

賃金・価格の因果関係と階級闘争

佐 藤 真 人

0. 序

本稿の目的は、グレンジャーの因果性テストを賃金・価格関係に適用し、結果について「グレンジャーの意味で、賃金が価格の原因である（あるいは、ない。）」「両方向への因果関係がある（あるいは、ない。）」等々同義反復以上の何かを言おうとすることである。

意図をもう少し詳しく説明しよう。因果関係の統計的テストが、グレンジャーのそれに限らず、経済変数間の因果関係の問題に決着をつけるとは考えられない。他方、賃金や価格を、それだけで完結したシステムと見なすことは、余りにも単純化に過ぎることにも異論はないだろう。以上2点にもかかわらず、因果関係の統計的テストは、後者のような点の制約をもつタイプのものであっても、次のような意味で、非常に有用であると考ええる。

1. 変数間の量的関係を主張する意見が、その論理上の問題は別にして、事実に関する命題として妥当かどうかを確かめる。
2. 特定の変数間に、「因果関係」が見出されれば、やはりそれらの変数は、まずは、相互に関係している限りなく多い変数の内の1つという以上の取扱いを受けて然るべきであるという根拠を強めるであろう。

さて、賃金と価格は、労・資それぞれが存在を賭けて売る「商品」の価格であるから重要な変数である。従ってそれらの関係について当該テストを適用し、異なる場合を比較すれば、経済の違い、特に階級関係について、それをもたらした仕組についてはさておき、重要な手懸りが得られるであろう。

以上のような一般の方針で、グレンジャーの因果性テストを日本、イギリス経済に適用し、その違い、変化について見、その意味を考えようとするのが目的である。

1. 日本とイギリス

まず、日本とイギリスを比較することから始める。両経済の概括的な価格と賃金(正確にはUnit Labour Costs,生産物単位当り賃金)について、70年代前半を境に、前後2期間に分けて見た。同じ価格の時期による違い、同じ時期の価格による違い、ひいては明白さは劣るが、両経済の違いの有無が目につけどころである。何はともあれ、表1, 2 (GDP デフレーター, 日本), 表3, 4 (消費者物価指数, 日本), 表5, 6 (卸売物価指数, 日本), 表7, 8 (GDP デフレーター, イギリス), 表9, 10 (小売物価指数, イギリス), 表11 (生産者物価指数, イギリス)を一通り眺めよう¹⁾。

1) 表の読み方。

OBS: 分析の対象となった期間。例えば $5(56Q1) \leq \text{OBS} \leq 52(67Q4)$ は、1956年第I 4半期から、1967年第IV 4半期までの観測値についての結果であることを示す。年次データの場合は、YEAR で示したから自明。

LAG: 独立変数のラグの数。例えば、LAG=3 の行は、

Model: $X = X_{-1}, X_{-2}, X_{-3}$

と

Model: $X = X_{-1}, X_{-2}, X_{-3}, Y_{-1}, Y_{-2}, Y_{-3}$

に関する結果であり、

LAG=5 の行は、

Model: $X = X_{-1}, X_{-2}, X_{-3}, X_{-4}, X_{-5}$

と

Model: $X = X_{-1}, X_{-2}, X_{-3}, X_{-4}, X_{-5}, Y_{-1}, Y_{-2}, Y_{-3}, Y_{-4}, Y_{-5}$

に関する結果である。ここで、 X は従属変数、 X_{-i} 、 Y_{-i} は独立変数で X 、 Y の i 期のラグをとった変数。なお、1973、4年について、ダミー変数を導入(イギリスの長期データについては、1915-22年)。

N : 分析の対象となった観測値の数。

DF1: 分子に関する自由度。

表1 GDPデフレーター, 日本

TABLE GDP-DEFLATOR, JPN

TABLE OF G_P2*G_W2, 5(56Q1)<=OBS<=52(67Q4)

LAG	N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_ULS1	F_ULS2
1	47	1	44	0.631	0.072	0.631	0.072
2	46	2	41	1.065	0.379	1.065	0.379
3	45	3	38	1.268	0.400	1.268	0.400
4	44	4	35	1.072	0.767	1.072	0.767
5	43	5	32	1.084	1.650	1.084	1.650
6	42	6	29	1.728	1.279	1.728	1.279
7	41	7	26	1.408	1.443	1.408	1.443
8	40	8	23	1.460	1.518	1.460	1.518
9	39	9	20	1.475	2.760*	1.475	2.760*
10	38	10	17	1.329	2.703*	1.329	2.703*

TABLE OF G_P2*G_W2, 5(56Q1)<=OBS<=56(68Q4)

LAG	N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_ULS1	F_ULS2
1	51	1	48	0.738	0.058	0.738	0.058
2	50	2	45	1.065	0.344	1.065	0.344
3	49	3	42	1.258	0.365	1.258	0.365
4	48	4	39	1.029	0.712	1.029	0.712
5	47	5	36	1.062	1.640	1.062	1.640
6	46	6	33	1.694	1.310	1.694	1.310
7	45	7	30	1.397	1.431	1.397	1.431
8	44	8	27	1.544	1.512	1.544	1.512
9	43	9	24	1.334	2.667*	1.334	2.667*
10	42	10	21	1.318	2.301	1.318	2.301

TABLE OF G_P2*G_W2, 5(56Q1)<=OBS<=60(69Q4)

LAG	N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_ULS1	F_ULS2
1	55	1	52	0.687	0.083	0.687	0.083
2	54	2	49	1.115	0.174	1.115	0.174
3	53	3	46	1.115	0.300	1.115	0.300
4	52	4	43	0.967	0.699	0.967	0.699
5	51	5	40	0.897	1.472	0.897	1.472
6	50	6	37	1.233	1.174	1.233	1.174
7	49	7	34	1.046	1.401	1.046	1.401
8	48	8	31	1.094	1.527	1.094	1.527
9	47	9	28	0.907	2.318*	0.907	2.318*
10	46	10	25	0.929	1.950	0.929	1.950

表2 GDPデフレーター, 日本

TABLE GDP-DEFLATOR, JPN

TABLE OF G_P2*G_W2, 85(76Q1)<=OBS<=129(87Q1)

LAG	N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_ULS1	F_ULS2
1	44	1	41	0.758	6.776*	0.758	6.776
2	43	2	38	0.320	1.820	0.320	1.820
3	42	3	35	0.411	1.328	0.411	1.328
4	41	4	32	0.276	1.526	0.276	1.526
5	40	5	29	0.149	1.031	0.149	1.031
6	39	6	26	1.033	0.767	1.033	0.767
7	38	7	23	0.946	0.651	0.946	0.651
8	37	8	20	1.268	0.841	1.268	0.841
9	36	9	17	0.971	0.556	0.971	0.556
10	35	10	14	0.959	1.166	0.959	1.166

TABLE OF G_P2*G_W2, 89(77Q1)<=OBS<=129(87Q1)

LAG	N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_ULS1	F_ULS2
1	40	1	37	0.026	3.472	0.026	3.472
2	39	2	34	0.013	0.651	0.013	0.651
3	38	3	31	0.103	0.521	0.103	0.521
4	37	4	28	0.080	1.485	0.080	1.485
5	36	5	25	0.182	0.818	0.182	0.818
6	35	6	22	0.692	0.709	0.692	0.709
7	34	7	19	0.468	0.708	0.468	0.708
8	33	8	16	0.984	1.210	0.984	1.210
9	32	9	13	0.674	0.860	0.674	0.860
10	31	10	10	0.732	1.668	0.732	1.668

TABLE OF G_P2*G_W2, 93(78Q1)<=OBS<=129(87Q1)

LAG	N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_ULS1	F_ULS2
1	36	1	33	0.079	1.610	0.079	1.610
2	35	2	30	0.044	0.917	0.044	0.917
3	34	3	27	0.041	1.175	0.041	1.175
4	33	4	24	0.068	2.257	0.068	2.257
5	32	5	21	0.178	1.331	0.178	1.331
6	31	6	18	0.719	1.689	0.719	1.689
7	30	7	15	0.576	0.977	0.576	0.977
8	29	8	12	0.910	1.232	0.910	1.232
9	28	9	9	0.917	1.323	0.917	1.323
10	27	10	6	0.489	0.977	0.489	0.977

表3 消費者物価指数, 日本

TABLE CPI:GENERAL(EXCL. IMPUTED RENT), JPN

TABLE OF G_CPI1*G_W1, 5(56Q1)<=OBS<=52(67Q4)

LAG	N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_ULS1	F_ULS2
1	47	1	44	2.029	1.211	2.029	1.211
2	46	2	41	0.862	0.538	0.862	0.538
3	45	3	38	0.804	0.512	0.804	0.512
4	44	4	35	1.354	1.149	1.354	1.149
5	43	5	32	1.119	1.414	1.119	1.414
6	42	6	29	2.479*	1.882	2.479*	1.882
7	41	7	26	3.723**	1.511	3.723**	1.511
8	40	8	23	2.565*	1.143	2.565*	1.143
9	39	9	20	4.148**	0.959	4.148**	0.959
10	38	10	17	3.170*	0.870	3.170*	0.870

TABLE OF G_CPI1*G_W1, 5(56Q1)<=OBS<=56(68Q4)

LAG	N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_ULS1	F_ULS2
1	51	1	48	2.083	0.651	2.083	0.651
2	50	2	45	0.884	0.316	0.884	0.316
3	49	3	42	0.819	0.310	0.819	0.310
4	48	4	39	1.436	0.782	1.436	0.782
5	47	5	36	1.138	1.086	1.138	1.086
6	46	6	33	2.758*	1.335	2.758*	1.335
7	45	7	30	3.634**	1.087	3.634**	1.087
8	44	8	27	2.507*	0.822	2.507*	0.822
9	43	9	24	3.819**	0.651	3.819**	0.651
10	42	10	21	3.208*	0.576	3.208*	0.576

TABLE OF G_CPI1*G_W1, 5(56Q1)<=OBS<=60(69Q4)

LAG	N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_ULS1	F_ULS2
1	55	1	52	1.333	0.896	1.333	0.896
2	54	2	49	0.674	0.901	0.674	0.901
3	53	3	46	0.667	0.601	0.667	0.601
4	52	4	43	1.369	1.098	1.369	1.098
5	51	5	40	0.986	1.382	0.986	1.382
6	50	6	37	2.152	1.569	2.152	1.569
7	49	7	34	2.686*	1.267	2.686*	1.267
8	48	8	31	2.067	1.045	2.067	1.045
9	47	9	28	2.535*	0.826	2.535*	0.826
10	46	10	25	2.135	0.766	2.135	0.766

表4 消費者物価指数, 日本

TABLE CPI:GENERAL(EXCL. IMPUTED RENT), JPN

TABLE OF G_CPI1*G_W1, 85(76Q1)<=OBS<=129(87Q1)

LAG	N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_OLS1	F_OLS2
1	44	1	41	1.815	15.931**	1.815	15.931**
2	43	2	38	0.123	5.516**	0.123	5.516**
3	42	3	35	0.024	3.691*	0.024	3.691*
4	41	4	32	0.177	2.709	0.177	2.709
5	40	5	29	0.648	1.933	0.648	1.933
6	39	6	26	0.550	1.560	0.550	1.560
7	38	7	23	0.549	1.825	0.549	1.825
8	37	8	20	0.506	2.351	0.506	2.351
9	36	9	17	0.472	1.782	0.472	1.782
10	35	10	14	0.847	1.568	0.847	1.568

TABLE OF G_CPI1*G_W1, 89(77Q1)<=OBS<=129(87Q1)

LAG	N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_OLS1	F_OLS2
1	40	1	37	3.950	11.553**	3.950	11.553**
2	39	2	34	0.082	4.423*	0.082	4.423*
3	38	3	31	0.055	2.737	0.055	2.737
4	37	4	28	0.186	2.425	0.186	2.425
5	36	5	25	0.466	1.764	0.466	1.764
6	35	6	22	0.552	1.414	0.552	1.414
7	34	7	19	0.750	1.440	0.750	1.440
8	33	8	16	1.156	2.079	1.156	2.079
9	32	9	13	1.599	1.486	1.599	1.486
10	31	10	10	1.599	1.138	1.599	1.138

TABLE OF G_CPI1*G_W1, 93(78Q1)<=OBS<=129(87Q1)

LAG	N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_OLS1	F_OLS2
1	36	1	33	2.321	9.137**	2.321	9.137**
2	35	2	30	0.408	4.248*	0.408	4.248*
3	34	3	27	0.159	2.657	0.159	2.657
4	33	4	24	0.390	2.047	0.390	2.047
5	32	5	21	0.678	1.496	0.678	1.496
6	31	6	18	1.204	1.064	1.204	1.064
7	30	7	15	2.356	1.319	2.356	1.319
8	29	8	12	2.674	1.270	2.674	1.270
9	28	9	9	2.235	1.178	2.235	1.178
10	27	10	6	1.272	0.752	1.272	0.752

表5 卸売物価指数，日本

TABLE WPI(OVERALL):ALL COMMODITIES, JPN

TABLE OF G_WPI1*G_W1, 25(61Q1)<=OBS<=52(67Q4)

LAG	N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_OLS1	F_OLS2
1	27	1	24	0.522	2.572	0.522	2.572
2	26	2	21	1.498	2.759	1.498	2.759
3	25	3	18	1.932	2.204	1.932	2.204
4	24	4	15	1.381	3.094*	1.381	3.094*
5	23	5	12	2.086	2.151	2.086	2.151
6	22	6	9	0.705	1.792	0.705	1.792
7	21	7	6	1.446	0.891	1.446	0.891
8	20	8	3	6.963	0.395	6.963	0.395
9	19	9	0
10	18	10	-3

TABLE OF G_WPI1*G_W1, 25(61Q1)<=OBS<=56(68Q4)

LAG	N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_OLS1	F_OLS2
1	31	1	28	0.389	2.385	0.389	2.385
2	30	2	25	1.499	2.391	1.499	2.391
3	29	3	22	2.125	1.552	2.125	1.552
4	28	4	19	1.837	2.941*	1.837	2.941*
5	27	5	16	3.971*	2.251	3.971*	2.251
6	26	6	13	1.424	2.059	1.424	2.059
7	25	7	10	2.171	1.674	2.171	1.674
8	24	8	7	1.243	1.121	1.243	1.121
9	23	9	4	2.135	0.935	2.135	0.935
10	22	10	1	2.472	0.701	2.472	0.701

TABLE OF G_WPI1*G_W1, 25(61Q1)<=OBS<=60(69Q4)

LAG	N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_OLS1	F_OLS2
1	35	1	32	1.289	0.709	1.289	0.709
2	34	2	29	2.813	1.184	2.813	1.184
3	33	3	26	3.340*	0.921	3.340*	0.921
4	32	4	23	2.744	1.325	2.744	1.325
5	31	5	20	2.610	1.108	2.610	1.108
6	30	6	17	1.163	1.012	1.163	1.012
7	29	7	14	1.325	0.977	1.325	0.977
8	28	8	11	0.912	1.095	0.912	1.095
9	27	9	8	1.217	0.797	1.217	0.797
10	26	10	5	0.716	0.952	0.716	0.952

表6 卸売物価指数, 日本

TABLE WPI(OVER-ALL):ALL COMMODITIES, JPN

TABLE OF G_WPI1*G_W1, 85(76Q1)<=OBS<=129(87Q1)

LAG	N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_OLS1	F_OLS2
1	44	1	41	0.470	3.775	0.470	3.775
2	43	2	38	0.398	3.795*	0.398	3.795*
3	42	3	35	0.259	2.155	0.259	2.155
4	41	4	32	0.288	1.752	0.288	1.752
5	40	5	29	0.371	1.455	0.371	1.455
6	39	6	26	1.483	1.241	1.483	1.241
7	38	7	23	1.283	1.036	1.283	1.036
8	37	8	20	2.670*	0.814	2.670*	0.814
9	36	9	17	2.297	0.698	2.297	0.698
10	35	10	14	1.913	0.603	1.913	0.603

TABLE OF G_WPI1*G_W1, 89(77Q1)<=OBS<=129(87Q1)

LAG	N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_OLS1	F_OLS2
1	40	1	37	1.522	4.580*	1.522	4.580*
2	39	2	34	0.826	4.153*	0.826	4.153*
3	38	3	31	0.601	2.803	0.601	2.803
4	37	4	28	0.382	1.967	0.382	1.967
5	36	5	25	0.364	1.702	0.364	1.702
6	35	6	22	1.505	1.215	1.505	1.215
7	34	7	19	1.774	0.887	1.774	0.887
8	33	8	16	3.059*	0.672	3.059*	0.672
9	32	9	13	3.442*	0.634	3.442*	0.634
10	31	10	10	2.528	0.476	2.528	0.476

TABLE OF G_WPI1*G_W1, 93(78Q1)<=OBS<=129(87Q1)

LAG	N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_OLS1	F_OLS2
1	36	1	33	0.626	5.647*	0.626	5.647*
2	35	2	30	1.738	3.931*	1.738	3.931*
3	34	3	27	1.119	2.095	1.119	2.095
4	33	4	24	0.484	1.744	0.484	1.744
5	32	5	21	0.596	1.459	0.596	1.459
6	31	6	18	1.868	1.038	1.868	1.038
7	30	7	15	1.131	1.146	1.131	1.146
8	29	8	12	1.713	0.980	1.713	0.980
9	28	9	9	0.980	0.645	0.980	0.645
10	27	10	6	0.732	0.936	0.732	0.936

表7 GDPデフレーター, イギリス

TABLE GDP-DEFLATOR, UK POST WW2

TABLE OF G_P1*G_W1, 5(56Q1)<=OBS<=52(67Q4)

LAG	N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_ULS1	F_ULS2
1	47	1	44	12.948**	2.989	12.948**	2.989
2	46	2	41	2.878	1.794	2.878	1.794
3	45	3	38	2.763	0.758	2.763	0.758
4	44	4	35	1.289	0.400	1.289	0.400
5	43	5	32	1.420	0.433	1.420	0.433
6	42	6	29	1.079	0.333	1.079	0.333
7	41	7	26	1.806	0.897	1.806	0.897
8	40	8	23	1.549	1.137	1.549	1.137
9	39	9	20	1.043	0.691	1.043	0.691
10	38	10	17	0.718	0.854	0.718	0.854

TABLE OF G_P1*G_W1, 5(56Q1)<=OBS<=56(68Q4)

LAG	N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_ULS1	F_ULS2
1	51	1	48	11.443**	2.527	11.443**	2.527
2	50	2	45	2.433	1.918	2.433	1.918
3	49	3	42	1.951	0.739	1.951	0.739
4	48	4	39	0.946	0.582	0.946	0.582
5	47	5	36	0.982	0.411	0.982	0.411
6	46	6	33	0.706	0.363	0.706	0.363
7	45	7	30	1.565	1.181	1.565	1.181
8	44	8	27	1.207	1.423	1.207	1.423
9	43	9	24	0.852	0.956	0.852	0.956
10	42	10	21	0.612	1.205	0.612	1.205

TABLE OF G_P1*G_W1, 5(56Q1)<=OBS<=60(69Q4)

LAG	N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_ULS1	F_ULS2
1	55	1	52	10.397**	3.563	10.397**	3.563
2	54	2	49	2.189	2.493	2.189	2.493
3	53	3	46	1.691	1.328	1.691	1.328
4	52	4	43	0.813	1.042	0.813	1.042
5	51	5	40	0.853	0.769	0.853	0.769
6	50	6	37	0.637	0.725	0.637	0.725
7	49	7	34	1.276	1.721	1.276	1.721
8	48	8	31	0.775	1.291	0.775	1.291
9	47	9	28	0.689	1.000	0.689	1.000
10	46	10	25	0.551	1.161	0.551	1.161

