

**NACHTRAG NR. 5 VOM 11. AUGUST 2026 ZU DEN  
BASISPROSPEKTEN VOM 17. DEZEMBER 2025**



**Merrill Lynch B.V.**  
(eine niederländische Gesellschaft mit beschränkter Haftung)

**BASISPROSPEKT FÜR SCHULDVERSCHREIBUNGEN**

und

**BASISPROSPEKT FÜR OPTIONSSCHEINE UND ZERTIFIKATE**

unter dem

**DEUTSCHEN SCHULDVERSCHREIBUNGS-, OPTIONSSCHEINS- UND  
ZERTIFIKATEPROGRAMM**

bedingungslos und unwiderruflich garantiert

durch

**Bank of America Corporation**

(eine Delaware Gesellschaft (USA))

**Nachtrag zu den Basisprospekten**

Dieser Nachtrag (der "**Nachtrag**") zu dem Basisprospekt für Schuldverschreibungen der Merrill Lynch B.V. ("**MLBV**") vom 17. Dezember 2025 (der "**Basisprospekt Schuldverschreibungen**") (*Prospekt-ID: 70864254*) und zu dem Basisprospekt für Optionsscheine und Zertifikate der Merrill Lynch B.V. vom 17. Dezember 2025 (der "**Basisprospekt Optionsscheine und Zertifikate**") (*Prospekt-ID: 69537063*) und zusammen mit dem Basisprospekt Schuldverschreibungen die "**Basisprospekte**"), der in Zusammenhang mit dem Deutschen Schuldverschreibungs-, Optionsscheins- und Zertifikateprogramm (das "**Programm**") von MLBV erstellt wurde, stellt einen Nachtrag im Sinne des Artikel 23 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2017/1129 (in der jeweils gültigen Fassung, die "**EU-Prospektverordnung**") dar. Die Begriffe, die in den Basisprospekten definiert wurden, haben die gleiche Bedeutung, wenn sie in diesem Nachtrag verwendet werden.

Am 17. Dezember 2025 wurden die Basisprospekte von der *Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht* (die "**BaFin**") als zuständige Behörde gemäß der EU-Prospektverordnung gebilligt und sind für einen Zeitraum von 12 Monaten ab Billigung der Basisprospekte für öffentliche Angebote oder Zulassungen zum Handel an einem geregelten Markt gültig.

Der Nachtrag wurde von der BaFin als zuständige Behörde gemäß der EU-Prospektverordnung gebilligt. Die BaFin billigt nicht die Informationen im Zusammenhang mit der Emission von Ausgenommenen Instrumenten.

Der Nachtrag wurde im Hinblick auf die Geltung der Prospekte in der Schweiz und auf Betreiben der Emittentin bei der SIX Exchange Regulation AG in ihrer Eigenschaft als Prüfstelle gemäß Artikel 54 des Schweizer Bundesgesetz über Finanzdienstleistungen vom 15. Juni 2018 in seiner geänderten Fassung hinterlegt.

Die Emittentin hat bei der BaFin beantragt, den zuständigen Behörden in der Republik Österreich und im Großherzogtum Luxemburg eine Bescheinigung über die Billigung dieses Nachtrags zu übermitteln, aus der hervorgeht, dass dieser Nachtrag in Übereinstimmung mit der EU-Prospektverordnung erstellt wurde.

Dem Nachtrag ist eine rechtlich unverbindliche, weder von der BaFin geprüfte noch gebilligte, englischsprachige Übersetzung von Teilen des Nachtrags als Anlage beigefügt.

### **Widerrufsrecht**

**Gemäß Artikel 23 Absatz 2 der EU-Prospektverordnung haben Anleger im Europäischen Wirtschaftsraum, die bereits vor Veröffentlichung dieses Nachtrags dem Erwerb oder der Zeichnung von unter den Basisprospekten begebenen Wertpapieren zugestimmt haben und denen die Wertpapiere zum Zeitpunkt des Eintritts oder der Feststellung des wichtigen neuen Umstandes, der wesentlichen Unrichtigkeit oder der wesentlichen Ungenauigkeit, auf die sich dieser Nachtrag bezieht, noch nicht geliefert wurden, das Recht, innerhalb von drei Arbeitstagen nach Veröffentlichung dieses Nachtrags ihre Zusage zu widerrufen, sofern der wesentliche neue Umstand, die wesentliche Unrichtigkeit oder die wesentliche Ungenauigkeit, auf die sich dieser Nachtrag bezieht, vor Ablauf der Angebotsfrist oder vor der Lieferung der Wertpapiere, je nachdem, was zuerst eintritt, eingetreten ist oder festgestellt wurde. Anleger können sich an den/die jeweiligen Autorisierten Anbieter (wie in den Endgültigen Bedingungen der jeweiligen Schuldverschreibungen (wie in dem Basisprospekt Schuldverschreibungen definiert) oder O&Z-Instrumente (wie in dem Basisprospekt Optionsscheine und Zertifikate definiert) angegeben) der Schuldverschreibungen oder O&Z-Instrumente wenden, wenn sie dieses Rücktrittsrecht ausüben möchten.**

### **Nachtragsbegründende Umstände im Sinne des Art. 23 Abs. 1 der EU-Prospektverordnung**

In Bezug auf die in den Basisprospekten enthaltenen Angaben ist der folgende wichtige neue Umstand aufgetreten, der Grund für diesen Nachtrag ist:

- Am 31. Juli 2026 wurde der Quartalsbericht der BAC auf Formular 10-Q für das am 30. Juni 2026 endende Quartal bei der United States Securities and Exchange Commission (die "SEC") eingereicht.

