

交易日记-2025-05-13

一。四大规则

进场规则：

顺大做小；趋势背驰或极端乖离；多级别共振。

出场规则：

达到技术面出场目标；达到盈利或止损目标；有疑惑或不安时；没出现自己进场条件下应该发生的走势时（无关是否盈亏）。

仓位规则：

操作级别和风险级别决定仓位大小。

情绪规则：

时刻检查是否情绪在主导交易。必要时停下来，等一等。

二。当天交易行为

走势和交易图示



MES走势图（截止2025/05/13）

交易描述

一。交易时的市场情况

继昨天中美关税接触利好声明出台大涨后，今日开盘45分钟继续快速拉高，随后进入震荡上升通道，中场10:30之后震荡走弱。

二。交易行为以及决策过程（技术面逻辑和心理逻辑）

1. 昨日收盘前双卖今日MES期权。在1处因早盘大涨，sell put已无多少剩余价值，当时指标有背离迹象。换成明日sell put。
2. 继续指标有背离，反弹到上升通道中轨，做了一个spx put spread看跌。
3. 在2处进场做空后，后面继续反弹短期被套，然后跌破了上升通道，但达到绿色均线处，指标也有背离，平仓止盈。
4. 在4处指标出现背离，跌破上升通道后反弹没再进入通道内，再做了一个spx put spread看跌。
5. 临近收盘，内心评估还有下跌空间，但再次到达绿色均线处，可能会受到支撑，尾盘像昨天一样剩下15分钟爆拉。选择平仓止盈。

三。认知，情感或行为模式所产生的结果

心理有预判的影响，昨天跳空暴涨后今天内心在想找逢高做空的机会。

尾盘没有坚持到收盘而丧失较大盈利空间，原因有：一是期权的高波动性在尾盘较难把握，使得自己担心到嘴的鸭子飞掉；二是昨天尾盘爆拉造成的心理影响。

当天最差交易分析（略）

三。总结

肯定的部分

今天整体是上涨，在违背进场规则而逆势做空情况之下，锁利坚决。

改进的方面

1. 没遵守顺大做小的规则选择逆势做空。今天逢低做多的机会要多一些。
2. 在2处做空的条件不够充分，2处前面的阳K线突破前面下降小通道趋势线，虽然遇到蓝色通道中轨，可以等对蓝色通道中轨的突破尝试失败后在开仓，或者等像后面实际走出来的走势那样，涨不到通道上轨而掉头再开空单。
3. 4处开的空仓，当时的进场逻辑除了走势技术性背离外，还有个以小搏大的风险收益比考量，想以较小的成本博取更大的收益，有赌博心理。既然选择以小搏大，本应该去承受预设的最

大风险（选择用spread已经限定了最大亏损额），去换取更高的利润。后面选择平仓的理由变成了：“赚比亏好”，放弃了开仓时经过评估决定以小搏大的初衷。这里需要在风险和收益，博弈的理性分析和盈亏的情感体验之间寻找一种取舍的平衡。