

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 40,000,000¹ Securities due March 2031 under the Global Structured Securities Programme
(the Tranche 1 Securities)
Issue Price: 100 per cent**

This document constitutes the amended and restated final terms of the Securities (the "**Final Terms**" or the "**Amended and Restated Final Terms**") described herein for the purposes of Article 8 of 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 24 March 2020 as supplemented on 8 May 2020 and 5 August 2020, 23 December 2020 and 29 January 2021 and the Securities Note relating to the GSSP Base Prospectus 9 dated 17 July 2020 as supplemented) for the purposes of Article 8(6) of the 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/fixed-income-investors/prospectus-and-documents/structured-securities-prospectuses/> and during normal business hours at the registered office of the Issuer and the specified office of the Issue and Paying Agent for the time being in London, and copies may be obtained from such office.

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

BARCLAYS

Amended and Restated Final Terms dated 12 March 2021

(replacing the original Final Terms dated 1 February 2021)

¹ Amended by the Amended and Restated Final Terms dated 12 March 2021.

PART A – CONTRACTUAL TERMS

Provisions relating to the Securities

1. (a) Series: NX000272084
(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 40,000,000²
 - (ii) Series: Up to EUR 40,000,000³
 - (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 4.00% of the Issue Price.
8. Issue Date: 12 March 2021
9. Scheduled Settlement Date: 12 March 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: Digital (Bullish with dual barrier)

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.

² Amended by the Amended and Restated Final Terms dated 12 March 2021.

³ Amended by the Amended and Restated Final Terms dated 12 March 2021.

- (b) Interest Valuation Dates: Each of the dates set out in Table 1 below in the column entitled 'Interest Valuation Date'.

Table 1

Interest Valuation Date	Interest Payment Date
7 March 2022	14 March 2022
6 March 2023	13 March 2023
5 March 2024	12 March 2024
5 March 2025	12 March 2025
5 March 2026	12 March 2026
5 March 2027	12 March 2027
6 March 2028	13 March 2028
5 March 2029	12 March 2029
5 March 2030	12 March 2030
5 March 2031	12 March 2031

- (c) (i) Fixed Interest Type: Fixed Amount
- (ii) Fixed Interest Rate(1): 4.60 per cent.
- (iii) Fixed Interest Rate(2): 9.20 per cent.
- (d) Interest Barrier Percentage(1): 60.00 per cent.
- (e) Interest Barrier Percentage(2): 100.00 per cent.
- (f) Interest Valuation Price: The Valuation Price on the Interest Valuation Date as determined by the Determination Agent
- (i) Averaging-out: Not Applicable
- (ii) Min Lookback-out: Not Applicable
- (iii) Max Lookback-out: Not Applicable
- (g) Global Floor: Zero

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: 100.00 per cent.
- (c) Autocall Settlement Percentage: 100.00 per cent.

- (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'.
- (f) Autocall Valuation Price: The Valuation Price on the relevant Autocall Valuation Date.
- (i) Averaging-out: Not Applicable
- (ii) Min Lookback-out: Not Applicable
- (iii) Max Lookback-out: Not Applicable

Table 2

Autocall Valuation Date	Autocall Settlement Date
7 March 2022	14 March 2022
6 March 2023	13 March 2023
5 March 2024	12 March 2024
5 March 2025	12 March 2025
5 March 2026	12 March 2026
5 March 2027	12 March 2027
6 March 2028	13 March 2028
5 March 2029	12 March 2029
5 March 2030	12 March 2030

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

Provisions relating to Final Settlement

17. (a) Final Settlement Type: General Capped
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: 60.00 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: 5 March 2021
 - (b) Index: EURO STOXX BANKS® INDEX
 - (i) Exchange: Multi-exchange
 - (ii) Related Exchange: All Exchanges
 - (iii) Underlying Asset Currency: EUR
 - (iv) Bloomberg Screen: SX7E <Index>
 - (v) Refinitiv Screen: .SX7E
 - (vi) Index Sponsor: STOXX LTD.
 - (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: 5 March 2031

Provisions relating to disruption events

23. Consequences of a Disrupted Day (in respect of an Averaging Date or Lookback Date):
General Condition 18 (*Consequences of Disrupted Days*)
- (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 (*Adjustments to Valuation Dates and Reference Date*)
- (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 (*Consequences upon a Reference Date becoming a Disrupted Day*)
- (a) Omission: Not Applicable
 - (b) Postponement: Not Applicable
 - (c) Modified Postponement: Not Applicable
26. Additional Disruption Events: General Condition 34 (*Adjustment, early redemption or early cancellation following an Additional Disruption Event*)
- (a) Change in Law: Applicable as per General Condition 65.1 (*Definitions*)
 - (b) Currency Disruption Event: Applicable as per General Condition 65.1 (*Definitions*)
 - (c) Hedging Disruption: Not Applicable
 - (d) Issuer Tax Event: Applicable as per General Condition 65.1 (*Definitions*)
 - (e) Extraordinary Market Disruption: Applicable as per General Condition 65.1 (*Definitions*)
 - (f) Increased Cost of Hedging: Not Applicable as per General Condition 65.1 (*Definitions*)
 - (g) Affected Jurisdiction Hedging Disruption: Not Applicable as per General Condition 65.1 (*Definitions*)
 - (h) Affected Jurisdiction Increased Cost of Hedging: Not Applicable as per General Condition 65.1 (*Definitions*)

