

一時間の時刻ずれは、存在しない予測を作る [F042]

時刻が正しければ、一時間先を当てる力は十二対のどれにも無い（日次 t の絶対値が 2 以上は 0 対）——夏のあいだだけ一時間ずらすと、十二対すべてが 2 を超える——そしてずれた夏の値は、同時刻の値と 0.000000 まで一致する

山岸 勇輝 (Yuuki YAMAGISHI) / Independent Researcher

ORCID 0009-0006-8587-3450

2026年9月 / CC BY 4.0

要旨

本稿が問うのは、片方のデータだけ夏に一時間ずれていたとき、存在しない予測がどれだけ作られるか、である——答えは、ゼロだったものが十二対すべてで有意になる。新しい数学定理も新しい法則も主張しない。

第一に、時刻が正しければ、一時間先を当てる力は無い。十二対の D は中央 -0.0363 pips、日次 t の絶対値が 2 以上になった対は 0 である（第3節）。

第二に、これが本稿の芯である。★夏のあいだだけ一時間ずらすと、十二対すべてが 2 を超える。EURUSD → GBPUSD は 27.5623、GBPUSD → EURUSD は 28.5147 である（第3節）。

第三に、冬は何も変わっていない。冬の差（ずれ－正しい）は最大の絶対値 0.000000 である。★触ったのは夏だけなので、当然である。検算にはなるが発見ではない（第4節）。

第四に、★ずれた夏の値は、同時刻の値そのものである。十二対すべてで差の絶対値は 0.000000 である。一時間先を測っているつもりで、同じ一時間を測っていた（第5節）。

第五に、★だから符号は、同時刻の相関の符号に従う。USDJPY → XAUUSD は -8.6852 、EURUSD → XAUUSD は 9.3861 pips である。「予測」の向きは、ただの同時刻の向きである（第5節）。

第六に、★年ごとに見ると、六年すべてで正になる対が 12 のうち 6 できる。正しい時刻では 0 である。「六年中六年黒字」という見かけが、ずれだけで作られる（第6節）。

本稿の射程（scope note）：新しい数学定理も新しい法則も主張しない——夏時間、時刻の突き合わせ、同時刻相関はすべて既知である。特定の商材や提唱者を論じない——実在の教材、その著者、販売元は主題ではなく、一切名指さない。実在のデータ提供元を論じない——ずれは本稿が意図的に作ったもので、どの提供元がずれているという主張はしない（第7節）。売買を論じない——コストもスリッページも入れておらず、中値で測っている（第7節）。予測の存在を主張しない——正しい時刻での一時間先はゼロであり、本稿はそれを確かめただけである（第3節）。ずれ方を一通りに固定している——欧州夏時間の期間だけ、一時間ぶんだけである（第7節）。射程は日中・少数銘柄に限る——四銘柄・六年・1 時間足の測定である。月次の時系列モメンタム（数十市場・保有1～12ヶ月）は学術的に文書化されており、本稿はそれを否定しない。予測を主張しない。

1. 記法と問い

別々の出所のデータを突き合わせるとき、片方だけ現地時刻だったことがある。

言われること	言われないこと
片方が一時間先を予測している	二つの時刻が同じ規約かどうか
どの年でも黒字だった	夏と冬で成績が違わないか
t 値が大きいので確かである	大きな t は、ずれでも作れること

観察 1.1：★ 夏時間のある地域の現地時刻は、夏のあいだだけ協定世界時から一時間ずれる。冬は一致する。

観察 1.2：★ そのとき「一時間先」を要求すると、夏のあいだは「同じ一時間」が返る。同時刻の相関は強いので、予測でないものが予測に見える。

観察 1.3：分離子は、時刻の扱いである。データ・量・対・期間をすべて固定し、夏のあいだの参照を一本ずらすかどうかだけを変える。規約の取り方が答えを作る例は [F040] で、参照する時点の効果は [F041] で測ってある。

問い：夏だけ一時間ずれていると、存在しない予測はどれだけ作られるのか。

2. 測る量と設計を、先に書く

走らせる前に宣言し、実行時には変えていない。

格子	1 時間足（中値・完成足のみ）。時刻は協定世界時
先行	その一時間の値動きの符号
後追い	次の一時間の値動き（pips）
ずれ	欧州夏時間（三月最終日曜 01:00 UTC ～ 十月最終日曜 01:00 UTC）のあいだだけ、後追いの参照を一本前にする（＝同時刻になる）
対	四銘柄から十二通りの順序対
測る量	$D = (\text{先行の符号} \times \text{後追いの値動き})$ の平均（pips）／日次 t ／件数
同時刻	比べるために、後追いの 同じ一時間 の値動きでも測る
分離子	時刻の扱い（正しいか、夏だけ一時間ずれているか）
銘柄・期間	USDJPY・EURUSD・GBPUSD・XAUUSD／2019–2024

