

Index Report (No.8)

BEI: バイオエネルギー指数
IFIJ: 輸入食料指数

作成基準日: 2011年9月30日 公表日: 2011年10月14日

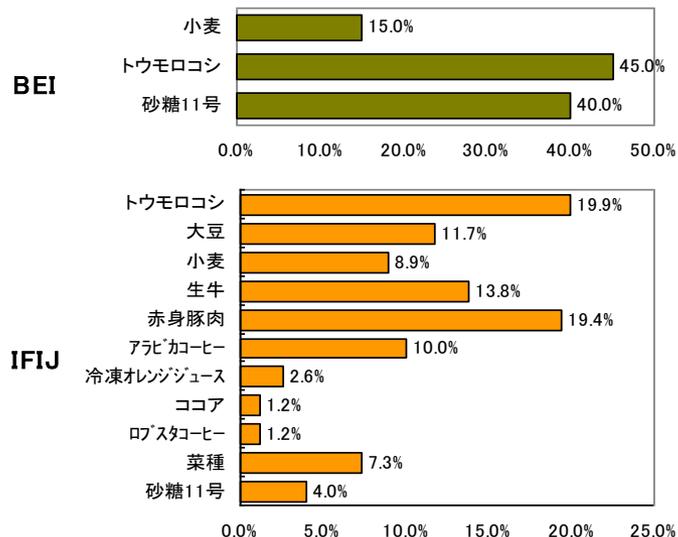
指数構成銘柄の価格

	構成銘柄	作成基準日現在	基準値(2005年平均)
BEI	ICE 砂糖11号	26.85 ^円	9.99 ^円
	CME トウモロコシ	632.50 ^円	208.84 ^円
	CME 小麦	654.25 ^円	318.95 ^円

	構成銘柄	作成基準日現在	基準値(2004年12月31日)
IFIJ	CME トウモロコシ	484.68 ^円	209.95 ^円
	CME 大豆	942.54 ^円	561.66 ^円
	CME 小麦	501.35 ^円	315.31 ^円
	CME 生牛	92.26 ^円	92.13 ^円
	CME 赤身豚肉	69.25 ^円	78.34 ^円
	ICE アラビカコーヒー	177.13 ^円	106.38 ^円
	ICE 冷凍オレンジジュース	116.66 ^円	88.28 ^円
	NYSE LIFFE ココア	208,318 ^円	165,290 ^円
	NYSE LIFFE ロブスタコーヒー	150,501 ^円	74,854 ^円
	ICE 菜種	39,458 ^円	22,925 ^円
ICE 砂糖11号	20.57 ^円	9.26 ^円	

※ 値は全てCME為替先物価格を以て本所が算出した邦貨換算値

配分比率



BEI, IFIJの推移(単位: point)



参考指標(年初来)

	記録 (算出日)	
BEI	最高値	32,707 (2/3)
	最低値	26,314 (5/9)
	平均値	29,753 —
	標準偏差	1,361 —
	データ数	184 —

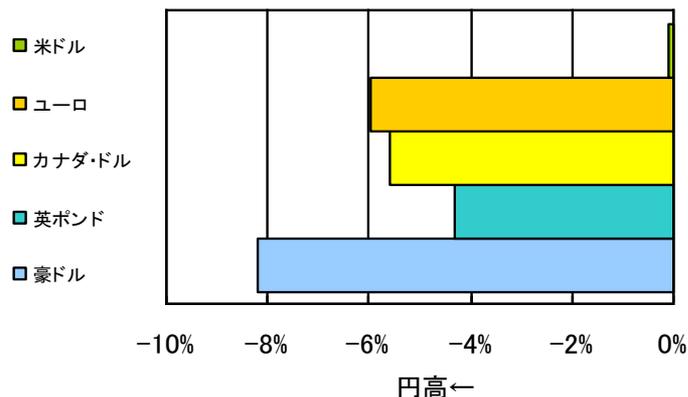
	記録 (算出日)	
IFIJ	最高値	19,788 (4/12)
	最低値	15,423 (9/29)
	平均値	17,842 —
	標準偏差	845 —
	データ数	184 —

Index Report (No.8)

BEI: バイオエネルギー指数
 IFIJ: 輸入食料指数

作成基準日: 2011年9月30日 公表日: 2011年10月14日

過去一ヶ月間の為替騰落率(参考)

