

Aplicacao dos Niveis AT.RFG2P na Estruturacao de Regras de Gestao de Risco

Evidencia do 5P, controle defensivo e desenho de backtest operacional

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

A evidencia de risco disponivel na base oficial esta concentrada no 5P, tratado como ponto defensivo. Em 2026, o 5P foi preservado em 2.032 de 3.356 observacoes (60,55%) e acionado em 1.324 observacoes (39,45%).

Estatistica do 5P

Metrica	Valor
5P preservado	2.032 / 3.356 = 60,55%
5P acionado	1.324 / 3.356 = 39,45%
Wilson 95% preservacao	58.88% - 62.19%
Definicao	Ponto defensivo; preservacao nao equivale a lucro

Relacao com gestao de risco

A preservacao do 5P pode funcionar como variavel de estabilidade defensiva, mas nao permite calcular drawdown, payoff, expectativa matematica ou retorno liquido sem regras formais de entrada, saida, tamanho de posicao, custos e slippage.

Experimento operacional pendente

Metrica	Status
Retorno por operacao	Pendente de regra de entrada/saida
Payoff	Pendente
Drawdown maximo	Pendente
Expectativa matematica	Pendente
Custos/slippage	Pendente de especificacao
Comparacao risco fixo vs volatilidade vs AT.RFG2P	Pendente

Conclusao

A base sustenta uma analise defensiva do 5P, mas nao sustenta ainda alegacao de rentabilidade. O artigo diferencia explicitamente preservacao de stop, ocorrencia de nivel e performance financeira.

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.