

現代の計量経済学・統計学において、ブートストラップ法は非常に重要な手法の一つである。ブートストラップ法を用いることによって、従来の漸近理論に基づく推定・検定の精度を改善することができる可能性があることがよく知られている。本報告では、Beran (1988) によるダブル・ブートストラップ法および Davidson and MacKinnon (2002) ファスト・ダブル・ブートストラップ法を平均に関する検定に応用し、その特性をシミュレーションにより分析する。シミュレーションの結果から、標本がある程度大きい場合、ダブル・ブートストラップ法を行うことにより、漸近理論や通常のブートストラップ法に基づく検定よりも精度が高く、検定力のパフォーマンスも良好な検定を行える可能性があることが示される。