

Index Report (No.6)

BEI: バイオエネルギー指数
IFIJ: 輸入食料指数

作成基準日: 2011年7月29日 公表日: 2011年8月15日

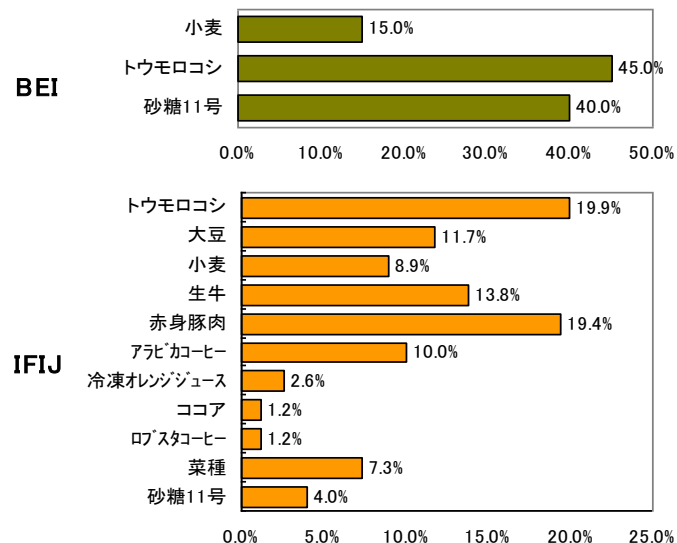
指数構成銘柄の価格

	構成銘柄	作成基準日現在	基準値(2005年平均)
BEI	ICE 砂糖11号	29.92 ^円	9.99 ^円
	CME トウモロコシ	682.25 ^円	208.84 ^円
	CME 小麦	693.25 ^円	318.95 ^円

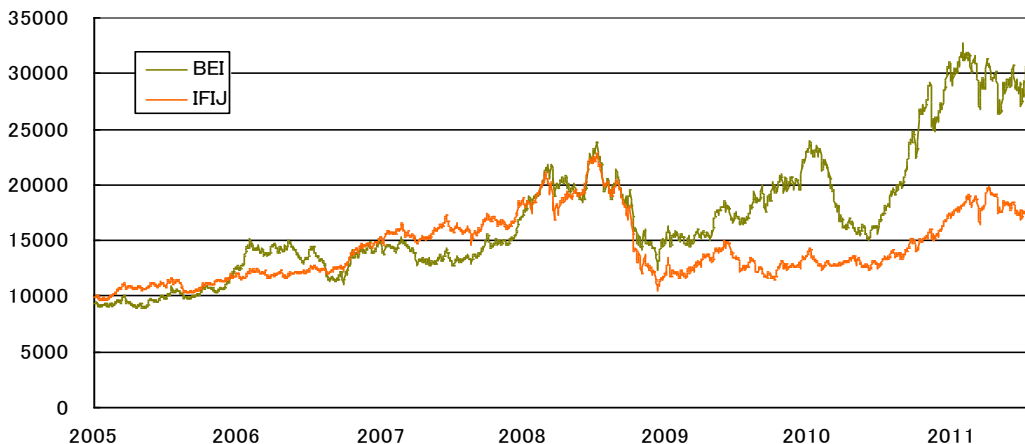
	構成銘柄	作成基準日現在	基準値(2004年12月31日)
IFIJ	CME トウモロコシ	530.51 ^円	209.95 ^円
	CME 大豆	1,063.56 ^円	561.66 ^円
	CME 小麦	539.07 ^円	315.31 ^円
	CME 生牛	86.79 ^円	92.13 ^円
	CME 赤身豚肉	79.68 ^円	78.34 ^円
	ICE アラビカコーヒー	185.57 ^円	106.38 ^円
	ICE 冷凍オレンジジュース	154.66 ^円	88.28 ^円
	NYSE LIFFE ココア	236,529 ^円	165,290 ^円
	NYSE LIFFE ロブスタコーヒー	158,552 ^円	74,854 ^円
	ICE 菜種	45,387 ^円	22,925 ^円
	ICE 砂糖11号	23.26 ^円	9.26 ^円

※ 値は全てCME為替先物価格を以て本所が算出した邦貨換算値

配分比率



BEI, IFIJの推移(単位: point)



参考指標(年初来)

	記録 (算出日)	
BEI	最高値	32,707 (2/3)
	最低値	26,314 (5/9)
	平均値	29,699 -
	標準偏差	1,340 -
	データ数	141 -

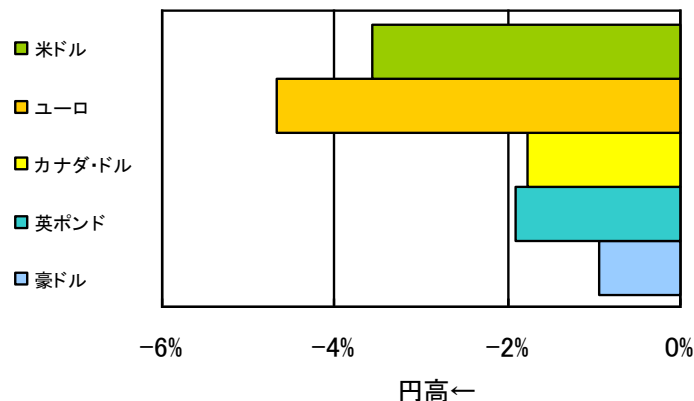
	記録 (算出日)	
IFIJ	最高値	19,788 (4/12)
	最低値	16,490 (3/17)
	平均値	18,117 -
	標準偏差	700 -
	データ数	141 -

