

BEI(バイオエネルギー指数) 月間レポート No.25

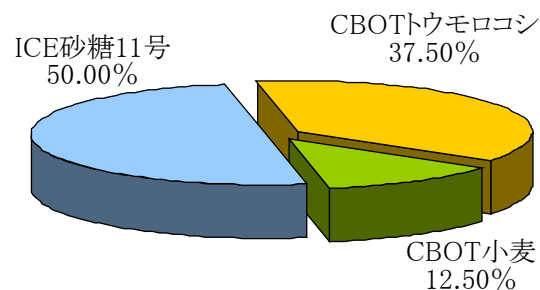
作成基準日: 2009年12月30日 公表日: 2010年1月15日

BEI構成銘柄の価格

BEI構成銘柄	作成基準日現在	基準値(2005年)
ICE砂糖11号	22. 20 セン	9. 99 セン
CBOTトウモロコシ	397. 25 セン	208. 84 セン
CBOT小麦	548. 75 セン	318. 95 セン

※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)

BEI構成銘柄の配分比率



BEIの推移



参考指標(年初来)

	BEI	公表日
最高値	23,270	12月28日
最安値	14,439	3月4日
平均値	17,686	
標準偏差	2,117	
データ数	243	

騰落率比較(BEI他)

	1ヶ月	3ヶ月	6ヵ月	1年	3年
BEI	12.8%	15.6%	30.7%	53.9%	54.5%
砂糖11号	20.6%	14.1%	58.1%	140.7%	125.7%
トウモロコシ	5.0%	22.3%	10.6%	6.0%	7.3%
小麦	-1.4%	20.9%	2.4%	-8.6%	7.3%
原油	3.7%	11.7%	10.3%	97.1%	30.3%
ダウ平均	2.3%	8.2%	23.6%	21.7%	-15.6%
日経平均	12.8%	4.1%	5.9%	19.0%	-38.8%

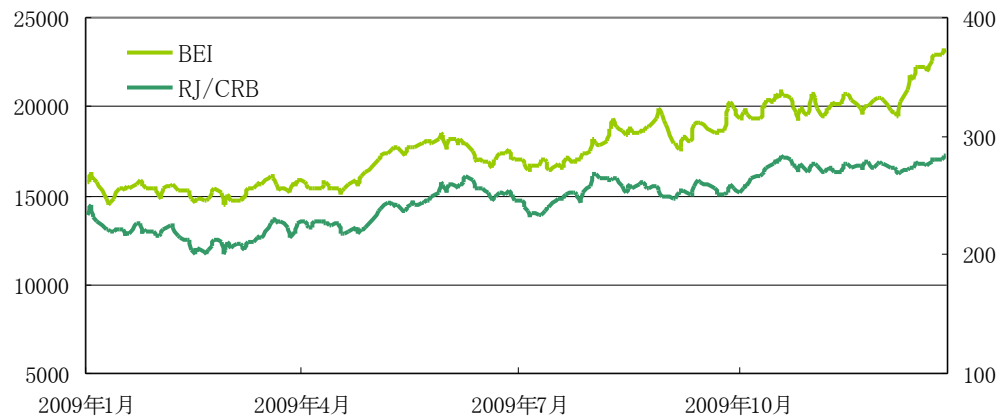
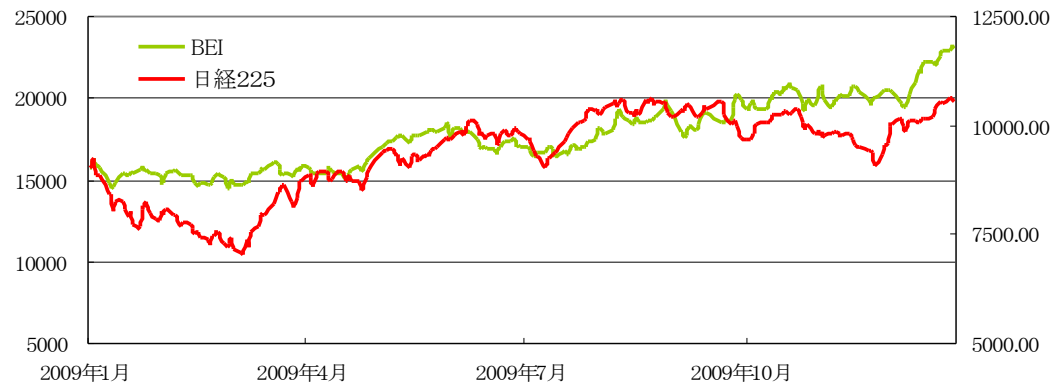
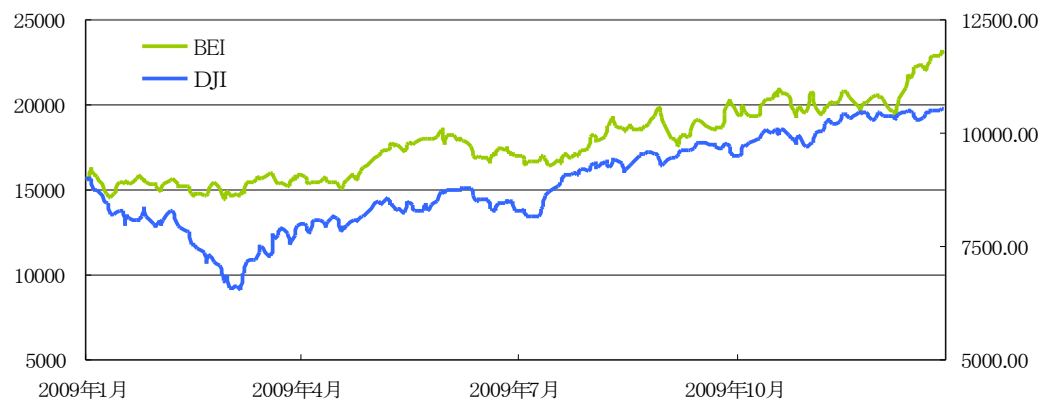
リスク・リターン比較(BEI他)

	リターン	リスク	シャープR
BEI	45.4%	65.8%	0.6908
砂糖11号	96.4%	121.4%	0.7941
トウモロコシ	9.2%	93.7%	0.0985
小麦	-3.2%	124.8%	-0.0254
原油	74.0%	110.0%	0.6726
ダウ平均	21.6%	67.8%	0.3180
日経平均	20.3%	84.4%	0.2399

※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。

※リスク・リターン比較は直近12ヶ月間の月間騰落率より算出しています。



相 関

価格

	BEI	DJI	日経225	RJ/CRB
BEI				
DJI	0.9152			
日経225	0.7883	0.8137		
RJ/CRB	0.9297	0.9247	0.8787	

変化率

	BEI	DJI	日経225	RJ/CRB
BEI				
DJI	0.4023			
日経225	0.3980	0.6083		
RJ/CRB	0.6797	0.5689	0.5036	

月間騰落率

	BEI	DJI	日経225	RJ/CRB
BEI				
DJI	0.2707			
日経225	0.5060	0.6444		
RJ/CRB	0.5116	0.4296	0.5920	

- ・グラフ、相関共に、2009年1月から12月のデータ
- ・データの出所は本所(関西商品取引所)算出および、REUTERS