



CAP EURO N°2

COMMUNICATION À CARACTÈRE PROMOTIONNEL

TITRE DE CRÉANCE COMPLEXE DE DROIT FRANÇAIS PRÉSENTANT UN RISQUE DE PERTE EN CAPITAL PARTIELLE OU TOTALE EN COURS DE VIE ET À L'ÉCHÉANCE, CI-APRÈS LE « TITRE DE CRÉANCE » OU « TITRE ».

Produit de placement risqué alternatif à un placement dynamique risqué de type « actions ».

Durée d'investissement conseillée : 5 ans et 4 mois (hors activation du mécanisme de remboursement automatique anticipé⁽¹⁾). Le mécanisme de remboursement automatique anticipé intervient si, du semestre 2 au semestre 9, à l'une des Dates de Constatation Semestrielle⁽²⁾, le niveau de l'Indice EURO STOXX 50® ne clôture pas en baisse par rapport à son Niveau Initial⁽³⁾. L'investisseur prend un risque de perte en capital partielle ou totale non mesurable a priori si les titres de créance sont revendus avant la date de maturité (Date de Remboursement Automatique Anticipé⁽²⁾ ou Date de Remboursement Final⁽²⁾ selon le cas).

- **Émetteur :** Barclays Bank PLC (Moody's A1, Standard & Poor's A, Fitch Ratings A+)⁽⁴⁾. L'investisseur supporte le risque de crédit lié au non-remboursement en cas de faillite, de défaut de paiement et mise en résolution de Barclays Bank PLC en tant qu'émetteur.
- **Éligibilité :** contrats d'assurance vie ou de capitalisation en unités de compte et comptes-titres. La présente brochure décrit les caractéristiques du produit et ne prend pas en compte les spécificités des contrats d'assurance vie ou de capitalisation dans le cadre desquels ce produit est proposé. Ce document ne constitue pas une offre d'adhésion au contrat d'assurance vie. **L'assureur s'engage exclusivement sur le nombre d'unités de compte mais non sur leur valeur, qu'il ne garantit pas. Il est précisé que l'entreprise d'assurance, d'une part, l'émetteur, d'autre part, sont des entités juridiques indépendantes. Ce document n'a pas été rédigé par l'assureur.**
- **Période de commercialisation :** du 08/03/2021 au 30/06/2021. Montant du nominal de l'Émission limité⁽⁵⁾.
- **Catégorie d'investisseurs :** cet instrument financier s'adresse à des investisseurs professionnels et non-professionnels.
- **Cotation :** Marché officiel de la Bourse de Luxembourg (marché réglementé).
- **ISIN :** FR0014001ZG6

La documentation juridique composée des Conditions Définitives d'Émission en date du 08 Mars 2021, se rattachant au prospectus de base, qui se compose du document Securities Note en date du 17 Juillet 2020 et du Document d'Enregistrement en date du 24 Mars 2020 ainsi que de leurs suppléments, a été publiée et est disponible sur le site internet de l'AMF, <http://www.amf-france.org>. Ces documents sont également disponibles gratuitement, sur simple demande auprès du distributeur. Document à caractère promotionnel à destination de clients non professionnels au sens de la directive MIF II (Directive Européenne 2014/65/CE).

⁽¹⁾ Le mécanisme de remboursement automatique anticipé et ses conditions sont détaillées dans cette brochure (pages 4 et 7).

⁽²⁾ Le détail des dates figure en page 7 de la présente brochure.

⁽³⁾ Cours de clôture à la Date de Constatation Initiale du 30 juin 2021

⁽⁴⁾ Notations en vigueur au 08 février 2021. Les agences de notation peuvent les modifier à tout moment et ne sont pas une garantie de solvabilité de l'Émetteur. Elles ne sauraient constituer un argument de souscription au produit.

⁽⁵⁾ Une fois atteint le montant du nominal total de l'Émission prévu dans les Conditions Définitives (« Final Terms »), la commercialisation du produit CAP EURO N°2 pourra cesser à tout moment sans préavis avant la fin de la période de commercialisation.

