

Mr.IF

金融推理 **Agent** 系统

"在别人看不到金融信号的地方找到信号"

三模式驱动的美股洞察引擎

蝴蝶效应推理

×

金融传导映射

×

第一性原理分析

全球/国内事件

+

金融市场信号

→

美股 (NYSE/NASDAQ)

V4.0

chaos2alpha

2026-02-10

A 传统分析痛点

PAIN 01 反应滞后 (Slow)

依赖财报与研报，信息从发生到发布周期长。往往市场已经 Price-in 后才看到报告，错过最佳窗口。

PAIN 02 过度共识 (Consensus)

所有人都在看相同的数据 (CPI/非农/财报)，导致观点趋同，Alpha 收益极其稀薄。

PAIN 03 视野片面 (Limited)

只关注金融业内数据，忽视气象、社交、流行病学等跨学科信号的蝴蝶效应传导。

PAIN 04 分类僵化 (Rigid) LEGACY

依赖硬编码规则。面对“冬奥会”等新事件无法识别，输出降级为泛化推理。

Mr.IF 解决方案

VALUE 01 毫秒级响应 (Fast)

事件即触发。无需等待财报，天气/推文/新闻直接进入推理引擎，第一时间捕捉因果链。

VALUE 02 反共识挖掘 (Contrarian)

通过“二阶思考”和“时间错配”寻找隐形赢家，在市场盯着显而易见受益者时挖掘第二落点。

VALUE 03 量化落地 (Actionable)

拒绝模棱两可。给出概率区间、幅度预测和关键敏感因子，直接转化为可执行策略。

VALUE 04 LLM 智能分类 NEW v4.0

LLM 自行语义理解事件类型 (Step 0)，任何新事件都能精准归类，彻底摆脱关键词库。

三大推理模式

THREE REASONING MODES // MR. IF CORE

v4.0 | chaos2alpha

01



蝴蝶效应推理

BUTTERFLY EFFECT

适用于

日常生活事件

"好多人感冒"、"今天好冷"

✓ 短链因果追踪

每一环明确"因为"支撑，拒绝逻辑跳跃

✓ 跨学科桥接

气象 × 能源 × 经济 × 供需传导映射

✓ 历史模式对照

基于 18+ 核心历史案例进行模式匹配

OUTPUT FORMAT

Chain Template

02



金融传导推理

v3.1+

FINANCIAL TRANSMISSION

适用于

金融市场事件

"收益率倒挂"、"NVDA 财报超预期"

✓ 5大传导通道

板块轮动 / 盈利传导 / 宏观重定价...

✓ 3问测试

Priced in? Second derivative? Wrong?

✓ 跳过蝴蝶链

直接映射传导通道，不走跨学科链条

OUTPUT FORMAT

Transmission Channel

03



第一性原理推理

v3.2+

FIRST-PRINCIPLES

适用于

极端新事件

关键词和 LLM 都无法分类的罕见情况

✓ Follow the Money

谁付钱？谁赚钱？金额多大？定价了吗？

✓ 领域知识搜索

自动生成双语搜索查询，补充领域知识

✓ 营收重要性检验

对标公司总营收，评估影响规模

FALLBACK MECHANISM

LLM + Keywords Failed

数据基础：案例与锚点

DATA FOUNDATION // CASES & ANCHORS

18+ CASES

38+ ANCHORS

系统的“弹药库”

精选历史案例库

模式匹配 Pattern Matching

YEAR	SCALE	EVENT	KEY LESSON (LOGIC)
2022	EXTREME	Russia-Ukraine	避险(Gold) → 供给(Energy) → 通胀三波传导
2022	EXTREME	ChatGPT Launch	范式转移技术 → 卖铲人(NVDA)优先于应用层
2020	EXTREME	COVID-19	危机中寻找受益者(Zoom/PFE)；二阶效应滞后爆发
2021	LARGE	Texas Freeze	极端天气 → 能源现货定价权(LNG)瞬间飙升
2023	LARGE	SVB Bank Run	社交媒体加速恐慌传播；流动性危机速度×10
2024	LARGE	BTC ETF	监管逆风转顺风 → 机构资金入场信号
2022	MEDIUM	Yield Curve Inv.	倒挂 → 板块轮动即刻启动；防御板块超额收益

核心量化锚点

精准估算 Precise Estimation

CATEGORY	METRIC	THRESHOLD / VALUE	SOURCE
Weather	HDD Sensitivity	10% Dev → NatGas ±5-8%	EIA
Tech	NVDA Training Share	>80% (Monopoly Pricing Power)	Ind. Est.
Econ	10Y Yield → QQQ	+100bp → QQQ -8% to -12%	History
Physio	CDC ILI Baseline	~2.5% (Above 3.5% = Hot Season)	CDC
Market	2Y-10Y Inversion	Last 8 recessions, lead 6-24mo	Fed/NBER
Corp	Earnings Sympathy	±2-8% for sector peers, 2-5 days	Academic
FX	DXY +5% Impact	~2-3% S&P EPS Headwind	FactSet