Vor dem Hintergrund dieses Umstandes werden die folgenden Abschnitte in den Basisprospekten angepasst:

- Ergänzung des Abschnitts der *"Durch Verweis einbezogenen Informationen"*.
- Aktualisierung der Abschnitte *"Allgemeine Informationen"* und *"Beschreibung der Emittentin und der Garantin"*.

## Änderungen in den Basisprospekten:

### 1. Änderung des Abschnitts "Durch Verweis einbezogene Informationen"

- (a) Der Abschnitt "Durch Verweis einbezogene Informationen" wird dahingehend ergänzt, dass auf Seite 73 des Basisprospekts Schuldverschreibungen und auf Seite 69 des Basisprospekts Optionsscheine und Zertifikate der folgende Buchstabe (a) vor dem bestehenden Absatz (a) eingefügt wird und die Nummerierung der nachfolgenden Absätze entsprechend angepasst wird:
- “(a) der am 31. Juli 2026 bei der SEC eingereichte Quartalsabschluss der Garantin auf Formular 10-Q für das zum 30. Juni 2026 endende Quartal (zur Ansicht unter <https://dl.luxse.com/dlp/10f4bcae3e047f4efcb1e4685cf002a37e> verfügbar) (der "Quartalsabschluss zum 30. Juni 2026 der Garantin") (mit Ausnahme von Informationen, die im Zusammenhang mit diesem Bericht zwar vorgelegt, aber nach den Vorschriften der SEC nicht als eingereicht gelten);"
- (b) Der Abschnitt "Durch Verweis einbezogene Informationen" wird dahingehend ergänzt, dass auf Seite 74 des Basisprospekts Schuldverschreibungen unter der Überschrift "Informationen über die Garantin" vor der Querverweisliste zum "Quartalsabschluss zum 31. März 2026 der Garantin" die folgende Querverweisliste eingefügt wird:

#### Quartalsabschluss zum 30. Juni 2026 der Garantin

##### Part I Financial Information

##### Item 1. Financial Statements

|                                                                          |                         |                                                                     |
|--------------------------------------------------------------------------|-------------------------|---------------------------------------------------------------------|
| <i>Consolidated Statement of<br/>Income</i>                              | <i>Seite 47</i>         | "Historische<br>Finanzinformationen der<br>Garantin" auf Seite 389. |
| <i>Consolidated Statement of<br/>Comprehensive Income</i>                | <i>Seite 47</i>         | "Historische<br>Finanzinformationen der<br>Garantin" auf Seite 389. |
| <i>Consolidated Balance<br/>Sheet</i>                                    | <i>Seite 48</i>         | "Historische<br>Finanzinformationen der<br>Garantin" auf Seite 389. |
| <i>Consolidated Statement of<br/>Changes in Shareholders'<br/>Equity</i> | <i>Seite 49</i>         | "Historische<br>Finanzinformationen der<br>Garantin" auf Seite 389. |
| <i>Consolidated Statement of<br/>Cash Flows</i>                          | <i>Seite 50</i>         | "Historische<br>Finanzinformationen der<br>Garantin" auf Seite 389. |
| <i>Notes to Consolidated<br/>Financial Statements</i>                    | <i>Seiten 51 bis 99</i> | "Historische<br>Finanzinformationen der<br>Garantin" auf Seite 389. |
| <i>1 – Summary of<br/>Significant Accounting<br/>Principles</i>          | <i>Seite 51</i>         |                                                                     |
| <i>2 – Net Interest Income<br/>and Noninterest Income</i>                | <i>Seite 52</i>         |                                                                     |
| <i>3 – Derivatives</i>                                                   | <i>Seiten 53 bis 59</i> |                                                                     |

|                                                                                               |                      |                                                                      |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------|----------------------------------------------------------------------|
| 4 – Securities                                                                                | Seiten 60 bis 62     |                                                                      |
| 5 – Outstanding Loans and Leases and Allowance for Credit Losses                              | Seiten 63 bis 74     |                                                                      |
| 6 – Securitizations and Other Variable Interest Entities                                      | Seiten 74 bis 79     |                                                                      |
| 7 – Goodwill and Intangible Assets                                                            | Seite 79             |                                                                      |
| 8 – Leases                                                                                    | Seite 79             |                                                                      |
| 9 – Securities Financing Agreements, Collateral and Restricted Cash                           | Seiten 80 bis 81     | "Erwartete Finanzierungstätigkeiten der Garantin" auf der Seite 389. |
| 10 – Commitments and Contingencies                                                            | Seiten 81 bis 84     |                                                                      |
|                                                                                               | Nur Seiten 83 bis 84 | "Rechtsstreitigkeiten" auf der Seite 438.                            |
| 11 – Shareholders' Equity                                                                     | Seite 84             | "Stammkapital der Garantin" auf der Seite 389.                       |
| 12 – Accumulated Other Comprehensive Income (Loss)                                            | Seite 85             |                                                                      |
| 13 – Earnings Per Common Share                                                                | Seite 86             |                                                                      |
| 14 – Fair Value Measurements                                                                  | Seiten 86 bis 93     |                                                                      |
| 15 – Fair Value Option                                                                        | Seiten 93 bis 95     |                                                                      |
| 16 – Fair Value of Financial Instruments                                                      | Seite 95             |                                                                      |
| 17 – Business Segment Information                                                             | Seiten 96 bis 99     |                                                                      |
| Glossary                                                                                      | Seiten 100 bis 101   |                                                                      |
| Acronyms                                                                                      | Seite 102            |                                                                      |
| Item 2. Management's Discussion and Analysis of Financial Condition and Results of Operations |                      |                                                                      |
| Liquidity Risk                                                                                | Seiten 23 bis 25     | "Erwartete Finanzierungstätigkeiten der Garantin" auf der Seite 389. |

