

期間騰落率

	BEI	Suger	Corn	Wheat	C.Oil	DJI	N225
直近1ヶ月	14.69%	13.37%	8.98%	26.72%	11.11%	1.12%	0.08%
直近3ヶ月	41.80%	43.82%	41.66%	34.52%	12.72%	-5.48%	-13.25%
直近6ヶ月	58.55%	47.59%	68.32%	51.82%	39.84%	-4.96%	-17.90%
直近1年	45.96%	22.97%	32.18%	148.59%	66.92%	3.00%	-22.73%
直近3年	126.64%	62.96%	156.86%	261.64%	99.24%	16.05%	15.86%

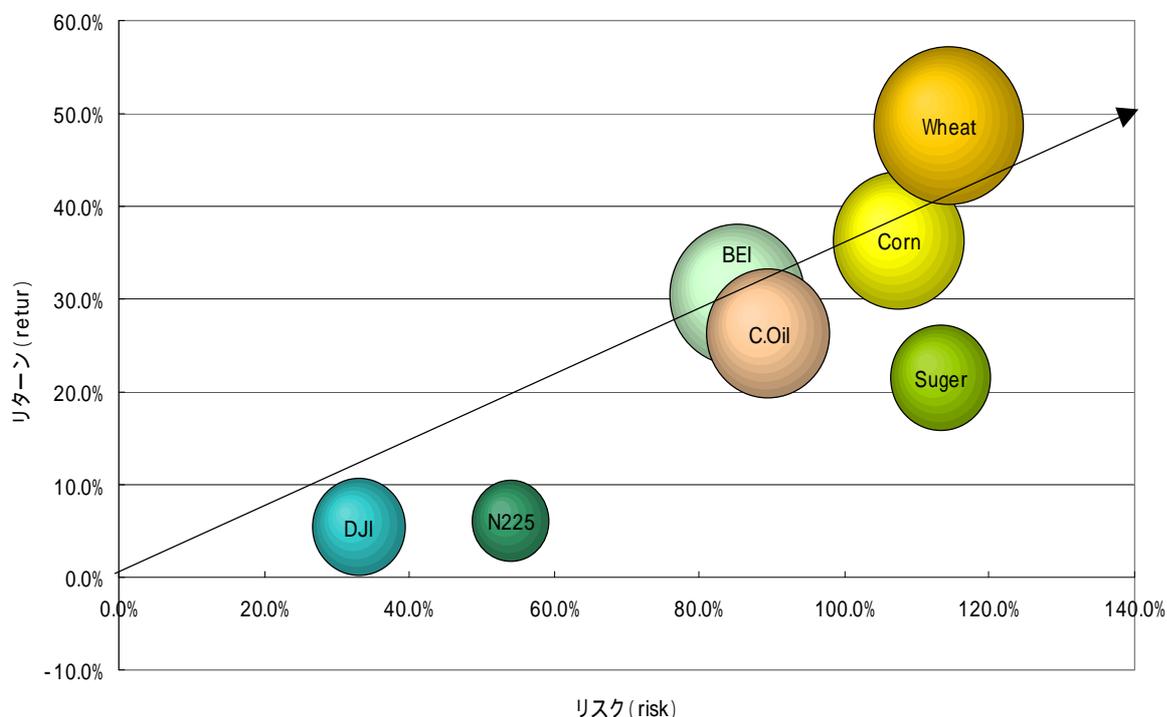
2008/02/29から一定期間遡った騰落率。

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	30.42%	21.58%	36.35%	48.59%	26.39%	5.41%	6.11%
リスク	85.09%	113.20%	107.49%	114.27%	89.48%	32.95%	54.08%
シャープR	0.3575	0.1906	0.3382	0.4252	0.2949	0.1643	0.1130

