



FIDELITY OF GEORGETOWN INC.
Life Settlement since 2004



Maturity Report Policen Portfolio

**Managed Account
Third-Party
Purchaser Business**

1/2024

Einzelübersicht (aller bereits fällig gewordenen Policen)

Jahr	Policen Code	Kaufdatum Monat/Tag/Jahr	Eintritt der Fälligkeit	Erwarteter Kapital- Ertrag (p.a.)	Tatsächliche Kapital- Rendite (p.a.)
2015	T-4030	12/27/2014	06/11/2015	8,00%	38,25%
	T-4024	09/02/2014	06/12/2015	8,00%	52,52%
	T-4013	07/25/2014	07/08/2015	8,00%	21,01%
2016	T-4006	04/08/2014	10/29/2016	8,00%	9,39%
	T-4114	01/29/2016	10/31/2016	8,00%	52,90%
	T-4143	05/23/2016	12/08/2016	8,00%	73,00%
2017	T-4027	09/03/2014	05/13/2017	8,00%	8,91%
	T-4215	11/28/2016	06/27/2017	8,00%	34,28%
2018	T-4268	05/05/2017	02/24/2018	8,00%	49,49%
	T-4188	11/17/2016	04/27/2018	8,00%	16,68%
	T-4157	08/18/2016	06/21/2018	8,00%	22,80%
	T-4225	02/13/2017	07/19/2018	8,00%	22,05%
	T-4355	02/23/2018	02/13/2019	9,07%	49,75%
2019	T-4399	07/12/2018	04/16/2019	8,00%	47,25%
	T-4152	09/28/2016	04/22/2019	8,00%	12,48%
	T-4393	07/10/2018	08/14/2019	8,00%	29,20%
	T-4288	10/13/2017	10/18/2019	10,00%	17,38%
2020	T-4440	10/28/2018	03/07/2020	20,00%	13,88%
	T-4395	07/26/2018	03/28/2020	9,00%	12,55%
	T-4126	12/18/2015	06/16/2020	8,00%	5,34%
	T-4148	04/15/2016	06/25/2020	8,00%	6,68%
	T-4581	05/13/2020	10/05/2020	8,00%	99,00%
	T-4145	06/17/2016	10/29/2020	8,00%	7,33%
2021	T-4334A	12/14/2017	01/03/2021	10,00%	9,83%
	T-4334B	02/22/2018	01/03/2021	10,00%	10,47%
	T-4550	10/11/2019	02/27/2021	8,00%	12,55%
	T-4693	12/01/2020	02/27/2021	8,00%	202,45%
	T-4431	10/31/2018	03/21/2021	7,50%	8,89%
	T-4577	06/22/2020	05/18/2021	8,00%	23,35%
	T-4705	03/31/2021	07/02/2021	7,50%	293,64%
	T-4103	10/27/2015	08/02/2021	8,00%	2,95%
2022	T-4634	08/18/2020	09/26/2021	8,00%	36,18%
	T-4754A	05/26/2021	02/01/2022	8,00%	89,02%
	T-4754B	05/26/2021	02/01/2022	8,00%	89,02%
	T-4397	10/10/2018	02/01/2022	9,00%	11,11%
	T-4284	01/08/2018	03/09/2022	9,00%	16,37%
	T-4380	12/26/2018	03/17/2022	9,00%	14,22%
	T-4224	12/22/2016	04/23/2022	10,00%	14,99%
	T-4526	07/18/2019	05/28/2022	8,00%	13,05%
	T-4190	08/29/2016	06/17/2022	8,00%	5,51%
T-5009	01/19/2022	07/01/2022	8,00%	35,35%	

