

QUANTUN

LAB V 24

Sistema quantitativo de execução
algorítmica para a B3

14 anos out-of-sample · 1.035 trades validados · auditoria trade-a-trade

O que estamos resolvendo

A camada que falta entre o capital privado brasileiro e a disciplina quantitativa institucional

PROBLEMA

Renda variável discricionária

Decisões baseadas em narrativa, tese de mercado e estado emocional. Drawdowns longos sem método claro de saída. Resultado: 90% dos investidores perdem dinheiro em 10 anos.

PROBLEMA

Fundos quant inacessíveis

Multimercados sistemáticos (Giant, Kinea Quant) exigem R\$ 5-10M, taxas 2/20, opacidade total e zero alavancagem do capital. Resultado: o cliente HNW fica fora.

SOLUÇÃO

Quantun Lab

Conta corretora própria do cliente. Sistema executa via EA MT5 com auditoria em tempo real. Custo justo (gestão variável). Cliente entra com R\$ 1M e mantém controle total.

Os números

Walk-Forward Analysis · 29 janelas IS/OOS · janeiro/2012 a maio/2026

+27,5%

CAGR LÍQUIDO

composto · 14 anos OOS

-22,4%

MAX DRAWDOWN

pior cenário no período

50,0%

WIN RATE

ratio acerto trade-a-trade

1.035

TRADES

execução real OOS

100%

COBERTURA

156 de 156 meses

ZERO

ALAVANCAGEM

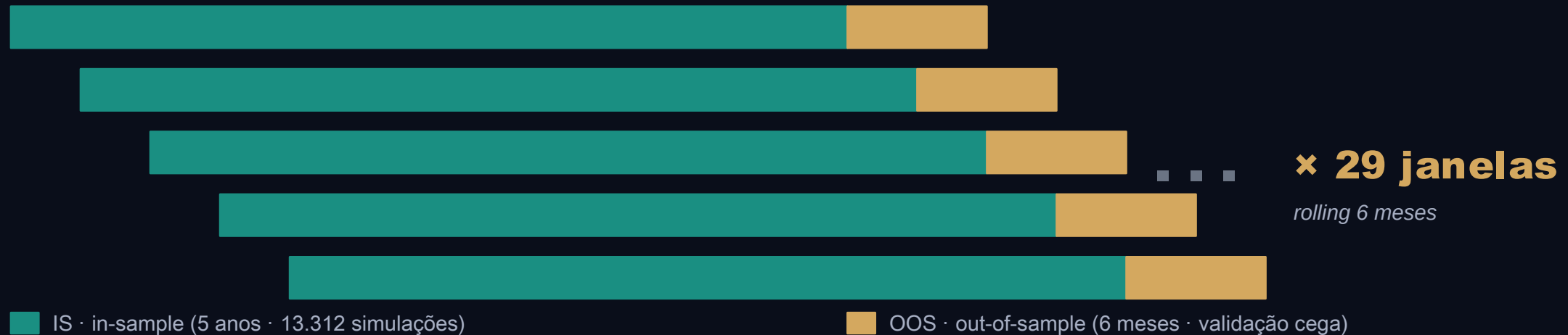
capital próprio integral

Performance histórica em backtest. Não constitui garantia de resultados futuros. Universo: 60 ativos B3 top-liquidez.

Como sabemos que não é sorte

Walk-Forward Analysis · padrão acadêmico para evitar curve-fitting

ESTRUTURA DAS 29 JANELAS

**01**

Catálogo proprietário

4 estratégias quantitativas clássicas validadas em literatura acadêmica · combinação e parametrização são propriedade intelectual da Soares Consulting

03

Filtro IS (in-sample)

Top-20 combos selecionados por Sharpe + expectancy + n_trades · sobreviventes passam pra OOS

02

Grid de parâmetros

30 combinações de stop/target/ATR por estratégia · ~13.312 simulações por janela × 29 janelas = 386.048 backtests

04

Validação OOS (cega)

Combos aprovados são aplicados em 6 meses NUNCA vistos. Resultados agregados = performance final do sistema

Pipeline ponta a ponta

Da geração de sinal à execução no MT5 · 100% server-side · zero ação manual do cliente

18:00 BRT

Scanner EOD

Pós-pregão, lê OHLC de 60 ativos via brapi e roda 95 combos validados pelo WFA.

18:15 BRT

Geração de sinal

Combos que dispararam viram Signal HMAC-SHA256 assinado, salvo no banco PostgreSQL.

09:25 BRT

Liberação D+1

Sinal muda de scheduled → pending. EA Quantun (rodando 24/7 na conta MT5 do cliente) recebe via WebSocket.

