de ses actifs (non négociés) et de ses passifs. En vertu de la loi bancaire (Banking Act), des pouvoirs substantiels sont accordés à la Banque d'Angleterre (ou, dans certaines circonstances, au Trésor de Sa Majesté [HM Treasury]), en consultation avec l'Autorité de régulation prudentielle [Prudential Regulation Authority] du Royaume-Uni, l'Autorité de conduite financière [Financial Conduct Authority] du Royaume-Uni et le Trésor de Sa Majesté, selon le cas, dans le cadre d'un régime spécial de résolution. Ces pouvoirs permettent à la Banque d'Angleterre (ou à tout successeur ou remplaçant de celle-ci et/ou à toute autre autorité du Royaume-Uni ("l'Autorité de résolution") ayant la capacité d'exercer la procédure de renflouement interne du Royaume-Uni (Bail-in Power) pour mettre en œuvre diverses mesures de résolution et options de stabilisation (y compris, mais sans s'y limiter, le "Bail-in Tool") à l'égard d'une banque ou d'une entreprise d'investissement du Royaume-Uni et de certaines de ses filiales (incluant actuellement l'Émetteur) dans des circonstances où l'Autorité de résolution est convaincue que les conditions de résolution pertinentes sont remplies.
- Risques opérationnel et de modèle** : Le risque opérationnel expose le Barclays Bank Group à des pertes résultant de processus ou de systèmes inadéquats ou défaillants, de facteurs humains ou d'événements externes (par exemple, la fraude), lorsque la cause profonde n'est pas liée à des

risques de crédit ou de marché. Le risque de modèle concerne des conséquences négatives potentielles liées à des évaluations financières ou des décisions fondées sur des résultats et des rapports de modèle incorrects ou mal utilisés.

- **Risques de conduite, de réputation et juridiques et questions juridiques, de concurrence et de réglementation** : Le risque de conduite est le risque de porter préjudice aux clients privés et professionnels, à l'intégrité du marché, à la concurrence effective ou au Barclays Bank Group par la prestation inappropriée de services financiers, y compris tout cas de faute intentionnelle ou de négligence. Le risque de réputation existe lorsqu'une action, une transaction, un investissement, un événement, une décision ou une relation d'affaires réduit la confiance dans l'intégrité et la compétence du Barclays Bank Group. Le Barclays Bank Group exerce ses activités sur un marché très réglementé qui l'expose, ainsi que ses employés, à des risques juridiques découlant (i) de la multitude des lois et règlements applicables aux entreprises qu'il opère, qui sont extrêmement dynamiques, pouvant varier d'une juridiction à l'autre, manquant souvent de clarté pour les appliquer dans des circonstances particulières, notamment dans des domaines nouveaux et émergents ; et (ii) de la nature diversifiée et évolutive des activités et des pratiques commerciales du Barclays Bank Group. Dans chaque cas, cela expose le Barclays Bank Group et ses employés à des risques de pertes ou à des pénalités, des dommages et intérêts ou des amendes pour non-respect des obligations légales respectives, y compris les exigences légales ou contractuelles, des membres du Barclays Bank Group. Le risque juridique peut être lié à un certain nombre de risques importants, existants ou émergents, résumés ci-dessus.

INFORMATIONS CLÉS SUR LES TITRES

Quelles sont les principales caractéristiques des Titres ?

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

Les Titres se présenteront sous la forme de Notes et seront identifiés de manière unique par le : Numéro de série : NX000284178 ; le Numéro de tranche : 1 ; ISIN : FR0014003011 ; le Code commun : 233289949.

Les Titres seront compensés et réglés par Euroclear Bank S.A./N.V. or Clearstream Banking *société anonyme*.

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

Les Titres seront émis en euros (EUR) (la « **de vise d'émission** ») et réglés dans la même devise (la « **de vise de règlement** »). Les Titres sont négociables en valeur nominale et la valeur nominale spécifiée par titre est de 1 000 euros. Le montant du calcul est de 1 000 euros par titre (le « **montant du calcul** »). La taille de l'émission peut atteindre 30 000 000 d'euros. Le prix d'émission est de 100 % de la dénomination spécifiée.