表8 GDPデフレーター, イギリス

TABLE GDP-DEFLATOR, UK POST WW2

TABLE OF G_P1*G_W1, 85(76Q1)<=OBS<=126(86Q2)

LAG	N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_ULS1	F_ULS2
1	41	1	38	11.879**	0.822	11.879**	0.822
2	40	2	35	4.398*	2.941	4.398*	2.941
3	39	3	32	3.225*	1.295	3.225*	1.295
4	38	4	29	2.552	1.281	2.552	1.281
5	37	5	26	1.636	1.067	1.636	1.067
6	36	6	23	2.513	1.322	2.513	1.322
7	35	7	20	1.808	1.500	1.808	1.500
8	34	8	17	1.799	2.912*	1.799	2.912*
9	33	9	14	6.035**	2.646	6.035**	2.646
10	32	10	11	5.647**	2.139	5.647**	2.139

TABLE OF G_P1*G_W1, 89(77Q1)<=OBS<=126(86Q2)

LAG	N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_ULS1	F_ULS2
1	37	1	34	12.070**	0.173	12.070**	0.173
2	36	2	31	6.816**	2.543	6.816**	2.543
3	35	3	28	4.613**	1.238	4.613**	1.238
4	34	4	25	3.538**	1.528	3.538**	1.528
5	33	5	22	1.756	1.083	1.756	1.083
6	32	6	19	1.241	1.173	1.241	1.173
7	31	7	16	1.188	1.033	1.188	1.033
8	30	8	13	0.962	3.812*	0.962	3.812*
9	29	9	10	8.191**	3.850*	8.191**	3.850*
10	28	10	7	5.462*	4.451*	5.462*	4.451*

TABLE OF G_P1*G_W1, 93(78Q1)<=OBS<=126(86Q2)

LAG	N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_ULS1	F_ULS2
1	33	1	30	17.019**	0.235	17.019**	0.235
2	32	2	27	8.831**	2.510	8.831**	2.510
3	31	3	24	5.817**	1.152	5.817**	1.152
4	30	4	21	5.219**	1.407	5.219**	1.407
5	29	5	18	1.908	1.124	1.908	1.124
6	28	6	15	1.855	1.227	1.855	1.227
7	27	7	12	1.929	1.956	1.929	1.956
8	26	8	9	1.693	3.348*	1.693	3.348*
9	25	9	6	3.606	2.066	3.606	2.066
10	24	10	3	3.762	0.393	3.762	0.393

表9 小売物価指数, イギリス

TABLE GENERAL INDEX OF RETAIL PRICES, UK POST WW2

TABLE OF G_P3*G_W1, 5(56Q1)<=OBS<=52(67Q4)

LAG N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_ULS1	F_ULS2
1	47	1 44	2.583	3.337	2.583	3.337
2	46	2 41	0.850	1.757	0.850	1.757
3	45	3 38	0.791	2.501	0.791	2.501
4	44	4 35	0.697	2.177	0.697	2.177
5	43	5 32	1.013	2.123	1.013	2.123
6	42	6 29	1.484	2.215	1.484	2.215
7	41	7 26	1.648	1.467	1.648	1.467
8	40	8 23	1.174	1.037	1.174	1.037
9	39	9 20	1.259	1.595	1.259	1.595
10	38	10 17	1.682	1.362	1.682	1.362

TABLE OF G_P3*G_W1, 5(56Q1)<=OBS<=56(68Q4)

LAG N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_ULS1	F_ULS2
1	51	1 48	2.397	0.857	2.397	0.857
2	50	2 45	0.920	0.688	0.920	0.688
3	49	3 42	0.988	1.306	0.988	1.306
4	48	4 39	0.731	1.427	0.731	1.427
5	47	5 36	1.709	1.397	1.709	1.397
6	46	6 33	2.039	2.347	2.039	2.347
7	45	7 30	2.265	1.616	2.265	1.616
8	44	8 27	1.711	0.961	1.711	0.961
9	43	9 24	1.557	2.000	1.557	2.000
10	42	10 21	2.027	1.888	2.027	1.888

TABLE OF G_P3*G_W1, 5(56Q1)<=OBS<=60(69Q4)

LAG N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_ULS1	F_ULS2
1	55	1 52	0.768	3.047	0.768	3.047
2	54	2 49	0.173	1.982	0.173	1.982
3	53	3 46	0.615	2.220	0.615	2.220
4	52	4 43	0.560	2.425	0.560	2.425
5	51	5 40	1.525	2.099	1.525	2.099
6	50	6 37	2.288	2.688*	2.288	2.688*
7	49	7 34	2.775*	1.742	2.775*	1.742
8	48	8 31	2.195	0.755	2.195	0.755
9	47	9 28	2.095	1.336	2.095	1.336
10	46	10 25	2.692*	1.023	2.692*	1.023

表10 小売物価指数, イギリス

TABLE GENERAL INDEX OF RETAIL PRICES, UK POST WW2

TABLE OF G_P3*G_W1, 85(76Q1)<=OBS<=126(86Q2)

LAG	N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_ULS1	F_ULS2
1	41	1	38	1.926	1.520	1.926	1.520
2	40	2	35	1.455	7.238*	1.455	7.238*
3	39	3	32	1.723	3.301*	1.723	3.301*
4	38	4	29	1.889	2.090	1.889	2.090
5	37	5	26	2.662*	1.288	2.662*	1.288
6	36	6	23	1.892	3.129**	1.892	3.129**
7	35	7	20	2.346	3.469*	2.346	3.469*
8	34	8	17	2.805*	3.328*	2.805*	3.328*
9	33	9	14	3.223*	3.184*	3.223*	3.184*
10	32	10	11	5.241**	3.005*	5.241**	3.005*

TABLE OF G_P3*G_W1, 89(77Q1)<=OBS<=126(86Q2)

LAG	N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_ULS1	F_ULS2
1	37	1	34	1.231	0.404	1.231	0.404
2	36	2	31	3.610*	3.868*	3.610*	3.868*
3	35	3	28	3.581*	5.132**	3.581*	5.132**
4	34	4	25	2.788*	3.418*	2.788*	3.418*
5	33	5	22	1.338	3.209*	1.338	3.209*
6	32	6	19	1.487	3.338*	1.487	3.338*
7	31	7	16	2.158	3.305*	2.158	3.305*
8	30	8	13	2.775*	3.168*	2.775*	3.168*
9	29	9	10	3.450*	4.559*	3.450*	4.559*
10	28	10	7	5.086*	3.472	5.086*	3.472

TABLE OF G_P3*G_W1, 93(78Q1)<=OBS<=126(86Q2)

LAG	N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_ULS1	F_ULS2
1	33	1	30	0.220	1.647	0.220	1.647
2	32	2	27	1.769	5.301**	1.769	5.301**
3	31	3	24	3.414*	7.066**	3.414*	7.066**
4	30	4	21	4.489*	7.680**	4.489*	7.680**
5	29	5	18	2.622	6.316**	2.622	6.316**
6	28	6	15	3.713*	4.323**	3.713*	4.323**
7	27	7	12	2.217	3.549*	2.217	3.549*
8	26	8	9	1.508	1.947	1.508	1.947
9	25	9	6	4.405*	3.228	4.405*	3.228
10	24	10	3	2.651	3.618	2.651	3.618

表11 生産者物価指数, イギリス

TABLE PRODUCER PRICE INDEX, UK POST WW2

TABLE OF G_P2*G_W1, 85(76Q1)<=OBS<=126(86Q2)

LAG	N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_ULS1	F_ULS2
1	41	1	38	0.010	0.504	0.010	0.504
2	40	2	35	0.946	0.184	0.946	0.184
3	39	3	32	1.226	1.241	1.226	1.241
4	38	4	29	2.081	1.147	2.081	1.147
5	37	5	26	2.623*	0.799	2.623*	0.799
6	36	6	23	2.328	0.844	2.328	0.844
7	35	7	20	2.775*	0.913	2.775*	0.913
8	34	8	17	3.247*	0.884	3.247*	0.884
9	33	9	14	1.992	1.672	1.992	1.672
10	32	10	11	1.466	1.120	1.466	1.120

TABLE OF G_P2*G_W1, 89(77Q1)<=OBS<=126(86Q2)

LAG	N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_ULS1	F_ULS2
1	37	1	34	0.112	0.200	0.112	0.200
2	36	2	31	0.948	1.003	0.948	1.003
3	35	3	28	1.327	0.887	1.327	0.887
4	34	4	25	1.786	0.621	1.786	0.621
5	33	5	22	3.449*	0.723	3.449*	0.723
6	32	6	19	2.825*	1.222	2.825*	1.222
7	31	7	16	2.764*	1.555	2.764*	1.555
8	30	8	13	2.111	1.130	2.111	1.130
9	29	9	10	1.331	1.513	1.331	1.513
10	28	10	7	1.072	1.638	1.072	1.638

TABLE OF G_P2*G_W1, 93(78Q1)<=OBS<=126(86Q2)

LAG	N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_ULS1	F_ULS2
1	33	1	30	0.000	1.772	0.000	1.772
2	32	2	27	0.884	1.207	0.884	1.207
3	31	3	24	1.724	1.163	1.724	1.163
4	30	4	21	1.645	0.878	1.645	0.878
5	29	5	18	3.294*	0.601	3.294*	0.601
6	28	6	15	2.854*	2.002	2.854*	2.002
7	27	7	12	2.237	1.401	2.237	1.401
8	26	8	9	1.303	0.842	1.303	0.842
9	25	9	6	1.356	1.025	1.356	1.025
10	24	10	3	0.681	1.358	0.681	1.358