推理引擎核心

REASONING ENGINE CORE // MECHANISMS

LOGIC ARCHITECTURE | 3 CORE PILLARS

推理链模板库

TEMPLATES

22

全谱系覆盖

从日常事件到金融信号的标准化路径

- | | |
|---------------|-------------------------|
| ● 生理/健康 | symptom_to_pharma |
| ● 天气/能源 | weather_to_energy |
| ● 经济/消费 | consumption_to_industry |
| 政策/供应链 | policy_to_industry |
| ● 金融传导 [v3.1] | yield_curve_to_playbook |

Output: Chain Template / Transmission Channel

9 因子评分机制

SCORING SYSTEM

9

50
BASE SCORE

- | | |
|---------|-----|
| ● 历史匹配 | +15 |
| - 链长惩罚 | -16 |
| ● 多学科支撑 | +10 |
| - 共识惩罚 | -20 |

WEAK <45

MOD 45-64

STRONG ≥65

事件交互效应

INTERACTIONS

22+

当多个事件同时发生时，系统计算叠加或抑制效应，而非线性相加。

天气 × 地缘

Compound Effect

1.5×

能源安全双重打击

科技 × 地缘

Amplify Effect

1.4×

芯片制裁放大科技链

市场 × 汇率

Amplify Effect

1.3×

Fed政策联动

工作流程与编排

WORKFLOW & ORCHESTRATION // 6-STEP LOOP

v4.0 NEW FEATURE



推理技能体系

CORE SKILLS SYSTEM (9 SKILLS)

FOUNDATION

ALPHA GEN

CLASSIFICATION



FOUNDATION LAYERS (基础层)

SKILL 01

蝴蝶效应链构建

butterfly-effect-chain.md

- 短链优先: 避免过度推演衰减
- 因果闭环: 拒绝逻辑量子跳跃



SKILL 02

跨学科桥接

cross-domain-reasoning.md

- 10学科映射: 气象/心理 → 金融
- 异构连接: 寒冷 → 购药行为



SKILL 03

自适应推理纪律

reasoning-discipline.md



- 复杂度分级: Light/Medium/Heavy
- 出口检查: 5点逻辑自洽性验证

SKILL 04

二阶思考

second-order-thinking.md

- 共识检测: 是否已 Priced-in?
- 时间错配: 寻找隐形赢家



SKILL 05 | 量化框架

quantitative-reasoning.md

基于历史锚点估算幅度与概率

幅度估计

概率校准

敏感性分析



ALPHA GENERATION (Alpha 生成层)

SKILL 06 • 金融传导推理

5大传导通道 (板块/盈利/宏观/信用/汇率)

3-Question Test: Priced-in? 2nd Derivative? Consensus?

v3.1



SKILL 07 • 动态历史搜索

自动生成搜索查询 + 3维评估准则

Search Query Gen → Evaluation (Mech × Mag × Macro)

v3.1



SKILL 08 • 新事件第一性原理

极端新事件分析: Follow the Money

Who pays? Who earns? Materiality Check?

v3.2



CLASSIFICATION (分类层)

NEW v4.0



SKILL 09 | LLM 语义分类

彻底摆脱硬编码关键词。LLM 理解 12 种事件类型，执行歧义消解与实体提取。



Step 0 Core

Adaptive

输出交付标准

OUTPUT STANDARD // RIA STYLE

QUANTIFIABLE

ACTIONABLE

✓ 5个必含要素 (MANDATORY ELEMENTS)



概率语言

使用具体区间 (60-70%)，拒绝"可能"等模糊词汇。



幅度区间

给出涨跌幅预测 (+3-8%)，基于量化锚点估算。



关键敏感因子

指出决定成败的单一最重要变量 (Key Sensitivity)。



历史基准率

参考历史上类似事件对该行业的平均影响幅度。



来源锚点

所有数字必须标注数据来源或参考的历史案例。



Chain Template 格式

适用于：日常事件 / 蝴蝶效应

Pattern

Disciplines

Typical Steps

Sector Hints

Ticker Seeds



Transmission Channel 格式

适用于：金融事件 / 传导映射

Mechanism

Time Horizon

Winners/Losers

Priced-in Risk

Expected Magnitude

■ Ticker 总结表标准 (7 Columns)

v3 FORMAT

TICKER	WHY (LOGIC)	DIRECTION	MAGNITUDE	PROBABILITY	KEY VARIABLE
ET	中游管道量价弹性, 7%+高分红安全边际	↑ Bullish	+4 - 9%	~65%	EIA Inventory
KBE	NIM压缩, 银行板块直接承压...	Bearish	-10 - 15%	~65%	Curve Duration

输出层

RIA 风格叙事

标的汇总表·7列

双格式·链/通道

推理层

核心推理引擎

Core

分类



模板匹配



9因子评分



锚点计算

蝴蝶效应

金融传导

第一性原理

技能层

9大核心技能模块

蝴蝶效应链

跨学科桥接

自适应纪律

二阶思考

量化框架

金融传导

动态搜索

第一性原理

分类层

LLM 语义理解 → event_type (12类)

v4.0 新增

数据层

历史案例 (18+)

量化锚点 (38+)

实时信号流

外部工具路由

• 高优先级

网络检索

评级校验

涨幅榜

中优先级

情绪数据

DCF 估值

历史回测

项目统计

1

9

核心工具

技能模块

12

22

事件类型

模板库