

**Scopo**

Il presente documento contiene informazioni chiave relative a questo prodotto d'investimento. Non si tratta di un documento promozionale. Le informazioni, prescritte per legge, hanno lo scopo di aiutarvi a capire le caratteristiche, i rischi, i costi, i guadagni e le perdite potenziali di questo prodotto e di aiutarvi a fare un raffronto con altri prodotti d'investimento.

|   |   |
|---|---|
| <b>Prodotto</b>   |   |
| Nome del prodotto   | Worst-of Reverse Convertible Note correlato a un paniere di azioni ordinarie    |
| Identificatore del prodotto   | Codice ISIN: CH1102105983   Valore: 110210598                                   |
| Ideatore di PRIIP   | Barclays Bank PLC (www.barx-is.com)   |
|   | Per ulteriori informazioni si prega di chiamare il numero +44 (0) 20 7116 9000. |
| Data e ora di realizzazione del documento contenente le informazioni chiave | 02.03.2021 12:59 ora di Roma  |

State per acquistare un prodotto che non è semplice e può essere di difficile comprensione.

1. Cos'è questo prodotto?

**Tipo**

Notes disciplinate dal diritto svizzero

**Obiettivi**

(I termini che compaiono in **grassetto** in questa sezione sono descritti in dettaglio nella tabella qui sotto riportata.)

Il prodotto è stato progettato per rimborsare un importo nella forma (1) dei regolari pagamenti della cedola a tasso fisso e (2) di un pagamento in denaro o con la consegna fisica del **sottostante con rendimento peggiore** alla **data di scadenza**. Ciò che l'investitore riceverà dipenderà dalla performance dei **sottostanti**. Il prodotto è a scadenza fissa e si estinguerà alla **data di scadenza**. Nel caso in cui, alla data di scadenza, il **prezzo di riferimento finale** del **sottostante con rendimento peggiore** sia sceso al di sotto del relativo **prezzo di esercizio**, il prodotto potrebbe rimborsare azioni di un valore inferiore all'**ammontare nominale del prodotto** potendo il rimborso risultare anche pari a zero.

Cedola: Ad ogni **data di pagamento della cedola** l'investitore riceverà il pagamento della cedola calcolato moltiplicando l'**ammontare nominale del prodotto** per il tasso di interesse di 5% per anno e successivamente applicando la **frazione di calcolo giornaliera** per effettuare gli aggiustamenti di tale importo in modo tale da riflettere la durata del **periodo di interesse** di riferimento. I pagamenti della cedola non sono correlati alla performance dei **sottostanti**. Le date rilevanti si possono trovare nella tabella di sotto.

| Date di pagamento della cedola |
|--------------------------------|
| 14 giugno 2021                 |
| 13 settembre 2021              |
| 13 dicembre 2021               |
| Data di scadenza               |

Estinzione alla data di scadenza: All'estinzione del prodotto alla **data di scadenza**, l'investitore riceverà:

- nel caso in cui il **prezzo di riferimento finale** del **sottostante con rendimento peggiore** sia pari o superiore al relativo **prezzo di esercizio**, un pagamento in denaro di importo pari a 1.000 CHF; o
- nel caso in cui il **prezzo di riferimento finale** del **sottostante con rendimento peggiore** sia inferiore al relativo **prezzo di esercizio**, la consegna fisica del **sottostante con la performance peggiore**. Il numero di azioni del **sottostante con la performance peggiore** che verrà consegnato, sarà calcolato dividendo (i) 1.000 CHF diviso per (ii) il **prezzo di esercizio** di tale **sottostante**. Nel caso in cui all'esito del presente calcolo si renda necessaria la consegna di una frazione di un'azione del **sottostante** di riferimento, in luogo di tale frazione, all'investitore verrà corrisposto l'equivalente in denaro del valore di tale frazione (i contanti residui). Il valore di tali azioni in aggiunta ai contanti residui sarà generalmente inferiore all'importo investito.

Ai sensi dei termini e condizioni del prodotto, alcune delle date sotto e sopra specificate saranno modificate nel caso in cui non cadano in un giorno lavorativo o in un giorno di negoziazione (a seconda dei casi). Ogni modifica potrebbe avere un impatto sul rendimento del prodotto, ove esistente.

