



MODULE 0

Trading Foundation

先学会活下来

SURVIVE FIRST. SCALE LATER.

先学会活下来

✕ 错误起点

~~先寻找 Entry~~

✓ 正确起点

Trading 的第一步，不是寻找 Entry

而是先理解 Risk

你必须知道：

1

我开了多少 Position?

2

SL 在哪里?

3

如果 SL，我会亏多少钱?

4

这笔 Loss 我能不能接受?

核心原则：Survive First. Scale Later.

今天你要学会什么

这一个 Module, 你需要掌握:

01

Lot / Pip / Point

02

Position Size

03

Risk Calculation

04

Acceptable Risk

05

Trading 的三个阶段

为什么 Risk 要先学?

很多人进入市场的顺序:

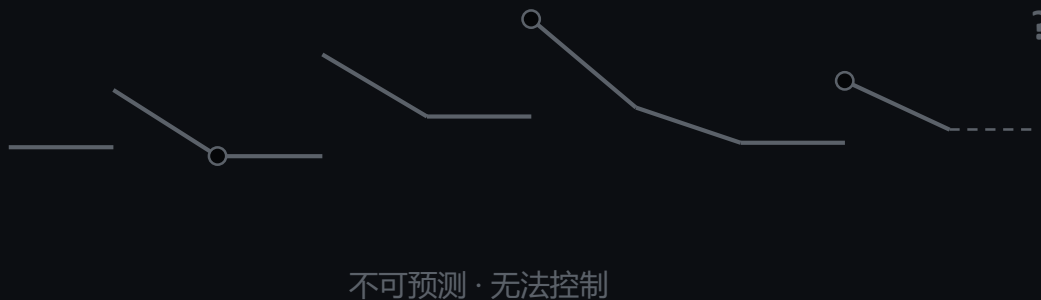


正确的顺序应该是:



因为: 没有任何 Strategy 可以保证每一单盈利。

你无法控制 Market



但你可以控制:

- Position Size
- Stop Loss
- Risk
- Execution

什么是 Lot Size?

Lot Size = Position Size

简单理解：Lot 越大，同样的价格波动，对账户造成的 P/L 越大。

0.01

Lot

0.05

Lot

0.1

Lot

1

Lot

Pip / Point 是什么?

以黄金 XAUUSD 为例:

4100.00 → 4110.00

100 Pips = 1000 Points

简单来说：我们看的不是价格涨了多少钱，而是价格走了多少点。

举例：黄金从 4100.00 → 4120.00，跑了 200 Pips

0.01 Lot

\$20

0.1 Lot

\$200

1.0 Lot

\$2000

\$500 Account: 一单到底能亏多少?

\$500

Account Balance

固定 Entry → SL Distance, 比较不同 Position Size:

Lot Size	SL Distance	Potential Loss
0.01	100 Pips	\$10
0.03	100 Pips	\$30
0.05	100 Pips	\$50
0.10	100 Pips	\$100

重点: 同样的 SL Distance, Lot 不一样, Loss 完全不同。

不要问：我能开多大？

✗ 错误问题

「我的 \$500 可以开多少 Lot? 」

✓ 正确问题

「如果这笔交易 SL, 我最多愿意亏多少? 」

正确思考：

Acceptable Loss



SL Distance



Position Size

\$1000 户口：你能撑几单？

\$1000 Account, 比较不同单笔亏损：

\$20

单笔亏损

连续亏 50 单，才会爆仓

\$50

单笔亏损

连续亏 20 单，才会爆仓

重要的不是你能撑几单，而是：亏了这一单，你会不会想要追单？

交易极少会连续出现 20 ~ 50 单亏损。真正让账户爆掉的，往往是亏了一单自己无法接受的单子后，情绪上头开始乱下单。

什么是 Acceptable Risk?

Acceptable Risk 不是单纯:「我可以接受亏 \$10。」

真正的问题是: 当这一单真的打到 SL 后, 我还能不能正常进行下一笔交易?

