



ラリー・ウィリアムズのパートナー なりた・ひろゆきと

米アマゾンの第一人者、エール・ハーシュのあとを継いだ ジェフリー・A・ハーシュによる

主要市場を分析した最新相場予測レポート！

▼▼▼ご購入の詳細はこちら▼▼▼

<http://trs.jp/p/5962/2011411200000>

2021年6月14日

June Quarterly Options Expiration Week and After Historically Volatile
6月SQ週とその後：ボラティリティーが高い

Year	Monday		Option Expiration Day		Option Expiration Week		Week After	
	PNT Change	% Change	PNT Change	% Change	PNT Change	% Change	PNT Change	% Change
1982	-7.89	-0.97	-2.86	-0.36	-21.12	-2.61	14.46	1.83
1983	24.44	2.04	-6.11	-0.49	46.08	3.85	-0.50	-0.04
1984	-15.64	-1.38	-10.71	-0.98	-44.35	-3.92	44.17	4.06
1985	-2.57	-0.20	24.75	1.90	23.52	1.81	10.98	0.83
1986	-2.42	-0.13	23.68	1.28	5.35	0.29	5.72	0.30
1987	13.81	0.58	12.72	0.53	43.12	1.81	16.01	0.66
1988	-2.31	-0.11	9.78	0.47	2.31	0.11	38.94	1.85
1989	5.42	0.22	11.38	0.46	-27.04	-1.08	45.49	1.83
1990	30.19	1.05	7.67	0.26	73.51	2.57	-78.71	-2.68
1991	-6.49	-0.22	11.62	0.39	-34.89	-1.16	-58.81	-1.98
1992	0.54	0.02	11.23	0.34	-69.01	-2.06	-2.94	-0.09
1993	9.68	0.28	-27.12	-0.77	-10.24	-0.29	-3.88	-0.11
1994	9.67	0.26	-34.56	-0.91	3.33	0.09	-139.84	-3.70
1995	22.47	0.51	14.52	0.32	86.80	1.96	75.05	1.66
1996	3.33	0.06	45.80	0.81	55.78	0.99	-50.60	-0.89
1997	-9.95	-0.13	19.45	0.25	14.47	0.19	-108.79	-1.40
1998	-207.01	-2.34	-100.14	-1.14	-122.07	-1.38	231.67	2.66
1999	72.82	0.69	13.93	0.13	365.05	3.48	-303.00	-2.79
2000	-49.85	-0.47	-265.52	-2.48	-164.76	-1.55	-44.55	-0.43
2001	-54.91	-0.50	-66.49	-0.62	-353.36	-3.22	-19.05	-0.18
2002	213.21	2.25	-177.98	-1.89	-220.42	-2.33	-10.53	-0.11
2003	201.84	2.21	21.22	0.23	83.63	0.92	-211.70	-2.30
2004	-75.37	-0.72	38.89	0.37	6.31	0.06	-44.57	-0.43
2005	9.93	0.09	44.42	0.42	110.44	1.05	-325.23	-3.06
2006	-99.34	-0.91	-0.64	-0.01	122.63	1.13	-25.46	-0.23
2007	0.57	0.00	85.76	0.63	215.09	1.60	-279.22	-2.05
2008	-38.27	-0.31	-220.40	-1.83	-464.66	-3.78	-496.18	-4.19
2009	-187.13	-2.13	-15.87	-0.19	-259.53	-2.95	-101.34	-1.19
2010	-20.18	-0.20	16.47	0.16	239.57	2.35	-306.83	-2.94
2011	1.06	0.01	42.84	0.36	52.45	0.44	-69.78	-0.58
2012	-142.97	-1.14	115.26	0.91	212.97	1.70	-126.39	-0.99
2013	109.67	0.73	41.08	0.28	-270.78	-1.80	110.20	0.74
2014	5.27	0.03	25.62	0.15	171.34	1.02	-95.24	-0.56
2015	-107.67	-0.60	-99.89	-0.55	117.11	0.65	-69.27	-0.38
2016	-132.86	-0.74	-57.94	-0.33	-190.18	-1.06	-274.41	-1.55
2017	-36.30	-0.17	24.38	0.11	112.31	0.53	10.48	0.05
2018	5.78	0.02	-84.83	-0.34	-226.05	-0.89	-509.59	-2.03
2019	22.92	0.09	-34.04	-0.13	629.52	2.41	-119.17	-0.45
2020	157.62	0.62	-208.64	-0.80	265.92	1.04	-855.91	-3.31
Average		-0.04		-0.08		0.05		-0.62
Median		0.00		0.15		0.29		-0.43
Up		20		22		24		11
Down		19		17		15		28

