

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.

MIFID II product governance/ Retail investors, professional investors and ECPs target market – Solely for the purposes of the manufacturer's product approval process, the target market assessment in respect of the Securities has led to the conclusion that: (i) the target market for the Securities is eligible counterparties, professional clients and retail clients, each as defined in Directive 2014/65/EU (as amended, "MiFID II") and (ii) all channels for distribution of the Securities are appropriate. Any person subsequently offering, selling or recommending the Securities (a "distributor") should take into consideration the manufacturers' target market assessment; however, a distributor subject to MiFID II is responsible for undertaking its own target market assessment in respect of the Securities (by either adopting or refining the manufacturers' target market assessment) and determining appropriate distribution channels.



BARCLAYS BANK PLC

(Incorporated with limited liability in England and Wales)

Legal Entity Identifier (LEI): G5GSEF7VJP5I7OUK5573

**EUR 30,000,000 Securities due July 2026 under the Global Structured Securities Programme
(the "Securities")**

Issue Price: 100.00 per cent

This document constitutes the final terms of the Securities (the "**Final Terms**") described herein for the purposes of Article 8 of the Prospectus Regulation (EU) 2017/1129 (as amended, the "**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 the 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 and the Securities Note relating to the GSSP Base Prospectus 9 dated 17 July 2020 as supplemented on 23 December 2020 and 29 January 2021) for the purposes of Article 8(6) of the Prospectus Regulation (the "**Base Prospectus**"), which constitutes a base prospectus for the purposes 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.

The Registration Document is expected to be updated in March 2021. The new Registration Document will be valid from and including its date of approval and will be published on the website of the Issuer. The terms and conditions of the securities from the Securities Note dated 17 July 2020 will continue to apply to the Securities.

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

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

BARCLAYS

Final Terms dated 8 March 2021

PART A – CONTRACTUAL TERMS

Provisions relating to the Securities

1. (a) Series: NX000274894
(b) Tranche: 1
2. Currencies:
 - (a) Issue Currency: Euro (“EUR”)
 - (b) Settlement Currency: EUR
3. Securities: Notes
4. Notes: Applicable
 - (a) Aggregate Nominal Amount as at the Issue Date:
 - (i) Tranche: EUR 30,000,000
 - (ii) Series: EUR 30,000,000
 - (b) Specified Denomination: EUR 1,000
 - (c) Minimum Tradable Amount: N/A
5. Certificates: Not Applicable
6. Calculation Amount: EUR 1,000
7. Issue Price: 100.00% of the Aggregate Nominal Amount

The Issue Price includes a commission element payable by the Issuer to the Authorised Offeror which will be no more than 2% of the Issue Price. Investors in the Securities intending to invest through an intermediary (including by way of introducing broker) should request details of any such commission or fee payment from such intermediary before making any purchase hereof.
8. Issue Date: 8 March 2021
9. Scheduled Settlement Date: 14 July 2026
10. Type of Security: Equity Index Linked Securities and French Securities
11. Underlying Performance Type_(Interest): Single Asset
12. Underlying Performance Type_(Autocall): Single Asset
13. Underlying Performance Type_(Settlement): Single Asset

Provisions relating to interest (if any) payable

14. Interest Type: Snowball
General Condition 9 (*Interest*)

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

Table 1

T	Interest Valuation Date	Interest Payment Date	Interest Barrier Percentage
2	30 June 2022	14 July 2022	100%
3	30 December 2022	16 January 2023	100%
4	30 June 2023	14 July 2023	100%
5	2 January 2024	16 January 2024	100%
6	1 July 2024	15 July 2024	100%
7	30 December 2024	14 January 2025	100%
8	30 June 2025	14 July 2025	100%
9	30 December 2025	14 January 2026	100%
10	30 June 2026	14 July 2026	70%

- (c) (i) Fixed Interest Type: Fixed Amount
- (ii) Fixed Interest Rate: 1.50%
- (d) Information relating to the Floating Rate: Not Applicable
- (e) Interest Barrier Percentage: Each of the percentages set out in Table 1 above in the column entitled 'Interest Barrier Percentage'.

Provisions relating to Automatic Settlement (Autocall)

15. Automatic Settlement (Autocall): Applicable
General Condition 10 (*Automatic Settlement (Autocall)*)
- (a) Autocall Observation Type: Discrete
- (b) Autocall Barrier Percentage: 100%
- (c) Autocall Settlement Percentage: 100%
- (d) Autocall Valuation Dates: Each date set out in Table 2 below in the column entitled 'Autocall Valuation Date'.
- (e) Autocall Settlement Date: Each date set out in Table 2 below in the column entitled 'Autocall Settlement Date'.

- (f) Autocall Valuation Price: The Valuation Price of the Underlying Asset on the Autocall Valuation Date
- (i) Averaging-out: Not Applicable
- (ii) Min Lookback-out: Not Applicable
- (iii) Max Lookback-out: Not Applicable
- (g) Autocall Reset Event: Not Applicable

Table 2

Autocall Valuation Date	Autocall Settlement Date
30 June 2022	14 July 2022
30 December 2022	16 January 2023
30 June 2023	14 July 2023
2 January 2024	16 January 2024
1 July 2024	15 July 2024
30 December 2024	14 January 2025
30 June 2025	14 July 2025
30 December 2025	14 January 2026

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

Provisions relating to Final Settlement

17. (a) Final Settlement Type: Capped
General Condition 12 (*Final Settlement*)
- (b) Settlement Method: Cash
- (c) Strike Price Percentage: 100.00 per cent.
- (d) Knock-in Barrier Type: European
- (e) Knock-in Barrier Percentage: 70.00 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: 30 April 2021
 - (b) Index: EURO STOXX 50[®] Index
 - (i) Exchange: Multi-exchange
 - (ii) Related Exchange: All Exchanges
 - (iii) Underlying Asset Currency: EUR
 - (iv) Bloomberg Screen: SX5E <Index>
 - (v) Refinitiv Screen: .STOXX50E
 - (vi) Index Sponsor: Stoxx Ltd.
 - (vii) Weight: Not Applicable
 - (viii) Pre-nominated Index: Not Applicable
21. (a) 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
- (b) Initial Valuation Date: 30 June 2021
22. (a) Final Valuation Price:
- (i) Averaging-out: Not Applicable
 - (ii) Min Lookback-out: Not Applicable
 - (iii) Max Lookback-out: Not Applicable
- (b) Final Valuation Date: 30 June 2026

