

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	22.20 トン	9.99 トン
トウモロコシ	397.25 トン	208.84 トン
小麦	548.75 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	2.4%	5.3%	13.3%	42.0%	38.2%
砂糖11号	-0.2%	-5.6%	41.9%	88.0%	79.6%
トウモロコシ	4.7%	23.8%	-7.3%	12.2%	7.3%
小麦	8.9%	17.5%	-13.0%	2.5%	11.9%
原油	-4.8%	4.6%	16.9%	39.7%	21.8%
ダウ平均	3.5%	8.0%	22.7%	18.1%	-15.7%
日経平均	-6.9%	-10.9%	-1.9%	9.8%	-42.6%

リスク・リターン比較(B E I 他)

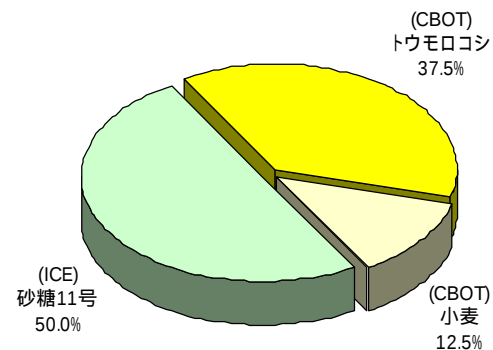
	リターン	リスク	シャープR
B E I	36.7%	56.4%	0.6511
砂糖11号	70.0%	120.2%	0.5825
トウモロコシ	15.4%	99.6%	0.1548
小麦	8.8%	130.1%	0.0676
原油	43.8%	158.1%	0.2772
ダウ平均	18.6%	68.3%	0.2725
日経平均	11.5%	74.1%	0.1550

リスク・リターン(年率換算)は、12ヵ月間('08/12~'09/11)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



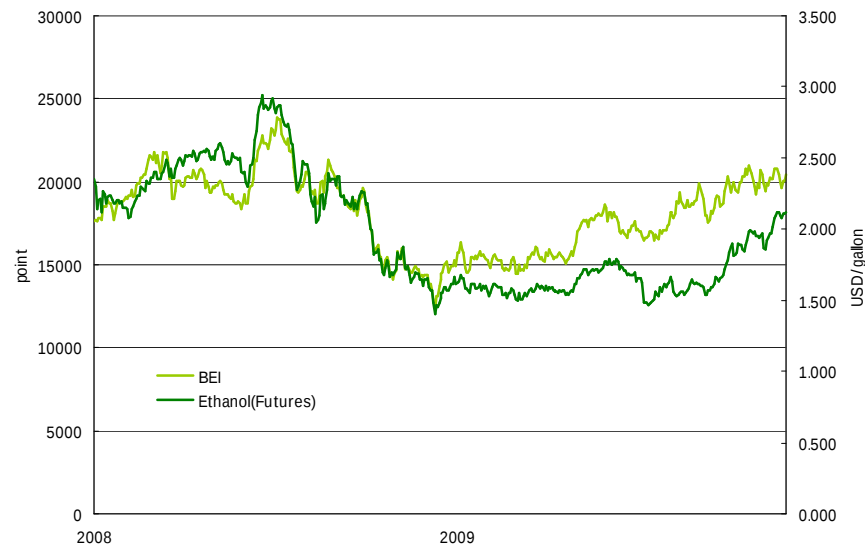
参考指標(年初来)

	B E I	公表日
最高値	20,987	10月22日
最安値	14,439	3月4日
平均値	17,340	
標準偏差	1,835	
データ数	222	

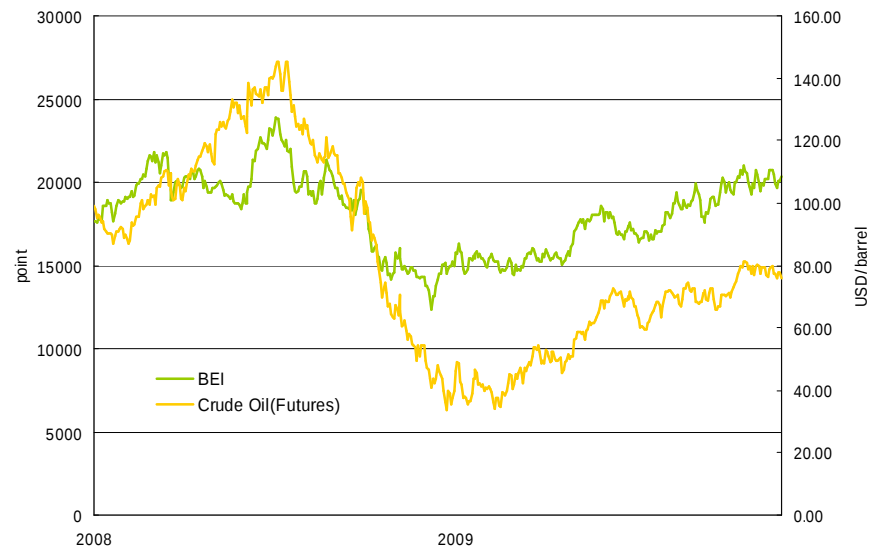
B E I(バイオエネルギー指数)は、本所がB E I算出要領に基づき算出したドル・ベースの商品指数です。その他のデータ出所はREUTERS。
上表(騰落率比較、リスク・リターン比較)のデータは、日経平均を除き全てドル建ての価格データに基づき算出しています。

B E I (バイオエネルギー指数) 月間レポート

BEIとエタノール先物価格の推移



BEIと原油先物価格の推移



相関係数(価格)

	BEI	Ethanol	ESALQ	Crude Oil
BEI				
Ethanol	0.7684			
ESALQ	0.8083	0.7354		
Crude Oil	0.9187	0.6747	0.7035	

相関係数(騰落率)

	BEI	Ethanol	ESALQ	Crude Oil
BEI				
Ethanol	0.5510			
ESALQ	0.0975	0.1787		
Crude Oil	0.3420	0.4389	0.1522	

Ethanol(エタノール)およびCrude Oil(原油)の価格は、米国CME Groupの先物価格(期近)となります。

ESALQとは、ブラジル・サンパウロ大学が公表するエタノール現物価格(週間値)です。

相関係数(価格・騰落率)の算出に際しては、BEI、Ethanol、Crude Oilのデータを週間(中央)値としています。