

Evidências Empíricas da Eficiência do Método **AT.RFG2P** na Identificação de Níveis Técnicos do Mercado Acionário Brasileiro

Programa Científico AT.RFG2P
Versão 1.0 - Agosto de 2026

3.521 observações oficiais	3.361 acertos ação/dia	95,46% critério ação/dia
30.617 IDs emitidos	14.221 IDs atingidos	46,45% taxa bruta por ID

Documento de síntese científica, técnica, estatística, educacional e informativa. Não constitui recomendação de investimento, promessa de rentabilidade ou garantia de desempenho futuro.

1. Apresentação

Este Resumo Executivo apresenta, de forma sintética, a estrutura metodológica e as principais evidências empíricas documentadas no programa de pesquisa do Método AT.RFG2P, desenvolvido pela ATB3 Inteligência Técnica.

O AT.RFG2P é uma metodologia quantitativa destinada à geração, organização e avaliação de nove níveis técnicos, identificados de 1P a 9P, aplicados ao estudo do comportamento de preços de instrumentos financeiros.

A pesquisa investiga, mediante critérios previamente definidos, dados históricos e procedimentos estatísticos, a ocorrência dos níveis projetados durante os períodos de observação.

Questão central da pesquisa

Os níveis técnicos produzidos pelo Método AT.RFG2P apresentam padrões de ocorrência empiricamente mensuráveis e estatisticamente avaliáveis no mercado acionário brasileiro?

2. Objeto e unidade de estudo

A unidade fundamental de análise é constituída pela relação entre ativo x data/pregão x nível técnico projetado x comportamento observado do preço.

Para cada observação podem ser registrados: identificação do ativo; data do pregão; abertura, máxima, mínima e fechamento; níveis 1P a 9P; tolerância aplicável; ocorrência ou não ocorrência; distância até o nível; versão metodológica; timestamps e registros de auditoria.

Essa estrutura separa a geração do nível de sua posterior avaliação empírica.

3. Estrutura e reprodutibilidade do AT.RFG2P

O método organiza sua estrutura analítica em 1P, 2P, 3P, 4P, 5P, 6P, 7P, 8P e 9P. Os níveis são calculados segundo regras próprias da metodologia e posteriormente avaliados contra os preços observados.

Princípio de reprodutibilidade: mantidos os mesmos dados de entrada, parâmetros, regras de arredondamento e versão metodológica, a geração técnica deve produzir os mesmos níveis projetados.

A metodologia prevê versionamento e preservação dos dados necessários à rastreabilidade dos estudos.

4. Regra de tolerância

A avaliação não considera exclusivamente igualdade absoluta entre o preço observado e o valor projetado. A metodologia utiliza tolerância técnica definida segundo a faixa de preço do ativo.

Preço de referência	Tolerância
Acima de R\$ 5,00	R\$ 0,12
Faixa de R\$ 4,00	R\$ 0,04
Faixa de R\$ 3,00	R\$ 0,03

Faixa de R\$ 2,00	R\$ 0,02
R\$ 1,00 ou abaixo	R\$ 0,01

A aplicação formal da tolerância deve seguir a especificação matemática e a versão metodológica correspondente ao estudo.

5. Evidências históricas consolidadas

A base histórica consolidada utilizada pela ATB3 para o período documentado de 2025/2026 apresenta os indicadores abaixo.

Indicador	Resultado
Observações oficiais	3.521
Acertos pelo critério ação/dia	3.361
Assertividade ação/dia	95,46%
IDs técnicos emitidos	30.617
IDs técnicos atingidos	14.221
Taxa bruta de ocorrência por ID	46,45%

6. Distinção fundamental entre as métricas

A taxa de 95,46% corresponde ao critério agregado ação/dia: $3.361 / 3.521 \times 100 \approx 95,46\%$.

A taxa de 46,45% considera individualmente os IDs técnicos emitidos: $14.221 / 30.617 \times 100 \approx 46,45\%$.

95,46% não significa que 95,46% de todos os níveis 1P-9P emitidos tenham sido atingidos. As duas taxas utilizam unidades estatísticas distintas.