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 a Disrupted Day
(in respect of an Averaging Date or
Lookback Date):
General Condition 37
(*Consequences upon a Reference
Date becoming a Reference Date*)
- (a) Omission: Not Applicable
- (b) Postponement: Not Applicable
- (c) Modified Postponement: Not Applicable
26. Additional Disruption Events:
General Condition 65.1
(*Definitions*)
- (a) Change in Law: Applicable
- (b) Currency Disruption Event: Applicable
- (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 (*Definitions*)
- (j) Loss of Stock Borrow: Not Applicable as per General Condition 65.1 (*Definitions*)
- (k) Foreign Ownership Event: Not Applicable as per General Condition 65.1 (*Definitions*)
- (l) Fund Disruption Event: Not Applicable as per General Condition 65.1 (*Definitions*)
- (m) Fund Event: Not Applicable
- (n) Potential Adjustment of
Payment Events: 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 20 (<i>Consequences of FX Disruption Events (FX)</i>)	Not Applicable
33. Unwind Costs:	Not Applicable
34. Settlement Expenses:	Not Applicable
35. Local Jurisdiction Taxes and Expenses:	Not Applicable
36. Consequences of a Fund Event: General Condition 27 (<i>Consequences of a Fund Event</i>)	Not Applicable
 <i>General provisions</i>	
37. Form of Securities:	Global Bearer Securities: Permanent Global Security TEFRA: Not Applicable NGN Form: Not Applicable Held under the NSS: Not Applicable CGN Form: Applicable CDIs: Not Applicable
38. Trade Date:	5 February 2021
39. Additional Business Centre(s):	Not Applicable
40. 871(m) Securities:	The Issuer has determined that the Securities (without regard to any other transactions) should not be subject to US withholding tax under Section 871(m) of the US Internal Revenue Code and regulations promulgated thereunder.
41. (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
42. Prohibition of Offer to Private Clients in Switzerland:	Applicable
43. Business Day Convention:	Following
44. Determination Agent:	Barclays Bank PLC

45. Registrar: Not Applicable
46. CREST Agent: Not Applicable
47. Transfer Agent: Not Applicable
48. (a) Names of Manager: Barclays Bank Ireland PLC
- (b) Date of underwriting agreement: Not Applicable
- (c) Names and addresses of secondary trading intermediaries and main terms of commitment: Not Applicable
49. Registration Agent: Not Applicable
50. *Masse Category*: Full *Masse*
The Representative shall be:
MASSQUOTES.A.S.U.
RCS 529 065 880 Nanterre
7bis rue de Neuilly
F-92110 Clichy
Mailing address:
33, rue Anna Jacquin
92100 Boulogne Billancourt
France
Represented by its Chairman
- The Representative will be entitled to a remuneration of €450 (VAT excluded) per year, payable on each Interest Payment Date with the first payment at the Issue date.
- The Representative will exercise its duty until its dissolution, resignation or termination of its duty by a general assembly of Noteholders or until it becomes unable to act. Its appointment shall automatically cease on the Maturity Date, or total redemption prior to the Maturity Date.
51. Governing Law: French law
52. Relevant Benchmarks: Amounts payable under the Securities are calculated by reference to EURO STOXX 50® Index, which is provided by Stoxx Ltd. (the "**Administrator**"). As at the date of this Final Terms, the Administrator appears on the register of administrators and benchmarks established and maintained by the European Securities and Markets Authority ("**ESMA**") pursuant to Article 36 of Regulation (EU) 2016/1011 (as amended, the "**EU Benchmarks Regulation**").

PART B – OTHER INFORMATION

1. LISTING AND ADMISSION TO TRADING

- (a) Listing and Admission to Trading: Application has been made/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 with effect from the Issue Date.
- (b) Estimate of total expenses related to admission to trading: EUR 1,500

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: SX5E <Index>

Index Disclaimer: SX5E <Index>

6. OPERATIONAL INFORMATION

- (a) ISIN: FR0014001ZG6
- (b) Common Code: 230015686
- (c) Relevant Clearing System(s): Euroclear France
- (d) Delivery: Delivery free of payment
- (e) Name and address of additional Paying Agent(s): Not Applicable
- (f) Intended to be held in a manner which would allow Eurosystem eligibility: No. Whilst the designation is specified as "no" at the date of these Final Terms, should the Eurosystem eligibility criteria be amended in the future such that the Notes are capable of meeting them the Notes may then be deposited with one of the International Central Securities Depositories ("ICSDs") as common safekeeper.

7. TERMS AND CONDITIONS OF THE OFFER

7.1 Authorised Offer(s)

- (a) Public Offer: An offer of the Securities may be made, subject to the conditions set out below by the Authorised Offeror(s) (specified in (b) immediately below) other than

pursuant to Article 1(4) of the EU Prospectus Regulation) during the Offer Period (specified in (d) immediately below) subject to the conditions set out in the Base Prospectus and in (e) immediately below.

- (b) Name(s) and address(es), to the extent known to the Issuer, of the placers in the various countries where the offer takes place (together the "**Authorised Offeror(s)**"): Each financial intermediary specified in (i) and (ii) below:
- (i) **Specific consent:** Volcap Europe tied agent of TP ICAP Europe (the "**Initial Authorised Offeror(s)**") and each financial intermediary expressly named as an Authorised Offeror on the Issuer's website (<https://home.barclays/investor-relations/fixed-income-investors/prospectus-and-documents/structured-securities-final-terms>); and
 - (ii) **General consent:** Not Applicable
- (c) Jurisdiction(s) where the offer may take place (together, the "**Public Offer Jurisdictions(s)**"): France
- (d) Offer period for which use of the Base Prospectus is authorised by the Authorised Offeror(s) (the "**Offer Period**"): From and including 8 March 2021 to but excluding 30 June 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: EUR 30,000,000
- (c) Conditions to which the offer is subject: The Issuer reserves the right to withdraw the offer for Securities at any time prior to the end of the Offer Period.
- Following withdrawal of the offer, if any application has been made by any potential investor, each such potential investor shall not be entitled to subscribe or otherwise acquire the Securities and any applications will be automatically cancelled and any purchase money will be refunded to the applicant by the Authorised Offeror in accordance with the Authorised Offeror's usual procedures.
- (d) Time period, including any possible amendments, during which the offer will be open and description of the application process: From and including 8 March 2021 to but excluding 30 June 2021.

