

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

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

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



BARCLAYS BANK PLC

(Incorporated with limited liability in England and Wales)

Legal Entity Identifier (LEI): G5GSEF7VJP5I7OUK5573

Up to EUR 30,000,000 Securities due August 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 Regulation (EU) 2017/1129 (as amended, the "**EU Prospectus Regulation**") and is prepared in connection with the Global Structured Securities Programme established by Barclays Bank PLC (the "**Issuer**"). These Final Terms complete and should be read in conjunction with the GSSP Base Prospectus 9 which constitutes a base prospectus drawn up as separate documents (including the Registration Document dated 23 March 2021 and the Securities Note relating to the GSSP Base Prospectus 9 dated 1 July 2021 for the purposes of Article 8(6) of the EU Prospectus Regulation (the "**Base Prospectus**"), which constitutes a base prospectus for the purposes of the EU Prospectus Regulation. Full information on the Issuer and the offer of the Securities is only available on the basis of the combination of this Final Terms and the Base Prospectus.

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

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

BARCLAYS

Final Terms dated 2 July 2021

PART A – CONTRACTUAL TERMS

Provisions relating to the Securities

1. (a) Series: NX000292196
- (b) Tranche: 1
2. Currencies:
 - (a) Issue Currency: Euro (“EUR”)
 - (b) Settlement Currency: EUR
3. Securities: Notes
4. Notes: Applicable
 - (a) Aggregate Nominal Amount as at the Issue Date:
 - (i) Tranche: Up to EUR 30,000,000
 - (ii) Series: Up to EUR 30,000,000
 - (b) Specified Denomination: EUR 1,000
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 2.50% 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: 5 August 2021
9. Scheduled Settlement Date: 19 August 2026
10. Type of Security: Equity Index Linked Securities
11. Underlying Performance Type_(Interest): Worst-of
12. Underlying Performance Type_(Autocall): Worst-of
13. Underlying Performance Type_(Settlement): For the purpose of determination of the Final Performance: Best-of
14. Downside Underlying Performance Type_(Settlement): For the purpose of determination of the Final Performance: Worst-of

Provisions relating to interest (if any) payable

15. Interest Type: Digital (Bullish with memory feature)
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

Interest Valuation Date	Interest Payment Date
7 February 2022	21 February 2022
5 August 2022	19 August 2022
6 February 2023	20 February 2023
7 August 2023	21 August 2023
5 February 2024	19 February 2024
5 August 2024	19 August 2024
5 February 2025	19 February 2025
5 August 2025	19 August 2025
5 February 2026	19 February 2026
5 August 2026	19 August 2026

- (c) (i) Fixed Interest Type: Fixed Amount
- (ii) Fixed Interest Rate: 2.25%
- (d) Information relating to the Floating Rate: Not Applicable
- (e) Interest Barrier Percentage: 60.00%

Provisions relating to Automatic Settlement (Autocall)

16. 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
7 February 2022	21 February 2022
5 August 2022	19 August 2022
6 February 2023	20 February 2023
7 August 2023	21 August 2023
5 February 2024	19 February 2024
5 August 2024	19 August 2024
5 February 2025	19 February 2025
5 August 2025	19 August 2025
5 February 2026	19 February 2026

Provisions relating to Optional Early Redemption

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

Provisions relating to Final Settlement

18. (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: 60.00 per cent.
- (f) Downside: Applicable

Provisions relating to Drop Back

19. Drop Back Payout: General Condition 9.39 and General Condition 12.27 Not Applicable

Provisions relating to Nominal Call Event Settlement

20. 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

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

Provisions relating to the Underlying Asset(s)

22. Underlying Asset:
- (a) Initial Valuation Date: 5 August 2021
- (b) Index: Each Index as set out in Table 3 below in the column entitled 'Index'
- (i) Exchange: In respect of each Index, Multi-exchange Index
- (ii) Related Exchange: In respect of each Index, all Exchanges
- (iii) Underlying Asset Currency: In respect of each Index, EUR
- (iv) Bloomberg Screen: Each Bloomberg Screen set out in Table 3 below in the column entitled 'Bloomberg Screen'
- (v) Refinitiv Screen: In respect of each Index, Not Applicable
- (vi) Index Sponsor: In respect of each Index, STOXX Limited
- (vii) Weight: Not Applicable
- (viii) Pre-nominated Index: Not Applicable

Table 3

Underlying Asset	Bloomberg Screen
STOXX Europe 600 Travel & Leisure	SXTP <Index>
STOXX Europe 600 Industrial Goods & Services	SXNP <Index>
STOXX Europe 600 Banks	SX7P <Index>
STOXX Europe 600 Automobiles & Parts	SXAP <Index>

23. (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
24.	(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
25.	(a) Final Valuation Price:	The Valuation Price of the Underlying Asset on the Final Valuation Date
	(i) Averaging-out:	Not Applicable
	(ii) Min Lookback-out:	Not Applicable
	(iii) Max Lookback-out:	Not Applicable
	(b) Final Valuation Date:	5 August 2026

Provisions relating to disruption events

26.	Consequences of a Disrupted Day (in respect of an Averaging Date or Lookback Date): General Condition 18 (<i>Consequences of Disrupted Days</i>)	
	(a) Omission:	Not Applicable
	(b) Postponement:	Not Applicable
	(c) Modified Postponement:	Not Applicable
27.	Consequences of a Disrupted Day (in respect of an Averaging Date or Lookback Date): General Condition 25 (<i>Adjustments to Valuation Dates and Reference Date</i>)	
	(a) Omission:	Not Applicable
	(b) Postponement:	Not Applicable
28.	Consequences of a Disrupted Day (in respect of an Averaging Date or Lookback Date): General Condition 37 (<i>Consequences upon a Reference Date becoming a Reference Date</i>)	
	(a) Omission:	Not Applicable
	(b) Postponement:	Not Applicable

(c) Modified Postponement:	Not Applicable
29. Additional Disruption Events: General Condition 65.1 (Definitions)	
(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:	Applicable as per General Condition 65.1 (Definitions)
(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
(o) Barclays Index Disruption:	Not Applicable
30. Early Cash Settlement Amount:	Market Value
31. Early Settlement Notice Period Number:	As specified in General Condition 65.1 (Definitions)
32. Substitution of Shares:	Not Applicable
33. Entitlement Substitution:	Not Applicable
34. FX Disruption Event:	Not Applicable
35. Unwind Costs:	Applicable
36. Settlement Expenses:	Not Applicable
37. Local Jurisdiction Taxes and Expenses:	Not Applicable
38. Consequences of a Fund Event: General Condition 27 (Consequences of a Fund Event)	Not Applicable

General provisions

39. 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
40. Trade Date:	1 June 2021
41. Additional Business Centre(s):	Not Applicable
42. 871(m) Securities:	The Issuer has determined that Section 871(m) of the US Internal Revenue Code is not applicable to the Securities.
43. (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
44. Prohibition of Sales to Swiss Retail Investors:	Applicable – see the cover page of these Final Terms
45. Business Day Convention:	Modified Following
46. Determination Agent:	Barclays Bank PLC
47. Registrar:	Not Applicable
48. Transfer Agent:	Not Applicable
49. (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
50. Registration Agent:	Not Applicable
51. Governing Law:	English law
52. Relevant Benchmarks:	Amounts payable under the Securities are calculated by reference to STOXX Europe 600 Travel & Leisure which is provided by STOXX Limited (the " Administrator "). As at the date of this Final Terms, the Administrator appears on the register of administrators and benchmarks established and maintained by the European Securities and Markets Authority (" ESMA ") pursuant to Article 36 of Regulation (EU) 2016/1011 (as amended, the " EU Benchmarks Regulation "). Amounts payable under the Securities are calculated by reference to STOXX Europe 600 Industrial Goods & Services which is provided by STOXX Limited (the " Administrator "). As at the

date of this Final Terms, the Administrator appears on the register of administrators and benchmarks established and maintained by the European Securities and Markets Authority ("**ESMA**") pursuant to Article 36 of Regulation (EU) 2016/1011 (as amended, the "**EU Benchmarks Regulation**").

Amounts payable under the Securities are calculated by reference to STOXX Europe 600 Banks which is provided by STOXX Limited (the "**Administrator**"). As at the date of this Final Terms, the Administrator appears on the register of administrators and benchmarks established and maintained by the European Securities and Markets Authority ("**ESMA**") pursuant to Article 36 of Regulation (EU) 2016/1011 (as amended, the "**EU Benchmarks Regulation**").

Amounts payable under the Securities are calculated by reference to STOXX Europe 600 Automobiles & Parts which is provided by STOXX Limited (the "**Administrator**"). As at the date of this Final Terms, the Administrator appears on the register of administrators and benchmarks established and maintained by the European Securities and Markets Authority ("**ESMA**") pursuant to Article 36 of Regulation (EU) 2016/1011 (as amended, the "**EU Benchmarks Regulation**").

PART B – OTHER INFORMATION

1. LISTING AND ADMISSION TO TRADING

- (a) Listing and Admission to Trading: Application has been made/is expected to be made to the Irish Stock Exchange plc trading as Euronext Dublin for the securities to be admitted to the official list and trading on its regulated market with effect from the Issue Date.
- (b) Estimate of total expenses related to admission to trading: EUR 1,000
- (c) Name and address of the entities which have a firm commitment to act as intermediaries in secondary trading, providing liquidity through bid and offer rates and a description of the main terms of their commitment: Not Applicable

2. RATINGS

Ratings: The Securities have not been individually rated.

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

- (a) Reasons for the offer: General funding
- (b) Use of proceeds: Not Applicable

4. YIELD

Not Applicable

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

Bloomberg Screen:

SXTP <Index>

SXNP <Index>

SX7P <Index>

SXAP <Index>

Index Disclaimers: see Schedule hereto

6. POST ISSUANCE INFORMATION

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

7. OPERATIONAL INFORMATION

- (a) ISIN: XS2279165596
- (b) Common Code: 227916559

- | | |
|-------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| (c) Relevant Clearing System(s) | Euroclear, Clearstream |
| (d) Delivery: | Delivery against payment |
| (e) Name and address of additional Paying Agent(s): | Not Applicable |
| (f) Green Securities: | No |
| (g) Green Structured Notes: | No |
| (h) Intended to be held in a manner which would allow Eurosystem eligibility: | No since unsecured debt instruments issued by credit institutions established outside the European Union are not Eurosystem eligible. |

8. TERMS AND CONDITIONS OF THE OFFER

8.1 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 in the Public Offer Jurisdiction(s) (specified in (c) immediately below) during the Offer Period (specified in (d) immediately below) subject to the conditions set out in the Base Prospectus and in (e) immediately below |
| (b) Name(s) and address(es), to the extent known to the Issuer, of the placers in the various countries where the offer takes place (together the " Authorised Offeror(s) "): | Each financial intermediary specified in (i) and (ii) below: <ul style="list-style-type: none"> (i) Specific consent: Banco BPI SA, Largo Jean Monnet, n.1, 4th floor, 1269-067 Lisbon, Portugal (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-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) "): | Portugal |
| (d) Offer period for which use of the Base Prospectus is authorised by the Authorised Offeror(s) (the " Offer Period "): | From and including 2 July 2021 to but excluding 3 August 2021 |
| (e) Other conditions for use of the Base Prospectus by the Authorised Offeror(s): | Not Applicable |

Other terms and conditions of the offer

(f) Offer Price:	The Issue Price
(g) Total amount of offer:	Up to EUR 30,000,000
(h) 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>
(i) Time period, including any possible amendments, during which the offer will be open and description of the application process:	From and including 2 July 2021 to but excluding 3 August 2021.
(j) 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 1(4) of the EU Prospectus Regulation in Portugal (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>
(k) Details of the minimum and/or maximum amount of application:	The minimum and maximum amount of application from the Authorised Offeror will be notified to investors by the Authorised Offeror.
(l) Description of possibility to reduce subscriptions and manner for refunding excess amount paid by applicants:	Not Applicable
(m) Details of method and time limits for paying up and delivering the Securities:	Investors will be notified by the Authorised Offeror of their allocations of Securities and the settlement arrangements in respect thereof.
(n) Manner in and date on which results of the offer are to be made public:	Investors will be notified by the Authorised Offeror of their allocations of Securities and the settlement arrangements in respect thereof.
(o) Procedure for exercise of any right of pre-emption, negotiability of subscription rights and treatment of subscription rights not exercised:	Not Applicable
(p) Whether tranche(s) have been reserved for certain countries:	Offers may be made through the Authorised Offeror in the Public Offer Jurisdiction to any person. Offers (if any) in other EEA countries will only be made through

the Authorised Offeror pursuant to an exemption from the obligation under the Prospectus Regulation as implemented in such countries to publish a prospectus.

- (q) Process for notification to applicants of the amount allotted and indication whether dealing may begin before notification is made: Applicants will be notified directly by the Authorised Offeror of the success of their application. No dealings in the Securities may take place prior to the Issue Date.
- (r) Amount of any expenses and taxes specifically charged to the subscriber or purchaser: Prior to making any investment decision, investors should seek independent professional advice as they deem necessary.
- (s) Name(s) and address(es), to the extent known to the Issuer, of the placers in the various countries where the offer takes place: Banco BPI SA, Rua Tenente Valadim, 284 - 4100-476 Porto, Portugal

Schedule

STOXX 600 Travel & Leisure® Index (the "Index")

The Index is the intellectual property (including registered trademarks) of STOXX Limited, Zurich, Switzerland and/or Dow Jones & Company, Inc., a Delaware corporation, New York, USA, (the "Licensors") which is used under license. 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.