POINTS CLÉS

- **Un investissement d'une durée maximum de 5 ans et 4 mois⁽¹⁾.**
- L'investisseur est exposé au marché actions par le biais d'une **exposition à l'indice EURO STOXX 50®** (code Bloomberg : SX5E, code Reuters : .STOXX50E) (l'« Indice ») pour une durée de 1 à 5 ans et 4 mois. Le remboursement du Titre « CAP EURO N°2 » est conditionné à l'évolution de cet indice **calculé dividendes non réinvestis, ce qui est moins favorable pour l'investisseur par rapport au cas où les dividendes sont réinvestis.**
- À la Date de Constatation Finale⁽²⁾, en cas de baisse de l'Indice de plus de 30% depuis la Date de Constatation Initiale⁽²⁾, l'investisseur subit une perte en capital à hauteur de l'intégralité de la baisse enregistrée par l'Indice. Afin de bénéficier d'un remboursement du capital initial en cas de baisse de moins de 30% de l'Indice à la Date de Constatation Finale⁽²⁾, l'investisseur accepte de limiter ses gains à 1.50%⁽³⁾ par semestre écoulé depuis la Date de Constatation Initiale⁽²⁾ en cas de forte hausse du marché actions (Taux de Rendement Annualisé brut maximum de 2.90%⁽³⁾).
- **Un mécanisme de remboursement anticipé activable automatiquement tous les semestres à partir du semestre 2 (inclus) jusqu'au semestre 9 (inclus)** si, à chaque Date de Remboursement Automatique Anticipé⁽²⁾, la performance de l'Indice est positive ou nulle par rapport à son Niveau Initial⁽⁴⁾.
- **Un objectif de gain potentiel plafonné à 1.50%⁽³⁾ par semestre écoulé depuis la Date de Constatation Initiale⁽²⁾** (soit un Taux de Rendement Annualisé brut maximum de 2.90%⁽³⁾) en cas d'activation automatique du mécanisme de remboursement anticipé ou si l'Indice enregistre, à la Date de Constatation Finale⁽²⁾, une performance supérieure ou égale à -30% par rapport à son Niveau Initial⁽⁴⁾.
- **Un risque de perte partielle ou totale en capital en cours de vie et à l'échéance** si l'Indice, à la Date de Constatation Finale⁽²⁾, enregistre une baisse de plus de 30% depuis la Date de Constatation Initiale⁽²⁾. Par exemple, si l'Indice enregistre une baisse égale à 40% par rapport à son Niveau Initial⁽⁴⁾, l'investisseur subira une perte en capital équivalente à la performance négative de l'Indice depuis la Date de Constatation Initiale, soit un remboursement à hauteur de 60% du capital initial⁽³⁾.
- **Un remboursement du capital⁽³⁾ à l'échéance** si l'Indice, à la Date de Constatation Finale⁽²⁾, n'enregistre pas de baisse de plus de 30% par rapport à son Niveau Initial⁽⁴⁾.

Les termes « capital » et « capital initial » utilisés dans cette brochure désignent la valeur nominale du produit CAP EURO N°2, soit 1 000 euros. Les gains ou pertes résultant de l'investissement sur ce titre de créance s'entendent hors commission ou frais d'entrée, de rachat, de réorientation d'épargne et de gestion liés, le cas échéant, au contrat d'assurance vie, de capitalisation ou de comptes titres, et/ou fiscalité et prélèvements sociaux applicables.

Les Taux de Rendement Annualisés (TRA) nets mentionnés dans cette brochure sont nets de frais de gestion dans le cas d'un contrat d'assurance vie ou de capitalisation ou nets de droits de garde dans le cas d'un investissement en compte titres (en prenant comme hypothèse un taux de frais de gestion ou de droits de garde de 1% annuel) et sont calculés hors prélèvements fiscaux et sociaux. D'autres frais, tels que les frais d'entrée ou d'arbitrage dans le cas d'un contrat d'assurance, ou tels que des frais dans le cas d'un investissement en comptes titres pourront être appliqués. Les TRA s'entendent hors faillite, défaut de paiement et mise en résolution de l'Émetteur. Ces TRA ne correspondent donc pas nécessairement aux rendements effectifs obtenus par les investisseurs sur leur placement. Dans cette brochure, les calculs sont effectués pour un investissement de 1 000 euros à la Date de Constatation Initiale (le 30/06/2021) et une détention jusqu'à la Date de Remboursement Final (le 14/07/2026) ou, selon le cas, la Date de Remboursement Automatique Anticipé⁽²⁾. En cas de vente du Titre de créance avant ces dates (ou en cas d'arbitrage ou de rachat pour les contrats d'assurance-vie/capitalisation, ou de dénouement par décès pour les contrats d'assurance-vie), les TRA peuvent être supérieurs ou inférieurs à ceux indiqués dans cette brochure. De plus, l'investisseur peut subir une perte en capital partielle ou totale non mesurable a priori. **Les avantages du Titre de créance ne profitent qu'aux seuls investisseurs conservant le Titre de créance jusqu'à son échéance effective.**

Les titres de créance CAP EURO N°2 sont proposés comme actif représentatif d'une unité de compte dans le cadre de contrats d'assurance-vie ou de capitalisation. La présente brochure décrit les caractéristiques du produit CAP EURO N°2 et ne prend pas en compte les spécificités des contrats d'assurance-vie ou de capitalisation dans le cadre desquels ce produit est proposé.

L'assureur s'engage exclusivement sur le nombre d'unités de compte mais non sur leur valeur, qu'il ne garantit pas. Il est précisé que l'entreprise d'assurance d'une part, l'Émetteur d'autre part sont des entités juridiques indépendantes. Ce document n'a pas été rédigé par l'assureur.

⁽¹⁾ Sujet à un mécanisme de remboursement automatique anticipé.

⁽²⁾ Le détail des dates figure en page 7 de la présente brochure.

⁽³⁾ Hors frais de gestion, commission de souscription ou frais d'entrée, de rachat, et/ou fiscalité et prélèvement sociaux applicables au cadre d'investissement et sauf faillite, défaut de paiement et mise en résolution de Barclays Bank PLC.

⁽⁴⁾ Cours de clôture à la Date de Constatation Initiale du 30 juin 2021.