(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
<i>General provisions</i>	
37. Form of Securities:	Global Bearer Securities: Permanent Global Security TEFRA: Not Applicable NGN Form: Applicable Held under the NSS: Not Applicable CGN Form: Not Applicable CDIs: Not Applicable
38. Trade Date:	15 January 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.		Additional Business Centre(s):	Not Applicable
42.		Business Day Convention:	Following
43.		Determination Agent:	Barclays Bank PLC
44.		Registrar:	Not Applicable
45.		CREST Agent:	Not Applicable
46.		Transfer Agent:	Not Applicable
47.	(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
48.		Registration Agent:	Not Applicable
49.		Governing Law:	English law
50.		Relevant Benchmark:	Not Applicable

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 3,000 |
| (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: SX7E <Index>

Index Disclaimer: as set out in the Schedule hereto

6. OPERATIONAL INFORMATION

- | | |
|---|---|
| (a) ISIN: | XS2234147705 |
| (b) Common Code: | 223414770 |
| (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: | Yes. Note that the designation “yes” simply means that the Notes are intended upon issue to be deposited with one of the International Central Securities Depositories (“ICSDs”) as common safekeeper and does not necessarily mean that the Notes will be recognized as eligible collateral for Eurosystem monetary policy and intra day credit operations by Eurosystem either upon issue or at any or all times 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 Notes may be made, subject to the conditions set out below by the Authorised Offeror(s) (specified in (b) immediately below) other than pursuant to Article 3(2) of the 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)"): | <p>Each financial intermediary specified in (i) and (ii) below:</p> <p>(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/structured-securities-final-terms); and</p> <p>(ii) General consent: Not Applicable</p> |
| (c) Jurisdiction(s) where the offer may take place (together, the "Public Offer Jurisdictions(s)"): | France |
| (d) Offer period for which use of the Base Prospectus is authorised by the Authorised Offeror(s) (the "Offer Period"): | From and including 1 February 2021 to but excluding 5 March 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 40,000,000 ⁴ |
| (c) Conditions to which the offer is subject: | <p>The Issuer reserves the right to withdraw the offer for Securities at any time prior to the end of the Offer Period.</p> <p>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.</p> |
| (d) Time period, including any possible amendments, during which the offer will be open and description of the application process: | From and including 1 February 2021 to but excluding 5 March 2021. |

⁴ Amended by the Amended and Restated Final Terms dated 12 March 2021.

(e) Description of the application process:	<p>An offer of the Securities may be made by the Manager or the Authorised Offeror other than pursuant to Article 3(2) of the Prospectus Directive in the France (the “Public Offer Jurisdiction”) during the Offer Period.</p> <p>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.</p>
(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 Haussmann, 75008 Paris, France (telephone number: +33 1 44 56 45 45) and its LEI is 9695007NQ9E3N5VPW317.

Schedule

Index Disclaimer:

EURO STOXX Banks® (the "Index")

The Index is the intellectual property (including registered trademarks) of STOXX Limited, Zurich, Switzerland and/or its licensors (the "Licensors") which is used under license from STOXX. The Securities based on the Index are in no way sponsored, endorsed, sold or promoted by the Licensors and neither of the Licensors shall have any liability with respect thereto.

SUMMARY

INTRODUCTION AND WARNINGS

The Summary should be read as an introduction to the Prospectus. Any decision to invest in the Securities should be based on consideration of the Prospectus as a whole by the investor. In certain circumstances, the investor could lose all or part of the invested capital. Where a claim relating to the information contained in the Prospectus is brought before a court, the plaintiff investor might, under the national law, have to bear

the costs of translating the Prospectus before the legal proceedings are initiated. Civil liability attaches only to those persons who have tabled the Summary, including any translation thereof, but only where the Summary is misleading, inaccurate or inconsistent when read together with the other parts of the Prospectus or it does not provide, when read together with the other parts of the Prospectus, key information in order to aid investors when considering whether to invest in the Securities.

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

Securities: Up to EUR 40,000,000⁵ Securities due March 2031 pursuant to the Global Structured Securities Programme pursuant to the Global Structured Securities Programme)] (ISIN: XS2234147705) (the "**Securities**").

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

The Authorised Offeror: The Authorised Offeror is UBS (France) SA with its address at 69 Boulevard Haussmann Paris, 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: 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. The Legal Entity Identifier (LEI) of the Issuer is G5GSEF7VJP5I7OUK5573.

Principal activities of the Issuer: The Group's businesses include consumer banking and payments operations around the world, as well as a top-tier, full service, global consumer 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?

⁵ Amended by the Amended and Restated Final Terms dated 12 March 2021.

The Issuer has derived the selected consolidated financial information included in the table below for the years ended 31 December 2019 and 31 December 2018 from the annual consolidated financial statements of the Issuer for the years ended 31 December 2019 and 2018 (the "**Financial Statements**"), which have each been audited without qualification by KPMG. The selected financial information included in the table below for the six months ended 30 June 2020 and 30 June 2019 was derived from the unaudited Interim Report and Condensed Financial Statements of the Issuer in respect of the six months ended 30 June 2020.

