

BEIの推移



期間騰落率

	BEI	Sugar	Corn	Wheat	OIL	DJ	N225
直近1ヶ月	-3.1%	-1.3%	-5.2%	0.2%	-8.8%	1.1%	-2.3%
直近3ヶ月	8.7%	32.7%	-2.1%	6.1%	-8.7%	-7.4%	-8.8%
直近6ヶ月	-7.4%	-6.0%	4.9%	-32.5%	12.7%	-6.9%	-3.9%
直近1年	46.8%	38.7%	76.6%	2.5%	57.6%	-11.5%	-21.1%
直近2年	74.6%	14.8%	149.5%	98.5%	65.1%	2.9%	-19.0%
直近3年	101.0%	30.7%	180.1%	156.8%	65.6%	12.5%	5.3%

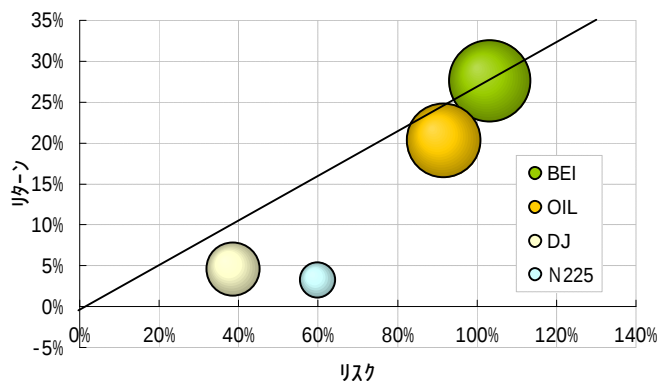
上表は、2008/8/29から一定期間遡った騰落率です。

リスク・リターン

	BEI	Sugar	Corn	Wheat	OIL	DJ	N225
リターン	27.6%	15.7%	40.7%	39.1%	20.3%	4.6%	3.2%
リスク	103.2%	129.1%	122.8%	136.0%	91.7%	38.7%	60.0%
シャープレシオ	0.2674	0.1217	0.3310	0.2877	0.2214	0.1177	0.0531

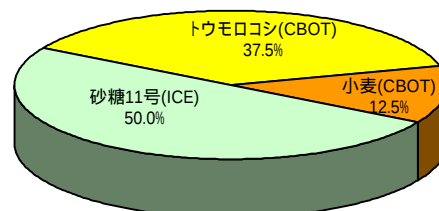
上表のリスク・リターン(年率換算)は、2005/9～2008/8の月間騰落率を基に算出しています。

リスク・リターンの分布



上グラフは、「リスク・リターン」をグラフ化したものであり、x軸はリスク、y軸はリターン、円の大きさはシャープレシオの大小を表わしています。

BEIの配分比率



価格相関

	BEI	Sugar	Corn	Wheat	OIL	DJ	N225
BEI	1.0000						
Sugar	0.3286	1.0000					
Corn	0.9163	-0.0483	1.0000				
Wheat	0.8412	-0.0574	0.8394	1.0000			
OIL	0.8824	0.1547	0.8606	0.7935	1.0000		
DJ	0.4758	-0.2399	0.5475	0.6681	0.3520	1.0000	
N225	0.1503	0.2542	0.0553	0.0575	-0.0827	0.6331	1.0000

騰落率相関

	BEI	Sugar	Corn	Wheat	OIL	DJ	N225
BEI	1.0000						
Sugar	0.6688	1.0000					
Corn	0.7454	0.1699	1.0000				
Wheat	0.6280	0.1549	0.5696	1.0000			
OIL	0.2872	0.1846	0.2220	0.1698	1.0000		
DJ	0.0017	-0.0135	0.0152	0.0278	-0.0889	1.0000	
N225	0.0501	0.0457	0.0124	0.0105	0.0008	0.4821	1.0000

上表の相関(価格・騰落率)は、日々の価格データを基に算出しています。
期間:2005/1～2008/8末

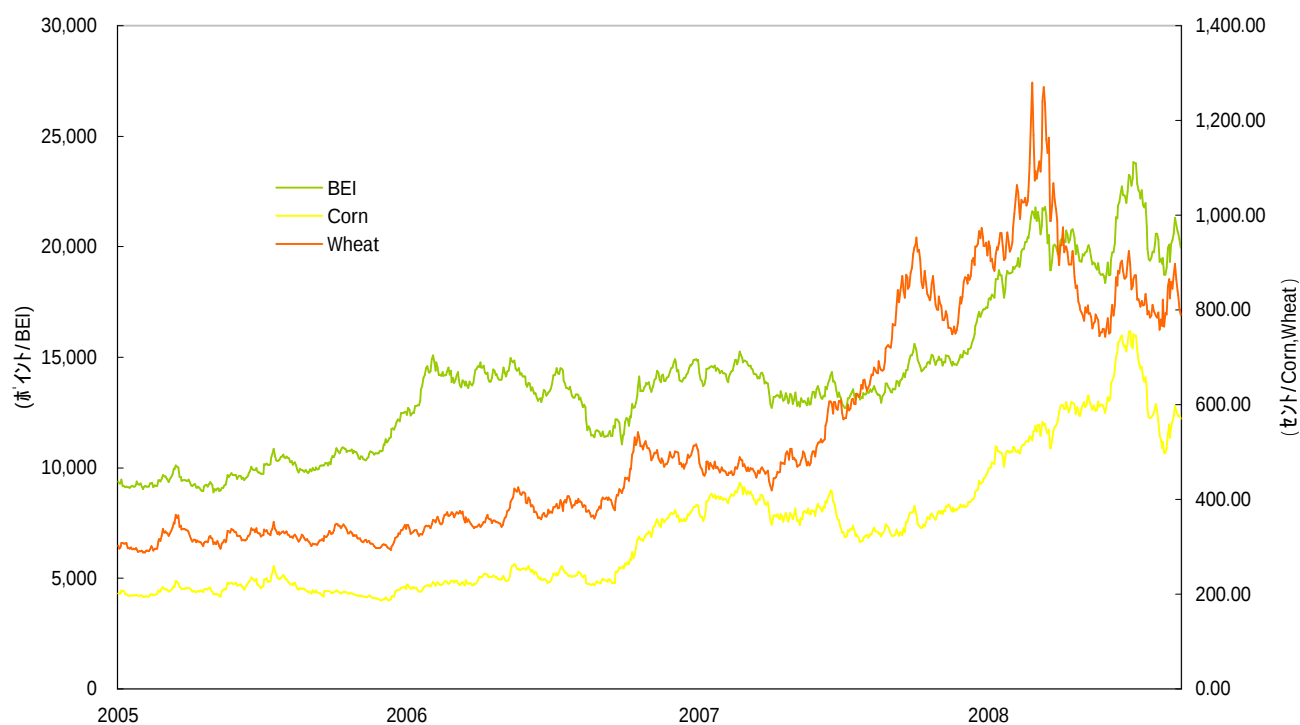
【データ(表・グラフ)の略称表記について】

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)、OIL: 原油(NYMEX)、DJ: ダウ平均、N225: 日経平均

BEI, Sugarの推移



BEI, Corn, Wheatの推移



【データについて】

BEIは、本所が算出・公表する指数値。Sugar、Corn及びWheatは、海外先物期近価格である。