STOXX 600 Industrial Goods & Services® Index (the "Index")

The Index is the intellectual property (including registered trademarks) of STOXX Limited, Zurich, Switzerland and/or Dow Jones & Company, Inc., a Delaware corporation, New York, USA, (the "Licensors") which is used under license. 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.

STOXX 600 Banks® Index (the "Index")

The Index is the intellectual property (including registered trademarks) of STOXX Limited, Zurich, Switzerland and/or Dow Jones & Company, Inc., a Delaware corporation, New York, USA, (the "Licensors") which is used under license. 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.

STOXX 600 Automobiles & Parts® Index (the "Index")

The Index is the intellectual property (including registered trademarks) of STOXX Limited, Zurich, Switzerland and/or Dow Jones & Company, Inc., a Delaware corporation, New York, USA, (the "Licensors") which is used under license. 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 30,000,000 Securities due August 2026 pursuant to the Global Structured Securities Programme pursuant to the Global Structured Securities Programme] (ISIN: XS2279165596) (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 Banco BPI SA with its address at Rua Tenente Valadim, 284 - 4100-476 Porto, Portugal (telephone number: +351 22 207 50 00) and its LEI is 3DM5DPGI3W6OU6GJ4N92.

Competent authority: The Base Prospectus was approved on 1 July 2021 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 corporate and investment bank. The Group comprises of Barclays PLC together with its subsidiaries, including the Issuer. The Issuer's principal activity is to offer products and services designed for larger corporate, wholesale and international banking clients. The term the "**Group**" mean Barclays PLC together with its subsidiaries and the term "**Barclays Bank Group**" means Barclays Bank PLC together with its subsidiaries

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

Identity of the key managing directors of the Issuer: The key managing directors of the Issuer are James Staley (Chief Executive Officer and Executive Director) and Tushar Morzaria (Executive Director).

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

What is the key financial information regarding the Issuer?

The Issuer has derived the selected consolidated financial information included in the table below for the years ended 31 December 2020 and 31 December 2019 from the annual consolidated financial statements of the Issuer for the years ended 31 December 2020 and 2019 (the "Financial Statements"), which have each been audited with an unmodified opinion provided by KPMG.

Consolidated Income Statement

	As at 31 December	
	2020	2019
	(£m)	
Net interest income.....	3,160	3,907
Net fee and commission income	5,659	5,672
Credit impairment charges	(3,377)	(1,202)
Net trading income	7,076	4,073
Profit before tax.....	3,075	3,112
Profit/(loss) after tax.....	2,451	2,780

Consolidated Balance Sheet

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

Certain Ratios from the Financial Statements

	As at 31 December	
	2020	2019
	(%)	
Common Equity Tier 1 capital	14.2	13.9
Total regulatory capital	21.0	22.1
CRR leverage ratio	3.9	3.9

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

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

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

KEY INFORMATION OF THE SECURITIES

What are the main features of the Securities?

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

The Securities will be in the form of notes and will be uniquely identified by: NX000292196; Tranche number:1; ISIN: XS2279165596; Common Code: 227916559.

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 30,000,000. The issue price is 100% of the Specified Denomination.

The issue date is 5 August 2021 (the "Issue Date"). Subject to early termination, the Securities are scheduled to redeem on 19 August 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 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 an Early Cash Settlement Amount, instead.

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

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

Limitations on rights

Early redemption following certain disruption events or due to unlawfulness or impracticability: The Issuer may redeem the Securities prior to their Scheduled Settlement Date following the occurrence of certain disruption events or extraordinary events concerning the Issuer, its hedging arrangements, the Underlying Asset(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 ^(Interest) _(Settlement)	Initial Valuation Date
STOXX Europe 600 Travel & Leisure (Bloomberg Code: SXTL <Index>)	Index	The Valuation Price of the Underlying Asset on the Initial Valuation Date	5 August 2021
STOXX Europe 600 Industrial Goods & Services (Bloomberg Code: SXNP <Index>)	Index	The Valuation Price of the Underlying Asset on the Initial Valuation Date	5 August 2021
STOXX Europe 600 Banks (Bloomberg Code: SX7P <Index>)	Index	The Valuation Price of the Underlying Asset on the Initial Valuation Date	5 August 2021
STOXX Europe 600 Automobiles & Parts (Bloomberg Code: SXAP <Index>)	Index	The Valuation Price of the Underlying Asset on the Initial Valuation Date	5 August 2021

For the purposes of determining an Interest Amount, Underlying Assets shall mean the Underlying Assets, for the purposes of determining Automatic Settlement (Autocall) Event, Underlying Assets shall mean the Underlying Assets, for the purposes of determining the Final Cash Settlement Amount, Underlying Assets shall mean the Underlying Assets and for the purposes of determining the Downside Final Performance and the relevant terms and definitions, Underlying Assets shall mean the Underlying Assets.

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 Date*	Interest Valuation Dates	Interest Barrier Percentage
21 February 2022	7 February 2022	60%
19 August 2022	5 August 2022	60%
20 February 2023	6 February 2023	60%
21 August 2023	7 August 2023	60%
19 February 2024	5 February 2024	60%
19 August 2024	5 August 2024	60%

19 February 2025	5 February 2025	60%
19 August 2025	5 August 2025	60%
19 February 2026	5 February 2026	60%
19 August 2026	5 August 2026	60%

*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 will be calculated in respect of each Interest Valuation Date and will depend on and is calculated as follows:

- (i) If the Modified Performance is greater than or equal to the corresponding Interest Barrier Percentage, the Interest Amount is calculated as the sum of (a) the Fixed Interest Rate (being 2.25%) multiplied by the Calculation Amount, and (b) the number of previous Interest Valuation Dates in respect of which no interest was payable (after which interest shall be considered to have been payable in respect of such previous Interest Valuation Date(s)) multiplied by the Fixed Interest Rate and then multiplied by the Calculation Amount; or
- (ii) otherwise, the Interest Amount is zero.

Where:

"**Asset Performance**" means, in respect of an Underlying Asset and in respect of an Interest Valuation Date, the Final Valuation Price or any other day, the Interest Valuation Price, the Final Valuation Price or the Valuation Price, respectively, divided by the Initial Price_(Interest) of such Underlying Asset.

"**Modified Performance**" means, in respect of an Interest Valuation Date the Interest Valuation Price on such day divided by the Initial Price_(Interest), in respect of the Worst Performing Underlying Asset as calculated in respect of such Interest Valuation Date.

"**Initial Price**_(Interest)" means as stated above in the table specifying the Underlying Assets, in respect of an Underlying Asset.

"**Initial Valuation Date**" means 5 August 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.

"**Worst Performing Underlying Asset**" means, in respect of any day, the Underlying Asset with the lowest Asset Performance for such day.

B – Automatic Settlement (Autocall)

The Securities will automatically redeem if the closing price or level of the worst-performing Underlying Asset divided by its Initial Price is at or above its corresponding Autocall Barrier Percentage 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 February 2022	21 February 2022	100%
5 August 2022	19 August 2022	100%
6 February 2023	20 February 2023	100%
7 August 2023	21 August 2023	100%
5 February 2024	19 February 2024	100%
5 August 2024	19 August 2024	100%
5 February 2025	19 February 2025	100%
5 August 2025	19 August 2025	100%
5 February 2026	19 February 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 Strike Price Percentage ("**SPP**") (being 100%) or the Downside Final Performance is greater than or equal to the Knock-in Barrier Percentage (being 60%), 100% multiplied by the Calculation Amount;
- (ii) otherwise, an amount calculated by dividing the Downside Final Performance by the SPP and multiplying the result by the Calculation Amount.

Where:

"**Downside Final Performance**" means the Final Valuation Price divided by the Initial Price_(Settlement) each in respect of the Worst Performing Underlying Asset as calculated in respect of the Final Valuation Date. For the avoidance of doubt, references to and the definitions of, Initial Price_(Settlement), Worst Performing Underlying Asset and related terms shall be construed in respect of the relevant Underlying Asset.

"**Final Performance**" means the Final Valuation Price divided by the Initial Price_(Settlement) each in respect of the Best Performing Underlying Asset as calculated in respect of the Final Valuation Date. For the avoidance of doubt, references to and the definitions of, Initial Price_(Settlement), Best Performing Underlying Asset and related terms shall be construed in respect of the relevant Underlying Asset.

"**Best Performing Underlying Asset**" means, in respect of any day, the Underlying Asset with the highest Asset Performance for such day.

"**Final Valuation Date**" means 5 August 2026, subject to adjustment.

"**Final Valuation Price**" means, in respect of an 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 Irish Stock Exchange Trading plc as Euronext Dublin.
What are the key risks that are specific to the Securities?
<p>The Securities are subject to the following key risks:</p> <ul style="list-style-type: none"> <p>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.</p> <p>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.</p> <p>You are subject to risks associated with the determination of amount payable under the Securities:</p> <p>The Securities bear interest at a rate that is contingent upon the performance of the Underlying Assets and may vary from one Interest Payment Date to the next. You may not receive any interest payments if the Underlying Assets do not perform as anticipated.</p> <p>The Interest Amount is conditional on the performance of Underlying Asset(s) and may be zero where the performance criteria are not met. In such case the Interest Amount may be deferred to the next interest payment that may be made, but you will not be paid any amount to compensate for such deferral and it is possible that you will not receive any interest at all over the lifetime of the Securities.</p> <p>The Interest Amount is either a higher pre-determined Interest Amount or zero, 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.</p> <p>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.</p> <p>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.</p> <p>You are exposed to the performance of every Underlying Asset. Irrespective of how the other Underlying Assets perform, if any one or more Underlying Assets fail to meet a relevant threshold or barrier for the payment of interest or the calculation of any redemption amount, you might receive no interest payments and/or could lose some or all of your initial investment.</p> <p>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.</p> <p>The Securities reference a basket of Underlying Assets, each of which demonstrates unique risk characteristics. If the Underlying Assets are correlated, the performance of the Underlying Asset(s) in the basket can be expected to move in the same direction. If the performance of a basket gives a greater 'weight' to a basket constituent as compared to other basket constituents, the basket performance will be more affected by changes in the value of that particular basket constituent than a basket which apportions an equal weight to each basket constituent. The performance of basket constituents may be moderated or offset by one another. This means that, even in the case of a positive performance of one or more constituents, the performance of the basket as a whole may be negative if the performance of the other constituents is negative to a greater extent.</p> <p>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</p>

to participate in any subsequent positive performance of the Underlying Asset(s) and be unable to realise any potential gains in the value of the Securities. You may not be able to reinvest the proceeds from an investment at a comparable return and/or with a comparable interest or coupon rate for a similar level of risk.

Settlement is subject to conditions and may be impossible in certain circumstances: Payment of the amount payable to you will not take place until all conditions to settlement have been satisfied in full. No additional amounts will be payable to you by the Issuer because of any resulting delay or postponement. Certain settlement disruption events may occur which could restrict the Issuer's ability to make payments, and the date of settlement could be delayed accordingly.

Your Securities are subject to foreign exchange risks: Payment under the Securities will be made in a Settlement Currency which may be different from your home currency. You will be exposed to the risk of foreign exchange rate fluctuations between the Settlement Currency and your home currency. These fluctuations may decrease the value of the Securities.

Certain specific information in relation to the Securities is not be known at the beginning of an offer period: The terms and conditions of your Securities only provide an indicative amount. The actual amounts will be determined based on market conditions by the Issuer on or around the end of the offer period. There is a risk that the indicative amounts will not be same as the actual amount, in which case, the return on your Securities may be materially different from the expected return based on the indicative amount.

Risks relating to Underlying Asset(s) that are equity indices: Equity indices are composed of a synthetic portfolio of shares and provide investment diversification opportunities, but will be subject to the risk of fluctuations in both equity prices and the value and volatility of the relevant equity index. The Securities are linked to equity indices, and as such may not participate in dividends or any other distributions paid on the shares which make up such indices. Accordingly, you may receive a lower return on the Securities than you would have received if you had invested directly in those shares. The index sponsor can add, delete or substitute the components of an equity index at its discretion, and may also alter the methodology used to calculate the level of such index. These events may have a detrimental impact on the level of that index, which in turn could have a negative impact on the value of and return on the Securities.

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).

- **Taxation risks:** The levels and basis of taxation on the Securities and any reliefs for such taxation will depend on your individual circumstances and could change at any time over the life of the Securities. This could have adverse consequences for you and you should therefore consult your own tax advisers as to the tax consequences to you of transactions involving the Securities.
- **Potential conflicts of interest:** Conflicts of interest may exist where Barclays Bank PLC or its affiliate: (i) acts in multiple capacities with respect to the Securities (e.g. acting as issuer, manager and determination agent); (ii) enters into hedging transactions to cover the Issuer's exposure to the relevant cash amounts to be paid or assets to be delivered under the Securities as these fall due; and (iii) uses price contributions from its trading desks as a pricing source for an Underlying Asset. In light of such conflicts, the actions taken or determinations made by Barclays Bank PLC in relation to the Securities may not always be in the best interest of the holders. In addition to hedging transactions, Barclays Bank PLC may trade on the Underlying Asset(s) in the ordinary course of its business. Such trading could affect the market price of the Underlying Asset(s), which may in turn materially adversely affect the value and return on your Securities.