Income Statement

	As at 30 June (unaudited)		As at 31 December	
	2020	2019	2019	2018
	(£m)			
Net interest income	1,671	1,821	3,907	3,130
Net fee and commission income	2,879	2,829	5,672	5,607
Credit impairment charges	(2,674)	(510)	(1,202)	(643)
Net trading income	4,225	2,093	4,073	4,364
Profit/(loss) before tax	1,523	1,725	3,112	1,286
Profit/(loss) after tax	1,293	1,465	2,780	1,010

Balance Sheet

	As at 30 June 2020 (unaudited)	As at 31 December	
		2019	2018
	(£m)		
Total assets	1,095,958	876,672	877,700
Debt securities in issue	50,496	33,536	39,063
Subordinated liabilities	36,965	33,425	35,327
Loans and advances at amortised costs	150,203	141,636	136,959
Deposits at amortised costs	245,737	213,881	199,337
Total equity	56,694	50,615	47,711
Non-controlling interests	0	0	2

Certain Ratios from the Financial Statements

	As at 30 June 2020 (unaudited)	As at 31 December	
		2019	2018
	(%)		
Common Equity Tier 1 capital	14.3	13.9	13.5
Total regulatory capital	21.0	22.1	22.2
CRR leverage ratio	4.74.1	3.9	4.0

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

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, epidemic outbreaks and similar events, although not detailed below, could have a similar impact on the Barclays Bank Group.

- Material existing and emerging risks potentially impacting more than one principal risk:** In addition to material and emerging risks impacting the principal risks set out below, there are also material existing and emerging risks that potentially impact more than one of these principal risks. These risks are: (i) potentially unfavourable global and local economic and market conditions, as well as geopolitical developments; (ii) the impact of COVID-19; (iii) the process of UK 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.
- **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.
- 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, 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 (currently including the Issuer) in circumstances in which the Resolution Authority is satisfied that the relevant resolution conditions are met.

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 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 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 a number of the risk factors 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: NX000272084; Tranche number: 1; ISIN: XS2234147705; Common Code: 223414770.

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

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

The Securities will be issued in Euro ("EUR") (the "Issue Currency") and settled in the same currency (the "Settlement Currency"). The Securities are tradable in nominal and the specified denomination per Security is EUR 1,000. The issue size is up to EUR 40,000,000⁶. The issue price is 100.00% of the Specified Denomination.

⁶ Amended by the Amended and Restated Final Terms dated 12 March 2021.

The issue date is 12 March 2021 (the "**Issue Date**"). Subject to early termination, the Securities are scheduled to redeem on 12 March 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, (ii) an Autocall Cash Settlement Amount, and/or (iii) a Final Cash Settlement Amount, provided that if the Securities are early terminated, the potential return may be in the form of (i) an Early Cash Settlement Amount instead.

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

Events of default: If the Issuer fails to make any payment due under the Securities or breaches any other term and condition of the Securities in a way that is materially prejudicial to the interests of the holders (and such failure is not remedied within 30 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, the Underlying Asset(s), 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(s), holders do not have any rights in respect of the Underlying Asset(s).
- The terms and conditions of the Securities permit the Issuer and the Determination Agent (as the case may be), on the occurrence of certain events and in certain circumstances, without the holders' consent, to make adjustments to the terms and conditions of the Securities, to redeem the Securities prior to maturity, to monetise the Securities, to postpone valuation of the Underlying Asset(s) or scheduled payments under the Securities, to change the currency in which the Securities are denominated, [to substitute the Underlying Asset(s), to substitute the Issuer with another permitted entity subject to certain conditions, and to take certain other actions with regard to the Securities and the Underlying Asset(s).
- The Securities contain provisions for calling meetings of holders to consider matters affecting their interests generally and these provisions permit defined majorities to bind all holders, including holders who did not attend and vote at the relevant meeting and holders who voted in a manner contrary to the majority.

Governing law

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

Description of the calculation of potential return on the Securities

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

Underlying Asset	Type	Initial Price	Initial Valuation Date
EURO STOXX BANKS® Index	Index	The Valuation Price of the Underlying Asset on the Initial Valuation Date	5 March 2021

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

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

Interest Payment Dates*	Interest Valuation Dates	Interest Barrier Percentage (1)	Interest Barrier Percentage (2)
14 March 2022	7 March 2022	60%	100%
13 March 2023	6 March 2023	60%	100%
12 March 2024	5 March 2024	60%	100%
12 March 2025	5 March 2025	60%	100%
12 March 2026	5 March 2026	60%	100%
12 March 2027	5 March 2027	60%	100%
13 March 2028	6 March 2028	60%	100%
12 March 2029	5 March 2029	60%	100%
12 March 2030	5 March 2030	60%	100%
12 March 2031	5 March 2031	60%	100%

* The relevant Interest Payment Date may be postponed following the postponement of an Interest Valuation Date due to a disruption event. The Interest Amount payable on each Security on each Interest Payment Date is calculated as follows:

1. if the Modified Performance is greater than or equal to the relevant Interest Barrier Percentage(2), the Interest Amount is calculated by multiplying the Fixed Interest Rate(2) (being 9.20) by the Calculation Amount; or
2. if the Modified Performance is both (a) less than the relevant Interest Barrier Percentage(2) and (b) greater than or equal to the relevant Interest Barrier Percentage(1), the Interest Amount is calculated by multiplying the Fixed Interest Rate(1) (being 4.60) by the Calculation Amount; or

3. otherwise, the Interest Amount is calculated by multiplying the Global Floor (being 0.00%) by the Calculation Amount
-

Where:

"**Initial Price**" means in respect of an Underlying Asset the closing level in respect of the Initial Valuation Date.

"**Initial Valuation Date**" means 5 March 2021, subject to adjustment.

"**Interest Valuation Price**" means, in respect of an Interest Valuation Date and an Underlying Asset, the closing level of such Underlying Asset in respect of such Interest Valuation Date.

"**Modified Performance**" means, in respect of an Interest Valuation Date, the Interest Valuation Price on such day divided by the Initial Price.

