

Index Report (No.10)

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11月30日 公表日: 2011年12月15日

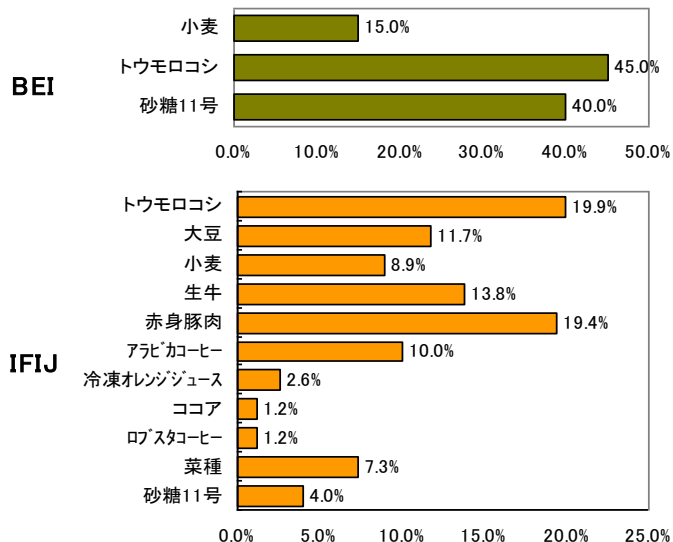
指数構成銘柄の価格

	構成銘柄	作成基準日現在	基準値(2005年平均)
BEI	ICE 砂糖11号	23.49 ^円	9.99 ^円
	CME トウモロコシ	598.00 ^円	208.84 ^円
	CME 小麦	594.50 ^円	318.95 ^円

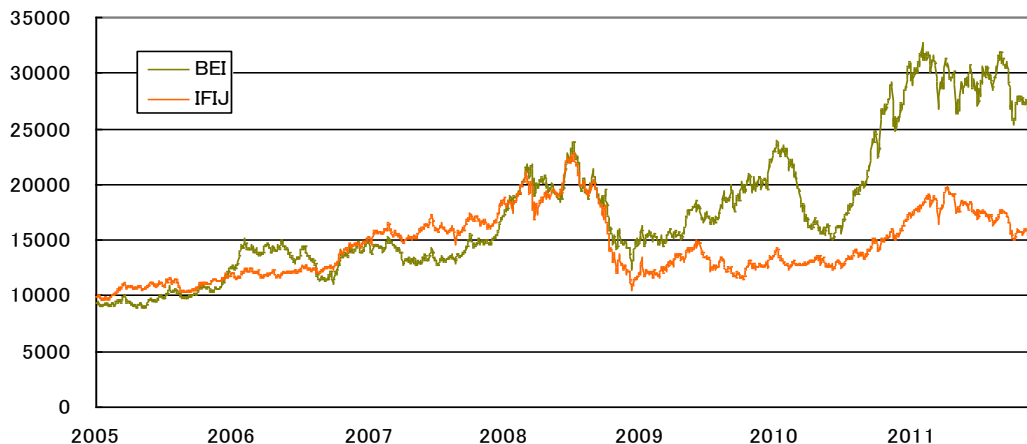
	構成銘柄	作成基準日現在	基準値(2004年12月31日)
IFIJ	CME トウモロコシ	465.78 ^円	209.95 ^円
	CME 大豆	876.26 ^円	561.66 ^円
	CME 小麦	463.05 ^円	315.31 ^円
	CME 生牛	93.91 ^円	92.13 ^円
	CME 赤身豚肉	68.54 ^円	78.34 ^円
	ICE アラビカコーヒー	175.44 ^円	106.38 ^円
	ICE 冷凍オレンジジュース	137.43 ^円	88.28 ^円
	NYSE LIFFE ココア	177,419 ^円	165,290 ^円
	NYSE LIFFE ロースタコーヒー	151,418 ^円	74,854 ^円
	ICE 菜種	38,329 ^円	22,925 ^円
ICE 砂糖11号	18.29 ^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)