La date d'émission est le 31 mai 2021 (la « **date d'émission** »). Sous réserve d'une résiliation anticipée, le remboursement des Titres est prévu le 2 juin 2031 (la « **date de règlement prévue** »).

Droits attachés aux Titres

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

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

Les cas de défaillance : Si l'Émetteur n'effectue pas un paiement dû en vertu des Titres ou viole toute autre condition des Titres d'une manière qui porte préjudice aux intérêts des détenteurs (et s'il n'est pas remédié à ce manquement dans les 30 jours ou, dans le cas des intérêts, dans les 14 jours), ou si l'Émetteur fait l'objet d'une ordonnance de liquidation, alors (sous réserve, dans le cas des intérêts, de l'impossibilité pour l'Émetteur de payer en vertu d'une disposition légale impérative) les Titres deviendront immédiatement dus et payables, sur avis donné au détenteurs.

Limitations des droits

Remboursement anticipé suite à certains événements perturbateurs ou pour cause d'illégalité ou d'impossibilité pratique : L'Émetteur peut racheter les Titres avant leur Date de Règlement Prévue à la suite de la survenance de certains événements perturbateurs ou extraordinaires concernant l'Émetteur, ses dispositifs de couverture l'Actif Sous-jacent, la fiscalité ou la devise concernée des Titres, ou s'il détermine que l'exécution de l'une de ses obligations en vertu des Titres est illégale ou physiquement impossible. Dans ce cas, les investisseurs recevront un « Montant de Règlement Anticipé en Espèces » égal à la juste valeur marchande des Titres avant leur rachat.

Certaines limitations supplémentaires :

- Bien que les titres soient liés à la performance de l'Actif sous-jacent, les détenteurs n'ont aucun droit sur ce dernier.
- Les conditions des Titres permettent à l'Émetteur et à l'Agent de détermination (selon le cas), à la survenance de certains événements et dans certaines circonstances, sans le consentement des détenteurs, d'apporter des ajustements aux conditions des Titres, de racheter les Titres avant l'échéance, pour monétiser les Titres (le cas échéant) pour reporter l'évaluation l'Actif sous-jacent ou les paiements prévus en vertu des Titres, pour changer la devise dans laquelle les Titres sont libellés, pour remplacer l'Actif sous-jacent, pour remplacer l'Émetteur par une autre entité autorisée sous certaines conditions, et pour prendre certaines autres mesures concernant les Titres et l'Actif sous-jacent.

- Les Titres contiennent des dispositions relatives à la convocation d'assemblées de détenteurs pour examiner des questions affectant leurs intérêts en général et ces dispositions permettent à des majorités définies de lier tous les détenteurs, y compris les détenteurs qui n'ont pas assisté et voté à l'assemblée concernée et les détenteurs qui ont voté d'une manière contraire à la majorité.

Droit applicable

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

Description du calcul du rendement potentiel des Titres

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

Actif sous-jacent	Type	Prix initial	Date d'évaluation initiale
S&P Europe 50 ESG Select Equal Weight (BEL, DEU, FRA, NLD) Décrément de 50 points (Séries 2) (EUR) TR (Code Bloomberg : SPCEEDET <Indice>	Indice des actions	Le cours de clôture de l'actif sous-jacent à la date d'évaluation initiale	28 mai 2021

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

Montants Indicatifs : Si les Titres sont offerts au moyen d'une Offre Publique et qu'aucune valeur spécifiée du produit n'est fixée ou déterminée au début de l'Offre Publique (incluant un quelconque montant, niveau, pourcentage, prix, taux ou autre valeur en relation avec les termes des Titres qui n'a pas été fixé ou déterminé au début de l'Offre Publique), ces valeurs spécifiées du produit détermineront un montant indicatif, un montant indicatif minimum, un montant indicatif maximum ou un montant indicatif ou toute autre combinaison de ceux-ci. Dans un tel cas, la (les) valeur(s) spécifiée(s) du produit sera (seront) la valeur déterminée par l'Émetteur sur base des conditions du marché au moment de ou autour de la fin de l'Offre Publique. Un avis sur la valeur spécifiée du produit pertinente sera publié avant la Date d'Émission.