観察 2.1：★ ずれは本稿が意図的に作っている。どの提供元がずれているという主張はしない。測っているのは「ずれたら何が起きるか」である。

観察 2.2：対ごとに共通の時刻だけを使う。USDJPY → EURUSD では **36,106** 本で、夏の割合は **0.5802** である。

観察 2.3：★ 先行の符号は、その一時間の始値から終値への向きである。完成した足なので、次の一時間を見るのに先読みは無い。

観察 2.4：十二通りの順序対をすべて測る。★ 先行と後追いを入れ替えた対も別に数える。

予言（測る前に書いた）

- ① 時刻が正しければ、一時間先の予測はゼロである。
- ② 夏だけ一時間ずらすと、夏の値が大きく正になり、冬は変わらない。
- ③ 夏冬をまとめても、正に出る。
- ④ ずらした版の夏の値は、同時刻の値とほぼ一致する。
- ⑤ 年ごとに見ると、ほとんどの年で正になる。

3. 時刻が正しいときと、夏だけ一時間ずれているとき

同じデータ・同じ量。違うのは夏のあいだの参照だけである。

計算 3.1 十二の順序対

先行 → 後追い	正しい D	正しい t	ずれ D	ずれ t
USDJPY → EURUSD	−0.0073	−0.2899	−1.5362	−17.8202
USDJPY → GBPUSD	−0.0264	−0.7194	−1.8679	−15.2583
USDJPY → XAUUSD	−0.0054	1.3851	−5.3203	−11.7157
EURUSD → USDJPY	0.0324	1.5019	−1.9923	−14.6412
EURUSD → GBPUSD	−0.1260	−0.9503	3.5583	27.5623
EURUSD → XAUUSD	−0.3250	−1.6847	5.5340	13.6119
GBPUSD → USDJPY	0.0951	1.4962	−1.6107	−10.8203
GBPUSD → EURUSD	−0.0463	−0.1187	2.5690	28.5147
GBPUSD → XAUUSD	−0.2287	−1.2349	4.8788	11.2282
XAUUSD → USDJPY	0.0614	1.8093	−2.0629	−11.7241
XAUUSD → EURUSD	−0.0785	−1.5087	1.5967	16.9711
XAUUSD → GBPUSD	−0.1207	−1.5175	1.9406	13.5275

観察 3.2：予言①は当たった。正しい時刻の D は中央 **−0.0363** pips、日次 t の絶対値が 2 以上になった対は 12 のうち 0 である。

観察 3.3：★これが本稿の芯である。夏だけずらすと、十二対すべてが 2 を超える。最大は **GBPUSD → EURUSD** の **28.5147**、次が **EURUSD → GBPUSD** の **27.5623** である。

観察 3.4：★一つの対も例外が無い。0 対 12 から 12 対 12 へ、ずれだけで移る。

観察 3.5：D の大きさも桁が変わる。正しい時刻では **−0.3250** から **0.0951** pips だが、ずらすと **−5.3203** から **5.5340** pips になる。

観察 3.6：★ ただし中央値は 0.0303 pips で小さい。 符号が対によって割れるからである。 十二対をまとめた一つの数だけ見ると、異変に気づけない。

4. 夏と冬に分ける

ずらしたのは夏だけである。 冬は何も触っていない。

計算 4.1 十二対の中央

	夏 正しい	夏 ずれ	冬 正しい	冬 ずれ
十二対の中央	- 0.0109	0.0550	- 0.0957	- 0.0957

観察 4.2：冬の差（ずれ - 正しい）は、最大の絶対値が 0.000000 である。 ★ 触っていないので当然で、検算にはなるが発見ではない。

観察 4.3：★ 夏の差は中央 0.0887、幅 -8.7858 から 9.6806 である。 対によって符号も大きさもまったく違う。

観察 4.4：★ だから「夏と冬で成績が違う」を見れば気づける。 USDJPY → XAUUSD は夏 -8.6852、冬 -0.1612 pips である。

観察 4.5：逆に、夏と冬を分けずに一つの数で報告すると、気づけない。 ★ 中央値は 0.0303 pips で、正しい時刻の -0.0363 pips とさほど変わらない。