B – Automatic Settlement (Autocall)

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

Autocall Valuation Date	Autocall Settlement Date	Autocall Barrier Percentage
7 March 2022	13 March 2023	100%
6 March 2023	12 March 2024	100%
5 March 2024	12 March 2025	100%
5 March 2025	12 March 2026	100%
5 March 2026	12 March 2027	100%
5 March 2027	13 March 2028	100%
6 March 2028	12 March 2029	100%
5 March 2029	12 March 2030	100%
5 March 2030	13 March 2031	100%

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 Final Cash Settlement Amount is calculated as follows:

1. if the Final Performance is greater than or equal to the Knock-in Barrier Percentage (being 60%), 100% multiplied by the Calculation Amount;

2. otherwise, an amount calculated by dividing the Final Performance by the Strike Price Percentage (being 100%) and multiplying the result by the Calculation Amount.

Where:

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

"**Final Valuation Date**" means 5 March 2031, subject to adjustment.

"**Final Valuation Price**" means, in respect of the Underlying Asset, the closing level 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 the Securities do not provide for a scheduled minimum payment at maturity and as such, depending on the performance of the Underlying Asset(s), you may lose some or all of your investment. You may also lose some or all of your investment if: (a) you sell your Securities before their scheduled maturity or expiry; (b) your Securities are early redeemed in certain extraordinary circumstances; or (c) the terms and conditions of your Securities are adjusted such that the amount payable or property deliverable to you is less than your initial investment.
- **There are risks associated with the valuation, liquidity and offering of the Securities:** The market value of your Securities may be significantly lower than the issue price since the issue price may take into account the Issuer's and/or distributor's profit margin and costs in addition to the fair market value of the Securities. The market value of your Securities may be affected by the volatility, level, value or price of the Underlying Asset(s) at the relevant time, changes in interest rates, the Issuer's financial condition and credit ratings, the supply of and demand for the Securities, the time remaining until the maturity or expiry of the Securities and other factors. The price, if any, at which you will be able to sell your Securities prior to maturity may be substantially less than the amount you originally invested. Your Securities may not have an active trading market and the Issuer may not be under any obligation to make a market or repurchase the Securities prior to redemption. The Issuer may withdraw the public offer at any time. In such case, where you have already paid or delivered subscription monies for the relevant Securities, you will be entitled to reimbursement of such amounts, but will not receive any remuneration that may have accrued in the period between their payment or delivery of subscription monies and the reimbursement of the Securities.
- **You are subject to risks associated with the determination of amount payable under the Securities:**

The Securities bear interest at a rate that is contingent upon the performance of the Underlying Asset and may vary from one Interest Payment Date to the next. You may not receive any interest payments if the Underlying Asset do not perform as anticipated.

The Interest Amount is either a higher pre-determined Interest Amount or a lower Interest Amount, depending on whether the performance criteria are met. It is possible that you will not receive any interest at all over the lifetime of the Securities.

The Final Cash Settlement Amount is based on the performance of the Underlying Asset(s) as at the final valuation date only (rather than in respect of multiple periods throughout the term of the Securities). This means you may not benefit from any movement in level of the Underlying Asset(s) during the term of the Securities that is not maintained in the final performance as at the final valuation date.

As the Final Cash Settlement Amount is subject to a cap, the value of or return on your Securities may be significantly less than if you had purchased the Underlying Asset(s) directly.]The calculation of amount payable depends on the level, value or price of the Underlying Asset(s) reaching or crossing a 'barrier' during a specified period or specified dates during the term of the Securities. This means you may receive less (or, in certain cases, more) if the level, value or price of the Underlying Asset(s) crosses or reaches (as applicable) a barrier, than if it comes close to the barrier but does not reach or cross it (as applicable), and in certain cases you might receive no interest or coupon payments and/or could lose some or all of your investment.

- **Your Securities are subject to adjustments and early redemption:** Pursuant to the terms and conditions of the Securities, following the occurrence of certain disruption events or extraordinary events concerning the Issuer, its hedging arrangements, the Underlying Asset(s), taxation or the relevant currency of the Securities, the Determination Agent or the Issuer may take a number of remedial actions, including estimating the 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 price at which you purchase the Securities, or may even be zero. You will also lose the opportunity to participate in any subsequent positive performance of the Underlying Asset(s) and be unable to realise any potential gains in the value of the Securities. You may not be able to reinvest the proceeds from an investment at a comparable return and/or with a comparable interest or coupon rate for a similar level of risk. This feature may limit the market value of the Securities.
- **Settlement is subject conditions and may be impossible in certain circumstances:** Payment of the amount payable to you will not take place until all conditions to settlement have been satisfied in full. No additional amounts will be payable to you by the Issuer because of any resulting delay or postponement. Certain settlement disruption events may occur which could restrict the Issuer's ability to make payments, and the date of settlement could be delayed accordingly. Since 'Entitlement Substitution' is applicable, the Issuer may elect to either (i) substitute the affected entitlement components and deliver substitute assets, or (ii) not deliver the affected entitlement components and to pay an amount in lieu thereof to Holders. This may result in you being exposed to the issuer or custodian of the substituted assets, being unable to sell such substituted assets for a specific price and/or being subject to documentary or stamp taxes and/or other charges.
- **The Underlying Asset(s) are 'benchmarks' for the purposes of the EU Benchmarks Regulation (Regulation (EU) 2016/1011, as amended):** Pursuant to the Benchmarks Regulation, an Underlying Asset may not be used in certain ways by an EU supervised entity after 31 December 2021 if its administrator does not obtain authorisation or registration (or, if a non-EU entity, does not satisfy the "equivalence" conditions and is not "recognised" pending an equivalence decision or is not "endorsed" by an EU supervised entity).
- **Potential conflicts of interest:** Conflicts of interest may exist where Barclays Bank PLC or its affiliate: (i) acts in multiple capacities with respect to the Securities (e.g. acting as issuer, manager and determination agent) [and the Barclays Index (e.g. acting as index sponsor, index administrator, licensing agent, and/or publisher)]; (ii) enters into hedging transactions to cover the Issuer's exposure to the relevant cash amounts to be paid or assets to be delivered under the Securities as these fall due; and (iii) uses price contributions from its trading desks as a pricing source for an Underlying Asset. In light of such conflicts, the actions taken or determinations made by Barclays Bank PLC in

relation to the Securities may not always be in the best interest of the holders. In addition to hedging transactions, Barclays Bank PLC may trade on the Underlying Asset(s) in the ordinary course of its business. Such trading could affect the market price of the Underlying Asset(s), which may in turn materially adversely affect the value and return on your Securities.