Jahr	Policen Code	Kaufdatum Monat/Tag/Jahr	Eintritt der Fälligkeit	Erwarteter Kapital- Ertrag (p.a.)	Tatsächliche Kapital- Rendite (p.a.)*
2022	T-4633	08/07/2020	01/31/2022	8,00%	16,20%
	T-4696	07/06/2021	10/13/2022	7,00%	22,06%
	T-4578	04/27/2020	10/10/2022	8,00%	12,91%
	T-4299	08/22/2017	12/12/2022	8,00%	5,26%
2023	T-4845	12/17/2021	01/04/2023	8,00%	38,15%
	T-4744	05/25/2021	02/21/2023	8,50%	22,30%
	T-5108	12/08/2022	03/07/2023	8,00%	157,30%
	T-4883	01/15/2022	04/30/2023	8,00%	43,35%
	T-5021A	07/07/2022	04/14/2023	8,00%	66,71%
	T-5021B	07/07/2022	04/14/2023	8,00%	66,71%
	T-4022	09/15/2014	10/11/2023	8,00%	4,98%
	T-4920	05/09/2022	10/17/2023	8,00%	27,30%
	T-5380	07/21/2023	10/23/2023	8,00%	116,41%
	T-5156	02/03/2023	10/06/2023	8,00%	35,71%
	T-4783	10/05/2022	11/07/2023	7,00%	19,24%
	T-4598	07/16/2020	12/03/2023	8,00%	11,84%
	2024	T-5332	06/30/2023	01/01/2024	8,00%

Blau = testierte Zahlen aus dem Audit ALTA CPA Group vom 31. Dezember 2022

Schwarz = noch nicht testierte Zahlen

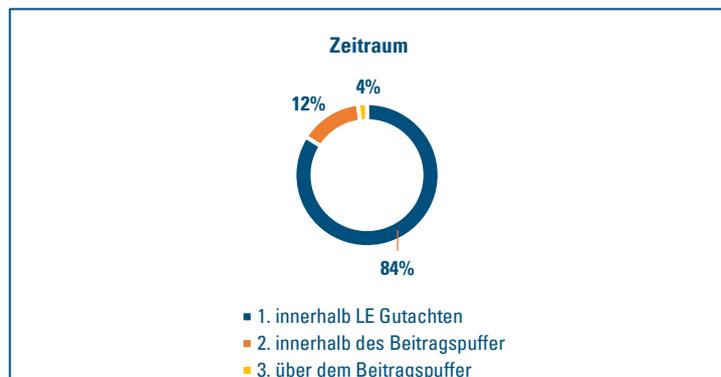
*Anmerkung 1 = Berechnung der "Jährlich tatsächlichen Kapitalrendite"

Die „tatsächliche Kapitalrendite“ für bereits fällig gewordene Lebensversicherungspolice werden anhand des Ertragsgewinns des Anlegers und der Haltedauer der Police vom Abschlussdatum bis zur Fälligkeit berechnet

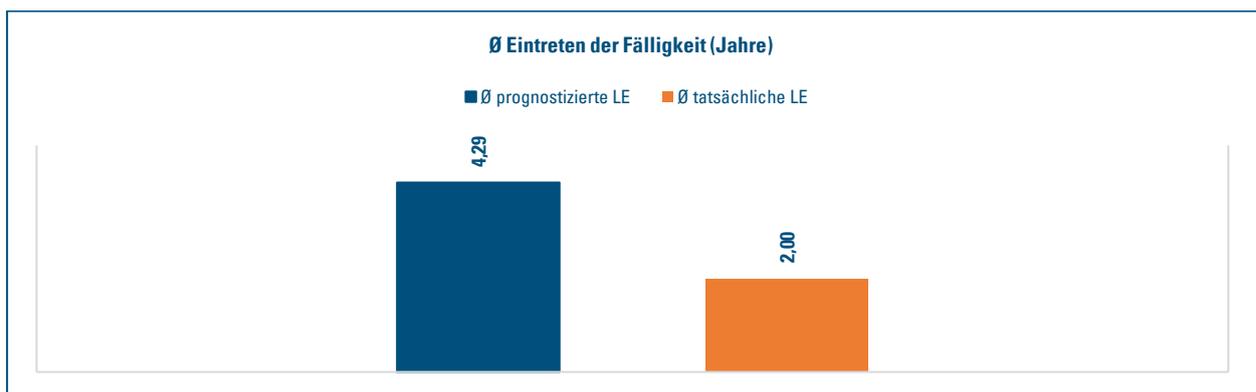
Polizenzahl

Bereits fällig gewordene Policen	58
Frühzeitig fällig gewordene Policen innerhalb der jeweiligen LE Gutachten	49
Fällig gewordene Policen über LE Gutachten innerhalb Beitragspuffer (2 Jahre)	7
Fällig gewordene Policen über dem Beitragspuffer	2

