

Abstrakt

Práce se pokouší určit, jakou úspěšnost mají strategie používané na forexových a akciových trzích při aplikaci na kryptoměnové trhy. Zkoumanými přístupy jsou ARIMA, VAR, MA Crossover (klouzavý průměr) a Grangerova kauzalita s využitím cen zlata a S&P 500. Obchodovanými kryptoměny jsou Bitcoin, Ethereum, Binance Coin a Basic Attention Token. Modely jsou trénovány na logaritmicky transformovaných a diferencovaných časových řadách složených z konečných denních a hodinových cen jednotlivých měn. Aplikace strategií vede k nejednoznačným výsledkům. MA Crossover dosahuje obecně lepších výsledků než VAR, ARIMA pak vede k nejhorším. Přesto každá strategie funguje přijatelně pro alespoň jednu z měn. Obchodování na hodinových řadách bylo negativně ovlivněno náhlými cenovými skoky. ARIMA a VAR dosahují lepších výsledků v obdobích mezi cenovými bublinami. Signifikantní Grangerova kauzalita nebyla nalezena.

Klíčová slova	Kryptoměny, Obchodování, Bitcoin, Ethereum, Binance Coin, Basic Attention Token, ARIMA, VAR, Klouzavý průměr, Grangerova kauzalita
Název práce	Ziskovost standardních obchodních strategií na kryptoměnových trzích
E-mail autora	miroslav.duda11@gmail.com
E-mail vedoucího práce	ladislav.kristoufek@fsv.cuni.cz