

第1章添付フォルダの説明

- 1.3 節フォルダ
randomgen: $u_{t+1} = (\beta u_t + \alpha) \bmod m$ ($\alpha = 0, \beta = 65539, m = 2^{31}$) による乱数発生プログラム

randomgen.wf1: 乱数プログラムの結果ファイル
- EViews フォルダ
sna.wf1: 国民経済計算ファイル
snaevIEWS8: sna ファイルに、boj ファイルを統合したファイル
- EXCEL フォルダ
boj: 日銀データ
sample: 政府関係データ
sna: 国民経済計算データ

第2章添付フォルダの説明

- 2.2.1 節フォルダ
program#1: モンテカルロ実験プログラム #1
program#2: モンテカルロ実験プログラム #2
program#3: モンテカルロ実験プログラム #3
program-blue: 線形最良不偏推定量のモンテカルロ実験プログラム
- 2.2.2 節フォルダ
program#4: モンテカルロ実験プログラム #4(p.48)
- 2.2.3 節フォルダ
bootdata: ブートストラップ実行のための EViews データ
注) このファイルは、ブートストラッププログラムで指定されたディレクトリに置くこと。

boot-nonpara: ノンパラメトリック・ブートストラッププログラム
boot-para: パラメトリック・ブートストラッププログラム
program#5: 残差ブートストラッププログラム (p.54)
- 2.2.5 節フォルダ
Program#1': 説明変数が非確率変数である時のモンテカルロ実験

第3章 添付フォルダ

- 3.1.3 節フォルダ
seizoubyou.wf1: 製造業データ EViews ファイル
seizougyou.xls: 製造業データファイル (森棟(2005))
- 3.2.4 節フォルダ
capm_boot : CAPM のブートストラッププログラム
capm_toyota: トヨタ株に関する CAPM 分析
- 3.3.3 節フォルダ
Madoff : FFS 運用利回りデータ
Madoff.wf1: EViews ファイル

第4章 添付フォルダ

- monte_multi#1: 重回帰分析モンテカルロ実験プログラム
- 4.3.1 節フォルダ
kenchochiku.wf1: 県民貯蓄ファイル
program-hetero: 分散不均一性モンテカルロ実験プログラム
- 4.3.2 節フォルダ
monte-auto: 系列相関モンテカルロ実験プログラム

第5章 添付フォルダ

- 5.1 節フォルダ
seizoubyou.wf1: 製造業データ EViews ファイル
seizougyou.xls: 製造業データファイル (森棟(2005))
- 5.2 節フォルダ
mrw.xls: Favero データファイル
mrw.wf1: EViews ファイル

第 6 章添付フォルダ

● 6.1 節フォルダ

marrstack : 表 6.2 のエクセルデータ

marrunstack: 表 6.3 のエクセルデータ

● 6.3 節フォルダ

marrpool : 表 6.3 のプールデータ取り込み EViews ファイル

● 6.4 節フォルダ

marrpool : 表 6.3 のパネルデータ取り込み EViews ファイル

第 7 章添付ファイル

seisan-panel.xls : 12 産業別エクセルデータ
seisan-panel.wf1 : 12 産業別パネルデータ EViews ファイル
seisan-pool.wf1 : 12 産業別プール取り込み EViews ファイル
betaboot : 残差ブートストラッププログラム(171 ページ)
bpooldatabeta.wf1 : 残差ブートストラップデータ (上記プログラムでされたディレクトリへ置いておくこと。)

第 8 章添付ファイル

● 8.5 節フォルダ

monetarypolicydata.xls : 表 8.1 で説明されたエクセルデータ

monetarypolicydata.wf1 : VAR 分析を行う EViews ファイル

● 付論 A の添付ファイル

b1teiri : 定理 A の実験プログラム (217 ページ)
b2teiri : 定理 B の実験プログラム (218 ページ)
chidist : カイ二乗分布の実験プログラム (220 ページ)
tdist : t 分布の実験プログラム (221 ページ)
fdist : F 分布の実験プログラム (222 ページ)