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

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

Terms and conditions of the offer

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

The Securities are offered for subscription in Portugal during the period from (and including) 2 July 2021 to (but excluding) 3 August 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 may be made by the Manager or the Authorised Offeror other than pursuant to Article 1(4) of the EU Prospectus Regulation in Portugal (the "Public Offer Jurisdiction") during the Offer Period. Applications for the Securities can be made in the Public Offer Jurisdiction through the Authorised Offeror during the Offer Period. The Securities will be placed into the Public Offer Jurisdiction by the Authorised Offeror. Distribution will be in accordance with the Authorised Offeror's usual procedures, notified to investors by the Authorised Offeror.
- Details of the minimum and/or maximum amount of application: The minimum and maximum amount of application from the Authorised Offeror will be notified to investors by the Authorised Offeror.
- Description of possibility to reduce subscriptions and manner for refunding excess amount paid by applicants: Not Applicable.
- Details of the method and time limits for paying up and delivering the Securities: Investors will be notified by the Authorised Offeror of their allocations of Securities and the settlement arrangements in respect thereof.
- Manner in and date on which results of the offer are to be made public: Investors will be notified by the Authorised Offeror of their allocations of Securities and the settlement arrangements in respect thereof.
- Procedure for exercise of any right of pre-emption, negotiability of subscription rights and treatment of subscription rights not exercised: Not Applicable.

- Categories of holders to which the Securities are offered and whether Tranche(s) have been reserved for certain countries: Offers may be made through the Authorised Offeror in the Public Offer Jurisdiction to any person. Offers (if any) in other EEA countries will only be made through the Authorised Offeror pursuant to an exemption from the obligation under the Prospectus Regulation to publish a prospectus.
- Process for notification to applicants of the amount allotted and indication whether dealing may begin before notification is made: Applicants will be notified directly by the Authorised Offeror of the success of their application. No dealings in the Securities may take place prior to the Issue Date.
- Name(s) and address(es), to the extent known to the Issuer, of the placers in the various countries where the offer takes place: the Authorised Offeror

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

The estimated total expenses of the issue and/or offer are EUR 1,000.

The Issuer will not charge any expenses to holders in connection with any issue of Securities. Offerors may, however, charge expenses to holders. Such expenses (if any) will be determined by agreement between the offeror and the holders at the time of each issue.

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

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 2.50 per cent. Any Authorised Offeror and its affiliates may engage, and may in the future engage, in hedging transactions with respect to the Underlying Asset.

PROIBIÇÃO DE VENDA A INVESTIDORES A RETALHO DO REINO UNIDO – Os Valores Mobiliários não se destinam a serem oferecidos, vendidos ou de outra forma disponibilizados a e não deverão ser oferecidos, vendidos ou de forma alguma disponibilizados a qualquer investidor a retalho no Reino Unido. Para os devidos fins, um investidor a retalho significa uma pessoa que é um (ou mais): (i) um cliente a retalho, tal como se define no ponto (8) do Artigo 2.º do Regulamento (UE) n.º 2017/565 tal como constitui a legislação nacional do Reino Unido em virtude da European Union (Withdrawal) Act 2018 ou, em português, Lei da Saída do Reino Unido da UE de 2018, (conforme alterada, a "EUWA"); ou (ii) um cliente no âmbito das cláusulas da Financial Services and Markets Act 2000 (conforme alterada, a "FSMA") e demais regras e regulamentos criados ao abrigo da FSMA com vista à implementação da Diretiva (UE) 2016/97, na qual um cliente não se qualificaria como um cliente profissional, como se define no ponto (8) do Artigo 2.º(1) do Regulamento (UE) n.º 600/2014 na medida em que forme parte da legislação nacional do Reino Unido em virtude da EUWA; ou (iii) um investidor não qualificado como se define no Artigo 2.º do Regulamento (UE) 2017/1129 tal como constitui a legislação nacional do Reino Unido em virtude da EUWA (conforme alterado, o "**Regulamento do Prospeto do Reino Unido**"). Consequentemente, qualquer documento de informações fundamentais exigido pelo Regulamento (UE) n.º 1286/2014 tal como constitua a legislação nacional do Reino Unido em virtude da EUWA (conforme alterada, o "**Regulamento de PRIIPs do Reino Unido**") para a oferta ou venda de Valores Mobiliários ou de outra forma a sua disponibilização a investidores a retalho no Reino Unido foi preparado e, por conseguinte, a oferta ou venda dos Valores Mobiliários ou a sua disponibilização a qualquer investidor a retalho no Reino Unido poderá ser ilícita ao abrigo do Regulamento de PRIIPs do Reino Unido.

PROIBIÇÃO DE VENDA A INVESTIDORES A RETALHO DA SUÍÇA– Os Valores Mobiliários não se destinam a serem oferecidos, vendidos ou de outra forma disponibilizados a e não deverão ser oferecidos, vendidos ou de forma alguma disponibilizados a qualquer investidor a retalho na Suíça. Para os devidos fins, um “investidor a retalho significa uma pessoa que não é um cliente profissional ou institucional, tal como definido no artigo 4 paragrafo 3, 4 e 5 e no artigo 5 paragrafo 1 e 2 do Swiss Federal Act on Financial Services ("**FINSA**") de 15 Junho 2018, tal como modificado. Consequentemente, não foi preparado qualquer documento de informações fundamentais tal como exigido pela FINSA para a oferta ou venda dos Valores Mobiliários na Suíça. A oferta ou venda de Valores Mobiliários ou a sua disponibilização a investidores a retalho no Suíça não foi preparada e, por conseguinte, a oferta ou venda dos Valores Mobiliários ou a sua disponibilização a qualquer investidor a retalho na suíça poderá ser ilícita ao abrigo do Regulamento da FINSA.



BARCLAYS BANK PLC

(Constituída com responsabilidade limitada em Inglaterra e no País de Gales)

Identificador de entidade legal (LEI): G5GSEF7VJP5I7OUK5573

**Até EUR 30.000.000 de Valores Mobiliários com vencimento em Agosto de 2026 no âmbito do
Global Structured Securities Programme (os “Valores Mobiliários”)
Preço de emissão: 100,00 por cento**

Este documento constitui os termos finais dos Valores Mobiliários (os "**Termos Finais**") aqui descritos para finalidades do Artigo 8 do Regulamento (EU) 2017/1129 (conforme alterado, o "**Regulamento do Prospeto**") e está preparado em relação com o Global Structured Securities Programme estabelecido pelo Barclays Bank PLC (e "**Emitente**"). Estes Termos Finais complementam e devem ser lidos conjuntamente com o Prospeto de Base GSSP 9 que constitui um prospeto de base elaborado como documento separado (incluindo o Documento de Registo datado de 23 de março de 2021 e os Valores Mobiliários tipo Notes relacionados com o GSSP Prospeto Base 9 datado de 1 de julho de 2021 para as finalidades do Artigo 8(6) do Regulamento do Prospeto da UE (o "**Prospeto de Base**"), o qual constitui um prospeto de base para as finalidades da Regulamento Europeia do Prospeto. A informação completa sobre o Emitente e a oferta de Valores Mobiliários está disponível apenas na base de uma combinação destes Termos Finais e do Prospeto de Base.

O Prospeto de Base e quaisquer suplementos relacionados, estão disponíveis para visualização em <https://home.barclays/investor-relations/structured-income-investors/prospectus-and-documents/structured-securities-prospectuses> e durante o horário normal de expediente na sede social do Emitente e no gabinete especificado do Agente de Emissão e Pagamento, por enquanto em Londres, podendo cópias ser obtidas a partir de tal gabinete. Palavras e expressões definidas no Prospeto de Base e não definidas nos Termos Finais terão o mesmo significado quando aqui utilizadas.

O Documento de Registo e os suplementos relacionados estão disponíveis para visualização em: <https://home.barclays/investor-relations/structured-income-investors/prospectus-and-documents/structuredsecurities-prospectuses/#registrationdocument> e <https://home.barclays/investor-relations/structured-income-investors/prospectus-and-documents/structuredsecurities-prospectuses/#registrationdocumentsupplement>.

As palavras e expressões definidas no Prospeto de Base e não definidas nos Termos Finais terão o mesmo significado quando aqui utilizadas.

BARCLAYS

Termos Finais datados de 2 de julho de 2021

PARTE A – CLÁUSULAS CONTRATUAIS

Disposições relacionadas com os Valores Mobiliários

9. (t) Série: NX000292196
- (u) Tranche: 1
10. Divisas:
- (a) Divisa de Emissão Euro (“EUR”)
- (b) Divisa de Liquidação: EUR
11. Valores Mobiliários: Notes
12. Notas: Aplicável
- (v) Montante Nominal Global conforme na Data de Emissão:
- (i) Tranche: Até EUR 30.000.000
- (ii) Série: Até EUR 30.000.000
- (w) Denominação Especificada: EUR 1.000
13. Certificados: Não Aplicável
14. Montante do Cálculo: EUR 1.000
15. Preço de Emissão: 100,00% do Montante Nominal Global
- O Preço de Emissão inclui uma comissão a pagar pelo Emitente ao Oferente Autorizado que será não superior a 2,50% do Preço de Emissão. Os Investidores nos Valores Mobiliários que pretendam investir através de um intermediário (incluindo através da introdução de um corretor) devem solicitar detalhes de qualquer comissão ou pagamento de taxa de tal intermediário antes de fazer qualquer compra do mesmo.
16. Data de Emissão: 5 de agosto de 2021
17. Data de Liquidação Programada: 19 de agosto de 2026
18. Tipo de Valor Mobiliário: Valores Imobiliários indexados a índices de ações
19. Tipo de Desempenho do Ativo Subjacente_(Juro): O pior
20. Tipo de Desempenho do Ativo Subjacente_(Autocall): O pior
21. Tipo de Desempenho do Ativo Subjacente_(Liquidação): Para a finalidade de determinação do Desempenho Final: O melhor
22. Tipo de Desempenho do Ativo Subjacente_{Downside(Liquidação)}: Para a finalidade de determinação do Desempenho Final: O pior

Disposições relacionadas com juros (caso haja) a pagar

23. Tipo de Juro: Digital (Otimista com funcionalidade de memória)
Condição Geral 9 (*Juro*)

- (a) **Datas de Pagamento de Juros:** Cada uma das datas definidas na Tabela 1 abaixo na coluna designada “Data de Pagamento de Juros”, sujeita a ajuste de acordo com a Convenção de Dias Úteis.
- (b) **Datas de Avaliação de Juros:** Cada uma das datas definidas na Tabela 1 abaixo, na coluna designada “Data de Avaliação de Juros”.

Tabela 1

Data de Avaliação de Juros	Data de Pagamento de Juros
7 de fevereiro de 2022	21 de fevereiro de 2022
5 de agosto de 2022	19 de agosto de 2022
6 de fevereiro de 2023	20 de fevereiro de 2023
7 de agosto de 2023	21 de agosto de 2023
5 de fevereiro de 2024	19 de fevereiro de 2024
5 de agosto de 2024	19 de agosto de 2024
5 de fevereiro de 2025	19 de fevereiro de 2025
5 de agosto de 2025	19 de agosto de 2025
5 de fevereiro de 2026	19 de fevereiro de 2026
5 de agosto de 2026	19 de agosto de 2026

- (c) (i) **Tipo de Juro Fixo:** Valor fixo
- (ii) **Taxa de Juro Fixa:** 2.25%
- (d) **Informação relacionada com a Taxa Variável:** Não Aplicável
- (e) **Barreira de Taxa de Juros:** 60,00%

Disposições relacionadas com Liquidação Antecipada Automática (Autocall)

24. **Liquidação Antecipada Automática (Autocall):** Aplicável
Condição Geral 10 (Liquidação Antecipada Automática (Autocall))
- (a) **Tipo de Observação Autocall:** Discreto
- (b) **Percentagem da Barreira de Autocall:** 100%
- (c) **Percentagem de Liquidação de Autocall:** 100%
- (d) **Datas de Avaliação de Autocall:** Cada data definida na Tabela 2 abaixo na coluna designada “Data de Avaliação de Autocall”

- (e) Datas de Liquidação de Autocall: Cada data definida na Tabela 2 abaixo na coluna designada “Data de Liquidação de Autocall”.
- (f) Preço de Avaliação de Autocall: O Preço de Avaliação do Ativo Subjacente na Data de Avaliação de Autocall
- (i) Ponderação de entrada: Não Aplicável
- (ii) Lookback-out mín.: Não Aplicável
- (iii) Lookback-out máx.: Não Aplicável
- (g) Evento de Reposição de Autocall: Não Aplicável

Tabela 2

Data de Avaliação de Autocall	Data de Liquidação de Autocall
7 de fevereiro de 2022	21 de fevereiro de 2022
5 de agosto de 2022	19 de agosto de 2022
6 de fevereiro de 2023	20 de fevereiro de 2023
7 de agosto de 2023	21 de agosto de 2023
5 de fevereiro de 2024	19 de fevereiro de 2024
5 de agosto de 2024	19 de agosto de 2024
5 de fevereiro de 2025	19 de fevereiro de 2025
5 de agosto de 2025	19 de agosto de 2025
5 de fevereiro de 2026	19 de fevereiro de 2026