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

A – Intérêts

Chaque valeur mobilière ne paiera des intérêts à une date de paiement des intérêts que si le cours de clôture ou le niveau de l'Actif sous-jacent à la date de valorisation des intérêts correspondante est supérieur ou égal à sa barrière d'intérêts correspondante. Dans ce cas, le montant des intérêts à payer est calculé comme suit :

- (1) en multipliant le taux fixe de 1,5375 % par le montant du calcul ; et ensuite
- (2) en multipliant le résultat par le nombre correspondant à cette date de valorisation des intérêts (soit le nombre dans la colonne "T" dans le tableau ci-dessous).

Chaque date de paiement des intérêts, la date de valorisation des intérêts correspondante, T et la barrière d'intérêt sont les suivants :

T	Date de valorisation des intérêts	Date de paiement des intérêts	Barrière d'intérêts
4	24 mai 2022	31 mai 2022	100% du prix initial
5	24 août 2022	31 août 2022	100% du prix initial
6	24 novembre 2022	1 décembre 2022	100% du prix initial
7	24 février 2023	3 mars 2023	100% du prix initial
8	24 mai 2023	31 mai 2023	100% du prix initial
9	24 août 2023	31 août 2023	100% du prix initial
10	24 novembre 2023	1 décembre 2023	100% du prix initial
11	26 février 2024	4 mars 2024	100% du prix initial
12	24 mai 2024	31 mai 2024	100% du prix initial
13	26 août 2024	2 septembre 2024	100% du prix initial
14	25 novembre 2024	2 décembre 2024	100% du prix initial
15	24 février 2025	3 mai 2025	100% du prix initial
16	26 mai 2025	2 juin 2025	100% du prix initial
17	25 août 2025	1 septembre 2025	100% du prix initial
18	24 novembre 2025	1 décembre 2025	100% du prix initial
19	24 février 2026	3 mars 2026	100% du prix initial
24	24 mai 2027	31 mai 2027	100% du prix initial
25	24 août 2027	31 août 2027	100% du prix initial
26	24 novembre 2027	1 décembre 2027	100% du prix initial
27	24 février 2028	2 mars 2028	100% du prix initial
28	24 mai 2028	31 mai 2028	100% du prix initial
29	24 août 2028	31 août 2028	100% du prix initial
30	24 novembre 2028	1 décembre 2028	100% du prix initial
31	26 février 2029	5 mars 2029	100% du prix initial
32	24 mai 2029	31 mai 2029	100% du prix initial
33	24 août 2029	31 août 2029	100% du prix initial
34	26 novembre 2029	3 décembre 2029	100% du prix initial
35	25 février 2030	4 mars 2030	100% du prix initial
36	24 mai 2030	31 mai 2030	100% du prix initial
37	26 août 2030	2 septembre 2030	100% du prix initial
38	25 novembre 2030	2 décembre 2030	100% du prix initial
39	24 février 2031	3 mars 2031	100% du prix initial

20	25 mai 2026	1 juin 2026	100% du prix initial	40	Date de valorisation finale	Date de remboursement	70% du prix initial
----	-------------	-------------	----------------------	----	-----------------------------	-----------------------	---------------------

B – Règlement automatique (Autocall)

Les Titres seront automatiquement remboursés si la performance Autocall est égale ou supérieure au pourcentage de la barrière Autocall correspondant à toute date d'évaluation d'Autocall. Dans ce cas, vous recevrez un montant de règlement en espèces Autocall égal au Montant du calcul multiplié par 100 % payable à la date de règlement Autocall correspondant à la date de valorisation Autocall. La date de règlement Autocall pertinente peut être reportée lorsque la date de valorisation Autocall a été reportée après un événement perturbateur.

