



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

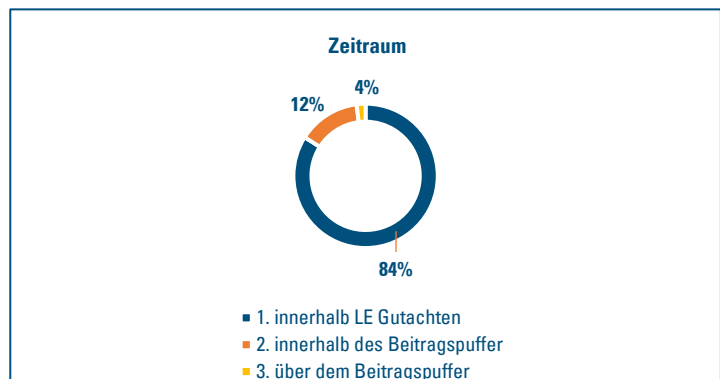
*Anmerkung 1 = Berechnung der "Jährlich tatsächlichen Kapitalrendite"

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

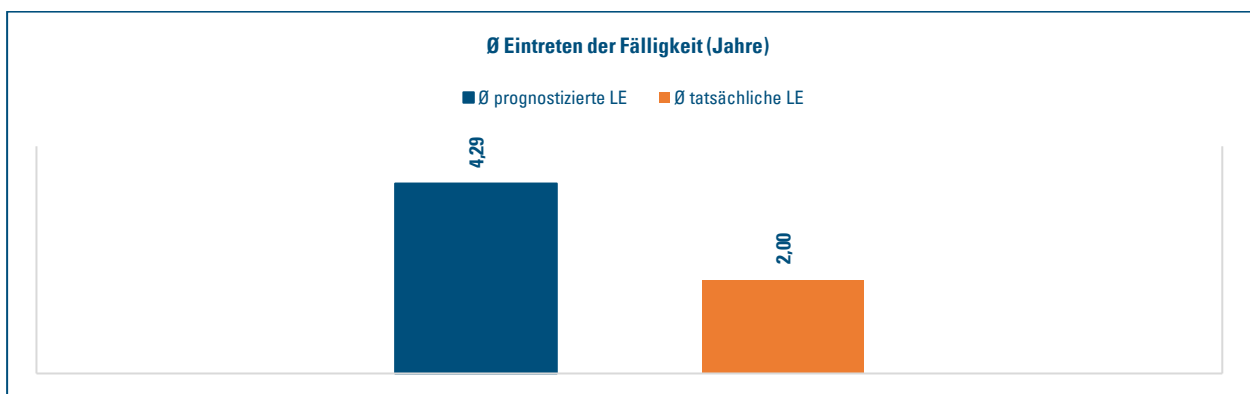
Polizenzahl

| | |
|--|-----------|
| 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)

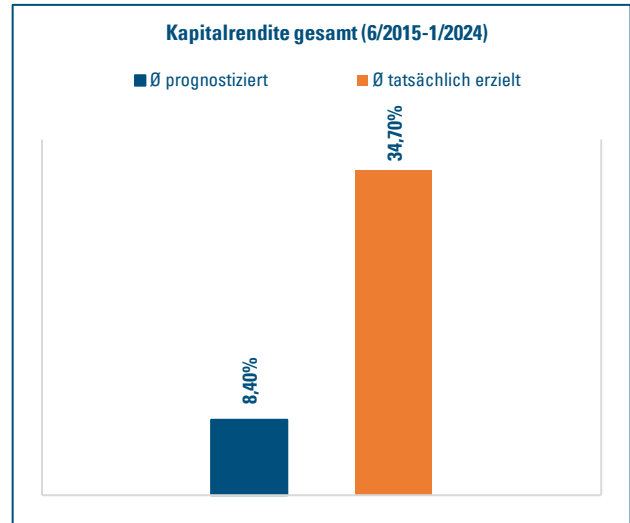


Durchschnittsberechnungen Lebenserwartung (in Bezug auf LE Gutachten)



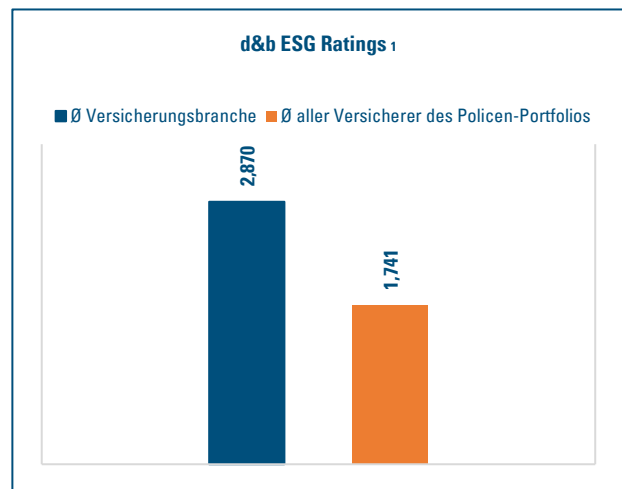
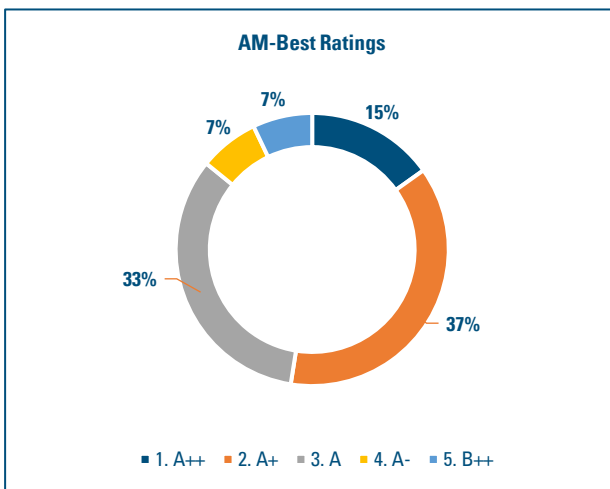
Durchschnittsberechnungen Kapitalrendite (historisch)

| 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.