

ATB3 RESEARCH

RFG-07

Validação Histórica Quantitativa

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

Desenvolvedor: Rodrigo Facundes Gonçalves

Status: FINALIZADO - EVIDÊNCIA HISTÓRICA EXPLORATÓRIA

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

1. Finalidade

Aplicar uma regra objetiva de reconstrução histórica do primeiro componente D1 e quantificar a correspondência com as classificações históricas.

2. Base e elegibilidade

Universo histórico: 75 observações de ITUB4. Amostra quantitativa elegível para aplicação uniforme da regra D1: 52 observações com janela intradiária suficiente.

3. Regra D1 avaliada

D1 = primeira direção que alcança $\pm 0,30\%$ dentro dos primeiros 60 minutos; sem confirmação -> LATERAL

4. Resultado D1

23/52 = 44,23%

5. Componente D2

A concordância estrutural de D2 na base histórica não é interpretada como validação independente, pois a direção final histórica estava estruturalmente relacionada ao segundo componente informado.

6. Correspondência integral histórica

Accuracy Full = 23/52 = 44,23% | IC95% Wilson $\approx$ [31,60%; 57,66%]

7. Benchmark majoritário reconstruído

BB = 20/52 = 38,46% | diferença descritiva = +5,77 p.p.

8. Matriz 9x9

Prev./Real	AA	AB	AL	BA	BB	BL	LA	LB	LL
AA	6	0	0	10	0	0	1	0	0
AB	0	0	0	0	7	0	0	0	0
AL	0	0	1	0	0	2	0	0	0
BA	0	0	0	2	0	0	0	0	0
BB	0	3	0	0	13	0	0	3	0
BL	0	0	1	0	0	1	0	0	2
LA	0	0	0	0	0	0	0	0	0
LB	0	0	0	0	0	0	0	0	0
LL	0	0	0	0	0	0	0	0	0

9. Métricas complementares

Balanced Accuracy $\approx$ 29,44%; Macro-F1 $\approx$ 24,00%; Cohen Kappa $\approx$ 0,302; MCC multiclass $\approx$ 0,320.

10. Principal achado

A regra $\pm 0,30\%/60$ minutos é reproduzível, porém mostrou sensibilidade elevada e não representou suficientemente o conceito original de D1. O resultado motivou revisão metodológica em vez de recalibração retroativa.

11. Conclusão

O RFG-07 é classificado como evidência histórica exploratória, não confirmatória. O RFG-DTI v1.0 permanece preservado e os resultados desfavoráveis não foram removidos.

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