

BSO PATRIMOINE

	déc-16	déc-17	déc-18	déc-19	déc-20	déc-21	déc-22	déc-23	déc-24	mars-25	juin-25	sept-25	déc-25	janv-26	févr-26	mars-26	avr-26	mai-26
Actif (MC)	165	196	199	200	174	171	148	130	104	91	88	87	86	85	85	81	80	80
Poids des Actions %	21	18	17	19	19	21	23	25	25	25	26	27	27	26	27	26	25	25
N titres	42	42	44	41	30	32	37	38	38	34	35	36	35	35	34	35	28	28
P/E N+1	17,5	19,7	17,0	20,3	29,1	29,8	20,9	21,7	20,8	17,6	20,3	21,0	20,6	19,9	17,6	17,0	17,7	18,0
Rendement %	2,42	2,31	2,75	2,56	1,31	1,41	2,03	2,26	2,61	2,82	2,64	2,71	2,69	2,72	2,81	2,88	2,53	2,53
Obligations convertibles %	23	21	21	24	26	30	33	32	28	30	28	24	23	22	22	22	22	24
Delta moyen	0,34	0,33	0,24	0,27	0,34	0,28	0,28	0,21	0,16	0,14	0,17	0,18	0,21	0,22	0,26	0,22	0,15	0,15
Exposition actions % (Action)	29	25	22	23	25	29	31	32	29	29	31	31	32	31	33	31	28	29
Obligations classiques %	55	57	62	55	54	47	43	43	47	44	41	47	47	49	48	50	50	47
Taux actuariel %	2,21	1,56	2,77	2,02	1,03	0,93	3,93	3,79	3,58	3,29	3,70	3,12	3,19	3,04	2,80	3,36	3,18	3,25
Rating %																		
AAA	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
AA	0	1	1	1	23	15	7	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
A	4	3	3	4	1	1	2	5	11	11	12	12	5	5	7	7	4	3
BBB	16	12	14	16	18	17	14	11	15	23	24	24	23	23	26	30	28	31
BB	21	21	23	16	9	14	22	27	27	27	26	30	29	32	37	37	37	37
B	6	12	14	18	4	3	1	2	4	3	4	4	4	4	2	0	2	1
CCC	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
NR	53	51	45	45	44	50	54	60	44	35	34	30	39	36	28	26	29	28
Maturité %																		
< 1 an	16	12	11	7	12	16	16	20	40	31	27	27	15	13	14	15	15	14
1 à 2 ans	14	10	10	21	18	27	22	46	13	14	12	10	7	8	9	11	21	23
2 à 3 ans	16	11	17	21	31	17	29	9	7	13	25	34	38	36	35	33	30	30
3 à 4 ans	9	17	24	21	18	19	6	7	25	24	13	8	15	15	13	13	9	9
> 4 ans	44	50	38	29	22	21	27	18	15	18	23	21	25	28	29	28	25	23
Sensibilité	3,1	3,4	2,7	2,6	2,3	2,4	2,2	2,0	1,8	1,9	2,1	2,0	2,3	2,4	2,3	2,7	2,1	2,3
N lignes taux	89	103	113	103	91	84	83	77	73	70	64	65	62	62	61	60	62	60
Monétaire %	2	3	0	2	1	2	1,6	0,8	0,5	0,6	4,5	2,0	2,8	1,8	2,3	2,1	3,3	4,0

Document non contractuel. Estimation à partir des données disponibles sur Bloomberg au dernier jour du mois