AVANTAGES

- Du semestre 2 (inclus) au semestre 9 (inclus), si à l'une des Dates de Constatation Semestrielle⁽¹⁾, la performance de l'Indice est positive ou nulle par rapport à son Niveau Initial⁽²⁾, le mécanisme de remboursement anticipé est automatiquement activé. **L'investisseur reçoit alors 100% du capital initial⁽³⁾ majoré d'un gain de 1.50%⁽³⁾ par semestre écoulé depuis la Date de Constatation Initiale⁽¹⁾** (soit un Taux de Rendement Annualisé brut maximum de 2.90%⁽³⁾).
- À l'échéance, au semestre 10, si le mécanisme de remboursement anticipé n'a pas été automatiquement activé précédemment et si l'Indice enregistre une performance supérieure ou égale à - 30% par rapport à son Niveau Initial⁽²⁾, **l'investisseur reçoit, à la Date de Remboursement Final⁽¹⁾, 100% du capital initial⁽³⁾ majoré d'un gain de 1.50%⁽³⁾ par semestre écoulé depuis la Date de Constatation Initiale⁽¹⁾**, soit un gain total de 15% du capital initial⁽³⁾. Le Taux de Rendement Annualisé brut est alors égal à 2.81%⁽³⁾.

INCONVÉNIENTS

- **CAP EURO N°2 présente un risque de perte partielle ou totale du capital en cours de vie** (en cas de revente du produit à l'initiative de l'investisseur alors que les conditions de remboursement automatique ne sont pas remplies, dans ce cas, la formule de remboursement ne s'applique pas et le prix dépend alors des paramètres de marché le jour de la revente) **et à l'échéance** (si, à la Date de Constatation Finale⁽¹⁾, le niveau de l'Indice est inférieur à 70% de son Niveau Initial⁽²⁾). Si le cadre d'investissement du produit est un contrat d'assurance-vie ou de capitalisation, le dénouement ou le rachat partiel de celui-ci peut entraîner le désinvestissement des unités de compte adossées aux titres de créance avant leur Date de Remboursement Final⁽¹⁾.
- **Le rendement du produit CAP EURO N°2 à l'échéance est très sensible** à une faible variation de la performance de l'Indice autour des seuils de 70% et de 100% de son Niveau Initial⁽²⁾.
- **L'investisseur ne connaît pas à l'avance la durée exacte de son investissement** qui peut varier de 1 an (2 semestres) à 5 ans et 4 mois (10 semestres) si le mécanisme de remboursement anticipé n'a pas été automatiquement activé.
- **L'investisseur peut ne bénéficier que d'une hausse partielle de l'Indice du fait du mécanisme de plafonnement des gains** (1.50%⁽³⁾ par semestre écoulé, soit un Taux de Rendement Annualisé brut maximum de 2.90%⁽³⁾).
- **L'investisseur est exposé à une dégradation de la qualité de crédit de l'Émetteur** (qui induit un risque sur la valeur de marché du produit) **et un éventuel défaut de paiement, faillite et mise en résolution** de ce dernier (qui induit un risque sur le remboursement).
- **L'investisseur ne bénéficie pas des dividendes éventuellement détachés par les actions composant l'indice EURO STOXX 50®**. La performance d'un Indice « dividendes non réinvestis » est inférieure à celle d'un Indice « dividendes réinvestis ».
- **Aucun gain ne sera versé dans un contexte de marché fortement baissier** (performance de l'Indice toujours strictement inférieure à -30% depuis la Date de Constatation Initiale⁽¹⁾ par exemple).

⁽¹⁾ Le détail des dates figure en page 7 de la présente brochure.

⁽²⁾ Cours de clôture à la Date de Constatation Initiale du 30 juin 2021.

⁽³⁾ Hors frais de gestion, commission de souscription ou frais d'entrée, de rachat, et/ou fiscalité et prélèvement sociaux applicables au cadre d'investissement et sauf faillite, défaut de paiement et mise en résolution de Barclays Bank PLC.

MÉCANISME DE REMBOURSEMENT

À la Date de Constatation Initiale du 30 juin 2021, on observe le niveau de clôture de l'indice EURO STOXX 50® et on le retient comme Niveau Initial.

MÉCANISME DE REMBOURSEMENT AUTOMATIQUE ANTICIPÉ

- À l'issue de chaque semestre à partir du semestre 2 (inclus) jusqu'au semestre 9 (inclus), si à la Date de Constatation Semestrielle⁽¹⁾, si l'Indice EURO STOXX 50® ne clôture pas en baisse par rapport à son Niveau Initial, **le mécanisme de remboursement anticipé est automatiquement activé et le produit s'arrête**. L'investisseur reçoit à la Date de Remboursement Automatique Anticipé⁽¹⁾ correspondante :

100% du capital initial⁽²⁾
+
Un gain de 1.50%⁽²⁾ par semestre écoulé depuis la Date de Constatation Initiale⁽¹⁾
(soit un TRA brut compris entre 2.83%⁽²⁾ et 2.90%⁽²⁾ et net compris entre 1.87%⁽³⁾ et 1.91%⁽³⁾)

- Si le mécanisme de remboursement automatique anticipé n'est pas activé, **le produit continue** jusqu'à l'échéance des 5 ans et 4 mois.

MÉCANISME DE REMBOURSEMENT À L'ÉCHÉANCE DES 10 SEMESTRES

À la Date de Constatation Finale⁽¹⁾, à l'issue du semestre 10, si le mécanisme de remboursement anticipé n'a pas été automatiquement activé précédemment, on observe la performance de l'Indice par rapport à son Niveau Initial.

