

Index Report (No.11)

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12月30日 公表日: 2012年1月13日

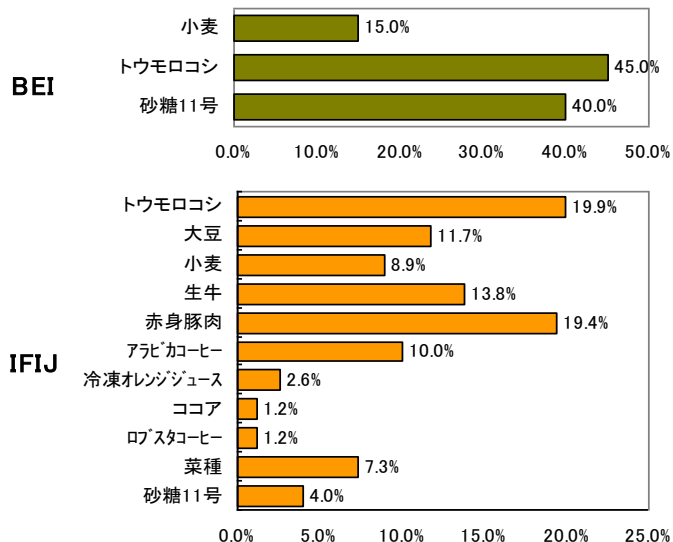
指数構成銘柄の価格

	構成銘柄	作成基準日現在	基準値(2005年平均)
BEI	ICE 砂糖11号	23.51円	9.99円
	CME トウモロコシ	638.00円	208.84円
	CME 小麦	645.25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	494.64円	209.95円
	CME 大豆	920.66円	561.66円
	CME 小麦	500.26円	315.31円
	CME 生牛	95.03円	92.13円
	CME 赤身豚肉	65.10円	78.34円
	ICE アラビカコーヒー	173.86円	106.38円
	ICE 冷凍オレンジジュース	130.94円	88.28円
	NYSE LIFFE ココア	162,657円	165,290円
	NYSE LIFFE ロブスタコーヒー	136,995円	74,854円
	ICE 菜種	39,622円	22,925円
ICE 砂糖11号	18.22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	24,307	(12/16)
	平均値	28,856	—
	標準偏差	2,042	—
	データ数	245	—

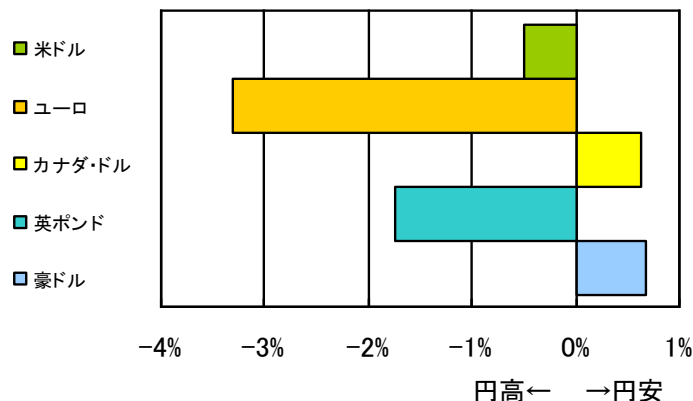
		記録	(算出日)
IFIJ	最高値	19,788	(4/12)
	最低値	14,663	(12/16)
	平均値	17,219	—
	標準偏差	1,323	—
	データ数	245	—

Index Report (No.11)

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12月30日 公表日: 2012年1月13日

過去一ヶ月間の為替騰落率(参考)

