

Data Metrics Ver.2 IDS

Investment Decision Support

基準日：2026/08/07

【市場全体評価 & 投資行動戦略】

市場評価
下落警戒局面

CTA判断（推定）
売り優勢

日経平均株価
65,607
前日比
-76.55円
(-0.12%)

結論：下落警戒局面。 β を引き下げ、市場感応度の高い銘柄のリスク管理を優先する局面。
CTA判断（推定）：売り優勢。指数方向性の改善が確認されるまでは慎重に。
IDS判断：5営業日前期待中心値と現在値の乖離をボラティリティで評価し、日経平均とのRelative Returnで順位付け。
IDS履歴：個別銘柄履歴 50営業日、正式Relative Return算出 225銘柄。
前日比：日経平均は-76.55円、-0.12%の65,606.71円。

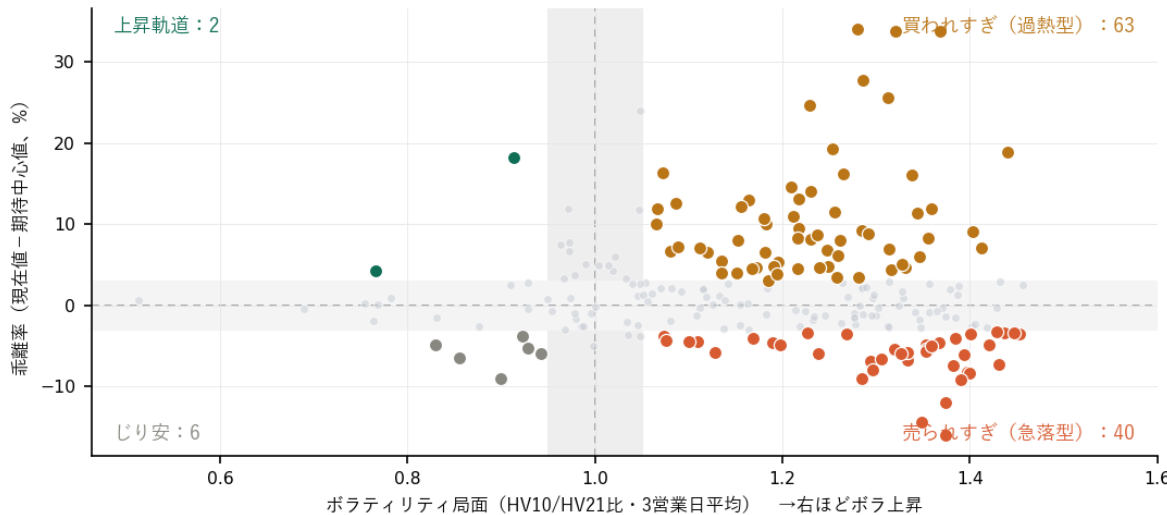
参考投資戦略案

上昇局面 β （市場感応度）高位維持を検討 ボックス局面 β （市場感応度）中立維持を検討
下落局面 β （市場感応度）引下げを検討

※ 本マップ（平均回帰型の乖離指標）は、トレンド継続を前提とした押し目検出の設計。下落局面では平均回帰の成立が保証されない。

【市場状態マップ | 乖離 × ボラティリティ 4象限】

縦軸＝5営業日前期待中心値との乖離率、横軸＝ボラ局面（HV10/HV21比・3営業日平均）。
下方乖離×ボラ上昇＝オーバーシュート由来の可能性（反発エネルギー大）、下方乖離×ボラ安定＝じり安（同 小）。



※ 各象限は乖離とボラティリティの「状態」の分類であり、取るべき行動は投資家のポジションと時間軸により異なる（売買の推奨ではない）。
※ 掲載は基準充足銘柄のみ・各象限最大10（掲載数は日々変動し、それ自体が市場状態の情報）。並びは乖離絶対値順で、優先順位ではない。
※ 「売られすぎ（急落型）」の乖離はオーバーシュート由来の可能性を示す物差しで、解消の時期・方向は保証されない。ボラ上昇局面では乖離がさらに拡大する場合がある。

売られすぎ（急落型） | 下方乖離 × ボラ上昇 | 40銘柄（乖離上位10表示）

順	コード	銘柄	株価	乖離	HV比	CTA
1	4901	富士フイルムH	3,236	-16.0%	1.37	-80
2	2413	エムスリー	1,530	-14.3%	1.35	-80
3	4661	オリエンタル	2,979	-12.0%	1.37	+55
4	9064	ヤマトホールデ	1,936	-9.1%	1.39	+24
5	9008	京王電鉄	754	-9.0%	1.28	-64
6	9020	東日本旅客鉄道	3,461	-8.3%	1.40	+12
7	7270	S U B A R U	2,568	-8.3%	1.40	+27
8	6954	ファナック	6,535	-7.9%	1.30	+22
9	7269	スズキ	1,956	-7.4%	1.38	-13
10	7202	いすゞ自動車	2,290	-7.2%	1.43	+7

