

期間騰落率

	BEI	Suger	Corn	Wheat	C.Oil	DJI	N225
直近1ヶ月	8.94%	13.22%	9.62%	0.82%	-4.44%	-6.86%	-11.21%
直近3ヶ月	26.23%	23.34%	34.64%	13.33%	2.16%	-9.79%	-18.79%
直近6ヶ月	40.99%	23.95%	54.10%	44.71%	20.17%	-6.85%	-21.20%
直近1年	30.91%	17.73%	23.16%	100.76%	62.07%	-0.64%	-21.81%
直近3年	103.50%	35.74%	154.66%	218.10%	95.70%	19.33%	19.36%

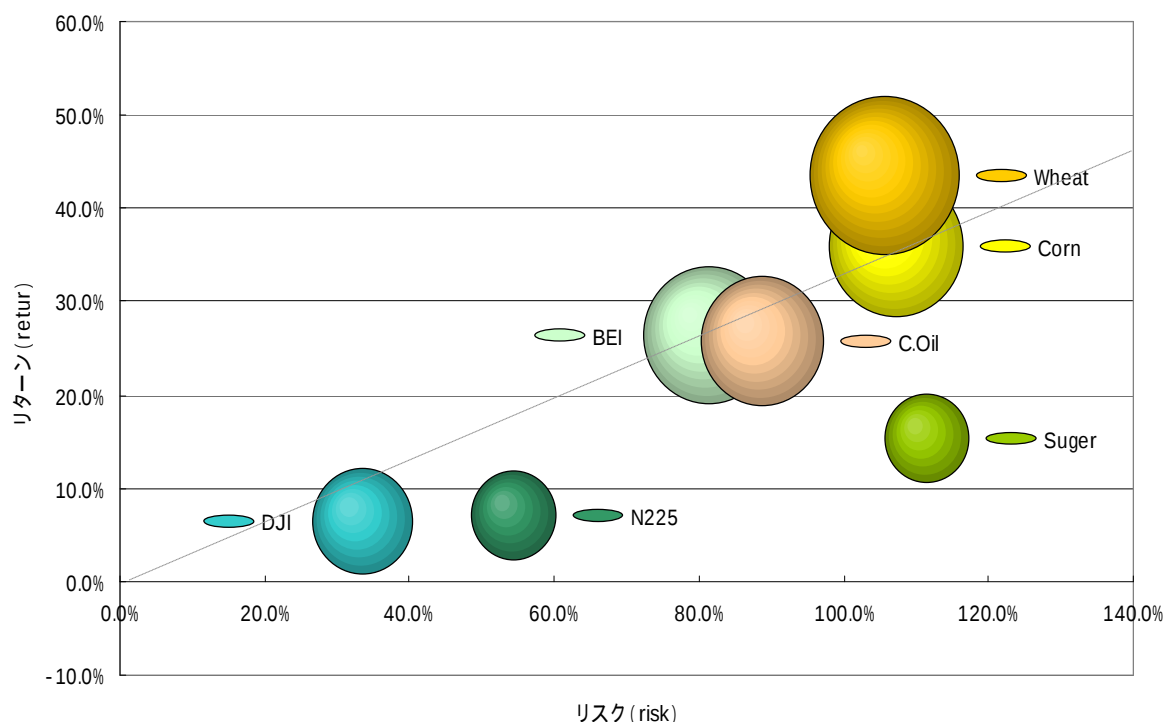
2008/01/31から一定期間遡った騰落率。

リスク・リターン分析 (年率換算)

	BEI	Suger	Corn	Wheat	C.Oil	DJI	N225
リターン	26.52%	15.26%	36.04%	43.50%	25.73%	6.36%	7.12%
リスク	81.34%	111.56%	107.29%	105.56%	88.75%	33.68%	54.32%
シャープR	0.3260	0.1368	0.3359	0.4121	0.2899	0.1890	0.1310