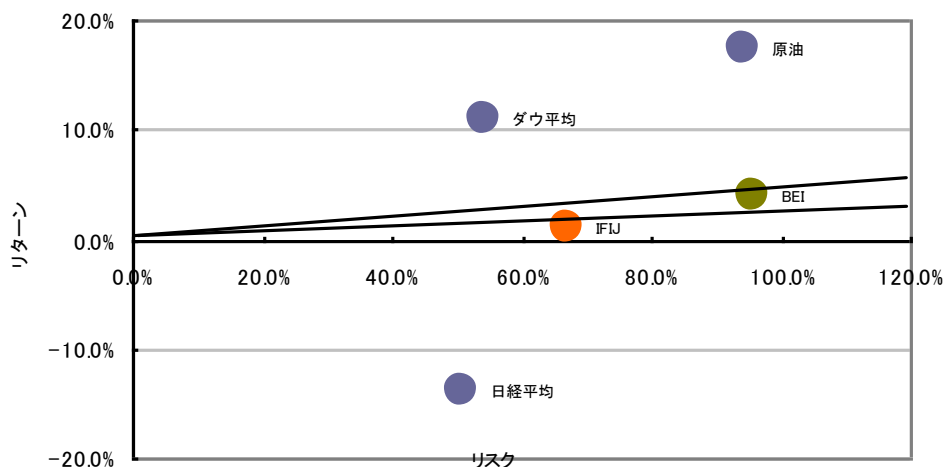


※ 三菱東京UFJ銀行公表の対顧客外国為替相場のTTM(中間値)を使用しています。

騰落率比較

	1ヶ月	3ヶ月	6ヵ月	1年	3年
BEI	4.4%	-3.8%	-10.3%	-15.1%	75.2%
IFIJ	2.4%	-0.9%	-13.0%	-10.6%	29.1%
砂糖11号	0.1%	-12.4%	-19.7%	-30.5%	111.4%
トウモロコシ	6.7%	0.9%	-8.6%	2.2%	62.1%
小麦	8.5%	-1.4%	0.6%	-19.3%	9.0%
大豆	5.6%	-3.5%	-11.0%	-13.1%	26.5%
生牛	1.7%	1.8%	9.7%	15.3%	42.6%
赤身豚肉	-4.6%	-7.1%	-11.8%	5.5%	42.0%
アラビカ	-0.4%	-3.0%	-13.8%	-6.4%	110.3%
オレンジJ	-4.3%	10.9%	-13.3%	-0.9%	145.7%
ココア	-6.6%	-21.8%	-29.5%	-33.6%	-22.9%
ロブスタ	-9.1%	-10.0%	-27.6%	-11.4%	15.3%
菜種	3.1%	-2.4%	-10.6%	-9.4%	30.9%
原油	-0.1%	21.3%	5.1%	9.4%	149.0%
ダウ平均	6.3%	10.2%	0.2%	6.1%	41.7%
日経平均	0.2%	-2.8%	-13.9%	-17.3%	-4.6%

リスク・リターン



※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。

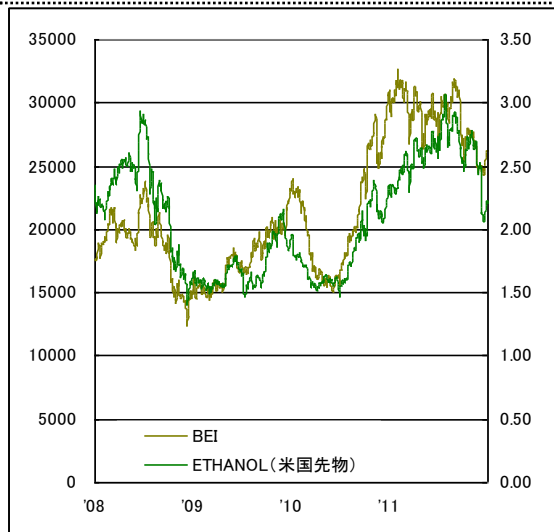
	リターン	リスク	シャープR
BEI	3.9%	95.8%	0.0406
IFIJ	1.1%	67.4%	0.0156
砂糖11号	-10.0%	142.4%	-0.0699
トウモロコシ	21.4%	120.0%	0.1782
小麦	6.8%	138.2%	0.0489
大豆	-1.3%	76.9%	-0.0163
生牛	18.4%	58.9%	0.3130
赤身豚肉	20.7%	97.8%	0.2116
アラビカ	16.6%	136.4%	0.1217
オレンジJ	17.4%	131.0%	0.1326
ココア	-23.3%	107.9%	-0.2160
ロブスタ	6.2%	123.0%	0.0501
菜種	-0.4%	55.5%	-0.0067
原油	17.4%	94.4%	0.1842
ダウ平均	10.9%	54.5%	0.2008
日経平均	-13.8%	50.7%	-0.2718

Index Report (No.11)

