

主たる R スクリプトのリスト

『R で学ぶ経済シミュレーション分析—予測と政策効果の検証—』

最新更新日：2025 年 9 月 25 日

村尾博

ダウンロード用フォルダーには多くの R スクリプトが含まれています。これを受け、重要と思われる R スクリプトのみを選び、以下にリストアップします。本書に記載している主役的な R スクリプト、演習問題用の R スクリプトが含まれています。本書に記載していないものの、重要と思われる R スクリプトも含めています。

フォルダー	No.	R スクリプト名
ISLM	1	data_check_graph_description.R
	2	est_bimets_ISLM_wDum.R
	3	est_systemfit_ISLM_wDum.R
	4	forecast_in_sample_ISLM.R
	5	forecast_out_sample_ISLM_V1.R
	6	forecast_out_sample_ISLM_V2.R
	7	forecast_out_sample_ISLM_dumQs_outside.R
	8	forecast_out_sample_ISLM_Part2_graph_ys.R
	9	sim_out_sample_use_TSEXTEND_shock_G.R
	10	sim_in_sample_no_TSEXTEND_shock_G.R
	11	sim_Income_puzzle_ISLM_in_sample.R
	12	sim_Income_puzzle_ISLM_impluse_R.R
	13	sim_COVID19_noGov_ISLM.R
	14	forecast_stochastic_ISLM_V1.R
	15	forecast_stochastic_ISLM_V2.R
	16	sim_stochastic_ISLM.R
	17	sim_stochastic_ISLM_UNIF_G.R
	18	multiplier_bimets_MULTMATRIX_ISLM_M_vs_G.R
	19	test_LR_bimets_byMat.R
	20	test_systemfit_lrtest_ISLM_noID_wDum.R
	21	test_systemfit_linearHypothesis_ISLM_noID_wDum.R
	22	test_lmtest_bgtest_Eq_C.R
	23	test_lmtest_bptest_Eq_C.R

	24	test_Decstools_JacqueBeraTest_Eq_C.R
	25	test_tseries_jacque_bera_Eq_C.R
	26	test_strucchange_efp_Eq_C.R
	27	test_roots_vars_ISLM.R
	28	test_ARselect_ys_ISLM.R
	29	est_bimets_TSLS_Eq_C.R
	30	est_lm_TSLS_Eq_C.R
	31	test_Wald_bimets_Eq_C.R
	32	test_W_LR_LM_bimets_Eq_C.R

フォルダー	No.	R スクリプト名
Klein	1	est_bimets_Klein_GreeneData.R (演習問題の解答)
	2	est_bimets_Klein_bimetsData.R
	3	test_LR_bimets_Klein_GreeneData.R (演習問題の解答)
	4	forecast_out_sample_bimets_Klein_GreeneData.R (演習問題の解答)
	5	forecast_out_sample_bimets_Klein_bimetsData.R
	6	forecast_stochastic_bimets_Klein_GreeneData.R (演習問題の解答)
	7	forecast_stochastic_bimets_Klein_bimetsData.R

フォルダー	No.	R スクリプト名
Kmenta	1	est_bimets_Kmenta.R
	2	test_systemfit_lrtest.R
	3	test_systemfit_linearHypothesis.R

フォルダー	No.	R スクリプト名
Metal	1	est_two_models_Cobb_Trans.R (演習問題に使用)
	2	graph_line_dot.R

フォルダー	No.	R スクリプト名
Apple	1	test_P_apple.R (演習問題に使用)
	2	graph_demand_curve_apple.R

ダウンロード用フォルダーには実験的な R スクリプトも含まれ、その中にはエラーメッセージが表示されるものが存在します。そのような要注意の R スクリプトを以下にリストアップします。

フォルダー	No.	R スクリプト名
ISLM	1	est_ivmodel_LIML_Eq_M_noGood.R

R スクリプト「est_ivmodel_LIML_Eq_M_noGood.R」においては、適切な操作変数を採用すれば、エラーはなくなるはずです。ivmodel()関数を用いる別の R スクリプト「est_ivmodel_LIML_Eq_R」は、エラーなしで正しく機能しています。

フォルダー	No.	R スクリプト名
Kmenta	1	forecast_out_sample_bimets_Kmenta_noGood.R

R スクリプト「forecast_out_sample_bimets_Kmenta_noGood.R」は、R パッケージ [bimets] の基本的設計に対して違反する使い方になっています。そのためのエラーです。2 本の方程式からなる需要・供給モデルにおいて、一方の従属変数を「価格」、他方の従属変数を「数量」にすれば、問題解決です。そのようなモデルは別の R スクリプト「forecast_out_sample_bimets_Kmenta_OK.R」に採用しています。

おわり