

# 在卡拉玛常数下的欧式看涨期权定价

我们定义一个行权价为K欧式期权,底层资产为S的欧式期权。它的赔付函数为  $\max(K - S, 0)$ 。在概率测度P下，对该合约定价  $\mathbb{E}^P[(S - K)^+] = \int_{k}^{\infty} (k - s) , ds$