Zeitraum der Fälligkeiten (in Bezug auf LE Gutachten)

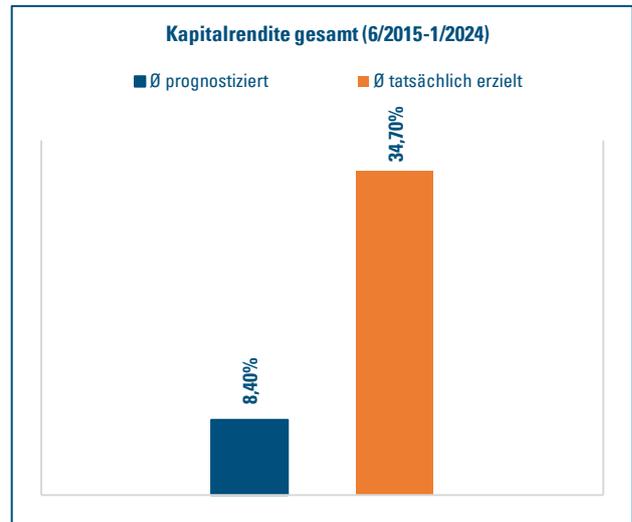


Durchschnittsberechnungen Lebenserwartung (in Bezug auf LE Gutachten)



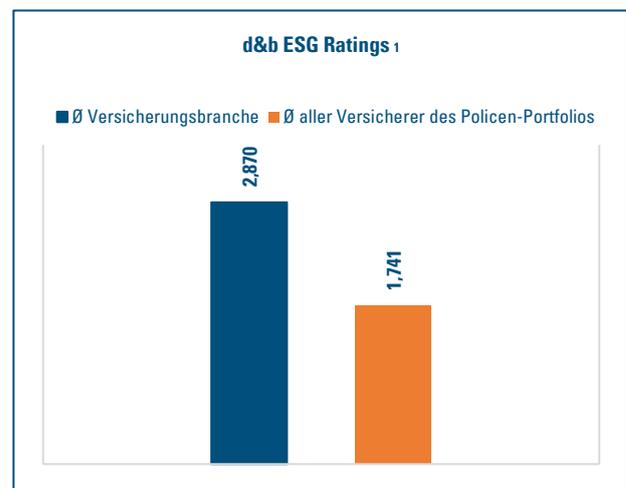
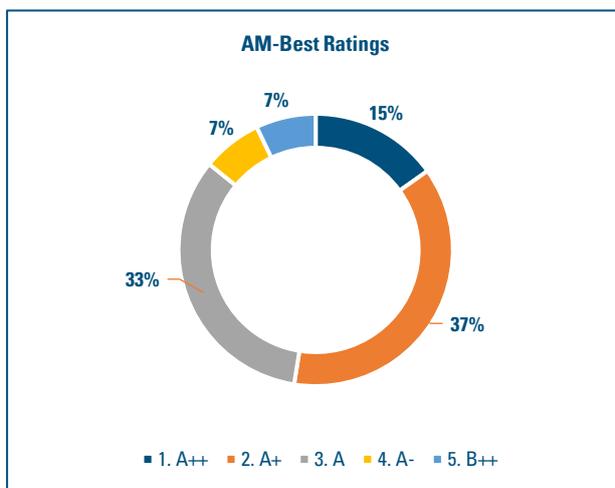
Durchschnittsberechnungen Kapitalrendite (historisch)