- (c) Der Abschnitt "*Durch Verweis einbezogene Informationen*" wird dahingehend ergänzt, dass auf Seite 70 des Basisprospekts Optionsscheine und Zertifikate unter der Überschrift "*Informationen über die Garantin*" vor der Querverweisliste zum "Quartalsabschluss zum 31. März 2026 der Garantin" die folgende Querverweisliste eingefügt wird:

**Quartalsabschluss zum 30. Juni 2026 der Garantin**

*Part I Financial  
Information*

*Item 1. Financial  
Statements*

|                                                                                 |                         |                                                                     |
|---------------------------------------------------------------------------------|-------------------------|---------------------------------------------------------------------|
| <i>Consolidated Statement of<br/>Income</i>                                     | <i>Seite 47</i>         | "Historische<br>Finanzinformationen der<br>Garantin" auf Seite 642. |
| <i>Consolidated Statement of<br/>Comprehensive Income</i>                       | <i>Seite 47</i>         | "Historische<br>Finanzinformationen der<br>Garantin" auf Seite 642. |
| <i>Consolidated Balance<br/>Sheet</i>                                           | <i>Seite 48</i>         | "Historische<br>Finanzinformationen der<br>Garantin" auf Seite 642. |
| <i>Consolidated Statement of<br/>Changes in Shareholders'<br/>Equity</i>        | <i>Seite 49</i>         | "Historische<br>Finanzinformationen der<br>Garantin" auf Seite 642. |
| <i>Consolidated Statement of<br/>Cash Flows</i>                                 | <i>Seite 50</i>         | "Historische<br>Finanzinformationen der<br>Garantin" auf Seite 642. |
| <i>Notes to Consolidated<br/>Financial Statements</i>                           | <i>Seiten 51 bis 99</i> | "Historische<br>Finanzinformationen der<br>Garantin" auf Seite 642. |
| <i>1 – Summary of<br/>Significant Accounting<br/>Principles</i>                 | <i>Seite 51</i>         |                                                                     |
| <i>2 – Net Interest Income<br/>and Noninterest Income</i>                       | <i>Seite 52</i>         |                                                                     |
| <i>3 – Derivatives</i>                                                          | <i>Seiten 53 bis 59</i> |                                                                     |
| <i>4 – Securities</i>                                                           | <i>Seiten 60 bis 62</i> |                                                                     |
| <i>5 – Outstanding Loans<br/>and Leases and Allowance<br/>for Credit Losses</i> | <i>Seiten 63 bis 74</i> |                                                                     |
| <i>6 – Securitizations and<br/>Other Variable Interest<br/>Entities</i>         | <i>Seiten 74 bis 79</i> |                                                                     |
| <i>7 – Goodwill and<br/>Intangible Assets</i>                                   | <i>Seite 79</i>         |                                                                     |

|                                                                                                      |                             |                                                                      |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------|----------------------------------------------------------------------|
| <i>8 – Leases</i>                                                                                    | <i>Seite 79</i>             |                                                                      |
| <i>9 – Securities Financing Agreements, Collateral and Restricted Cash</i>                           | <i>Seiten 80 bis 81</i>     | "Erwartete Finanzierungstätigkeiten der Garantin" auf der Seite 642. |
| <i>10 – Commitments and Contingencies</i>                                                            | <i>Seiten 81 bis 84</i>     |                                                                      |
|                                                                                                      | <i>Nur Seiten 83 bis 84</i> | "Rechtsstreitigkeiten" auf der Seite 691.                            |
| <i>11 – Shareholders' Equity</i>                                                                     | <i>Seite 84</i>             | "Stammkapital der Garantin" auf der Seite 642.                       |
| <i>12 – Accumulated Other Comprehensive Income (Loss)</i>                                            | <i>Seite 85</i>             |                                                                      |
| <i>13 – Earnings Per Common Share</i>                                                                | <i>Seite 86</i>             |                                                                      |
| <i>14 – Fair Value Measurements</i>                                                                  | <i>Seiten 86 bis 93</i>     |                                                                      |
| <i>15 – Fair Value Option</i>                                                                        | <i>Seiten 93 bis 95</i>     |                                                                      |
| <i>16 – Fair Value of Financial Instruments</i>                                                      | <i>Seite 95</i>             |                                                                      |
| <i>17 – Business Segment Information</i>                                                             | <i>Seiten 96 bis 99</i>     |                                                                      |
| <i>Glossary</i>                                                                                      | <i>Seiten 100 bis 101</i>   |                                                                      |
| <i>Acronyms</i>                                                                                      | <i>Seite 102</i>            |                                                                      |
| <i>Item 2. Management's Discussion and Analysis of Financial Condition and Results of Operations</i> |                             |                                                                      |
| <i>Liquidity Risk</i>                                                                                | <i>Seiten 23 bis 25</i>     | "Erwartete Finanzierungstätigkeiten der Garantin" auf der Seite 642. |

## **2. Aktualisierung des Abschnitts "Beschreibung der Emittentin und der Garantin"**

In dem Abschnitt "Beschreibung der Emittentin und der Garantin" in dem Unterabschnitt "Bank of America Corporation" auf den Seiten 389 und 390 des Basisprospekts Schuldverschreibungen und Seite 642 des Basisprospekts Optionsscheine und Zertifikate werden die Absätze "Erwartete Finanzierungstätigkeiten der

