

# Validacao Estatistica do Metodo AT.RFG2P na Identificacao de Niveis Tecnicos no Mercado Acionario Brasileiro

Artigo fundador - validacao quantitativa e inferencia estatistica

**Base empirica atual utilizada:** 70 ativos em 2026; 3.356 observacoes oficiais; 3.221 acertos no criterio acao/dia (95,98%); 29.140 IDs emitidos e 13.786 atingidos. Consolidacao 2025/2026: 3.521 observacoes e 3.361 acertos (95,46%).

**Status editorial:** versao tecnico-cientifica com dados historicos consolidados. Resultados de experimentos ainda nao executados sao identificados como pendentes, evitando fabricacao de evidencia.

## Resumo

O estudo quantifica a ocorrencia dos niveis AT.RFG2P na base consolidada. O resultado oficial de 2026 no criterio acao/dia foi  $3.221/3.356 = 95,98\%$ . Em nivel de IDs individuais,  $13.786/29.140 = 47,31\%$ ; excluindo 5P,  $12.462/25.784 = 48,33\%$ . O 1o parametro ajustado registrou 59,67% e o 5P foi preservado em 60,55% das observacoes.

## Pergunta e hipoteses

Pergunta: os niveis apresentam taxa de ocorrencia diferente da referencia nula? Para o teste simplificado historico utiliza-se  $H_0: p=0,50$  contra  $H_1: p \neq 0,50$ . Esse baseline nao deve ser tratado como probabilidade universal do mercado.

## Resultados estatisticos

| Base             | n      | k      | Taxa   | Wilson 95%      | z vs 50% |
|------------------|--------|--------|--------|-----------------|----------|
| 2026 acao/dia    | 3.356  | 3.221  | 95,98% | 95.26% - 96.59% | 53.27    |
| Historico citado | 2.700  | 1.650  | 61,11% | 59.26% - 62.93% | 11.547   |
| IDs 2026         | 29.140 | 13.786 | 47,31% | 46,74% - 47,88% | -9,19    |

## Leitura por parametros

| Metrica               | Resultado                   |
|-----------------------|-----------------------------|
| 1o parametro ajustado | $10.013 / 16.780 = 59,67\%$ |
| IDs tecnicos ex-5P    | $12.462 / 25.784 = 48,33\%$ |
| Zonas 6P-9P           | $3.773 / 12.360 = 30,53\%$  |
| 5P preservado         | $2.032 / 3.356 = 60,55\%$   |

## Conclusao provisoria

A base atual mostra forte taxa de ocorrencia no criterio agregado acao/dia, mas esse indicador combina varios niveis e nao pode ser comparado de modo ingenuo a 50%. A evidencia confirmatoria deve priorizar taxas por nivel, dependencia entre niveis e benchmarks calibrados. O resultado historico  $n=2.700/k=1.650$  permanece classificado como evidencia historica a reconstruir.

## Fonte e rastreabilidade dos dados

Os numeros empiricos deste documento derivam da base interna consolidada ATB3 de validacao 2025/2026 e da lista de 70 ativos G001-G070. A base 2026 registra 3.356 observacoes, 3.221 acertos acao/dia, 29.140 IDs emitidos e 13.786 IDs atingidos. A consolidacao 2025/2026 registra 3.521 observacoes e 3.361 acertos.

Aviso: resultados historicos nao constituem recomendacao de investimento, promessa de rentabilidade ou garantia de desempenho futuro. O criterio acao/dia mede ocorrencia de pelo menos um toque tecnico valido ex-5P e nao equivale a lucratividade operacional.