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

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

Terms and conditions of the offer

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

The Securities are offered for subscription in France during the period from (and including) 1 February 2021 to (but excluding) 5 March 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 3(2) of the Prospectus Directive may be made by the Manager or the Authorised Offeror in France (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 Boulevard Haussmann Paris, 75008 Paris, Franc.

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 4,000.

The Issuer will not charge any expenses to holders in connection with any issue of Securities.

Not Applicable: no expenses will be charged to the holder by the issuer or the offeror.

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 4.00%. 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 réclamation 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.

Jusqu'à 30 000 000 EUR de titres échéant en mars 2031 dans le cadre du Programme mondial de titres structurés (Global Structured Securities Programme)] (ISIN : XS2234147705) (les « **Titres** »).

L'Émetteur : L'Émetteur est Barclays Bank PLC. Son siège social est situé au 1 Churchill Place, Londres, E14 5HP, Royaume-Uni (numéro de téléphone : +44 (0)20 7116 1000) et son Legal Entity Identifier (« **LEI** ») est G5GSEF7VJP517OUK5573

L'Offrant Autorisé : L'offrant autorisé est UBS (France) SA dont l'adresse est 69 Boulevard Haussmann Paris, 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 : 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. Legal Entity Identifier (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 de détail 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 Chief Executive Officer and Executive Director (Directeur général et Directeur exécutif) et Tushar Morzaria Executive Director (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?⁷

L'Émetteur a extrait les informations financières consolidées sélectionnées figurant dans le tableau ci-dessous pour les exercices clos les 31 décembre 2019 et 31 décembre 2018 des états financiers consolidés annuels de l'Émetteur pour les exercices clos les 31 décembre 2019 et 2018 (les "États Financiers"), qui ont chacun été audités sans réserve par KPMG. Les informations financières sélectionnées figurant dans le tableau ci-dessous pour les semestres clos les 30 juin 2020 et 30 juin 2019 sont tirées de l'Annonce des Résultats Intermédiaires non audités de l'Émetteur pour le semestre clos le 30 juin 2020.

Compte de résultat

	Au 30 juin (non audité)		Au 31 Décembre	
	2020	2019	2019	2018
	(en millions de livres sterling)	(en millions de livres sterling)	(en millions de livres sterling)	
Revenu net d'intérêt				3.13
	1.671	1.821	3.907	0
Commissions et honoraires nets.....				5.60
	2.879	2.829	5.672	7
Charges de dépréciation des crédits.....			(1.202	
	(2.674)	(510))	(643)
Résultat net des opérations de négoce.....				4.36
	4.225	2.093	4.073	4
Bénéfice avant impôt				1.28
	1.523	1.725	3.112	6
Bénéfice/(perte) après impôt.....				1.01
	1.293	1.465	2.780	0

Bilan financier

	Au 30 juin 2020 (non audité)	Au 31 Décembre	
		2019	2018
	(en millions de livres sterling)	(en millions de livres sterling)	
Total des actifs.....	1.095.958	876.672	877.700
Titres de créance en circulation	50.496	33.536	39.063
Passif subordonné	36.965	33.425	35.327
Prêts et avances au coût amorti	150.203	141.636	136.959
Dépôts au coût amorti.....	245.737	213.881	199.337
Total des fonds propres.....	56.694	50.615	47.711
Intérêts minoritaires...	0	0	2

Certain Ratios des États Financiers

	Au 30 juin 2020 (non audité)	Au 31 Décembre	
		2019	2018
	(%)	(%)	
Capital Common Equity Tier 1	14.3	13.9	13.5
Capital réglementaire.....	21.0	22.1	22.2
Ratio de levier CCR.....	4.1	3.9	4.0

Quels sont les principaux risques spécifiques à l'Émetteur ?

⁷ En vertu du Supplément 2/2020 daté du 5 août 2020, cette section est mise à jour.

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

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

services financiers, y compris les cas de faute intentionnelle ou de négligence. *Le risque réputationnel est le risque qu'une action, une transaction, un investissement, un événement, une décision ou une relation d'affaire réduise la confiance dans l'intégrité et la compétence du Groupe Bancaire Barclays.* La Groupe Bancaire Barclays exerce des activités sur un marché très réglementé qui l'expose au risque juridique découlant (i) de la multitude de lois et de règlements qui s'appliquent aux activités qu'elle exerce, qui sont très dynamiques, qui peuvent varier selon les juridictions, et sont souvent peu claires dans leur application à des circonstances particulières, notamment dans les domaines nouveaux et émergents ; et (ii) de la nature diversifiée et évolutive des activités du Groupe Bancaire Barclays et de ses pratiques commerciales. Dans chaque cas, le Groupe Bancaire Barclays est confronté au risque de perte ou à l'imposition de pénalités, de dommages et intérêts ou d'amendes suite au non-respect des membres du Groupe Bancaire Barclays de leurs obligations légales, y compris les exigences légales ou contractuelles. Le risque juridique peut survenir en relation avec un certain nombre de facteurs de risque 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 billets et seront identifiés de manière unique par : Numéro de série : NX000272084 ; numéro de tranche : 1 ; ISIN : XS2234147705 ; code commun : 223414770.

