

Tato práce se zaměřuje na spready na futuritních trzích, konkrétně studuje obchodní strategie založené na dvou přístupech - kointegrace otestovaná na inter-komoditních spreadech a sezónnost kterou pozorujeme na kalendářních (intra-komoditních) spreadech. Na párech kontraktů, které jsou kointegrované budeme testovat strategie založené na návratu k průměru. Tři strategie budou využívat filtr tzv. 'férové hodnoty', jedna bude pracovat s hodnotou relativní. Podobným způsobem budeme na kalendářních spreadech testovat strategie typu "buy and hold". Všechny strategie testujeme na in-sample a out-of-sample datech. Sezónní strategie nevygenerovaly dostatečně ziskové strategie, některé inter-komoditní spready se naopak ukázaly jako profitabilní v obou testovacích periodách. Výjimku u inter-komoditních spreadů tvořily zejména všeobecně známé spready, které v out-of-sample testech neobstály.