



M.Sc. Brice Hakwa

## Zufallsprozesse und stochastische Integration (SS 2012).

### Brownian Bridge

Das folgende R Programm simuliert einen Pfad eines BB.

```
1 set.seed(88)
2 N <- 100, T <- 1
3 Delta <- T/N
4 W <- numeric(N + 1) #% initialization of the vector W
5 t <- seq(0, T, length = N + 1)
6 for (i in 2:(N + 1))
7 {
8   W[i] <- W[i - 1] + rnorm(1) * sqrt(Delta)
9 }
10 x <- 0
11 y <- -1
12 BB <- x + W - t/T * (W[N + 1] - y + x)
13 plot(t, BB, type = "l")
14 abline(h = y, lty = 3)
```

