

Robustez Setorial do Metodo AT.RFG2P

Evidencias empiricas em diferentes segmentos do mercado acionario brasileiro

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 agrega as 70 acoes por classificacao setorial presente na base de validacao. A finalidade e verificar se a taxa acao/dia esta concentrada em poucos segmentos ou aparece de forma distribuida.

Resultados por setor - classificacao original da base

Setor	Ativos	Obs.	Acertos	Taxa
Bebidas / Consumo	1	48	48	100.00%
Varejo / Consumo	3	144	144	100.00%
Varejo	4	192	192	100.00%
Educação	2	96	96	100.00%
Energia / Agro	1	47	47	100.00%
Siderurgia	3	144	144	100.00%
Tecnologia / Indústria	1	48	48	100.00%
Financeiro / Holding	1	48	48	100.00%
Tecnologia	3	144	144	100.00%
Mídia / Tecnologia	1	48	48	100.00%
Consumo / Beleza	1	48	48	100.00%
Logística	1	48	48	100.00%
Locação	1	48	48	100.00%
Agro / Açúcar	1	48	48	100.00%
Distribuição / Consumo	1	48	48	100.00%
Logística / Locação	1	47	47	100.00%
Distribuição de Combustíveis	1	47	47	100.00%
Construção	5	239	237	99.16%
Shopping / Imobiliário	2	96	95	98.96%
Saúde	5	237	234	98.73%
Turismo	1	47	46	97.87%
Saúde / Varejo Farma	1	47	46	97.87%
Financeiro	2	97	93	95.88%
Energia	8	383	366	95.56%
Financeiro / Bancos	4	196	186	94.90%
Agro	1	48	45	93.75%
Saúde / Farma	1	47	44	93.62%
Papel e Celulose	2	96	89	92.71%
Indústria	2	95	88	92.63%
Financeiro / Seguros	3	147	136	92.52%
Telecom	1	48	43	89.58%
Alimentos	2	96	84	87.50%
Petróleo e Gás	2	96	78	81.25%
Mineração	1	48	28	58.33%

Interpretacao

Os grupos setoriais possuem tamanhos muito diferentes, inclusive categorias com apenas um ativo. Portanto, taxas de 100% em subgrupos pequenos nao devem ser comparadas diretamente a grupos amplos sem intervalo de confianca ou modelo hierarquico.

Teste recomendado

A versao de submissao deve usar regressao logistica/multinivel ou erros-padrao agrupados, controlando nivel, ativo, volatilidade e tamanho da amostra. A tabela acima e uma fotografia descritiva dos dados consolidados, nao uma prova de efeito causal do setor.

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.