Disposições relacionadas com Reembolso Antecipado Opcional

25. Evento de Liquidação Antecipada Opcional: Não Aplicável
 Condição Geral 11 (*Evento de Liquidação Antecipada Opcional*)

Disposições relacionadas com Liquidação Final

26. (x) Tipo de Liquidação Final: Nivelado
 Condição Geral 12 (*Liquidação Final*)
- (y) Método de Liquidação: Numerário
- (z) Strike Price em Percentagem: 100.00%
- (aa) Tipo de Barreira de Knock-in: Europeu

(bb) Barreira de Knock-in em Percentagem: 60.00%

(cc) Downside: Aplicável

Disposições relacionadas com DropBack

27. Tipo de Reembolso DropBack: Não Aplicável
Condição Geral 9.39 and Condição Geral 12.27

Disposições relacionadas com Liquidação de Evento de Valor de Compra Nominal

28. Liquidação de Evento de Valor de Compra Nominal: Não Aplicável
Condição Geral 13 (*Liquidação de Evento de Valor de Compra Nominal*)

(dd) Percentagem do Valor de Compra Nominal: Não Aplicável

Disposições relacionadas com Notas de Prestações

29. Notas de Prestações: Não Aplicável
Condição Geral 15 (*Liquidação por Prestações*)

Disposições relacionadas com o(s) Ativo(s) Subjacente(s)

30. Ativo Subjacente:

(ee) Data de avaliação inicial: 5 de agosto de 2021

(ff) Índice: Cada Índice conforme definido na Tabela 3 abaixo na coluna designada "Índice"

(i) Bolsa: Com respeito a cada Índice, Multi-Bolsas

(ii) Bolsa Relacionada: Com respeito a cada Índice, todas as bolsas

(iii) Divisa do Ativo Subjacente: Com respeito a cada Índice, EUR

(iv) Ecrã da Bloomberg: Cada Ecrã da Bloomberg conforme definido na Tabela 3 abaixo na coluna designada "Ecrã da Bloomberg"

(v) Ecrã da Refinitiv: Com respeito a cada Índice, Não Aplicável

(vi) Patrocinador do Índice: Com respeito a cada Índice, Stox Limited.

(vii) Peso: Não Aplicável

(viii) Índice pré-nomeado: Não Aplicável

Tabela 3

Índice	Ecrã da Bloomberg
STOXX Europe 600 Travel & Leisure	SXTP <Index>

STOXX Europe 600 Industrial Goods & Services	SXNP <Index>
STOXX Europe 600 Banks	SX7P <Index>
STOXX Europe 600 Automobiles & Parts	SXAP <Index>

31. (gg) Preço Inicial_(Juros): O Preço de Avaliação do Ativo Subjacente na Data de Avaliação Inicial
- (i) Ponderação de entrada: Não Aplicável
 - (ii) Lookback-in mín.: Não Aplicável
 - (iii) Lookback-in máx.: Não Aplicável
32. (a) Preço Inicial_(Liquidação): O Preço de Avaliação do Ativo Subjacente na Data de Avaliação Inicial
- (i) Ponderação de entrada: Não Aplicável
 - (ii) Lookback-in mín.: Não Aplicável
 - (iii) Lookback-in máx.: Não Aplicável
33. (hh) Preço de Avaliação Final: O Preço de Avaliação do Ativo Subjacente na Data de Avaliação Final
- (i) Ponderação de saída: Não Aplicável
 - (ii) Lookback-out mín.: Não Aplicável
 - (iii) Lookback-out máx.: Não Aplicável
- (ii) Data de Avaliação Final: 5 de agosto de 2026

Disposições relacionadas com eventos de interrupção

34. Consequências de um Dia Interrompido (com respeito a uma Data de Ponderação ou Data de Lookback): Condição Geral 18 (*Consequências de Dias Interrompidos*)
- (jj) Omissão: Não Aplicável
 - (kk) Adiamento: Não Aplicável
 - (ll) Adiamento Modificado: Não Aplicável
35. Consequências de um Dia Interrompido (com respeito a uma Data de Ponderação ou Data de Lookback): Condição Geral 25 (*Ajustes às Datas de Avaliação e Data de Referência*)
- (mm) Omissão: Não Aplicável
 - (nn) Adiamento: Não Aplicável

36. Consequências de um Dia Interrompido (com respeito a uma Data de Ponderação ou Data de Lookback):
Condição Geral 37 (*Consequências mediante uma Data de Referência que se torna uma Data de Referência*)
- (a) Omissão: Não Aplicável
- (b) Adiamento: Não Aplicável
- (c) Adiamento Modificado: Não Aplicável
37. Eventos de Interrupção Adicional:
Condição Geral 65.1 (*Definições*)
- (oo) Alteração na Lei: Aplicável de acordo com a Condição Geral 65.1 (*Definições*)
- (pp) Evento de Interrupção de Divisa: Aplicável de acordo com a Condição Geral 65.1 (*Definições*)
- (qq) Interrupção de Cobertura: Aplicável de acordo com a Condição Geral 65.1 (*Definições*)
- (rr) Evento Fiscal do Emitente: Aplicável de acordo com a Condição Geral 65.1 (*Definições*)
- (ss) Interrupção Extraordinária do Mercado: Aplicável de acordo com a Condição Geral 65.1 (*Definições*)
- (tt) Custo de Cobertura Aumentado: Não Aplicável de acordo com a Condição Geral 65.1 (*Definições*)
- (uu) Interrupção de Cobertura da Jurisdição Afetada: Não Aplicável de acordo com a Condição Geral 65.1 (*Definições*)
- (vv) Custo de Cobertura Aumentado da Jurisdição Afetada: Não Aplicável de acordo com a Condição Geral 65.1 (*Definições*)
- (ww)Custo Aumentado do Emissão de Ações: Não Aplicável 65.1 (*Definições*)
- (xx) Perda de Emissão de Ações: Não Aplicável 65.1 (*Definições*)
- (yy) Evento de Propriedade Estrangeira: Não Aplicável 65.1 (*Definições*)
- (zz) Evento de Interrupção de Fundos: Não Aplicável 65.1 (*Definições*)
- (aaa)Evento de Fundos: Não Aplicável
- (bbb) Potencial Ajuste de Eventos de Pagamento: Não Aplicável
- (ccc)Interrupção de Barclays Índice: Não Aplicável
38. Valor de Liquidação Antecipada em Numerário: Valor de Mercado

39. Número do Período de Aviso de Liquidação Antecipada :	Conforme especificado na Condição Geral 65.1 (<i>Definições</i>)
40. Substituição de Ações:	Não Aplicável
41. Substituição de Direitos:	Não Aplicável
42. Evento de Interrupção FX:	Não Aplicável
43. Custos de Alienação:	Aplicável
44. Despesas de Liquidação:	Não Aplicável
45. Impostos e Despesas da Jurisdição Local:	Não Aplicável
46. Consequências de um Evento de Fundos: Condição Geral 27 (<i>Consequências de um Evento de Fundos</i>)	Não Aplicável

Disposições Gerais

47. Forma de Valores Mobiliários:	Valores Mobiliários Globais ao Portador: Valor Mobiliário Permanente Global TEFRA: Não Aplicável Forma NGN: Não Aplicável Detido sob o SLVL: Não Aplicável Forma CGN: Aplicável
48. Data de transação:	1 de junho de 2021
49. Centro(s) de Negócios Adicional(ais):	Não Aplicável
50. Valores Mobiliários 871(m):	O Emitente determinou que a secção 871 (m) do Código de Receita Interna dos EUA não é aplicável aos Valores Mobiliários.
51. (i) Proibição de Comercialização a Clientes de Retalho residentes na Área Económica Europeia:	Não Aplicável
(ii) Proibição de Comercialização a Clientes de Retalho residentes no Reino Unido:	Aplicável – ver a página inicial dos presentes Termos Finais
52. Proibição de Comercialização a Clientes de Retalho residentes na Suíça:	Aplicável – ver a página inicial dos presentes Termos Finais
53. Convenção de Dias Úteis:	Modified Following
54. Agente de Determinação:	Barclays Bank PLC
55. Registrar:	Não Aplicável
56. Agente de Transferência:	Não Aplicável

57. (ddd) Nomes e moradas do Gestor:	Barclays Bank Ireland PLC
(eee) Data do Contrato de Subscrição:	Não Aplicável
(fff) Nomes e moradas de intermediários comerciais secundários e termos principais de compromisso:	Não Aplicável
58. Agente de registo:	Não Aplicável
59. Legislação Aplicável:	Legislação Inglesa
60. Referências relevantes:	<p>Os montantes a pagar ao abrigo dos Valores Mobiliários são calculados por referência ao Índice STOXX Europe 600 Travel & Leisure , que é fornecido pela STOXX Limited (o "Administrador"). À data destes Termos Finais, o Administrador aparece no registo de administradores e benchmarks estabelecidos e mantidos pela Autoridade Europeia dos Valores Mobiliários e dos Mercados ("ESMA") nos termos do Artigo 36 do Regulamento (UE) 2016/1011 (conforme alterado, o "Regulamento de Benchmarks da UE").</p> <p>Os montantes a pagar ao abrigo dos Valores Mobiliários são calculados por referência ao Índice STOXX Europe 600 Industrial Goods & Services, que é fornecido pela STOXX Limited (o "Administrador"). À data destes Termos Finais, o Administrador aparece no registo de administradores e benchmarks estabelecidos e mantidos pela Autoridade Europeia dos Valores Mobiliários e dos Mercados ("ESMA") nos termos do Artigo 36 do Regulamento (UE) 2016/1011 (conforme alterado, o "Regulamento de Benchmarks da UE").</p> <p>Os montantes a pagar ao abrigo dos Valores Mobiliários são calculados por referência ao Índice STOXX Europe 600 Banks, que é fornecido pela STOXX Limited (o "Administrador"). À data destes Termos Finais, o Administrador aparece no registo de administradores e benchmarks estabelecidos e mantidos pela Autoridade Europeia dos Valores Mobiliários e dos Mercados ("ESMA") nos termos do Artigo 36 do Regulamento (UE) 2016/1011 (conforme alterado, o "Regulamento de Benchmarks da UE").</p> <p>Os montantes a pagar ao abrigo dos Valores Mobiliários são calculados por referência ao Índice STOXX Europe 600 Automobiles & Parts , que é fornecido pela STOXX Limited (o "Administrador"). À data destes Termos Finais, o Administrador aparece no registo de administradores e benchmarks estabelecidos e mantidos pela Autoridade Europeia dos Valores Mobiliários e dos Mercados ("ESMA") nos termos do Artigo 36 do Regulamento (UE) 2016/1011 (conforme alterado, o "Regulamento de Benchmarks da UE").</p>

PARTE B – OUTRAS INFORMAÇÕES

61. LISTAGEM E ADMISSÃO PARA NEGOCIAÇÃO

- (a) Listagem e Admissão para Negociação: O pedido foi/deverá ser feito à Irish Stock Exchange PLC negociando como a Euronext Dublin para os valores mobiliários a serem admitidos na lista oficial e negociados no seu mercado regulamentado com efeitos a partir da Data de Emissão.
- (b) Estimativa das despesas totais relacionadas com a admissão para negociação: EUR 1.000
- (c) Nome e morada das entidades que têm um compromisso de actuar como intermediários em mercado secundário, dando liquidez através de preços de compra e venda e descrição dos principais termos do seu compromisso: Não Aplicável

62. CLASSIFICAÇÕES

Classificações: Os Valores Mobiliários não foram classificados individualmente.

63. RAZÕES PARA A OFERTA, RECEITA LÍQUIDA ESTIMADA E DESPESAS TOTAIS

- (a) Razões para a oferta: Financiamento Geral
- (b) Utilização da receita: Não Aplicável

64. RENDIMENTO

Não Aplicável

65. DESEMPENHO PASSADO E FUTURO DO ATIVO SUBJACENTE E OUTRA INFORMAÇÃO RELACIONADA COM O ATIVO SUBJACENTE

Ecrã da Bloomberg:

SXTP <Index>

SXNP <Index>

SX7P <Index>

SXAP <Index>

Aviso Legal relativo ao(s) Índice(s): verifique a tabela em baixo indicada

66. INFORMAÇÃO PÓS EMISSÃO

O Emitente não fornecerá qualquer informação sobre os Ativos Subjacentes após a emissão dos Valores Mobiliários, a menos que tal seja requerido por lei ou regulamentação aplicável.

67. INFORMAÇÃO OPERACIONAL

(ggg) ISIN: XS2279165596

(hhh) Código Comum:	227916559
(iii) Sistema(s) de Compensação Relevante(s):	Euroclear, Clearstream
(jjj) Entrega:	Entrega contra pagamento
(kkk) Nome e morada do(s) Agente(s) Pagador(es) Adicional(ais):	Não Aplicável
(lll) Valores Mobiliários Verdes	Não
(mmm) "Notes" Verdes	Não
(nnn) Destina-se a ser detido de forma a permitir a elegibilidade do Eurosistema:	Não aplicável pois instrumentos de dívida unsecured emitidos por instituições de crédito fora da União Europeia não são elegíveis para o Eurosystem.