CAS FAVORABLE : Si l'Indice EURO STOXX 50® ne clôture pas en baisse de plus de 30% par rapport à son Niveau Initial, l'investisseur reçoit à la Date de Remboursement Final⁽¹⁾ :

100% du capital initial⁽²⁾
+
Un gain de 1.50%⁽²⁾ par semestre écoulé depuis la Date de Constatation Initiale⁽¹⁾,
soit un gain total de 15% du capital initial⁽²⁾ (soit un TRA brut de 2.81%⁽²⁾ et net de 1.86%⁽³⁾)

CAS DÉFAVORABLE : Sinon, si l'Indice EURO STOXX 50® clôture en baisse de plus de 30% par rapport à son Niveau Initial, l'investisseur subit une perte en capital partielle ou totale et reçoit à la Date de Remboursement Final⁽¹⁾ :

La Valeur Finale de l'Indice⁽⁴⁾ multipliée par le capital initial⁽²⁾
(soit un TRA brut et net négatif)

⁽¹⁾ Le détail des dates figure en page 7 de la présente brochure.

⁽²⁾ Hors frais de gestion, commission de souscription ou frais d'entrée, de rachat, et/ou fiscalité et prélèvement sociaux applicables au cadre d'investissement et sauf faillite, défaut de paiement et mise en résolution de Barclays Bank PLC.

⁽³⁾ Net des frais de gestion dans le cas d'un contrat d'assurance vie ou de capitalisation ou net de droits de garde dans le cas d'un investissement en compte titres (en prenant comme hypothèse un taux de frais de gestion ou de droits de garde de 1% annuel), sans prise en compte des frais d'entrée/d'arbitrage dans le cas d'un contrat d'assurance vie ou de capitalisation, ni des prélèvements sociaux et fiscaux. Le montant net affiché s'entend hors faillite, défaut de paiement et mise en résolution de l'Émetteur. Une sortie anticipée à l'initiative de l'investisseur se fera à un cours dépendant de l'évolution des paramètres de marché au moment de la sortie (niveau de l'Indice, des taux d'intérêt, de la volatilité et des primes de risque de crédit) et pourra donc entraîner un risque sur le capital.

⁽⁴⁾ La Valeur Finale de l'Indice à l'échéance est exprimée en pourcentage de sa valeur initiale.

ILLUSTRATIONS DU REMBOURSEMENT

LES DONNÉES CHIFFRÉES UTILISÉES DANS CES EXEMPLES N'ONT QU'UNE VALEUR INDICATIVE ET INFORMATIVE, L'OBJECTIF ÉTANT DE DÉCRIRE LE MÉCANISME DU PRODUIT. ELLES NE PRÉJUGENT EN RIEN DE RÉSULTATS FUTURS ET NE SAURAIENT CONSTITUER EN AUCUNE MANIÈRE UNE OFFRE COMMERCIALE.

- - - Seuil d'activation du mécanisme de remboursement anticipé
- - - Seuil de perte en capital et de versement des gains à l'échéance (70%)
- Performance de l'Indice EURO STOXX 50® par rapport à son Niveau Initial

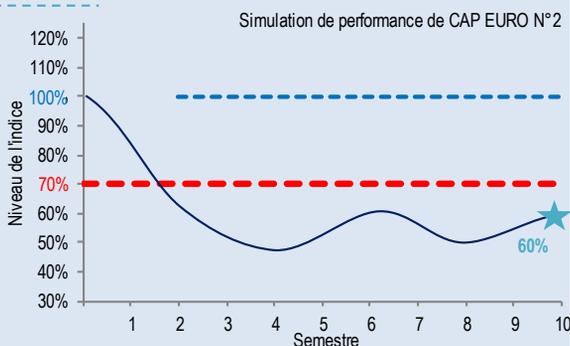
- ★ Valeur de remboursement
- ↓ Plafonnement des gains

CAS DÉFAVORABLE : INDICE FORTEMENT BAISSIER À LONG TERME

À chaque Date de Constatation Semestrielle⁽¹⁾, la performance de l'Indice est négative par rapport au Niveau Initial⁽²⁾. Le mécanisme de remboursement anticipé n'est donc pas activé.

À la fin du semestre 10, l'Indice clôture en baisse de 40% par rapport à son Niveau Initial⁽²⁾ soit en dessous du seuil de perte en capital à l'échéance. **L'investisseur reçoit à l'échéance 60% du capital initial⁽³⁾**. Le Taux de Rendement Annualisé est alors de -9.64% brut⁽³⁾ et de -10.85% net⁽⁴⁾ (similaire pour un investissement direct dans l'Indice).

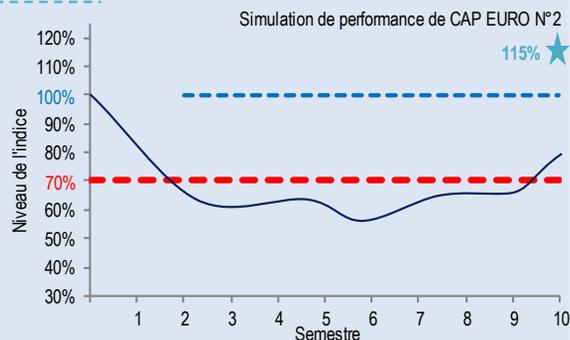
L'investisseur subit dans ce cas une perte en capital qui peut être totale dans le cas le plus défavorable.



