

Cílem práce je charakterizovat zisk maximalizující užitkovou funkci. Jedním způsobem je řešení věrohodnostního poměru mezi subjektivními pravděpodobnostními mírami agenta P a rizikově neutrální mírou trhu Q . Takovéto výnosy by měly být převedeny na funkci konečné ceny aktiv. Otázkou je, jakou míru P zvolit. Práce by měla shrnout Kellyho kritérium pro binomický vývoj ceny akcií a také problém Mertonova portfolia uvažující geometrický Brownův pohyb. Dále se ukáže spojitost s Bayesovskou statistikou, která umožňuje rozšíření z již dobře známých výsledků. Práce by měla pojednávat o cenách a zajištění kontraktů spolu s jejich asymptotickým chováním.