Les titres seront compensés et réglés par Euroclear Bank S.A./N.V. ou par la *société anonyme* Clearstream Banking.

Devise, [dénomination spécifiée] [nombre de titres dans une unité], taille de l'émission et durée des Titres

Les titres seront émis en euros (« EUR ») (la « monnaie d'émission ») et réglés dans la même monnaie (la « monnaie de règlement »). Les titres sont négociables en valeur nominale et la dénomination spécifiée par titre est La taille de l'émission est de 30.000.000 EUR maximum. Le prix d'émission est de 100,00 % de la valeur nominale spécifiée.

La date d'émission est le 12 mars 2021 (la « **Date d'Émission** »). Sous réserve d'une résiliation anticipée, il est prévu que les Titres soient remboursés le 12 mars 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 (i) d'un Montant de Règlement en Espèces Anticipé.

Fiscalité : Tous les paiements relatifs aux Titres seront effectués sans retenue ou déduction au titre des impôts britanniques, à moins qu'une telle retenue ou déduction ne soit exigée par la loi. Dans le cas où une telle retenue ou déduction est exigée par la loi, l'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 provision légale impérative) les Titres deviendront immédiatement dus et payables, sur avis donné par le détenteur.

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 Prévus à la suite de la survenance de certains événements perturbateurs ou extraordinaires concernant l'Émetteur, -le(s) Actif(s) Sous-Jacent(s), la fiscalité ou la devise concernée des Titres, ou s'il détermine que l'exécution de l'une de ses obligations en vertu des Titres est illégale ou physiquement impossible. Dans ce cas, les investisseurs recevront un « **Montant de Règlement Anticipé en Espèces** » égal à la juste valeur marchande des Titres avant leur rachat.

Certaines limitations supplémentaires :

- Bien que les Titres soient liés à la performance du/des Actif(s) Sous-Jacent(s), les détenteurs n'ont aucun droit sur le(s) Actif(s) Sous-Jacent(s).
- Les conditions des Titres permettent à l'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, monétiser les Titres, pour reporter l'évaluation des Actif(s) Sous-Jacent(s) ou les paiements prévus en vertu des Titres, pour changer la devise dans laquelle les Titres sont libellés, pour remplacer le(s) Actif(s) Sous-Jacent(s), pour remplacer l'Émetteur par une autre entité autorisée sous certaines conditions, et pour prendre certaines autres mesures concernant les Titres [et le(s) Actif(s) Sous-Jacent(s)].
- Les Titres contiennent des dispositions relatives à la convocation d'assemblées de détenteurs pour examiner des questions affectant leurs intérêts en général et ces dispositions permettent à des majorités définies de lier tous les détenteurs, y compris les détenteurs qui n'ont pas assisté et voté à l'assemblée concernée et les détenteurs qui ont voté d'une manière contraire à la majorité.

Droit applicable

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

Description du calcul du rendement potentiel des actifs sous-jacents aux 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
EURO STOXX BANKS® Index	Index	Le prix d'évaluation de l'actif sous-jacent à la date d'évaluation initiale	5 mars 2021

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

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

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.

Dates de paiement des intérêts*	Dates d'évaluation des intérêts	Pourcentage de barrière des intérêts (1)	Pourcentage de la barrière des intérêts (2)
14 Mars 2022	7 Mars 2022	60 %	100 %
13 Mars 2023	6 Mars 2023	60 %	100 %
12 Mars 2024	5 Mars 2024	60 %	100 %
12 Mars 2025	5 Mars 2025	60 %	100 %
12 Mars 2026	5 Mars 2026	60 %	100 %
12 Mars 2027	5 Mars 2027	60 %	100 %
13 Mars 2028	6 Mars 2028	60 %	100 %
12 Mars 2029	5 Mars 2029	60 %	100 %
12 Mars 2030	5 Mars 2030	60 %	100 %
12 Mars 2031	5 Mars 2031	60 %	100 %

* La date de paiement d'intérêts concernée peut être reportée suite au report d'une date d'évaluation des intérêts en raison d'un événement perturbateur. Le montant de l'intérêt payable sur chaque titre à chaque Date de Paiement d'Intérêt est calculé comme suit

4. si la Performance Modifiée est supérieure ou égale au Pourcentage de la Barrière d'Intérêts(2) concerné, le Montant des Intérêts est calculé en multipliant le Taux d'Intérêt Fixe(2) (soit 9,20) par le Montant du Calcul ; ou
5. si la Performance Modifiée est à la fois (a) inférieure au Pourcentage d'Intérêt Barrière(2) concerné et (b) supérieure ou égale au Pourcentage d'Intérêt Barrière(1) concerné, le Montant de l'Intérêt est calculé en multipliant le Taux d'Intérêt Fixe(1) (soit 4,60) par le Montant du Calcul ; ou
sinon, le montant des intérêts est calculé en multipliant le plancher global (soit 0,00 %) par le montant du calcul

Où :

« **Prix initial** » signifie, pour un actif sous-jacent, le niveau de clôture à la date d'évaluation initiale..

« **Date d'évaluation initiale** » signifie le 5 mars 2021, sous réserve d'ajustement..