CAS MÉDIAN : BAISSÉ DE L'INDICE INFÉRIEURE À 30% À ÉCHÉANCE

À chaque Date de Constatation Semestrielle⁽¹⁾, la performance de l'Indice est négative par rapport au Niveau Initial⁽²⁾. Le mécanisme de remboursement anticipé n'est donc pas activé.

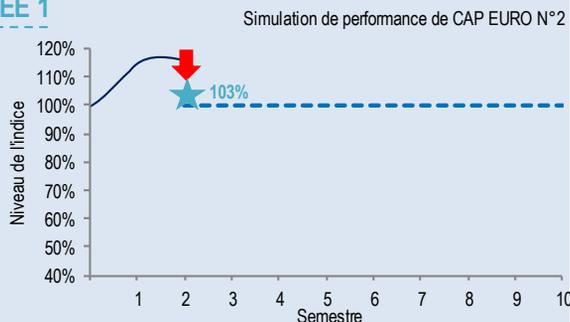
À la fin du semestre 10, l'Indice clôture en baisse de 20% par rapport à son Niveau Initial⁽²⁾ et se maintient donc au-dessus du seuil de perte en capital à l'échéance. **L'investisseur reçoit à l'échéance 100% du capital initial⁽³⁾ majoré d'un gain de 1.50%⁽³⁾ par semestre écoulé, soit au total 115% du capital initial⁽³⁾**. Le Taux de Rendement Annualisé est alors de 2.81% brut⁽³⁾ et de 1.86% net⁽⁴⁾ (contre un Taux de Rendement Annualisé de -4.33%⁽³⁾ pour un investissement direct dans l'Indice).



CAS FAVORABLE : HAUSSE DE L'INDICE À LA FIN DE L'ANNÉE 1

À l'issue du semestre 2, l'Indice enregistre une performance égale à +15% par rapport à son Niveau Initial⁽²⁾ : le mécanisme de remboursement anticipé est donc automatiquement activé.

L'investisseur reçoit alors 100% du capital initial⁽³⁾ majoré d'un gain de 1.50%⁽³⁾ par semestre écoulé, soit au total 103% du capital initial⁽³⁾. Le Taux de Rendement Annualisé est alors de 2.89% brut⁽³⁾ et de 1.89% net⁽⁴⁾ (contre un Taux de Rendement Annualisé de 14.41%⁽³⁾ pour un investissement direct dans l'Indice du fait du plafonnement des gains).



⁽¹⁾ Le détail des dates figure en page 7 de la présente brochure.

⁽²⁾ Cours de clôture à la Date de Constatation Initiale du 30 juin 2021.

⁽³⁾ Hors frais de gestion, commission de souscription ou frais d'entrée, de rachat, et/ou fiscalité et prélèvement sociaux applicables au cadre d'investissement et sauf faillite, défaut de paiement et mise en résolution de Barclays Bank PLC.

⁽⁴⁾ Net des frais de gestion dans le cas d'un contrat d'assurance vie ou de capitalisation ou net de droits de garde dans le cas d'un investissement en compte titres (en prenant comme hypothèse un taux de frais de gestion ou de droits de garde de 1 % annuel), sans prise en compte des frais d'entrée/d'arbitrage dans le cas d'un contrat d'assurance vie ou de capitalisation, ni des prélèvements sociaux et fiscaux. Le montant net affiché s'entend hors faillite, défaut de paiement et mise en résolution de l'Émetteur. Une sortie anticipée à l'initiative de l'investisseur se fera à un cours dépendant de l'évolution des paramètres de marché au moment de la sortie (niveau de l'Indice, des taux d'intérêt, de la volatilité et des primes de risque de crédit) et pourra donc entraîner un risque sur le capital.

PRÉSENTATION DU SOUS-JACENT

DESCRIPTION

L'indice EURO STOXX 50®, dividendes non réinvestis, est composé des 50 premières sociétés de la Zone Euro, sélectionnées sur la base de la capitalisation boursière, du volume des transactions et du secteur d'activité. Il respecte une pondération géographique et sectorielle qui reflète la structure et le développement économique de la Zone Euro.

Les dividendes éventuellement détachés par les actions qui composent cet indice ne sont pas réinvestis et ne bénéficient donc pas à la performance de l'Indice, ce qui est moins favorable pour l'investisseur.

L'Indice est calculé et publié par le fournisseur d'indices internationaux STOXX Limited. Le poids de chaque valeur dans l'Indice est ajusté sur la base de sa capitalisation boursière, ainsi qu'en proportion du nombre de titres disponibles sur le marché. Par conséquent, le nombre de valeurs entrant dans la composition du panier constituant l'Indice peut évoluer au cours du temps. La composition de l'Indice est revue tous les ans afin de maintenir cette représentativité.

