

BEI(バイオエネルギー指数) 月間レポート No.32

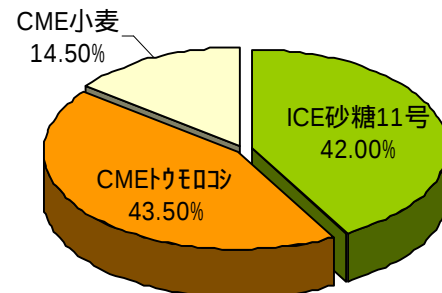
作成基準日:2010年7月30日 公表日:2010年8月13日

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	19.50 円	9.99 円
CMEトウモロコシ	379.25 円	208.84 円
CME小麦	627.50 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。

BEI構成銘柄の配分比率



BEIの推移



騰落率比較 (BEI他)

	1ヶ月	3ヶ月	6ヵ月	1年	3年
BEI	21.6%	17.5%	-17.3%	9.1%	42.2%
砂糖11号	10.9%	29.1%	-32.8%	4.0%	94.6%
トウモロコシ	16.7%	5.2%	4.8%	14.1%	17.2%
小麦	42.0%	29.5%	28.9%	21.5%	-1.6%
原油	3.2%	-8.0%	6.4%	17.5%	2.0%
ダウ平均	6.0%	-6.3%	3.4%	13.6%	-21.6%
日経平均	1.6%	-13.7%	-6.5%	-7.9%	-44.7%

リスク・リターン比較 (BEI他)

	リターン	リスク	シャープR
BEI	14.6%	125.3%	0.1166
砂糖11号	19.4%	200.5%	0.0967
トウモロコシ	17.2%	100.9%	0.1701
小麦	29.0%	169.8%	0.1707
原油	19.2%	88.1%	0.2183
ダウ平均	13.9%	52.5%	0.2647
日経平均	-5.8%	79.3%	-0.0737

参考指標 (年初来)

	年初来の記録	公表日
最高値	24,014	1月7日
最低値	14,982	6月8日
平均値	18,329	-
標準偏差	2,755	-
データ数	142	-

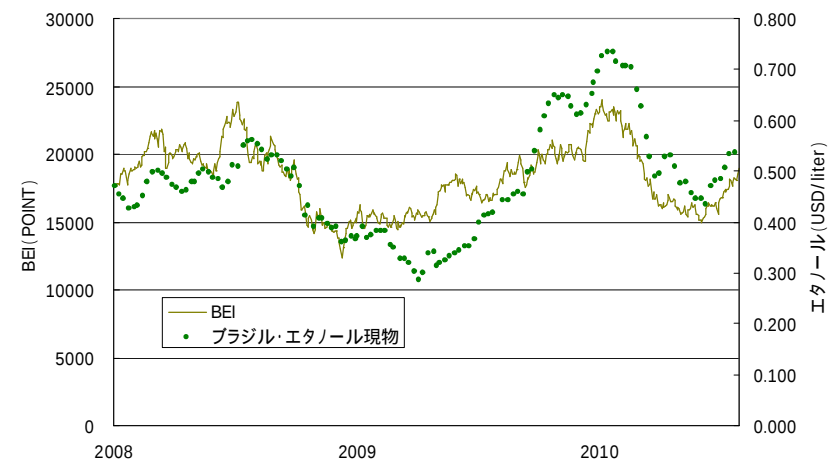
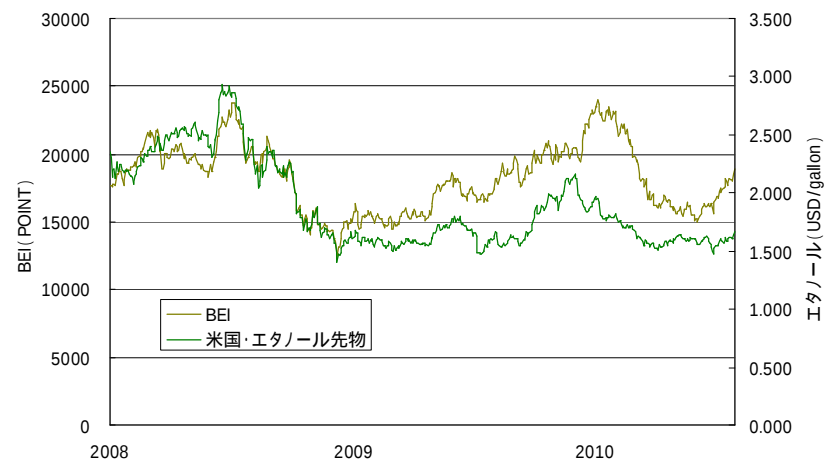
BEI(バイオエネルギー指数)は、本所がBEI算出要領に基づき算出したドル・ベースの商品指数です。
 騰落率比較およびリスク・リターン比較は、日経平均を除き全てドル建のデータに基づき算出しています。
 リスク・リターン比較は、直近12ヶ月間の月間騰落率より算出しています。