Garantin", "Historische Finanzinformationen der Garantin" und "Stammkapital der Garantin" wie folgt ersetzt:

### **"Erwartete Finanzierungstätigkeiten der Garantin"**

Hinsichtlich der erwarteten Finanzierungstätigkeiten der Garantin finden sich die entsprechenden Informationen im Quartalsabschluss zum 30. Juni 2026 der Garantin im Abschnitt "Liquidity Risk" auf den Seiten 23 bis 25 und im Abschnitt "Securities Financing Agreements, Collateral and Restricted Cash" auf Seite 80, im Abschnitt "Liquidity Risk" auf den Seiten 20 bis 24 und im Abschnitt "Shareholders' Equity" auf Seite 80 des Quartalsabschlusses zum 31. März 2026 der Garantin, im Abschnitt "Capital Management" auf den Seiten 48 bis 53 in "Item 7. Management's Discussion and Analysis of Financial Condition and Results of Operations" des Jahresabschlusses 2024 der Garantin, im Abschnitt "Liquidity Risk" auf den Seiten 53 bis 58 in "Item 7. Management's Discussion and Analysis of Financial Condition and Results of Operations" des Jahresabschlusses 2024 der Garantin, in Anmerkung 13 des konsolidierten Jahresabschlusses im Abschnitt "Shareholders' Equity", auf den Seiten 140 bis 141 des Jahresabschlusses 2024 der Garantin, im Abschnitt "Capital Management" auf den Seiten 20 bis 24 in "Item 2. Management's Discussion and Analysis of Financial Condition and Results of Operations" des Quartalsabschlusses vom 30. September 2025 der Garantin, im Abschnitt "Liquidity Risk" auf den Seiten 25 bis 28 in "Item 2. Management's Discussion and Analysis of Financial Condition and Results of Operations" des Quartalsabschlusses vom 30. September 2025 der Garantin, und in Anmerkung 11 "Shareholders' Equity" auf Seite 85 des Quartalsabschlusses vom 30. September 2025 der Garantin und werden gemäß Artikel 19 Absatz 1 der EU-Prospektverordnung durch Verweis in diesen Basisprospekt einbezogen.

### **Historische Finanzinformationen der Garantin**

In Bezug auf die historischen Finanzinformationen der Garantin werden (a) die geprüften konsolidierten Finanzberichte der Garantin im Jahresabschluss 2025 der Garantin auf den Seiten 87 bis 173 und (b) die ungeprüften Finanzberichte der Garantin im Quartalsabschluss zum 30. Juni 2026 der Garantin auf den Seiten 47 bis 102, im Quartalsabschluss zum 31. März 2026 der Garantin auf den Seiten 44 bis 95, im Quartalsabschluss vom 30. Juni 2025 der Garantin auf den Seiten 48 bis 103 und im Quartalsabschluss vom 30. September 2025 der Garantin auf den Seiten 48 bis 104 gemäß Artikel 19 Absatz 1 der EU-Prospektverordnung durch Verweis in diesen Basisprospekt einbezogen (detaillierte Informationen zu den relevanten Abschnitten in diesen Dokumenten, aus denen Informationen durch Verweis einbezogen werden, finden Sie im Abschnitt "Durch Verweis einbezogene Informationen").

Die Informationen zu den historischen Abschlüssen der Garantin auf konsolidierter Basis zum 31. Dezember 2024 und 2025 sowie für jedes der drei Jahre im Zeitraum bis zum 31. Dezember 2025 (wie hierin durch Verweis einbezogen) sind im Jahresabschluss 2025 der Garantin enthalten.

### **Stammkapital der Garantin**

In Bezug auf das Stammkapital der Garantin werden die im Abschnitt "Shareholders' Equity" auf Seite 84 des Quartalsabschlusses zum 30. Juni 2026 der Garantin, im Abschnitt "Shareholders' Equity" auf Seite 80 des Quartalsabschlusses zum 31. März 2026 der Garantin, in Anmerkung 13 des konsolidierten Jahresabschlusses im Abschnitt "Shareholders' Equity" auf den Seiten 140 bis 141 des Jahresabschlusses 2024 der Garantin und in Anmerkung 11 im Abschnitt "Shareholders' Equity" auf Seite 85 des

Quartalsabschlusses vom 30. September 2025 der Garantin enthaltenen Informationen gemäß Artikel 19 Absatz 1 der EU-Prospektverordnung durch Verweis in diesen Basisprospekt einbezogen."

### **3. Aktualisierung des Abschnitts "Allgemeine Informationen"**

- (a) In dem Abschnitt "Allgemeine Informationen" im Absatz "(6) Signifikante oder wesentliche Änderung" auf Seite 438 des Basisprospekts Schuldverschreibungen und Seite 691 des Basisprospekts Optionsscheine und Zertifikate wird der Unterabsatz "Die Garantin" wie folgt ersetzt:

#### **"Die Garantin**

Seit dem 30. Juni 2026 hat sich die Vermögens-, Finanz- und Ertragslage von BAC und ihren Tochtergesellschaften auf konsolidierter Basis nicht wesentlich verändert. Seit dem 31. Dezember 2025 haben sich die Aussichten von BAC und ihren Tochtergesellschaften auf konsolidierter Basis nicht wesentlich verschlechtert."