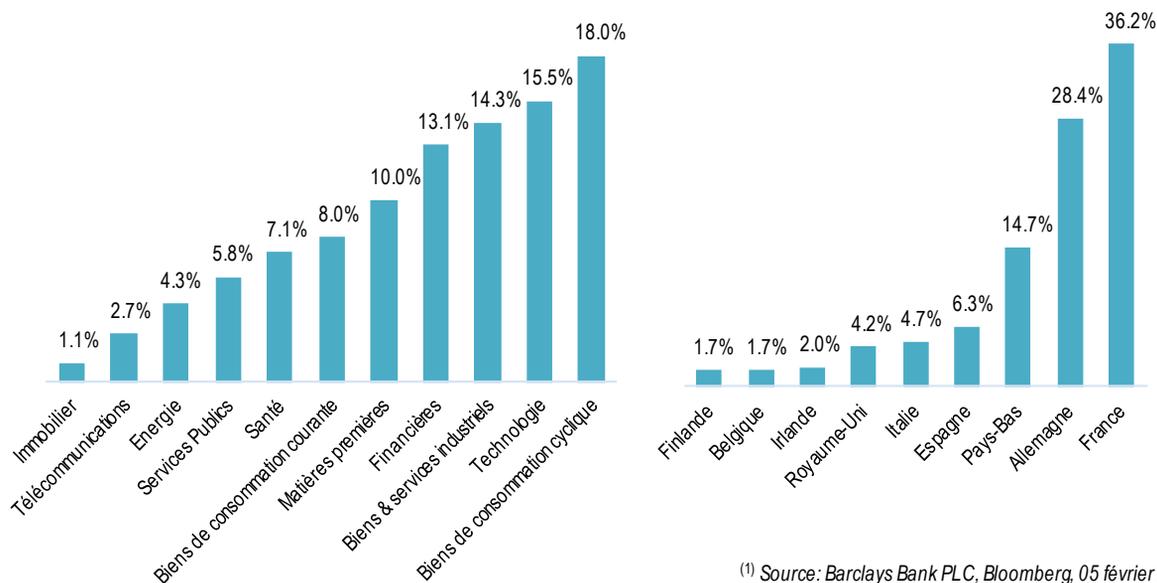
Pour de plus amples informations sur l'Indice, consulter le site www.stoxx.com, code Bloomberg : SX5E Index, code Reuters : .STOXX50E, code ISIN : EU0009658145.

ÉVOLUTION HISTORIQUE DE L'INDICE EURO STOXX 50® SUR 10 ANS⁽¹⁾



LES DONNÉES RELATIVES AUX PERFORMANCES PASSÉES ONT TRAIT OU SE RÉFÈRENT À DES PÉRIODES PASSÉES ET NE SONT PAS UN INDICATEUR FIABLE DES RÉSULTATS FUTURS. CECI EST VALABLE ÉGALEMENT POUR CE QUI EST DES DONNÉES HISTORIQUES DE MARCHÉ. L'exactitude, l'exhaustivité ou la pertinence de l'information provenant de sources externes n'est pas garantie, bien qu'elle ait été obtenue auprès de sources raisonnablement jugées fiables. Sous réserve des lois applicables, l'Émetteur n'assume pas de responsabilité à cet égard. Les éléments du présent document relatifs aux données de marchés sont fournis sur la base de données constatées à un moment précis et qui sont susceptibles de varier.