比較の結果は、次のようにまとめることができよう。

1. 価格の種類, 時期, 因果関係の方向にかかわらず, イギリスでは, 日本に比し, 因果関係が強いことが印象的である。
したがって, 前者については, 価格の種類, 時期による違い, 変化が言いやすく, 後者については言いにくい。この点に関し, 日本の消費者物価指数は例外的。
2. 時期による因果関係の強さの変化という点では, イギリスでは70年代後半から, その方向はともかく因果関係が非常に強くなった。これに対し, 日本では, むしろ弱くなった。(特に, GDP デフレーター, 消費者物価指数)
3. 時期による因果関係の方向の違いに注目すると, 日本では判りにくいだが, 敢て言えば両経済とも70年代までに比し, 70年代後半から, 価格から賃金への因果関係が強まった。極端な場合が消費者物価指数(日本)で, 因果関係の方向が逆転した。このことは, 70年代まで, マーク・アップ方式がほぼ順調に作動していたが, その後, 変調を来したことを示唆していると考ええる。これを階級関係の面から見て, 70年代までは, 両階級の力関係にある種のバランスが維持されていたが, その後崩れたと理解する。
4. 因果関係の方向に注目すると, イギリスでは, 日本に比し, 価格の種類, 時期にかかわらず賃金から価格への因果関係が強い。
5. イギリスの小売物価指数は, 70年代までは賃金との因果関係が非常に弱いかのようであるが(表9, 10), 実は, 時期による変化が激しい(表12, 13)。以上のような結果を, 当初に述べた私達の文脈で見直すとイギリスでは, 日

DF2: 分母に関する自由度。

F-OLS1, ULS1: 賃金から価格への因果関係を検定するための OLS, Cochrane-Orcutt 法による F 値。

F-OLS2, ULS2: 価格から賃金への因果関係を検定するための上記の方法による F 値。

** : 1%以下の有意確率に対応する場合。

* : 5%以下の有意確率に対応する場合。

表12 小売物価指数，イギリス

TABLE GENERAL INDEX OF RETAIL PRICES, UK POST WW2

TABLE OF G_P3*G_W1, 5(56Q1)<=OBS<=40(64Q4)

LAG	N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_ULS1	F_ULS2
1	35	1	32	1.386	6.534*	1.386	6.534*
2	34	2	29	0.370	2.676	0.370	2.676
3	33	3	26	0.303	4.445*	0.303	4.445*
4	32	4	23	1.045	5.712**	1.045	5.712**
5	31	5	20	0.620	7.149**	0.620	7.149**
6	30	6	17	0.930	5.358**	0.930	5.358**
7	29	7	14	1.991	3.357*	1.991	3.357*
8	28	8	11	1.561	3.127*	1.561	3.127*
9	27	9	8	3.042	4.899*	3.042	4.899*
10	26	10	5	5.483*	3.983	5.483*	3.983

TABLE OF G_P3*G_W1, 5(56Q1)<=OBS<=44(65Q4)

LAG	N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_ULS1	F_ULS2
1	39	1	36	1.227	8.823**	1.227	8.823**
2	38	2	33	0.388	3.528*	0.388	3.528*
3	37	3	30	0.397	5.214**	0.397	5.214**
4	36	4	27	1.153	6.048**	1.153	6.048**
5	35	5	24	0.654	6.227**	0.654	6.227**
6	34	6	21	1.095	4.484**	1.095	4.484**
7	33	7	18	1.840	2.739*	1.840	2.739*
8	32	8	15	1.108	1.717	1.108	1.717
9	31	9	12	1.224	2.902*	1.224	2.902*
10	30	10	9	1.004	2.199	1.004	2.199

TABLE OF G_P3*G_W1, 5(56Q1)<=OBS<=48(66Q4)

LAG	N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_ULS1	F_ULS2
1	43	1	40	1.314	8.181**	1.314	8.181**
2	42	2	37	0.446	3.904*	0.446	3.904*
3	41	3	34	0.376	4.463**	0.376	4.463**
4	40	4	31	0.892	3.852*	0.892	3.852*
5	39	5	28	0.705	3.861**	0.705	3.861**
6	38	6	25	1.172	2.645*	1.172	2.645*
7	37	7	22	1.673	1.654	1.673	1.654
8	36	8	19	1.326	0.828	1.326	0.828
9	35	9	16	1.373	0.810	1.373	0.810
10	34	10	13	1.653	0.767	1.653	0.767

表13 小売物価指数, イギリス

TABLE GENERAL INDEX OF RETAIL PRICES, UK POST WW2

TABLE OF G_P3*G_W1, 5(56Q1)<=OBS<=64(70Q4)

LAG	N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_ULS1	F_ULS2
1	59	1	56	3.255	3.009	3.255	3.009
2	58	2	53	1.292	1.982	1.292	1.982
3	57	3	50	1.252	1.900	1.252	1.900
4	56	4	47	1.489	1.965	1.489	1.965
5	55	5	44	2.348	2.211	2.348	2.211
6	54	6	41	3.063*	1.907	3.063*	1.907
7	53	7	38	4.245**	1.536	4.245**	1.536
8	52	8	35	3.389**	1.389	3.389**	1.389
9	51	9	32	3.094**	1.367	3.094**	1.367
10	50	10	29	3.403**	1.463	3.403**	1.463

TABLE OF G_P3*G_W1, 5(56Q1)<=OBS<=68(71Q4)

LAG	N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_ULS1	F_ULS2
1	63	1	60	3.770	3.133	3.770	3.133
2	62	2	57	1.714	1.959	1.714	1.959
3	61	3	54	1.306	2.537	1.306	2.537
4	60	4	51	1.885	2.671*	1.885	2.671*
5	59	5	48	2.439*	2.650*	2.439*	2.650*
6	58	6	45	2.663*	2.195	2.663*	2.195
7	57	7	42	2.841*	1.751	2.841*	1.751
8	56	8	39	1.978	1.383	1.978	1.383
9	55	9	36	1.808	1.194	1.808	1.194
10	54	10	33	2.762*	1.088	2.762*	1.088

TABLE OF G_P3*G_W1, 5(56Q1)<=OBS<=72(72Q4)

LAG	N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_ULS1	F_ULS2
1	67	1	64	5.330*	3.987	5.330*	3.987
2	66	2	61	2.954	3.865*	2.954	3.865*
3	65	3	58	2.308	3.871*	2.308	3.871*
4	64	4	55	3.478*	4.267**	3.478*	4.267**
5	63	5	52	3.476**	3.439**	3.476**	3.439**
6	62	6	49	3.523**	2.611*	3.523**	2.611*
7	61	7	46	3.918**	2.362*	3.918**	2.362*
8	60	8	43	2.850*	2.054	2.850*	2.054
9	59	9	40	2.627*	1.728	2.627*	1.728
10	58	10	37	3.665**	1.521	3.665**	1.521

本より階級関係が緊張している表われと理解することができると思う。これが一般的結論である。これは、事実に基づく他の事実についての予想である。

2. 消費者物価指数

本節以降では、前節で紹介した結果がどの程度普遍的であるかを見るため、より多くの価格について見た結果を紹介する。ただし、イギリスについては、他の機会に回す。結論を先に述べると、多くの価格についての結果は、代表的なものについての結果を補強する。

まず、消費者物価指数(中分類指数)について。印象的にならざるをえないが、見易さを考えて、前節の表に該当する表を眺めた結果を表14にまとめた²⁾。これは、価格から賃金への因果関係が強まったという一般的結論を補強していると考え。それに反しているのは、「被服及び履き物」のみである。

次に、少し見方を変え、価格によって違いがあるかどうかを見るのがおもしろい価格について見よう。何がおもしろいかは観点によって異なるが、ここでは、価格・賃金関係が資本家と労働者の関係を集約しているのに対し、価格間

表14

消費者物価指数 (中分類指数)	因果関係の方向	
	56年I期—69年IV期	76年I期—87年I期
食料	<=	=>
家賃(持家の帰属家賃を除く)	なし	弱<=>
光熱・水道	弱<=>>	=>>
被服及び履き物	=>>	=>弱
保健医療	<<=>	弱<=>
授業料等	なし	なし

2) 表の読み方。

<= : 賃金から価格への因果関係あり。

=> : 価格から賃金への因果関係あり。

<, >の多さは、その程度を表わす。

表15

消費者物価指数 (特殊分類指数)	因果関係の方向
	76年I期—87年I期
商 品	弱<=>>
農水畜産物	=>弱
工業製品	=>
大企業性製品	=>>>
中小企業性製品	=>>
サービス(持家の帰属家賃を除く)	=>

の関係は資本家間の関係を集約しているだろうという観点からである。

すなわち、消費者物価指数(特殊分類指数)における商品とサービス、農水畜産物と工業製品、大企業製品と中小企業製品である。(表15, 詳しくは付表15-1~6)。60年代とは比較できないが、各価格について一様に価格から賃金への因果関係が見られるのが印象的である。

3. 卸売物価指数

前節と同様の観点から、総合卸売物価指数についてみる。まず、表16から。これも、70年代後半以降、価格から賃金への因果関係が強まっているという一般的結論を強く支持している。これに反しているのは、「加工食品」、「非鉄金属」、「農林水産物」とくに「食料用農畜産物」だけである。

次に、価格間の違いに興味がある価格、すなわち、総合卸売物価指数(需要段階別・用途別)における素原材料、中間財と最終財、資本財と消費財について見よう。(表17, 詳しくは付表17-1~10)ここでも、どの価格についても(但し、消費財は除く)一様に、価格から賃金への因果関係が70年代前半を境に強まっていることが特長である。