買われすぎ（過熱型） | 上方乖離 × ボラ上昇 | 63銘柄（乖離上位10表示）

順	コード	銘柄	株価	乖離	HV比	CTA
1	5801	古河電気工業	3,856	+34.1%	1.28	+39
2	7272	ヤマハ発動機	1,842	+33.9%	1.37	+37
3	5803	フジクラ	5,185	+33.8%	1.32	+80
4	4004	レゾナック・ホ	16,395	+27.7%	1.29	+80
5	4062	イビデン	19,110	+25.6%	1.31	+60
6	6645	オムロン	6,632	+24.7%	1.23	+24
7	6723	ルネサスエレクト	3,757	+19.3%	1.25	-22
8	8309	三井住友トラ	1,680	+19.0%	1.44	-2
9	285A	キオクシアホー	47,730	+16.4%	1.07	-78
10	5301	東海カーボン	1,734	+16.2%	1.26	+39

じり安 | 下方乖離 × ボラ安定 | 6銘柄

順	コード	銘柄	株価	乖離	HV比	CTA
1	7211	三菱自動車工業	349	-9.0%	0.90	+13
2	1605	I N P E X	3,499	-6.4%	0.85	+49
3	8002	丸紅	5,024	-5.9%	0.94	+23
4	8766	東京海上ホール	7,939	-5.3%	0.93	+57
5	8725	M S & A D イン	4,850	-4.8%	0.83	+47
6	1812	鹿島建設	5,059	-3.8%	0.92	-67

上昇軌道 | 上方乖離 × ボラ安定 | 2銘柄

順	コード	銘柄	株価	乖離	HV比	CTA
1	6506	安川電機	5,266	+18.2%	0.91	-1
2	5631	日本製鋼所	7,744	+4.3%	0.77	+39

※ 本資料は投資判断を支援する情報提供を目的としたもので、個別銘柄の売買を推奨するものではありません。
※ 期待収益・相対収益は、5営業日前時点の期待中心値への回帰をボラティリティ上限（ $\pm 2\sigma$ ）で制限した理論値であり、リターンは予測値ではありません。

Data Metrics Ver.2 IDS

β 分析レポート

基準日：2026/08/07

【 β 別 期待リターン＋銘柄】

相対収益がプラスの銘柄のうち、 β 21を参考に高 β ・低 β の2群を抽出。

※ β 別ランキングは、市場方向の影響を除いた相対評価。方向感の乏しいボックス局面での銘柄間比較を想定した設計。

高 β （市場感応度が高い）かつ期待リターン＋銘柄20

順	コード	銘柄	株価	期待収益	相対収益	β 21	β 10
1	6857	アドバンテスト	32,190	+2.3%	+6.2%	2.41	3.00
2	6752	パナソニック	4,312	-2.5%	+1.3%	1.72	2.75
3	6504	富士電機	14,630	-1.7%	+2.2%	1.44	2.05
4	6503	三菱電機	5,826	+1.3%	+5.2%	1.37	1.89
5	6954	ファナック	6,535	+8.6%	+12.4%	1.30	1.73
6	5332	T O T O	6,483	+4.1%	+8.0%	1.17	1.73
7	6113	アマダ	2,708	+0.9%	+4.8%	1.14	1.63
8	5214	日本電気硝子	4,928	+3.7%	+7.6%	1.01	1.63
9	8411	みずほフィナンシャルグループ	8,446	-2.1%	+1.8%	0.95	1.06
10	4021	日産化学工業	7,495	-2.7%	+1.2%	0.83	0.82
11	6971	京セラ	3,792	-3.3%	+0.5%	0.81	1.07
12	4188	三菱ケミカルHD	1,219	-0.9%	+3.0%	0.77	1.03
13	6471	日本精工	1,174	-1.9%	+2.0%	0.75	0.85
14	8591	オリックス	6,336	+2.1%	+6.0%	0.71	0.68
15	9502	中部電力	2,708	+0.4%	+4.3%	0.70	0.73
16	6473	ジェイテクト	2,159	+5.1%	+9.0%	0.68	0.86
17	6472	N T N	392	-0.9%	+2.9%	0.63	0.51
18	8331	千葉銀行	2,666	-0.1%	+3.7%	0.62	0.33
19	8697	日本取引所グループ	2,264	-1.7%	+2.2%	0.61	0.50
20	7012	川崎重工業	2,778	+0.2%	+4.1%	0.61	0.75

