

BEIの推移(2005/01~2008/12末)



期間騰落率

	BEI	Sugar	Corn	Wheat	OIL	DJ	N225
直近1ヶ月	4.1%	-5.8%	11.2%	10.6%	-26.5%	-0.7%	4.1%
直近3ヶ月	-19.3%	-11.7%	-23.3%	-11.4%	-58.5%	-16.4%	-21.3%
直近6ヶ月	-35.5%	-2.3%	-47.9%	-33.9%	-71.5%	-23.6%	-34.3%
直近1年	-13.3%	1.4%	-13.5%	-35.3%	-58.6%	-35.1%	-42.1%
直近2年	0.4%	-6.2%	1.3%	17.4%	-33.9%	-30.7%	-48.6%
直近3年	19.5%	-24.8%	86.5%	75.5%	-33.7%	-19.6%	-45.0%

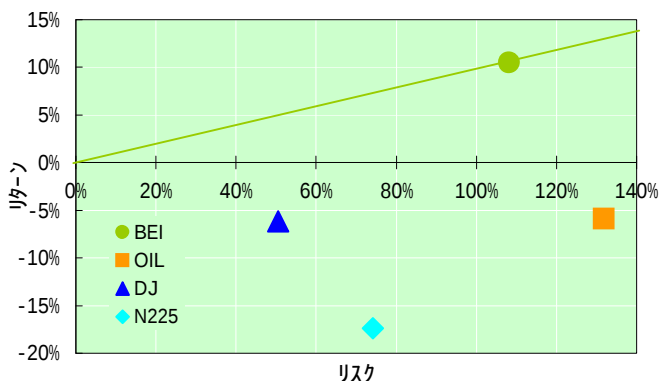
上表は、2008/12/30から一定期間遡った騰落率です。

リスク・リターン

	BEI	Sugar	Corn	Wheat	OIL	DJ	N225
リターン	10.5%	-3.3%	28.2%	27.3%	-5.9%	-6.2%	-17.3%
リスク	108.2%	123.3%	135.8%	145.4%	131.9%	50.5%	74.1%
シャープレシオ	0.097	-0.027	0.208	0.188	-0.044	-0.122	-0.234

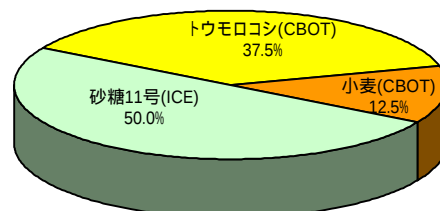
上表のリスク・リターン(年率換算)は、2006/1~2008/12の月間騰落率を基に算出しています。

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	0.3304						
Corn	0.9202	-0.0366					
Wheat	0.8413	-0.0506	0.8378				
OIL	0.8574	0.1611	0.8319	0.7749			
DJ	0.3426	-0.1928	0.3844	0.5348	0.3661		
N225	0.0585	0.2024	-0.0309	0.0246	0.0089	0.7526	

騰落率相関

	BEI	Sugar	Corn	Wheat	OIL	DJ	N225
BEI							
Sugar	0.6828						
Corn	0.7832	0.2312					
Wheat	0.6617	0.2113	0.5974				
OIL	0.3714	0.2347	0.3010	0.2510			
DJ	0.0701	0.0497	0.0479	0.0848	0.1393		
N225	0.1081	0.0921	0.0525	0.0808	0.0719	0.5733	