Jahr	Ø prognostiziert (aller in dem Jahr fällig gewordenen Policen)	Ø tatsächlich erzielt (aller in dem Jahr fällig gewordenen Policen)
2015	8,00%	37,26%
2016	8,00%	45,10%
2017	8,00%	21,60%
2018	8,00%	27,76%
2019	8,61%	31,21%
2020	10,17%	24,13%
2021	8,33%	66,70%
2022	8,31%	26,54%
2023	7,96%	50,83%
2024	8,00%	15,92%



Hinweis: Bei allen hier dargestellten Durchschnittsberechnungen, handelt es sich nicht um Renditen aus einem Fonds, sondern um eine reine Darstellung von Ergebnissen aus der Vergangenheit (Backtesting) von bisher einzeln fällig gewordenen Policen (in unterschiedlichen Szenarien) und stellen keine Garantie für zukünftige Renditen dar. Grundsätzlich muss jede Police einzeln betrachtet werden.

Ratings der Versicherungsgesellschaften



Top 8 Versicherungsgesellschaften

Versicherer	AM Best Rating	d&b ESG Rating
Transamerica Life Insurance	A	1,0
Lincoln National Life Insurance	A+	3,0
Metropolitan Life Insurance	A+	3,0
Northwestern Mutual Life Insurance	A++	2,0
Massachusetts Mutual Life Insurance	A++	1,0
AXA Life Insurance	A	3,0
Gerber Life Insurance	A	2,0
State Farm Insurance	A++	2,0



ALTA CPA

INDEPENDENT ACCOUNTANT'S REPORT

To the Owners of
Fidelity of Georgetown, Inc.
517 Benfield Road, Suite 301
Severna Park, MD 21146

We have examined management of Fidelity of Georgetown, Inc.'s assertion that the annual returns of the life insurance policies which have matured in the period from January 1, 2022 through December 31, 2022, listed in the attached schedule, are properly calculated in accordance with (or based on) the criteria set forth in Note 1. Fidelity of Georgetown, Inc.'s management is responsible for its assertion. Our responsibility is to express an opinion on the schedule of annual returns for the life insurance policies which matured in the period from January 1, 2022 through December 31, 2022, based on our examination.

Our examination was conducted in accordance with attestation standards established by the American Institute of Certified Public Accountants. Those standards require that we plan and perform the examination to obtain reasonable assurance about whether the annual returns of the life insurance policies which have matured in the period from January 1, 2022 through December 31, 2022 is presented in accordance with the criteria, in all material respects. An examination involves performing procedures to obtain evidence about the schedule of annual returns. The nature, timing, and extent of the procedures selected depend on our judgment, including an assessment of the risks of material misstatement of the schedule of life insurance policies which matured in the period from January 1, 2021 and December 31, 2021, whether due to fraud or error. We believe that the evidence we obtained is sufficient and appropriate to provide a reasonable basis for our opinion.

In our opinion, the accompanying schedule of annual returns for the life insurance policies which matured in the period from January 1, 2022 through December 31, 2022 is presented in accordance with the criteria set forth in Note 1, in all material respects.

Report on Comparative Information

We have previously examined Fidelity of Georgetown, Inc.'s assertion that the annual returns of the life insurance policies which have matured in the period from January 1, 2014 through December 31, 2021 are properly calculated in accordance with (or based on) the criteria set forth in Note 1 and provided our opinion on February 15, 2022. In our opinion, the comparative information presented herein for the period ended December 31, 2021, is presented in accordance with the criteria set forth in Note 1, in all material respects.

Alta CPA Group, LLC
January 9, 2023

Organisation und Kriterien

Fidelity of Georgetown Inc. (Unternehmen)

Das Unternehmen ist im US-Bundesstaat Maryland eingetragen und tätig. Das Unternehmen beschafft, wählt aus, bietet und verhandelt über den Kauf von US-Lebensversicherungspolicen zum Weiterverkauf an Dritte.

