

BEIの推移(2002/01~2008/10末)



期間騰落率

	BEI	Sugar	Corn	Wheat	OIL	DJ	N225
直近1ヶ月	-16.9%	-5.9%	-20.2%	-19.5%	-31.6%	-11.4%	-23.8%
直近3ヶ月	-25.3%	-11.6%	-31.9%	-31.7%	-48.0%	-20.7%	-35.9%
直近6ヶ月	-20.4%	16.6%	-30.7%	-32.2%	-43.0%	-28.5%	-38.1%
直近1年	3.4%	17.7%	10.6%	-33.9%	-27.0%	-33.4%	-48.8%
直近2年	13.1%	3.5%	24.3%	7.4%	13.0%	-24.0%	-47.7%
直近3年	45.3%	2.1%	107.9%	69.3%	7.7%	-11.7%	-37.0%

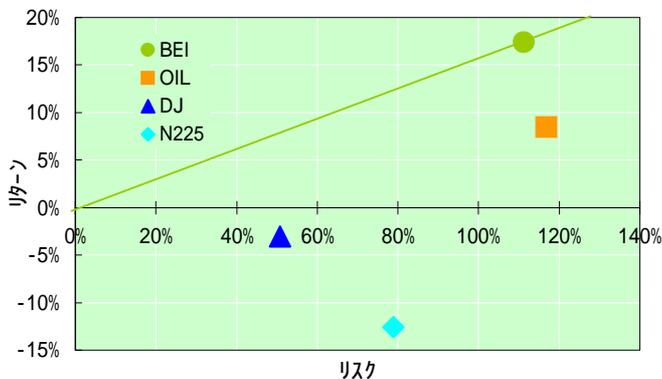
上表は、2008/10/31から一定期間遡った騰落率です。

リスク・リターン

	BEI	Sugar	Corn	Wheat	OIL	DJ	N225
リターン	17.3%	7.4%	31.7%	26.2%	8.5%	-3.1%	-12.6%
リスク	111.2%	129.1%	133.4%	146.6%	116.8%	50.7%	78.8%
シャープレシオ	0.156	0.057	0.237	0.179	0.073	-0.061	-0.160

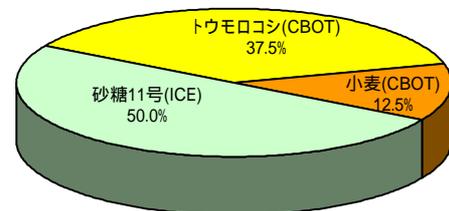
上表のリスク・リターン(年率換算)は、2005/11~2008/10の月間騰落率を基に算出しています。

リスク・リターンの分布



上グラフは、「リスク・リターン」のデータをもとに作成しています。

BEIの配分比率



価格相関

	BEI	Sugar	Corn	Wheat	OIL	DJ	N225
BEI	1.0000						
Sugar	0.3303	1.0000					
Corn	0.9201	-0.0369	1.0000				
Wheat	0.8417	-0.0508	0.8386	1.0000			
OIL	0.8855	0.1617	0.8635	0.7954	1.0000		
DJ	0.4006	-0.2244	0.4566	0.6050	0.3068	1.0000	
N225	0.0770	0.2254	-0.0167	0.0243	-0.1087	0.6817	1.0000

騰落率相関

	BEI	Sugar	Corn	Wheat	OIL	DJ	N225
BEI	1.0000						
Sugar	0.6778	1.0000					
Corn	0.7734	0.2170	1.0000				
Wheat	0.6558	0.1942	0.5961	1.0000			
OIL	0.3506	0.2156	0.2798	0.2441	1.0000		
DJ	0.0197	0.0156	0.0137	0.0243	0.0149	1.0000	
N225	0.0987	0.0838	0.0527	0.0476	0.0629	0.5604	1.0000