- (e) Description of the application process: An offer of the Securities may be made by the Manager or the Authorised Offeror other than pursuant to Article 1(4) of the Prospectus Regulation in France (the “**Public Offer Jurisdiction**”) during the Offer Period.
- Applications for the Securities can be made in the Public Offer Jurisdiction through the Authorised Offeror during the Offer Period. The Securities will be placed into the Public Offer Jurisdiction by the Authorised Offeror. Distribution will be in accordance with the Authorised Offeror’s usual procedures, notified to investors by the Authorised Offeror.
- (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 Regulation 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: TP ICAP (Europe) SA
LEI: 213800R54EFFINMY1P02
France, French Republic, Paris, 89-91, Rue Du Faubourg Saint-Honoré, 75008

SUMMARY

INTRODUCTION AND WARNINGS

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

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

Securities: EUR 30,000,000 Securities due July 2026 pursuant to the Global Structured Securities pursuant to the Global Structured Securities Programme) (ISIN: FR0014001ZG6) (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 TP ICAP (EUROPE) SA with its address at France, French Republic, PARIS, 89-91, rue du faubourg saint-honoré, 75008 and its LEI is 213800R54EFFINMY1P02.

Competent authority: The Base Prospectus was approved on 17 July 2020 by the Central Bank of Ireland of New Wapping Street, North Wall Quay, Dublin 1, D01 F7X3, Ireland (telephone number: +353 (0)1 224 6000).

KEY INFORMATION OF THE ISSUER

Who is the Issuer of the Securities?

Domicile and legal form of the Issuer

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

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 Results Announcement of the Issuer in respect of the six months ended 30 June 2020.

Consolidated Income Statement

	As at 30 June (unaudited)		As at 31 December	
	2020	2019	2019	2018
	(£m)		(£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 before tax.....	1,523	1,725	3,112	1,286
Profit/(loss) after tax.....	1,293	1,465	2,780	1,010

Consolidated Balance Sheet

	As at 30 June 2020	As at 31 December	
	(unaudited)	2019	2018
	(£m)	(£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 cost	150,203	141,636	136,959
Deposits at amortised cost	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.....	4.1	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: NX000274894 ;ISIN: FR0014001ZG6; Common Code: 230015686.

The Securities will be cleared and settled through Clearstream Banking *société anonyme* or Euroclear France S.A.

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

The Securities will be issued in Euro ("EUR") (the "Issue Currency") and settled in the same currency (the "Settlement Currency"). The Securities are tradable in nominal and the specified denomination per Security is EUR 1,000. The issue size is EUR 30,000,000. The issue price is 100% of the Specified Denomination.

The issue date is 8 March 2021 (the "Issue Date"). Subject to early termination, the Securities are scheduled to redeem on 14 July 2026 (the "Scheduled Settlement Date").

Rights attached to the Securities

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

Limitations on rights

Early redemption following certain disruption events or due to unlawfulness or impracticability: The Issuer may redeem the Securities prior to their Scheduled Settlement Date following the occurrence of certain disruption events or extraordinary events concerning the Issuer, its hedging arrangements, the Underlying Asset(s), taxation or the relevant currency of the Securities, or if it determines that 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 substitute the Issuer with another permitted entity subject to certain conditions, and to take certain other actions with regard to the Securities.
- The Securities contain provisions for calling meetings of holders to consider matters affecting their interests generally and these provisions permit defined majorities to bind all holders, including holders who did not attend and vote at the relevant meeting and holders who voted in a manner contrary to the majority.

Governing law

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

Description of the calculation of potential return on the Securities

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

Underlying Asset	Type	Initial Price	Initial Valuation Date
EURO STOXX 50® Index	Index	Valuation Price of such Underlying Asset on the Initial Valuation Date	30 June 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, 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.

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

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

A – Interest

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

- (1) multiplying the fixed rate of 1.50% by EUR 1,000; and then
- (2) multiplying the result by the number corresponding to that Interest Valuation Date (i.e. the number in the column headed 'T' in the table below).

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

T	Interest Payment Date	Interest Valuation Dates	Interest Barrier Percentage
2	14 July 2022	30 June 2022	100%
3	16 January 2023	30 December 2022	100%
4	14 July 2023	30 June 2023	100%
5	16 January 2024	02 January 2024	100%
6	15 July 2024	01 July 2024	100%
7	14 January 2025	30 December 2024	100%
8	14 July 2025	30 June 2025	100%
9	14 January 2026	30 December 2025	100%
10	14 July 2026	30 June 2026	70%

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
30 June 2022	14 July 2022	100%
30 December 2022	16 January 2023	100%
30 June 2023	14 July 2023	100%
02 January 2024	16 January 2024	100%
01 July 2024	15 July 2024	100%
30 December 2024	14 January 2025	100%
30 June 2025	14 July 2025	100%
30 December 2025	14 January 2026	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 Scheduled Settlement Date may be postponed following the postponement of the Final Valuation Date due to a disruption event.

The Final Cash Settlement Amount is calculated as follows:

- (i) if the Final Performance is greater than or equal to the Knock-in Barrier Percentage (being 70%), 100% multiplied by the Calculation Amount;
- (ii) otherwise, an amount calculated by dividing the Final Performance by the Strike Price Percentage (being 100%) and multiplying the result by the Calculation Amount.

Where:

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

"Final Valuation Date" means 30 June 2026 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 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.

- **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, 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.
- **Taxation risks:** The levels and basis of taxation on the Securities and any reliefs for such taxation will depend on your individual circumstances and could change at any time over the life of the Securities. This could have adverse consequences for you and you should therefore consult your own tax advisers as to the tax consequences to you of transactions involving the Securities.
- **Potential conflicts of interest:** Conflicts of interest may exist where Barclays Bank PLC or its affiliate: (i) acts in multiple capacities with respect to the Securities (e.g. acting as issuer, manager and determination agent) [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 Securities are offered for subscription in France during the period from (and including) 8 March 2021 to (but excluding) 30 June 2021 (the "**Offer Period**") and such offer is subject to the following conditions:

- Offer Price: 100% of the Issue Price
- Conditions to which the offer is subject: The Issuer reserves the right to withdraw the offer for Securities at any time prior to the end of the Offer Period. Following withdrawal of the offer, if any application has been made by any potential investor, each such potential investor shall not be entitled to subscribe or otherwise acquire the Securities and any applications will be automatically cancelled and any purchase money will be refunded to the applicant by the Authorised Offeror in accordance with the Authorised Offeror's usual procedures.
- Description of the application process: An offer of the Securities other than pursuant to Article 1(4) of the Prospectus Regulation may be made by the Manager or the Authorised Offeror in the 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 Regulation 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: TP ICAP (EUROPE) SA with its address at France, French Republic, PARIS, 89-91, rue du faubourg saint-honoré, 75008 and its LEI is 213800R54EFFINMY1P02.