如果 SL 后你会:



Revenge Trade



Chase Market



加大 Lot



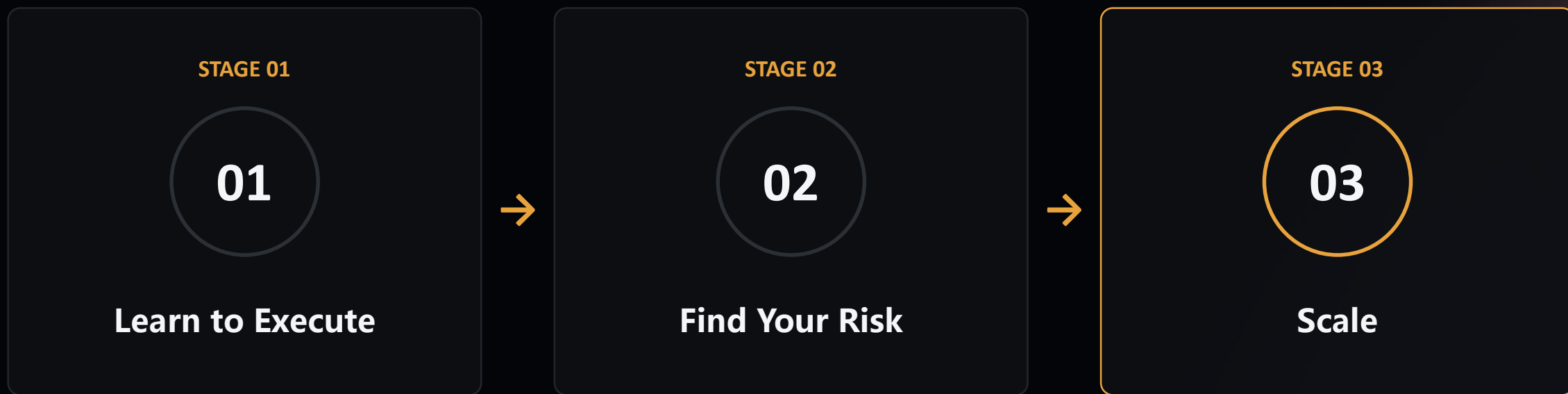
改变 Strategy



不敢再下单

Your Position Size Is Too Large.

Trading 的三个阶段



STAGE 01 | Learn to Execute

新手阶段：目标不是 Profit，而是 Learn to Execute

学习：

MT5 操作

Entry

SL

TP

Floating P/L

Closing Position

Trade History

接受 Profit & Loss

0.01 Lot

练习仓位建议

重点：先让自己习惯市场的波动和 Loss。

STAGE 02 | Find Your Risk

\$500 Account

✓ **-\$10**

仍然可以正常交易

⚠ **-\$50**

开始情绪化

那么你的 Risk 就应该根据自己的实际承受能力重新调整。

核心：Risk Management 必须让你能够继续执行你的 Trading System。

STAGE 03 | Scale Without Losing Discipline

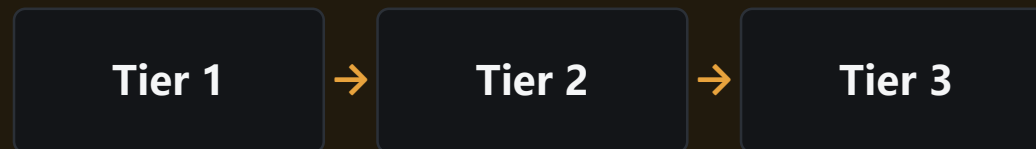
当你已经拥有：

- ✓ Stable Execution
- ✓ Enough Trading Samples
- ✓ Backtesting
- ✓ Forward Testing
- ✓ Validated Trading Model
- ✓ Emotional Control

才开始 Scale Position Size — 但不是：

Win → Increase Lot — Loss → Decrease Lot

而是：Predefined Risk Tier



根据预先设定的条件升级。

Lot Size 怎么加?

从 0.01 Lot 开始:

0.01 Lot



经历连续亏损



心态没有变化



才算稳, 可以加

不要一次性加太多, 慢慢上。

加上去之后, 标准不变:

✗ 不是看

顺利的时候, 赚了多少钱

✓ 而是看

不顺利的时候, 你会不会追单

不要让仓位跟着情绪走

Win → 加 Lot

Loss → 减 Lot

Win → 再加 Lot

Loss → 再乱调整

这其实不是 Risk Management。这是：Emotional Position Sizing

正确方式：Position Size 应该在交易之前决定，而不是交易之后根据情绪改变。

SURVIVE FIRST. SCALE LATER.

01 Lot Size 决定 P/L Magnitude

02 每一笔交易之前, 知道 SL 会亏多少钱

03 如果 Loss 会让你失控, Position Size 太大

04 先建立 Execution, 再建立 Consistency, 最后才 Scale



MODULE 0 · COMPLETE

正式进入

盘面分析

你已经掌握了 Risk、Position Size、Execution 这些基础。接下来，我们把它们应用到真正的图表上。

MODULE 1 · CHART ANALYSIS →