7. Universo estudado

O ecossistema atual da ATB3 contempla 88 ativos da Bolsa Brasileira (G001-G088), 15 criptoativos (CR001-CR015) e WDO - Mini Dólar como categoria específica de estudo.

O universo comercial ou operacional disponível atualmente não deve ser confundido com a amostra histórica utilizada em determinada validação. Na consolidação 2026 anteriormente documentada, a validação compreende G001-G070, correspondentes a 70 ativos.

8. Controles metodológicos

Congelamento: preservação dos níveis antes da observação do resultado.

Controle de look-ahead bias: informações futuras não devem participar da construção dos níveis avaliados.

Versionamento: identificação do conjunto de regras que produziu determinado resultado.

Preservação da base original: vedação de alterações retrospectivas destinadas a melhorar artificialmente o desempenho.

Rastreabilidade: registros, timestamps e estruturas de auditoria.

In-sample / out-of-sample: separação entre desenvolvimento e validação prospectiva.

9. Programa Científico AT.RFG2P

FASE 1 - FUNDAMENTAÇÃO: Protocolo Científico; Dicionário de Dados e Banco Científico; Especificação Matemática Formal.

FASE 2 - EVIDÊNCIAS: Artigos 1 a 9: validação estatística; comparação com análise técnica tradicional; passeio aleatório; eficiência dos níveis 1P-9P; aplicação em ações B3; robustez setorial; teste fora da amostra; gestão de risco; backtest de longo prazo.

FASE 3 - CONSOLIDAÇÃO: Artigo 10 - Evidências Empíricas do Método AT.RFG2P: Uma Avaliação Estatística, Comparativa e Robusta de Níveis Técnicos no Mercado Acionário Brasileiro.

10. Interpretação científica dos resultados

Os registros históricos disponíveis constituem evidência empírica relevante para investigação científica, justificando testes sobre significância, estabilidade por nível, ativo e setor, comparação com benchmarks e validação fora da amostra.

Os números históricos, isoladamente, não demonstram causalidade, não garantem repetição futura e não devem ser interpretados automaticamente como prova de capacidade preditiva economicamente explorável.

Uma taxa elevada no critério ação/dia não pode ser convertida diretamente em rentabilidade, probabilidade de lucro, taxa de operações vencedoras ou probabilidade individual de cada nível ser atingido.

11. Próxima etapa científica

A prioridade é o Artigo 1 - Validação Estatística do Método AT.RFG2P. A análise deverá reconstruir o banco observação por observação e calcular taxas de ocorrência, intervalos de confiança, efeitos por nível, ativo e pregão, testes de hipótese, benchmarks nulos, testes de permutação e análises de sensibilidade e robustez.

Somente após esses procedimentos as hipóteses científicas correspondentes poderão ser avaliadas formalmente.

12. Conclusão executiva

A documentação histórica acumulada pela ATB3 apresenta uma base estruturada para o desenvolvimento de um programa formal de investigação científica do AT.RFG2P.

Os registros consolidados de 2025/2026 apresentam 3.521 observações oficiais, das quais 3.361 foram classificadas como acertos pelo critério ação/dia, correspondendo a 95,46% nessa unidade específica de avaliação. Separadamente, foram documentados 30.617 IDs técnicos emitidos, dos quais 14.221 foram atingidos, correspondendo a uma taxa bruta de 46,45% por ID.

Esses resultados devem ser tratados como evidências históricas a serem submetidas a testes estatísticos, comparações, controles de viés, validação fora da amostra e análises de robustez - e não como conclusão definitiva sobre capacidade preditiva ou desempenho financeiro.

O objetivo do Programa Científico AT.RFG2P é avançar da documentação histórica para uma avaliação formal, transparente, reproduzível e cientificamente testável.

ATB3 Inteligência Técnica Ltda.
Programa Científico AT.RFG2P

Resumo Executivo - Versão 1.0 | Agosto de 2026

Aviso: este documento possui finalidade científica, técnica, estatística, educacional e informativa. Não constitui recomendação de compra, venda ou manutenção de ativos, consultoria individualizada, promessa de rentabilidade ou garantia de resultados futuros.