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

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

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 Manager 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 2.00% of the Issue Price. Any Authorised Offeror and its affiliates may engage, and may in the future engage, in hedging transactions with respect to the Underlying Asset.

RÉSUMÉ

INTRODUCTION ET AVERTISSEMENTS

Le Résumé doit être lu comme une introduction au Prospectus. Toute décision d'investir dans les Valeurs mobilières doit être fondée sur l'examen du Prospectus entier par l'investisseur. Dans certaines circonstances, l'investisseur pourrait perdre tout ou partie du capital investi. Lorsqu'une réclamation relative aux informations contenues dans le Prospectus est portée devant un tribunal, l'investisseur plaignant pourrait, en vertu du droit national, être obligé de supporter les frais de traduction du Prospectus avant l'ouverture de la procédure judiciaire. La responsabilité civile n'est engagée qu'à l'égard des personnes qui ont déposé le Résumé, y compris toute traduction de celui-ci, mais uniquement lorsque le Résumé est trompeur, inexact ou incohérent lorsqu'il est lu conjointement avec les autres parties du Prospectus ou qu'il ne fournit pas, lorsqu'il est lu conjointement avec les autres parties du Prospectus, des informations clés destinées à aider les investisseurs à décider s'ils doivent investir dans les Valeurs mobilières.

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

Valeurs mobilières : 30 000 000 EUR de Valeurs mobilières arrivant à maturité en juillet 2026 conformément au Programme mondial de titres structurés (ISIN) : FR0014001ZG6 (les "**Valeurs mobilières**").

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 identifiant d'entité légale [Legal Entity Identifier] ("**LEI**") est G5GSEF7VJP5I7OUK5573

Offrant autorisé : L'Offrant autorisé est TP ICAP (EUROPE) SA, ayant son adresse en France, République française, PARIS, 89-91, rue du Faubourg Saint-Honoré, 75008 et son identifiant d'entité légale est 213800R54EFFINMY1P02.

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

INFORMATIONS CLÉS DE L'ÉMETTEUR

Qui est l'Émetteur des Valeurs mobilières ?

Domicile et forme juridique de l'Émetteur

Barclays Bank PLC ("**Émetteur**") est une société immatriculée en Angleterre et au Pays de Galles sous le numéro 1026167. La responsabilité des membres de l'Émetteur est limitée. Son siège social est situé au 1 Churchill Place, Londres, E14 5HP, Royaume-Uni (téléphone +44 (0)20 7116 1000). L'identifiant d'entité légale (LEI) de l'Émetteur est G5GSEF7VJP5I7OUK5573.

Activités principales de l'Émetteur

Les activités du groupe incluent des opérations bancaires et de paiement pour les particuliers dans le monde entier, ainsi qu'une banque de consommation et d'investissement de premier plan, offrant des services complets à l'échelle mondiale. Le Groupe se compose de Barclays PLC et de ses filiales, incluant l'Émetteur. L'activité principale de l'Émetteur est d'offrir des produits et des services destinés aux grandes entreprises, aux grossistes et aux clients bancaires internationaux.

Le terme "**Groupe**" désigne Barclays PLC ainsi que ses filiales. Le terme "Barclays Bank Group" désigne Barclays Bank PLC ainsi que ses filiales.

Principaux actionnaires de l'Émetteur

La totalité du capital social ordinaire émis par l'Émetteur est détenue en propriété effective par Barclays PLC. Barclays PLC est la société holding ultime du groupe.

Identité des principaux directeurs généraux de l'Émetteur

Les principaux directeurs généraux de l'Émetteur sont James Staley (directeur général et directeur exécutif) et Tushar Morzaria (directeur exécutif).

Identité des auditeurs légaux de l'Émetteur

Les auditeurs légaux des comptes de l'Émetteur sont KPMG LLP ("**KPMG**"), Comptables agréés et auditeurs agréés (membre de l'Institute of Chartered Accountants en Angleterre et au Pays de Galles), 15 Canada Square, Londres E14 5GL, Royaume-Uni.

Quelles sont les principales informations financières concernant l'Émetteur ?

L'Émetteur a extrait les informations financières consolidées et sélectionnées dans le tableau ci-dessous pour les exercices clos le 31 décembre 2019 et le 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 approuvés sans réserve par KPMG. Les informations financières sélectionnées figurant dans le tableau ci-dessous pour les semestres clos le 30 juin 2020 et le 30 juin 2019 proviennent de l'annonce des résultats intermédiaires non audités de l'Émetteur pour le semestre clos le 30 juin 2020.

Compte de résultat consolidé

	Au 30 juin (non audité)		Au 31 décembre	
	2020	2019	2019	2018
	(m£)	(m£)	(m£)	
Revenus d'intérêts nets.....	1 671	1 821	3 907	3 130
Revenus nets des honoraires et commissions.....	2 879	2 829	5 672	5 607
Charges pour dépréciation de crédit.....	(2 674)	(510)	(1 202)	(643)
Revenus nets des opérations commerciales.....	4 225	2 093	4 073	4 364
Bénéfice avant impôt.....	1 523	1 725	3 112	1 286
Bénéfice/ (perte) après impôt.....	1 293	1 465	2 780	1 010

Bilan consolidé

	Au 30 juin 2020 (non audité)	Au 31 décembre	
	(m£)	2019	2018
	(m£)	(m£)	
Total des actifs.....	1 095 958	876 672	877 700
Titres de créance en circulation.....	50 496	33 536	39 063
Dettes subordonnées.....	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 Fonds propres.....	56 694	50 615	47 711
Intérêts minoritaires.....	0	0	2

Certains ratios issus des États financiers

	Au 30 juin 2020 (non audité)	Au 31 décembre	
	()	2019	2018
Ratio de capital CET 1.....	14,3	13,9	13,5
Total des capitaux réglementaires.....	21,0	22,1	22,2
Ratio de levier CRR.....	4,1	3,9	4,0

Quels sont les principaux risques spécifiques à l'Émetteur ?