[BEI専用ページへアクセス](#)

BEI(バイオエネルギー指数) 月間レポート No.32

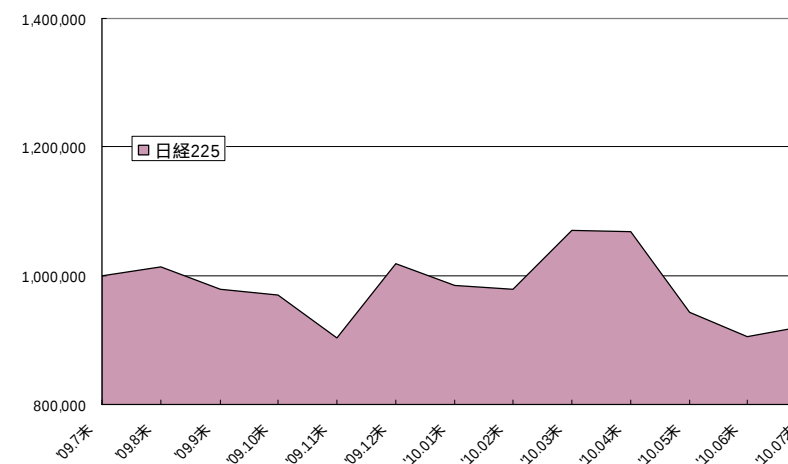
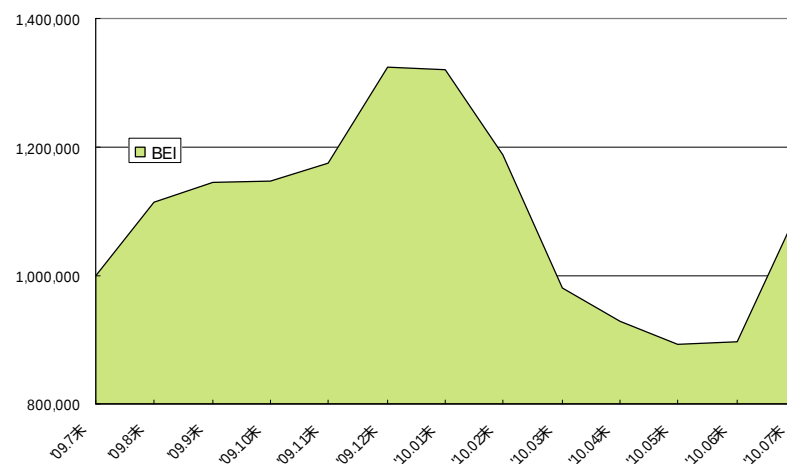
作成基準日:2010年7月30日 公表日:2010年8月13日

BEIとエタノール価格(米国先物・ブラジル現物)の推移



グラフのデータ期間は、2008 年から直近まで。エタノール現物価格(ブラジル・ESALQ)は週間値。

運用シミュレーション:資金(100万円)を各指標の月間騰落率に連動させた場合



(1)運用シミュレーションの当初資金 100 万円は'09 年 7 月末時点のもの。(2)グラフデータは、前月末現在資金×当月騰落率+前月末現在資金で計算したもの。