

V předložené práci se věnujeme Kellyho strategii, která je jednoduchým návodem, jak zvolit sázený podíl kapitálu při hraní hazardních her, které mají kladnou střední hodnotu. V první části práce seznámíme čtenáře s matematickým zdůvodněním, prozkoumáme vývoj kapitálu po n pokusech v závislosti na volbě sázeného podílu, dlouhodobou míru výnosnosti a asymptotické vlastnosti růstu kapitálu. V druhé části se pokusíme zobecnit Kellyho kritérium z první části pro některé situace. Pro ilustraci vlastností Kellyho kritéria uvedeme v poslední části práce příklady pro jednoduchou hru i zobecněné situace a aplikujeme na ně získané znalosti z předcházejících částí.