

期間騰落率

	BEI	Suger	Corn	Wheat	C.Oil	DJI	N225
直近1ヶ月	-2.44%	-13.38%	5.49%	-19.72%	9.48%	5.04%	10.57%
直近3ヶ月	2.90%	-18.20%	18.61%	-13.93%	25.24%	3.13%	1.89%
直近6ヶ月	29.89%	0.89%	59.69%	-2.46%	27.94%	-6.96%	-17.25%
直近1年	45.64%	5.72%	62.10%	56.61%	77.73%	-2.09%	-20.40%
直近3年	108.02%	18.41%	183.91%	148.51%	124.05%	25.82%	25.81%

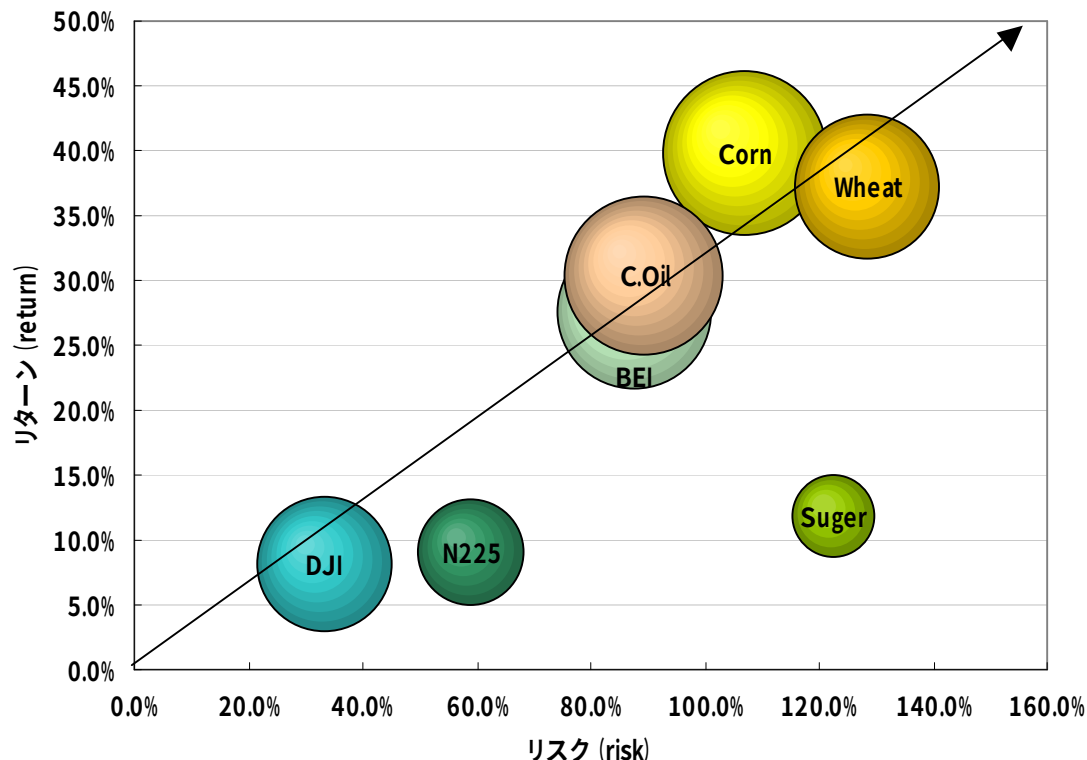
※2008/04/30から一定期間遡った騰落率。

リスク・リターン分析(年率換算)