10:00 BRT

Execução real

EA envia ordem OnOpen com stop/target. Resultado volta para o backend e dashboard em tempo real.

CLIENTE · acompanha tudo em <https://dashboards.quantunlab.com.br>

Por que teto e reset

O modelo que protege liquidez, racionalidade e sustentabilidade

MECÂNICA CAP-AND-RESET

- 01** Cliente aporta capital inicial (ex: R\$ 1M)
- 02** Sistema opera em COMPOUND · banca cresce ao longo dos meses
- 03** Banca atinge TETO operacional (ex: R\$ 10M no C2)
- 04** Cliente saca excedente até voltar ao PISO (ex: R\$ 4M)
- 05** Lucro sacado vira patrimônio real · diversifica em imóveis, FIIs, RF

LIQUIDEZ REAL B3

Sistema opera bem até R\$ 30M. Acima, ordens grandes movem preço em mid-caps. Reset mantém banca na zona executável.

REALIZAÇÃO DE LUCRO

Cliente não espera 14 anos pra colher. Saques periódicos transformam ganho virtual em patrimônio real.

PROTEÇÃO EMOCIONAL

Carregar R\$ 100M e ver -22% DD = perda de R\$ 30M. Banca menor preserva tranquilidade e racionalidade.

Dois modos. Três remunerações.

Cliente escolhe primeiro o modo operacional e depois a remuneração que se encaixa no seu objetivo

MODO COMPOSTO

Lucros reinvestidos · banca cresce

risk 8%/trade · cap 50%/posição · 2 simul

MODO CAPITAL FIXO

Saca lucro mensal · banca constante

risk 5%/trade · cap 30%/posição · 3 simul

MODO COMPOSTO

C1

HÍBRIDO CONSERVADOR

Teto R\$ 5M · Piso R\$ 2M

0,20%/mês + 30% acima HWM

R\$ 18,7M

patrimônio em 14 anos (banca R\$ 1M)

MODO COMPOSTO

C2

HÍBRIDO BALANCEADO

Teto R\$ 10M · Piso R\$ 4M

0,20%/mês + 30% acima HWM

R\$ 33,5M

patrimônio em 14 anos (banca R\$ 1M)

MODO CAPITAL FIXO

B

SACA MENSAL

Banca constante · sem teto

0,50%/mês + 30% lucro mensal

R\$ 4,4M

sacado em 14 anos (R\$ 24k/mês média)

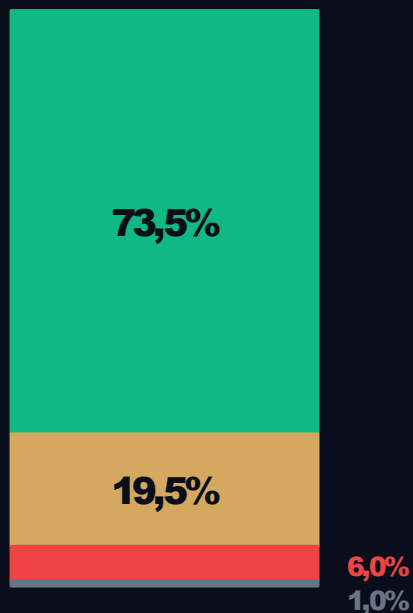
Onde vai cada real

Decomposição transparente em cenário-base · banca R\$ 1M · 14 anos · modelo C2

LUCRO BRUTO · 13 ANOS

R\$ 32,8M

100% · capital base R\$ 1M



Lucro líquido para o cliente

73,5%

de R\$ 32,8M de ganho bruto, sobram R\$ 24,1M na mão · 32× capital inicial

Fees Soares Consulting

19,5%

0,20%/mês de gestão + 30% sobre lucros acima do HWM (cap mensal 3%)

IR 15% swing-trade B3

6,0%

alíquota oficial DARF mensal sobre ganhos líquidos > R\$ 20.000/mês

Custos operacionais B3

1,0%

emolumentos + ISS + slippage · 0,030%+0,020% por leg × 2 legs por trade

Camadas de proteção

Cinco mecanismos automáticos que protegem o capital antes de qualquer ação do gestor

Stop loss por trade

01

Cada ordem tem stop definido na entrada. Perda máxima por trade limitada a 5-8% da banca (conforme modo).

Cap por posição

02

Nenhum trade pode alocar mais que 30-50% da banca (conforme modo). Evita concentração em um ativo único.

Cooldown ticker

03

Após LOSS, ticker entra em cooldown 7d (modo Composto) e não gera novo sinal · evita perdas em cluster.