I termini e le condizioni del prodotto prevedono inoltre che nel caso in cui si verificino alcuni eventi straordinari (1) potrebbero essere effettuati degli aggiustamenti sul prodotto e/o (2) l'emittente del prodotto potrebbe estinguere anticipatamente il prodotto. Tali eventi sono specificati nei termini e nelle condizioni del prodotto e riguardano principalmente i **sottostanti**, il prodotto e l'emittente del prodotto. Nel caso in cui si verifichi tale estinzione anticipata, è probabile che il rendimento (ove esistente), sia diverso da quello indicato negli scenari sopra descritti e potrebbe essere inferiore al capitale investito.

All'acquisto di questo prodotto nel corso della sua durata, il prezzo di acquisto non includerà gli interessi maturati su base proporzionale.

L'investitore non ha alcun diritto di riscuotere dei dividendi derivanti da qualsiasi **sottostante** né di qualsiasi ulteriore diritto connesso a tale **sottostante** (ad es. i diritti di voto).

Ai fini espositivi tutti i numeri in questo documento sono visualizzati con 4 posizioni decimali.

|  |  |                                     |   |
|--|--|-------------------------------------|---|
| <b>Sottostanti</b>                     | Azioni ordinarie di NESTLE SA-REG (NESN; Codice ISIN: CH0038863350; Bloomberg: NESN SE Equity; RIC: NESN.S), NOVARTIS AG-REG (NOVN; Codice ISIN: CH0012005267; Bloomberg: NOVN SE Equity; RIC: NOVN.S), ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN (ROG; Codice ISIN: CH0012032048; Bloomberg: ROG SE Equity; RIC: ROG.S), ZURICH INSURANCE GROUP AG (ZURN; Codice ISIN: CH0011075394; Bloomberg: ZURN SE Equity; RIC: ZURN.S) | <b>Prezzo di riferimento</b>        | Il prezzo di chiusura di un <b>sottostante</b> secondo la <b>fonte di riferimento</b> rilevante                     |
| <b>Mercato sottostante</b>             | Mercato azionario  | <b>Fonti di riferimento</b>         | • NESN: Six Swiss Exchange<br>• NOVN: Six Swiss Exchange<br>• ROG: Six Swiss Exchange<br>• ZURN: Six Swiss Exchange |
| <b>Ammontare nominale del prodotto</b> | 1.000 CHF  | <b>Prezzo di riferimento finale</b> | Il <b>prezzo di riferimento</b> alla <b>data di valutazione finale</b>  |
| <b>Prezzo di emissione</b>             | 100% dell' <b>ammontare nominale del prodotto</b>  | <b>Data di valutazione iniziale</b> | 5 marzo 2021  |
| <b>Valuta del prodotto</b>             | Franco Svizzero (CHF)  | <b>Data di valutazione finale</b>   | 7 marzo 2022  |
| <b>Valute del sottostante</b>          | • NESN: CHF<br>• NOVN: CHF<br>• ROG: CHF<br>• ZURN: CHF  | <b>Data di scadenza / termine</b>   | 14 marzo 2022   |

|                                |  |                                     |   |
|--------------------------------|--|-------------------------------------|---|
| Data di emissione              | 12 marzo 2021  | Periodo di interesse                | Ogni periodo intercorrente da una <b>data di pagamento della cedola</b> (inclusa) (o dalla <b>data di emissione</b> , nel caso del periodo di interesse iniziale), fino alla successiva <b>data di pagamento della cedola</b> (esclusa) (o alla <b>data di scadenza</b> , nel caso del periodo di interesse finale) |
| Prezzo di riferimento iniziale | Il prezzo di riferimento alla data di valutazione iniziale | Frazione di calcolo giornaliera     | 30/360  |
| Prezzo di esercizio            | 85% del prezzo di riferimento iniziale                     | Sottostante con rendimento peggiore | Il sottostante con rendimento peggiore tra il prezzo di riferimento iniziale e il prezzo di riferimento finale  |

