

交易日记-2025-05-23

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2025/05/23）

交易描述

一。交易时的市场情况

今日大幅跳空低开上半场震荡走高，下半场震荡走低。

二。交易行为以及决策过程（技术面逻辑和心理逻辑）

1. 在1处sell 当日5835call。5835乃夜盘大跌起跌点附近。认为大跌后的反弹目标位。
2. 在2处sell5775put。5775乃夜盘大跌后的低点整固区间，判断此处应有支撑。
3. 在3和4处相应平仓前面两个单，已有盈利。但是在区间震荡，后市可能向任何方向突破。
4. 在5处到达震荡区间上边缘，开es put spread空单，按照继续震荡的思路。
5. 在6处反弹达到夜盘起跌点，spx put spread，判断反弹目标几乎达到。
6. 在7处达到长期均线，止盈6处空单。
7. 在8处，止损平仓第5单空单。

三。认知，情感或行为模式所产生的结果

1. 在1和2处双卖基于赚取未日期权时间价值。
2. 在3和4处因对后市可能向某方向突破，退出观望。
3. 在3处按区间震荡操作，未到10-10:30市场易反转时间段，假设还有区间震荡的机会。后面走势没有证明自己判断正确，应该立刻止损退出，心中预判反弹不会超过起跌点的预判阻止了止损操作。
4. 在6处开的空单依旧受到反弹不过起跌点的预判。
5. 在7处的平仓基于回撤到长期均线支撑位。加之之前的第6单有两次想波动操作而没有操作，原因是设的平仓单价格差了一点点，错失两次波段机会，想尾盘可能还会有一次波段机会。但是后面出门办事，最后确实有一次波段机会，因开车无法操作。
6. 在8处见打到第5单理想目标位机会渺茫，平仓退出。

当天最差交易分析

第5单。开单后走势证明自己开单理由失效，应择机平仓，等待更好机会。另外这段时间的历史经验在这个时间段内反转概率较低。

三。总结

肯定的部分

无

需要改进的方面

1. 第5单没走出预期应果断平仓。
2. 第6单原计划判断会吃到最大利润，想做短差波段，在有盈利的基础上可适当持仓坚持到最后，下半场依然区间震荡，且有走弱迹象，支持持仓博取最大利润。另外可以止盈一般让另外一半博取最大利润，激进点是在震荡高点加仓做波段，留起始仓位博取开单理由下的最大利润。
3. 如果当天有事需要出门，开单时要考虑这个因素带来的对操作的影响。可以选择不要开单，或者开单后在出门前平仓。