Index Report (No.6)

BEI: バイオエネルギー指数
IFIJ: 輸入食料指数

作成基準日: 2011年7月29日 公表日: 2011年8月15日

過去一ヶ月間の為替騰落率(参考)

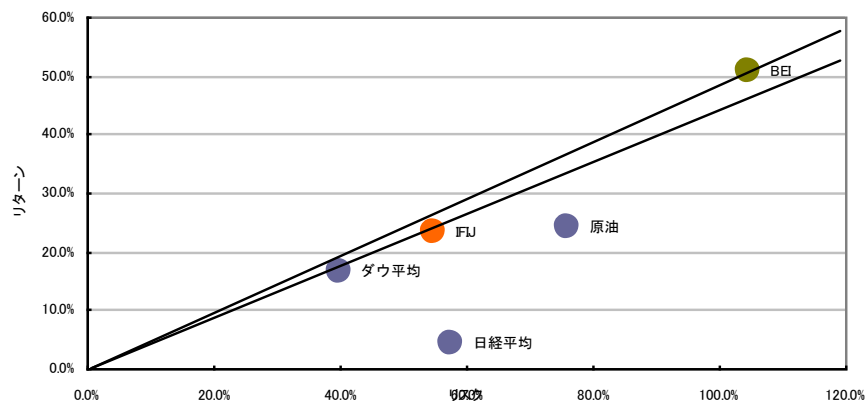


※ 三菱東京UFJ銀行公表の対顧客外国為替相場のTTM(中間値)を使用しています。

騰落率比較

	1ヶ月	3ヶ月	6ヵ月	1年	3年
BEI	2.5%	2.1%	-4.8%	58.0%	45.4%
IFIJ	-3.6%	-10.0%	-4.5%	24.5%	-15.8%
砂糖11号	2.2%	21.9%	-11.8%	53.4%	123.3%
トウモロコシ	-2.3%	-9.3%	5.9%	79.9%	13.4%
小麦	8.1%	-10.8%	-16.0%	10.5%	-12.0%
大豆	2.5%	-0.7%	-2.2%	33.2%	-1.9%
生牛	-0.1%	-4.8%	3.8%	21.5%	14.0%
赤身豚肉	7.6%	4.8%	19.5%	20.8%	29.9%
アラビカ	-8.3%	-19.3%	-2.6%	37.9%	73.5%
オレンジJ	2.2%	15.2%	19.9%	36.0%	84.4%
ココア	-3.8%	-2.8%	-14.0%	-18.5%	24.2%
ロブスタ	-16.4%	-18.8%	-2.9%	17.1%	-16.6%
菜種	-5.1%	-2.2%	-7.1%	21.9%	-8.8%
原油	2.8%	-13.6%	9.1%	24.3%	-23.1%
ダウ平均	-0.2%	-3.6%	3.5%	16.9%	5.7%
日経平均	0.2%	-0.2%	-4.0%	3.1%	-26.5%

リスク・リターン



	リターン	リスク	シャープR
BEI	50.5%	104.9%	0.4817
IFIJ	23.2%	54.8%	0.4241
砂糖11号	55.0%	182.9%	0.3010
トウモロコシ	65.4%	118.8%	0.5502
小麦	17.0%	134.0%	0.1269
大豆	30.3%	58.4%	0.5179
生牛	21.2%	63.0%	0.3366
赤身豚肉	23.1%	101.8%	0.2268
アラビカ	36.0%	96.6%	0.3731
オレンジJ	34.4%	92.0%	0.3741
ココア	-16.0%	104.9%	-0.1521
ロブスタ	20.6%	109.3%	0.1882
菜種	21.1%	57.3%	0.3690
原油	24.2%	76.0%	0.3186
ダウ平均	16.4%	40.1%	0.4078
日経平均	4.3%	57.7%	0.0752