### Investitori al dettaglio a cui si intende commercializzare il prodotto

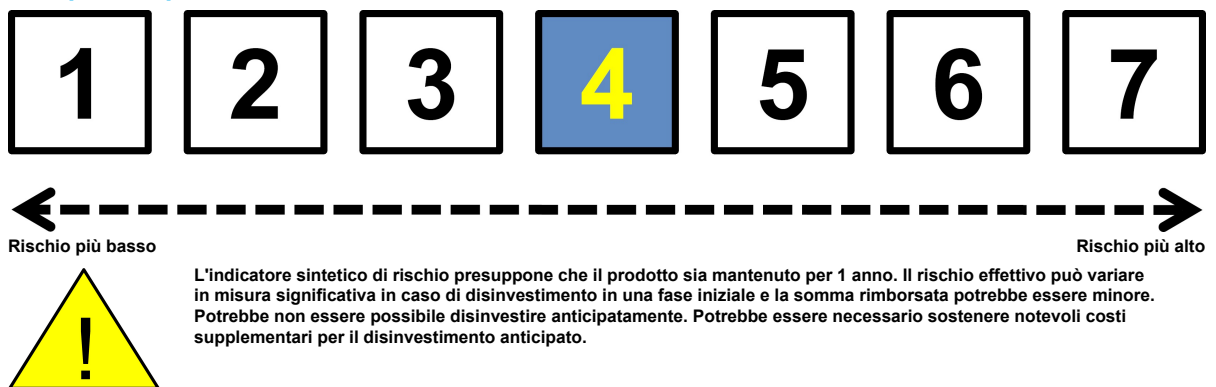
Il prodotto è destinato ad essere offerto agli investitori al dettaglio che soddisfino tutti i requisiti di seguito riportati:

1. abbiano la capacità di prendere decisioni d'investimento consapevoli attraverso la conoscenza sufficiente e la comprensione del prodotto e degli specifici rischi e benefici ad esso associati, indipendentemente oppure avvalendosi di una consulenza professionale, con esperienza negli investimenti in prodotti simili e/oppure nella detenzione dei prodotti simili che forniscono una simile esposizione al mercato;
2. mirino ad un profitto, si aspettino un andamento del sottostante tale da generare un rendimento favorevole e abbiano un orizzonte temporale di investimento pari al periodo di detenzione raccomandato sotto indicato;
3. accettino il rischio che l'emittente possa non essere in grado di pagare o di adempiere ai propri obblighi derivanti dal prodotto e siano comunque in grado di sostenere un'eventuale perdita totale del proprio investimento; e
4. al fine di ottenere un rendimento potenziale, siano disposti ad accettare un livello di rischio coerente con quello indicato dall'indicatore sintetico di rischio sotto riportato.

Il prodotto non è destinato ad essere offerto agli investitori al dettaglio che non soddisfino tali requisiti.

## 2. Quali sono i rischi e qual è il potenziale rendimento?

### Indicatore di rischio



L'indicatore sintetico di rischio è un'indicazione orientativa del livello di rischio di questo prodotto rispetto ad altri prodotti. Esso esprime la probabilità che il prodotto subisca perdite monetarie a causa di movimenti sul mercato o a causa della nostra incapacità di pagarvi quanto dovuto.

Abbiamo classificato questo prodotto al livello 4 su 7, che corrisponde alla classe di rischio media. Ciò significa che le perdite potenziali dovute alla performance futura dei sottostanti sono classificate nel livello medio, e che è molto improbabile che le cattive condizioni di mercato influenzino la nostra capacità di pagarvi quanto dovuto.

**Nel caso in cui la valuta del paese in cui acquistate il prodotto differisce dalla valuta del prodotto, si prega di essere consapevole del rischio di cambio. Riceverete pagamenti in una valuta straniera, quindi il rendimento finale che otterrete dipenderà dal tasso di cambio tra le due valute. Questo rischio non è contemplato nell'indicatore sintetico di rischio sopra riportato.**

Nel caso di consegna fisica di qualsiasi dei **sottostanti** all'estinzione del prodotto, si potrebbe subire una perdita se il valore di tale **sottostante** dovesse diminuire nel periodo intercorrente tra l'estinzione del prodotto e la data in cui tale **sottostante** viene accreditato sul conto titoli dell'investitore.

Questo prodotto non comprende alcuna protezione dalla performance futura del mercato; pertanto potreste perdere il vostro intero investimento o parte di esso.

Nel caso in cui non fossimo in grado di pagarvi quanto dovuto, potreste perdere il vostro intero investimento.

Per informazioni più dettagliate su tutti i rischi relativi al prodotto, si rinvia alle sezioni rischio del prospetto e agli eventuali supplementi al medesimo, come precisato di seguito nella sezione "7. Altre informazioni rilevanti".

**Scenari di performance** Gli sviluppi futuri del mercato non possono essere previsti accuratamente. Gli scenari illustrati sono soltanto l'indicazione dei risultati possibili, basata sui rendimenti recenti. I rendimenti attuali potrebbero essere di un valore inferiore.

