KANSAI COMMODITIES EXCHANGE

BEI（バイオエネルギー指数） 月間レポート No.33

作成基準日：2010年8月31日 公表日：2010年9月15日

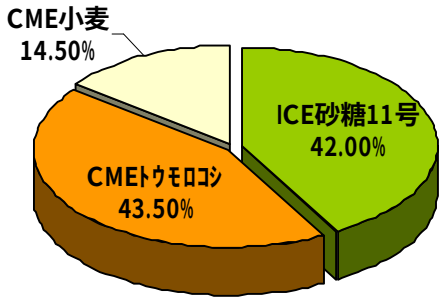
BEI構成銘柄の価格

BEI構成銘柄	作成基準日現在	基準値（2005年）
ICE砂糖11号	19.81 セント	9.99 セント
CMEトウモロコシ	425.50 セント	208.84 セント
CME小麦	671.25 セント	318.95 セント

※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の推移

BEI構成銘柄の配分比率



騰落率比較（BEI他）

	1ヶ月	3ヶ月	6ヵ月	1年	3年
BEI	6.8%	30.4%	-1.8%	4.5%	49.0%
砂糖11号	1.6%	39.6%	-19.0%	-15.8%	107.7%
トウモロコシ	12.2%	18.5%	14.3%	32.6%	31.8%
小麦	7.0%	46.6%	37.1%	43.7%	-12.8%
原油	-4.7%	1.0%	-6.2%	2.7%	1.8%
ダウ平均	-4.4%	-1.3%	-3.0%	4.9%	-24.4%
日経平均	-7.5%	-9.7%	-12.9%	-15.9%	-46.7%

リスク･リターン比較（BEI他）

	リターン	リスク	シャープR
BEI	10.0%	121.3%	0.0822
砂糖11号	-4.5%	179.3%	-0.0248
トウモロコシ	32.7%	105.5%	0.3104
小麦	45.5%	164.1%	0.2773
原油	5.5%	85.7%	0.0640
ダウ平均	5.9%	54.8%	0.1084
日経平均	-14.6%	82.5%	-0.1775

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	18,511	ー
標準偏差	2,607	ー
データ数	164	ー

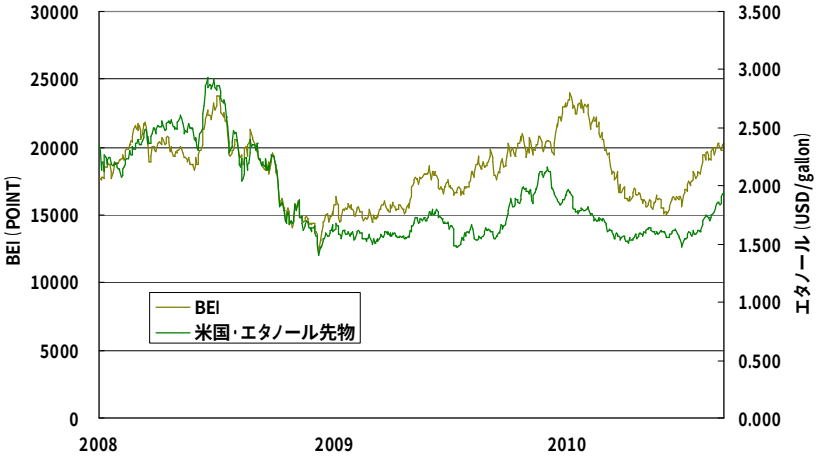
※BEI（バイオエネルギー指数）は、本所がBEI算出要領に基づき算出したドル･ベースの商品指数です。
※騰落率比較およびリスク･リターン比較は、日経平均を除き全てドル建のデータに基づき算出しています。
※リスク･リターン比較は、直近 12 ヶ月間の月間騰落率より算出しています。

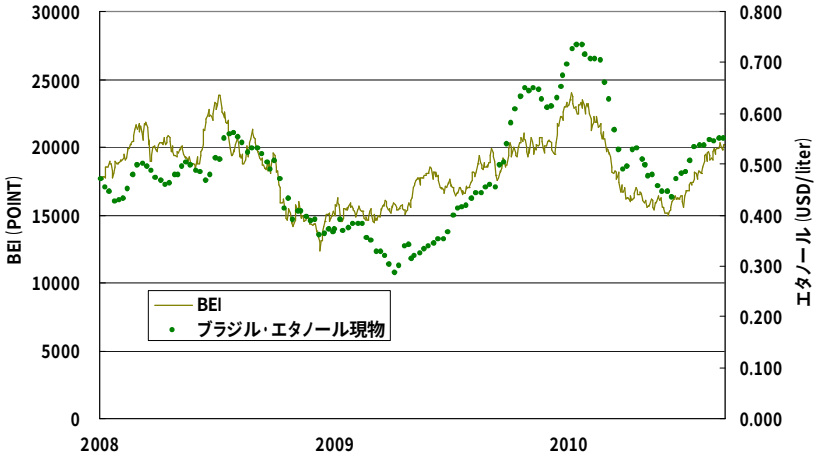
BEI専用ページへアクセス

ＢＥＩ（バイオエネルギー指数） 月間レポート No.33

作成基準日：2010年8月31日 公表日：2010年9月15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'05 年 8 月末時点とする。(2)資金推移は、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。