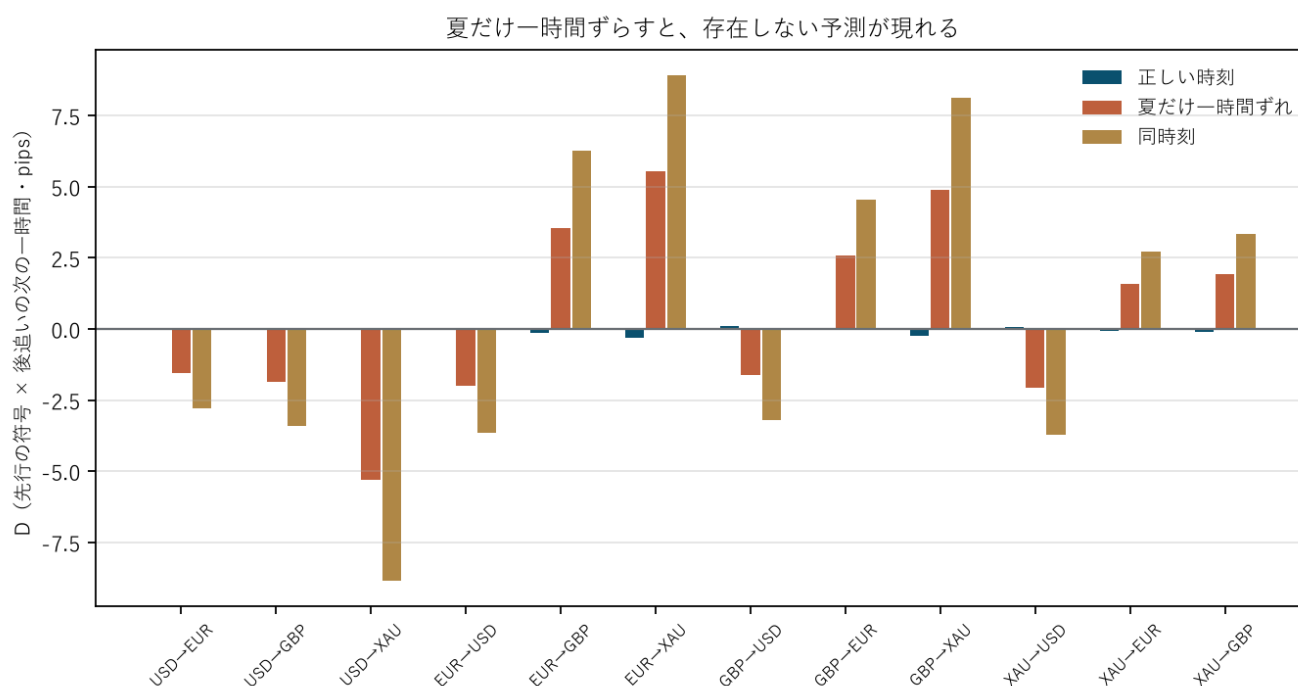


図1：十二の順序対について、D（先行の符号 × 後追いの次の一時間・pips）。左から正しい時刻、夏だけ一時間ずれ、同時刻である。

5. ずれた値は、何の写しか

ずらした版の夏を、同時刻の値と並べる。

計算 5.1 夏の値と、同時刻の値

先行 → 後追い	夏 ずれ	同時刻	差
USDJPY → EURUSD	-2.6183	-2.6183	0.000000
USDJPY → XAUUSD	-8.6852	-8.6852	0.000000
EURUSD → GBPUSD	6.1925	6.1925	0.000000
EURUSD → XAUUSD	9.3861	9.3861	0.000000
GBPUSD → XAUUSD	8.3689	8.3689	0.000000
XAUUSD → GBPUSD	3.2700	3.2700	0.000000

観察 5.2：★ 十二対すべてで、差の絶対値は **0.000000** である。ずらした版の夏は、同時刻の値そのものである。

観察 5.3：★ つまり一時間先を測っているつもりで、同じ一時間を測っていた。予言④は当たった。設計からそうなるので、これは検算である。

観察 5.4：★ だから符号は、同時刻の相関の符号に従う。USDJPY → XAUUSD は **-8.6852**、EURUSD → XAUUSD は **9.3861 pips** である。「予測」の向きは、ただの同時刻の向きである。

