FIDELITY OF GEORGETOWN INC.
Life Settlements since 2004

Maturity Report Policen Portfolio

Managed Account

Third-Party

Purchaser Business

8/2026

Einzelübersicht (aller bereits fällig gewordenen Policen)

Jahr	Policen Code	Kaufdatum Monat/Tag/Jahr	Eintritt der Fälligkeit	Kalkulierter Gesamt-Ertrag (erzielt)	Erwarteter Ertrag (p.a.)*	Tatsächlicher Ertrag (p.a.)**
2015	T-4030	12/27/2014	06/11/2015	24,00%	8,00%	38,25%
	T-4024	09/02/2014	06/12/2015	40,67%	8,00%	52,52%
	T-4013	07/25/2014	07/08/2015	20,00%	8,00%	21,01%
2016	T-4006	04/08/2014	10/29/2016	24,00%	8,00%	9,39%
	T-4114	01/29/2016	10/31/2016	40,00%	8,00%	52,90%
	T-4143	05/23/2016	12/08/2016	40,00%	8,00%	73,00%
2017	T-4027	09/03/2014	05/13/2017	24,00%	8,00%	8,91%
	T-4215	11/28/2016	06/27/2017	20,00%	8,00%	34,28%
2018	T-4268	05/05/2017	02/24/2018	40,00%	8,00%	49,49%
	T-4188	11/17/2016	04/27/2018	24,00%	8,00%	16,68%
	T-4157	08/18/2016	06/21/2018	42,00%	8,00%	22,80%
	T-4225	02/13/2017	07/19/2018	32,00%	8,00%	22,05%
2019	T-4355	02/23/2018	02/13/2019	48,37%	9,07%	49,75%
	T-4399	07/12/2018	04/16/2019	36,00%	8,00%	47,25%
	T-4152	09/28/2016	04/22/2019	32,00%	8,00%	12,48%
	T-4393	07/10/2018	08/14/2019	32,00%	8,00%	29,20%
	T-4288	10/13/2017	10/18/2019	35,00%	10,00%	17,38%
2020	T-4440	10/28/2018	03/07/2020	20,00%	20,00%	13,88%
	T-4395	07/26/2018	03/28/2020	23,33%	10,00%	12,55%
	T-4126	12/18/2015	06/16/2020	24,00%	8,00%	5,34%
	T-4148	04/15/2016	06/25/2020	28,00%	8,00%	6,68%
	T-4581	05/13/2020	10/05/2020	39,33%	8,00%	99,00%
	T-4145	06/17/2016	10/29/2020	32,00%	8,00%	7,33%
2021	T-4334A	12/14/2017	01/03/2021	30,00%	10,00%	9,83%
	T-4334B	02/22/2018	01/03/2021	30,00%	10,00%	10,47%
	T-4550	10/11/2019	02/27/2021	17,33%	8,00%	12,55%
	T-4693	12/01/2020	02/27/2021	50,00%	8,00%	202,45%
	T-4431	10/31/2018	03/21/2021	21,25%	7,50%	8,89%
	T-4577	06/22/2020	05/18/2021	21,33%	8,00%	23,35%
	T-4705	03/31/2021	07/02/2021	75,00%	7,50%	293,64%
	T-4103	10/27/2015	08/02/2021	16,67%	8,00%	2,95%
	T-4634	08/18/2020	09/26/2021	40,00%	8,00%	36,18%
2022	T-4754A	05/06/2021	02/01/2022	65,33%	8,00%	89,02%
	T-4754B	05/06/2021	02/01/2022	65,33%	8,00%	89,02%
	T-4397	10/10/2018	02/01/2022	36,75%	9,00%	11,11%
	T-4284	01/08/2018	03/09/2022	68,25%	9,00%	16,37%
	T-4380	12/26/2018	03/17/2022	45,75%	9,00%	14,22%