低 β （市場感応度が低い）かつ期待リターン＋銘柄20

順	コード	銘柄	株価	期待収益	相対収益	β 21	β 10
1	4307	野村総合研究所	4,859	-2.4%	+1.5%	-0.87	-1.73
2	9602	東宝	1,501	+6.3%	+10.2%	-0.83	-1.06
3	3697	S H I F T	896	+6.2%	+10.0%	-0.75	-0.83
4	3382	7 & i H D	2,098	+2.6%	+6.5%	-0.74	-0.99
5	7974	任天堂	8,043	-2.2%	+1.7%	-0.72	-0.97
6	9766	コナミ	21,045	+2.4%	+6.2%	-0.69	-1.11
7	2871	ニチレイ	2,226	+0.3%	+4.1%	-0.61	-0.95
8	7532	パン・パシフィックIH	918	+1.5%	+5.4%	-0.59	-0.83
9	4324	電通	3,655	+0.8%	+4.7%	-0.57	-0.91
10	2501	サッポロホールディングス	1,960	+4.6%	+8.5%	-0.54	-0.65
11	8267	イオン	1,391	-0.6%	+3.2%	-0.52	-0.73
12	2413	エムスリー	1,530	+12.4%	+16.3%	-0.50	-0.95
13	4543	テルモ	2,373	-0.2%	+3.7%	-0.50	-0.67
14	2002	日清製粉グループ本社	2,001	+1.5%	+5.4%	-0.49	-0.70
15	3092	Z O Z O	1,149	+0.0%	+3.9%	-0.48	-0.72
16	2502	アサヒグループHD	1,694	+0.7%	+4.6%	-0.46	-0.80
17	2282	日本ハム	6,110	+3.5%	+7.4%	-0.44	-0.64
18	9007	小田急電鉄	1,707	+5.2%	+9.1%	-0.44	-0.56
19	4751	サイバーエージェント	1,499	-1.3%	+2.6%	-0.43	-0.81
20	9021	西日本旅客鉄道	2,926	+5.7%	+9.6%	-0.43	-0.60

Source: history_nikkei225_constituents_YYYYMMDD.csv / 225採用銘柄引値.xlsx

※ 本資料は投資判断を支援する情報提供を目的としたもので、個別銘柄の売買を推奨するものではありません。
※ 期待収益・相対収益は、5営業日前時点の期待中心値への回帰をボラティリティ上限（ $\pm 2\sigma$ ）で制限した理論値であり、リターンの予測値ではありません。

Data Metrics Ver.2 IDS

CTA型シグナル推定レポート

基準日：2026/08/07

【CTA型シグナル推定（個別銘柄）】

東京版Simple CTAと同一のトレンド判定ロジック（5日線・25日線の位置と乖離＋モメンタム）を各銘柄の終値履歴に適用し、CTA型トレンドフォロー戦略の売買判定を銘柄別に推定したものの、HV21＝21日ヒストリカル・ボラティリティ（年率換算）。同水準のシグナルでもHV21が高い銘柄ほど値動きのリスク量が大きく、CTA流のボラティリティ・ターゲティングではポジションを小さくする対象。スコア換算：線形換算（参考値・履歴252日到達後に相対順位へ自動移行） | 算出対象 225銘柄

※シグナル強度に沿った順張り（トレンドフォロー）設計であり、トレンド反転局面が構造上の弱点。Data Metrics（予兆）との併読を想定。1・2ページの平均回帰型（逆張り系）とは評価軸が異なるため、両者で正反対の評価となる銘柄があるのは仕様。

【CTA型シグナル 銘柄内訳】 買い 141 / 中立 45 / 売り 39 / 判定無 0（採用 225銘柄・ネット+102）

売り 39	中立 45	買い 141
-------	-------	--------

※ 帯の長さは銘柄数の比率。買い＝スコア+20超、中立帯＝-20以上+20以下、売り＝-20未満。
判定無＝上場後の履歴が26営業日未満等で算出対象外。内訳は分布であり、売買の推奨ではありません。