Haftungsausschluss

Wichtiger Hinweis: Dieses Dokument wird durch Fidelity of Georgetown Inc. erstellt. Die hierin enthaltenen Angaben sind vertraulich und geschützt und dienen ausschließlich der Verwendung durch den Empfänger. Sie dürfen nicht vervielfältigt, verbreitet oder für andere Zwecke verwendet werden. Die hierin enthaltenen Angaben stellen lediglich eine kurze Zusammenfassung der wichtigsten Aspekte des Fidelity of Georgetown Inc. Trust dar und sind nicht vollständig. Sie enthalten keine bestimmten wesentlichen Informationen über alternative Anlagen, einschließlich wichtiger Offenlegungen und Risikofaktoren im Zusammenhang mit einer Investition in diese Art von Anlagen. Dieses Dokument ist nicht als Angebot zum Verkauf oder als Aufforderung zur Abgabe eines Angebots zum Kauf von Policen des Fidelity of Georgetown Inc. Trust gedacht und sollte auch nicht als ein solches ausgelegt oder genutzt werden. Dieses Dokument stellt ohne Einschränkung keine Anlageberatung dar und gilt nicht als Angebot, Aufforderung oder Empfehlung zum Abschluss einer Transaktion. Wird ein Angebot gemacht, geschieht dies gemäß den entsprechenden durch den oder im Namen der Gesellschaft erstellten Kaufunterlagen und die mit dem Kauf von Policen verbundenen Risiken, Gebühren und Ausgaben. Diese Kaufunterlagen bilden die alleinige verbindliche Grundlage für den Kauf von Policen. Die Wertentwicklung in der Vergangenheit ist keine Garantie und kein Indikator für zukünftige Ergebnisse.

Allgemeine Informationen

Der Maturity Report dokumentiert nur die bisher fällig gewordenen Policen, die seit dem 01. Januar 2014 ausschließlich über das sogenannte „Third-Party Purchaser“-Business über den Fidelity of Georgetown Inc. Trust (Managed Account) erworben und abgewickelt werden. Stichtag der Betrachtungen ist der 09. Januar 2024. Die in der Einzelübersicht „blau“ kenntlich gemachten Policen, sind testierte Zahlen aus dem Audit ALTA CPA Group vom 31. Dezember 2022. Grafische Darstellungen erfolgten zu Durchschnittsberechnungen und Statistiken. Die ausgewiesenen Zahlen zur Performance wurden dabei basierend auf dem tatsächlichen Stand, d.h. gemäß den jeweiligen zu Grunde liegenden prognostizierten Kapitalrenditen und den tatsächlich erzielten Kapitalrenditen ermittelt. Die Renditen werden als Nettoergebnisse in USD ausgewiesen. Da möglicherweise weitere Gebühren, Abgaben und Steuern für den Anleger anfallen, geltend die vorstehenden Angaben nicht als Richtwert für die tatsächliche Rendite für den Anleger. Als zusätzliche Gebühren können auf Anlegerebene z. B. Gebühren für Währungsumrechnungen anfallen.

Fußnoten

¹ d&b = dun&bradstreet; Die Themenarchitektur des ESG-Rankings wurde unter Bezugnahme auf mehrere der führenden ESG-Standards erstellt, einschließlich des SASB, der Global Reporting Initiative (GRI), der Task Force on Climate-related Financial Disclosures (TCFD), das CDP (ehemals Carbon Disclosure Project), die SDGs der Vereinten Nationen und andere namhafte Nachhaltigkeitsberichte Rahmenwerke. d&b vergibt nur dann ein ESG-Ranking an ein Unternehmen, für das es über ausreichende Daten verfügt, um mindestens 4 der 13 Themen angemessen zu bewerten. Das d&b ESG-Ranking verwendet eine 5-Punkte-Skala, um den Grad des Risikos oder der Leistung im Bereich ESG anzugeben, wobei 1 für ein geringes Risiko oder die beste Leistung und 5 für ein hohes Risiko oder die schlechteste Leistung steht. (Ratings: 1 = sehr gut - 2 = gut - 3 = mittel - 4 = schlecht - 5 = sehr schlecht)

Fidelity of Georgetown Inc. | Fidelity Settlements
517 Benfield Road | Suite 301
Severna Park | MD 21146
USA

© 2024 Fidelity of Georgetown Inc. and/or its affiliates. All rights reserved.