

Desempenho Historico e Robustez Temporal do Metodo AT.RFG2P

Backtest temporal, estabilidade entre periodos e regimes de mercado

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 objetivo final é avaliar persistência em janelas longas e diferentes regimes. A base recuperada possui evidência consolidada de 2025 e 2026, com aumento do universo para 70 ativos e 3.356 observações em 2026. Essa janela ainda é curta para ser chamada de backtest de longo prazo completo.

Evidência temporal existente

Base	Obs.	Acertos	Taxa	IDs emitidos	IDs atingidos
2025 historico	165	140	84,85%	1.477	435
2026	3.356	3.221	95,98%	29.140	13.786
2025/2026	3.521	3.361	95,46%	30.617	14.221

Variacao por blocos recentes

Registros intermediarios recuperados mostram variacao relevante entre pregões: 05/06/2026 = 53/70 (75,71%), 08/06 = 63/70 (90,00%), 09/06 = 68/70 (97,14%) e 12/06 = 69/70 (98,57%). Isso reforça a necessidade de modelar o tempo e não apenas reportar o consolidado.

Backtest de longo prazo pendente

Para cumprir integralmente o título, o banco deve ser estendido para vários anos e classificado por regimes de alta, baixa, lateralização e volatilidade. As regras de classificação precisam ser congeladas antes da comparação. A evidência 2025/2026 funciona como primeira camada temporal, não como prova de persistência secular.

Conclusao

A continuidade entre 2025 e 2026 é favorável no critério acao/dia, mas a robustez temporal de longo prazo permanece uma pergunta aberta. A versão atual do artigo documenta a evidência existente e delimita claramente o experimento ainda necessário.

Fonte e rastreabilidade dos dados

Os números empíricos deste documento derivam da base interna consolidada ATB3 de validação 2025/2026 e da lista de 70 ativos G001-G070. A base 2026 registra 3.356 observações, 3.221 acertos acao/dia, 29.140 IDs emitidos e 13.786 IDs atingidos. A consolidação 2025/2026 registra 3.521 observações e 3.361 acertos.

Aviso: resultados históricos não constituem recomendação de investimento, promessa de rentabilidade ou garantia de desempenho futuro. O critério acao/dia mede ocorrência de pelo menos um toque técnico válido ex-5P e não equivale a lucratividade operacional.