Jahr	Policen Code	Kaufdatum Monat/Tag/Jahr	Eintritt der Fälligkeit	Kalkulierter Gesamt-Ertrag (erzielt)	Erwarteter Ertrag (p.a.)*	Tatsächlicher Ertrag (p.a.)**
2022	T-4224	12/22/2016	04/23/2022	80,00%	10,00%	14,99%
	T-4526	07/18/2019	05/28/2022	37,33%	8,00%	13,05%
	T-4190	08/29/2016	06/17/2022	32,00%	8,00%	5,51%
	T-5009	01/19/2022	07/01/2022	16,67%	8,00%	35,35%
	T-4633	08/07/2020	01/31/2022	24,00%	8,00%	16,20%
	T-4696	07/06/2021	10/13/2022	28,00%	7,00%	22,06%
	T-4578	04/27/2020	10/10/2022	32,00%	8,00%	12,91%
	T-4299	08/22/2017	12/12/2022	28,00%	8,00%	5,26%
2023	T-4845	12/17/2021	01/04/2023	40,00%	8,00%	38,15%
	T-4744	05/25/2021	02/21/2023	38,96%	8,50%	22,30%
	T-5108	12/08/2022	03/07/2023	39,33%	8,00%	157,30%
	T-4883	01/15/2022	04/30/2023	56,00%	8,00%	43,35%
	T-5021A	07/07/2022	04/14/2023	51,33%	8,00%	66,71%
	T-5021B	07/07/2022	04/14/2023	51,33%	8,00%	66,71%
	T-4022	09/15/2014	09/29/2023	45,00%	8,00%	4,98%
	T-4920	05/09/2022	10/27/2023	40,00%	8,00%	27,30%
	T-5380	07/21/2023	10/26/2023	30,67%	8,00%	116,41%
	T-5156	02/03/2023	10/05/2023	24,00%	8,00%	35,71%
	T-4783	10/05/2022	11/08/2023	21,00%	7,00%	19,24%
	T-4598	07/16/2020	12/03/2023	40,00%	8,00%	11,84%
2024	T-5332	06/30/2023	01/03/2024	8,00%	8,00%	15,75%
	T-5392	09/19/2023	02/06/2024	52,67%	8,00%	136,80%
	T-4233	12/07/2016	03/11/2024	24,00%	8,00%	3,31%
	T-4089	09/09/2015	03/11/2024	40,00%	8,00%	4,70%
	T-5075	01/27/2023	07/24/2024	26,67%	8,00%	17,91%
	T-4131	02/11/2016	08/25/2024	42,00%	8,00%	4,92%
	T-4240	04/13/2017	08/24/2024	66,00%	9,00%	8,96%
	T-4064	09/21/2015	10/30/2024	40,00%	8,00%	4,39%
	T-5627	12/11/2023	12/06/2024	29,33%	8,00%	29,81%
2025	T-4930A	04/05/2022	01/22/2025	20,00%	8,00%	7,15%
	T-4930B	03/23/2022	01/22/2025	20,00%	8,00%	7,07%
	T-5249	04/03/2023	01/17/2025	24,00%	8,00%	13,43%
	T-5283A	05/02/2023	01/22/2025	8,00%	8,00%	4,65%
	T-5283B	05/02/2023	01/22/2025	8,00%	8,00%	4,65%
	T-5283C	05/02/2023	01/22/2025	8,00%	8,00%	4,65%
	T-5928	02/05/2025	02/28/2025	60,00%	8,00%	1.119,92%
	T-5453	08/21/2023	03/12/2025	77,33%	8,00%	49,86%