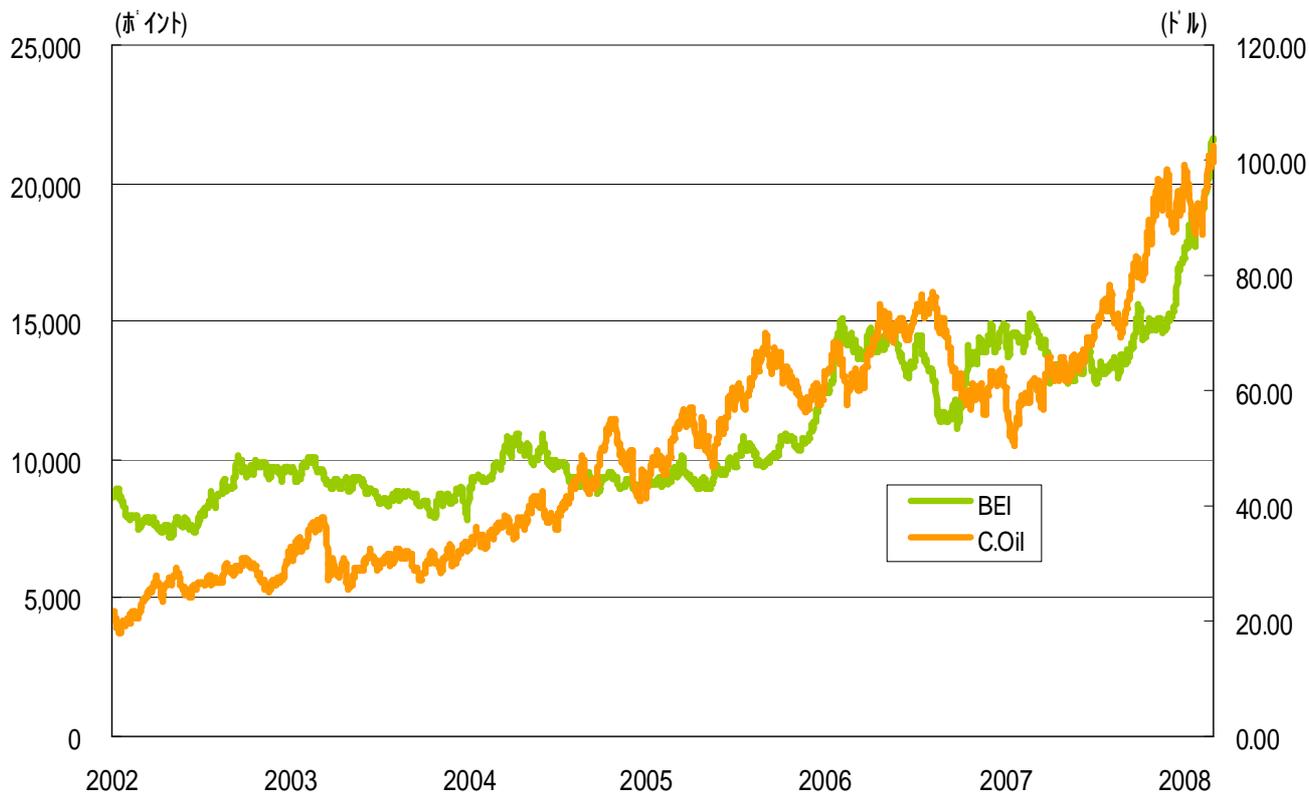
上表は、2005/02～2008/01の月間騰落率データ(36か月分)を基に算出したもので、月間騰落率の年率換算を「リターン」、リターンのばらつき度合いを「リスク」とし、リターンをリスクで除したものを「シャープR(レシオ)」としてまとめている。

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とC.Oil (NYMEX原油) 価格推移



価格相関 (2002年1月 ~ 2008年2月)

	BEI	Suger	Corn	Wheat	C.Oil	DJI	N225
BEI	1.00000						
Suger	0.72155	1.00000					
Corn	0.77989	0.14954	1.00000				
Wheat	0.78890	0.22786	0.84294	1.00000			
C.Oil	0.86364	0.71631	0.54882	0.70136	1.00000		
DJI	0.75492	0.44585	0.65797	0.69369	0.80308	1.00000	
N225	0.77725	0.68607	0.51261	0.49115	0.78289	0.88961	1.00000

変動率相関 (2002年1月 ~ 2008年2月)

	BEI	Suger	Corn	Wheat	C.Oil	DJI	N225
BEI	1.00000						
Suger	0.24776	1.00000					
Corn	0.69043	0.00800	1.00000				
Wheat	0.55763	-0.02759	0.54042	1.00000			
C.Oil	0.14985	0.06820	0.12436	0.08437	1.00000		
DJI	-0.00525	0.00958	0.03959	0.01997	-0.04682	1.00000	
N225	0.03563	-0.01066	0.01519	0.02379	-0.01629	0.41439	1.00000

<各データについて>

BEI: バイオエネルギー指数、Suger: 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