

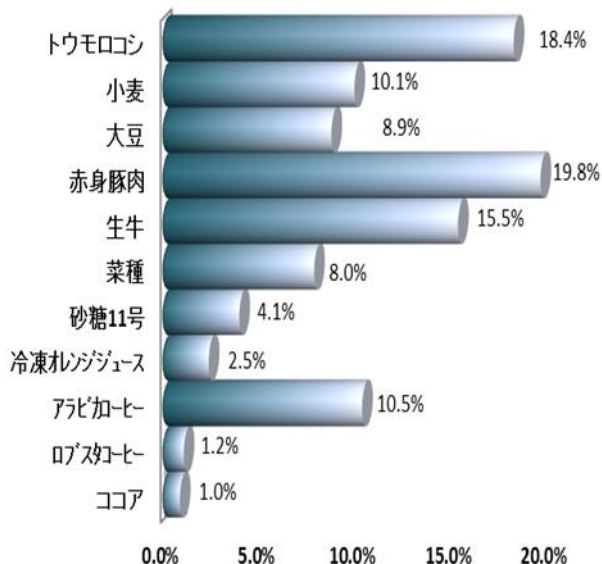
IFIJ(輸入食料指数)月間レポート No.11

作成基準日:2015年12月30日
公表日:2016年1月15日

指数構成銘柄の価格

配分比率

構成銘柄	作成基準日 現在	基準値 (2004年12月31日)
CME トウモロコシ	435.61円	209.95円
CME 小麦	571.70円	315.31円
CME 大豆	1,045.47円	561.66円
CME 赤身豚肉	71.08円	78.34円
CME 生牛	156.46円	92.13円
ICE CA 菜種	42,063円	22,925円
ICE US 砂糖11号	17.76円	9.26円
ICE US 冷凍オレンジJ	178.21円	88.28円
ICE US アラビカコーヒー	145.94円	106.38円
ICE EU ロブスタコーヒー	177,491円	74,854円
ICE EU ココア	399,769円	165,290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

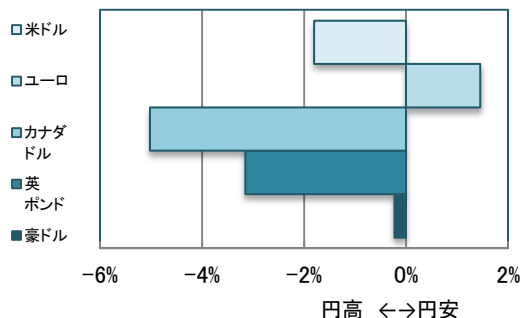
騰落率の比較

参考指標(年初来)

	1ヶ月	3ヶ月	6ヵ月	1年	3年
IFIJ	-1.3%	-2.4%	-11.8%	-17.7%	-7.6%
トウモロコシ	0.9%	-6.8%	-5.4%	-12.2%	-47.6%
小麦	2.1%	-5.6%	-18.0%	-22.7%	-38.4%
大豆	-0.3%	-1.6%	-13.2%	-16.5%	-38.7%
赤身豚肉	0.7%	-19.2%	-20.3%	-27.7%	-32.0%
生牛	-1.2%	0.8%	-13.0%	-21.8%	1.0%
菜種	4.4%	1.4%	-7.5%	6.6%	-18.2%
砂糖11号	-1.3%	25.7%	25.0%	1.2%	-24.0%
冷凍オレンジJ	3.6%	39.6%	27.6%	5.0%	13.8%
アラビカコーヒー	0.4%	0.5%	-7.1%	-26.5%	-17.9%
ロブスタコーヒー	-0.3%	-6.0%	-21.9%	-19.5%	-24.6%
ココア	-0.8%	2.9%	3.4%	13.2%	55.7%
原油	-9.2%	-16.3%	-35.1%	-29.4%	-58.3%
ダウ平均	-0.4%	10.4%	0.7%	-1.8%	35.3%
日経平均	-3.6%	9.5%	-5.9%	9.1%	83.1%

	記録	(算出日)
最高値	19,760	(1/6)
最低値	16,270	(9/8)
平均値	17,772	—
標準偏差	830	—
データ数	244	—

過去一ヶ月間の為替騰落率(参考)



