

O Metodo AT.RFG2P Apresenta Evidencia de Poder Preditivo Alem do Acaso?

Analise sob referencias nulas e desenho de passeio aleatorio

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 investiga se a evidencia observada pode ser explicada por um processo sem conteudo preditivo especifico. A base atual permite um teste simples contra $p_0=0,50$, mas ainda nao contam a simulacao completa de passeio aleatorio/Monte Carlo com niveis artificiais calibrados.

Evidencia disponivel

Metrica	n	k	Taxa	z vs 50%
1o parametro ajustado	16.780	10.013	59,67%	25.06
Historico n=2700	2.700	1.650	61,11%	11.547
Acao/dia	3.356	3.221	95,98%	53.27

Limite do baseline de 50%

O criterio acao/dia considera ao menos um toque entre varios niveis ex-5P; portanto, sua probabilidade nula nao e necessariamente 50%. O benchmark adequado deve preservar numero de niveis, distancia ao preco, volatilidade, datas e ativos. Essa e a razao para o Monte Carlo formal permanecer como etapa confirmatoria.

Desenho Monte Carlo

Para cada ativo/data serao gerados niveis nulos com a mesma estrutura de distancia e janela. Recomenda-se $B \geq 10.000$ replicacoes. O p-valor empirico sera calculado pela posicao da estatistica AT.RFG2P dentro da distribuicao nula.

Conclusao

Os testes simples mostram desvio relevante de 50% em algumas metricas, sobretudo no 1o parametro. Contudo, a afirmacao de poder preditivo alem do acaso exige o benchmark aleatorio calibrado, que ainda nao consta como executado na base oficial.

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.