- (b) In dem Abschnitt "Allgemeine Informationen" wird der Absatz "(7) Rechtsstreitigkeiten" auf Seite 438 des Basisprospekts Schuldverschreibungen und Seite 691 des Basisprospekts Optionsscheine und Zertifikate wie folgt ersetzt:

#### **"(7) Rechtsstreitigkeiten**

##### **Die Garantin**

Mit Ausnahme der Angaben in (i) dem Abschnitt "Rechtsstreitigkeiten und aufsichtsrechtliche Angelegenheiten" auf den Seiten 140 bis 141, bei dem es sich um den Abschnitt "Rechtsstreitigkeiten und aufsichtsrechtliche Angelegenheiten" in Anhang 12 des konsolidierten Jahresabschlusses 2025 der Garantin handelt, und (ii) dem Abschnitt "Rechtsstreitigkeiten und aufsichtsrechtliche Angelegenheiten" auf den Seiten 83 und 84, bei dem es sich um den Abschnitt "Rechtsstreitigkeiten und aufsichtsrechtliche Angelegenheiten" in Anhang 10 des konsolidierten Quartalsabschlusses der Garantin zum 30. Juni 2026 handelt, ist oder war weder BAC noch eine Tochtergesellschaft von BAC in den letzten zwölf Monaten vor dem Datum dieses Basisprospekts in ein behördliches, gerichtliches oder schiedsgerichtliches Verfahren verwickelt (einschließlich anhängiger oder angedrohter Verfahren, die BAC bekannt sind), das sich in diesem Zeitraum erheblich auf die Finanzlage oder die Rentabilität von BAC und ihren Tochtergesellschaften auf konsolidierter Basis auswirken könnte oder ausgewirkt hat.

##### **Die Emittentin**

Die Emittentin ist oder war in den letzten zwölf Monaten vor dem Datum dieses Basisprospekts in kein behördliches, gerichtliches oder schiedsgerichtliches Verfahren verwickelt (einschließlich anhängiger oder angedrohter Verfahren, die MLBV bekannt sind), das sich in diesem Zeitraum erheblich auf die Finanzlage oder die Rentabilität von MLBV auswirken könnte oder ausgewirkt hat."

### **Allgemeines**

Dieser Nachtrag und das durch Verweis einbezogene Dokument können während der üblichen Geschäftszeiten in den angegebenen Geschäftsräumen der Zahlstelle (im Falle von Schuldverschreibungen) und der Haupt-O&Z-Instrumentenstelle (im Falle von O&Z-Instrumenten) sowie auf der Website der Luxemburger Börse unter [www.luxse.com](http://www.luxse.com) eingesehen und angefordert werden.

**Die nachfolgende unverbindliche englischsprachige Übersetzung von Teilen des vorstehenden deutschsprachigen Inhalt des Nachtrags vom 11. August 2026 zu den Basisprospekten vom 17. Dezember 2025 stellt keinen Nachtrag gemäß der EU-Prospektverordnung dar und wurde entsprechend auch nicht von der Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht gebilligt.**

**The following non-binding English language translation of parts of the foregoing German language content of the supplement dated 11 August 2026 Base Prospectuses dated 17 December 2025 is not a supplement in accordance with Article 23 of the EU Prospectus Regulation and was not approved by the German Federal Financial Supervisory Authority (*Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht*).**

**SUPPLEMENT NO. 5 DATED 11 AUGUST 2026 TO THE  
BASE PROSPECTUSES DATED 17 DECEMBER 2025**



**Merrill Lynch B.V.**  
(a Dutch Private Limited Liability Company)

**NOTES BASE PROSPECTUS**

and

**WARRANTS AND CERTIFICATES BASE PROSPECTUS**

under the

**GERMAN NOTE, WARRANT AND CERTIFICATE PROGRAMME**

Unconditionally and irrevocably guaranteed

by

**Bank of America Corporation**  
(a Delaware (U.S.A.) Corporation)

**Supplement to the Base Prospectuses**

This supplement (the "**Supplement**") constitutes a supplement to the base prospectus for notes of Merrill Lynch B.V. ("**MLBV**") dated 17 December 2025 (the "**Base Prospectus Notes**") (*Prospectus-ID: 70864254*) and to the base prospectus for warrants and certificates of MLBV dated 17 December 2025 (the "**Base Prospectus Warrants and Certificates**") (*Prospectus-ID: 69537063*) and, together with the Base Prospectus Notes, the "**Base Prospectuses**", prepared in connection with the German Note, Warrant and Certificate Programme (the "**Programme**") of MLBV constitutes a supplement for the purposes of Article 23(1) of Regulation (EU) 2017/1129 (as amended, the "**EU Prospectus Regulation**"). Terms defined in the Base Prospectuses have the same meanings when used in this Supplement.

On 17 December 2025, the Base Prospectuses were approved by the *Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht* (the "**BaFin**") as competent authority under the EU Prospectus Regulation and are valid for 12 months after its approval for offers to the public or admissions to trading on a regulated market.

The Supplement has been approved by BaFin as competent authority under the EU Prospectus Regulation. BaFin does not approve the information relating to the issue of Exempt Instruments.

With regard to the validity of the prospectuses in Switzerland: the Supplement has been deposited with SIX Exchange Regulation Ltd. in its capacity as review body pursuant to article 54 of the Swiss Financial Services Act of 15 June 2018, as amended.

MLBV has applied to BaFin to send the competent authorities in the Republic of Austria and the Grand Duchy of Luxembourg a certificate confirming the approval of this Supplement, stating that this Supplement has been prepared in accordance with the EU Prospectus Regulation.