観察 5.5：同時刻の **D** を全期間で見ると、中央 **-0.0306 pips**・日次 **t -0.5136** である。★ 夏冬をまとめると符号が割れて小さくなるので、対ごとに見なければ大きさは分からない。

6. 年ごとに見る

「N 年中 N 年黒字」という見かけが、ずれだけで作られるか。

計算 6.1 年ごとの中央と、正だった対の数

年	正しい 中央	正しいが正の対	ずれ 中央	ずれが正の対
2019	0.0403	7	0.0536	6
2020	−0.0866	2	0.3131	6
2021	−0.0265	6	0.2519	6
2022	−0.1977	5	0.1736	6
2023	−0.0388	3	0.1360	6
2024	0.0162	6	0.0033	6

観察 6.2：★ 六年すべてで正だった対は、ずれで 12 のうち 6、正しい時刻で 12 のうち 0 である。予言⑤は当たった。

観察 6.3：★ 「六年中六年黒字」という見かけが、ずれだけで作られる。しかも半数の対でそうなる。

観察 6.4：年 × 対の 72 通りで正だったのは、正しい時刻で 29、ずれで 36 である。★ 全体の割合だけ見ると差は小さい。効いているのは「同じ対がずっと正のままになる」という一貫性のほうである。

観察 6.5：ずれた版は、正の対の数が六年すべてで 6 である。★ 年ごとの中央値は 0.0033 から 0.3131 まで動くのに、どの対が正かは動かない。

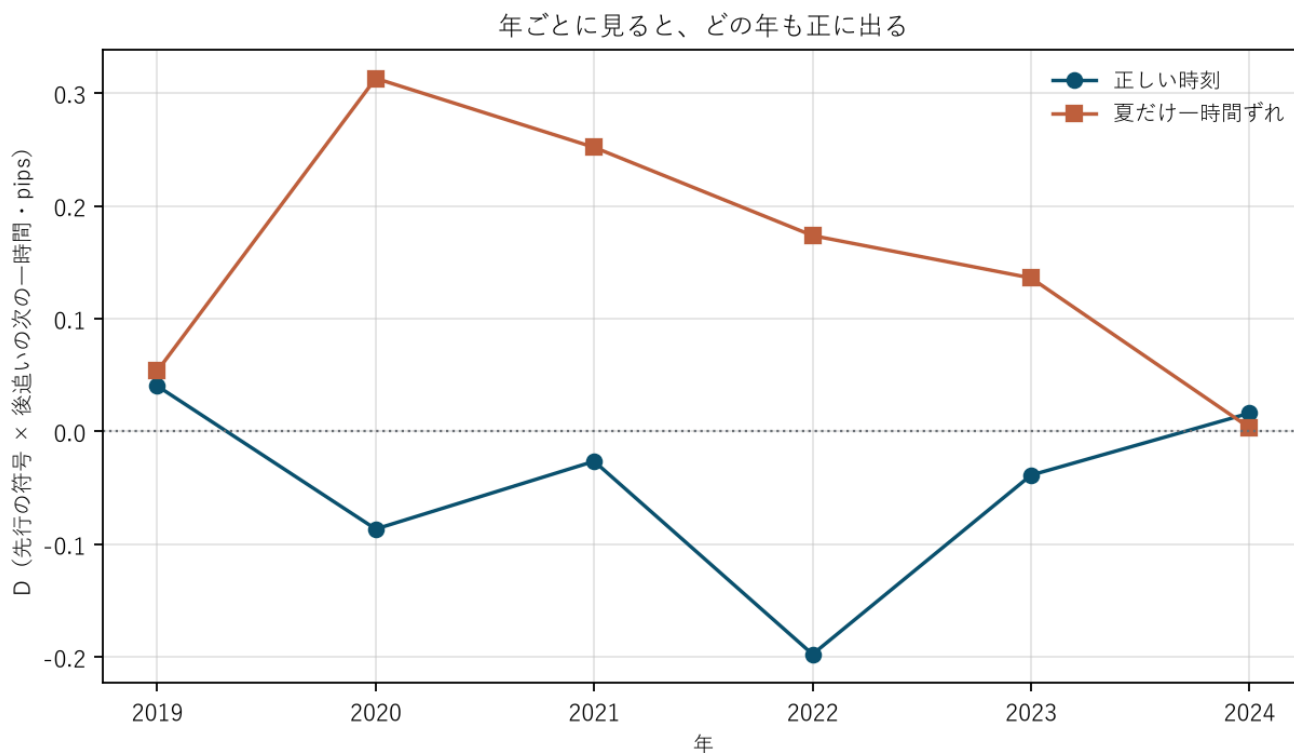


図2：横が年、縦が十二対の D の中央 (pips)。丸が正しい時刻、四角が夏だけ一時間ずれである。点線は 0 である。

7. 限界

1. ⚠️ ずれは本稿が意図的に作ったものである。どの提供元がずれているという主張はしない。
2. ずれ方を一通りに固定している。欧州夏時間の期間だけ、一時間ぶんだけである。
3. 量を一つに固定している。先行の符号 × 後追いの次の一時間だけで、他の量では測っていない。
4. 格子を一つに固定している。1 時間足なので、ずれがちょうど一本ぶんになる。別の足種では効き方が変わる。
5. 売買を論じていない。コストもスリッページも入れておらず、中値で測っている。
6. 同時刻の相関そのものを主題にしていない。大きさも機序も測っていない。
7. 正しい時刻での一時間先がゼロであることを、本稿は確かめただけである。それ自体は既知である。

8. 四銘柄・六年・1時間足である。他の市場、他の期間について述べるものではない。

結び

別々の出所のデータを突き合わせるとき、片方だけ現地時刻だったことがある。夏時間のある地域なら、夏のあいだだけ一時間ずれる。

時刻が正しければ、一時間先を当てる力はない。十二対の D は中央 -0.0363 pips、日次 t の絶対値が 2 以上になった対は 0 である。

★夏のあいだだけ一時間ずらすと、十二対すべてが 2 を超える。最大は 28.5147、次が 27.5623 である。0 対 12 から 12 対 12 へ、ずれだけで移る。一つの対も例外が無い。