CTA型買いシグナル推定 上位20（スコア+20超）

順	コード	銘柄	株価	当日比	5日騰落	MA5乖離	HV21	CTAスコア
1	2269	明治ホールディングス	4,110	+2.44%	+8.47%	+7.57%	48.3%	+80
2	2503	麒麟ホールディングス	3,038	+3.79%	+2.88%	+4.32%	33.6%	+80
3	2768	双日	5,668	+2.31%	+5.33%	+4.89%	30.9%	+80
4	4755	楽天	886	+3.08%	+6.35%	+4.05%	23.0%	+80
5	4689	LINEヤフー	484	+2.89%	+8.24%	+4.16%	30.6%	+80
6	4578	大塚ホールディングス	12,705	+4.40%	+14.46%	+5.53%	31.6%	+80
7	4324	電通	3,655	+2.99%	+3.10%	+3.45%	44.6%	+80
8	4188	三菱ケミカルHD	1,219	+2.91%	+2.61%	+4.89%	41.6%	+80
9	4004	レゾナック・ホールディ	16,395	+8.18%	+19.45%	+7.20%	95.6%	+80
10	3697	S H I F T	896	+8.39%	+2.14%	+4.58%	77.1%	+80
11	3405	クラレ	1,954	+3.66%	+6.22%	+5.15%	27.7%	+80
12	3402	東レ	1,355	+4.27%	+17.01%	+10.72%	42.6%	+80
13	3401	帝人	1,752	+4.13%	+7.03%	+5.26%	30.5%	+80
14	5711	三菱マテリアル	5,157	+15.71%	+22.99%	+15.67%	75.2%	+80
15	6701	N E C	4,862	+3.67%	+2.57%	+3.39%	46.2%	+80
16	6702	富士通	3,675	+2.68%	+0.44%	+3.97%	49.7%	+80
17	5803	フジクラ	5,185	+12.82%	+24.28%	+9.06%	100.6%	+80
18	5831	しずおかフィナンシャル	3,413	+4.47%	+7.33%	+5.05%	39.7%	+80
19	5714	D O W Aホールディング	9,137	+2.58%	+10.95%	+6.35%	42.0%	+80
20	9766	コナミ	21,045	+3.80%	+1.96%	+3.11%	60.6%	+80

CTA型売りシグナル推定 上位20（スコア-20未満）

順	コード	銘柄	株価	当日比	5日騰落	MA5乖離	HV21	CTAスコア
1	1801	大成建設	12,890	-5.05%	-1.34%	-1.41%	36.0%	-80
2	1802	大林組	3,030	-4.20%	-4.24%	-2.69%	21.6%	-80
3	2413	エムスリー	1,530	-16.89%	-14.12%	-11.59%	74.8%	-80
4	4061	デンカ	3,575	-4.89%	+4.23%	-1.67%	59.3%	-80
5	4901	富士フイルムHD	3,236	-16.55%	-14.21%	-12.37%	65.0%	-80
6	6113	アマダ	2,708	-7.88%	-2.83%	-4.42%	56.6%	-80
7	7735	SCREENホールディ	13,085	-4.42%	+3.85%	-0.70%	96.6%	-80
8	6146	ディスコ	58,440	-5.11%	-0.07%	-4.25%	94.2%	-80
9	6976	太陽誘電	9,699	-2.41%	-5.14%	-4.93%	133.9%	-80
10	6920	レーザーテック	37,460	-13.55%	-1.19%	-11.85%	111.8%	-80
11	285A	キオクシアホールディン	47,730	-2.07%	+2.65%	-5.31%	160.4%	-78
12	3436	S U M C O	3,470	-2.09%	+3.37%	-2.37%	132.2%	-73
13	5333	日本碍子	5,642	-2.25%	+0.86%	-0.94%	61.8%	-72
14	6981	村田製作所	7,263	-2.13%	-2.06%	-1.33%	111.7%	-71
15	6361	荏原製作所	5,686	-2.84%	+2.30%	-1.62%	73.1%	-71
16	8591	オリックス	6,336	-2.72%	-1.15%	-1.22%	37.0%	-70
17	6526	ソシオネクスト	1,981	-1.49%	+3.58%	-2.72%	79.5%	-67
18	8035	東京エレクトロン	54,500	-1.50%	-1.80%	-2.70%	76.8%	-67
19	9984	ソフトバンクグループ	5,552	-2.51%	+5.55%	-0.24%	106.7%	-67
20	1812	鹿島建設	5,059	-1.48%	-6.02%	-2.75%	23.6%	-67

※ 実際のCTA（商品投資顧問業者）が取引するのは日経225先物等の指数先物であり、個別株ではありません。
本表は指数CTAと同一ロジックを個別銘柄に適用した場合の推定値であり、実際のCTAポジションを示すものではありません。

Source: history_nikkei225_constituents_YYYYMMDD.csv（各銘柄26営業日以上で算出）

※ 本資料は投資判断を支援する情報提供を目的としたもので、個別銘柄の売買を推奨するものではありません。
※ 期待収益・相対収益は、5営業日前時点の期待中心値への回帰をボラティリティ上限（±2σ）で制限した理論値であり、リターンの予測値ではありません。