4. GDP デフレーター

最後に、GDP デフレーターについて(表18)。

表16

総合卸売物価指数	因果関係の方向	
	61年I期—69年IV期	76年I期—87年I期
工業製品	<=	弱<=>>
加工食品	弱<=>	なし
繊維製品	なし	<=>>
製材・木製品	<=	なし
パルプ・紙製品	<<=	なし
化学製品	弱<=	=>弱
プラスチック製品	弱<=>	弱<=>
石油・石炭製品	=>	<=>>
窯業・土石製品	=>	=>
鉄鋼	弱<=	=>>
非鉄金属	なし	弱<=
金属製品	<=	なし
一般機器	<=	=>>
電気機器	なし	<=>>
輸送用機器	<=	弱<=>弱
精密機器	弱<=	なし
その他工業製品	<<=	<=>
農林水産物	=>>	なし
食料用農畜産物	=>>	弱<=>弱
非食料農林水産物	なし	なし
鉱産物	弱<=	=>>
電力・都市ガス・水道	なし	=>>
スクラップ類	<<=	<<=

表18は、次の2点について一般的結論を支持している。

1. GDP デフレーターについては、消費者、卸売物価指数に比し賃金との因果関係が非常に弱い。但し、この点でサービス業は例外的で、70年代までは、賃金から価格への強い因果関係を示す。
2. 70年代前半を境に、価格から賃金への因果関係が強まった。もちろん、いくつかの反例がある（製造業、一次金属、一般機械、精密機械、不動産業）。

以上、消費者、卸売物価指数、GDP デフレーターについてのより細かい検討は、包括的指数についての結果を補強すると考える。

表17

総合卸売物価指数 (需要段階別・用途別)	因果関係の方向	
	61年I期—69年IV期	76年I期—87年I期
国内需要材	<=>弱	<=>>
素原材料	<=>	=>
中間財	<=>弱	<=>>
最終財	=>	<=>>
資本財	=>	=>
消費財	=>	<=>

5. イギリスの長期データ

日本に比し、イギリス経済のより細かい賃金・価格関係が、包括的指数についての結果を支持するかどうか(日本では、そうであった。)、ひいては階級関係についての一般的結論を支持するかどうかを見ることは、他の機会に回す。ここでは、より長期について(1855-1965)見てみよう。(表19, 詳しくは付表19-1~8)。次の点が印象的である。

1. 一般的に、賃金・価格の強い因果関係が見られる。この点で、1935~65年の消費財・サービス価格指数は例外である。
2. 20世紀初頭を境に、因果関係の方向の変化を見ると、小売価格指数、資本財価格指数では、その方向が鮮やかに逆転するほど価格から賃金への因果関係が強まり、消費財・サービス価格指数も、弱い意味で同様の変化を示す。これに対し、GDPデフレーターは、価格から賃金への因果関係が極端に弱まったという意味で、これらの価格と反対の方向変化を示す。

これらの結果は、既に述べた階級関係についての予想の根拠を強めこそすれ弱めるものではないだろう。

表18

	因果関係の方向	
	1956—69	1976—87
1. 産 業	なし	=>弱
(1) 農 林 水 産 業	なし	なし
(2) 鉱 業	弱<=	なし
(3) 製 造 業	=>弱	なし
① 食 料 品	なし	なし
② 織 維	なし	なし
③ パ ル プ ・ 紙	=>弱	=>
④ 化 学	なし	なし
⑤ 石 油 製 品 ・ 石 炭 製 品	なし	なし
⑥ 窯 業 ・ 土 石 製 品	なし	なし
⑦ 一 次 金 属	なし	弱<=
⑧ 金 属 製 品	<=>弱	なし
⑨ 一 般 機 械	=>弱	なし
⑩ 電 気 機 械	なし	なし
⑪ 輸 送 機 械	なし	=>弱
⑫ 精 密 機 械	なし	<=
⑬ その他の製造業	<<=>	なし
(4) 建 設 業	なし	=>
(5) 電 気 ・ ガ ス ・ 水 道 業	弱<=	なし
(6) 卸 売 ・ 小 売 業	=>弱	=>弱
(7) 金 融 ・ 保 險 業	なし	なし
(8) 不 動 産 業	なし	<=
(9) 運 輸 ・ 通 信 業	弱<=	なし
(10) サ ー ビ ス 業	<<=>	なし

表19

価 格	因果関係の方向	
	1856—1910	1935—1965
GDPデフレーター	<=>>	<=
小売物価指数	<=	=>
消費財・サービス価格指数	<=	なし
資本財価格指数	<=	=>

変数の定義とデータの出所

日本の価格としては、

1. GNP デフレーター, (NEEDS, A-19 以下同様)
 2. 消費者物価指数 (F-9, 10, 11) の4半期に対応する3月の単純平均,
 3. 総合卸売物価指数 (F-1, 2) の4半期に対応する3月の単純平均,
- これらに対応させる賃金としては、
4. 生産物単位当り労働費用=雇用者所得/実質国民総生産(80年価格), (A-22, A-19)

いずれも、対前年同期比変化率。

他に、暦年データで、

5. GDP デフレーター (A-24),
ただし、製造業については、
6. 名目国内総生産/実質国内総生産(80年価格), (A-38, 39)

これらに対応させる賃金としては、

- 生産物単位当り労働費用=雇用者所得/実質国内総生産(80年価格), (A-43, A-40, 41)

いずれも、対前年変化率。

イギリスの価格として、*Economic Trend: Annual Supplement 1987* (Central Statistical Office) より、

7. GDP デフレーター=GDP at factor cost in current prices (pp. 9-10) /GDP at factor cost in 1980 prices (pp. 14-5)
8. 小売物価指数=General index of retail prices (pp. 115-6)
9. 生産者物価指数=Producer price index (p. 117)

これらに対応させる賃金として、

10. 生産物単位当り労働費用=Income from Impleynt (pp. 39-41) /GDP at factor cost in 1980 prices (pp. 14-5)

いずれも、対前年同期比変化率。

イギリスの長期データは、C. H. Feinstein, *National Income, Expenditure and Output of the United Kingdom 1855-1965* (Cambridge University Press, 1972) より、価格として、

11. GDP デフレーター = GDP at factor cost (T4)/GDP at constant factor cost (T18)

12. Price Indices for Consumers' Goods & Services (T132)

13. Price Indices for Capital Goods (T132)

14. Indices of Retail Prices (T140)

これらに対応させる賃金として、

15. 生産物単位当り労働費用 = Income from Employment (T4)/GDP at constant factor cost (T18)

いずれも、その対前年変化率。

参 考 文 献

- Feige, E. L. and Pearce, D. K., "The Casual Causal Relationship between Money and Income: Some Caveats for Time Series Analysis", *Review of Economics and Statistics*, Nov. 1979, Vol. 61, No. 4, pp. 521-32.
- Granger, C. W. J. "Investigating Causal Relations by Econometric Models and Cross-Spectral Methods," *Econometrica*, July 1969, Vol. 37, No. 3, pp. 424-38.
- Mehra, Y. P. "Money Wages, Prices, and Causality." *Journal of Political Economy*, 1977, Vol. 85, No. 6, pp. 1227-44.
- Shannon, R. and Wallace, M. S. "Wages and Inflation: an investigation into causality." *Journal of Post Keynesian Economics*, 1985-86, Vol. 8, No. 2, pp. 182-91.
- Sims, C. A., "Money, Income, and Causality", *American Economic Review*, Sept. 1972, Vol. 62, pp. 540-52.

付表15-1 消費者物価指数(商品)

TABLE CPI:COMMODITIES, JPN

TABLE OF G_CPI3*G_W1, 85(76Q1)<=OBS<=129(87Q1)

LAG	N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_ULS1	F_ULS2
1	44	1	41	1.463	12.119**	1.463	12.119**
2	43	2	38	0.053	5.511*	0.053	5.511*
3	42	3	35	0.022	3.389*	0.022	3.389*
4	41	4	32	0.280	2.202	0.280	2.202
5	40	5	29	0.275	1.630	0.275	1.630
6	39	6	26	0.361	1.184	0.361	1.184
7	38	7	23	0.455	1.502	0.455	1.502
8	37	8	20	0.634	1.465	0.634	1.465
9	36	9	17	0.802	1.463	0.802	1.463
10	35	10	14	0.762	1.180	0.762	1.180

TABLE OF G_CPI3*G_W1, 89(77Q1)<=OBS<=129(87Q1)

LAG	N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_ULS1	F_ULS2
1	40	1	37	2.951	9.307**	2.951	9.307**
2	39	2	34	0.041	4.587*	0.041	4.587*
3	38	3	31	0.040	2.923*	0.040	2.923*
4	37	4	28	0.394	1.985	0.394	1.985
5	36	5	25	0.285	1.598	0.285	1.598
6	35	6	22	0.398	1.163	0.398	1.163
7	34	7	19	0.691	1.209	0.691	1.209
8	33	8	16	1.341	1.312	1.341	1.312
9	32	9	13	2.069	1.311	2.069	1.311
10	31	10	10	1.451	0.964	1.451	0.964

TABLE OF G_CPI3*G_W1, 93(78Q1)<=OBS<=129(87Q1)

LAG	N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_ULS1	F_ULS2
1	36	1	33	0.979	8.990**	0.979	8.990**
2	35	2	30	0.195	4.041*	0.195	4.041*
3	34	3	27	0.108	2.311	0.108	2.311
4	33	4	24	0.376	1.629	0.376	1.629
5	32	5	21	0.401	1.265	0.401	1.265
6	31	6	18	0.942	0.852	0.942	0.852
7	30	7	15	2.222	1.350	2.222	1.350
8	29	8	12	3.073*	1.405	3.073*	1.405
9	28	9	9	2.321	1.021	2.321	1.021
10	27	10	6	1.271	0.960	1.271	0.960

付表15-2 消費者物価指数（サービス）

TABLE CPI:SERVICE(EXCL. IMPUTED RENT), JPN

TABLE OF G_CPI8*G_W1, 85(76Q1)<=OBS<=129(87Q1)