RÉPARTITIONS SECTORIELLE ET GÉOGRAPHIQUE⁽¹⁾



⁽¹⁾ Source: Barclays Bank PLC, Bloomberg, 05 février 2021

PRINCIPALES CARACTÉRISTIQUES FINANCIÈRES

Nature juridique	Titres de créance complexes de droit français présentant un risque de perte en capital en cours de vie ou à l'échéance.
Émetteur	Barclays Bank PLC (Moody's A1, Standard & Poor's A, Fitch Ratings A+). Notations en vigueur au 08 février 2021. Les agences de notation peuvent les modifier à tout moment et ne sont pas une garantie de solvabilité de l'Émetteur. Elles ne sauraient constituer un argument de souscription au produit.
Devise	Euro
Garantie en capital	Pas de garantie en Capital, ni en cours de vie, ni à l'échéance
Code ISIN	FR0014001ZG6
Éligibilité	Comptes-titres, contrats d'assurance vie et de capitalisation
Période de commercialisation	Du 08/03/2021 au 30/06/2021. La commercialisation du produit peut cesser à tout moment sans préavis avant le 30/06/2021.
Taille de l'Émission	30 000 000 €
Prix d'Émission	100% de la Valeur Nominale
Prix d'achat	100% du Prix d'Émission
Valeur nominale	1 000 € (Minimum de souscription : 1 titre)
Durée d'investissement	5 ans et 4 mois (hors activation du mécanisme de remboursement automatique anticipé)
Niveau Initial	Prix de clôture du Sous-Jacent à la Date de Constatation Initiale
Date d'Émission	8 mars 2021
Date de Constatation Initiale	30 juin 2021
Dates de Constatation Semestrielle	30 juin 2022, 30 décembre 2022, 30 juin 2023, 02 janvier 2024, 01 juillet 2024, 30 décembre 2024, 30 juin 2025, 30 décembre 2025, 30 juin 2026
Dates de Paiement	14 juillet 2022, 16 janvier 2023, 14 juillet 2023, 16 janvier 2024, 15 juillet 2024, 14 janvier 2025, 14 juillet 2025, 14 janvier 2026, 14 juillet 2026
Dates de Remboursement Automatique Anticipé	14 juillet 2022, 16 janvier 2023, 14 juillet 2023, 16 janvier 2024, 15 juillet 2024, 14 janvier 2025, 14 juillet 2025, 14 janvier 2026
Date de Constatation Finale	30 juin 2026
Date de Remboursement Final	14 juillet 2026
Sous-jacent	Indice EURO STOXX 50® (code Bloomberg : SX5E Index, code Reuters : .STOXX50E, code ISIN : EU0009658145, devise de référence : EUR) dividendes non réinvestis, ce qui est moins favorable pour l'investisseur.
Commission de souscription et commission de rachat	1.50% / Néant
Commission de distribution	Des commissions incluses dans le prix d'achat ont été payées au titre de cette transaction au distributeur. Elles couvrent les coûts de la distribution et sont d'un montant annuel maximum équivalent à 2.00% TTC de la Valeur Nominale des titres (calculées sur la durée de vie totale des titres de 5 ans et 4 mois). Le versement de cette rémunération pourra être indifféremment réparti sur la durée de vie du produit par une rémunération à l'émission du produit et/ou par des commissions annuelles. Une information complémentaire pourra être fournie aux investisseurs et investisseurs potentiels sur simple demande auprès du distributeur.
Marché secondaire	Barclays Bank PLC s'engage, dans des conditions normales de marché et de financement, à donner de manière quotidienne des prix indicatifs pendant toute la durée de vie du produit avec une fourchette achat/vente maximum de 1%.
Publication et périodicité de la valorisation	Les valorisations indicatives des titres seront tenues à la disposition du public en permanence et publiées de manière quotidienne sur Reuters, Telekurs et Bloomberg.
Diffusion des cours	Les cours seront diffusés quotidiennement, et si ce jour n'est pas un Jour de Bourse prévu, le Jour de Bourse prévu suivant, et à titre indicatif sur la page publique Reuters « FR0014001ZG6=BARL ».
Frais de sortie	Néant
Double valorisation	En plus de celle produite par Barclays Bank PLC, une double valorisation du Titre de créance sera assurée, tous les quinze jours à compter de la Date de Constatation Initiale par une société de service indépendante financièrement de Barclays Bank PLC, Derivative Partners. Ce service est payé par Barclays Bank PLC.
Offre au Public	En France uniquement
Règlement/Livraison	Euroclear France
Cotation	Marché officiel de la Bourse de Luxembourg (marché réglementé)
Droit applicable	Droit français
Agent de calcul	Barclays Bank PLC, ce qui peut être source de conflit d'intérêt.

AVERTISSEMENT

Ce document à caractère promotionnel est établi sous la responsabilité de Volcap Europe agent lié de TP ICAP Europe, qui commercialise le produit **CAP EURO N°2**. Ce document est destiné à être distribué dans le cadre d'une offre public en France : **ce document ne constitue pas une proposition de souscription au contrat d'assurance vie ou de capitalisation ni une offre de contrat, une sollicitation, un conseil ou une recommandation en vue de l'achat ou de la vente du produit qui y est décrit**. Volcap Europe est amené à percevoir des rétrocessions de la part de nos fournisseurs de produits en contrepartie du service de distribution. Une information complète sur le produit, notamment ses facteurs de risques inhérents au Titre de créance, ne peut être obtenue qu'en lisant le prospectus de base (le « Prospectus ») et les Conditions Définitives. Ce document constitue une présentation commerciale. Il ne saurait en aucun cas constituer une recommandation personnalisée d'investissement ou une sollicitation ou une offre en vue de la souscription au Titre de créance. Il est diffusé au public, indifféremment de la personne qui en est destinataire. Ainsi le support financier visé ne prend en compte aucun objectif d'investissement, situation financière ou besoin spécifique à un destinataire en particulier. En cas de souscription, l'investisseur doit obligatoirement consulter préalablement le Prospectus de **CAP EURO N°2** afin notamment de prendre connaissance de manière exacte des risques encourus. L'investissement doit s'effectuer en fonction de ses objectifs d'investissement, son horizon d'investissement, son expérience et sa capacité à faire face au risque lié à la transaction. L'investisseur est invité, s'il le juge nécessaire, à consulter ses propres conseils juridiques, fiscaux, financiers, comptables et tous autres professionnels compétents, afin de s'assurer que ce Titre de créance est conforme à ses besoins au regard de sa situation, notamment financière, juridique, fiscale ou comptable. L'attention de l'investisseur est attirée sur le fait que la souscription à ce support financier peut faire l'objet de restrictions à l'égard de certaines personnes ou de certains pays en vertu des réglementations nationales applicables à ces personnes. **IL VOUS APPARTIEN DONC DE VOUS ASSURER QUE VOUS ÊTES AUTORISÉS À SOUSCRIRE À CE PRODUIT**. Il conviendrait de préciser que les titres décrits aux présentes ne peuvent à aucun moment être la propriété légale ou effective d'une « US person » au sens défini dans la Régulation S, et par voie de conséquence sont offerts et vendus hors des États-Unis à des personnes qui ne sont pas ressortissantes des États-Unis sur le fondement de la Régulation S. Les simulations et opinions présentées sur ce document sont le résultat d'analyses de Barclays Bank PLC à un moment donné et ne préjugent en rien de résultats futurs. Il est rappelé que les performances passées ne sont pas un indicateur fiable des performances futures et ne sont pas constantes dans le temps. **CAP EURO N°2** est (i) éligible pour une souscription en compte-titres et (ii) un support représentatif d'une unité de compte de contrat d'assurance vie ou de capitalisation, tel que visé dans le Code des assurances (ci-après le « Contrat »). L'ensemble des données est présenté hors fiscalité applicable, hors inflation et/ou frais liés au cadre d'investissement. Les indications qui figurent dans le présent document, y compris la description des avantages et des inconvénients, ne préjugent pas du cadre d'investissement choisi et notamment de l'impact que les frais liés à ce cadre d'investissement peuvent avoir sur l'économie générale de l'opération pour l'investisseur. Cette brochure décrit exclusivement les caractéristiques techniques et financières du produit.