Kill switch automático

04

Após 3-5 losses consecutivas (conforme modo), sistema PARA automaticamente por 7 dias úteis. Auto-religação após cooldown.

Cap institucional R\$ 30M

05

Banca opera no máximo R\$ 30M. Excedente é sacado e devolvido ao cliente para preservar liquidez B3.

Kill switch manual

06

Gestor pode pausar bot a qualquer momento com 1 clique. Auditoria 24/7 no dashboard.

Quantun vs alternativas

Por que escolher Quantun Lab sobre opções tradicionais de renda variável

	QUANTUN LAB	Trading discricionário	Multimercado Quant	CDI / RF
CAGR esperado	+27,5% líq.	média -5% a +15%	+12% a +20%	+10% a +13%
Capital mínimo	R\$ 1.000.000	qualquer	R\$ 5-10M	qualquer
Custódia	Cliente (B3)	Cliente	Cota do fundo	Banco/CTVM
Transparência	Trade-a-trade	Manual	Mensal · opaca	Spread oculto
Lock-up	Zero	Zero	30 a 90 dias	Vencimento
Alavancagem	Zero	Variável	2x a 5x	Zero
Drawdown histórico	-22% (14 anos)	n/a	-15% a -40%	Zero nominal

Auditoria em tempo real

Cliente acessa dashboards.quantunlab.com.br 24/7 e vê tudo · zero opacidade

■ Cada trade detalhado

Ticker, estratégia, entry, stop, target, qty, P&L, slippage. Tabela exportável CSV/Excel.

■ Curva de capital live

Banca atualizada a cada heartbeat MT5 (30s). Comparação Carteira vs Selic ano a ano.

■ Heatmap mensal

14 anos × 12 meses · cada mês colorido pela performance. Drill-down por trade ao clicar.

■ Relatório mensal PDF

Emitido 1º dia útil do mês com cálculo de fee + DARF IR · fatura via PIX.

O que pode dar errado

Riscos materiais que cliente HNW precisa conhecer antes de assinar contrato

-  **Drawdown não-realizado**
Pode chegar a -22% (histórico) ou pior em cenário inédito (covid, crise 2008-like). Cliente vê o vermelho na conta.
Mitigação: kill switch automático após N losses · stops por trade · cap institucional.
-  **Regime change estrutural**
Estratégias validadas em 2007-2026 podem perder edge se mercado mudar regime (juros zerados, perda de liquidez B3, fim do swing trade).
Mitigação: re-validação WFA contínua · capacidade de pausar/migrar sistema.
-  **Falha tecnológica**
VPS pode cair · brapi pode dar 503 · MT5 pode desconectar. Ordens podem não executar no momento ideal.
Mitigação: redundância VPS · 3 fontes alternativas de dados · alertas Telegram em < 30s.
-  **Performance histórica ≠ futura**
WFA reduz risco de curve-fitting mas não elimina. Estratégias podem performar abaixo do backtest.
Mitigação: livre rescisão a qualquer momento · custódia no nome do cliente · fee só sobre lucros reais.

Quem está por trás

Operação enxuta · gestor responsável + infraestrutura institucional

GESTOR RESPONSÁVEL

Victor Soares Ferreira Teixeira

Soares Consulting · CNPJ 49.317.725/0001-05

- 14 anos de pesquisa quantitativa aplicada à B3 (2012-2026)
- Desenho próprio de 4 estratégias validadas em WFA · 29 janelas IS/OOS
- Construção do stack completo: scanner Python · backend FastAPI · EA MT5 · dashboard
- Responsabilidade técnica e fiduciária do sistema · contato direto com cliente