LAG N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_OLS1	F_OLS2
1 44	1 41	1.272	3.657	1.272	3.657	
2 43	2 38	0.875	1.902	0.875	1.902	
3 42	3 35	0.455	1.542	0.455	1.542	
4 41	4 32	0.224	1.656	0.224	1.656	
5 40	5 29	0.247	1.082	0.247	1.082	
6 39	6 26	0.227	1.039	-0.227	1.039	
7 38	7 23	0.163	1.195	0.163	1.195	
8 37	8 20	0.358	1.373	0.358	1.373	
9 36	9 17	0.374	2.687*	0.374	2.687*	
10 35	10 14	0.270	4.040**	0.270	4.040**	

TABLE OF G_CPI8*G_W1, 89(77Q1)<=OBS<=129(87Q1)

LAG N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_OLS1	F_OLS2
1 40	1 37	0.180	6.050*	0.180	6.050*	
2 39	2 34	0.047	1.908	0.047	1.908	
3 38	3 31	0.088	1.401	0.088	1.401	
4 37	4 28	0.189	1.890	0.189	1.890	
5 36	5 25	0.161	1.371	0.161	1.371	
6 35	6 22	0.153	1.031	0.153	1.031	
7 34	7 19	0.116	1.213	0.116	1.213	
8 33	8 16	0.377	1.665	0.377	1.665	
9 32	9 13	0.325	3.617*	0.325	3.617*	
10 31	10 10	0.293	2.831	0.293	2.831	

TABLE OF G_CPI8*G_W1, 93(78Q1)<=OBS<=129(87Q1)

LAG N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_OLS1	F_OLS2
1 36	1 33	0.249	4.704*	0.249	4.704*	
2 35	2 30	0.017	1.934	0.017	1.934	
3 34	3 27	0.079	1.652	0.079	1.652	
4 33	4 24	0.112	2.118	0.112	2.118	
5 32	5 21	0.152	1.447	0.152	1.447	
6 31	6 18	0.119	1.065	0.119	1.065	
7 30	7 15	0.097	1.093	0.097	1.093	
8 29	8 12	0.449	1.157	0.449	1.157	
9 28	9 9	0.292	3.029	0.292	3.029	
10 27	10 6	0.147	2.320	0.147	2.320	

付表15-3 消費者物価指数(農水畜産物)

TABLE CPI:AGRICULTURAL & AQUATIC PRODUCTS, JPN

TABLE OF G_CPI4*G_W1, 85(76Q1)<=OBS<=129(87Q1)

LAG N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_OLS1	F_OLS2
1 44	1 41		1.407	9.037**	1.407	9.037**
2 43	2 38		0.872	4.538*	0.872	4.538*
3 42	3 35		0.438	4.699**	0.438	4.699**
4 41	4 32		0.351	2.370	0.351	2.370
5 40	5 29		0.940	1.856	0.940	1.856
6 39	6 26		0.601	1.274	0.601	1.274
7 38	7 23		0.778	1.144	0.778	1.144
8 37	8 20		1.587	1.238	1.587	1.238
9 36	9 17		0.877	0.814	0.877	0.814
10 35	10 14		0.980	0.753	0.980	0.753

TABLE OF G_CPI4*G_W1, 89(77Q1)<=OBS<=129(87Q1)

LAG N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_OLS1	F_OLS2
1 40	1 37		0.131	4.740*	0.131	4.740*
2 39	2 34		0.113	3.216	0.113	3.216
3 38	3 31		0.428	2.325	0.428	2.325
4 37	4 28		0.523	2.460	0.523	2.460
5 36	5 25		0.743	1.845	0.743	1.845
6 35	6 22		0.673	1.358	0.673	1.358
7 34	7 19		0.706	1.176	0.706	1.176
8 33	8 16		1.497	1.008	1.497	1.008
9 32	9 13		0.865	0.704	0.865	0.704
10 31	10 10		0.882	0.554	0.882	0.554

TABLE OF G_CPI4*G_W1, 93(78Q1)<=OBS<=129(87Q1)

LAG N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_OLS1	F_OLS2
1 36	1 33		0.329	3.325	0.329	3.325
2 35	2 30		0.393	3.022	0.393	3.022
3 34	3 27		0.306	2.440	0.306	2.440
4 33	4 24		0.417	1.763	0.417	1.763
5 32	5 21		0.526	1.272	0.526	1.272
6 31	6 18		0.746	0.856	0.746	0.856
7 30	7 15		0.792	0.958	0.792	0.958
8 29	8 12		1.285	0.704	1.285	0.704
9 28	9 9		0.636	0.510	0.636	0.510
10 27	10 6		0.985	0.285	0.985	0.285

付表15-4 消費者物価指数（工業製品）

TABLE CPI:INDUSTRIAL PRODUCTS, JPN

TABLE OF G_CPI5*G_W1, 85(76Q1)<=OBS<=129(87Q1)

LAG	N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_OLS1	F_OLS2
1	44	1	41	1.117	7.962**	1.117	7.962**
2	43	2	38	2.354	4.009*	2.354	4.009*
3	42	3	35	1.816	2.506	1.816	2.506
4	41	4	32	1.203	1.916	1.203	1.916
5	40	5	29	0.565	1.359	0.565	1.359
6	39	6	26	0.472	1.454	0.472	1.454
7	38	7	23	0.657	1.200	0.657	1.200
8	37	8	20	1.320	0.927	1.320	0.927
9	36	9	17	1.128	1.143	1.128	1.143
10	35	10	14	0.910	1.050	0.910	1.050

TABLE OF G_CPI5*G_W1, 89(77Q1)<=OBS<=129(87Q1)

LAG	N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_OLS1	F_OLS2
1	40	1	37	1.834	7.160*	1.834	7.160*
2	39	2	34	0.722	3.559*	0.722	3.559*
3	38	3	31	0.477	2.586	0.477	2.586
4	37	4	28	0.565	2.691	0.565	2.691
5	36	5	25	0.602	2.100	0.602	2.100
6	35	6	22	0.396	1.509	0.396	1.509
7	34	7	19	0.676	1.082	0.676	1.082
8	33	8	16	1.348	0.764	1.348	0.764
9	32	9	13	1.335	0.804	1.335	0.804
10	31	10	10	1.052	0.791	1.052	0.791

TABLE OF G_CPI5*G_W1, 93(78Q1)<=OBS<=129(87Q1)

LAG	N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_OLS1	F_OLS2
1	36	1	33	1.912	7.917**	1.912	7.917**
2	35	2	30	0.623	3.298	0.623	3.298
3	34	3	27	0.561	2.062	0.561	2.062
4	33	4	24	0.469	2.499	0.469	2.499
5	32	5	21	0.623	1.610	0.623	1.610
6	31	6	18	0.440	1.093	0.440	1.093
7	30	7	15	0.582	1.110	0.582	1.110
8	29	8	12	0.885	0.850	0.885	0.850
9	28	9	9	0.696	1.334	0.696	1.334
10	27	10	6	0.404	0.987	0.404	0.987

付表15-5 消費者物価指数(大企業性製品)

TABLE CPI:INDUSTRIAL PRODUCTS
BY LARGE SCALE ENTERPRISES, JPN

TABLE OF G_CPI6*G_W1, 85(76Q1)<=OBS<=129(87Q1)

LAG	N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_OLS1	F_OLS2
1	44	1	41	0.176	7.823**	0.176	7.823**
2	43	2	38	1.122	1.863	1.122	1.863
3	42	3	35	0.731	2.257	0.731	2.257
4	41	4	32	1.689	2.393	1.689	2.393
5	40	5	29	1.433	1.491	1.433	1.491
6	39	6	26	1.171	1.040	1.171	1.040
7	38	7	23	0.525	0.942	0.525	0.942
8	37	8	20	0.438	1.275	0.438	1.275
9	36	9	17	0.358	0.924	0.358	0.924
10	35	10	14	0.539	0.813	0.539	0.813

TABLE OF G_CPI6*G_W1, 89(77Q1)<=OBS<=129(87Q1)

LAG	N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_OLS1	F_OLS2
1	40	1	37	0.270	5.144*	0.270	5.144*
2	39	2	34	0.173	1.128	0.173	1.128
3	38	3	31	0.192	1.470	0.192	1.470
4	37	4	28	0.676	2.689	0.676	2.689
5	36	5	25	0.602	2.172	0.602	2.172
6	35	6	22	0.206	1.871	0.206	1.871
7	34	7	19	0.569	2.222	0.569	2.222
8	33	8	16	0.955	1.563	0.955	1.563
9	32	9	13	0.545	2.412	0.545	2.412
10	31	10	10	0.850	2.374	0.850	2.374

TABLE OF G_CPI6*G_W1, 93(78Q1)<=OBS<=129(87Q1)

LAG	N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_OLS1	F_OLS2
1	36	1	33	0.888	4.073	0.888	4.073
2	35	2	30	0.350	3.052	0.350	3.052
3	34	3	27	0.140	3.615*	0.140	3.615*
4	33	4	24	0.763	3.172*	0.763	3.172*
5	32	5	21	0.845	3.109*	0.845	3.109*
6	31	6	18	1.579	3.411*	1.579	3.411*
7	30	7	15	1.339	2.428	1.339	2.428
8	29	8	12	0.820	1.856	0.820	1.856
9	28	9	9	0.343	4.523*	0.343	4.523*

付表15—5 消費者物価指数 (中小企業性製品)

TABLE CPI:INDUSTRIAL PRODUCTS
BY SMALL SCALE ENTERPRISES, JPN

TABLE OF G_CPI7*G_W1, 85(76Q1)<=OBS<=129(87Q1)