Source: www.stocktradersalmanac.com

1982年以降のダウの6月メジャーSQパフォーマンス

今年 2 回目のトリプルウィッチン週(メジャーSQ)は、損失が利益を上回ることが多く、不安定な取引となっている。NASDAQ はこの週の最初の取引日が他の指数と比べ弱いと言う記録を持っている。トリプルウィッチングの 18 日、金曜日は、通常、より良い結果となっている。DJIA は過去 18 年間のうち 10 年間は上昇しているが、直近の過去 6 年間のうち 5 年間は下落している。

今週一週間のパフォーマンスは不安定で、両方向に 1%以上の動きが散見されている。SQ の翌週はひどい。この週は、過去 31 年間のうち 27 年間で DJIA が下落し(87%の下落率)、平均上昇・下降率は-1.14%となっている。S&P500 と NASDAQ は、同じ 31 年の間に、平均でそれぞれ-0.79%と-0.29%の減少となり、翌週はやや良い結果となっている。

S&P 500 June TWW Option Expiration Performance Since 1982								
Year	Monday		Option Expiration Day		Option Expiration Week		Week After	
	PNT Change	% Change	PNT Change	% Change	PNT Change	% Change	PNT Change	% Change
1982	-1.28	-1.15	-0.32	-0.30	-3.96	-3.56	1.86	1.73
1983	2.16	1.33	-0.01	-0.01	6.45	3.96	1.27	0.75
1984	-2.11	-1.36	-1.36	-0.90	-6.14	-3.96	5.43	3.64
1985	-0.57	-0.30	2.88	1.54	2.51	1.34	2.24	1.18
1986	0.40	0.16	3.52	1.44	1.85	0.75	2.02	0.82
1987	1.07	0.35	1.28	0.42	5.35	1.77	0.19	0.06
1988	0.17	0.06	0.91	0.34	-0.58	-0.21	3.10	1.15
1989	-0.45	-0.14	1.27	0.40	-5.34	-1.63	6.65	2.07
1990	2.92	0.81	0.01	0.00	4.20	1.17	-7.48	-2.06
1991	-2.16	-0.57	2.33	0.62	-4.54	-1.19	-6.59	-1.74
1992	0.53	0.13	2.71	0.68	-6.09	-1.49	-0.22	-0.05
1993	0.45	0.10	-4.86	-1.08	-3.58	-0.80	3.92	0.88
1994	0.43	0.09	-3.48	-0.75	-0.22	-0.05	-15.65	-3.41
1995	2.94	0.56	2.71	0.50	11.89	2.25	9.88	1.83
1996	-0.69	-0.10	4.74	0.72	0.99	0.15	3.79	0.57
1997	0.63	0.07	0.71	0.08	5.43	0.61	-11.40	-1.27
1998	-21.83	-1.99	-5.72	-0.52	1.81	0.16	32.55	2.96
1999	0.36	0.03	2.94	0.22	49.20	3.80	-27.53	-2.05
2000	-10.95	-0.75	-14.27	-0.97	7.51	0.52	-22.98	-1.57
2001	-10.57	-0.84	-5.51	-0.45	-50.60	-4.00	10.99	0.91
2002	28.90	2.87	-17.15	-1.70	-18.13	-1.80	0.68	0.07
2003	22.13	2.24	0.99	0.10	7.08	0.72	-19.47	-1.96
2004	-11.18	-0.98	2.97	0.26	-1.45	-0.13	-0.59	-0.05
2005	2.71	0.23	6.00	0.50	18.85	1.57	-25.39	-2.09
2006	-15.90	-1.27	-4.62	-0.37	-0.76	-0.06	-7.04	-0.56
2007	1.45	0.10	9.94	0.65	25.24	1.67	-30.35	-1.98
2008	0.11	0.01	-24.90	-1.85	-42.10	-3.10	-39.55	-3.00
2009	-22.49	-2.38	2.86	0.31	-24.98	-2.64	-2.33	-0.25
2010	-1.97	-0.18	1.47	0.13	25.91	2.37	-40.75	-3.65
2011	0.85	0.07	3.86	0.30	0.52	0.04	-3.05	-0.24
2012	-16.73	-1.26	13.74	1.03	17.18	1.30	-7.82	-0.58
2013	12.31	0.76	4.24	0.27	-34.30	-2.11	13.85	0.87
2014	1.62	0.08	3.39	0.17	26.71	1.38	-1.91	-0.10
2015	-9.68	-0.46	-11.25	-0.53	15.88	0.76	-8.50	-0.40
2016	-17.01	-0.81	-6.77	-0.33	-24.85	-1.19	-33.81	-1.63
2017	-2.38	-0.10	0.69	0.03	1.38	0.06	5.15	0.21
2018	2.97	0.11	-2.83	-0.10	0.63	0.02	-24.78	-0.89
2019	2.69	0.09	-3.72	-0.13	63.48	2.20	-8.70	-0.29
2020	25.28	0.83	-17.60	-0.56	56.43	1.86	-88.69	-2.86
Average		-0.09		0.00		0.06		-0.33
Median		0.06		0.10		0.15		-0.24
Up		22		23		23		16
Down		17		16		16		23

