

2022年美股四巫日解析

聚焦第四季美股變化

四巫日是什麼？

四巫日是指美國股市，
每年三月、六月、九月和十二月的第三個星期五，
四種到期的衍生性金融商品同時結算。
結算時間為當日紐約時間下午三時至四時。
台灣時間最後交易日到期收盤時間21:30(夏令)或22:30(冬令)。

美股四巫日日期一覽

項次	日期
1	2022/3/18 (五) 已結算
2	2022/6/17 (五) 已結算
3	2022/9/16 (五) 已結算
4	2022/12/16 (五)

到期結算四類商品

項次	結算商品
1	股票指數期貨
2	股票指數期權
3	期權
4	個股期貨

資料來源:<https://zh.m.wikipedia.org/>

四巫日交易日趨勢

統計近五年，四巫日前一個交易日與後一個交易日，平均上漲機率不到4成。

統計週期: 2018年3月-2022年9月 樣本數:19次 統計商品:S&P500	四巫日 前一個交易日	四巫日 後一個交易日
上漲機率	26.32%	36.8%
上漲次數	5	7
平均上漲幅度	0.91%	0.51%
下跌機率	73.68%	63.16%
下跌次數	14	12
平均下跌幅度	1.02%	0.94%
樣本數	19	19

四巫日交易日趨勢

統計近五年，四巫日前五個交易日與後五個交易日，平均上漲機率達4至7成。

統計週期: 2018年3月-2022年9月 樣本數:19次 統計商品:S&P500	四巫日 前五個交易日	四巫日 後五個交易日
上漲機率	42.11%	73.68%
上漲次數	8	14
平均上漲幅度	2.11%	3.11%
下跌機率	57.89%	26.32%
下跌次數	11	5
平均下跌幅度	-3.65%	1.96%
樣本數	19	19

四巫日流通性

統計最近兩年，因結算、轉倉關係，相關金融商品於四巫日均出現交易量激增情況。



- 統計近五年觀察，結算日當天，成交量明顯放大，因此可能帶來劇烈波動。
- 交易統計近五年，四巫日前一個交易日與後一個交易日，下跌機會較高，平均下跌幅度都有將近1%的幅度，相反，平均統計上漲機率只有不到4成。
- 交易統計近五年，四巫日前五個交易日與後五個交易日，上漲機會較高，平均上漲幅度都有將近2%的幅度，平均統計上漲機率達4成至7成。