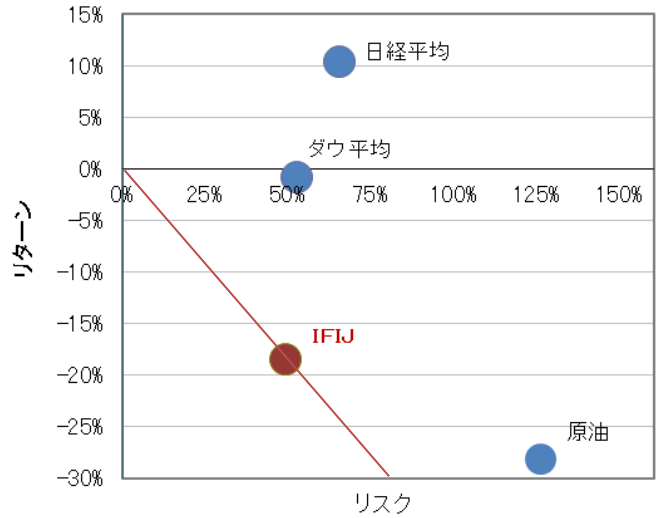
※ 三菱東京UFJ銀行公表の対顧客外国為替相場のTTM(中間値)を使用しています。

IFIJ(輸入食料指数)月間レポート No.11

作成基準日:2015年12月30日
公表日:2016年1月15日

リスク・リターン

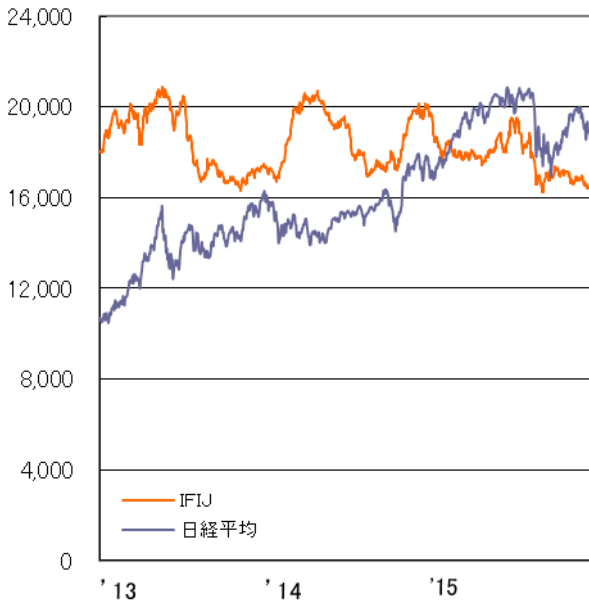
	リターン	リスク
IFIJ	-18.4%	48.8%
トウモロコシ	-11.2%	67.6%
小麦	-19.8%	121.0%
大豆	-16.4%	63.0%
赤身豚肉	-22.5%	157.6%
生牛	-22.7%	65.7%
菜種	7.5%	53.8%
砂糖11号	6.3%	118.1%
冷凍オレンジJ	12.4%	141.5%
アラビカコーヒー	-28.6%	65.9%
ロブスタコーヒー	-18.1%	97.2%
ココア	13.4%	50.2%
原油	-28.2%	126.0%
ダウ平均	-0.8%	52.3%
日経平均	10.4%	65.3%



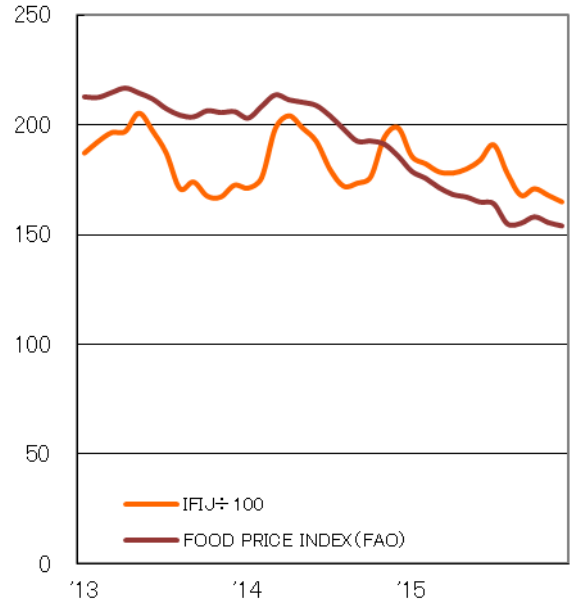
※ リスク・リターンは、直近12ヶ月間の月間騰落率により算出しています。
※ リスク・リターンは、全て現地通貨建のデータに基づき算出しています。

グラフ(参考)

IFIJと日経平均



IFIJ(1/100)とFAO食料価格指数



※ 単位について、IFIJ及びFAO食料価格指数はポイント、日経平均は円。
※ 「IFIJ(1/100)とFAO食料価格指数」のIFIJ(1/100)は月間中央値を100で除したものの。