★そしてずれた夏の値は、同時刻の値そのものである。十二対すべてで差の絶対値は 0.000000。一時間先を測っているつもりで、同じ一時間を測っていた。

★だから「予測」の向きは、ただの同時刻の向きである。USDJPY → XAUUSD は -8.6852 、EURUSD → XAUUSD は 9.3861 pips で、符号は同時刻の相関に従う。

★年ごとに見ると、六年すべてで正になる対が 12 のうち 6 できる。正しい時刻では 0 である。「六年中六年黒字」という見かけが、ずれだけで、しかも半数の対で作られる。

そして気づける場所と、気づけない場所がある。★夏と冬に分ければ、USDJPY → XAUUSD は夏 -8.6852 ・冬 -0.1612 pips と一目で分かる。だが十二対をまとめた中央値は 0.0303 pips で、正しい時刻の -0.0363 pips とさほど変わらない。まとめた一つの数だけ見れば、異変は消える。

したがって、別々の出所を突き合わせたら、まず夏と冬に分けて並べるべきである。★そして大きな t は、確かさの証拠ではない。ずれでも作れる。

データと再現

データ	為替は Dukascopy 由来のティック（2019 年以降はミリ秒・bid・ask まで一致することを確認済み）。金は Dukascopy
期間	2019–2024（六年）
銘柄	USDJPY・EURUSD・GBPUSD・XAUUSD（十二の順序対）
足	1 時間足・中値・完成足のみ。時刻は協定世界時。ティックの無い足は作らない
そろえ	対ごとに共通の時刻だけを使う（USDJPY → EURUSD で 36,106 本・夏の割合 0.5802）
先行	その一時間の始値から終値への向きの符号
後追い	次の一時間の値動き（pips）
ずれ	欧州夏時間（三月最終日曜 01:00 UTC ~ 十月最終日曜 01:00 UTC）のあいだだけ、後追いの参照を一本前にする
測る量	$D = (\text{先行の符号} \times \text{後追いの値動き})$ の平均 / 日次 t / 件数
検算	<code>検算/F042.py</code> （ <code>--zu</code> で図も書き出す）。本文の数字はすべて <code>検算/F042_output.txt</code> から取っている
図	<code>図/F042_zu1</code> ・ <code>図/F042_zu2</code> （png・svg・英語版）
土台の検査	<code>_ツール/audit_bars.py</code> （足の先読み・夏時間・日の区切り）。記録は <code>_土台の検査.txt</code>

参考文献

- 山岸勇輝 (2026). 練行足の転換点は、完成するまで転換点ではない [F040]. Zenodo. 10.5281/zenodo.22894529

- 山岸勇輝 (2026). 分に丸めた記録のずれは、反応したかどうかには属している [F041]. Zenodo. 10.5281/zenodo.22894667