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

- Risques matériels existants et émergents pouvant avoir un impact potentiel sur plus d'un risque principal :**
 Outre les risques matériels et émergents ayant un impact sur les principaux risques exposés ci-dessous, des risques matériels existants et émergents peuvent aussi avoir un impact sur plus d'un de ces principaux risques. Ces risques sont : (i) les conditions économiques et de marché mondiales et locales potentiellement défavorables, ainsi que les développements géopolitiques ; (ii) l'impact de la pandémie 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 Barclays Bank Group ; (v) l'environnement concurrentiel du 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 Barclays Bank Group ; et (viii) l'impact des réformes des taux d'intérêt de référence sur le Barclays Bank Group.

- **Risques de crédit et de marché** : Le risque de crédit est un risque de perte pour le Barclays Bank Group résultant du défaut des clients privés et professionnels, ou des contreparties, à honorer pleinement leurs obligations envers les membres du Barclays Bank Group. Le Barclays Bank Group est exposé à des risques de variations de la qualité du crédit et des taux de recouvrement des prêts et des avances dus par les emprunteurs et les contreparties dans des portefeuilles spécifiques. Le risque de marché est un risque de perte résultant d'une évolution défavorable potentielle de la valeur des actifs et des passifs du Barclays Bank Group, résultant de fluctuation des variables du marché.
- **Risque opérationnel et de modèle** : Le risque opérationnel expose le Barclays Bank Group à des pertes résultant de processus ou de systèmes inadéquats ou défaillants, de facteurs humains ou d'événements externes (par exemple, la fraude), lorsque la cause profonde n'est pas liée à des risques de crédit ou de marché. Le risque de modèle concerne des conséquences négatives potentielles liées à des évaluations financières ou des décisions fondées sur des résultats et des rapports de modèle incorrects ou mal utilisés.
- **Risque de trésorerie et de capital, et risque que l'Émetteur et le Barclays Bank Group soient soumis à d'importants pouvoirs de résolution** : Le Barclays Bank Group est confronté à trois principaux types de risque de trésorerie et de capital, à savoir (1) le risque de liquidité – le risque que le Barclays Bank Group ne soit pas en mesure de tenir ses obligations contractuelles ou éventuelles ou qu'il ne dispose pas du niveau approprié de financement stable et de liquidité pour soutenir ses actifs, pouvant également subir des changements de notation de crédit ; (2) le risque de capital – le risque que le Barclays Bank Group ait un niveau ou une composition de capital insuffisante ; et (3) le risque de taux d'intérêt dans le portefeuille bancaire – le risque que le Groupe Barclays Bank soit exposé à la volatilité du capital ou des revenus en raison d'une inadéquation entre les expositions aux taux d'intérêt de ses actifs (non négociés) et de ses passifs. En vertu de la loi bancaire (Banking Act), des pouvoirs substantiels sont accordés à la Banque d'Angleterre (ou, dans certaines circonstances, au Trésor de Sa Majesté [HM Treasury]), en consultation avec l'Autorité de régulation prudentielle [Prudential Regulation Authority] du Royaume-Uni, l'Autorité de conduite financière [Financial Conduct Authority] du Royaume-Uni et le Trésor de Sa Majesté, selon le cas, dans le cadre d'un régime spécial de résolution. Ces pouvoirs permettent à la Banque d'Angleterre (ou à tout successeur ou remplaçant de celle-ci et/ou à toute autre autorité du Royaume-Uni ("l'Autorité de résolution") ayant la capacité d'exercer la procédure de renflouement interne du Royaume-Uni (Bail-in Power) pour mettre en œuvre diverses mesures de résolution et options de stabilisation (y compris, mais sans s'y limiter, le "Bail-in Tool") à l'égard d'une banque ou d'une entreprise d'investissement du Royaume-Uni et de certaines de ses filiales (incluant actuellement l'Émetteur) dans des circonstances où l'Autorité de résolution est convaincue que les conditions de résolution pertinentes sont remplies.
- **Risques de conduite, de réputation et juridiques et questions juridiques, de concurrence et de réglementation** : Le risque de conduite est le risque de porter préjudice aux clients privés et professionnels, à l'intégrité du marché, à la concurrence effective ou au Barclays Bank Group par la prestation inappropriée de services financiers, y compris tout cas de faute intentionnelle ou de négligence. Le risque de réputation existe lorsqu'une action, une transaction, un investissement, un événement, une décision ou une relation d'affaires réduit la confiance dans l'intégrité et la compétence du Barclays Bank Group. Le Barclays Bank Group exerce ses activités sur un marché très réglementé qui l'expose à des risques juridiques découlant (i) de la multitude des lois et règlements applicables aux entreprises qu'il opère, qui sont extrêmement dynamiques, pouvant varier d'une juridiction à l'autre, manquant souvent de clarté pour les appliquer dans des circonstances particulières, notamment dans des domaines nouveaux et émergents ; et (ii) de la nature diversifiée et évolutive des activités et des pratiques commerciales du Barclays Bank Group. Dans chaque cas, cela expose le Barclays Bank Group à des risques de pertes ou à des pénalités, des dommages et intérêts ou des amendes pour non-respect des obligations légales respectives, y compris les exigences légales ou contractuelles, des membres du Barclays Bank Group. Le risque juridique dépend d'un certain nombre de facteurs de risque résumés ci-dessus.

INFORMATIONS CLÉS SUR LES VALEURS MOBILIÈRES

Quelles sont les principales caractéristiques des Valeurs mobilières ?

Type et catégorie de valeurs mobilières offertes et admises à la négociation, y compris les numéros d'identification des valeurs mobilières

Les Valeurs mobilières se présenteront sous la forme de Notes et seront identifiés de manière unique par : Numéros de série : NX000274894 ; ISIN : FR0014001ZG6 ; Code commun : 230015686.

Les Valeurs mobilières seront compensées et réglées par Clearstream Banking *société anonyme* ou Euroclear France S.A.

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

Les Valeurs mobilières seront émises en euros ("**EUR**") (la "devise d'émission") et réglées dans la même devise (la "**de vise de règlement**"). Les Valeurs mobilières sont négociables en valeur nominale et la valeur nominale spécifiée par titre est de 1 000 euros. La taille de l'émission est 30 000 000 d'euros. Le prix d'émission est de 100 % de la dénomination spécifiée.