68. TERMOS E CONDIÇÕES DA OFERTA

68.1 Oferta(s) Autorizada(s)

(ooo) Oferta Pública:	Pode ser feita uma oferta de Valores Mobiliários, sujeita às condições definidas abaixo pelo(s) Oferente(s) Autorizado(s) (especificadas na alínea (b) imediatamente abaixo, com exceção do presente no Artigo 1(4) do Regulamento do Prospeto na(s) Jurisdição(ões) da Oferta Pública (especificada na alínea (c) imediatamente abaixo) durante o Período da Oferta (especificado na alínea (d) imediatamente abaixo) sujeita às condições definidas no Prospeto de Base e na alínea (e) imediatamente abaixo
(ppp) Nome(s) e morada(s), na medida do conhecimento do Emitente, dos agentes de colocação nos vários países onde a oferta é realizada (em conjunto o(s) "Oferente(s) Autorizado(s)"):	Cada intermediário financeiro especificado em (i) e (ii) abaixo: <ul style="list-style-type: none"> (i) Autorização específica: Banco BPI SA, (o(s) "Oferente(s) Autorizado(s) Inicial(ais) e cada intermediário financeiro expressamente designado como um Oferente Autorizado no site da web do Emitente (https://home.barclays/investor-relations/fixed-income-investors/prospectus-and-documents/structured-securities-final-terms); e (ii) Autorização Geral: Não Aplicável
(qqq) Jurisdição(ões) onde a oferta pode ter lugar (junta(s), a(s) "Jurisdição(ões) da Oferta Pública"):	Portugal
(rrr) Período da oferta para o qual a utilização do Prospeto de Base está autorizada pelo(s) Oferente(s) Autorizado(s): (o "Período da Oferta")	Desde e incluindo 2 de julho de 2021 até, mas excluindo 3 de agosto de 2021
(sss) Outras condições para a utilização do Prospeto de Base	Não Aplicável

pelo(s) Oferente(s)
Autorizado(s):

68.2 Outros termos e condições da oferta

- (ttt) Preço da oferta: O Preço da Emissão
- (uuu) Valor total da oferta: Até EUR 30.000.000
- (vvv) Condições às quais a oferta está sujeita: O Emitente reserva-se o direito de retirar a oferta de Valores Mobiliários a qualquer momento antes do fim do Período da Oferta.
- Após retirar oferta, se qualquer aplicação tiver sido feita por qualquer potencial investidor, cada um desses potenciais investidores não terá o direito de subscrever ou adquirir os Valores Mobiliários e todos os pedidos serão automaticamente cancelados e qualquer dinheiro da compra será devolvido ao requerente pelo Oferente Autorizado de acordo com os procedimentos habituais do Oferente Autorizado.
- (www) Período, incluindo quaisquer alterações possíveis, durante o qual a oferta estará aberta e descrição do processo de aplicação: Desde e incluindo 2 de julho de 2021 até mas excluindo 3 de agosto de 2021.
- (xxx) Descrição do processo de aplicação: Uma oferta dos Valores Mobiliários pode ser feita pelo Gestor ou Oferente Autorizado exceto nos termos do Artigo 1(4) do Regulamento dos Prospetos em Portugal (a “Jurisdição da Oferta Pública”) durante o Período da Oferta.
- As Aplicações para Valores Mobiliários podem ser feitas na Jurisdição da Oferta Pública através do Oferente Autorizado durante o Período da Oferta. Os Valores Mobiliários serão colocados na Jurisdição da Oferta Pública pelo Oferente Autorizado. A distribuição será de acordo com os procedimentos habituais do Oferente Autorizado, notificados os investidores pelo Oferente Autorizado.
- (yyy) Detalhes do valor mínimo e/ou máximo de aplicação: O valor mínimo e máximo de aplicação do Oferente Autorizado será notificado aos investidores pelo Oferente Autorizado.
- (zzz) Descrição da possibilidade de reduzir subscrições e forma para reembolsar o montante excedente pago pelos requerentes: Não Aplicável
- (aaaa) Detalhes do método e limites de tempo para pagar e entregar os Valores Mobiliários: Os investidores serão notificados pelo Oferente Autorizado das suas alocações de Valores Mobiliários e dos acordos de liquidação relativamente aos mesmos.
- (bbbb) Forma e data em que os resultados da oferta serão tornados públicos: Os investidores serão notificados pelo Oferente Autorizado sobre as suas alocações de Valores Mobiliários e os acordos de liquidação relativos aos mesmos.
- (cccc) Procedimento para o exercício de qualquer direito de

preferência, negociabilidade dos direitos de subscrição e tratamento dos direitos de subscrição não exercidos:

- (dddd) Se a(s) tranche(s) foi/foram reservada(s) para certos países: As ofertas podem ser feitas através do Oferente Autorizado na Jurisdição de Oferta Pública a qualquer pessoa. As ofertas (caso as haja) noutros países do EEE serão feitas apenas através do Oferente Autorizado de acordo com uma isenção da obrigação prevista na Regulamento dos Prospetos, conforme implementado nesses países para publicar um prospeto.
- (eeee) Processo para notificação aos requerentes da quantia alocada e indicação se a negociação pode começar antes da notificação ser feita: Os requerentes serão notificados diretamente pelo Oferente Autorizado sobre o sucesso da sua aplicação. Nenhuma negociação de Valores Mobiliários pode ocorrer antes da Data de Emissão.
- (ffff) Montante de quaisquer despesas e impostos especificamente cobrados do subscritor ou comprador: Antes de tomarem qualquer decisão sobre investimento, os investidores devem procurar aconselhamento profissional independente conforme considerem necessário.
- (gggg) Nome(s) e morada(s), na medida do conhecimento do Emitente, dos agentes de colocação nos vários países onde a oferta tem lugar: Banco BPI SA, Rua Tenente Valadim, 284 - 4100-476 Porto, Portugal

Tabela – Aviso Legal do(s) Índice(s)

STOXX 600 Travel & Leisure® Index (o "Índice")

O Índice é propriedade intelectual (incluindo patentes registradas) do STOXX Limited, Zurich, Switzerland e/ou do Dow Jones & Company, Inc, uma Delaware corporation, Nova Yorque, USA (os “Licenciantes”) que é usado ao abrigo de uma licença. Os Valores Mobiliários indexados ao Índice não são de forma alguma promovidos, distribuídos, aconselhados ou endossados pelos Licenciantes e nenhum dos Licenciantes terá qualquer responsabilidade em relação a estes Valores Mobiliários.

STOXX 600 Industrial Goods & Services® Index (o "Índice")

O Índice é propriedade intelectual (incluindo patentes registradas) do STOXX Limited, Zurich, Switzerland e/ou do Dow Jones & Company, Inc, uma Delaware corporation, Nova Yorque, USA (os “Licenciantes”) que é usado ao abrigo de uma licença. Os Valores Mobiliários indexados ao Índice não são de forma alguma promovidos, distribuídos, aconselhados ou endossados pelos Licenciantes e nenhum dos Licenciantes terá qualquer responsabilidade em relação a estes Valores Mobiliários.

STOXX 600 Banks® Index (o "Índice")

O Índice é propriedade intelectual (incluindo patentes registradas) do STOXX Limited, Zurich, Switzerland e/ou do Dow Jones & Company, Inc, uma Delaware corporation, Nova Yorque, USA (os “Licenciantes”) que é usado ao abrigo de uma licença. Os Valores Mobiliários indexados ao Índice não são de forma alguma promovidos, distribuídos, aconselhados ou endossados pelos Licenciantes e nenhum dos Licenciantes terá qualquer responsabilidade em relação a estes Valores Mobiliários.

STOXX 600 Automobiles & Parts® Index (o "Índice")

O Índice é propriedade intelectual (incluindo patentes registradas) do STOXX Limited, Zurich, Switzerland e/ou do Dow Jones & Company, Inc, uma Delaware corporation, Nova Yorque, USA (os “Licenciantes”) que é usado ao abrigo de uma licença. Os Valores Mobiliários indexados ao Índice não são de forma alguma promovidos, distribuídos, aconselhados ou endossados pelos Licenciantes e nenhum dos Licenciantes terá qualquer responsabilidade em relação a estes Valores Mobiliários.

RESUMO

INTRODUÇÃO E AVISOS

O Resumo deve ser lido como uma introdução ao Prospeto. Qualquer decisão de investir nos Valores Mobiliários deve basear-se na consideração do Prospeto como um todo por parte do investidor. Em certas circunstâncias, o investidor poderá perder parte ou a totalidade do capital investido. Nos casos em que uma reclamação relativa às informações contidas no Prospeto seja apresentada em tribunal, o investidor queixoso poderá, de acordo com a lei nacional, ter de arcar com os custos de tradução do Prospeto antes do início do processo judicial. A responsabilidade civil é atribuída apenas às pessoas que apresentaram o presente Resumo, incluindo qualquer tradução do mesmo, mas apenas quando o Resumo for enganoso, impreciso ou inconsistente quando lido em conjunto com as outras partes do Prospeto ou não fornecer, quando lido em conjunto com as outras partes do Prospeto, informações essenciais para ajudar os investidores a considerar a possibilidade de investir nos Valores Mobiliários.

Está prestes a comprar um produto que não é simples e poderá ser difícil de entender.

Valores Mobiliários: Até EUR 30.000.000 em Valores Mobiliários com vencimento em agosto de 2026, de acordo com o Global Structured Securities Program (ISIN: XS2279165596) (os "Valores Mobiliários").

O Emitente: O emitente é o Barclays Bank PLC. A sua sede social localiza-se em 1 Churchill Place, Londres, E14 5HP, Reino Unido (número de telefone: +44 (0)20 7116 1000) e seu identificador de entidade jurídica ("LEI") é o G5GSEF7VJP517OUK5573

O Oferente Autorizado: O Oferente Autorizado é a Banco BPI SA, com endereço na Rua Tenente Valadim, 284 - 4100-476 Porto, Portugal e telefone +351 22 207 50 00) e LEI 3DM5DPGI3W6OU6GJ4N92.

Autoridade competente: O Prospeto de Base foi aprovado a 1 de julho de 2021 pelo Banco Central da Irlanda em New Wapping Street, North Wall Quay, Dublin 1, D01 F7X3, Irlanda (número de telefone: +353 (0)1 224 6000).

PRINCIPAIS INFORMAÇÕES SOBRE O EMITENTE

Quem é o Emitente dos valores mobiliários?

Domicílio e forma jurídica do emitente: Barclays Bank PLC (o "Emitente") é uma empresa pública limitada registada na Inglaterra e no País de Gales sob o número 1026167 e sediada em 1 Churchill Place, Londres, E14 5HP, Reino Unido (telefone +44 (0)20 7116 1000). A responsabilidade dos membros do emitente é limitada. O Identificador de Pessoa Jurídica (LEI) do emissor é G5GSEF7VJP517OUK5573.

Principais atividades do emitente: Os negócios do Grupo incluem operações bancárias e pagamentos ao consumidor em todo o mundo, além de um banco de primeira linha, serviço completo, corporativo global e banco de investimentos. O Grupo é constituído pelo Barclays PLC, juntamente com as suas subsidiárias, incluindo o Emitente. A principal atividade do Emitente é oferecer produtos e serviços concebidos para grandes clientes bancários empresariais, grossistas e internacionais.

O termo "**Grupo**" refere-se ao Barclays PLC em conjunto com as suas subsidiárias e o termo "**Barclays Bank Group**" refere-se ao Barclays Bank PLC em conjunto com as suas subsidiárias.

Principais acionistas do emitente: A totalidade do capital social ordinário emitido pelo Emitente pertence ao Barclays PLC. O Barclays PLC é a empresa-mãe final do grupo.

Identidade dos principais administradores do Emitente: Os principais diretores administrativos do emitente são James Staley (CEO e Diretor Executivo) e Tushar Morzaria (Diretor Executivo).

Identidade dos revisores oficiais de contas do Emitente: Os revisores oficiais de contas do Emitente são a KPMG LLP ("KPMG"), revisores oficiais de contas e auditores registados (membro do Institute of Chartered Accountants na Inglaterra e no País de Gales), 15 Canada Square, London E14 5GL, Reino Unido.

Quais são as principais informações financeiras sobre o Emitente?

Conta de Resultados Consolidada

	A 31 de dezembro	
	2020	2019
	(€m)	
Margem líquida de juros.....	3.160	3.907
Receita líquida de taxas e comissões.....	5.659	5.672
Encargos de redução de crédito.....	(3.377)	(1.202)
Resultados em operações financeiras.....	7.076	4.073
Lucro antes de impostos.....	3.075	3.112
Lucro/(prejuízo) após impostos.....	2.451	2.780

Balanço Consolidado

	A 31 de dezembro	
	2020	2019
	(€m)	
Total de ativos.....	1.059.731	876.672

Títulos de dívida em emissão	29.423	33.536
Passivos subordinados	32.005	33.425
Empréstimos e adiantamentos a custo amortizado.....	134.267	141.636
Depósitos a custo amortizado	244.696	213.881
Equidade total	53.710	50.615

Determinados Índices das Declarações Financeiras

	A 31 de dezembro	
	2020	2019
	(%)	
Fundos próprios principais de nível 1	14,2	13,9
Capital regulatório total	21,0	22,1
Rácio de alavancagem CRR	3,9	3,9

Quais são os principais riscos específicos do Emitente?