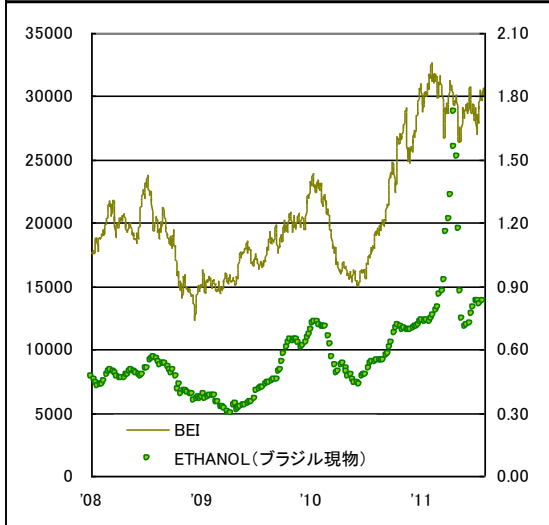
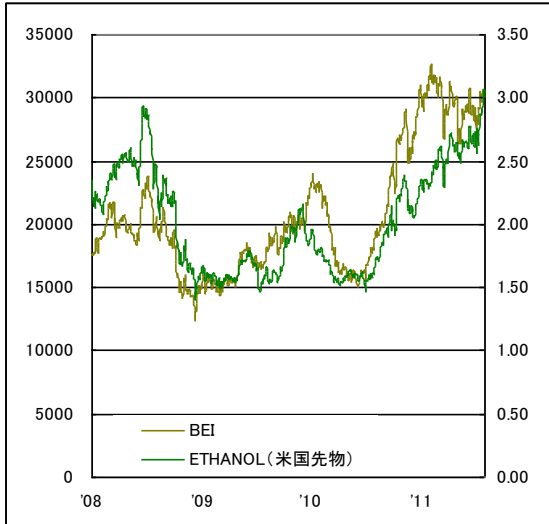
※リスク・リターンは、直近12ヶ月間の月間騰落率より算出しています。
※リスク・リターンは、全て現地通貨建のデータに基づき算出しています。

Index Report (No.6)

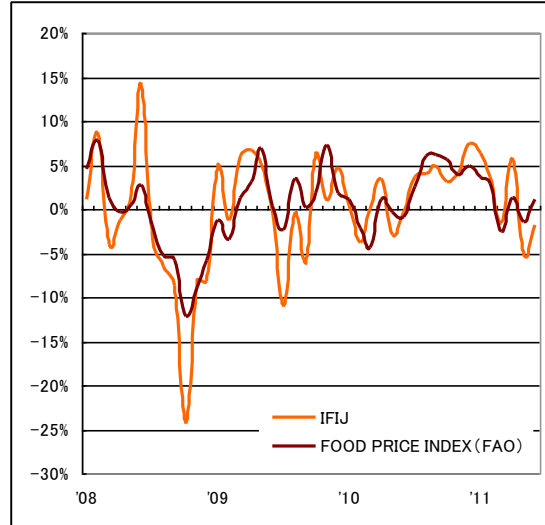
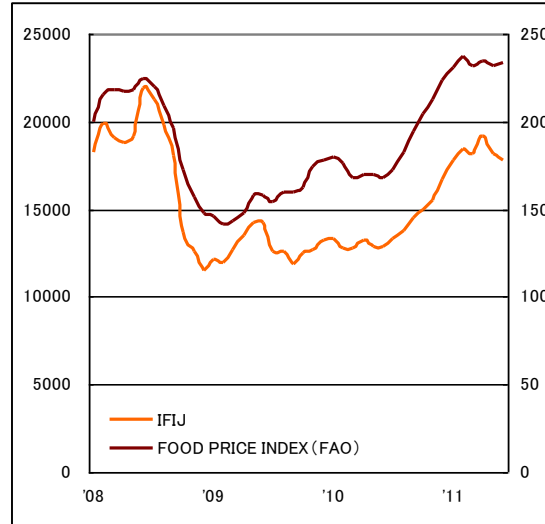
BEI: バイオエネルギー指数
 IFIJ: 輸入食料指数

作成基準日: 2011年7月29日 公表日: 2011年8月15日

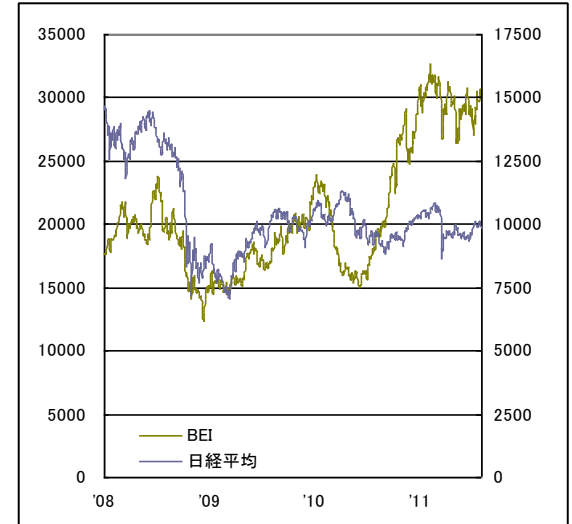
グラフ I : BEIとエタノール価格 (先物・現物)



グラフ II : IFIJとFAO食料価格指数



グラフ III : BEI, IFIJと株価指数



〔単位について〕(1) BEI, IFIJ及びFAO食料価格指数: ポイント。(2) エタノール価格: 米国先物が「ガロンあたりドル」、ブラジル現物は「リットルあたりドル(週値)」。(3) 日経平均: 円

〔グラフ II について〕(1) 上段は、IFIJが月間中央値、FAOの食料価格指数は毎月公表される値の推移。(2) 下段は、月間変動率の推移。