**Investimento: 10.000 CHF**

| Scenari                     | 1 anno<br>(Periodo di detenzione raccomandato)   |
|-----------------------------|--|
| <b>Scenario di stress</b>   | <b>Possibile rimborso al netto dei costi</b><br>Rendimento medio per ciascun anno<br>6.777,56 CHF<br>-32,0786% |
| <b>Scenario sfavorevole</b> | <b>Possibile rimborso al netto dei costi</b><br>Rendimento medio per ciascun anno<br>8.116,72 CHF<br>-18,7392% |
| <b>Scenario moderato</b>    | <b>Possibile rimborso al netto dei costi</b><br>Rendimento medio per ciascun anno<br>10.117,67 CHF<br>1,1701%  |
| <b>Scenario favorevole</b>  | <b>Possibile rimborso al netto dei costi</b><br>Rendimento medio per ciascun anno<br>10.502,78 CHF<br>4,9993%  |

Questa tabella mostra gli importi dei possibili rimborsi nel prossimo anno, in scenari diversi, ipotizzando un investimento di 10.000 CHF.

Gli scenari presentati mostrano la possibile performance dell'investimento. Gli scenari presentati possono essere confrontati con gli scenari di altri prodotti. Gli scenari presentati sono una stima della performance futura sulla base di prove relative alle variazioni passate del valore di questo investimento e non sono un indicatore esatto. Gli importi dei rimborsi varieranno a seconda della performance del mercato e del periodo di tempo per cui è mantenuto il prodotto. Lo scenario di stress indica quale potrebbe essere l'importo rimborsato in circostanze di mercato estreme e non tiene conto della situazione in cui non siamo in grado di pagarvi.

Questo prodotto non è facilmente liquidabile. Ciò significa che è difficile stimare l'importo del possibile rimborso in caso di disinvestimento prima della scadenza. Sarà impossibile disinvestire anticipatamente, oppure sarà possibile farlo soltanto pagando un costo elevato o subendo una forte perdita.

Le cifre riportate comprendono tutti i costi del prodotto in quanto tale, ma possono non comprendere tutti i costi da voi pagati al consulente o al distributore. Le cifre non tengono conto della vostra situazione fiscale personale, che può incidere anch'essa sull'importo del rimborso.

## 3. Cosa accade nel caso in cui l'ideatore non sia in grado di corrispondere quanto dovuto?

State assumendo il rischio che l'emittente possa non essere in grado di adempiere alle obbligazioni assunte in relazione al prodotto, ad esempio a causa di fallimento o nel caso di una decisione ufficiale per l'avvio di un'azione di risoluzione. Ciò potrebbe avere un impatto negativo significativo sul valore del prodotto e potrebbe comportare la perdita di una parte o dell'intero capitale investito. Il prodotto non è un deposito e pertanto non è coperto da nessun sistema di protezione dei depositi.

#### 4. Quali sono i costi?

La diminuzione del rendimento (Reduction in Yield - RIY) esprime l'impatto dei costi totali sostenuti sul possibile rendimento dell'investimento. I costi totali tengono conto dei costi una tantum, correnti e accessori.

Gli importi qui riportati corrispondono ai costi cumulativi del prodotto, nel periodo di detenzione raccomandato. Essi comprendono le potenziali penali per uscita anticipata. Questi importi si basano sull'ipotesi che siano investiti 10.000 CHF. Gli importi sono stimati e potrebbero cambiare in futuro.

##### Andamento dei costi nel tempo

| Investimento: 10.000 CHF   |   |
|--|---|
| Scenari  | In caso di disinvestimento alla fine del periodo di detenzione raccomandato |
| Costi totali   | 357,19 CHF  |
| Impatto sul rendimento (RIY) per anno  | 3,5516%   |
| I costi illustrati nella tabella sopra riportata indicano come i costi attesi del prodotto possono influenzarne il rendimento, ipotizzando che la performance del prodotto sia in linea con lo scenario di performance moderato. Tralasciando l'impatto sul vostro rendimento in tale scenario, si stima che i costi di entrata e di uscita in termini percentuali rispetto all'ammontare nominale del prodotto siano pari al 3,41% in caso di disinvestimento alla fine del periodo di detenzione raccomandato. |   |
| La persona che vende questo prodotto o fornisce consulenza riguardo ad esso potrebbe addebitare altri costi, nel qual caso deve fornire informazioni su tali costi e illustrare l'impatto di tutti i costi sull'investimento nel corso del tempo.  |   |