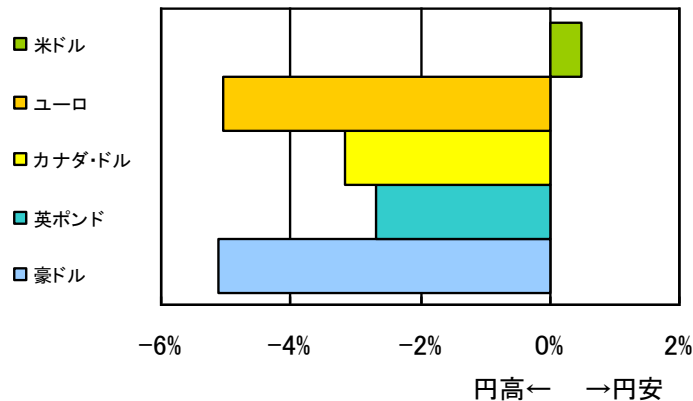
		記録 (算出日)	
BEI	最高値	32,707	(2/3)
	最低値	24,420	(11/28)
	平均値	29,202	—
	標準偏差	1,769	—
	データ数	224	—
		記録 (算出日)	
IFIJ	最高値	19,788	(4/12)
	最低値	14,844	(11/28)
	平均値	17,422	—
	標準偏差	1,195	—
	データ数	224	—

Index Report (No.10)

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11月30日 公表日: 2011年12月15日

過去一ヶ月間の為替騰落率(参考)

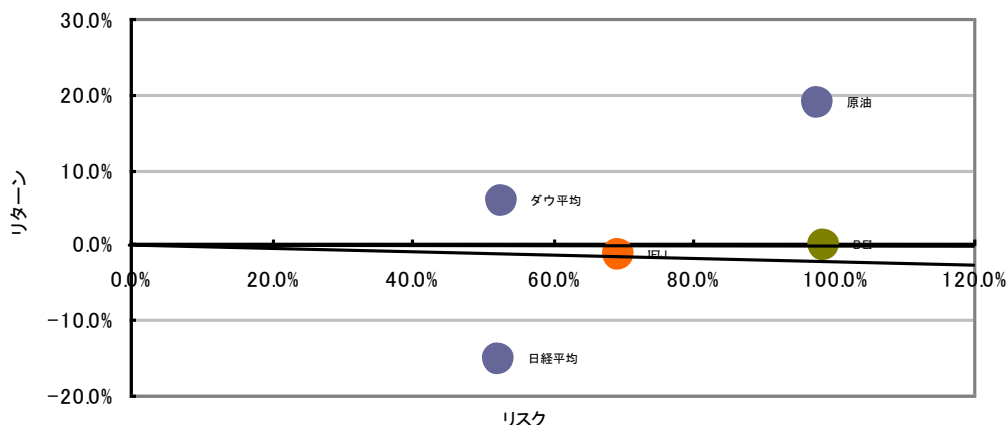


※ 三菱東京UFJ銀行公表の対顧客外国為替相場のTTM(中間値)を使用しています。

騰落率比較

	1ヶ月	3ヶ月	6ヵ月	1年	3年
BEI	-9.2%	-21.2%	-14.7%	-3.8%	74.6%
IFIJ	-3.1%	-15.0%	-17.8%	-3.1%	23.6%
砂糖11号	-10.2%	-20.7%	2.2%	-17.1%	98.9%
トウモロコシ	-8.7%	-21.7%	-21.2%	11.1%	68.9%
小麦	-7.8%	-20.8%	-27.5%	-8.6%	11.0%
大豆	-7.6%	-22.3%	-18.5%	-8.9%	27.0%
生牛	-0.3%	5.5%	15.8%	18.2%	37.9%
赤身豚肉	1.5%	2.7%	-1.0%	25.7%	50.0%
アラビカ	-4.2%	-21.6%	-14.6%	11.3%	97.4%
オレンジJ	-5.3%	5.9%	-4.8%	17.5%	129.5%
ココア	-14.1%	-24.3%	-19.5%	-21.2%	-10.2%
ロブスタ	4.7%	-16.4%	-24.5%	10.3%	11.3%
菜種	-4.2%	-12.5%	-14.2%	-4.6%	26.2%
原油	6.6%	11.9%	-1.1%	16.1%	82.8%
ダウ平均	-5.5%	0.0%	-7.1%	4.6%	32.4%
日経平均	-6.2%	-5.8%	-13.0%	-15.1%	-0.9%

リスク・リターン



	リターン	リスク	シャープR
BEI	-0.2%	98.8%	-0.0021
IFIJ	-1.3%	69.8%	-0.0187
砂糖11号	-10.9%	148.7%	-0.0731
トウモロコシ	16.5%	124.0%	0.1329
小麦	-1.2%	141.2%	-0.0087
大豆	-6.9%	77.5%	-0.0893
生牛	18.3%	61.5%	0.2977
赤身豚肉	27.0%	99.3%	0.2717
アラビカ	18.4%	142.3%	0.1295
オレンジJ	23.1%	135.1%	0.1710
ココア	-18.7%	111.3%	-0.1677
ロブスタ	15.8%	123.3%	0.1280
菜種	-3.5%	56.8%	-0.0620
原油	18.7%	98.2%	0.1901
ダウ平均	5.5%	53.1%	0.1040
日経平均	-15.2%	52.7%	-0.2880

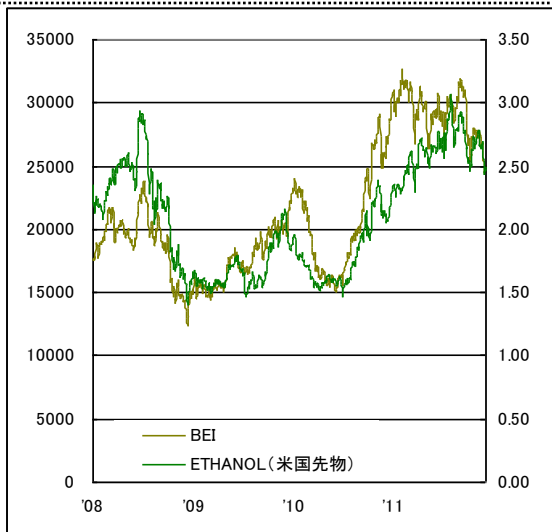
※リスク・リターンは、直近12ヶ月間の月間騰落率より算出しています。
※リスク・リターンは、全て現地通貨建のデータに基づき算出しています。

Index Report (No.10)

