

交易日记-2025-05-14

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2025/05/14）

交易描述

一。交易时的市场情况

昨天下半场走弱后，今天进入震荡市。

二。交易行为以及决策过程（技术面逻辑和心理逻辑）

1. 黑2上内部蓝色上下上有背驰，基于今天震荡市的预判，在1处put spread做空，后面黑2走势再走了一个蓝上才结束。在2处因打到长期均线，平仓。
2. 在3处因为之前在今天震荡区间的高位预埋了一个空单，被一个爆拉阳线触发成交。
3. 因为空单成交的这根k线过大，虽然在震荡区间上缘，担心这个大阳线是为了突破今天的震荡通道，赶紧在4处止盈。

三。认知，情感或行为模式所产生的结果

1. 在1处的空单比较勉强，走势没背离，后面的走势显示最佳卖点在小红旗处，在那里有指标背离。在1处开空的心理因素是有今天是震荡甚至走低的心理预判。
2. 在2处平仓的心理因素是打到长期均线之下，担心受到支撑再反弹。
3. 在2平仓后的那段走势，围绕长期均线缠绕。结合成交量来看显然较弱，犹豫了是否加空单。最后因为犹豫没有行动。
4. 在3处因大阳线触发的成交，大阳线让心情有些惊慌，担心这根大阳线会引发一轮上涨，因而在4处匆忙平仓。从后市走势看，冲击通道上边缘是失败的。
5. 黑5下的尾端指标已有背离，内部蓝色5段也有背驰，是个黑色买点（小红旗处）。内心想着开一个call spread博黑上开启，因接近收盘而放弃。
6. 引发一个值得自己注意和思考体会的东西：当技术面和心理面产生冲突的时候，是听从技术面还是听从心理面？心理面常常会寻找技术面的理由来支持自己的合理性。技术面一般不以最终的走势结果是否符合技术面判断来论英雄，而是买点买卖点卖般的机械操作，针对判断的错误设好相对应的止损，最终是否盈亏，交给市场。而心理面往往会因为后面出现的走势和交易本身产生的盈亏而受到影响。

当天最差交易分析（略）

三。总结

肯定的部分

犹豫的时候不开仓（2之后）。3处预设空单被触发的条件，不是自己预埋单时的预想的条件，果断平仓以消除担忧。尾盘赌博心态（想做call spread）得到控制。

改进的方面

1. 第一个空单应该在小红旗处开，有指标背离和黑2上盘整背驰结束两个技术理由支撑。
2. 在2处的平仓后可以因后面较弱的走势加开空仓，如担心期权有时间损耗，可在设紧止损的前提下，直接空mes正标的。
3. 在4处因大阳线造成的慌忙平仓，可以通过之后走势没有突破通道，判断全天震荡通道的走势依然保持，因在通道上缘，可以维持小级别看空的观点。
4. 黑5下尾端技术指标背离和黑5盘整下可以结束，如不是因为临近收盘，可以短线尝试做多。考虑到临近收盘，可用极小的期权成本博取可能的回报。当然没这样做，本身因临近收盘是可以理解接受的。如果开单去做，也必须是在当天有盈利的前提下，以极小成本去尝试博取高盈亏比。