EXE 파일은 "MS윈도우"나 "MS도스(MS-DOS)"의 실행파일"입니다. "실행파일"이란 "프로그램 파일"을 말합니다. EXE 파일을 클릭하면 프로그램이 실행됩니다. 게임 프로그램일 수도 있고, 사무용 프로그램일 수도 있고, 아니면 컴퓨터바이러스 같은 악성파일일 수도 있습니다.

예를 들어 FOO 라는 게임을 구했다면 그 안에, FOO.EXE 라는 이름의 파일이 있을 것입니다. 그 파일을 클릭하면 FOO 라는 게임이 실행됩니다.

"실행 파일"은 "문서 파일"의 반대되는 개념입니다. 문서파일에는 글이나 그림이나 음악 같은 내용이 들어 있습니다. 실행파일에는 컴퓨터만 이해할 수 있는 "기계어 코드"가 들어 있습니다. 문서파일은 사람이 직접 작성할 수 있지만, 실행파일은 C 같은 프로그래밍 언어의 컴파일러로 컴파일을 해야 만들어집니다.

그런데 윈도우에서는 어떤 파일이 EXE파일인지 잘 알 수가 없게 되어 있습니다. 가령 FOO.EXE 이런 파일이 있을 때에도 탐색기에서는 그냥 FOO 라는이름으로 보입니다. ".EXE" 라는 "확장자"를 숨겨 놓았기 때문입니다. 이때는 다음과 같은 방법으로 EXE 확장자를 탐색기에서 보이게 할 수 있습니다. 이러면 어떤 파일이 EXE파일인지 한 눈에 알 수가 있습니다: