

ATB3 RESEARCH

RFG-02

Especificação Funcional e Fluxo Algorítmico

Indicador RFG de Tendência Direcional - RFG-DTI v1.0

Desenvolvedor: Rodrigo Facundes Gonçalves

Status: FINALIZADO

Documento técnico-científico de pesquisa e desenvolvimento. Não constitui recomendação de investimento, promessa de rentabilidade ou garantia de resultados.

1. Finalidade

Descrever o fluxo funcional de geração do Indicador RFG sem exigir exposição pública do núcleo algorítmico proprietário.

2. Fluxo operacional

Dados do pregão D-1 -> algoritmo RFG -> classe D1/D2 -> registro pré-pregão -> pregão D -> validação posterior

3. Momento de cálculo

O RFG é calculado antes da abertura do pregão-alvo, com referência operacional às 08:00 BRT ou em registro anterior comprovadamente congelado. Somente dados disponíveis antes da abertura podem participar da geração.

4. Dados de entrada

A base utiliza informações do pregão anterior e demais variáveis efetivamente existentes no algoritmo. Campos não existentes não devem ser inventados. O conjunto exato de variáveis proprietárias pode permanecer confidencial.

5. Saída do algoritmo

A saída pública/auditável mínima é uma das nove classes, decomposta em predicted_d1, predicted_d2 e predicted_class.

Código	Classe
AA	ALTA/ALTA
AB	ALTA/BAIXA
AL	ALTA/LATERAL
BA	BAIXA/ALTA
BB	BAIXA/BAIXA
BL	BAIXA/LATERAL
LA	LATERAL/ALTA
LB	LATERAL/BAIXA
LL	LATERAL/LATERAL

6. Separação entre previsão e realizado

f_RFG(X_D-1) -> sinal_D | g_validation(P_D(t)) -> classe_realizada_D

7. No look-ahead

Informações do próprio pregão D são proibidas na geração do sinal D. Elas entram somente na camada REALIZED/EVALUATED após o evento.

8. Registro e congelamento

Cada sinal deverá possuir timestamp, versão, ativo, data-alvo e classe. Após o freeze, o valor original não poderá ser sobrescrito. Correções administrativas devem preservar a trilha original.

9. Proteção comercial

O protocolo científico não exige publicar fórmula, código-fonte ou pseudocódigo integral do algoritmo proprietário. É suficiente descrever entradas, sequência funcional, governança, saída e regras de validação com rastreabilidade adequada.

10. Conclusão

O RFG-02 formaliza como o sinal é gerado antes do pregão e como será posteriormente avaliado, preservando simultaneamente auditabilidade científica e propriedade intelectual.

Controle documental

Documento integrante da série técnica do Indicador RFG de Tendência Direcional. Alterações materiais posteriores devem ser registradas em nova versão, preservando a rastreabilidade das versões anteriores.

ATB3 Research | Agosto de 2026