« **Prix d'évaluation de l'intérêt** » signifie, pour une date d'évaluation de l'intérêt et un actif sous-jacent, le niveau de clôture de cet actif sous-jacent à cette date d'évaluation de l'intérêt.

« **Performance modifiée** » signifie, pour une date d'évaluation de l'intérêt, le prix d'évaluation de l'intérêt ce jour-là divisé par le prix initial.

B – Règlement Automatique (Autocall)

Les titres seront automatiquement rachetés si le cours de clôture ou le niveau de l'actif sous-jacent divisé par son prix initial est égal ou supérieur à son pourcentage de barrière d'Autocall correspondant pour toute date d'évaluation d'Autocall. Si cela se produit, vous recevrez un montant de règlement en espèces par appel automatique égal au montant du calcul multiplié par 100 % payable à la date de règlement par appel automatique correspondant à cette date d'évaluation par appel automatique. La date de règlement de l'appel automatique concernée peut être reportée à la suite du report d'une date d'évaluation de l'appel automatique en raison d'un événement perturbateur.

Date d'évaluation Autocall	Date de règlement Autocall	Pourcentage de la barrière Autocall
7 Mars 2022	13 Mars 2023	100 %
6 Mars 2023	12 Mars 2024	100 %
5 Mars 2024	12 Mars 2025	100 %
5 Mars 2025	12 Mars 2026	100 %
5 Mars 2026	12 Mars 2027	100 %
5 Mars 2027	13 Mars 2028	100 %
6 Mars 2028	12 Mars 2029	100 %
5 Mars 2029	12 Mars 2030	100 %
5 Mars 2030	13 Mars 2031	100 %

C – Règlement Final

Si les titres n'ont pas été rachetés autrement, chaque titre sera racheté à la date de règlement prévue par le paiement du montant final de règlement en espèces.

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

3. si la performance finale est supérieure ou égale au pourcentage de barrière d'entrée (soit 60 %), 100 % multiplié par le montant du calcul ;
4. 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 de calcul.

Où :

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

« **Date d'évaluation finale** » signifie le 5 mars 2031, sous réserve d'ajustement.

« **Prix d'évaluation final** » signifie, en ce qui concerne l'actif sous-jacent, le niveau 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 auront le même rang entre eux.

Description des restrictions au libre transfert des Titres :

Les Titres sont offerts et vendus en dehors des États-Unis à des personnes n'ayant pas la nationalité américaine, en s'appuyant sur le règlement S de la Loi sur les Valeurs Mobilières et doivent se conformer aux restrictions de transfert en ce qui concerne les États-Unis. Les Titres détenus dans un système de compensation seront transférés conformément aux règles, procédures et règlements de ce système de compensation. Sous réserve de ce qui précède, les Titres seront librement transférables.

Où les Titres seront-ils négociés ?

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 le risques clés spécifiques aux Titres ?

Les Titres sont soumis aux principaux risques suivants :

- **Vous pouvez perdre tout ou partie de votre investissement dans les Titres :** Les conditions des titres ne prévoient pas de paiement minimum à l'échéance et, par conséquent, en fonction de la performance des actifs sous-jacents, vous pouvez perdre tout ou partie 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 expiration prévue ; (b) vos titres sont rachetés de manière anticipée 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 sensiblement inférieure au prix d'émission, car le prix d'émission peut tenir compte de la marge bénéficiaire et des coûts de l'émetteur et/ou du distributeur en plus de la juste valeur marchande des titres. La valeur marchande de vos titres peut être affectée par la volatilité, le niveau, la valeur ou le prix des actifs sous-jacents 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 actif et l'émetteur ne peut être tenu de créer un marché 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 dans le cadre des Titres :**

Les titres portent intérêt à un taux qui dépend de la performance de l'actif sous-jacent et qui peut varier d'une date de paiement des intérêts à l'autre. Il est possible que vous ne receviez aucun paiement d'intérêt si l'actif sous-jacent ne se comporte pas comme prévu.

Le montant des intérêts est soit un montant d'intérêt supérieur prédéterminé, soit un montant d'intérêt inférieur, selon que les critères de performance sont satisfaits ou non. 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 des actifs sous-jacents à la date d'évaluation finale uniquement (plutôt que sur plusieurs périodes pendant la durée de vie des titres). Cela signifie que vous ne pouvez bénéficier d'aucun mouvement du niveau des actifs sous-jacents pendant la durée de vie des titres qui ne soit pas maintenu dans la performance finale à la date d'évaluation finale.

Comme le montant final de règlement en espèces est soumis à un plafond, la valeur ou le rendement de vos titres peut être sensiblement inférieur à celui que vous auriez obtenu si vous aviez acheté directement le ou les actifs sous-jacents] Le calcul du montant payable dépend du niveau, de la valeur ou du prix du ou des actifs sous-jacents qui atteignent ou franchissent une « barrière » pendant une période ou des dates déterminées pendant la durée des titres. Cela signifie que vous pouvez recevoir moins (ou, dans certains cas, plus) si le niveau, la valeur ou le prix 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 peuvent faire l'objet d'ajustements et d'un remboursement anticipé :** Conformément aux conditions des titres, à la suite de la survenance de certains événements perturbateurs ou extraordinaires concernant l'émetteur, ses dispositifs de couverture, le ou les actifs sous-jacents, la fiscalité ou la devise concernée des titres, l'agent de détermination ou l'émetteur peut prendre un certain nombre de mesures correctives, notamment en estimant le niveau de l'actif sous-jacent, en le remplaçant et en apportant des ajustements aux 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 physiquement 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 tout ou partie de votre investissement car le Montant de Règlement Anticipé en Espèces peut être inférieur au prix auquel vous avez acheté les Titres, ou peut même être nul. Vous perdrez également la possibilité de participer à toute performance positive ultérieure du ou des actifs sous-jacents et ne pourrez réaliser aucun gain potentiel de la valeur des titres. Il se peut que vous ne puissiez pas réinvestir le produit d'un investissement à un rendement comparable et/ou avec un taux d'intérêt ou un coupon comparable pour un niveau de risque similaire. Cette caractéristique peut limiter la valeur marchande des titres.