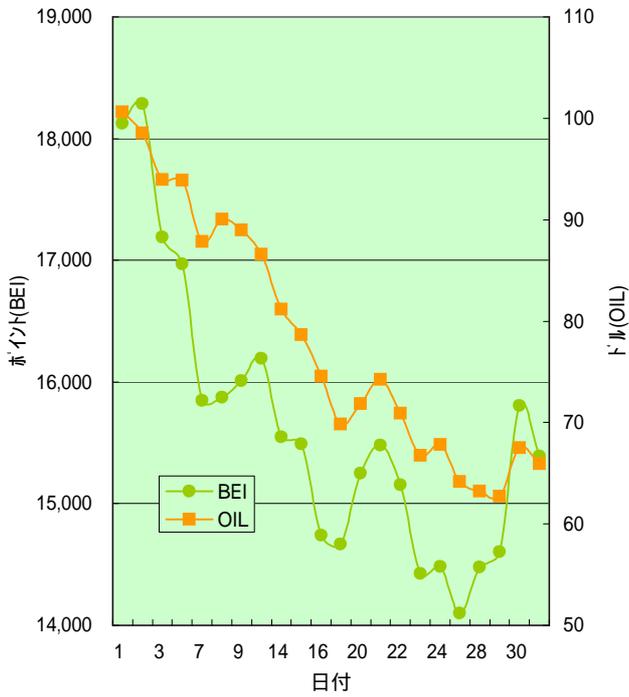
上表の相関(価格・騰落率)は、日々の価格データを基に算出しています。
期間:2005/1~2008/10末

[データ(表・グラフ)の略称表記について]

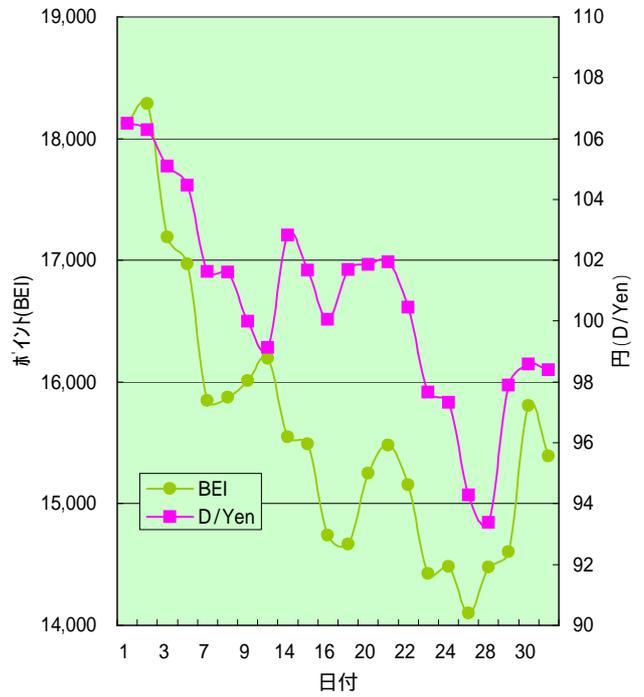
BEI:バイオエネルギー指数、Sugar:砂糖11号(ICE)、Corn:トウモロコシ(CBOT)、Wheat:小麦(CBOT)、OIL:原油(NYMEX)、DJ:ダウ平均、N225:日経平均

