

TOKYO MARKET DATA METRICS REPORT

日経平均株価マルチ・クオンツ定量分析ダッシュボード

基準日

2026/08/07

日経平均株価 大引値

65,606.71円

-76.55円
(-0.12%)

日経平均OHLCベース

相場環境判断：下落警戒局面

判定変化の主因：小動き、25日線割れ、日経VI 29.98

主要シグナル構成要素

Forward予測（参考値）

対象	トレンド	モメンタム	Vlt.
Nikkei 225	強含み	弱含み	中立
Score	+0.5	-0.2	0.7/5

※Vlt.Score：VI水準の警戒度0～5（+ -の方向性なし）

対象	翌日	5日	10日
Nikkei	47.5% -0.03%	46.3% -0.06%	46.5% -0.05%

Forward判断：下落継続に警戒。

CTAポジション評価シグナル & Data Metrics評価

売り優勢	中立帯	買い優勢
※表示スコア：過去分布の相対順位を-100～+100換算（-20～+20は中立帯）／前日＝前営業日スコア（緑＝買い方向へ変化・赤＝売り方向へ変化）		
Simple CTA トレンド推定		-10 前日-27 中立
VaR型CTA リスク調整		-23 前日-36 リスク圧縮
Data Metrics シグナル変更予兆		-25 前日-37 警戒

今回の評価コメント

結論：CTA推定シグナルは売り方向に傾いており、買いポジションの管理を優先したい。
CTA判断：終値は25日線を下回り、5日線は上回る。当日は-0.12%。Simple CTAは過去分布の中位圏。
VaR判断：日経VIは29.98（前日比+0.20、横ばい）。VaR型CTAはリスク量を圧縮する方向へ傾いた可能性。
過去分布順位：Simple 44.9% / VaR 38.4% / DM 37.6%（低いほど売りシグナル強）
前日スコア：Simple -27 / VaR -36 / DM -37 → 当日 -10 / -23 / -25（前日比 +17 / +13 / +12。総じて買いシグナル方向へ変化）
Forward判断：下落継続に警戒。
注目点：日経平均先物大証ラージ夜間取引引値に注目。CTAの売買シグナルに変化が生じるか要確認。