LAG	N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_OLS1	F_OLS2
1	44	1	41	2.235	8.401**	2.235	8.401**
2	43	2	38	1.783	4.608*	1.783	4.608*
3	42	3	35	2.254	3.634*	2.254	3.634*
4	41	4	32	1.912	1.818	1.912	1.818
5	40	5	29	0.587	1.473	0.587	1.473
6	39	6	26	0.332	1.758	0.332	1.758
7	38	7	23	0.446	1.359	0.446	1.359
8	37	8	20	1.416	1.278	1.416	1.278
9	36	9	17	1.271	1.508	1.271	1.508
10	35	10	14	1.059	1.180	1.059	1.180

TABLE OF G_CPI7*G_W1, 89(77Q1)<=OBS<=129(87Q1)

LAG	N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_OLS1	F_OLS2
1	40	1	37	1.197	5.995*	1.197	5.995*
2	39	2	34	0.590	3.854*	0.590	3.854*
3	38	3	31	0.621	3.149*	0.621	3.149*
4	37	4	28	0.281	2.429	0.281	2.429
5	36	5	25	0.445	2.993*	0.445	2.993*
6	35	6	22	0.718	2.207	0.718	2.207
7	34	7	19	1.040	1.433	1.040	1.433
8	33	8	16	2.178	1.173	2.178	1.173
9	32	9	13	1.588	1.015	1.588	1.015
10	31	10	10	1.369	0.959	1.369	0.959

TABLE OF G_CPI7*G_W1, 93(78Q1)<=OBS<=129(87Q1)

LAG	N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_OLS1	F_OLS2
1	36	1	33	1.304	8.416**	1.304	8.416**
2	35	2	30	1.522	3.634*	1.522	3.634*
3	34	3	27	0.513	2.156	0.513	2.156
4	33	4	24	0.490	2.457	0.490	2.457
5	32	5	21	0.879	2.454	0.879	2.454
6	31	6	18	1.103	2.068	1.103	2.068
7	30	7	15	0.978	1.505	0.978	1.505
8	29	8	12	1.498	1.094	1.498	1.094
9	28	9	9	1.105	1.266	1.105	1.266

表表17-1 総合卸売物価指数(素原材料)

TABLE WPI:RAW MATERIALS, JPN

TABLE OF G_WPID2*G_W1, 25(61Q1)<=OBS<=52(67Q4)

LAG	N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_ULS1	F_ULS2
1	27	1	24	0.266	1.938	0.266	1.938
2	26	2	21	1.368	1.263	1.368	1.263
3	25	3	18	1.459	1.685	1.459	1.685
4	24	4	15	2.604	4.463*	2.604	4.463*
5	23	5	12	3.258*	2.866	3.258*	2.866
6	22	6	9	2.576	2.650	2.576	2.650
7	21	7	6	11.184**	1.575	11.184**	1.575
8	20	8	3	8.576	0.920	8.576	0.920
9	19	9	0
10	18	10	-3

TABLE OF G_WPID2*G_W1, 25(61Q1)<=OBS<=56(68Q4)

LAG	N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_ULS1	F_ULS2
1	31	1	28	0.042	1.190	0.042	1.190
2	30	2	25	0.461	0.652	0.461	0.652
3	29	3	22	0.879	0.741	0.879	0.741
4	28	4	19	2.005	2.890	2.005	2.890
5	27	5	16	3.696*	2.845	3.696*	2.845
6	26	6	13	2.831	2.516	2.831	2.516
7	25	7	10	2.571	2.301	2.571	2.301
8	24	8	7	2.262	2.846	2.262	2.846
9	23	9	4	1.626	1.690	1.626	1.690
10	22	10	1	13.133	0.791	13.133	0.791

TABLE OF G_WPID2*G_W1, 25(61Q1)<=OBS<=60(69Q4)

LAG	N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_ULS1	F_ULS2
1	35	1	32	0.510	0.262	0.510	0.262
2	34	2	29	0.990	0.229	0.990	0.229
3	33	3	26	1.447	0.377	1.447	0.377
4	32	4	23	2.673	1.018	2.673	1.018
5	31	5	20	2.510	0.914	2.510	0.914
6	30	6	17	1.429	0.998	1.429	0.998
7	29	7	14	1.036	0.799	1.036	0.799
8	28	8	11	1.233	1.465	1.233	1.465
9	27	9	8	1.191	1.628	1.191	1.628
10	26	10	5	0.956	1.084	0.956	1.084

付表17-2 総合卸売物価指数（素原材料）

TABLE WPI:RAW MATERIALS, JPN

TABLE OF G_WPID2*G_W1, 85(76Q1)<=OBS<=129(87Q1)

LAG	N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_ULS1	F_ULS2
1	44	1	41	0.342	3.001	0.342	3.001
2	43	2	38	0.236	4.003*	0.236	4.003*
3	42	3	35	0.597	2.238	0.597	2.238
4	41	4	32	0.437	1.763	0.437	1.763
5	40	5	29	0.620	1.367	0.620	1.367
6	39	6	26	1.165	1.268	1.165	1.268
7	38	7	23	0.906	1.094	0.906	1.094
8	37	8	20	1.205	0.885	1.205	0.885
9	36	9	17	1.080	0.636	1.080	0.636
10	35	10	14	1.191	0.529	1.191	0.529

TABLE OF G_WPID2*G_W1, 89(77Q1)<=OBS<=129(87Q1)

LAG	N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_ULS1	F_ULS2
1	40	1	37	0.572	3.632	0.572	3.632
2	39	2	34	0.431	4.317*	0.431	4.317*
3	38	3	31	0.889	3.143*	0.889	3.143*
4	37	4	28	0.706	1.885	0.706	1.885
5	36	5	25	0.656	1.586	0.656	1.586
6	35	6	22	1.317	1.193	1.317	1.193
7	34	7	19	1.492	0.885	1.492	0.885
8	33	8	16	1.264	0.674	1.264	0.674
9	32	9	13	1.336	0.462	1.336	0.462
10	31	10	10	1.203	0.388	1.203	0.388

TABLE OF G_WPID2*G_W1, 93(78Q1)<=OBS<=129(87Q1)

LAG	N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_ULS1	F_ULS2
1	36	1	33	0.198	4.667*	0.198	4.667*
2	35	2	30	1.350	4.136*	1.350	4.136*
3	34	3	27	1.664	2.329	1.664	2.329
4	33	4	24	1.019	1.564	1.019	1.564
5	32	5	21	0.867	1.351	0.867	1.351
6	31	6	18	1.452	1.013	1.452	1.013
7	30	7	15	0.738	1.418	0.738	1.418
8	29	8	12	0.533	1.039	0.533	1.039
9	28	9	9	0.382	0.676	0.382	0.676
10	27	10	6	0.488	0.991	0.488	0.991

付表17-3 総合卸売物価指数(中間財)

TABLE WPI: INTERMEDIATE MATERIALS, JPN

TABLE OF G_WPID3*G_W1, 25(61Q1)<=OBS<=52(67Q4)

LAG N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_ULS1	F_ULS2
1	27	1 24	1.502	1.838	1.502	1.838
2	26	2 21	1.745	2.342	1.745	2.342
3	25	3 18	1.651	2.046	1.651	2.046
4	24	4 15	1.526	2.522	1.526	2.522
5	23	5 12	3.025	2.187	3.025	2.187
6	22	6 9	1.563	1.850	1.563	1.850
7	21	7 6	1.161	1.192	1.161	1.192
8	20	8 3	0.624	2.014	0.624	2.014
9	19	9 0
10	18	10 -3

TABLE OF G_WPID3*G_W1, 25(61Q1)<=OBS<=56(68Q4)

LAG N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_ULS1	F_ULS2
1	31	1 28	0.865	0.846	0.865	0.846
2	30	2 25	1.228	0.946	1.228	0.946
3	29	3 22	1.418	0.587	1.418	0.587
4	28	4 19	2.044	0.957	2.044	0.957
5	27	5 16	5.583*	0.828	5.583*	0.828
6	26	6 13	2.586	1.018	2.586	1.018
7	25	7 10	2.259	0.790	2.259	0.790
8	24	8 7	1.416	0.650	1.416	0.650
9	23	9 4	2.384	0.499	2.384	0.499
10	22	10 1	2.193	0.529	2.193	0.529

TABLE OF G_WPID3*G_W1, 25(61Q1)<=OBS<=60(69Q4)

LAG N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_ULS1	F_ULS2
1	35	1 32	2.413	0.029	2.413	0.029
2	34	2 29	2.198	0.224	2.198	0.224
3	33	3 26	1.992	0.217	1.992	0.217
4	32	4 23	2.035	0.334	2.035	0.334
5	31	5 20	1.883	0.282	1.883	0.282
6	30	6 17	0.843	0.424	0.843	0.424
7	29	7 14	1.102	0.605	1.102	0.605
8	28	8 11	0.910	0.667	0.910	0.667
9	27	9 8	1.383	0.585	1.383	0.585
10	26	10 5	1.001	1.112	1.001	1.112

付表17-4 総合卸売物価指数（中間財）

TABLE WPI:INTERMEDIATE MATERIALS, JPN

TABLE OF G_WPID3*G_W1, 85(76Q1)<=OBS<=129(87Q1)

LAG	N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_ULS1	F_ULS2
1	44	1	41	0.640	3.818	0.640	3.818
2	43	2	38	0.481	3.642*	0.481	3.642*
3	42	3	35	0.306	2.019	0.306	2.019
4	41	4	32	0.354	1.642	0.354	1.642
5	40	5	29	0.268	1.811	0.268	1.811
6	39	6	26	1.310	1.641	1.310	1.641
7	38	7	23	1.212	1.414	1.212	1.414
8	37	8	20	2.440	1.198	2.440	1.198
9	36	9	17	1.946	1.055	1.946	1.055
10	35	10	14	1.607	0.897	1.607	0.897

TABLE OF G_WPID3*G_W1, 89(77Q1)<=OBS<=129(87Q1)