## **Right of withdrawal**

**In accordance with Article 23(2) of the EU Prospectus Regulation, investors in the European Economic Area who have already agreed to purchase or subscribe for securities issued under the Base Prospectuses before this Supplement is published and where the securities have not yet been delivered to them at the time when the significant new factor, material mistake or material inaccuracy to which this Supplement relates arose or was noted have the right, exercisable within three working days after the publication of this Supplement, to withdraw their acceptances, provided that the significant new factor, material mistake or material inaccuracy to which this Supplement relates arose or was noted before the closing of the offer period or the delivery of the securities, whichever occurs first. Investors may contact the relevant Authorised Offeror(s) (as set out in the Final Terms of the relevant Notes (as defined in the Base Prospectus Notes) or W&C Instruments (as defined in the Base Prospectus Warrants and Certificates) of the Notes or the W&C Instruments should they wish to exercise such right of withdrawal.**

## **Circumstances Giving Rise to the Supplement within the Meaning of Art. 23(1) of the EU Prospectus Regulation**

With respect to the information contained in the Base Prospectuses, the following significant new circumstance has arisen, which constitutes the reason for this Supplement:

- On 31 July 2026, BAC's quarterly report on Form 10-Q for the quarter ended 30 June 2026, was filed with the United States Securities and Exchange Commission (the "SEC").

By virtue of this Supplement, the following sections of the Base Prospectuses are being amended:

- Supplement to the section on "Information Incorporated by Reference".
- Update the sections of the Base Prospectuses titled "*General Information*" and "*Description of the Issuer and Guarantor*".

## Amendments to the Base Prospectuses

### 1. Information incorporated by reference

- (a) The section titled "*Information incorporated by reference*" is supplemented by inserting the following letter (a) (above the current paragraph (a)) on page 60 of the Base Prospectus Notes and on page 59 of the Base Prospectus Warrants and Certificates (the numbering of the remaining paragraphs will be updated accordingly):

“(a) The Guarantor's Quarterly Report on Form 10-Q for the quarter ended 30 June 2026 filed with the SEC on 31 July 2026 (available for viewing at <https://dl.luxse.com/dlp/10f4bcae3e047f4efcb1e4685cf002a37e>) (the "**Guarantor 30 June 2026 Quarterly Report**") (other than with respect to this report, information that is furnished but deemed not to have been filed under the rules of the SEC).”

- (b) The section titled "*Information incorporated by reference*" is supplemented such that, on page 61 of the Base Prospectus Notes, the subsection "*Cross-reference list*" under the heading "*Information about the Guarantor*" and above the table "Guarantor 31 March 2026 Quarterly Report" the following table will be inserted:

#### Guarantor 30 June 2026 Quarterly Report

##### *Part I Financial Information*

##### *Item 1. Financial Statements*

|                                                                  |                       |                                                                  |
|------------------------------------------------------------------|-----------------------|------------------------------------------------------------------|
| <i>Consolidated Statement of Income</i>                          | <i>Page 47</i>        | "Historical Financial Information of the Guarantor" on page 128. |
| <i>Consolidated Statement of Comprehensive Income</i>            | <i>Page 47</i>        | "Historical Financial Information of the Guarantor" on page 128. |
| <i>Consolidated Balance Sheet</i>                                | <i>Page 48</i>        | "Historical Financial Information of the Guarantor" on page 128. |
| <i>Consolidated Statement of Changes in Shareholders' Equity</i> | <i>Page 49</i>        | "Historical Financial Information of the Guarantor" on page 128. |
| <i>Consolidated Statement of Cash Flows</i>                      | <i>Page 50</i>        | "Historical Financial Information of the Guarantor" on page 128. |
| <i>Notes to Consolidated Financial Statements</i>                | <i>Pages 51 to 99</i> | "Historical Financial Information of the Guarantor" on page 128. |
| <i>1 – Summary of Significant Accounting Principles</i>          | <i>Page 51</i>        |                                                                  |
| <i>2 – Net Interest Income and Noninterest Income</i>            | <i>Page 52</i>        |                                                                  |
| <i>3 – Derivatives</i>                                           | <i>Pages 53 to 59</i> |                                                                  |

|                                                                                               |                      |                                                              |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------|--------------------------------------------------------------|
| 4 – Securities                                                                                | Pages 60 to 62       |                                                              |
| 5 – Outstanding Loans and Leases and Allowance for Credit Losses                              | Pages 63 to 74       |                                                              |
| 6 – Securitizations and Other Variable Interest Entities                                      | Pages 74 to 79       |                                                              |
| 7 – Goodwill and Intangible Assets                                                            | Page 79              |                                                              |
| 8 – Leases                                                                                    | Page 79              |                                                              |
| 9 – Securities Financing Agreements, Collateral and Restricted Cash                           | Pages 80 to 81       | "Expected Financing Activities of the Guarantor" on page 87. |
| 10 – Commitments and Contingencies                                                            | Pages 81 to 84       |                                                              |
|                                                                                               | Pages 83 and 84 only | "Litigation" on page 128.                                    |
| 11 – Shareholders' Equity                                                                     | Page 84              | "Share Capital of the Guarantor" on page 87.                 |
| 12 – Accumulated Other Comprehensive Income (Loss)                                            | Page 85              |                                                              |
| 13 – Earnings Per Common Share                                                                | Page 86              |                                                              |
| 14 – Fair Value Measurements                                                                  | Pages 86 to 93       |                                                              |
| 15 – Fair Value Option                                                                        | Pages 93 to 95       |                                                              |
| 16 – Fair Value of Financial Instruments                                                      | Page 95              |                                                              |
| 17 – Business Segment Information                                                             | Pages 96 to 99       |                                                              |
| Glossary                                                                                      | Pages 100 to 101     |                                                              |
| Acronyms                                                                                      | Page 102             |                                                              |
| Item 2. Management's Discussion and Analysis of Financial Condition and Results of Operations |                      |                                                              |
| Liquidity Risk                                                                                | Pages 23 to 25       | "Expected Financing Activities of the Guarantor" on page 87. |