##### Composizione dei costi

- La seguente tabella presenta:
- l'impatto, per ciascun anno, dei differenti tipi di costi sul possibile rendimento dell'investimento alla fine del periodo di detenzione raccomandato,
  - il significato delle differenti categorie di costi.

| Questa tabella presenta l'impatto sul rendimento per anno. |                   |         |  |
|--|-------------------|---------|--|
| Costi una tantum   | Costi di ingresso | 3,5516% | Impatto dei costi già compresi nel prezzo.                   |
|  | Costi di uscita   | 0%      | Impatto dei costi di uscita dall'investimento alla scadenza. |

I costi indicati nella tabella sopra riportata rappresentano la ripartizione dell'impatto sul rendimento, indicato nella tabella dell'andamento dei costi nel tempo alla fine del periodo di detenzione raccomandato. La ripartizione dei costi stimati effettivi del prodotto in termini percentuali rispetto all'ammontare nominale del prodotto è stimata come segue: costi di entrata: 3,41% e costi di uscita: 0%.

#### 5. Per quanto tempo dovrei detenerlo? Posso ritirare il capitale prematuramente?

##### Periodo di detenzione raccomandato: 1 anno

Il prodotto è finalizzato a rimborsare l'importo descritto nella sezione "1. Cos'è questo prodotto?". Tuttavia, ciò vale solamente nel caso in cui il prodotto venga detenuto fino alla data di scadenza. Pertanto, si raccomanda di detenerlo fino al 14 marzo 2022 (data di scadenza).

Questo prodotto non garantisce la possibilità di disinvestimento, se non tramite la vendita del prodotto (1) in borsa (nel caso in cui il prodotto sia negoziato in borsa) oppure (2) fuori borsa, qualora vi sia un'offerta per tale prodotto. Nessuna commissione o penale sarà addebitata dall'emittente per tali transazioni, tuttavia potrebbe essere applicata una commissione di esecuzione da parte dell'intermediario, se del caso. Vendendo il prodotto prima della scadenza, l'investitore potrebbe ricevere un importo inferiore all'importo che si sarebbe ricevuto detenendo il prodotto fino alla data di scadenza.

| Quotazione in borsa          | Non applicabile | Quotazione del prezzo | Percentuale |
|------------------------------|-----------------|-----------------------|-------------|
| Lotto minimo di negoziazione | 1.000 CHF       |                       |             |

In caso di condizioni di mercato volatili o eccezionali, o in caso di problemi tecnici/malfunzionamenti, l'acquisto e/o la vendita del prodotto possono essere temporaneamente impediti e/o sospesi o anche risultare del tutto impossibili.

#### 6. Come presentare reclami?

Tutti i reclami relativi alla condotta della persona che fornisce consulenza sul prodotto o che vende il prodotto, possono essere presentati direttamente a tale persona.

Qualsiasi reclamo riguardante il prodotto o la condotta dell'ideatore del prodotto può essere presentato per iscritto al seguente indirizzo: KID Complaints Team, 5 The North Colonnade, Canary Wharf, London E14 4BB, UK, per email a: IBKIDComplaints@barclays.com oppure tramite il seguente sito web: [www.barx-is.com](http://www.barx-is.com).

#### 7. Altre informazioni rilevanti

Le informazioni contenute in questo Documento contenente le informazioni chiave non costituiscono una raccomandazione di acquisto o di vendita del prodotto e non sostituiscono consultazioni individuali con la vostra banca o il vostro consulente.

L'offerta di questo prodotto non è stata registrata ai sensi del Securities Act statunitense del 1933. Questo prodotto non può essere offerto o venduto, direttamente o indirettamente, negli Stati Uniti d'America o a persone statunitensi. Il termine "persona statunitense" è definito nel Regulation S del Securities Act statunitense del 1933, come di volta in volta modificato.

Qualsiasi documentazione aggiuntiva relativa al prodotto e, in particolare, la documentazione riguardante il programma di emissione, qualsiasi supplemento a ciò e ai termini e le condizioni del prodotto sono resi disponibili gratuitamente presso Barclays Bank PLC, 1 Churchill Place, London, E14 5HP, England, UK.