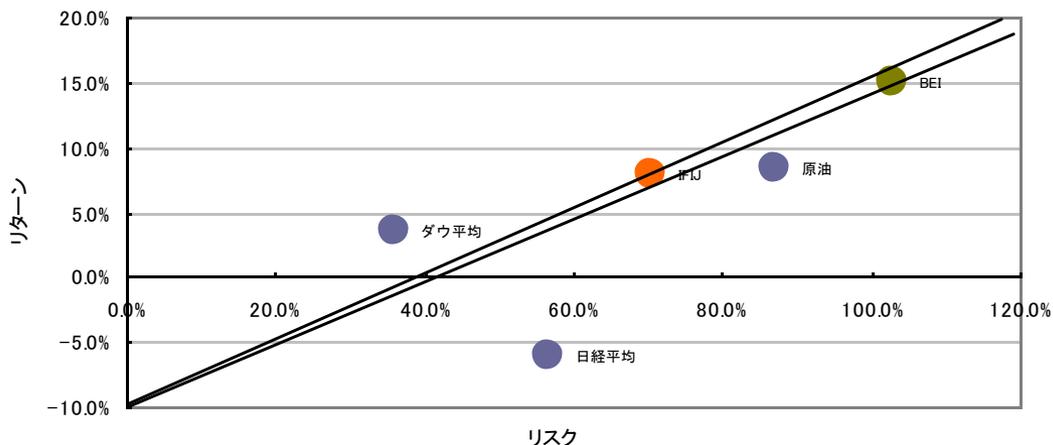


※ 三菱東京UFJ銀行公表の対顧客外国為替相場のTTM(中間値)を使用しています。

騰落率比較

	1ヶ月	3ヶ月	6ヵ月	1年	3年
BEI	-14.5%	-6.8%	-4.8%	11.4%	47.0%
IFIJ	-12.2%	-12.2%	-14.4%	6.0%	-6.2%
砂糖11号	-9.4%	-8.3%	-1.3%	0.1%	113.3%
トウモロコシ	-17.2%	-9.4%	-4.6%	25.2%	23.3%
小麦	-12.8%	2.0%	-10.0%	-4.3%	-2.1%
大豆	-15.1%	-7.8%	-10.3%	11.9%	12.4%
生牛	5.4%	7.8%	-0.1%	25.1%	22.8%
赤身豚肉	5.5%	-5.1%	-3.4%	17.1%	31.8%
アラビカ	-19.6%	-11.2%	-12.7%	24.4%	77.5%
オレンジJ	-8.6%	-21.8%	-5.7%	0.0%	75.2%
ココア	-9.5%	-9.8%	-10.2%	-9.3%	18.9%
ロブスタ	-15.5%	-19.5%	-22.2%	13.8%	-2.0%
菜種	-7.5%	-8.4%	-8.2%	12.6%	22.2%
原油	-7.6%	-13.3%	-21.2%	5.5%	-14.8%
ダウ平均	-3.5%	-9.0%	-9.7%	2.9%	7.6%
日経平均	-2.8%	-11.4%	-10.8%	-7.1%	-22.7%

リスク・リターン



	リターン	リスク	シャープレ
BEI	14.9%	103.1%	0.1443
IFIJ	7.8%	70.4%	0.1102
砂糖11号	7.7%	146.3%	0.0527
トウモロコシ	29.2%	130.5%	0.2240
小麦	3.6%	143.6%	0.0254
大豆	14.0%	82.5%	0.1695
生牛	24.1%	61.7%	0.3907
赤身豚肉	20.9%	111.5%	0.1871
アラビカ	29.7%	141.2%	0.2103
オレンジJ	4.8%	110.5%	0.0433
ココア	-5.7%	100.8%	-0.0564
ロブスタ	19.3%	126.4%	0.1524
菜種	13.5%	66.4%	0.2039
原油	8.3%	87.1%	0.0953
ダウ平均	3.4%	36.2%	0.0940
日経平均	-6.1%	56.8%	-0.1080

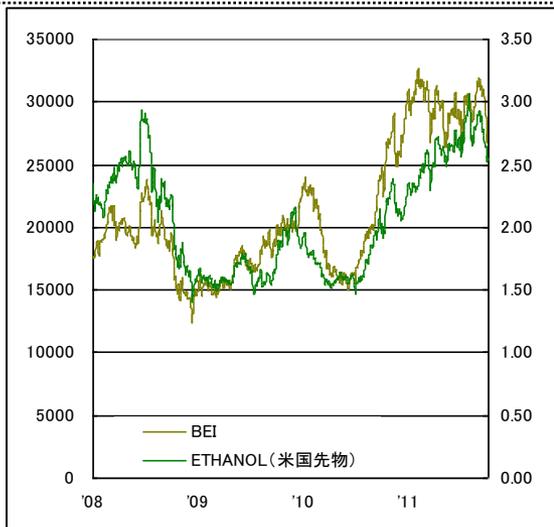
※リスク・リターンは、直近12ヶ月間の月間騰落率より算出しています。
 ※リスク・リターンは、全て現地通貨建のデータに基づき算出しています。