- (c) The section titled "*Information incorporated by reference*" is supplemented such that, on page 60 of the Base Prospectus Warrants and Certificates, the subsection "*Cross-reference list*" under the heading "*Information about the Guarantor*" and above the table "Guarantor 31 March 2026 Quarterly Report" the following table will be inserted:

## Guarantor 30 June 2026 Quarterly Report

### *Part I Financial Information*

#### *Item 1. Financial Statements*

|                                                                            |                       |                                                                  |
|----------------------------------------------------------------------------|-----------------------|------------------------------------------------------------------|
| <i>Consolidated Statement of Income</i>                                    | <i>Page 47</i>        | "Historical Financial Information of the Guarantor" on page 109. |
| <i>Consolidated Statement of Comprehensive Income</i>                      | <i>Page 47</i>        | "Historical Financial Information of the Guarantor" on page 109. |
| <i>Consolidated Balance Sheet</i>                                          | <i>Page 48</i>        | "Historical Financial Information of the Guarantor" on page 109. |
| <i>Consolidated Statement of Changes in Shareholders' Equity</i>           | <i>Page 49</i>        | "Historical Financial Information of the Guarantor" on page 109. |
| <i>Consolidated Statement of Cash Flows</i>                                | <i>Page 50</i>        | "Historical Financial Information of the Guarantor" on page 109. |
| <i>Notes to Consolidated Financial Statements</i>                          | <i>Pages 51 to 99</i> | "Historical Financial Information of the Guarantor" on page 109. |
| <i>1 – Summary of Significant Accounting Principles</i>                    | <i>Page 51</i>        |                                                                  |
| <i>2 – Net Interest Income and Noninterest Income</i>                      | <i>Page 52</i>        |                                                                  |
| <i>3 – Derivatives</i>                                                     | <i>Pages 53 to 59</i> |                                                                  |
| <i>4 – Securities</i>                                                      | <i>Pages 60 to 62</i> |                                                                  |
| <i>5 – Outstanding Loans and Leases and Allowance for Credit Losses</i>    | <i>Pages 63 to 74</i> |                                                                  |
| <i>6 – Securitizations and Other Variable Interest Entities</i>            | <i>Pages 74 to 79</i> |                                                                  |
| <i>7 – Goodwill and Intangible Assets</i>                                  | <i>Page 79</i>        |                                                                  |
| <i>8 – Leases</i>                                                          | <i>Page 79</i>        |                                                                  |
| <i>9 – Securities Financing Agreements, Collateral and Restricted Cash</i> | <i>Pages 80 to 81</i> | "Expected Financing Activities of the Guarantor" on page 109.    |
| <i>10 – Commitments and Contingencies</i>                                  | <i>Pages 81 to 84</i> |                                                                  |

|                                                                                                      |                             |                                                               |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------|---------------------------------------------------------------|
|                                                                                                      | <i>Pages 83 and 84 only</i> | "Litigation" on page 151.                                     |
| <i>11 – Shareholders' Equity</i>                                                                     | <i>Page 84</i>              | "Share Capital of the Guarantor" on page 109.                 |
| <i>12 – Accumulated Other Comprehensive Income (Loss)</i>                                            | <i>Page 85</i>              |                                                               |
| <i>13 – Earnings Per Common Share</i>                                                                | <i>Page 86</i>              |                                                               |
| <i>14 – Fair Value Measurements</i>                                                                  | <i>Pages 86 to 93</i>       |                                                               |
| <i>15 – Fair Value Option</i>                                                                        | <i>Pages 93 to 95</i>       |                                                               |
| <i>16 – Fair Value of Financial Instruments</i>                                                      | <i>Page 95</i>              |                                                               |
| <i>17 – Business Segment Information</i>                                                             | <i>Pages 96 to 99</i>       |                                                               |
| <i>Glossary</i>                                                                                      | <i>Pages 100 to 101</i>     |                                                               |
| <i>Acronyms</i>                                                                                      | <i>Page 102</i>             |                                                               |
| <i>Item 2. Management's Discussion and Analysis of Financial Condition and Results of Operations</i> |                             |                                                               |
| <i>Liquidity Risk</i>                                                                                | <i>Pages 23 to 25</i>       | "Expected Financing Activities of the Guarantor" on page 109. |

## 2. **Updating of the section titled "Description of the Issuer and Guarantor"**

- (a) In the "Description of the Issuer and Guarantor" section and sub-section "Bank of America Corporation" on page 128 of the Base Prospectus Notes and on page 109 of the Base Prospectus Warrants and Certificates the paragraphs titled "*Expected Financing Activities of the Guarantor*", "*Historical financial information of the Guarantor*" and "*Share Capital of the Guarantor*", shall be deleted and replaced with the following:

### **"Expected Financing Activities of the Guarantor"**

With respect to the expected financing activities of the Guarantor, the information contained on pages 23 to 25 and in the section titled "Securities Financing Agreements, Collateral and Restricted Cash" on page 80 of the Guarantor 30 June 2026 Quarterly Report, in the section titled "Liquidity Risk" on pages 20 to 24 and in the section titled "Shareholders' Equity" on page 80 of the Guarantor 31 March 2026 Quarterly Report, in the section titled "Capital Management" on pages 48 to 53 in "Item 7. Management's Discussion and Analysis of Financial Condition and Results of Operations" of the Guarantor 2024 Annual Report, in the section titled "Liquidity Risk" on pages 53 to 58 in "Item 7. Management's Discussion and Analysis of Financial Condition and Results of Operations" of the Guarantor 2024 Annual Report, in Note 13 to the Consolidated Financial Statements, "Shareholders' Equity," on pages 140 to 141 of the Guarantor 2024 Annual Report, in the section titled "Capital Management" on pages 20 to 24 in "Item 2. Management's Discussion and Analysis of Financial Condition and Results of Operations" of the Guarantor 30 September 2025 Quarterly Report, in the section titled "Liquidity Risk" on pages 25 to 28 in "Item 2. Management's Discussion and Analysis of

Financial Condition and Results of Operations" of the Guarantor 30 September 2025 Quarterly Report, and in Note 11 to the Consolidated Financial Statements, "Shareholders' Equity," on page 85 of the Guarantor 30 September 2025 Quarterly Report are incorporated by reference pursuant to Article 19 paragraph 1 of the EU Prospectus Regulation into this Base Prospectus.

### **Historical financial information of the Guarantor**

With respect to the historical financial information of the Guarantor, (a) the audited financial statements of the Guarantor on a consolidated basis are contained on pages 87 to 173 of the Guarantor 2025 Annual Report and (b) the unaudited financial statements of the Guarantor on a consolidated basis are contained on pages 47 to 102 of the Guarantor 30 June 2026 Quarterly Report, pages 44 to 95 of the Guarantor 31 March 2026 Quarterly Report, pages 48 to 103 of the Guarantor 30 June 2025 Quarterly Report and pages 48 to 104 of the Guarantor 30 September 2025 Quarterly Report are incorporated by reference pursuant to Article 19 paragraph 1 of the EU Prospectus Regulation into this Base Prospectus (detailed information regarding the relevant sections in these documents from which information is incorporated by reference can be found in section "Information incorporated by reference").

The information on the historical financial statements of the Guarantor on a consolidated basis as of 31 December 2024 and 2025, and for each of the three years in the period ended 31 December 2025 (as incorporated by reference herein) are contained in the Guarantor 2025 Annual Report."

### **Share Capital of the Guarantor**

With respect to the share capital of the Guarantor, the information contained in the section titled "Shareholders' Equity" on page 84 of the Guarantor 30 June 2026 Quarterly Report, in the section titled "Shareholders' Equity" on page 80 of the Guarantor 31 March 2026 Quarterly Report, in Note 13 to the Consolidated Financial Statements, "Shareholders' Equity," on pages 140 to 141 of the Guarantor 2024 Annual Report and in Note 11 to the Consolidated Financial Statements, "Shareholders' Equity," on page 85 of the Guarantor 30 September 2025 Quarterly Report are incorporated by reference pursuant to Article 19 paragraph 1 of the EU Prospectus Regulation into this Base Prospectus."

### **3. Updating of the section titled "General Information"**

- (a) In the "General Information" section and sub-section "Bank of America Corporation" on page 128 of the Base Prospectus Notes and on page 151 of the Base Prospectus Warrants and Certificates in the paragraph titled "(6) Significant or Material Change" the subsection titled "The Guarantor" shall be deleted and replaced with the following:

#### *"The Guarantor"*

There has been no significant change in the financial position or financial performance of the Guarantor and its subsidiaries on a consolidated basis since 30 June 2026.

There has been no material adverse change in the prospects of the Guarantor and its subsidiaries on a consolidated basis since 31 December 2025."

- (b) In the "General Information" section and sub-section "Bank of America Corporation" on page 128 of the Base Prospectus Notes and on page 151 of the Base Prospectus Warrants and Certificates the paragraph titled "(7) Litigation" shall be deleted and replaced with the following:

#### **"(7) Litigation"**

##### *The Guarantor*

Save as disclosed in (i) the section titled "Litigation and Regulatory Matters" on pages 140 to 141, being the Litigation and Regulatory Matters section in Note 12 to the Consolidated Financial Statements, of the Guarantor 2025 Annual Report and (ii) the section titled "Litigation and Regulatory Matters" on pages 83 and 84, being the Litigation and Regulatory Matters section in Note 10 to the Consolidated Financial Statements of the Guarantor 30 June 2026 Quarterly Report, neither the Guarantor nor any subsidiary of

the Guarantor is or has been involved in any governmental, legal or arbitration proceedings (including any such proceedings which are pending or threatened of which the Guarantor is aware) in the 12 months preceding the date of this Base Prospectus which may have or have in such period had a significant effect on the financial position or profitability of the Guarantor and its subsidiaries on a consolidated basis.

*The Issuer*

The Issuer is not and has not been involved in any governmental, legal or arbitration proceedings (including any such proceedings which are pending or threatened of which the Issuer is aware) in the 12 months preceding the date of this Base Prospectus which may have or have in such period had a significant effect on the financial position or profitability of the Issuer."

**General**

This Supplement and the document incorporated by reference will be available for viewing and can be obtained during normal business hours from the specified office of the applicable Paying Agent (in respect of Notes) and the applicable Principal W&C Instrument Agent (in respect of W&C Instruments) and on the Luxembourg Stock Exchange's website at [www.luxse.com](http://www.luxse.com).