Date de valorisation Autocall	Pourcentage de la barrière Autocall	Pourcentage du règlement Autocall	Date de règlement Autocall
24 mai 2022	100%	100%	31 mai 2022
24 août 2022	100%	100%	31 août 2022
24 novembre 2022	100%	100%	1 décembre 2022
24 février 2023	100%	100%	3 mars 2023
24 mai 2023	100%	100%	31 mai 2023
24 août 2023	100%	100%	31 août 2023
24 novembre 2023	100%	100%	1 décembre 2023
26 février 2024	100%	100%	4 mars 2024
24 mai 2024	100%	100%	31 mai 2024
26 août 2024	100%	100%	2 septembre 2024
25 novembre 2024	100%	100%	2 décembre 2024
24 février 2025	100%	100%	3 mai 2025
26 mai 2025	100%	100%	2 juin 2025
25 août 2025	100%	100%	1 septembre 2025
24 novembre 2025	100%	100%	1 décembre 2025
24 février 2026	100%	100%	3 mars 2026
25 mai 2026	100%	100%	1 juin 2026
24 août 2026	100%	100%	31 août 2026
24 novembre 2026	100%	100%	1 décembre 2026
24 février 2027	100%	100%	3 mars 2027
24 mai 2027	100%	100%	31 mai 2027

Date de valorisation Autocall	Pourcentage de la barrière Autocall	Pourcentage du règlement Autocall	Date de règlement Autocall
24 novembre 2027	100%	100%	1 décembre 2027
24 février 2028	100%	100%	2 mars 2028
24 mai 2028	100%	100%	31 mai 2028
24 août 2028	100%	100%	31 août 2028
24 novembre 2028	100%	100%	1 décembre 2028
26 février 2029	100%	100%	5 mars 2029
24 mai 2029	100%	100%	31 mai 2029
24 août 2029	100%	100%	31 août 2029
26 novembre 2029	100%	100%	3 décembre 2029
25 février 2030	100%	100%	4 mars 2030
24 mai 2030	100%	100%	31 mai 2030
26 août 2030	100%	100%	2 septembre 2030
25 novembre 2030	100%	100%	2 décembre 2030
24 février 2031	100%	100%	3 mars 2031
24 mai 2027	100%	100%	31 mai 2027
24 août 2027	100%	100%	31 août 2027
24 novembre 2027	100%	100%	1 décembre 2027
24 février 2028	100%	100%	2 mars 2028
24 mai 2028	100%	100%	31 mai 2028
24 août 2028	100%	100%	31 août 2028
24 novembre 2028	100%	100%	1 décembre 2028

C – Règlement final

Si les titres n'ont pas été remboursés autrement, chaque titre sera remboursé à la date de règlement prévue par le paiement du montant final de règlement en espèces. La date de règlement prévue peut être reportée à la suite du report de la date d'évaluation finale en raison d'un événement perturbateur.

Le montant final du règlement en espèces est calculé comme suit :

- (i) Si la performance finale est supérieure ou égale au pourcentage de la barrière à l'entrée (soit 55 %), 100 % multiplié par le montant du calcul ;
- (ii) Sinon, un montant calculé en divisant la performance finale par le pourcentage du prix d'exercice (soit 100 %) et en multipliant le résultat par le montant du calcul.

« **Performance finale** » signifie le prix d'évaluation final divisé par le prix initial.

« **Date d'évaluation finale** » 26 mai 2031

« **Prix d'évaluation final** » signifie, en ce qui concerne l'actif sous-jacent, le cours de clôture de l'actif sous-jacent à la date d'évaluation finale.

Statut des titres

Les titres sont des obligations directes, non subordonnées et non garanties de l'émetteur et ont un rang égal entre eux.

Description des restrictions à la libre transférabilité des titres

Les titres sont offerts et vendus en dehors des États-Unis à des personnes non américaines sur la base du règlement S de la loi sur les titres et doivent respecter les restrictions de transfert en ce qui concerne les États-Unis. Les titres détenus dans un système de compensation seront transférés conformément aux règles, procédures et règlements de ce système de compensation. Sous réserve de ce qui précède, les titres seront librement transférables.