2008年10月中のBEIと各相場の推移

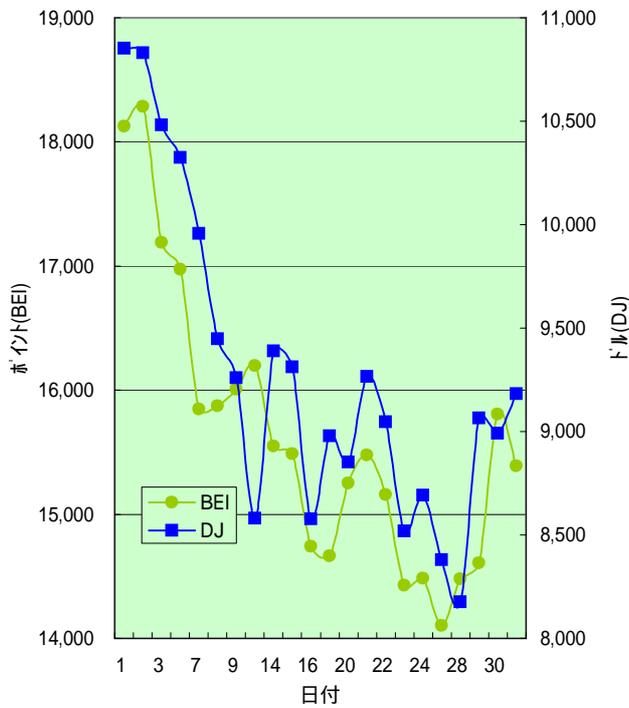
対 原油 (NYMEX) 相場



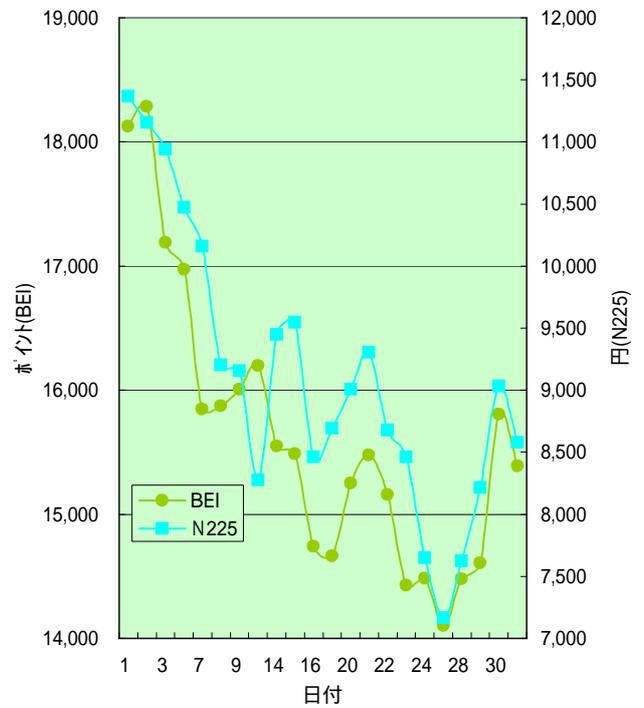
対 為替相場 (米ドル)



対 米国・株式相場 (ダウ平均)

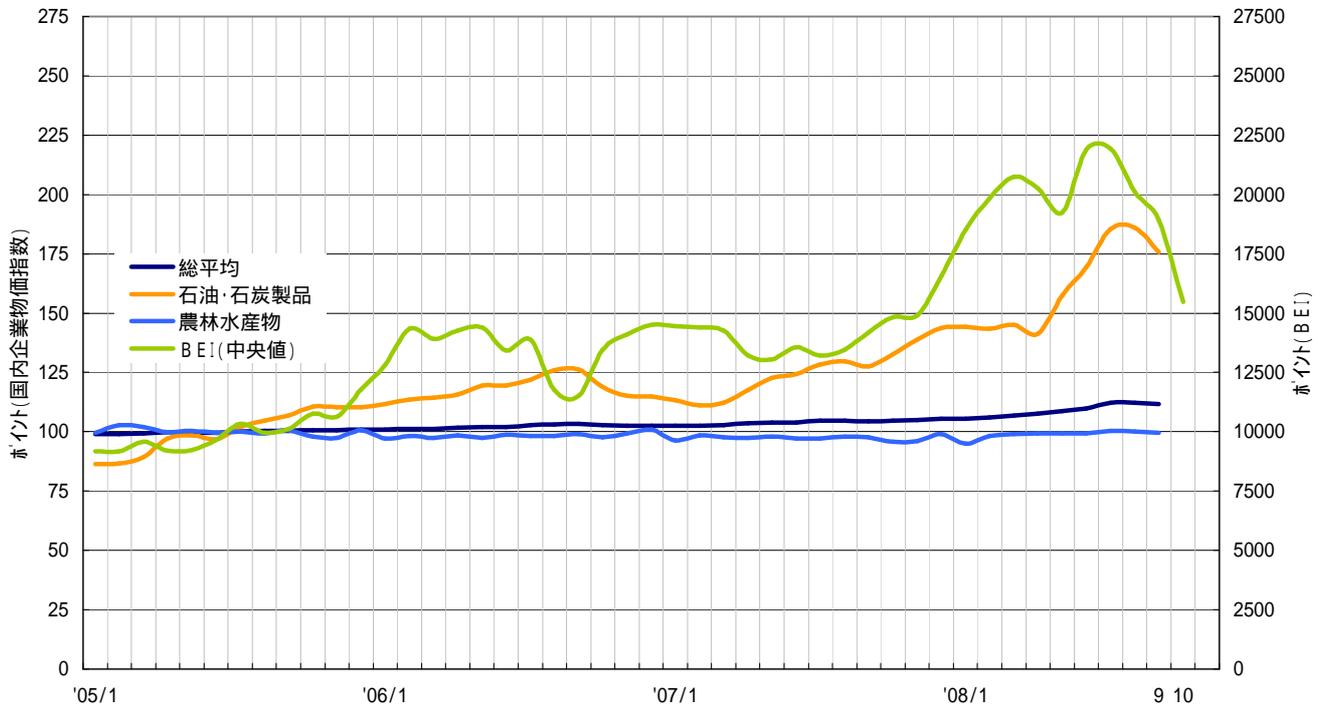


対 日本・株式相場 (日経平均)