O Grupo Barclays Bank identificou uma vasta gama de riscos aos quais os seus negócios estão expostos. Os riscos materiais são aqueles a que a administração presta particular atenção e que podem fazer com que a estratégia, os resultados das operações, a situação financeira e/ou as perspetivas do Grupo Barclays Bank sejam materialmente diferentes das expectativas. Os riscos emergentes são aqueles que têm componentes desconhecidas, e cujo impacto poderia cristalizar-se durante um período de tempo mais longo. Adicionalmente, outros fatores fora do controlo do Grupo Barclays Bank, incluindo o agravamento do terrorismo ou conflitos globais, catástrofes naturais, pandemias e eventos semelhantes, embora não detalhados abaixo, podem ter um impacto semelhante no Grupo Barclays Bank.

- **Riscos materiais existentes e emergentes com potencial impacto em mais do que um risco principal:** Para além dos riscos materiais e emergentes com impacto nos principais riscos abaixo indicados, existem também riscos materiais existentes e emergentes que potencialmente têm impacto em mais do que um destes riscos principais. Estes riscos são: (i) o impacto da COVID-19; (ii) condições económicas e de mercado globais e locais potencialmente desfavoráveis, bem como desenvolvimentos geopolíticos; (iii) a saída do Reino Unido da UE; (iv) o impacto da alteração das taxas de juro na rentabilidade do Grupo Barclays Bank; (v) os ambientes competitivos da indústria bancária e dos serviços financeiros; (vi) as alterações regulatórias em agenda e o impacto no modelo de negócio; (vii) o impacto das alterações climáticas no negócio do Grupo Barclays Bank; e (viii) o impacto das reformas das taxas de juro de referência sobre o Grupo Barclays Bank.
- **Riscos de Crédito e de Mercado:** O risco de crédito é o risco de incapacidade para o Grupo Barclays Bank decorrente do incumprimento por parte de clientes, consumidores ou contrapartes, de cumprir as suas obrigações para com os membros do Grupo Barclays Bank. O Grupo Barclays Bank está sujeito a riscos decorrentes de alterações na qualidade de crédito e taxas de recuperação de empréstimos e adiantamentos devidos por mutuários e contrapartes em qualquer carteira específica. O risco de mercado é o risco de perdas decorrente de uma potencial alteração adversa no valor dos ativos e passivos do Grupo Barclays Bank devido à flutuação das variáveis de mercado.
- **Risco de tesouraria e de capital e o risco de o Emitente e o Grupo Barclays Bank estarem sujeitos a poderes de resolução substanciais:** Há três tipos primários de risco de tesouraria e de capital enfrentados pelo Grupo Barclays Bank que são (1) risco de liquidez - o risco de que o Grupo Barclays Bank seja incapaz de cumprir as suas obrigações contratuais ou contingentes ou que não tenha o montante de financiamento e liquidez estáveis e adequados para suportar os seus ativos, que também podem ser afetados por alterações de notação de crédito; (2) risco de capital - o risco de que o Grupo Barclays Bank tenha um nível ou composição de capital insuficiente; e (3) risco de taxa de juro na carteira bancária - o risco de que o Grupo Barclays Bank esteja exposto à volatilidade do capital ou dos rendimentos devido a um desfazamento entre as exposições às taxas de juro dos seus ativos e passivos (não negociados). Ao abrigo da Lei Bancária de 2009 (*Banking Act 2009*), são concedidos poderes substanciais ao Banco de Inglaterra (ou, em certas circunstâncias, ao Tesouro do Reino Unido (*HM Treasury*)), em concertação com a Autoridade de Regulação Prudencial do Reino Unido (*United Kingdom Prudential Regulation Authority*), a Autoridade de Conduta Financeira do Reino Unido (*UK Financial Conduct Authority*) e o Tesouro do Reino Unido, conforme o caso, como parte de um regime de resolução especial. Estes poderes permitem ao Banco de Inglaterra (ou a qualquer sucessor ou substituto deste e/ou outra autoridade no Reino Unido com a capacidade de exercer o Poder de Fiança do Reino Unido) (a “**Autoridade de Resolução**” (“*Resolution Authority*”)) implementar várias medidas de resolução e opções de estabilização (incluindo, entre outros, o instrumento de fiança) no que respeite a um banco ou empresa de investimento do Reino Unido e algumas das suas subsidiárias (à data do Documento de Registo, incluindo o Emitente), em circunstâncias em que a Autoridade de Resolução considera que estão preenchidas as condições de resolução pertinentes.
- **Riscos operacionais e de modelo:** O risco operacional é o risco de perdas para o Grupo Barclays Bank devido a processos ou sistemas inadequados ou falhados, fatores humanos ou devido a eventos externos em que a causa principal não seja o risco de crédito ou de mercado. O risco de modelo é o risco de potenciais consequências adversas de avaliações ou decisões financeiras baseadas em resultados e relatórios de modelo incorretos ou mal utilizados.
- **Riscos de conduta, de reputação e jurídico e medidas legais, de concorrência e regulamentares:** O risco de conduta é o risco de prejuízo para os consumidores, clientes, integridade do mercado, concorrência ou para o Grupo Barclays Bank devido ao fornecimento inadequado de serviços financeiros, incluindo casos de conduta dolosa ou negligente. O risco de reputação é o risco de que uma ação, transação, investimento, evento, decisão ou relação comercial reduzam a confiança na integridade e competência do Grupo Barclays Bank. O Grupo Barclays Bank conduz atividades num mercado altamente regulado que o expõe a riscos legais decorrentes (i) da multiplicidade de leis e regulamentos aplicáveis à atividade em que opera, que são altamente dinâmicas, podem variar entre jurisdições e são frequentemente pouco claras na sua aplicação a circunstâncias concretas, especialmente em áreas novas e emergentes; e (ii) a natureza diversificada e evolutiva dos negócios e práticas comerciais do Grupo Barclays Bank. Em qualquer caso, o Grupo Barclays Bank e os seus trabalhadores ficam expostos ao risco de perdas ou à imposição

de sanções, danos ou multas pelo fracasso dos membros do Grupo Barclays Bank em cumprir as respetivas obrigações legais, incluindo requisitos legais ou contratuais. O risco legal pode surgir em relação a uma série de riscos existentes e emergentes, resumidos acima.

Quais são as principais características dos Valores Mobiliários?

Tipo e classe de valores mobiliários oferecidos e admitidos à negociação, incluindo números de identificação de segurança

Os Valores Mobiliários terão a forma de *Notes* e serão identificados exclusivamente através do: NX000292196; 1; ISIN: XS2279165596; Código Comum: 227916559.

Os Valores Mobiliários serão apurados e liquidados através do Euroclear Bank S.A./N.V. ou Clearstream Banking *société anonyme*.

Moeda, denominação especificada, tamanho da emissão e prazo dos Valores Mobiliários

Os Valores Mobiliários serão emitidos em Euro ("EUR") (a "**Divisa de Emissão**") e liquidados na mesma moeda (a "**Divisa de Liquidação**"). Os Valores Mobiliários são negociáveis em valores nominais e a denominação especificada por título é de 1.000 EUR. O montante da emissão é de até 30.000.000 de EUR. O preço de emissão é de 100% da Denominação Especificada.

A data de emissão é 5 de agosto de 2021 (a "**Data de emissão**"). Sujeitos a vencimento antecipado, os Valores Mobiliários estão programados para resgate a 19 de agosto de 2026 (a "**Data de Liquidação Programada**").

Direitos associados aos Valores Mobiliários

Retorno potencial: Os Valores Mobiliários concederão a cada titular dos Valores Mobiliários o direito de receber um retorno potencial sobre os Valores Mobiliários, juntamente com certos direitos acessórios, como o direito de receber notificação de certas determinações e eventos e o direito de votar em algumas (mas não todas) emendas aos termos e condições dos Valores Mobiliários. O retorno potencial será na forma de: (i) um ou mais Montantes de Juros (ii) um Montante de Liquidação em Numerário Autocall, e/ou (iii) um Montante Final de Liquidação em Numerário, desde que os Valores Mobiliários tenham vencido antecipadamente, o potencial retorno poderá ser, alternativamente, na forma de Montante de Liquidação em Numerário Antecipado.

Tributação: Todos os pagamentos relativos aos Valores Mobiliários serão efetuados sem retenção na fonte ou dedução de ou por conta de quaisquer impostos do Reino Unido, a menos que tal retenção ou dedução seja exigida por lei. Caso tal retenção ou dedução seja exigida por lei, o Emitente, salvo em circunstâncias limitadas, deverá pagar valores adicionais para cobrir os valores retidos ou deduzidos.

Eventos de inadimplência: Se o Emitente deixar de efetuar qualquer pagamento devido sob os Valores Mobiliários ou violar qualquer outro termo e condição dos Valores Mobiliários de forma que seja materialmente prejudicial para os interesses dos titulares (e essa falha não tenha sido sanada dentro de 30 dias, ou, no caso de juros, 14 dias), ou caso o Emitente esteja sujeito a uma ordem de liquidação, então (sujeito, no caso de juros, ao Emitente ter sido impedido de pagar por uma disposição legal obrigatória), os Valores Mobiliários passarão imediatamente a ser considerados devidos e pagáveis, mediante notificação do titular.

Limitações de direitos

Resgate antecipado após certos eventos de interrupção ou devido a ilegalidade ou impraticabilidade: O Emitente poderá resgatar os Valores Mobiliários antes da Data de Liquidação Programada após a ocorrência de certos eventos de interrupção ou eventos extraordinários relativos ao Emitente, aos seus acordos de cobertura de posições, aos Ativo(s) Subjacentes, à tributação ou à divisa relevante dos Valores Mobiliários, ou se se determinar que o desempenho de qualquer uma das suas obrigações sob os Valores Mobiliários é ilegal ou fisicamente impraticável. Se tal ocorrer, os investidores receberão um "**Montante de Liquidação Antecipada em Numerário**" igual ao valor justo de mercado dos Valores Mobiliários antes do seu resgate.

Certas limitações adicionais:

- Não obstante os Valores Mobiliários estarem vinculados ao desempenho do(s) Ativo(s) Subjacente(s), os titulares não têm nenhum direito em relação ao Ativo Subjacente.
- Os termos e condições dos Valores Mobiliários permitem que o Emitente e o Agente de Determinação (conforme o caso), na ocorrência de certos eventos e em determinadas circunstâncias, sem o consentimento dos titulares, faça ajustes nos termos e condições dos Valores Mobiliários, resgate os Valores Mobiliários antes da maturidade, monetize os Valores Mobiliários, adie a avaliação dos Ativo(s) Subjacentes ou pagamentos programados sob os Valores Mobiliários, altere a divisa na qual os Valores Mobiliários são denominados, substitua os Ativo(s) Subjacentes, substitua o Emitente por outra entidade permitida, sujeita a determinadas condições, e tome outras ações relacionadas com os Valores Mobiliários e com os Ativo(s) Subjacentes.
- Os Valores Mobiliários contêm disposições para convocar assembleias de obrigacionistas para considerar assuntos que afetam os seus interesses em geral, e estas disposições permitem que maiorias definidas vinculem todos os titulares, inclusive aqueles que não compareçam para votar na reunião relevante bem como os que votarem ao contrário da maioria.

Lei aplicável

Os Valores Mobiliários serão regidos pela lei inglesa e os direitos decorrentes serão interpretados de acordo com esta.

Descrição do cálculo do potencial retorno sobre os Valores Mobiliários

Ativos subjacentes: O retorno e o valor dos Valores Mobiliários dependem do desempenho dos seguintes "**Ativo Subjacente**":

Ativo Subjacente	Tipo	Preço Inicial ^(juros/liquidação)	Data da Avaliação Inicial
STOXX Europe 600 Travel & Leisure (Bloomberg Code: SXTF <Index>)	Índice	O Preço de Avaliação do Ativo Subjacente na Data de Avaliação Inicial	5 de agosto de 2021
STOXX Europe 600 Industrial Goods & Services (Bloomberg Code: SXNP <Index>)	Índice	O Preço de Avaliação do Ativo Subjacente na Data de Avaliação Inicial	5 de agosto de 2021
STOXX Europe 600 Banks (Bloomberg Code: SX7P <Index>)	Índice	O Preço de Avaliação do Ativo Subjacente na Data de Avaliação Inicial	5 de agosto de 2021

STOXX Europe 600 Automobiles & Parts (Bloomberg Code: SXAP <Index>)	Índice	O Preço de Avaliação do Ativo Subjacente na Data de Avaliação Inicial	5 de agosto de 2021
---------------------------------------------------------------------	--------	-----------------------------------------------------------------------	---------------------

Para efeitos de determinação de um Montante de Juros, entende-se por Ativos Subjacentes os Ativos Subjacentes. Para efeitos de determinação do Evento de Liquidação Antecipada Automática (*Autocall*), entende-se por Ativos Subjacentes os Ativos Subjacentes. Para efeitos de determinação do Montante Final de Liquidação em Numerário, entende-se por Ativos Subjacentes os Ativos Subjacentes. Para efeitos de determinação do Desempenho Final *Downside* e dos termos e definições relevantes, entende-se por Ativos Subjacentes os Ativos Subjacentes.