- **Le règlement est soumis à des conditions et peut être impossible dans certaines circonstances :**

Le paiement du montant qui vous est dû n'aura lieu que lorsque toutes les conditions du règlement auront été entièrement satisfaites. Aucun montant supplémentaire ne vous sera payable par l'émetteur en raison d'un retard ou d'un report qui en résulterait. Certains événements perturbateurs du règlement peuvent se produire, ce qui pourrait restreindre la capacité de l'émetteur à effectuer des paiements, et la date du règlement pourrait être retardée en conséquence. Étant donné que la « substitution de droits » est applicable, l'émetteur peut choisir soit (i) de substituer les éléments de droits concernés et de fournir des actifs de substitution, soit (ii) de ne pas fournir les éléments de droits concernés et de payer un montant en lieu et place de ceux-ci aux titulaires. Cela peut vous exposer à l'émetteur ou au dépositaire des actifs substitués, à l'impossibilité de vendre ces actifs substitués à un prix spécifique et/ou à des taxes sur les documents ou les timbres et/ou à d'autres frais.

- **Les actifs sous-jacents sont des « benchmarks » aux fins du règlement de l'UE sur les critères de référence (règlement (UE) 2016/1011, tel que modifié) :** Conformément au Règlement sur les critères de référence, un actif sous-jacent ne peut être utilisé de certaines manières par une entité soumise à la surveillance de l'UE après le 31 décembre 2021 si son administrateur n'obtient pas d'autorisation ou d'enregistrement (ou, s'il s'agit d'une entité non européenne, ne remplit pas les conditions d'« équivalence » et n'est pas « reconnu » dans l'attente d'une décision d'équivalence ou n'est pas « avalisé » par une entité soumise à la surveillance de l'UE).

- **Conflits d'intérêts potentiels :** Des conflits d'intérêts peuvent exister lorsque la Barclays Bank PLC ou sa filiale : (i) agit à plusieurs titres en ce qui concerne les titres (par exemple, en tant qu'émetteur, gestionnaire et agent de détermination) [et l'indice Barclays (par exemple, en tant que sponsor de l'indice, administrateur de l'indice, agent de licence et/ou éditeur)] ; (ii) conclut des opérations de couverture pour couvrir l'exposition de l'émetteur aux montants en espèces à payer ou aux actifs à livrer au titre des titres à l'échéance ; et (iii) utilise les contributions de ses pupitres de négociation comme source de tarification pour un actif sous-jacent. À la lumière de ces conflits, les mesures prises ou les décisions prises par Barclays Bank PLC en rapport avec les titres peuvent ne pas toujours être dans le meilleur intérêt des détenteurs. En plus des opérations de couverture, Barclays Bank PLC peut négocier les actifs sous-jacents dans le cadre de la formation normale de son activité. Ces opérations peuvent affecter le prix du marché des actifs sous-jacents, ce qui peut avoir un effet négatif sur la valeur et le rendement de vos titres.

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

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

Modalités de l'offre

Les modalités de toute offre de Titres au public peuvent être 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 allant du (et y compris) 1^{er} février 2021 au (mais à l'exclusion du) 5 mars 2021 (la « **Période d'Offre** ») et cette offre est soumise aux conditions suivantes :

- **Prix de l'Offre :** 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 d'une autre manière 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 de titres autre que celle prévue à l'article 3(2) de la Directive Prospectus peut être faite par la direction ou l'Offrant Autorisé en France (la « juridiction de l'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 : non applicable.
- Détails du mode et des délais de libération et de livraison des Titres : Les investisseurs seront informés par l'Offrant Autorisé de leurs attributions de Titres et des modalités de règlement y afférentes.
- Modalités et date auxquelles les résultats de l'offre doivent être rendus publics : Les investisseurs seront informés par l'Offrant Autorisé de leurs attributions de titres et des 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 : Non applicable
- Catégories de détenteurs auxquelles les Titres sont offerts et si la ou les Tranche(s) ont été réservée(s) pour certains pays : Les offres peuvent être 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 à l'obligation de publier un prospectus prévue par la Directive Prospectus telle qu'elle a été mise en œuvre dans ces pays.
- Procédure de notification aux demandeurs du montant alloué et indication du fait que la négociation peut commencer avant la notification : Les demandeurs seront informés directement par l'offrant autorisé du succès de leur demande. Aucune 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 dont l'adresse est 69 Boulevard Haussmann Paris, 75008 Paris, France.

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

Les dépenses totales estimées de l'émission et/ou de l'offre sont estimés à 4 000 EUR.

L'Émetteur ne facturera aucun frais aux détenteurs en relation avec une émission de Titres Non applicable : aucun frais ne sera facturé au titulaire par l'émetteur ou l'offrant

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

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 percevoir des honoraires en relation avec l'offre de Titres. Des conflits d'intérêts potentiels peuvent exister entre l'Émetteur, l'Agent de Détermination, l'Offrant Autorisé ou leurs sociétés affiliées (qui peuvent avoir des intérêts dans des opérations sur des produits dérivés liés à l'(aux) Actif(s) Sous-Jacent(s) 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 des commissions globales ne dépassant pas 4 %. 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.