

BEI (バイオエネルギー指数) 月間レポート

BEI 構成銘柄の価格

BEI構成銘柄	作成基準日現在	(2005) 基準値
砂糖11号	22.25 円	9.99 円
トウモロコシ	379.50 円	208.84 円
小麦	503.75 円	318.95 円

BEI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 (BEI他)

	1ヵ月	3ヵ月	6ヵ月	1年	3年
BEI	0.1%	14.7%	23.8%	29.5%	46.4%
砂糖11号	-5.2%	18.7%	60.8%	87.8%	94.3%
トウモロコシ	11.3%	14.2%	-3.4%	-7.3%	15.2%
小麦	12.6%	-2.4%	-3.3%	-6.4%	0.5%
原油	13.1%	19.8%	56.7%	21.1%	36.9%
ダウ平均	2.3%	8.1%	21.7%	8.5%	-17.6%
日経平均	-1.0%	-3.1%	13.7%	17.0%	-38.8%

リスク・リターン比較 (BEI他)

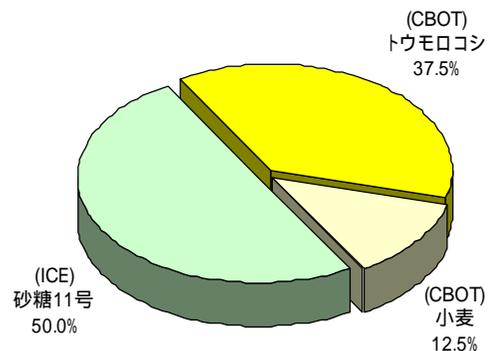
	リターン	リスク	シャープR
BEI	27.7%	65.8%	0.4210
砂糖11号	69.9%	120.2%	0.5811
トウモロコシ	-2.8%	110.8%	-0.0254
小麦	-0.6%	126.4%	-0.0047
原油	31.1%	172.4%	0.1806
ダウ平均	10.2%	71.4%	0.1428
日経平均	17.6%	68.5%	0.2571

リスク・リターン(年率換算)は、12ヵ月間('08/11~'09/10)の月間騰落率より算出しています。

BEIの推移



BEI構成銘柄の配分比率



参考指標 (年初来)

	BEI	公表日
最高値	20,987	10月22日
最安値	14,439	3月4日
平均値	17,076	
標準偏差	1,688	
データ数	203	

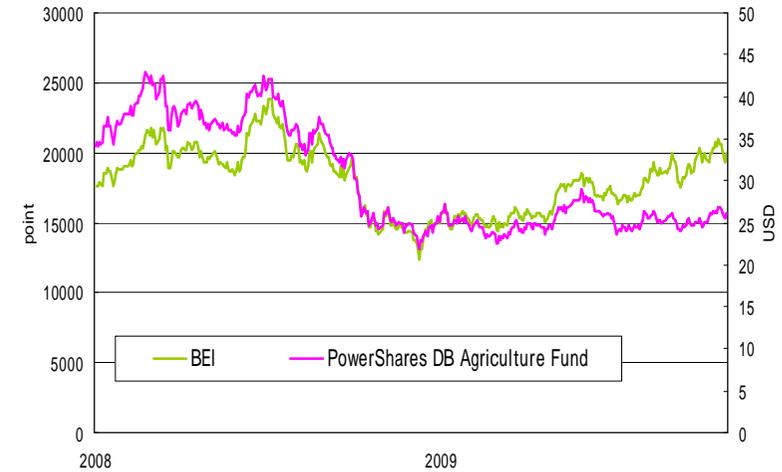
BEI(バイオエネルギー指数)は、本所がBEI算出要領に基づき算出したドルベースの商品指数です。その他のデータ出所はBloomberg。上表(騰落率比較、リスク・リターン比較)のデータは、日経平均を除き全てドル建ての価格データに基づき算出しています。

BEI (バイオエネルギー指数) 月間レポート

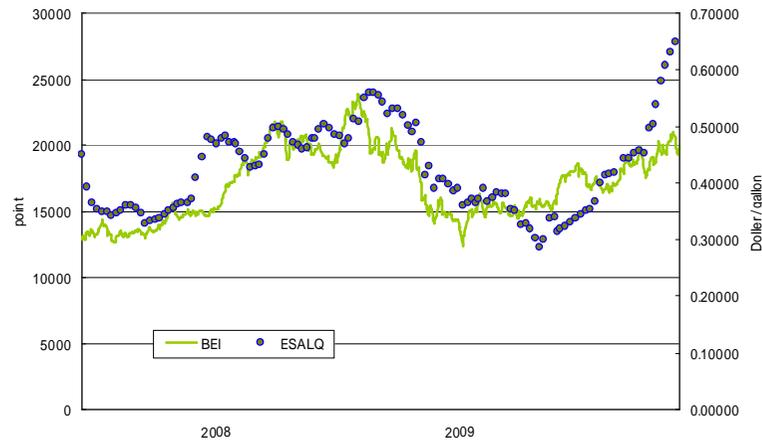
BEIと米国エタノール先物価格の推移



BEIとPowerShares DB Agriculture Fund(ETF)の推移



BEIとブラジルエタノール現物価格 (ESALQ) の推移



PowerShares DB Agriculture Fund は、米国の NYSEArca で取引されている ETF です。

同ETFは、Deutsche Bank Liquid Commodities Index に連動するよう設計されたものです。また、同指数は、コーン、小麦、大豆、砂糖など、流動性の高い農産物の先物価格を指数化しています。

[参考] Deutsche Bank (ドイツ銀行) < Global Markets

<http://dbfunds.db.com/index.aspx>

<http://dbfunds.db.com/dba/index.aspx>