La date d'émission est le 8 mars 2021 (la "**date d'émission**"). Sous réserve d'une résiliation anticipée, le remboursement des Valeurs mobilières est prévu le 14 juillet 2026 (la "**date de règlement prévue**").

Droits attachés aux Valeurs mobilières

Produit potentiel : Les Valeurs mobilières donneront à chaque détenteur le droit de recevoir un produit potentiel sur ces valeurs, ainsi que certains droits accessoires tels que le droit de recevoir une notification de certaines décisions et de certains événements et le droit de voter certaines (mais pas toutes) modifications des conditions des Valeurs mobilières. Le produit potentiel prendra la forme suivante : (i) un ou plusieurs montants des intérêts, (ii) un montant de règlement en espèces du produit de la vente Autocall, et/ou (iii) un montant de règlement en espèces final, étant entendu que si les Valeurs mobilières sont résiliées de manière anticipée, le produit potentiel peut être remplacé par (i) un montant de règlement en espèces anticipé.

Fiscalité : Tous les paiements relatifs aux Valeurs mobilières seront effectués sans retenue ni déduction au titre de tout impôt britannique, à moins qu'une telle retenue ou déduction ne soit exigée par la loi. Si une telle retenue ou déduction était exigée par la loi, l'Émetteur sera, sauf dans des circonstances limitées, tenu de payer des montants supplémentaires pour couvrir les montants ainsi retenus ou déduits.

Cas de défaillance : Si l'Émetteur n'effectue pas un ou plusieurs paiements dus au titre des Valeurs mobilières ou s'il enfreint toute autre condition et porte ainsi préjudice aux intérêts des détenteurs (et sans remédier 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, que l'Émetteur ne puisse pas payer une disposition légale impérative) les Valeurs mobilières deviendront immédiatement dues et exigibles, sur notification du représentant des détenteurs regroupés ensemble.

Limitations des droits

Remboursement anticipé après certains événements perturbateurs ou pour cause d'illégalité ou d'impraticabilité : L'Émetteur peut racheter les Valeurs mobilières avant leur date de règlement prévue après certains événements perturbateurs ou extraordinaires subis par l'Émetteur, ses dispositifs de couverture, le ou les Actifs sous-jacents, la fiscalité ou la devise pertinente des Valeurs mobilières, ou s'il détermine que l'exécution de l'une de ses obligations au titre des Valeurs mobilières est illégale. Si cela se produit, les investisseurs recevront un "montant de règlement anticipé en espèces" égal à la juste valeur marchande des Valeurs mobilières avant leur remboursement.

Limitations supplémentaires :

- Bien que les Valeurs mobilières soient liées à la performance d'Actifs sous-jacents, les détenteurs n'ont aucun droit sur aucun des Actifs sous-jacents.
- Les conditions générales des Valeurs mobilières permettent à l'Émetteur et à l'Agent de détermination (selon le cas), après certains événements et dans certaines circonstances, sans le consentement des détenteurs, d'apporter des ajustements aux conditions générales des Valeurs mobilières, de rembourser des Valeurs mobilières avant la date de maturité, de remplacer l'Émetteur par une autre entité autorisée sous réserve de conditions spécifiques, et de prendre certaines autres mesures concernant les Valeurs mobilières.
- Les Valeurs mobilières incluent des dispositions applicables à la convocation d'assemblées de détenteurs pour examiner des questions affectant leurs intérêts en général. Ces dispositions permettent à des majorités définies de contraindre 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.

Législation applicable

Les Valeurs mobilières seront régies par le droit français et les droits qui en découlent seront interprétés en conséquence.

Description du calcul du rendement potentiel des Valeurs mobilières

Actifs sous-jacents : Le rendement et la valeur des Valeurs mobilières dépendent de la performance de l'Actif sous-jacent suivant :

Actif sous-jacent :	Type	Prix initial	Date de valorisation initiale
Indice EURO STOXX 50®	Indice	Prix de valorisation de cet Actif sous-jacent à la date de valorisation initiale	30 juin 2021

Pour déterminer un montant d'intérêt, "Actif sous-jacent" signifie l'Actif sous-jacent. Pour déterminer un événement de remboursement automatique (Autocall), "Actif sous-jacent" signifie l'Actif sous-jacent. Pour déterminer le montant final du règlement en espèces, "Actif sous-jacent" signifie l'Actif sous-jacent.

Montant du calcul : Les calculs des montants payables au titre des Valeurs mobilières sont effectués par référence au "Montant du calcul", soit 1 000 euros.

Montants indicatifs : Si les Valeurs mobilières sont offertes dans le cadre d'une offre publique et que les valeurs des produits spécifiés ne sont pas fixées ou déterminées au début de l'offre publique (y compris tout montant, niveau, pourcentage, prix, taux ou autre valeur en rapport avec les conditions des Valeurs mobilières qui n'a pas été fixé ou déterminé au début de l'offre publique), ces valeurs des produits spécifiés seront un montant indicatif, un montant minimum indicatif, un montant maximum indicatif ou un montant indicatif ou toute combinaison de ceux-ci. Dans ce cas, la (les) valeur(s) de produit spécifiée(s) pertinente(s) est (sont) la valeur déterminée sur la base des conditions du marché par l'Émetteur à la fin ou vers la fin de l'offre publique. L'avis de la valeur du produit concerné sera publié avant la date d'émission.

Agent de détermination : Barclays Bank PLC sera désignée pour effectuer les calculs et prendre les décisions concernant les Valeurs mobilières.

A – Intérêts

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

- (1) multiplier le taux fixe de 1,50 % par 1 000 euros ; et ensuite
- (2) multiplier le résultat par le nombre correspondant à cette date de valorisation des intérêts (soit le nombre dans la colonne "T" dans le tableau ci-dessous).