Où les titres seront-ils négociés ?

Il est prévu que la demande soit faite par l'émetteur (ou en son nom) pour que les titres soient admis à la négociation sur le marché réglementé de la Bourse de Luxembourg.

Quels sont les principaux risques spécifiques aux titres ?

Les titres sont soumis aux principaux risques suivants :

- Vous pouvez perdre une partie ou la totalité de votre investissement dans les titres : Les conditions de vos titres ne prévoient pas de paiement minimum attendu à l'échéance et, de ce fait, selon la performance de l'actif sous-jacent, vous pouvez perdre une partie ou la totalité de votre investissement. Vous pouvez également perdre une partie ou la totalité de votre investissement si : (a) vous vendez vos titres avant leur échéance ou leur expiration prévue ; (b) vos titres sont remboursés par anticipation dans certaines circonstances extraordinaires ; ou (c) les conditions de vos titres sont ajustées de telle sorte que le montant payable ou le bien qui vous est livré est inférieur à votre investissement initial.
- Il existe des risques liés à l'évaluation, à la liquidité et à l'offre des titres : La valeur marchande de vos titres peut être inférieure au prix d'émission, car le prix d'émission peut tenir compte de la marge bénéficiaire et des coûts de l'émetteur et / ou du distributeur, en plus de la juste valeur marchande des titres. La valeur marchande de vos titres peut être affectée par la volatilité ou le niveau de l'actif sous-jacent au moment considéré, les variations des taux d'intérêt, la situation financière et les notations de crédit de l'émetteur, l'offre et la demande de titres, le temps restant avant l'échéance ou l'expiration des titres et d'autres facteurs. Le prix auquel vous pourrez, le cas échéant, vendre vos titres avant l'échéance peut être sensiblement inférieur au montant que vous avez investi à l'origine. Vos titres peuvent ne pas avoir un marché de négociation actif et l'émetteur ne peut être tenu de créer une négociation ou de racheter les titres avant leur rachat. L'émetteur peut retirer l'offre publique à tout moment. Dans ce cas, si vous avez déjà payé ou livré des fonds de souscription pour les titres concernés, vous aurez droit au remboursement de ces montants, mais vous ne recevrez aucune rémunération qui aurait pu être accumulée dans la période entre le paiement ou la livraison des fonds de souscription et le remboursement des titres.
- **Vous êtes soumis aux risques liés à la détermination du montant payable au titre des titres :**
Les titres portent intérêt à un taux qui dépend de la performance des actifs sous-jacents et qui peut varier d'une date de paiement des intérêts à l'autre. Il est possible que vous ne receviez aucun paiement d'intérêts si l'actif sous-jacent ne se comporte pas comme prévu.
Le montant des intérêts est conditionné à la performance des actifs sous-jacents et peut être nul si les critères de performance ne sont pas satisfaits. Dans ce cas, le montant des intérêts peut être reporté au prochain paiement d'intérêts qui peut être effectué, mais vous ne recevrez aucun montant pour compenser ce report et il est possible que vous ne receviez aucun intérêt pendant toute la durée de vie des titres.
Le montant final de règlement en espèces est basé sur la performance de l'actif sous-jacent à la date d'évaluation finale uniquement (plutôt que sur plusieurs périodes tout au long de la durée des titres). Cela signifie que vous ne pouvez bénéficier d'aucun mouvement du niveau de l'actif sous-jacent pendant la durée des titres qui ne soit pas maintenu dans la performance finale à la date d'évaluation finale.
Comme le montant final du règlement en espèces est soumis à un plafond, la valeur ou le rendement de vos titres peut être nettement inférieur à ce qu'il aurait été si vous aviez acheté directement le ou les actifs sous-jacents.
Le calcul du montant à payer dépend du niveau, de la valeur ou du montant des actifs sous-jacents qui atteignent ou franchissent une « barrière » pendant une période déterminée ou à des dates déterminées pendant la durée des titres. Cela signifie que vous pouvez recevoir moins (ou, dans certains cas, plus) si le niveau, la valeur ou le cours du ou des actifs sous-jacents franchit ou atteint (selon le cas) une barrière, que s'il s'approche de la barrière mais ne l'atteint pas ou ne la franchit pas (selon le cas), et dans certains cas, vous pouvez ne recevoir aucun paiement d'intérêt ou de coupon et / ou perdre tout ou partie de votre investissement.
- **Vos titres sont soumis à des ajustements et à un remboursement anticipé :** Conformément aux conditions générales des titres, à la suite de la survenance de certains événements perturbateurs ou extraordinaires concernant l'émetteur, ses dispositifs de couverture, l'actif sous-jacent, la fiscalité ou la devise concernée des titres, l'agent de détermination ou l'émetteur peut prendre un certain nombre de mesures correctives, notamment estimer le niveau de l'actif sous-jacent, remplacer l'actif sous-jacent et apporter des ajustements aux termes et conditions des titres. Chacune de ces mesures correctives peut modifier les caractéristiques économiques des titres et avoir un effet négatif important sur la valeur et le rendement des titres. Si aucune mesure corrective ne peut être prise, ou s'il est déterminé que l'exécution de l'une des obligations de l'émetteur au titre des titres est illégale ou matériellement impossible, l'émetteur peut procéder au remboursement anticipé des titres par le paiement d'un montant de règlement anticipé en espèces. En cas de remboursement anticipé, vous pouvez perdre une partie ou la totalité de votre investissement car le montant du remboursement anticipé en espèces peut être inférieur au niveau auquel vous avez acheté les titres, ou peut même être nul. Vous perdrez également la possibilité de participer à toute performance positive ultérieure de l'actif sous-jacent et serez incapable de réaliser des gains potentiels dans la valeur des titres. Il se peut que vous ne puissiez pas réinvestir le produit d'un investissement à un rendement comparable et / ou avec un taux d'intérêt ou un coupon comparable pour un niveau de risque similaire.