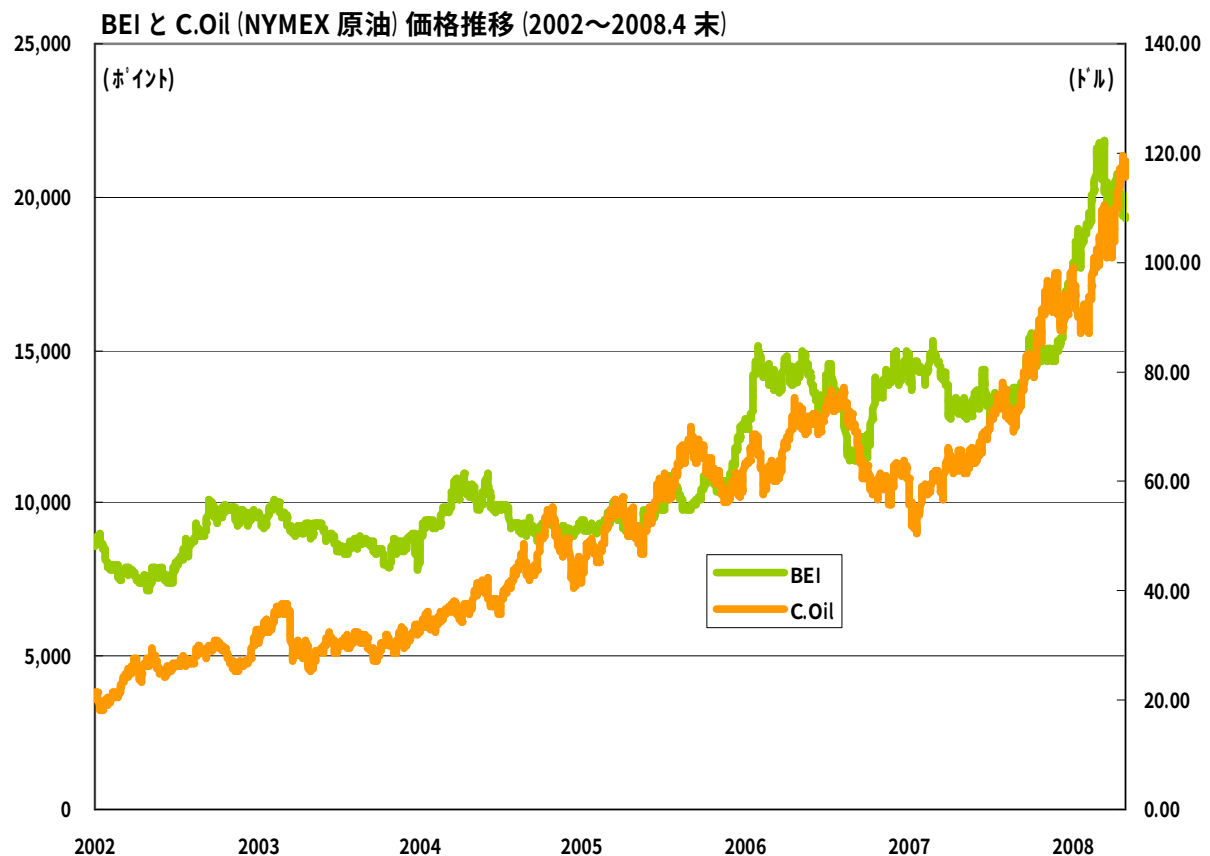
	BEI	Suger	Corn	Wheat	C.Oil	DJI	N225
リターン	27.68%	11.78%	39.75%	37.23%	30.38%	8.13%	9.08%
リスク	87.65%	122.59%	106.94%	128.53%	89.45%	33.35%	58.85%
シャープR	0.3158	0.0961	0.3717	0.2896	0.3396	0.2438	0.1544

※上表は、2005/05～2008/04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R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。



価格相関

	BEI	Suger	Corn	Wheat	C.Oil	DJI	N225
BEI							
Suger	0.36604						
Corn	0.86803	-0.11627					
Wheat	0.83259	-0.09165	0.86188				
C.Oil	0.82620	0.17989	0.72597	0.85303			
DJI	0.59853	-0.22639	0.73268	0.72420	0.52258		
N225	0.35060	0.28916	0.25758	0.14782	0.10478	0.65388	

変動率相関

	BEI	Suger	Corn	Wheat	C.Oil	DJI	N225
BEI							
Suger	0.69022						
Corn	0.71751	0.15384					
Wheat	0.59952	0.12465	0.55215				
C.Oil	0.25732	0.17305	0.19666	0.12854			
DJI	0.05942	0.00917	0.06551	0.06480	-0.01980		
N225	0.09376	0.08021	0.04068	0.03439	0.03576	0.46939	

※上表の各相関は、2005年5月～2008年4月までの価格データに基づくものである。

<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