

期間騰落率

	BEI	Suger	Corn	Wheat	C.Oil	DJI	N225
直近1ヶ月	-8.04%	-16.69%	3.18%	-15.40%	2.95%	-2.91%	-7.92%
直近3ヶ月	14.90%	6.93%	23.25%	8.09%	9.31%	-8.56%	-18.18%
直近6ヶ月	27.00%	19.45%	44.93%	6.00%	27.44%	-12.19%	-25.38%
直近1年	43.36%	19.09%	42.08%	114.53%	59.96%	-1.07%	-27.55%
直近3年	110.71%	37.19%	163.76%	196.55%	95.63%	15.89%	7.34%

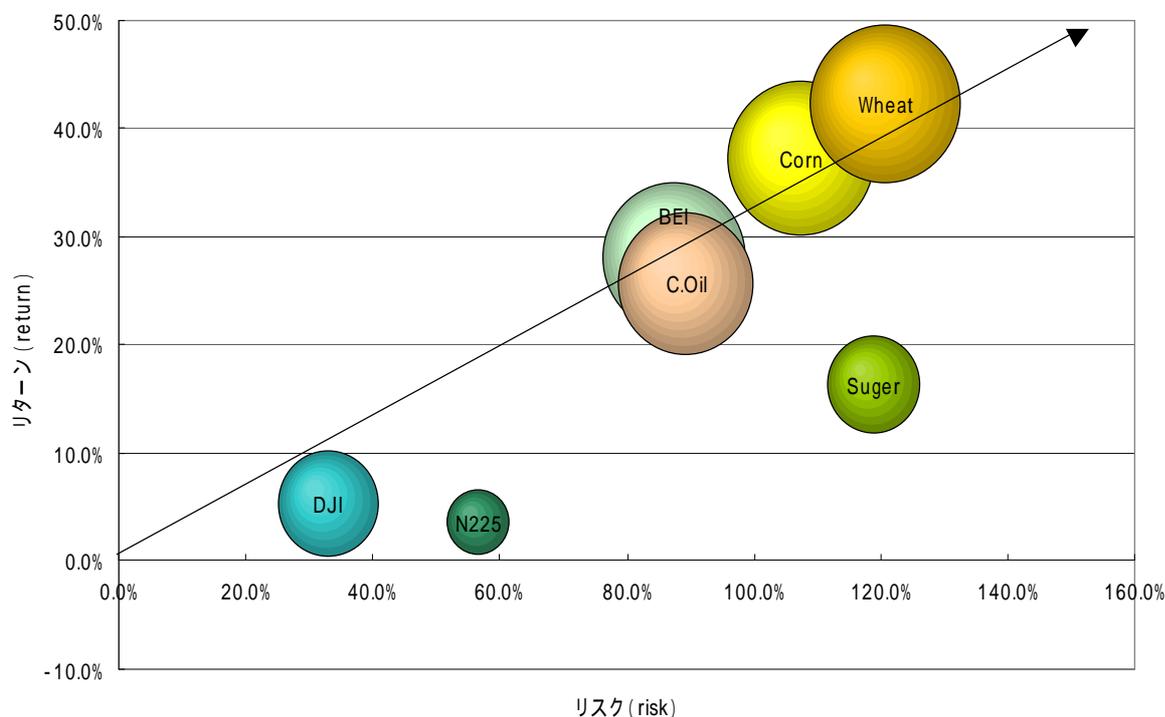
2008/03/31から一定期間遡った騰落率。

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	28.10%	16.36%	37.25%	42.40%	25.75%	5.37%	3.67%
リスク	87.41%	118.99%	107.36%	120.71%	89.33%	33.01%	56.62%
シャープR	0.3215	0.1375	0.3470	0.3513	0.2883	0.1626	0.0649