Montante de cálculo: Os cálculos referentes aos valores a pagar de acordo com os Valores Mobiliários são feitos por referência ao Montante do Cálculo, sendo EUR 1.000 por cada Valor Mobiliário.

Montantes indicativos: Se os Valores Mobiliários estiverem a ser oferecidos através de uma Oferta Pública e se algum valor de algum dos valores dos parâmetros do produto não forem fixados ou determinados no início da Oferta Pública (incluindo o montante da oferta, nível de barreiras, percentagem, preço, taxa ou outro valor em relação aos termos dos Valores Mobiliários que não tenham sido fixados ou determinados no início da Oferta Pública), o valor destes parâmetros serão especificados através de um montante indicativo, um montante mínimo indicativo, um montante máximo indicativo ou montante indicativo ou qualquer combinação destes. Neste caso, o(s) valor(es) relevante(s) dos parâmetros do produto será(ão) o valor determinado com base nas condições de mercado pelo Emitente no ou próximo ao final da Oferta Pública. O aviso do valor do parâmetro do produto será publicado antes da Data de Emissão.

Agente de Determinação: O Barclays Bank PLC será nomeado para fazer cálculos e determinações em relação aos Valores Mobiliários.

A – Juros

Data de Pagamento de Juros*	Data de Avaliação de Juros	Barreira de Juros
21 de fevereiro de 2022	7 de fevereiro de 2022	60%
19 de agosto de 2022	5 de agosto de 2022	60%
20 de fevereiro de 2023	6 de fevereiro de 2023	60%
21 de agosto de 2023	7 de agosto de 2023	60%
19 de fevereiro de 2024	5 de fevereiro de 2024	60%
19 de agosto de 2024	5 de agosto de 2024	60%
19 de fevereiro de 2025	5 de fevereiro de 2025	60%
19 de agosto de 2025	5 de agosto de 2025	60%
19 de fevereiro de 2026	5 de fevereiro de 2026	60%
19 de agosto de 2026	5 de agosto de 2026	60%

*A Data de Pagamento de Juros relevante pode ser adiada após o adiamento de uma Data de Avaliação de Juros devido a um evento de interrupção.

O Montante de Juros a pagar por cada Valor Mobiliário em cada Data de Pagamento de Juros será calculado em relação a cada Data de Avaliação de Juros e dependerá e será calculado da seguinte forma:

- (i) Se o Desempenho Modificado for igual ou superior à Barreira de Juros correspondente, o Montante de Juros será calculado como a soma de (a) a Taxa de Juros Fixa (2,25%) multiplicada pelo Montante de Cálculo e (b) o número de Datas de Avaliação de Juros anteriores onde nenhum juro tenha sido pago (após o qual os juros serão considerados como tendo sido pagos em relação a estas Datas de Avaliação de Juros anteriores) multiplicadas pela Taxa de Juros Fixa e depois multiplicadas pelo Montante de Cálculo.
- (ii) Caso contrário, o Montante de Juros é zero.

Onde:

“**Desempenho do Ativo**” significa, em relação a um Ativo Subjacente e em relação a uma Data de Avaliação de Juros, à Data de Avaliação Final ou qualquer outro dia, o Preço de Avaliação de Juros, o Preço de Avaliação Final ou o Preço de Avaliação, respetivamente, divididos pelo Preço Inicial (Juros) do respectivo Ativo Subjacente.

“**Desempenho Modificado**” significa, em relação a uma Data de Avaliação de Juros, o Preço de Avaliação de Juros nessa data dividido pelo Preço Inicial (Juros) referindo-se ao Ativo Subjacente com o Pior Desempenho nessa Data de Avaliação de Juros.

“**Preço Inicial (Juros)**” significa, a data mencionada na tabela que se refere aos Ativos Subjacentes, com respeito a cada um dos Ativos Subjacentes.

“**Data de Avaliação Inicial**” significa 5 de agosto de 2021, sujeito a ajustamento.

“**Preço de Avaliação de Juros**” significa, em relação a uma Data de Avaliação de Juros e a um Ativo Subjacente, o preço de fecho ou nível desse Ativo Subjacente nessa Data de Avaliação de Juros.

“**Ativo Subjacente com o Pior Desempenho**” significa, relativamente a qualquer dia, o Ativo Subjacente com o Desempenho do Ativo mais baixo nesse dia.

B - Liquidação Antecipada Automática (Autocall)

Os Valores Mobiliários serão resgatados automaticamente se o preço de fecho ou nível do Ativo Subjacente com o Pior Desempenho dividido pelo seu Preço Inicial for igual ou superior à correspondente Percentagem da Barreira de Autocall em relação a uma Data de Avaliação de Autocall. Se tal ocorrer, receberá um Montante de Autocall em Numerário igual ao Montante de Cálculo multiplicado por 100%, pagável na Data de Liquidação de Autocall, correspondente a essa Data de Avaliação de Autocall. A Data de Liquidação de Autocall relevante pode ser adiada após o adiamento de uma Data de Avaliação de Autocall devido a um evento de interrupção.

Data de Avaliação de Autocall	Data de Liquidação de Autocall	Percentagem da Barreira de Autocall
7 de fevereiro de 2022	21 de fevereiro de 2022	100%
5 de agosto de 2022	19 de agosto de 2022	100%
6 de fevereiro de 2023	20 de fevereiro de 2023	100%
7 de agosto de 2023	21 de agosto de 2023	100%
5 de fevereiro de 2024	19 de fevereiro de 2024	100%
5 de agosto de 2024	19 de agosto de 2024	100%
5 de fevereiro de 2025	19 de fevereiro de 2025	100%
5 de agosto de 2025	19 de agosto de 2025	100%
5 de fevereiro de 2026	19 de fevereiro de 2026	100%

C - Liquidação final

Se os Valores Mobiliários não tiverem sido resgatados de outra forma, cada Valor Mobiliário será resgatado na Data de Liquidação Programada mediante o pagamento do Montante Final de Liquidação em Numerário. A Data de Liquidação Programada pode ser adiada após o adiamento da Data de Avaliação Final devido a um evento de interrupção.

O Montante Final de Liquidação em Numerário é calculado da seguinte forma:

- (iii) se o Desempenho Final for igual ou superior ao *Strike Price* em Percentagem (“**SPP**”) (sendo 100%) ou se o Desempenho Final *Downside* for igual ou superior à Barreira de Knock-in em Percentagem (sendo 60%), 100% multiplicado pelo Montante de Cálculo;
- (iv) caso contrário, um valor calculado dividindo o Desempenho Final *Downside* pelo *Strike Price* em Percentagem (100%) e multiplicando o resultado pelo Montante de Cálculo.

Onde:

“**Desempenho Final Downside**” significa o Preço de Avaliação Final dividido pelo Preço Inicial_(Liquidação), ambos referindo-se ao Ativo Subjacente com o Pior Desempenho, calculado com respeito à Data de Avaliação Final. Para evitar dúvidas, as referências a, e as definições de Preço Inicial_(Liquidação), Ativo Subjacente com o Pior Desempenho e os termos relacionados serão interpretados em relação aos relevantes Ativos Subjacentes.

“**Desempenho Final**” significa o Preço de Avaliação Final dividido pelo Preço Inicial_(Liquidação) em relação ao Ativo Subjacente com Melhor Desempenho, calculado com respeito à Data de Avaliação Final. Para evitar dúvidas, as referências a, e as definições de Preço Inicial_(Liquidação), Ativo Subjacente com o Melhor Desempenho e os termos relacionados serão interpretados em relação aos relevantes Ativos Subjacentes.

“**Ativo Subjacente com o Melhor Desempenho**” significa, relativamente a qualquer dia, o Ativo Subjacente com o Desempenho do Ativo mais alto nesse dia.

“**Data de Avaliação Final**” significa 5 de agosto de 2026, sujeito a ajustes.

“**Preço de Avaliação Final**” significa, em relação a um Ativo Subjacente, o preço de fecho ou nível desse Ativo Subjacente na Data de Avaliação Final.

Situação dos valores mobiliários: Os Valores Mobiliários são obrigações diretas, não subordinadas e não garantidas da Emissora e têm a mesma classificação entre si.

Descrição das restrições à livre transferibilidade dos Valores Mobiliários:

Os Valores Mobiliários são oferecidos e vendidos fora dos Estados Unidos a pessoas fora dos EUA, de acordo com o Regulamento S, de acordo com a Lei de Valores Mobiliários, e devem cumprir as restrições de transferência com relação aos Estados Unidos. Os valores mobiliários mantidos num sistema de compensação serão transferidos de acordo com as regras, procedimentos e regulamentos desse sistema de compensação. Sujeito ao acima exposto, os Valores Mobiliários serão livremente transferíveis.

Onde serão os Valores Mobiliários negociados?

É esperado que o Emitente (ou em seu nome) solicite que os Valores Mobiliários sejam admitidos à negociação no mercado regulamentado da Irish Stock Exchange Trading plc como Euronext Dublin.

Quais são os principais riscos que são específicos aos Valores Mobiliários?

Os Valores Mobiliários estão sujeitos aos seguintes riscos principais:

Poderá perder parte ou todo o seu investimento nos Valores Mobiliários: Os termos dos Valores Mobiliários não preveem um pagamento mínimo programado ao atingir a maturidade, como tal, dependendo do desempenho dos Ativo(s) Subjacentes, poderá perder parte ou todo o seu investimento. Também poderá perder parte ou todo o seu investimento se: (a) vender os seus Valores Mobiliários antes do seu vencimento ou maturidade programada; (b) os seus Valores Mobiliários forem resgatados antecipadamente em determinadas circunstâncias extraordinárias; ou (c) os termos e condições dos seus Valores Mobiliários sejam ajustados de modo que o valor a pagar ou a propriedade a entregar seja menor que o seu investimento inicial.

Existem riscos associados à avaliação, liquidez e oferta dos Valores Mobiliários: O valor de mercado dos seus Valores Mobiliários pode ser significativamente inferior ao preço de emissão, uma vez que o preço de emissão pode ter em consideração a margem de lucro e os custos do Emitente e/ou distribuidor, além do valor justo de mercado dos Valores Mobiliários. O valor de mercado dos seus Valores Mobiliários poderá ser afetado pela volatilidade, nível, valor ou preço dos Ativo(s) Subjacentes no momento relevante, por alterações às taxas de juros, pela condição financeira e classificações de crédito do Emitente, pela oferta e procura dos Valores Mobiliários, o tempo restante até o vencimento ou maturidade dos Valores Mobiliários e outros fatores. O preço, se algum, pelo qual poderá vender os seus Valores Mobiliários antes da maturidade pode ser substancialmente menor do que o valor que investiu inicialmente. Os seus Valores Mobiliários poderão não ter um mercado de negociação ativo e o Emitente poderá não ter nenhuma obrigação de criar um mercado ou de voltar a comprar os Valores Mobiliários antes do resgate. O Emitente pode retirar a oferta pública a qualquer altura. Nesse caso, se já tiver pago ou entregue dinheiro de subscrição dos Valores Mobiliários relevantes, terá direito ao reembolso desses montantes, mas não receberá qualquer remuneração que possa ter acumulado no período entre o seu pagamento ou entrega de dinheiro de subscrição e o reembolso dos Valores Mobiliários.

Está sujeito a riscos associados à determinação do montante a pagar sob os Valores Mobiliários:

Os Valores Mobiliários vencem juros a uma taxa que está dependente do desempenho dos Ativos Subjacentes e pode variar de uma Data de Pagamento de Juros para a seguinte. Não poderá receber quaisquer pagamentos de juros se o(s) Ativo(s) Subjacente(s) não tiver(em) o desempenho previsto.

O Montante de Juros está condicionado ao desempenho do(s) Ativo(s) Subjacente(s) e pode ser zero quando os critérios de desempenho não são cumpridos. Nesse caso, o Montante de Juros pode ser diferido para o próximo pagamento de Juros que possa ser efetuado, mas não lhe será pago qualquer montante para compensar tal diferimento e é possível que não receba qualquer Juros durante toda a vida útil dos Valores Mobiliários.

O Montante dos Juros em que um valor de juros pré-determinado superior ou zero, dependendo se os critérios de desempenho tiverem sido atendidos. É possível que não receba juros durante toda a vida útil dos Valores Mobiliários.

O Montante Final de Liquidação em Numerário é baseado no desempenho do (s) Ativo (s) Subjacente (s) apenas na data de avaliação final (em vez de em relação a vários períodos ao longo do termo de vigência dos Valores Mobiliários). Isto significa que pode não beneficiar de qualquer movimento no nível do (s) Ativo (s) Subjacente (s) durante o prazo dos Valores Mobiliários que não seja mantido mesmo no desempenho final na data de avaliação final.

Uma vez que o Montante de Final de Liquidação está sujeito a um limite, o valor ou o retorno dos seus Valores Mobiliários pode ser significativamente inferior do que se tivesse adquirido o (s) Ativo (s) Subjacente (s) diretamente.

