

B E I (バイオエネルギー指数) 月間レポート

B E I 構成銘柄の価格

B E I 構成銘柄	作成基準日現在	(2005) 基準値
砂糖11号	23.46 トン	9.99 トン
トウモロコシ	341.00 トン	208.84 トン
小麦	447.50 トン	318.95 トン

B E I 構成銘柄の価格は、作成基準日(午前)に入電した海外先物市場のセツルメント価格(期近)です。

騰落率比較 (B E I 他)

	1ヵ月	3ヵ月	6ヵ月	1年	3年
B E I	2.8%	13.1%	31.0%	7.5%	64.9%
砂糖11号	-0.3%	38.6%	88.0%	86.3%	122.4%
トウモロコシ	6.2%	-9.5%	-11.7%	-33.5%	29.0%
小麦	-4.2%	-15.3%	-12.7%	-33.0%	0.4%
原油	-2.9%	-1.2%	45.9%	-26.7%	12.5%
ダウ平均	2.1%	14.2%	29.5%	-6.0%	-16.9%
日経平均	-3.4%	1.8%	25.0%	-10.0%	-37.2%

リスク・リターン比較 (B E I 他)

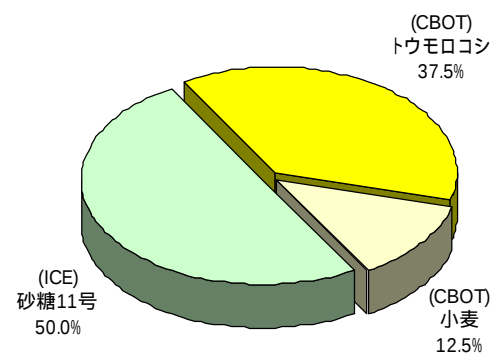
	リターン	リスク	シャープR
B E I	10.7%	93.6%	0.1143
砂糖11号	69.2%	121.1%	0.5710
トウモロコシ	-34.3%	121.1%	-0.2831
小麦	-32.6%	133.0%	-0.2453
原油	-13.5%	203.4%	-0.0665
ダウ平均	-3.5%	82.7%	-0.0423
日経平均	-5.3%	111.4%	-0.0472

リスク・リターン(年率換算)は、12ヵ月間('08/10~'09/9)の月間騰落率より算出しています。

B E I の推移



B E I 構成銘柄の配分比率



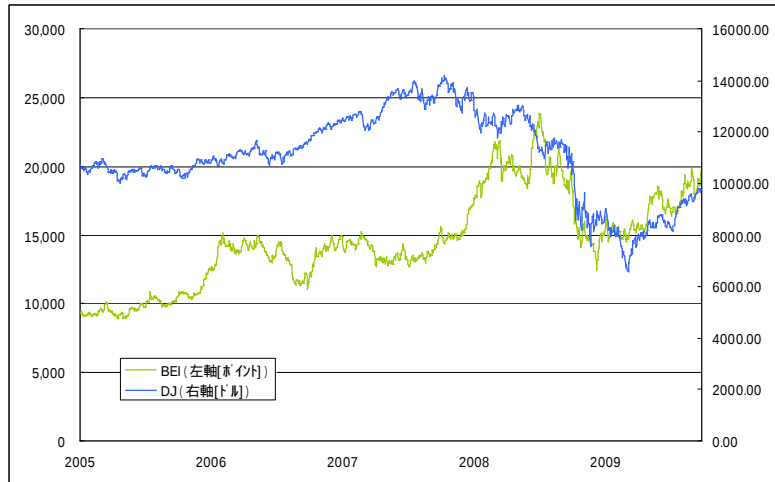
直近90日間・B E I の推移



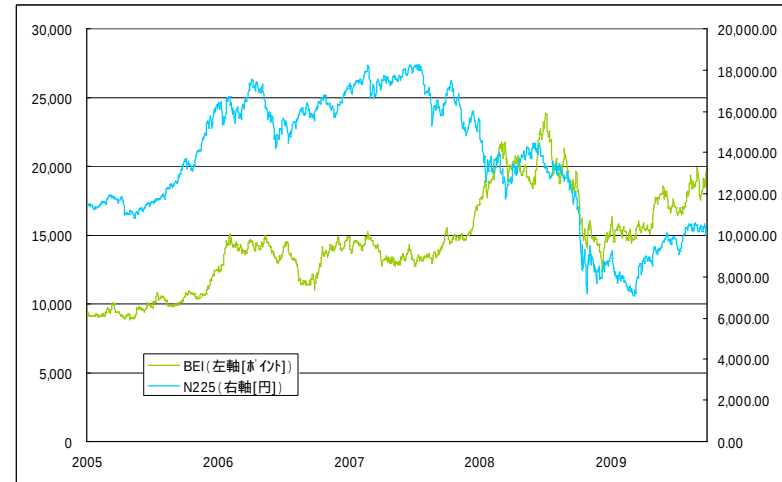
B E I (バイオエネルギー指数) は、本所が B E I 算出要領に基づき算出したドル・ベースの商品指数です。その他のデータ出所は Bloomberg。
上表(騰落率比較、リスク・リターン比較)のデータは、日経平均を除き全てドル建ての価格データに基づき算出しています。

BEI (バイオエネルギー指数) 月間レポート

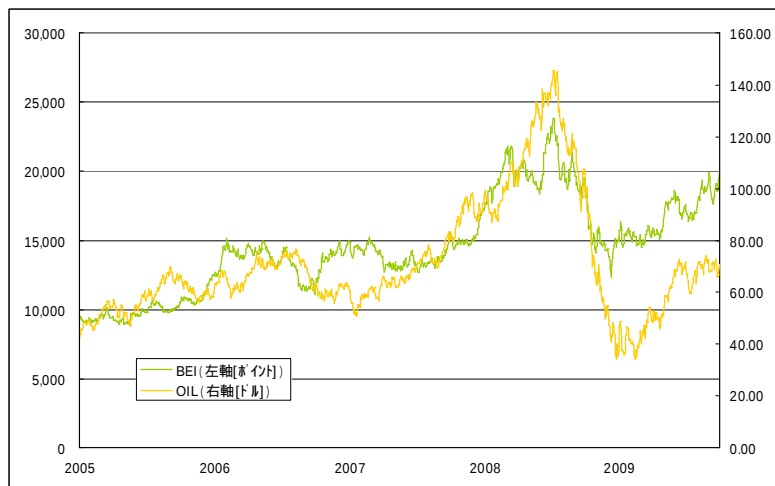
BEIとDJ(ダウ平均)の推移



BEIとN225(日経平均)の推移



BEIとOIL (NY原油)の推移



価格相関(2005.1 ~ 2009.9)