Source: www.stocktradersalmanac.com

1982 年以降の S&P500 の 6 月メジャーSQ パフォーマンス

NASDAQ June TWW Option Expiration Performance Since 1982								
Year	Monday		Option Expiration Day		Option Expiration Week		Week After	
	PNT Change	% Change	PNT Change	% Change	PNT Change	% Change	PNT Change	% Change
1982	-1.40	-0.81	-1.35	-0.79	-5.05	-2.91	1.98	1.18
1983	2.81	0.89	-0.39	-0.12	10.87	3.45	2.80	0.86
1984	-2.23	-0.93	0.02	0.01	-4.71	-1.96	5.47	2.32
1985	-0.57	-0.20	1.34	0.47	0.76	0.26	7.49	2.59
1986	-1.05	-0.26	0.48	0.12	-2.71	-0.68	6.65	1.68
1987	0.01	0.00	0.11	0.03	3.70	0.87	-2.40	-0.56
1988	0.56	0.14	-0.18	-0.05	0.67	0.17	4.70	1.21
1989	-0.26	-0.06	0.11	0.02	-6.44	-1.42	1.15	0.26
1990	1.92	0.42	0.45	0.10	6.68	1.45	-8.22	-1.76
1991	-0.75	-0.15	-0.06	-0.01	-9.25	-1.87	-9.90	-2.04
1992	-0.51	-0.09	5.03	0.92	-15.32	-2.69	-6.36	-1.15
1993	3.22	0.46	-6.35	-0.91	-3.60	-0.52	5.22	0.76
1994	-2.55	-0.35	-5.62	-0.76	-4.90	-0.67	-35.56	-4.88
1995	3.60	0.41	5.97	0.66	24.27	2.74	30.22	3.33
1996	-5.54	-0.46	8.10	0.69	-37.74	-3.11	9.58	0.82
1997	8.92	0.63	-0.04	0.00	24.07	1.69	-8.95	-0.62
1998	-29.30	-1.68	8.59	0.48	36.24	2.08	88.24	4.95
1999	-49.57	-2.03	19.29	0.76	115.56	4.72	-10.79	-0.42
2000	-106.93	-2.76	14.82	0.39	-14.28	-0.37	-15.22	-0.39
2001	-44.32	-2.00	-15.64	-0.77	-186.67	-8.43	6.41	0.32
2002	48.55	3.23	-23.79	-1.62	-63.78	-4.24	22.25	1.54
2003	40.09	2.46	-3.92	-0.24	18.23	1.12	-19.46	-1.18
2004	-29.88	-1.49	3.06	0.15	-13.14	-0.66	38.74	1.95
2005	5.96	0.29	0.96	0.05	27.11	1.31	-36.84	-1.76
2006	-43.74	-2.05	-14.20	-0.66	-5.11	-0.24	-8.48	-0.40
2007	-1.39	-0.05	27.30	1.05	53.17	2.07	-37.75	-1.44
2008	20.28	0.83	-55.97	-2.27	-48.41	-1.97	-90.46	-3.76
2009	-42.42	-2.28	19.75	1.09	-31.33	-1.69	10.75	0.59
2010	0.36	0.02	2.64	0.11	66.20	2.95	-86.32	-3.74
2011	-4.04	-0.15	-7.22	-0.28	-27.25	-1.03	36.41	1.39
2012	-48.69	-1.70	36.47	1.29	14.38	0.50	19.62	0.68
2013	28.57	0.83	-7.38	-0.22	-66.31	-1.94	46.00	1.37
2014	10.46	0.24	8.71	0.20	57.39	1.33	29.89	0.68
2015	-21.13	-0.42	-15.95	-0.31	65.90	1.30	-36.49	-0.71
2016	-46.11	-0.94	-44.57	-0.92	-94.21	-1.92	-92.36	-1.92
2017	-32.46	-0.52	-13.74	-0.22	-56.16	-0.90	113.49	1.84
2018	14.42	0.19	-14.66	-0.19	100.87	1.32	-53.56	-0.69
2019	48.36	0.62	-19.63	-0.24	235.05	3.01	-25.47	-0.32
2020	137.21	1.43	3.07	0.03	357.31	3.73	-188.90	-1.90
Average		-0.21		-0.05		-0.08		0.02
Median		-0.09		0.01		-0.24		0.26
Up		17		20		19		20
Down		22		19		20		19

Source: www.stocktradersalmanac.com

1982年以降のナスダックの6月メジャーSQパフォーマンス