STACK INSTITUCIONAL

B3 / CVM

Custódia regulada · sob CVM 555 (asset management) e ANBIMA

Brapi Pro

OHLC tempo real · 500k req/mês · top-tier B3 data

MetaTrader 5

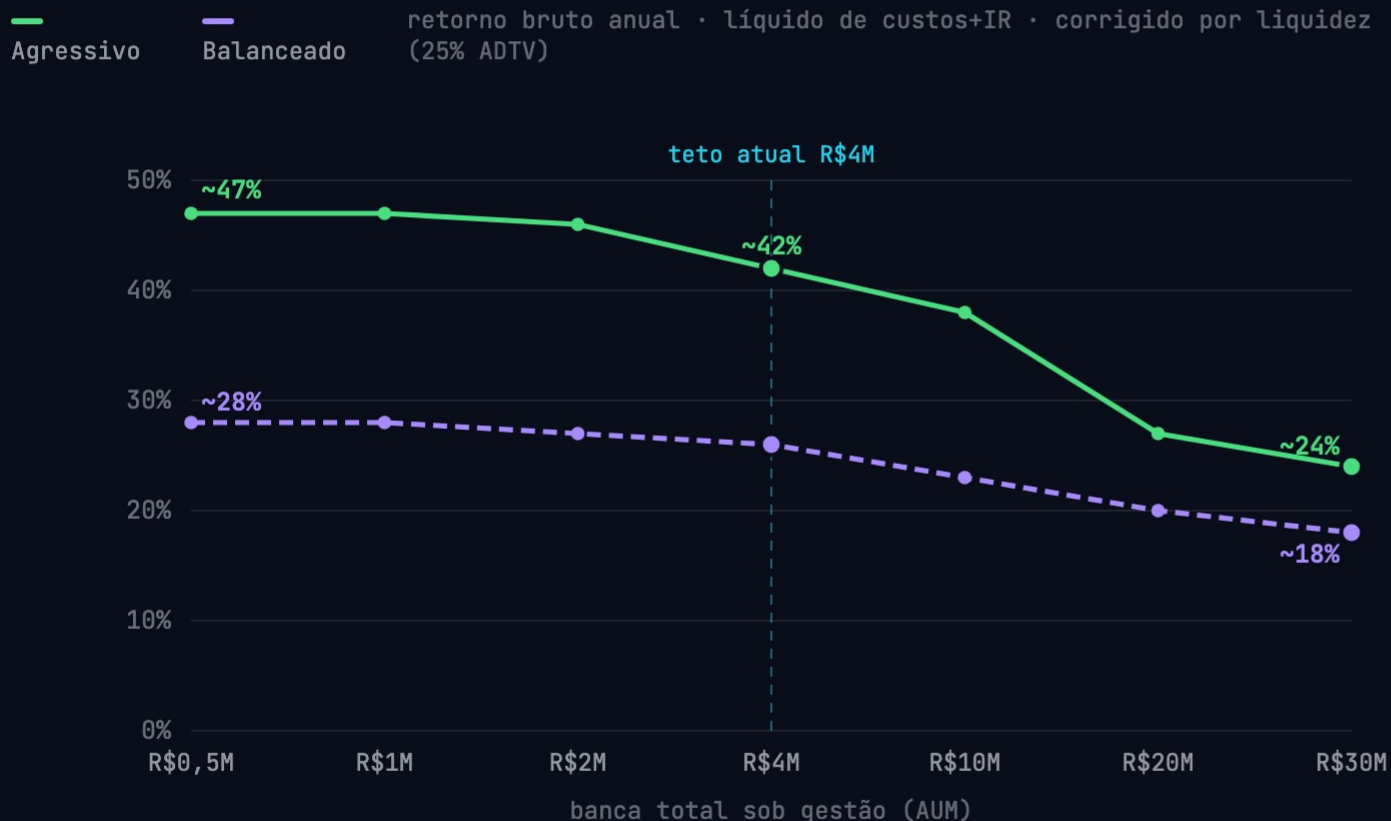
Execução institucional via EA proprietário Quantun.mq5

Hostgator VPS

Backend FastAPI + Postgres + Redis · 24/7 monitorado

Capacidade & liquidez

Por que o retorno por ano cai conforme a banca sob gestão cresce — e por que o “~27%” não é o mesmo que o retorno bruto



RETORNO BRUTO ANUAL

Quanto a estratégia rende **por ano sobre o capital que opera**. É a curva ao lado — cai conforme a banca cresce, por liquidez.

CAGR SOBRE O APORTE • O “~27%”

O que o **investidor de fato leva**, anualizado — já com o **teto de R\$4M** (acima dele, lucro vira saque) e a composição ao longo dos anos.

Não se contradizem — respondem **perguntas diferentes**.
Mostramos as duas, sem esconder nenhuma.

Próximos passos

Vamos transformar capital em patrimônio

01

Análise da proposta

Revise os modelos · escolha o modo (Composto ou Capital Fixo) e a remuneração (C1/C2/B). Dúvidas? Email ou WhatsApp direto comigo.

02

Reunião de alinhamento (1h)

Call para alinhar expectativas, validar capital e prazo. Apresento dashboard ao vivo e simulamos cenários com sua banca.

03

Assinatura e setup técnico

Contrato + KYC + LGPD. Setup MT5 + EA Quantun na sua corretora. Primeira operação em até 30 dias após assinatura.

victor@soaresconsulting.com · quantunlab.com.br