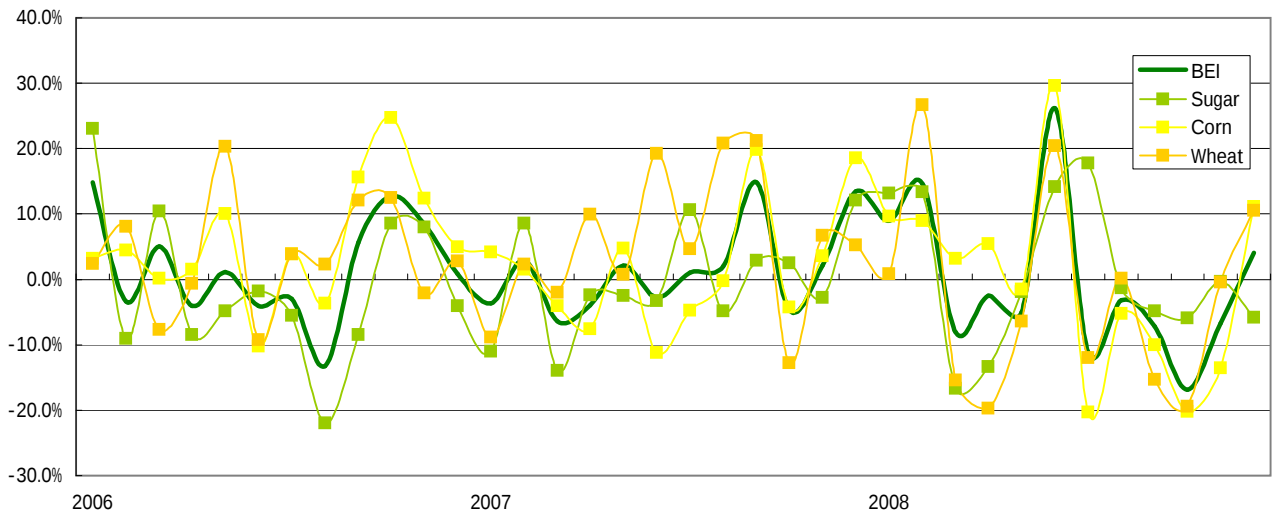
上表の相関(価格・騰落率)は、日々の価格データを基に算出しています。
期間:2005/1~2008/12末

【データ(表・グラフ)の略称表記について】

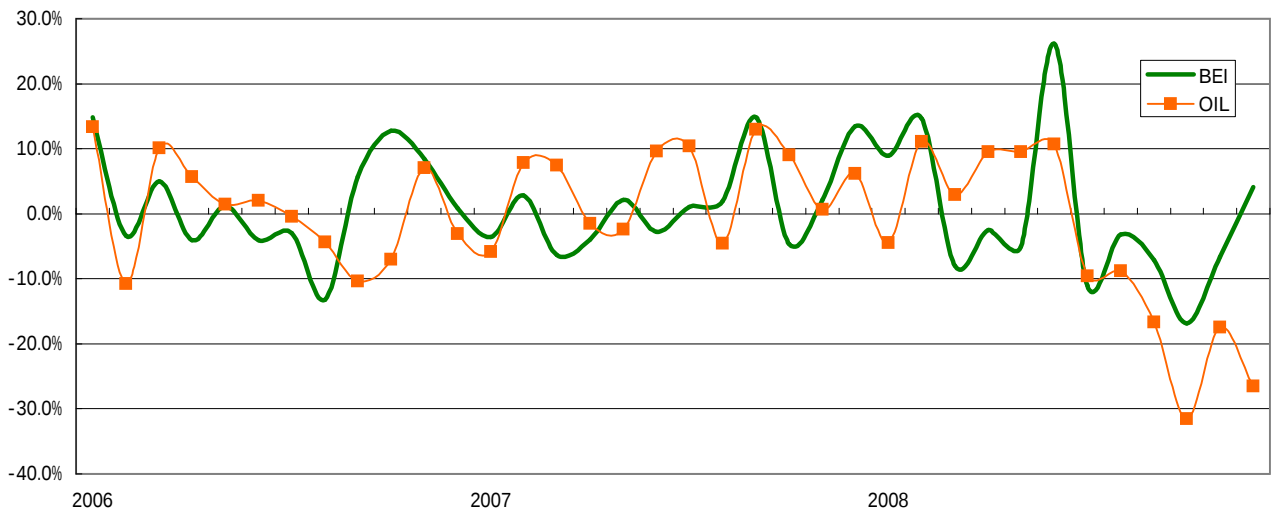
BEI:バイオエネルギー指数、Sugar:砂糖11号(ICE)、Corn:トウモロコシ(CBOT)、Wheat:小麦(CBOT)、OIL:原油(NYMEX)、DJ:ダウ平均、N225:日経平均

BEIと各相場の月間騰落率(直近36ヶ月間)

対 BEI構成銘柄



対 原油(NYMEX)



対 株式(ダウ平均、日経平均)