AVERTISSEMENT DE STOXX LTD.

L'Indice EURO STOXX 50® est la propriété intellectuelle (y compris ses marques déposées) de STOXX Limited, Zurich, Suisse et/ou ses concédants de licence (les « Concédants de Licence »), utilisé en vertu de la licence octroyée par STOXX. Les Titres basés sur l'Indice ne sont en aucun cas parrainés, approuvés, vendus ou promus par les Concédants de Licence, et aucun des Concédants de Licence ne peut être tenu responsable à ce titre.

PRINCIPAUX FACTEURS DE RISQUES

Avant tout investissement dans ce produit, les investisseurs sont invités, conformément à l'Article 14 du Règlement délégué (UE) 2019/979, à lire attentivement la section « Facteurs de Risques » du Prospectus de Base qui inclut notamment les principaux risques suivants :

RISQUE DE PERTE EN CAPITAL : Le produit présente un risque de perte en capital. En cas de sortie avant l'échéance, le prix de rachat du produit pourra être inférieur à son prix de commercialisation. Le client prend donc un risque de perte en capital non mesurable a priori. En outre, le remboursement du produit à maturité peut être inférieur au capital initial investi, voire nul. **RISQUE DE CRÉDIT** : L'investisseur est exposé au risque de faillite ou de défaut de l'Émetteur, à savoir que l'insolvabilité de l'Émetteur peut entraîner la perte totale ou partielle du capital initial investi. Les notations de crédit peuvent être révisées à la baisse ou retirées sans préavis. Une notation n'est pas une recommandation quant à la capacité financière de Barclays ou une évaluation des risques du produit. **RISQUE LIÉ AU SOUS-JACENT** : Le mécanisme de remboursement est lié à l'évolution du niveau de l'indice EURO STOXX 50®. **RISQUE LIÉ AU TAUX D'INTÉRÊT** : Les investisseurs de ce produit seront exposés au risque lié au taux d'intérêt. Les variations des taux d'intérêt affecteront la performance et la valeur du produit. Les taux d'intérêt peuvent varier de manière subite et imprévisible. **RISQUE DE VOLATILITÉ** : La performance de ce produit peut changer de manière imprévisible. Ce changement imprévisible est désigné « volatilité » et peut être influencé par la performance de tout actif sous-jacent et par des facteurs externes, notamment des événements financiers, politiques et économiques et d'autres conditions de marché. **RISQUE DE LIQUIDITÉ** : Certaines conditions exceptionnelles de marché peuvent avoir un effet défavorable sur la liquidité du produit, voire même rendre le produit totalement illiquide, ce qui peut rendre impossible la vente du produit et entraîner la perte totale ou partielle du capital initial investi.

INFORMATIONS IMPORTANTES

Disponibilité du Prospectus (Documentation juridique) : Le produit décrit dans le présent document fait l'objet de Conditions Définitives d'Émission en date du 08 Mars 2021, se rattachant au prospectus de base, qui se compose du document Securities Note en date du 17 Juillet 2020 et du Document d'Enregistrement en date du 24 Mars 2020 ainsi que de leurs suppléments, approuvés par la Banque Centrale D'Irlande régulateur en Irlande et formant ensemble un prospectus conforme à l'Article 8 du Règlement (EU) 2017/1129. Ce prospectus de base a fait l'objet d'un certificat d'approbation de la part de la Banque Centrale D'Irlande, et a été notifié à l'Autorité des Marchés Financiers. Le prospectus de base, les suppléments à ce prospectus de base, les Conditions Définitives d'Émission et le résumé du prospectus de base en langue locale, sont disponibles sur les sites <https://home.barclays/investor-relations/structured-income-investors/prospectus-and-documents/structured-securities-prospectuses/#registrationdocument> et <https://home.barclays/investor-relations/structured-income-investors/prospectus-and-documents/structured-securities-final-terms/> ou peuvent être obtenus gratuitement auprès de Barclays Bank PLC à l'adresse indiquée sur le document, sur simple demande. Le résumé du prospectus de base est disponible en langue française sur le site de l'AMF (www.amf-france.org). Il est recommandé aux investisseurs de se reporter à la rubrique « Facteurs de risque » du prospectus du produit et aux Conditions Définitives d'Émission avant tout investissement dans le produit. Barclays Bank PLC est immatriculée en Angleterre sous le numéro 1026167. Siège social: 1 Churchill Place, London E14 5HP, United Kingdom. Ce document ne peut être distribué directement ou indirectement à des citoyens ou résidents des États-Unis. Les informations figurant dans ce document n'ont pas vocation à faire l'objet d'une mise à jour. Par ailleurs, la remise de ce document n'entraîne en aucune manière une obligation implicite de quiconque de mise à jour des informations qui y figurent.