Jahr	Policen Code	Kaufdatum Monat/Tag/Jahr	Eintritt der Fälligkeit	Kalkulierter Gesamt-Ertrag (erzielt)	Erwarteter Ertrag (p.a.)*	Tatsächlicher Ertrag (p.a.)**
2025	T-4591	06/11/2020	01/07/2025	24,00%	8,00%	5,25%
	T-5171	04/11/2023	05/01/2025	27,33%	8,00%	13,31%
	T-5635	01/11/2024	05/10/2025	40,00%	8,00%	30,06%
	T-5557	12/12/2023	07/18/2025	23,33%	8,00%	14,59%
	T-4057	05/21/2015	08/11/2025	63,00%	9,50%	6,12%
	T-4860	12/30/2021	08/20/2025	38,67%	8,00%	10,62%
	T-5252A	04/12/2023	10/04/2025	53,33%	8,00%	21,54%
	T-5252B	05/03/2023	10/04/2025	53,33%	8,00%	22,04%
	T-5172	03/06/2023	10/19/2025	48,00%	8,00%	18,33%
	T-4792	09/10/2021	08/05/2025	50,00%	8,00%	12,80%
	T-7041	05/07/2025	11/13/2025	17,33%	8,00%	33,55%
	T-4412	07/11/2018	12/08/2025	30,00%	9,00%	4,05%
2026	T-5137	07/11/2022	01/30/2026	22,00%	8,00%	6,19%
	T-5254	04/26/2023	01/27/2026	20,00%	8,00%	7,26%
	T-4617	10/16/2020	02/13/2026	20,00%	8,00%	3,75%
	T-5397	08/08/2023	02/27/2026	30,00%	8,00%	11,73%
	T-4503	05/14/2019	03/21/2026	31,05%	8,10%	4,53%
	T-4016	07/23/2014	04/13/2026	59,25%	9,00%	5,05%
	T-5229	05/08/2023	04/03/2026	55,33%	8,00%	19,05%
	T-5710	02/16/2024	06/21/2026	24,67%	8,00%	10,51%
	T-7167	10/16/2025	07/13/2026	22,00%	8,00%	29,65%
	T-5752	03/29/2024	01/28/2026	28,67%	8,00%	15,66%

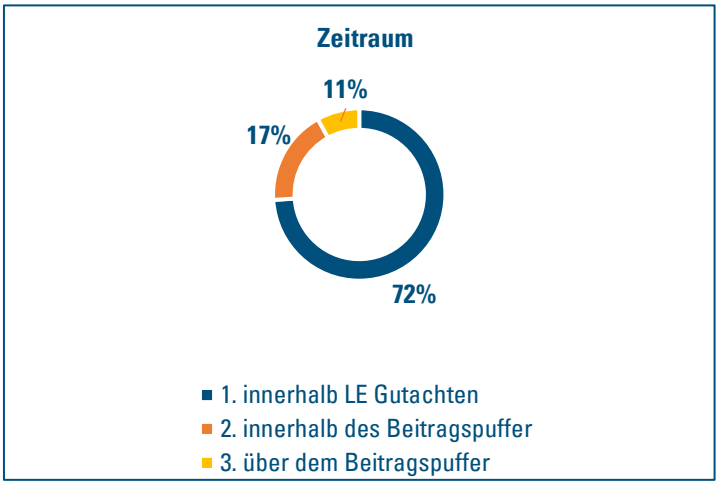
Blau = testierte Zahlen aus dem Audit ALTA CPA Group vom 28. Januar 2026
Schwarz = noch nicht testierte Zahlen

* Anmerkung 1 = Berechnung des „erwarteten Ertrags p.a." (sollte die Fälligkeit am Prognoseende eintreten)
**Anmerkung 2 = Berechnung des „tatsächlichen Ertrags p.a."
Der mathematische „tatsächliche Ertrag p.a." für bereits fällig gewordene Lebensversicherungspolicen wird anhand des kalkulierten Gesamtertrages und der Haltedauer der Police vom Kaufdatum bis zur tatsächlichen Fälligkeit berechnet

