

BEIの推移(2005/01~2008/11末)



期間騰落率

	BEI	Sugar	Corn	Wheat	OIL	DJ	N225
直近1ヶ月	-6.7%	-0.3%	-13.6%	-0.5%	-17.5%	-4.9%	-0.8%
直近3ヶ月	-28.0%	-10.7%	-37.9%	-32.1%	-52.9%	-25.5%	-34.9%
直近6ヶ月	-21.8%	18.5%	-39.2%	-28.0%	-57.0%	-31.0%	-40.6%
直近1年	-5.4%	20.6%	-7.7%	-38.4%	-40.2%	-34.4%	-45.7%
直近2年	-2.7%	-4.4%	-4.4%	9.2%	-12.9%	-28.6%	-47.7%
直近3年	33.6%	-5.1%	90.1%	78.2%	-3.7%	-19.9%	-42.8%

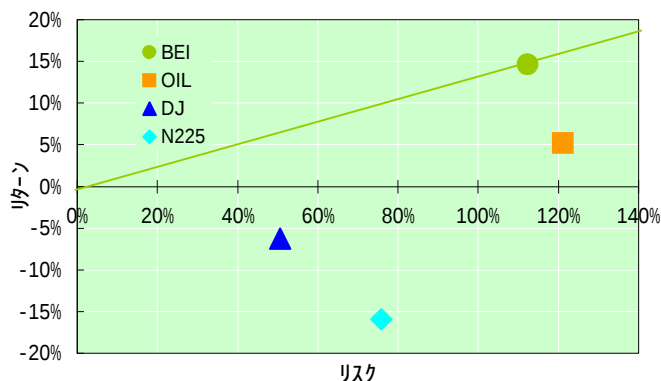
上表は、2008/11/28から一定期間遡った騰落率です。

リスク・リターン

	BEI	Sugar	Corn	Wheat	OIL	DJ	N225
リターン	14.6%	4.9%	29.0%	27.9%	5.2%	-6.3%	-15.9%
リスク	112.4%	128.4%	136.4%	145.9%	121.2%	50.6%	75.9%
シャープレシオ	0.130	0.038	0.212	0.191	0.043	-0.124	-0.210

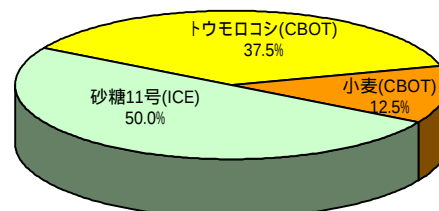
上表のリスク・リターン(年率換算)は、2005/12~2008/11の月間騰落率を基に算出しています。

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							
Sugar	0.3306						
Corn	0.9202	-0.0363					
Wheat	0.8413	-0.0508	0.8380				
OIL	0.8777	0.1602	0.8549	0.7912			
DJ	0.3670	-0.2129	0.4166	0.5682	0.3225		
N225	0.0636	0.2087	-0.0270	0.0237	-0.0658	0.7192	

騰落率相関

	BEI	Sugar	Corn	Wheat	OIL	DJ	N225
BEI							
Sugar	0.6805						
Corn	0.7748	0.2207					
Wheat	0.6551	0.2005	0.5897				
OIL	0.3637	0.2288	0.2881	0.2560			
DJ	0.0515	0.0392	0.0316	0.0642	0.1354		
N225	0.1156	0.1010	0.0580	0.0736	0.1131	0.5734	