Index Report (No.8)

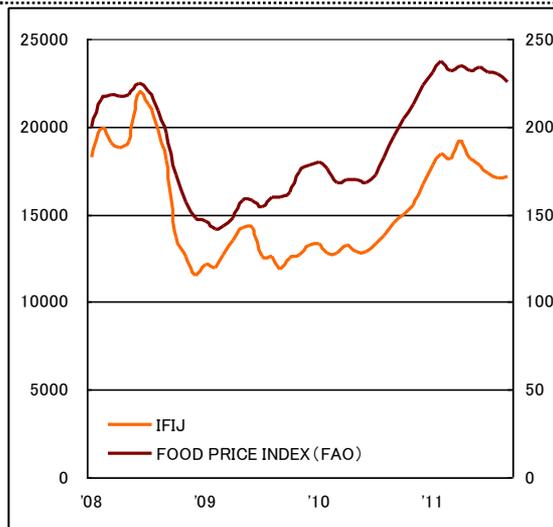
BEI: バイオエネルギー指数
IFIJ: 輸入食料指数

作成基準日: 2011年9月30日 公表日: 2011年10月14日

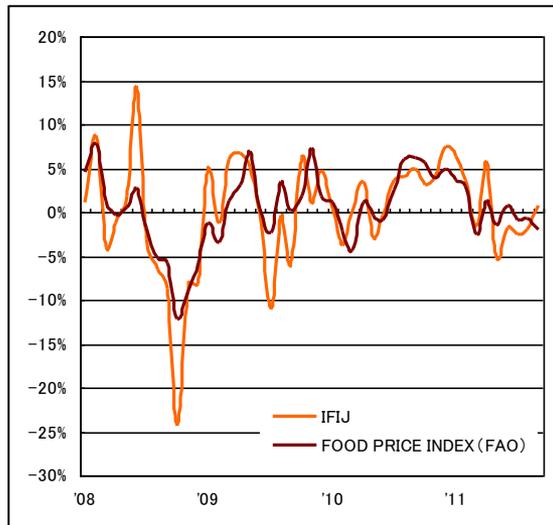
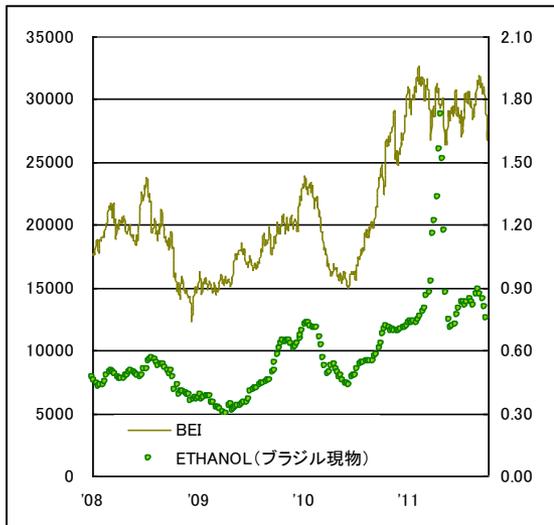
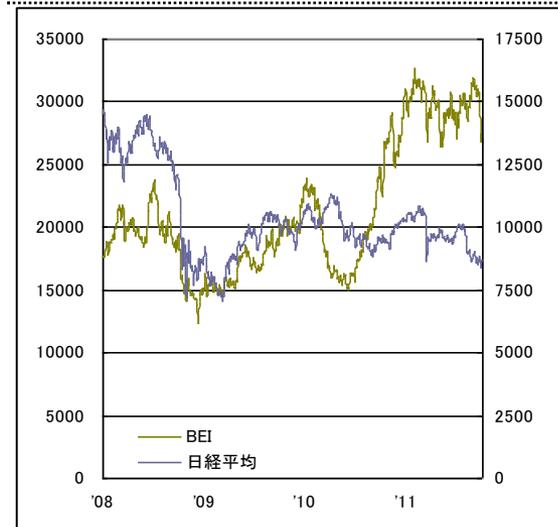
グラフ I : BEIとエタノール価格(先物・現物)



グラフ II : IFIJとFAO食料価格指数



グラフ III : BEI, IFIJと株価指数



[単位について] (1) BEI, IFIJ及びFAO食料価格指数: ポイント。(2) エタノール価格: 米国先物が「ガロンあたりドル」、ブラジル現物は「リットルあたりドル(週値)」。(3) 日経平均: 円

[グラフ II について] (1) 上段は、IFIJが月間中央値、FAOの食料価格指数は毎月公表される値の推移。(2) 下段は、月間変動率の推移。