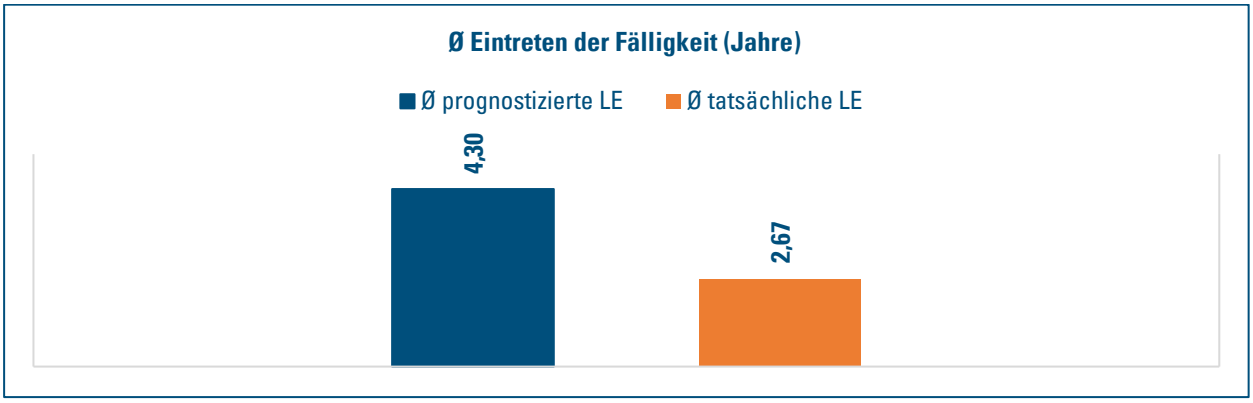
Policenanzahl

Bereits fällig gewordene Policen
96
Frühzeitig fällig gewordene Policen innerhalb der jeweiligen LE Gutachten
69
Fällig gewordene Policen über LE Gutachten innerhalb Beitragspuffer (2 Jahre)
16
Fällig gewordene Policen über dem Beitragspuffer
11

Zeitraum der Fälligkeiten (in Bezug auf LE Gutachten)

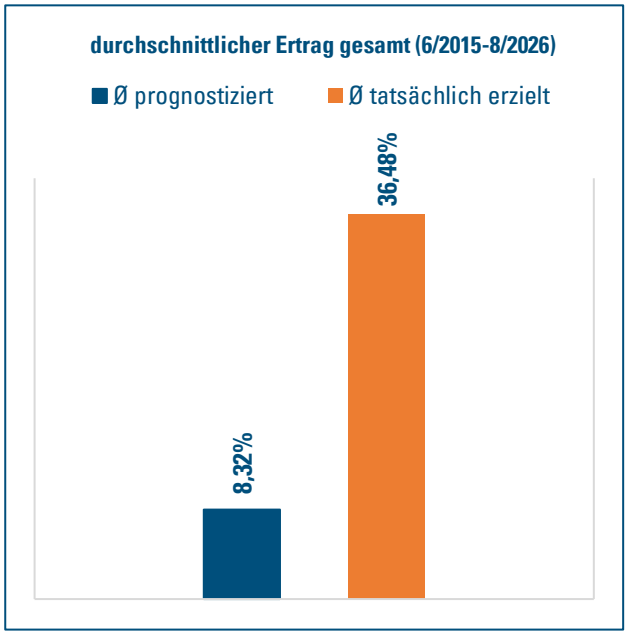


Durchschnittsberechnungen Lebenserwartung (in Bezug auf LE Gutachten)



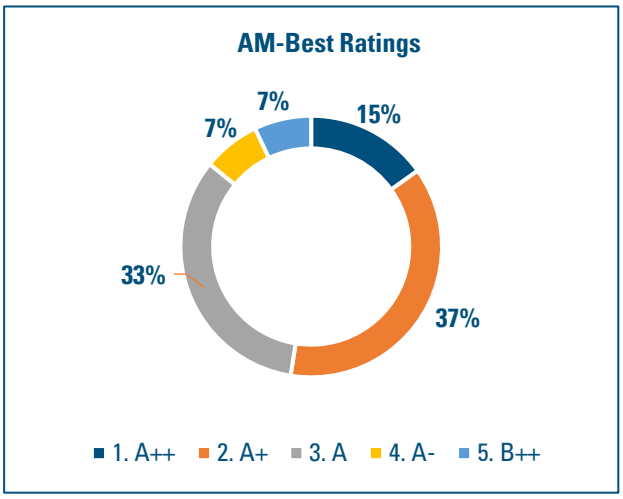
Durchschnittsberechnungen Ertrag (historisch)