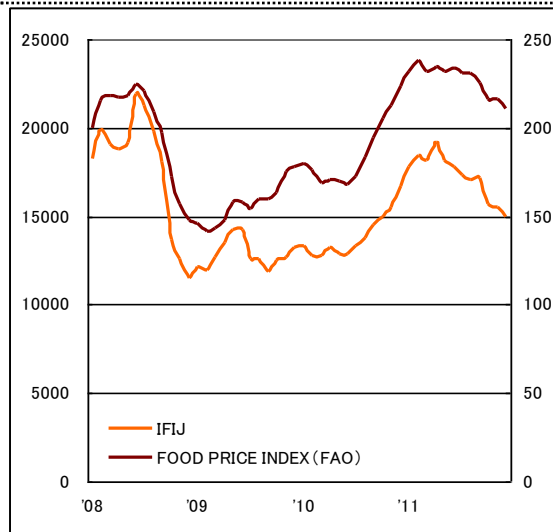
BEI: バイオエネルギー指数
IFIJ: 輸入食料指数

作成基準日: 2011年12月30日 公表日: 2012年1月13日

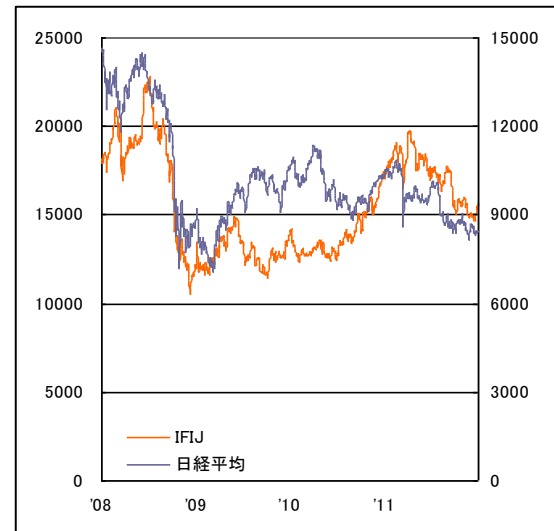
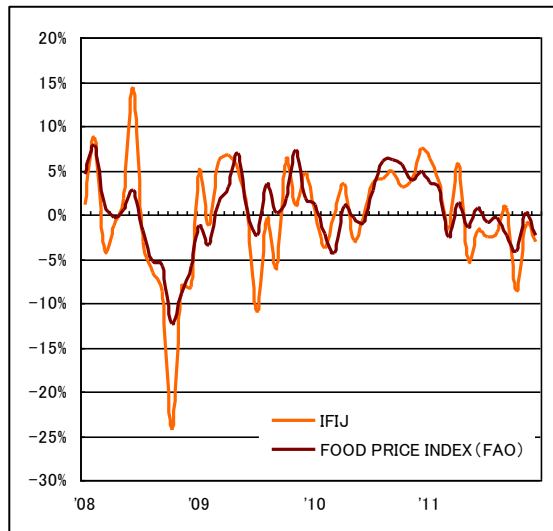
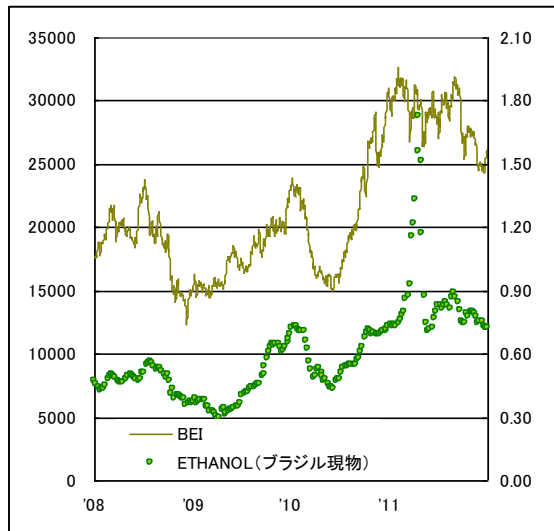
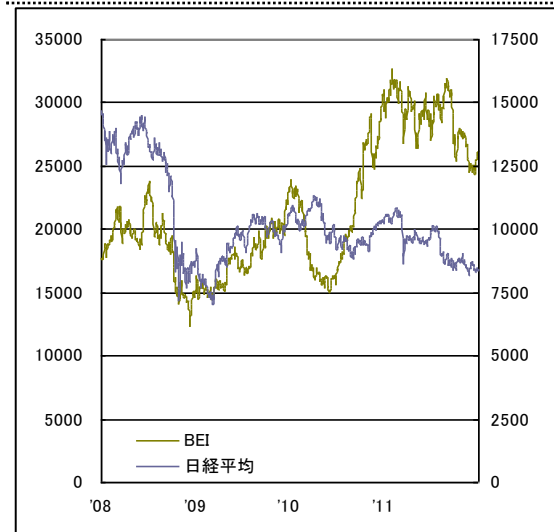
グラフⅠ: BEIとエタノール価格(先物・現物)



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。