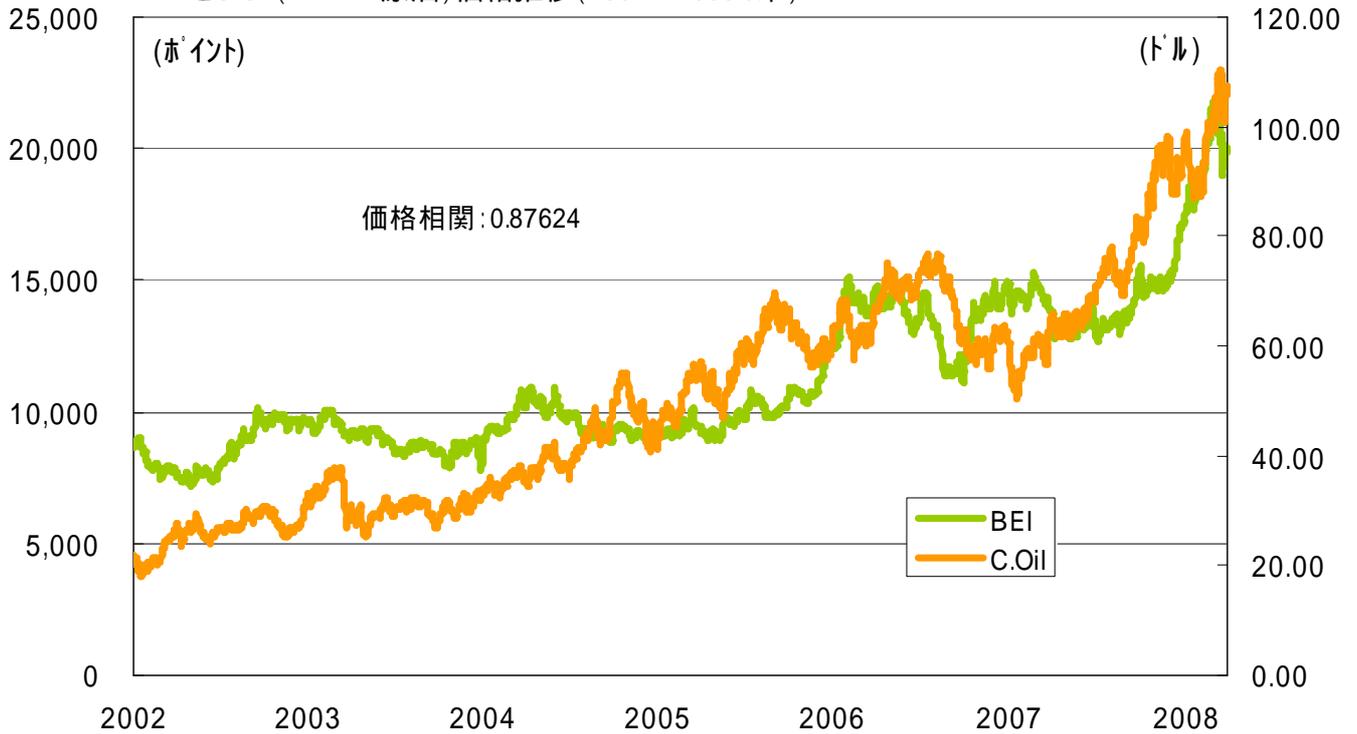
上表は、2005/04～2008/03の月間騰落率データ(36か月分)を基に算出したもので、月間騰落率の年率換算を「リターン」、リターンのばらつき度合いを「リスク」とし、リターンをリスクで除したものを「シャープR(レシオ)」としてまとめている。

リスク・リターンの分布

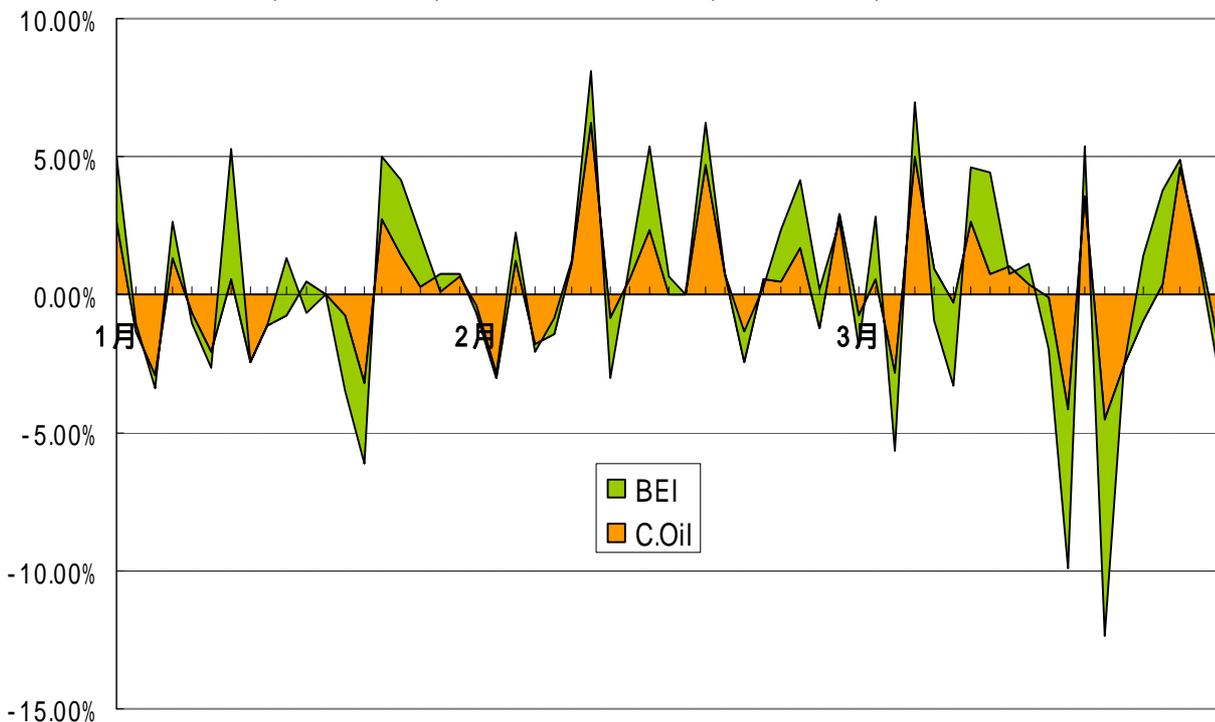


上グラフは、「リスク・リターン分析(年率換算)」のデータをグラフ化したもので、X 軸をリスク、Y 軸をリターンとしている。円の大きさは、シャープレシオの大小を表わしており、この値が大きいほど、効率よくリターンが上げられることを示す。

BEIとC.Oil(NYMEX原油) 価格推移 (2002 ~ 2008.3末)



BEIとC.Oil(NYMEX原油) 一日当たりの騰落率 (2008.1 ~ 3末)



<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