



# RIO BRAVO

## Fundo de Investimento Imobiliário XP Corporate Macaé (XPCMII)

Rentabilidade no exercício de 2015 à 2016

| Mês / Ano | RENTABILIDADE PATRIMONIAL         |                     |                           |                        |                         |                     |                            |                           |  | RENTABILIDADE DE MERCADO |                            |                        |                                |                                |
|-----------|-----------------------------------|---------------------|---------------------------|------------------------|-------------------------|---------------------|----------------------------|---------------------------|--|--------------------------|----------------------------|------------------------|--------------------------------|--------------------------------|
|           | Patrimônio Líquido do Fundo (R\$) | Quantidade de Cotas | Valor Patrimonial da Cota | Rendimentos (R\$/Cota) | Amortizações (R\$/Cota) | Varição Patrimonial | Dividend Yield Patrimonial | Rentabilidade Patrimonial | Rentabilidade Patrimonial Acumulada no Ano | Valor de Mercado da Cota | Varição da Cota de Mercado | Dividend Yield Mercado | Rentabilidade de Mercado Total | Rentabilidade Acumulada no Ano |
| jan/2015  | 211.444.484                       | 2.414.570           | 87,57                     | 0,79                   | 0,00                    | -0,06%              | 0,90%                      | 0,84%                     | 0,84%                                      | 81,00                    | 1,25%                      | 1,04%                  | 2,30%                          | 2,30%                          |
| fev/2015  | 211.505.169                       | 2.414.570           | 87,60                     | 0,79                   | 0,00                    | 0,03%               | 0,90%                      | 0,93%                     | 1,78%                                      | 79,63                    | -1,69%                     | 0,98%                  | -0,72%                         | 1,56%                          |
| mar/2015  | 211.543.515                       | 2.414.570           | 87,61                     | 0,79                   | 0,00                    | 0,02%               | 0,90%                      | 0,92%                     | 2,72%                                      | 73,61                    | -7,56%                     | 1,00%                  | -6,63%                         | -5,18%                         |
| abr/2015  | 199.031.774                       | 2.414.570           | 82,43                     | 0,79                   | 0,00                    | -5,91%              | 0,90%                      | -5,01%                    | -2,43%                                     | 76,90                    | 4,47%                      | 1,08%                  | 5,60%                          | 0,13%                          |
| mai/2015  | 199.137.534                       | 2.414.570           | 82,47                     | 0,79                   | 0,00                    | 0,05%               | 0,96%                      | 1,01%                     | -1,44%                                     | 77,13                    | 0,30%                      | 1,04%                  | 1,34%                          | 1,48%                          |
| jun/2015  | 199.605.526                       | 2.414.570           | 82,67                     | 0,82                   | 0,00                    | 0,24%               | 0,99%                      | 1,23%                     | -0,23%                                     | 79,44                    | 2,99%                      | 1,03%                  | 4,06%                          | 5,60%                          |
| jul/2015  | 199.502.662                       | 2.414.570           | 82,62                     | 0,79                   | 0,00                    | -0,05%              | 0,96%                      | 0,90%                     | 0,67%                                      | 79,80                    | 0,45%                      | 1,04%                  | 1,50%                          | 7,18%                          |
| ago/2015  | 199.688.564                       | 2.414.570           | 82,70                     | 0,79                   | 0,00                    | 0,09%               | 0,96%                      | 1,05%                     | 1,73%                                      | 78,00                    | -2,26%                     | 1,00%                  | -1,28%                         | 5,81%                          |
| set/2015  | 199.198.674                       | 2.414.570           | 82,50                     | 0,82                   | 0,00                    | -0,25%              | 0,99%                      | 0,75%                     | 2,48%                                      | 72,00                    | -7,69%                     | 1,02%                  | -6,75%                         | -1,33%                         |
| out/2015  | 198.761.599                       | 2.414.570           | 82,32                     | 0,82                   | 0,00                    | -0,22%              | 0,99%                      | 0,77%                     | 3,28%                                      | 75,00                    | 4,17%                      | 1,15%                  | 5,37%                          | 3,97%                          |
| nov/2015  | 199.201.544                       | 2.414.570           | 82,50                     | 0,87                   | 0,00                    | 0,22%               | 1,06%                      | 1,28%                     | 4,60%                                      | 76,01                    | 1,35%                      | 1,11%                  | 2,47%                          | 6,53%                          |
| dez/2015  | 199.375.827                       | 2.414.570           | 82,57                     | 0,88                   | 0,00                    | 0,09%               | 1,07%                      | 1,15%                     | 5,81%                                      | 72,60                    | -4,49%                     | 1,16%                  | -3,37%                         | 2,94%                          |
| jan/2016  | 199.549.274                       | 2.414.570           | 82,64                     | 0,88                   | 0,00                    | 0,09%               | 1,07%                      | 1,15%                     | 1,15%                                      | 61,00                    | -15,98%                    | 1,23%                  | -14,95%                        | -14,95%                        |
| fev/2016  | 199.724.142                       | 2.414.570           | 82,72                     | 0,88                   | 0,00                    | 0,09%               | 1,06%                      | 1,15%                     | 2,32%                                      | 58,00                    | -4,92%                     | 1,46%                  | -3,53%                         | -17,95%                        |
| mar/2016  | 199.895.391                       | 2.414.570           | 82,79                     | 0,88                   | 0,00                    | 0,09%               | 1,06%                      | 1,15%                     | 3,49%                                      | 63,85                    | 10,09%                     | 1,54%                  | 11,78%                         | -8,28%                         |
| abr/2016  | 200.059.863                       | 2.414.570           | 82,86                     | 0,88                   | 0,00                    | 0,08%               | 1,06%                      | 1,15%                     | 4,68%                                      | 61,50                    | -3,68%                     | 1,40%                  | -2,33%                         | -10,42%                        |
| mai/2016  | 200.230.473                       | 2.414.570           | 82,93                     | 0,88                   | 0,00                    | 0,09%               | 1,06%                      | 1,15%                     | 5,88%                                      | 61,99                    | 0,80%                      | 1,45%                  | 2,26%                          | -8,40%                         |
| jun/2016  | 200.082.840                       | 2.414.570           | 82,86                     | 0,88                   | 0,00                    | -0,07%              | 1,06%                      | 0,99%                     | 6,93%                                      | 65,50                    | 5,66%                      | 1,44%                  | 7,18%                          | -1,81%                         |
| jul/2016  | 200.243.114                       | 2.414.570           | 82,93                     | 0,75                   | 0,00                    | 0,08%               | 0,91%                      | 0,99%                     | 7,98%                                      | 76,69                    | 17,08%                     | 1,36%                  | 18,68%                         | 16,53%                         |

### Definições

**Varição Patrimonial:** Cota Patrimonial do mês anterior/Cota Patrimonial do mês corrente -1. **Dividend Yield Patrimonial:** Rendimentos anunciados no mês/ Cota Patrimonial do mês anterior. **Rentabilidade Patrimonial:** Variação Patrimonial + Dividend Yield Patrimonial. **Varição da Cota de Mercado:** Fechamento da cota na BM&F Bovespa do último dia útil do mês anterior/ Fechamento da cota na BM&F Bovespa do mês corrente -1. **Dividend Yield Mercado:** [I/ (I- Rendimentos anunciados no mês anterior/ Fechamento da cota na BM&F Bovespa do último dia útil do mês anterior)] -1. **Rentabilidade de Mercado Total:** (1 + Varição da Cota de Mercado) \* (1 + Dividend Yield Mercado)