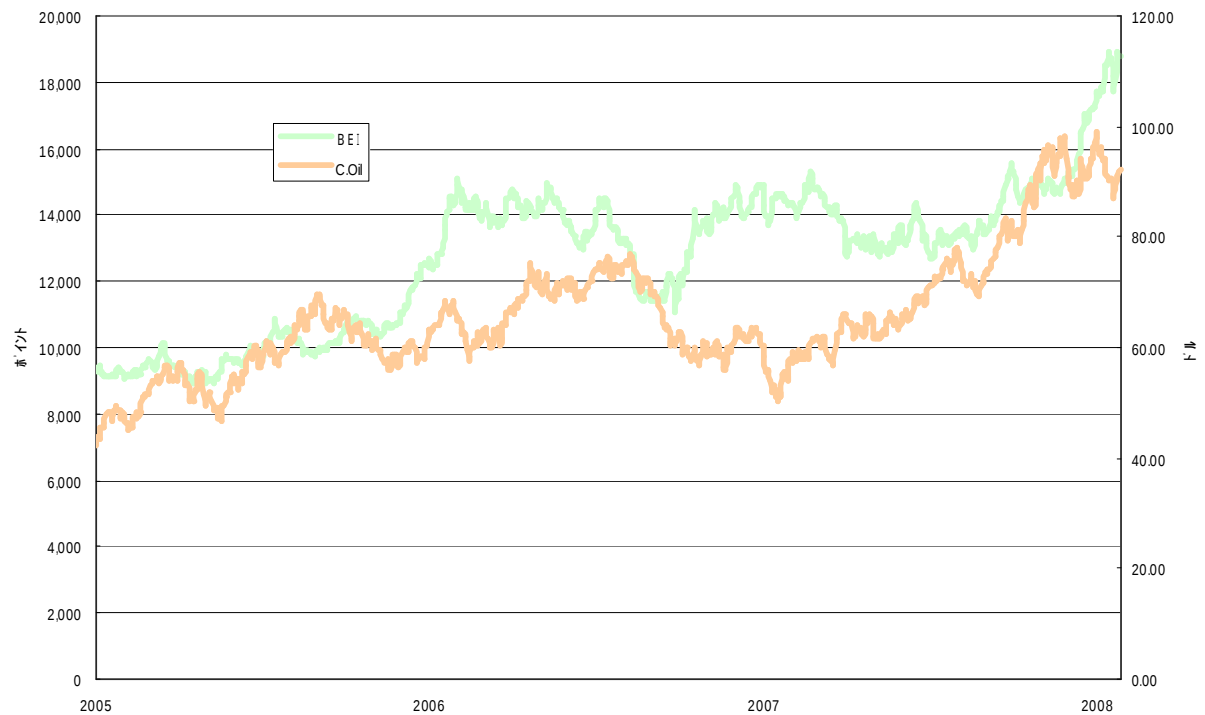
上表は、2005/02～2008/01の月間騰落率データ(36か月分)を基に算出したもので、月間騰落率の年率換算を「リターン」、リターンのばらつき度合いを「リスク」とし、リターンをリスクで除したものを「シャープR(レシオ)」としてまとめている。

リスク・リターンの分布

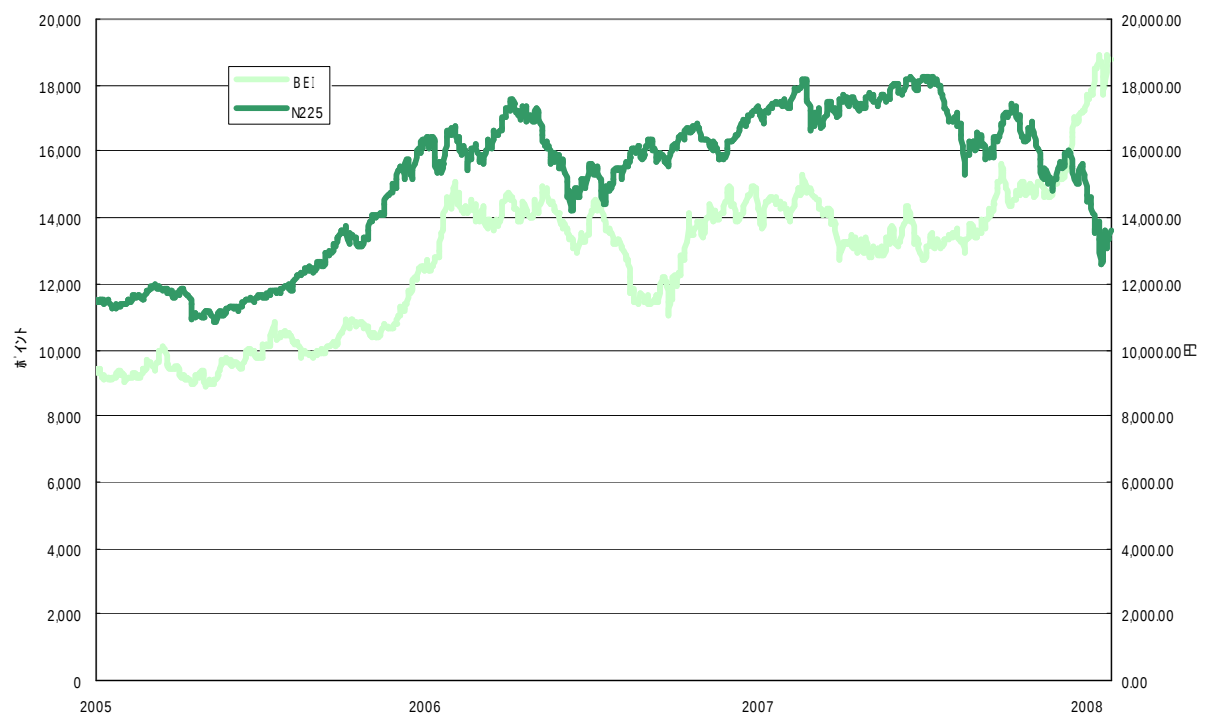


上グラフは、「リスク・リターン分析(年率換算)」のデータをグラフ化したもので、X 軸をリスク、Y 軸をリターンとしている。円の大きさは、シャープレシオの大小を表わしており、この値が大きいほど、効率よくリターンが上げられることを示す。

BEI、C.Oil



BEI、N225



< 各データについて >

BEI: バイオエネルギー指数、Sugar: 砂糖11号(ICE)、Corn: トウモロコシ(CBOT)、Wheat: 小麦(CBOT)

C.Oil: 原油(NYMEX)、DJI: NY ダウ、N225: 日経 225 株価指数