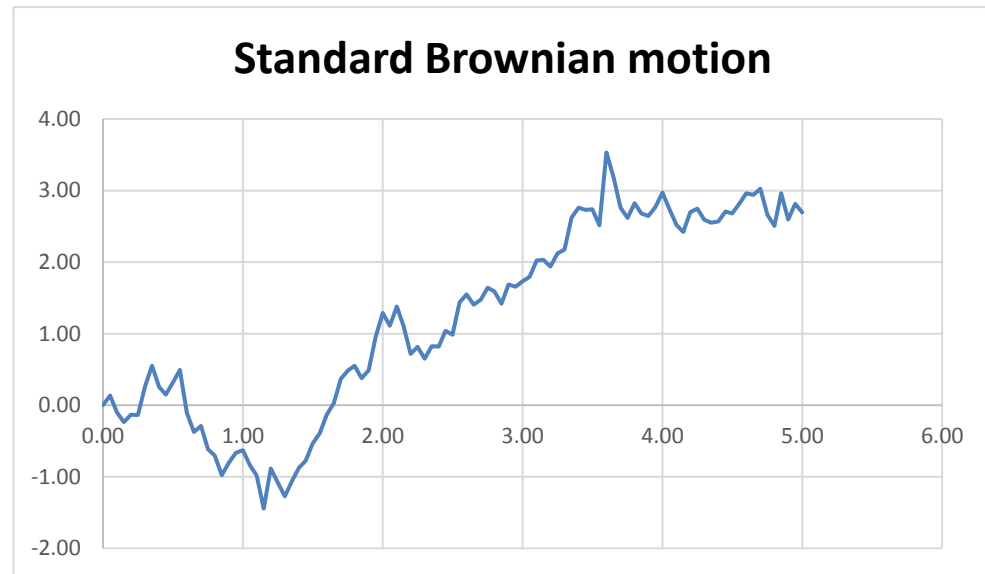


Simulating standard Brownian Motion

Simulate $W(t)$ over $[0,T]$

T	5
N	100
delta t	0.05
W0	0

t	RAND()	Sample number from $N(0,1)$	W_t
0.00			0.00
0.05	0.72	0.60	0.13
0.10	0.15	-1.03	-0.10
0.15	0.27	-0.62	-0.23
0.20	0.68	0.46	-0.13
0.25	0.49	-0.02	-0.14
0.30	0.96	1.78	0.26
0.35	0.90	1.31	0.55
0.40	0.09	-1.32	0.26
0.45	0.31	-0.49	0.15
0.50	0.77	0.75	0.31
0.55	0.79	0.81	0.50
0.60	0.00	-2.71	-0.11
0.65	0.12	-1.18	-0.37
0.70	0.64	0.37	-0.29
0.75	0.07	-1.45	-0.62
0.80	0.34	-0.41	-0.71
0.85	0.11	-1.20	-0.98
0.90	0.78	0.78	-0.80



0.95	0.73	0.61	-0.67
1.00	0.56	0.16	-0.63
1.05	0.17	-0.94	-0.84
1.10	0.26	-0.64	-0.98
1.15	0.02	-2.06	-1.45
1.20	0.99	2.51	-0.88
1.25	0.19	-0.87	-1.08
1.30	0.19	-0.87	-1.27
1.35	0.83	0.95	-1.06
1.40	0.80	0.83	-0.88
1.45	0.67	0.44	-0.78
1.50	0.86	1.07	-0.54
1.55	0.74	0.64	-0.39
1.60	0.88	1.18	-0.13
1.65	0.76	0.71	0.03
1.70	0.94	1.52	0.37
1.75	0.70	0.53	0.48
1.80	0.62	0.30	0.55
1.85	0.22	-0.78	0.38
1.90	0.69	0.49	0.49
1.95	0.98	2.10	0.96
2.00	0.93	1.49	1.29
2.05	0.21	-0.80	1.11
2.10	0.88	1.20	1.38
2.15	0.11	-1.21	1.11
2.20	0.04	-1.74	0.72
2.25	0.67	0.43	0.81
2.30	0.23	-0.74	0.65
2.35	0.78	0.78	0.82
2.40	0.49	-0.03	0.82
2.45	0.84	0.99	1.04
2.50	0.41	-0.24	0.99

2.55	0.98	2.01	1.44
2.60	0.69	0.50	1.55
2.65	0.26	-0.64	1.41
2.70	0.62	0.31	1.47
2.75	0.77	0.75	1.64
2.80	0.40	-0.24	1.59
2.85	0.23	-0.74	1.42
2.90	0.88	1.19	1.69
2.95	0.44	-0.14	1.66
3.00	0.63	0.34	1.73
3.05	0.61	0.29	1.80
3.10	0.84	1.01	2.02
3.15	0.52	0.04	2.03
3.20	0.33	-0.43	1.94
3.25	0.79	0.82	2.12
3.30	0.60	0.25	2.18
3.35	0.98	1.98	2.62
3.40	0.73	0.63	2.76
3.45	0.44	-0.15	2.73
3.50	0.52	0.05	2.74
3.55	0.16	-1.00	2.52
3.60	1.00	4.54	3.53
3.65	0.06	-1.54	3.19
3.70	0.03	-1.92	2.76
3.75	0.26	-0.64	2.62
3.80	0.82	0.93	2.82
3.85	0.26	-0.64	2.68
3.90	0.43	-0.17	2.64
3.95	0.71	0.55	2.77
4.00	0.82	0.91	2.97
4.05	0.15	-1.04	2.74
4.10	0.16	-0.99	2.52

4.15	0.33	-0.43	2.42
4.20	0.89	1.24	2.70
4.25	0.58	0.21	2.75
4.30	0.25	-0.69	2.59
4.35	0.42	-0.20	2.55
4.40	0.54	0.09	2.57
4.45	0.73	0.62	2.71
4.50	0.45	-0.12	2.68
4.55	0.73	0.60	2.81
4.60	0.75	0.67	2.96
4.65	0.45	-0.12	2.94
4.70	0.65	0.38	3.02
4.75	0.05	-1.62	2.66
4.80	0.24	-0.69	2.51
4.85	0.98	2.03	2.96
4.90	0.05	-1.63	2.60
4.95	0.84	0.98	2.81
5.00	0.29	-0.54	2.69