Les risques liés à l'actif sous-jacent que sont les indices d'actions : Les indices d'actions sont composés d'un portefeuille synthétique d'actions et offrent des possibilités de diversification des investissements, mais sont soumis au risque de fluctuations des prix des actions ainsi que de la valeur et de la volatilité de l'indice d'actions concerné. Les titres sont liés à des indices d'actions et, en tant que tels, ne peuvent pas participer aux dividendes ou à toute autre distribution versée sur les actions qui composent ces indices. En conséquence, vous pouvez recevoir un rendement inférieur à celui que vous auriez reçu si vous aviez investi directement dans ces actions. Le promoteur de l'indice peut ajouter, supprimer ou remplacer les composantes d'un indice d'actions à sa discrétion, et peut également modifier la méthodologie utilisée pour calculer le niveau de cet indice. Ces événements peuvent avoir un impact préjudiciable sur le niveau de cet indice, qui à son tour pourrait avoir un impact négatif sur [le niveau de l'indice Barclays et par conséquent la valeur et le rendement des titres.

INFORMATIONS CLES SUR L'OFFRE DES TITRES AU PUBLIC ET / OU L'ADMISSION A LA NEGOCIATION SUR UN MARCHÉ RÉGLEMENTÉ

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

Modalités de l'offre

Les termes et conditions de toute offre de titres au public peuvent être déterminés par un accord entre l'émetteur et l'offrant autorisé au moment de chaque émission.

Les titres sont offerts à la souscription en France pendant la période du (et y compris) 21 avril 2021 au (mais à l'exclusion du) 28 mai 2021 (la « Période de l'offre ») et cette offre est soumise aux conditions suivantes :