Está exposto ao desempenho de cada Ativo Subjacente. Independentemente do desempenho dos outros Ativos Subjacentes, se um ou mais Ativos Subjacentes não atingirem um limite ou barreira relevante para o pagamento de juros ou para o cálculo de qualquer montante de resgate, você pode não receber nenhum pagamento de juros e/ou pode perder parte ou a totalidade do seu investimento inicial.

O cálculo do valor a pagar depende do nível, valor ou preço do(s) Ativo(s) Subjacente(s) que atingem ou cruzam uma 'barreira' durante um período especificado ou datas especificadas durante o prazo dos outros constituintes é negativo em maior medida. Isso significa que você pode receber menos (ou, em certos casos, mais) se o nível, valor ou preço do(s) Ativo(s) Subjacente(s) cruzar ou atingir (conforme o caso) uma barreira, do que se chegar perto da barreira, mas não o alcança ou cruza (conforme aplicável) e, em certos casos, você pode não receber nenhum pagamento de juros ou cupão e/ou pode perder parte ou todo o seu investimento.

Os Valores Mobiliários fazem referência a um conjunto de Ativos Subjacentes, cada um dos quais demonstra características de risco únicas. Se os Ativos Subjacentes estiverem correlacionados, o desempenho do(s) Ativo(s) Subjacente(s) no conjunto pode ser esperado que se mova na mesma direção. Se o desempenho de um conjunto dá um "peso" maior a um constituinte do conjunto em comparação com outros constituintes do mesmo, o desempenho da conjunto será mais afetado por alterações no valor desse constituinte em particular do que um conjunto que atribui um peso igual a cada constituinte da conjunto. O desempenho dos componentes do conjunto pode ser moderado ou compensado um pelo outro. Isto significa que, mesmo no caso de um desempenho positivo de um ou mais constituintes, o desempenho do conjunto como um todo pode ser negativo se o desempenho dos outros constituintes for negativo em maior medida

Os seus Valores Mobiliários estão sujeitos a ajustes e ao resgate antecipado: De acordo com os termos e condições dos Valores Mobiliários, após a ocorrência de certos eventos de interrupção ou eventos extraordinários relacionados com o Emitente, os seus acordos de cobertura de posições, Ativos Subjacentes, tributação ou a divisa relevante dos Valores Mobiliários, o Agente de Determinação ou o Emitente poderão tomar um conjunto de ações corretivas, incluindo a estimativa do nível dos Ativo(s) Subjacentes, substituição dos Ativo(s) Subjacentes e ajustes nos termos e condições dos Valores Mobiliários. Qualquer uma dessas medidas corretivas pode alterar as características económicas dos Valores Mobiliários e ter um efeito adverso relevante no valor e no retorno dos Valores Mobiliários. Se nenhuma ação corretiva puder ser tomada ou se for determinado que o desempenho de qualquer uma das obrigações do Emitente sob os Valores Mobiliários é ilegal ou fisicamente impraticável, o Emitente poderá resgatar Antecipada mente os Valores Mobiliários mediante o pagamento de um Valor de Liquidação Antecipada. Se ocorrer um resgate antecipado, poderá perder parte ou todo o seu investimento porque o Montante da Liquidação Antecipada em Numerário poderá ser menor que o preço pelo qual comprou os Valores Mobiliários, podendo inclusive ser zero. Perderá também a oportunidade de participar em qualquer desempenho positivo subsequente dos Ativos Subjacentes e não poderá obter quaisquer ganhos potenciais no valor dos Valores Mobiliários. Poderá não conseguir reinvestir os recursos de um investimento com um retorno comparável e/ou com uma taxa de juros ou de cupão comparável para um nível de risco semelhante.

A liquidação está sujeita a condições e pode ser impossível em certas circunstâncias: O pagamento do valor devido a você não ocorrerá até que todas as condições de liquidação tenham sido integralmente satisfeitas. Nenhum valor adicional será pago a você pelo Emissor devido a qualquer atraso ou adiamento resultante. Certos eventos de interrupção da liquidação podem ocorrer, o que pode restringir a capacidade do Emitente de fazer pagamentos, e a data da liquidação pode ser atrasada em conformidade.

Certas informações específicas em relação aos Valores Mobiliários não são conhecidas no início de um período de oferta: Os termos e condições dos seus Valores Mobiliários fornecem apenas um montante indicativo. Os valores reais serão determinados com base nas condições de mercado pela

Emissora no final ou próximo ao final do período da oferta. Existe o risco de que os montantes indicativos não sejam iguais ao montante real, caso em que o retorno dos seus Valores Mobiliários pode ser materialmente diferente do retorno esperado com base no montante indicativo.

Riscos relacionados ao (s) ativo (s) subjacente (s) que são índices de ações: os índices de ações são compostos por uma carteira sintética de ações e fornecem oportunidades de diversificação de investimento, mas estarão sujeitos ao risco de flutuações nos preços das ações e no valor e volatilidade dos respetivos índice de ações. Os Valores Mobiliários estão atrelados a índices de ações e, como tal, não podem participar de dividendos ou quaisquer outras distribuições pagas sobre as ações que compõem tais índices. Consequentemente, você pode receber um retorno sobre os Valores Mobiliários menor do que teria recebido se tivesse investido diretamente nessas ações. O patrocinador do índice pode adicionar, excluir ou substituir os componentes de um índice de ações a seu critério, e também pode alterar a metodologia usada para calcular o nível desse índice. Estes eventos podem ter um impacto prejudicial no nível desse índice, o que, por sua vez, pode ter um impacto negativo no valor e na rentabilidade dos Valores Mobiliários.

O (s) Ativo (s) Subjacente (s) são 'benchmarks' para os fins do Regulamento de Benchmarks da UE (Regulamento (UE) 2016/1011, conforme alterado): De acordo com o Regulamento de Benchmarks, um Ativo Subjacente não pode ser usado de certas maneiras por uma UE entidade supervisionada condições de "equivalência" se não for "reconhecida" na pendência de uma decisão de equivalência ou não for "aprovada" por entidade supervisionada da UE após 31 de dezembro de 2021 se o seu administrador não obtiver autorização ou registo (ou, se for uma entidade não pertencente à UE, não cumprir as).

• **Riscos de tributação:** os níveis e a base da tributação dos Valores Mobiliários e quaisquer isenções para tal tributação dependerão das suas circunstâncias individuais e podem mudar a qualquer momento durante a vida dos Valores Mobiliários. Isso pode ter consequências adversas para você e, portanto, você deve consultar seus próprios consultores tributários quanto às consequências fiscais para você de transações envolvendo os Valores Mobiliários.

• **Potenciais conflitos de interesse:** podem existir conflitos de interesse quando o Barclays Bank PLC ou sua afiliada: (i) atua em múltiplas capacidades em relação aos Valores Mobiliários (por exemplo, atuando como emissor, gestor e agente de determinação); (ii) celebra transações de hedge para cobrir a exposição do Emitente aos valores em dinheiro relevantes a serem pagos ou ativos a serem entregues nos termos dos Valores Mobiliários no vencimento; e (iii) usa contribuições de preços de suas mesas de negociação como uma fonte de preços para um Ativo Subjacente. À luz de tais conflitos, as ações tomadas ou determinações feitas pelo Barclays Bank PLC em relação aos Valores Mobiliários podem nem sempre ser no melhor interesse dos titulares. Para além das transações de cobertura, o Barclays Bank PLC pode negociar no (s) Ativo (s) Subjacente (s) no decurso normal dos seus negócios. Tal negociação pode afetar o preço de mercado do (s) Ativo (s) Subjacente (s), o que pode, por sua vez, afetar de maneira adversa e relevante o valor e o retorno de seus Valores Mobiliários.

INFORMAÇÕES IMPORTANTES SOBRE A OFERTA DE VALORES MOBILIÁRIOS AO PÚBLICO E/OU A ADMISSÃO À NEGOCIAÇÃO EM MERCADO REGULAMENTADO

Sob quais condições e cronograma posso investir nesses valores mobiliários?

Termos e condições da oferta

Os termos e condições de qualquer oferta de Valores Mobiliários ao público podem ser determinados por acordo entre o Emitente e o Oferente Autorizado no momento de cada emissão.

Os Valores Mobiliários são oferecidos para subscrição em Portugal durante o período de 2 de julho de 2021 (inclusive) até 3 de agosto de 2021 (exclusive) (o "Período da Oferta") e esta oferta está sujeita às seguintes condições:

- **Preço de oferta:** O preço de emissão.
- **Condições às quais a oferta está sujeita:** O Emitente reserva o direito de retirar a oferta de Valores Mobiliários a qualquer momento antes do final do período de oferta. Após a retirada da oferta, se algum pedido tiver sido feito por qualquer investidor em potencial, cada investidor em potencial não terá o direito de assinar ou adquirir os Valores Mobiliários, e quaisquer pedidos serão automaticamente cancelados e qualquer dinheiro da compra será devolvido ao subscritor pelo Oferente Autorizado, de acordo com os procedimentos habituais do Oferente Autorizado.
- **Descrição do processo de candidatura:** Pode ser feita pelo Gestor ou pelo Oferente Autorizado uma oferta de Valores Mobiliários que não esteja de acordo com o Artigo 1 (4) do Regulamento do Prospeto da EU em Portugal (a "Jurisdição da Oferta Pública") durante o Período da Oferta. As solicitações dos Valores Mobiliários podem ser feitas na Jurisdição da Oferta Pública por meio do Oferente Autorizado durante o Período da Oferta. Os Valores Mobiliários serão colocados na Jurisdição da Oferta Pública pelo Oferente Autorizado. A distribuição será realizada de acordo com os procedimentos habituais do Oferente Autorizado, notificados aos investidores pelo Oferente Autorizado.
- **Informação detalhada sobre a quantidade mínima e/ou máxima de aplicação:** A quantidade mínima e máxima de solicitação do Oferente Autorizado será notificada aos investidores pelo Oferente Autorizado.
- **Descrição da possibilidade de redução de assinaturas e forma de reembolso do valor excedente pago pelos candidatos:** Não aplicável.
- **Informação detalhada relacionada com métodos e prazos de pagamento e entrega dos Valores Mobiliários:** Os investidores serão notificados pelo Oferente Autorizado sobre as suas alocações de Valores Mobiliários e os acordos de liquidação em relação a estes.
- **Procedimento para exercício de qualquer direito de preferência, negociabilidade dos direitos de subscrição e tratamento dos direitos de subscrição não exercidos:** Não aplicável.
- **Forma e data em que os resultados da oferta serão divulgados:** Os investidores serão notificados pelo Oferente Autorizado sobre as suas alocações de Valores Mobiliários e os acordos de liquidação em relação a estes.
- **Categorias de titulares aos quais os Valores Mobiliários são oferecidos e se a(s) Tranche(s) foram reservados para determinados países:** As ofertas podem ser feitas através do Oferente Autorizado na Jurisdição da Oferta Pública a qualquer pessoa. As ofertas (se alguma) em outros países do EEE serão feitas apenas por meio do Oferente Autorizado, de acordo com uma isenção da obrigação prevista no Regulamento do Prospeto de publicar um prospeto.
- **Processo para notificação aos subscritores do valor atribuído e a indicação se a negociação pode começar antes da notificação:** Os subscritores serão notificados diretamente pelo Oferente Autorizado do sucesso da sua subscrição. Nenhuma negociação nos Valores Mobiliários pode ocorrer antes da Data de Emissão.
- **Nome(s) e endereço(s), na medida que estes sejam conhecidos pelo emitente, dos licitadores nos diversos países em que a oferta ocorre:** Oferente Autorizado

Despesas totais estimadas da emissão e/ou oferta, incluindo as despesas cobradas ao investidor pelo emitente/oferte

As despesas totais estimadas da emissão e/ou oferta são de 1.000 EUR.

O Emitente não cobrará aos detentores nenhuma despesa relacionada com qualquer emissão de Valores Mobiliários. No entanto, os oferentes podem cobrar despesas aos titulares. Tais despesas (se alguma) serão determinadas por acordo entre o oferente e os titulares no momento de cada emissão.

Quem é o oferente e/ou a pessoa que solicita a admissão à negociação?

Consulte o item "O(s) Oferente(s) Autorizado(s)" acima.

Porque é que este Prospeto está a ser feito?

Uso e valor líquido estimado dos recursos

O produto líquido de cada emissão de Valores Mobiliários será aplicado pelo Emitente para os seus objetivos empresariais gerais, que incluem obter lucro e/ou proteção de certos riscos.

Contrato de subscrição com base num compromisso firme

A oferta dos Valores Mobiliários não está sujeita a um contrato de subscrição com base num compromisso firme.

Descrição de qualquer interesse material para a emissão/oferta, incluindo conflito de interesses

O Oferente Autorizado poderá receber taxas relacionadas a oferta de Valores Mobiliários. Poderão existir potenciais conflitos de interesse entre o Emitente, o Agente de Determinação, o Oferente Autorizado ou as suas afiliadas (que podem ter interesses em transações de derivativos relacionados com os ativos subjacentes que podem, mas não se destinam a, afetar adversamente o preço de mercado, a liquidez ou valor dos Valores Mobiliários) e titulares.

O Oferente Autorizado receberá comissões agregadas não superiores a 2,50%. Qualquer Oferente Autorizado e as suas afiliadas podem envolver-se, e no futuro envolver-se, em cobertura de posições relacionadas com os Ativo Subjacente.