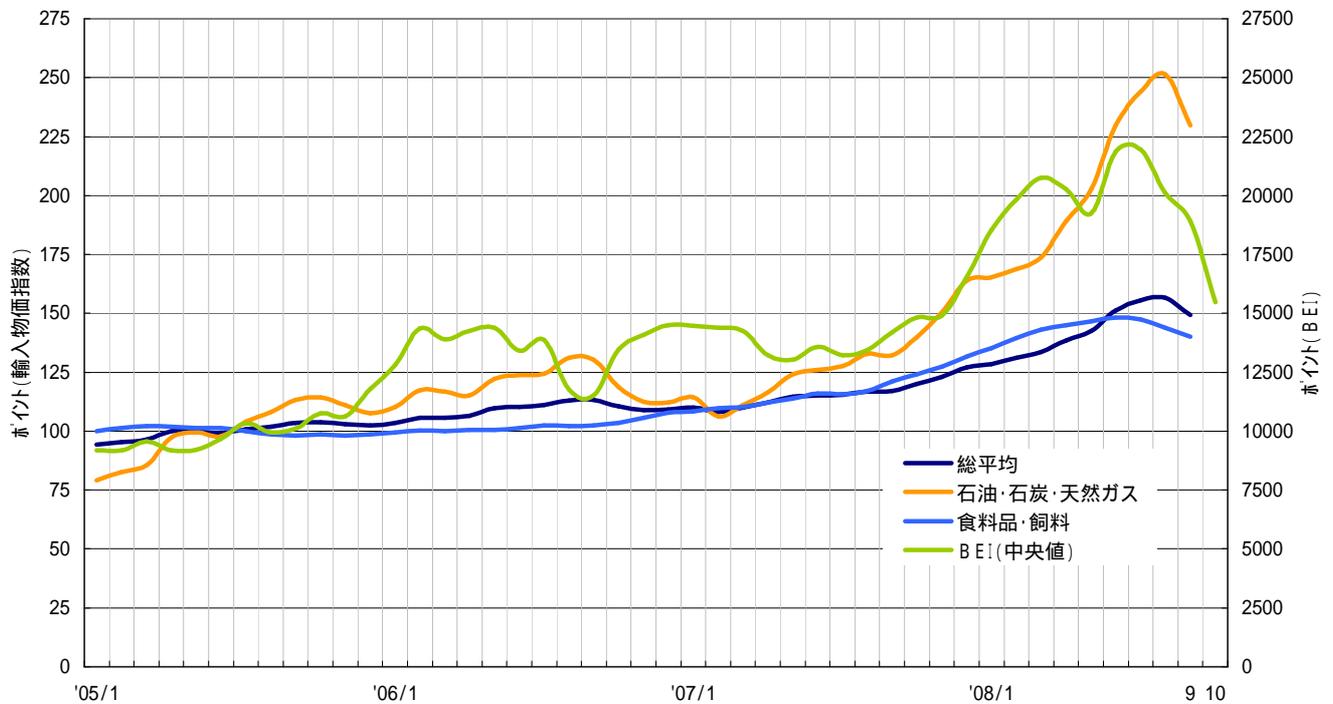


BEIと物価指数の推移

対 国内企業物価指数



対 輸入物価指数(契約通貨ベース指数)



【データについて】

- (1) BEIは、本所が算出・公表する指数値。BEIのグラフデータは、月間中央値を反映(2005/1～2008/10)させています。
- (2) 国内企業物価指数は「日銀」が公表。国内企業物価指数のグラフデータは、総平均、石油・石炭製品、農林水産物を反映(2005/1～2008/9)させています。
- (3) 輸入物価指数は「日銀」が公表。輸入物価指数のグラフデータは、総平均、石油・石炭・天然ガス、食料品・飼料を反映(2005/1～2008/9)させています。