- Offre de prix : Le prix d'émission
- Conditions auxquelles l'offre est soumise : L'émetteur se réserve le droit de retirer l'offre de titres à tout moment avant la fin de la période d'offre. Après le retrait de l'offre, si une demande a été faite par un investisseur potentiel, chacun de ces investisseurs potentiels n'aura pas le droit de souscrire ou d'acquérir autrement les titres et toute demande sera automatiquement annulée et tout montant d'achat sera remboursé au demandeur par l'Offrant Autorisé conformément aux procédures habituelles de l'Offrant Autorisé.
- Description de la procédure de candidature : Une offre des titres autre que celle prévue à l'article 1(4) de la directive de l'UE sur les prospectus peut être faite par le gestionnaire ou l'offrant autorisé en Suède (la « juridiction compétente en matière d'offre publique ») pendant la période d'offre.
- Détails du montant minimum et / ou maximum de la demande : Le montant minimum et maximum de la demande de l'Offrant Autorisé sera notifié aux investisseurs par l'Offrant Autorisé.
- Description de la possibilité de réduire les abonnements et des modalités de remboursement du montant excédentaire payé par les demandeurs : R.A.S.
- Détails du mode et des délais de libération et de livraison des titres : Les investisseurs seront informés par l'Offrant Autorisé de leurs attributions de Titres et des modalités de règlement y afférentes.
- Manière et date auxquelles les résultats de l'offre doivent être rendus publics : Les investisseurs seront informés par l'Offrant Autorisé de leurs attributions de Titres et des modalités de règlement y afférentes.
- Procédure d'exercice de tout droit de préemption, négociabilité des droits de souscription et traitement des droits de souscription non exercés : R.A.S.
- Les catégories de détenteurs auxquelles les titres sont offerts et si la ou les tranches ont été réservées pour certains pays : Les offres peuvent être faites par l'intermédiaire de l'offrant autorisé dans la juridiction de l'offre publique à toute personne. Les offres (le cas échéant) dans d'autres pays de l'EEE ne seront faites que par l'intermédiaire de l'Offrant Autorisé en vertu d'une exemption de l'obligation de publier un prospectus prévue par la Directive Prospectus telle que mise en œuvre dans ces pays
- Processus de notification aux demandeurs du montant alloué et indication si la négociation peut commencer avant que la notification ne soit faite : Les demandeurs seront informés directement par l'offrant autorisé du succès de leur demande. Aucune transaction sur les titres ne peut avoir lieu avant la date d'émission.
- Nom(s) et adresse(s), dans la mesure où ils sont connus de l'émetteur, des placeurs dans les différents pays où l'offre a lieu : UBS (France) SA avec son adresse au 69 BD Haussmann, 75008 Paris, France (numéro de téléphone : +33 1 44 56 45 45) et son LEI est 9695007NQ9E3N5VPW317.

Estimation des frais totaux de l'émission et / ou de l'offre, y compris les frais imputés à l'investisseur par l'émetteur / l'offrant

- Les frais totaux de l'émission et / ou de l'offre sont estimés à 3 000 euros.

Qui est l'offrant et / ou la personne qui demande l'admission à la négociation ?

Voir le point intitulé « Le(s) offrant(s) autorisé(s) », ci-dessus.

Pourquoi le Prospectus est-il produit ?

Utilisation et montant net estimé des recettes

Le produit net de chaque émission de titres sera affecté par l'émetteur à ses objectifs généraux, qui comprennent la réalisation d'un bénéfice et / ou la couverture de certains risques.

Accord de souscription sur une base d'engagement ferme

L'offre des titres n'est pas soumise à un contrat de prise ferme sur une base d'engagement ferme.

Description de tout intérêt important pour l'émission / l'offre, y compris les intérêts conflictuels

L'Offrant Autorisé peut recevoir des honoraires en relation avec l'offre de titres. Des conflits d'intérêts potentiels peuvent exister entre l'émetteur, l'agent de détermination, l'offreur autorisé ou leurs affiliés (qui peuvent avoir des intérêts dans des transactions sur des produits dérivés liés à l'actif sous-jacent qui peuvent, mais ne sont pas destinés à, affecter négativement le prix du marché, la liquidité ou la valeur des titres) et les détenteurs.

L'offrant autorisé recevra une commission globale ne dépassant pas 0,575%. Tout Offrant Autorisé et ses affiliés peuvent s'engager, et peuvent s'engager à l'avenir, dans des opérations de couverture concernant l'actif sous-jacent.