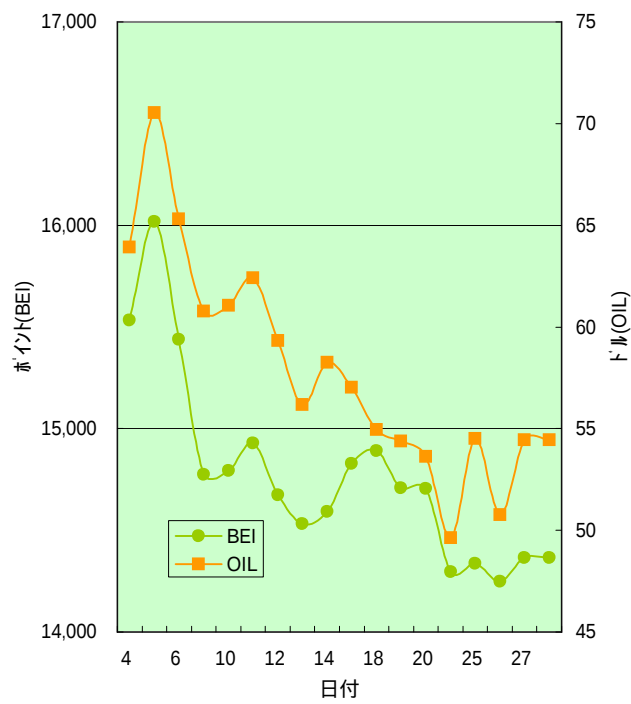
上表の相関(価格・騰落率)は、日々の価格データを基に算出しています。
期間:2005/1~2008/11末

【データ(表・グラフ)の略称表記について】

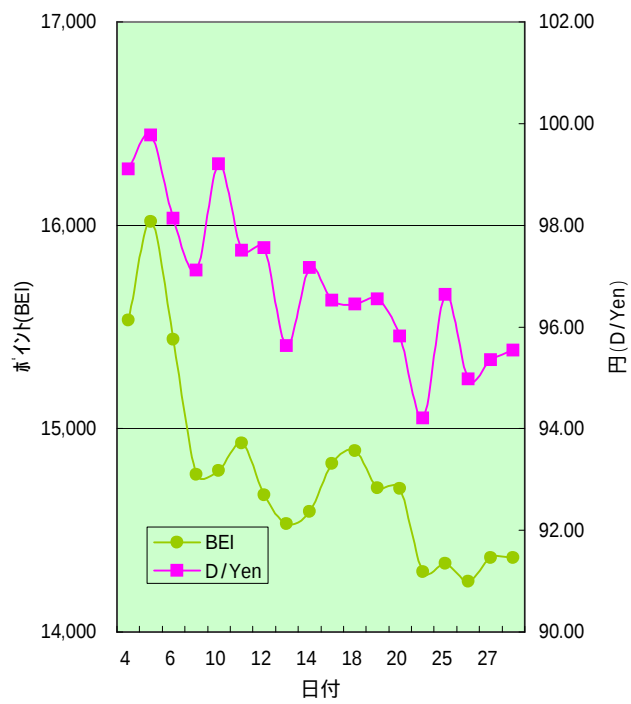
BEI:バイオエネルギー指数、Sugar:砂糖11号(ICE)、Corn:トウモロコシ(CBOT)、Wheat:小麦(CBOT)、OIL:原油(NYMEX)、DJ:ダウ平均、N225:日経平均

2008年11月中のBEIと各相場の推移

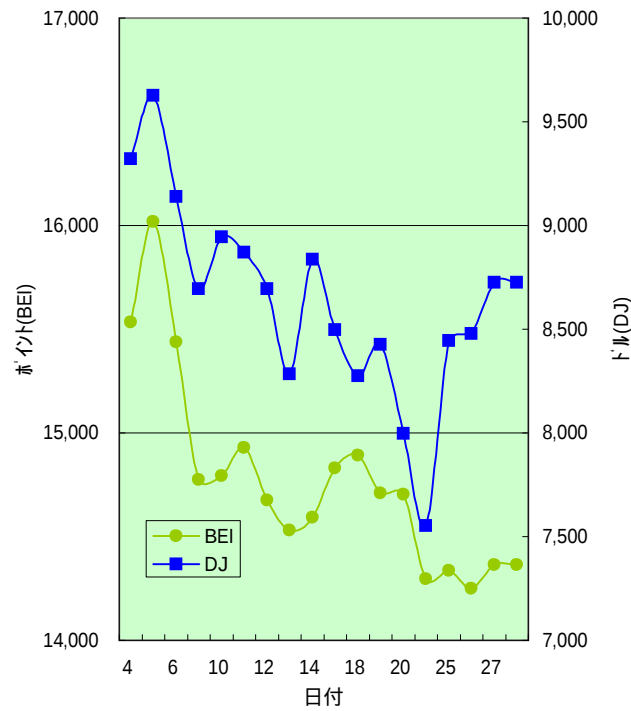
対 原油 (NYMEX) 相場



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)