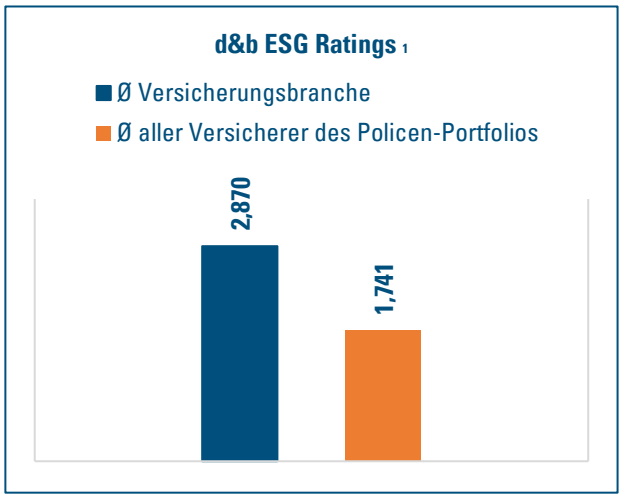
Jahr	Ø prognostiziert (aller in dem Jahr fällig gewordenen Policen)	Ø tatsächlich erzielt (aller in dem Jahr fällig gewordenen Policen)
2015	8,00%	37,26%
2016	8,00%	45,10%
2017	8,00%	21,60%
2018	8,00%	27,76%
2019	8,61%	31,21%
2020	10,33%	24,13%
2021	8,33%	66,70%
2022	8,31%	26,54%
2023	7,96%	50,83%
2024	8,11%	25,17%
2025	8,13%	70,18%
2026	8,11%	11,34%



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 Erträge dar. Grundsätzlich muss jede Police einzeln betrachtet werden.

Ratings der Versicherungsgesellschaften





Top 8 Versicherungsgesellschaften

Versicherer	AM Best Rating	d&b1 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 GROUP

INDEPENDENT ACCOUNTANT'S REPORT

To the Owners of
Fidelity of Georgetown, Inc.
517 Benfield Road, Ste 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, 2025 through December 31, 2025, 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, 2025 through December 31, 2025, 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, 2025 through December 31, 2025 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 have matured in the period from January 1, 2025 and December 31, 2025, 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, 2025 through December 31, 2025 are 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, 2024 are properly calculated in accordance with (or based on) the criteria set forth in Note 1 and provided our opinion on January 14, 2025. In our opinion, the comparative information presented herein for the period ended December 31, 2025, is presented in accordance with the criteria set forth in Note 1, in all material respects.

Alta CPA Group, LLC

Annapolis, MD
January 28, 2026

59 Franklin Street, 2nd Floor
Annapolis, MD 21401

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 Georgtown Inc. Trust (Managed Account) erworben und abgewickelt werden. Stichtag der Betrachtungen ist der 12. August 2026. Die in der Einzelübersicht „blau" kenntlich gemachten Policen, sind testierte Zahlen aus dem Audit ALTA CPA Group vom 28. Januar 2026. Grafische Darstellungen erfolgten zu Durchschnittberechnungen und Statistiken. Die ausgewiesenen Zahlen zur Performance wurden dabei basierend auf dem tatsächlichen Stand, d.h. gemäß den jeweiligen zu Grunde liegenden prognostizierten Gesamterträgen und der tatsächlichen Fälligkeit ermittelt. Die Ertragsergebnisse werden als Nettoergebnisse in USD ausgewiesen. Da möglicherweise weitere Gebühren, Abgaben und Steuern für den Käufer/Investor anfallen, geltend die vorstehenden Angaben nicht als Richtwert für die tatsächlichen Erträge für den Käufer/Investor. Als zusätzliche Gebühren können auf Käufer/Investor 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

© 2026 Fidelity of Georgetown Inc. and/or its affiliates. All rights reserved.