Chaque date de paiement des intérêts, la date de valorisation des intérêts correspondante, la valeur correspondante dans la colonne T et les barrières d'intérêts sont les suivants :

T	Date de règlement des intérêts	Dates de valorisation des intérêts	Pourcentage de la barrière d'intérêts
2	14 juillet 2022	30 juin 2022	100%
3	16 janvier 2023	30 décembre 2022	100%
4	14 juillet 2023	30 juin 2023	100%
5	16 janvier 2024	02 janvier 2024	100%
6	15 juillet 2024	01 juillet 2024	100%
7	14 janvier 2025	30 décembre 2024	100%
8	14 juillet 2025	30 juin 2025	100%
9	14 janvier 2026	30 décembre 2025	100%
10	14 juillet 2026	30 juin 2026	70%

B – Remboursement automatique (Autocall)

Les Valeurs mobilières seront automatiquement remboursées si le prix de clôture ou le niveau de l'Actif sous-jacent divisé par son prix initial est égal ou supérieur au pourcentage de sa barrière Autocall correspondante à toute date de valorisation Autocall. Dans ce cas, vous recevrez un montant de règlement en espèces Autocall égal au Montant du calcul multiplié par 100 % payable à la date de règlement Autocall correspondante à la date de valorisation Autocall. La date de règlement Autocall pertinente peut être reportée lorsque la date de valorisation Autocall a été reportée après un événement perturbateur.

Date de valorisation Autocall	Date de règlement Autocall	Pourcentage de la barrière Autocall
-------------------------------	----------------------------	-------------------------------------

30 juin 2022	14 juillet 2022	100%
30 décembre 2022	16 janvier 2023	100%
30 juin 2023	14 juillet 2023	100%
02 janvier 2024	16 janvier 2024	100%
01 juillet 2024	15 juillet 2024	100%
30 décembre 2024	14 janvier 2025	100%
30 juin 2025	14 juillet 2025	100%
30 décembre 2025	14 janvier 2026	100%

C – Règlement final

Si les Valeurs mobilières n'ont pas été remboursées autrement, chaque valeur mobilière sera remboursée à la date de règlement prévue par le paiement du montant final du règlement en espèces.

La date de règlement prévue peut être reportée lorsque la date de valorisation finale a été reportée après un événement perturbateur.

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

- (i) si la performance finale est supérieure ou égale au pourcentage de la barrière activante (soit 70 %), 100 % multiplié par le Montant du calcul ;
- (ii) sinon, un montant calculé en divisant la performance finale par le pourcentage du prix d'exercice (soit 100 %) et en multipliant le résultat par le Montant du calcul.

Où :

"**Performance finale**" signifie le prix de valorisation final divisé par le prix initial (règlement).

"**Date de valorisation finale**" signifie le 30 juin 2026, sous réserve d'ajustement.

"**Prix de valorisation final**" signifie, pour l'Actif sous-jacent, le niveau de l'Actif sous-jacent à la clôture à la date finale de valorisation.

Statut des Valeurs mobilières :

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

Description des restrictions applicables sur la libre transférabilité des Valeurs mobilières

Les Valeurs mobilières sont offertes et vendues en dehors des États-Unis à des personnes non américaines sur la base du Règlement S de la loi sur les Valeurs mobilières (Securities Act) et doivent respecter les restrictions de transfert exigées par les États-Unis. Les Valeurs mobilières détenues dans un système de compensation seront transférées conformément aux règles, procédures et règlements de ce système de compensation. Sous réserve de ce qui précède, les Valeurs mobilières seront librement transférables.

Où les Valeurs mobilières seront-elles négociées ?

Il est prévu que la demande sera présentée par l'Émetteur (ou en son nom) pour que les Valeurs mobilières soient admises sur le marché réglementé de la Bourse de Luxembourg.

Quels sont les principaux risques spécifiques aux Valeurs mobilières ?

Les Valeurs mobilières sont exposées aux principaux risques suivants :

- **Vous pouvez perdre une partie ou la totalité de votre investissement dans les Valeurs mobilières :** Les conditions des Valeurs mobilières ne prévoient pas de paiement minimum à la date de maturité. Par conséquent, en fonction de la performance du ou des Actifs sous-jacents, vous pouvez perdre tout ou partie de votre investissement. Vous pouvez aussi perdre une partie ou la totalité de votre investissement si : (a) vous vendez vos Valeurs mobilières avant leur date de maturité ou avant leur date d'expiration prévue ; (b) vos Valeurs mobilières sont remboursées par

anticipation dans certaines circonstances extraordinaires ; ou (c) les conditions de vos Valeurs mobilières 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 Valeurs mobilières :** La valeur marchande de vos Valeurs mobilières peut être [considérablement] inférieure au prix d'émission, car le prix d'émission peut tenir compte de la marge bénéficiaire et des coûts de l'Émetteur et/ou du distributeur, en plus de la juste valeur marchande des Valeurs mobilières. La valeur marchande de vos Valeurs mobilières peut être affectée par la volatilité, le niveau, la valeur ou le prix du ou des Actifs sous-jacents à la date prise en considération, les variations des taux d'intérêt, la situation financière et les notations de crédit de l'Émetteur, l'offre et la demande de Valeurs mobilières, le temps restant avant la maturité ou l'expiration des Valeurs mobilières et d'autres facteurs. Le prix auquel vous pourrez, le cas échéant, vendre vos Valeurs mobilières avant leur maturité peut être sensiblement inférieur au montant que vous avez investi à l'origine. Vos Valeurs mobilières peuvent ne pas avoir un marché de négociation actif et l'Émetteur ne peut être tenu de créer un marché ou de racheter les Valeurs mobilières avant leur remboursement. L'Émetteur peut retirer l'offre publique à tout moment. Dans ce cas, si vous avez déjà payé ou livré des sommes de souscription pour les Valeurs mobilières concernés, vous aurez droit au remboursement de ces montants, mais vous ne recevrez aucune rémunération qui aurait pu être accumulée pendant la période entre le paiement ou la livraison de ces sommes et le remboursement des Valeurs mobilières.

- **Vous êtes exposés aux risques liés à la détermination du montant payable pour les Valeurs mobilières :**

Les Valeurs mobilières portent intérêt à un taux lié à la performance de l'Actif sous-jacent et qui peut varier d'une date de paiement des intérêts à l'autre. Il est possible vous ne receviez aucun paiement d'intérêts si l'Actif sous-jacent n'a pas généré la performance attendue.

