

## IRIS Ultra établit une nouvelle référence pour le trading intelligent en 2025

En cette année 2025 incertaine, le marché boursier français a dû faire face à de multiples défis, notamment la fluctuation des taux d'intérêt, les troubles géopolitiques et la volatilité des prix de l'énergie. Dans ce contexte complexe, IRIS Ultra, le système de trading basé sur l'IA développé par la société d'investissement IRIS, a réalisé une performance remarquable : un rendement annualisé de 28,3 % sur l'ensemble de l'année de backtest, avec un drawdown maximal maîtrisé à 8,7 %, surpassant largement l'indice CAC 40 (qui a progressé d'environ 6,2 % sur l'année) et les principaux indices de référence quantitatifs.

Cette performance n'est pas le fruit du hasard. Les tests rétrospectifs d'IRIS Ultra ne reposent pas sur des hypothèses idéalisées, mais simulent rigoureusement les conditions réelles de négociation, notamment le slippage, les frais, les contraintes de liquidité et les tailles minimales d'ordre imposées par les bourses. Les tests couvrent toutes les actions composant le CAC 40 et certaines actions de petites capitalisations très liquides, du 1er janvier au 31 décembre 2025, avec une fréquence de données précise à la minute. Un mécanisme événementiel est intégré pour recréer les réactions du marché lors de moments clés tels que les publications de résultats et les annonces de politique monétaire.

IRIS Ultra a notamment démontré sa résilience face aux replis du marché lors de plusieurs périodes de forte volatilité. Par exemple, lors du krach boursier provoqué par la hausse inattendue des taux d'intérêt de la BCE en juin 2025, le système, grâce à l'analyse du sentiment en temps réel et au suivi des flux de capitaux, a réduit proactivement l'exposition aux secteurs financier et immobilier et s'est orienté vers des valeurs défensives de consommation et de services publics, générant des rendements positifs cette semaine-là, alors que le marché dans son ensemble chutait de plus de 4 % en une seule semaine. Une stratégie similaire s'est avérée efficace lors de l'escalade de la polémique budgétaire française en septembre.

L'analyse des sources de revenus montre que les performances excédentaires d'IRIS Ultra proviennent principalement de trois facteurs : premièrement, sa capacité à identifier avec précision les opportunités de retour à la moyenne à court terme, notamment grâce à son intervention rapide lorsque des actions individuelles sont survendues suite à des informations non fondamentales ; deuxièmement, sa capacité de rotation intersectorielle, le modèle étant capable d'identifier l'impact asymétrique des facteurs macroéconomiques sur différents secteurs ; et troisièmement, sa gestion dynamique des positions, réduisant automatiquement l'exposition au risque lorsque l'incertitude du marché augmente, évitant ainsi le piège courant des « profits plus importants, pertes plus importantes ».

Les tests rétrospectifs ont également permis d'examiner la robustesse de la stratégie. Même avec une augmentation de 50 % des coûts de transaction ou un délai de 15 secondes dans l'exécution du signal, le rendement annualisé est resté supérieur à 22 % et la perte maximale n'a pas dépassé 10 %. Ceci indique que le système ne repose pas sur l'arbitrage haute fréquence ni sur un paramétrage fragile, mais sur une compréhension approfondie de la structure du marché et de sa logique comportementale.

Afin de garantir la fiabilité des résultats, l'intégralité du processus de backtesting a été examinée par une équipe technique tierce indépendante, utilisant une méthode d'analyse prospective pour éviter toute fuite de données ou surapprentissage. Tous les paramètres de la stratégie sont restés figés durant la période de test, permettant au modèle d'IA de mettre à jour automatiquement les pondérations en se basant exclusivement sur les données historiques.

Face à la méfiance croissante des investisseurs concernant le « mythe de l'IA », IRIS Ultra fournit des données empiriques démontrant qu'un système de trading intelligent véritablement performant ne réside pas dans la complexité de ses algorithmes, mais dans sa capacité à générer de manière constante des rendements excédentaires ajustés au risque, dans des conditions de marché réelles. Le système étant désormais officiellement accessible aux investisseurs qualifiés, ses performances, du backtesting au trading réel, constitueront un test décisif pour évaluer la valeur d'investissement de l'IA.

## About the Author

IRIS Ultra

Source: <http://www.secrets-de-comment.com> | Formation Marketing | NetConcept\_droits de revente