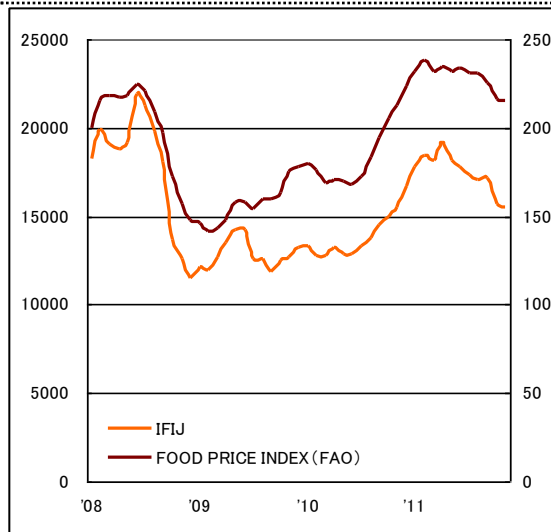
BEI: バイオエネルギー指数
IFIJ: 輸入食料指数

作成基準日: 2011年11月30日 公表日: 2011年12月15日

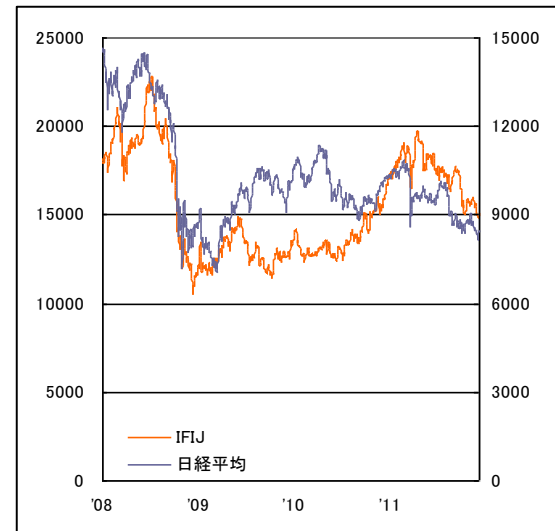
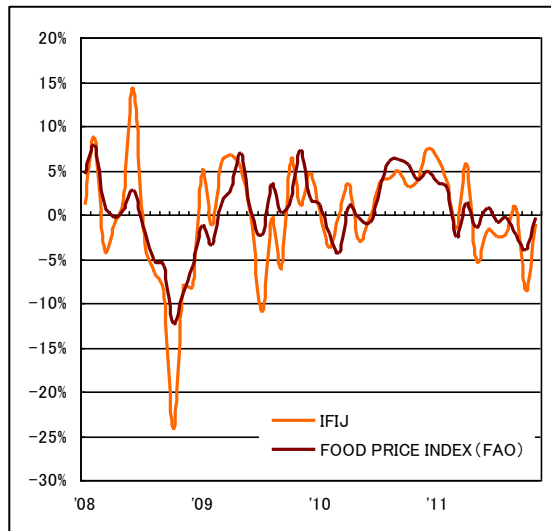
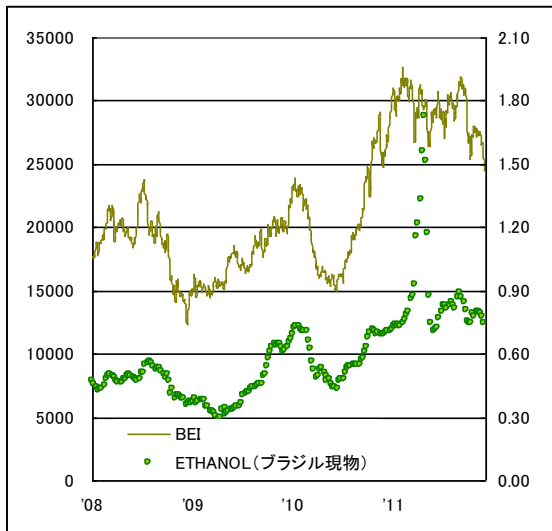
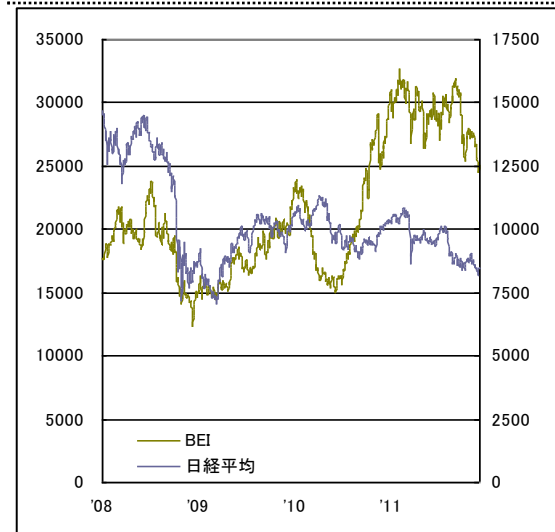
グラフ I : BEIとエタノール価格(先物・現物)



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。