- **Vos Valeurs mobilières sont sujets à des ajustements et à un remboursement anticipé :** Conformément aux conditions générales des Valeurs mobilières, suite à 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 Valeurs mobilières, l'Agent de détermination ou l'Émetteur peut prendre un certain nombre de mesures correctives, notamment l'estimation du niveau de l'Actif sous-jacent, le remplacement de l'Actif sous-jacent et des ajustements aux conditions générales des Valeurs mobilières. Chacune de ces mesures correctives peut modifier les caractéristiques économiques des Valeurs mobilières et avoir un effet négatif important sur leur valeur et leur rendement. Si aucune mesure corrective ne peut être prise, ou s'il est déterminé que l'exécution de l'une des obligations de l'Émetteur en vertu des Valeurs mobilières est illégale, l'Émetteur peut rembourser par anticipation les Valeurs mobilières en versant un montant de règlement anticipé en espèces. En cas de remboursement anticipé, vous pouvez perdre une partie ou la totalité de votre investissement car le montant du remboursement anticipé en espèces peut être inférieur au prix auquel vous avez acheté les Valeurs mobilières, ou peut même être nul. Vous perdrez également la possibilité de participer à toute performance positive ultérieure des Actifs sous-jacents et serez incapable de réaliser des gains potentiels sur la valeur des Valeurs mobilières. Il se peut que vous ne puissiez pas réinvestir le produit d'un investissement à un rendement comparable et/ou avec un taux de coupon ou d'intérêt comparable avec un niveau de risque similaire.

- **Risques fiscaux :** Les niveaux et la base d'imposition des Valeurs mobilières et tout allègement fiscal afférent dépendront de votre situation personnelle et pourraient changer à tout moment pendant la durée de vie des Valeurs mobilières. Ces risques représentent un potentiel de conséquences négatives. Vous devriez donc consulter vos propres conseillers fiscaux pour comprendre clairement les conséquences fiscales que ces transactions sur des Valeurs mobilières pourraient avoir au niveau personnel.

- **Conflits d'intérêts potentiels :** Des conflits d'intérêts peuvent exister lorsque la Barclays Bank PLC ou sa filiale : (i) agit en plusieurs capacités en ce qui concerne les Valeurs mobilières (par exemple, en tant qu'Émetteur, Gestionnaire, 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 en vertu des Valeurs mobilières à mesure que celles-ci arrivent à maturité ; et (iii) utilise ses trading desks comme source de prix pour un Actif sous-jacent. À la lumière de ces conflits, les mesures prises ou les décisions prises par Barclays Bank PLC en rapport

avec les Valeurs mobilières peuvent ne pas toujours être dans le meilleur intérêt des détenteurs. Outre les opérations de couverture, Barclays Bank PLC peut négocier les Actifs sous-jacents dans le cours normal de ses activités. De telles opérations de trading pourrait affecter le prix du marché des Actifs sous-jacents, ce qui pourrait à son tour avoir un effet négatif important sur la valeur et le rendement de vos propres Valeurs mobilières.

INFORMATIONS CLES SUR L'OFFRE DE VALEURS MOBILIERES AU PUBLIC ET/OU L'ADMISSION A LA NEGOCIATION SUR UN MARCHE REGLEMENTE

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

Conditions générales de l'offre

Les Valeurs mobilières sont offertes en France pendant la période allant du 8 mars 2021 (inclus) au 30 juin 2021 (exclu) (la "période d'offre") et cette offre est soumise aux conditions suivantes :

- Prix de l'offre : 100% du prix de l'émission
- Conditions auxquelles l'offre est soumise : L'Émetteur se réserve le droit de retirer l'offre de Valeurs mobilières à tout moment avant la fin de la période d'offre. Après le retrait de l'offre, si des demandes ont été présentées par des investisseurs potentiels, aucun de ces investisseurs potentiels n'aura pas le droit de souscrire ou d'acquérir autrement les Valeurs mobilières 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 demande : Une offre de Valeurs mobilières autre que celle prévue à l'article 1(4) du Règlement sur le Prospectus peut être faite par le Gestionnaire 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 : Les montants minimum et maximum de la demande de l'Offrant autorisé seront communiqués aux investisseurs par l'Offrant autorisé.
- Description de la possibilité de réduire les souscriptions et arrangements pour rembourser tout montant excédent payé par des demandeurs : Non applicable.
- Détails sur la méthode, les délais de paiement et de remise des Valeurs mobilières : L'Offrant autorisé communiquera aux investisseurs l'attribution de leurs Valeurs mobilières et des modalités de règlement afférentes.
- Méthodes et canaux de communication au public des résultats de l'offre : L'Offrant autorisé communiquera aux investisseurs l'attribution de leurs Valeurs mobilières et les arrangements afférents à leur règlement.
- 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 à qui des Valeurs mobilières ont été proposées et si une ou des tranche(s) ont été réservées pour certains pays : Les offres peuvent être faites à toute personne par l'intermédiaire de l'Offrant autorisé dans la juridiction de l'offre publique. Des offres (le cas échéant) dans d'autres pays de l'EEE ne pourront être faites que par l'intermédiaire de l'Offrant autorisé en vertu d'une exemption de l'obligation de publier un prospectus, telle que prévue par le Règlement sur les Prospectus tel qu'il est appliqué dans ces pays.
- Procédure de notification aux demandeurs du montant octroyé et indication de l'éventuel démarrage des opérations avant notification : L'Offrant autorisé communiquera directement aux demandeurs le succès de leur demande. Aucune transaction impliquant les Valeurs mobilières ne peut avoir lieu avant la date d'émission.
- Nom(s) et adresse(s) des placeurs, dans la mesure où ils sont connus de l'Émetteur, dans les différents pays où l'offre est disponible : TP ICAP (EUROPE) SA, ayant son adresse en France, République française, PARIS, 89-91, rue du Faubourg Saint-Honoré, 75008. Son identifiant d'entité légale est 213800R54EFFINMY1P02.

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

L'Émetteur n'imputera aucun frais aux détenteurs en relation avec l'émission des Valeurs mobilières.

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

Voir la section sur L'Offrant autorisé, ci-dessus.

Pourquoi le Prospectus est-il produit ?

Utilisation et montant net estimé du produit réalisé

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

Accord de souscription sur une base d'engagement ferme

L'offre des Valeurs mobilières n'est pas soumise à un Accord de souscription sur une base d'engagement ferme.

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

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

L'Offrant autorisé recevra une commission globale égale à 2,00% du Prix d'émission. Tout Offrant autorisé et ses affiliés peuvent s'engager maintenant et à l'avenir dans des opérations de couverture concernant l'Actif sous-jacent.