LAG	N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_ULS1	F_ULS2
1	40	1	37	2.823	4.823*	2.823	4.823*
2	39	2	34	0.880	3.577*	0.880	3.577*
3	38	3	31	0.535	2.494	0.535	2.494
4	37	4	28	0.246	2.009	0.246	2.009
5	36	5	25	0.283	2.070	0.283	2.070
6	35	6	22	1.202	1.489	1.202	1.489
7	34	7	19	1.633	1.163	1.633	1.163
8	33	8	16	3.309*	0.927	3.309*	0.927
9	32	9	13	2.052	0.948	2.052	0.948
10	31	10	10	1.933	0.773	1.933	0.773

TABLE OF G_WPID3*G_W1, 93(78Q1)<=OBS<=129(87Q1)

LAG	N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_ULS1	F_ULS2
1	36	1	33	1.424	5.753*	1.424	5.753*
2	35	2	30	1.180	3.313	1.180	3.313
3	34	3	27	0.675	1.783	0.675	1.783
4	33	4	24	0.309	1.829	0.309	1.829
5	32	5	21	0.522	1.718	0.522	1.718
6	31	6	18	1.816	1.204	1.816	1.204
7	30	7	15	1.211	1.059	1.211	1.059
8	29	8	12	1.948	1.006	1.948	1.006
9	28	9	9	0.593	0.860	0.593	0.860
10	27	10	6	0.738	0.792	0.738	0.792

付表17-5 総合卸売物価指数(最終財)

TABLE WPI:FINAL GOODS, JPN

TABLE OF G_WPID4*G_W1, 25(61Q1)<=OBS<=52(67Q4)

LAG	N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_ULS1	F_ULS2
1	27	1	24	0.202	1.388	0.202	1.388
2	26	2	21	0.335	3.219	0.335	3.219
3	25	3	18	1.015	1.935	1.015	1.935
4	24	4	15	0.934	1.458	0.934	1.458
5	23	5	12	0.312	1.161	0.312	1.161
6	22	6	9	0.174	0.910	0.174	0.910
7	21	7	6	0.340	0.581	0.340	0.581
8	20	8	3	0.544	2.731	0.544	2.731
9	19	9	0
10	18	10	-3

TABLE OF G_WPID4*G_W1, 25(61Q1)<=OBS<=56(68Q4)

LAG	N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_ULS1	F_ULS2
1	31	1	28	0.056	3.34	0.056	3.34
2	30	2	25	0.517	5.56*	0.517	5.56*
3	29	3	22	1.311	3.22*	1.311	3.22*
4	28	4	19	0.847	3.04*	0.847	3.04*
5	27	5	16	0.564	2.52	0.564	2.52
6	26	6	13	0.489	2.00	0.489	2.00
7	25	7	10	0.756	1.80	0.756	1.80
8	24	8	7	1.566	1.65	1.566	1.65
9	23	9	4	1.049	1.14	1.049	1.14
10	22	10	1	18.909	2622.34*	18.909	2622.34*

TABLE OF G_WPID4*G_W1, 25(61Q1)<=OBS<=60(69Q4)

LAG	N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_ULS1	F_ULS2
1	35	1	32	0.089	3.214	0.089	3.214
2	34	2	29	0.811	4.697*	0.811	4.697*
3	33	3	26	1.882	2.416	1.882	2.416
4	32	4	23	1.136	1.914	1.136	1.914
5	31	5	20	0.830	1.410	0.830	1.410
6	30	6	17	0.747	1.262	0.747	1.262
7	29	7	14	1.160	1.423	1.160	1.423
8	28	8	11	2.054	0.964	2.054	0.964
9	27	9	8	1.135	1.160	1.135	1.160
10	26	10	5	0.722	1.716	0.722	1.716

付表17-6 総合卸売物価指数（最終財）

TABLE WPI:FIANL GOODS, JPN

TABLE OF G_WPID4*G_W1, 85(76Q1)<=OBS<=129(87Q1)

LAG	N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_OLS1	F_OLS2
1	44	1	41	0.758	6.628*	0.758	6.628*
2	43	2	38	1.269	3.562*	1.269	3.562*
3	42	3	35	1.179	2.108	1.179	2.108
4	41	4	32	0.972	1.738	0.972	1.738
5	40	5	29	0.718	1.439	0.718	1.439
6	39	6	26	0.833	1.153	0.833	1.153
7	38	7	23	1.105	1.272	1.105	1.272
8	37	8	20	3.161*	0.984	3.161*	0.984
9	36	9	17	2.391	1.070	2.391	1.070
10	35	10	14	1.870	0.863	1.870	0.863

TABLE OF G_WPID4*G_W1, 89(77Q1)<=OBS<=129(87Q1)

LAG	N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_OLS1	F_OLS2
1	40	1	37	1.324	7.021*	1.324	7.021*
2	39	2	34	0.669	3.705*	0.669	3.705*
3	38	3	31	0.546	2.540	0.546	2.540
4	37	4	28	0.723	2.289	0.723	2.289
5	36	5	25	0.273	1.877	0.273	1.877
6	35	6	22	0.585	1.484	0.585	1.484
7	34	7	19	0.967	1.389	0.967	1.389
8	33	8	16	3.433*	0.945	3.433*	0.945
9	32	9	13	2.411	0.983	2.411	0.983
10	31	10	10	2.234	0.777	2.234	0.777

TABLE OF G_WPID4*G_W1, 93(78Q1)<=OBS<=129(87Q1)

LAG	N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_OLS1	F_OLS2
1	36	1	33	1.019	7.924*	1.019	7.924*
2	35	2	30	1.576	3.429*	1.576	3.429*
3	34	3	27	0.674	1.974	0.674	1.974
4	33	4	24	0.594	2.156	0.594	2.156
5	32	5	21	0.249	1.583	0.249	1.583
6	31	6	18	0.584	1.265	0.584	1.265
7	30	7	15	0.808	1.562	0.808	1.562
8	29	8	12	2.937*	1.377	2.937*	1.377
9	28	9	9	0.708	1.105	0.708	1.105
10	27	10	6	0.547	1.333	0.547	1.333

付表17-7 総合卸売物価指数(資本財)

TABLE WPI:FINAL GOODS-CAPITAL GOODS, JPN.

TABLE OF G_WPID5*G_W1, 25(61Q1)<=OBS<=52(67Q4)

LAG	N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_OLS1	F_OLS2
1	27	1	24	1.399	0.053	1.399	0.053
2	26	2	21	0.889	0.924	0.889	0.924
3	25	3	18	0.485	0.498	0.485	0.498
4	24	4	15	1.241	1.039	1.241	1.039
5	23	5	12	0.431	1.437	0.431	1.437
6	22	6	9	0.625	1.761	0.625	1.761
7	21	7	6	0.820	1.143	0.820	1.143
8	20	8	3	1.026	2.442	1.026	2.442
9	19	9	0
10	18	10	-3

TABLE OF G_WPID5*G_W1, 25(61Q1)<=OBS<=56(68Q4)

LAG	N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_OLS1	F_OLS2
1	31	1	28	1.557	0.708	1.557	0.708
2	30	2	25	1.041	1.672	1.041	1.672
3	29	3	22	0.591	1.021	0.591	1.021
4	28	4	19	0.816	1.393	0.816	1.393
5	27	5	16	0.428	1.132	0.428	1.132
6	26	6	13	0.127	2.303	0.127	2.303
7	25	7	10	0.086	1.697	0.086	1.697
8	24	8	7	0.987	4.609*	0.987	4.609*
9	23	9	4	0.721	9.392*	0.721	9.392*
10	22	10	1	1.237	44.216	1.237	44.216

TABLE OF G_WPID5*G_W1, 25(61Q1)<=OBS<=60(69Q4)

LAG	N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_OLS1	F_OLS2
1	35	1	32	0.987	0.654	0.987	0.654
2	34	2	29	1.269	2.453	1.269	2.453
3	33	3	26	0.995	1.455	0.995	1.455
4	32	4	23	0.943	2.078	0.943	2.078
5	31	5	20	0.312	1.671	0.312	1.671
6	30	6	17	0.185	3.430*	0.185	3.430
7	29	7	14	0.148	2.589	0.148	2.589
8	28	8	11	0.289	4.997**	0.289	4.997
9	27	9	8	0.992	3.594*	0.992	3.594
10	26	10	5	1.382	4.350	1.382	4.350

付表17-8 総合卸売物価指数（資本財）

TABLE WPI:FIANL GOODS-CAPITAL GOODS, JPN

TABLE OF G_WPID5*G_W1, 85(76Q1)<=OBS<=129(87Q1)

LAG	N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_OLS1	F_OLS2
1	44	1	41	0.848	2.453	0.848	2.453
2	43	2	38	0.642	1.884	0.642	1.884
3	42	3	35	0.380	1.406	0.380	1.406
4	41	4	32	0.197	1.697	0.197	1.697
5	40	5	29	0.346	1.208	0.346	1.208
6	39	6	26	0.339	1.311	0.339	1.311
7	38	7	23	0.646	1.241	0.646	1.241
8	37	8	20	1.545	0.942	1.545	0.942
9	36	9	17	1.052	0.766	1.052	0.766
10	35	10	14	0.990	0.936	0.990	0.936

TABLE OF G_WPID5*G_W1, 89(77Q1)<=OBS<=129(87Q1)

LAG	N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_OLS1	F_OLS2
1	40	1	37	0.169	6.262*	0.169	6.262*
2	39	2	34	0.308	3.585*	0.308	3.585*
3	38	3	31	0.525	2.885	0.525	2.885
4	37	4	28	0.474	2.076	0.474	2.076
5	36	5	25	0.276	1.765	0.276	1.765
6	35	6	22	0.323	1.532	0.323	1.532
7	34	7	19	0.719	1.086	0.719	1.086
8	33	8	16	1.241	0.770	1.241	0.770
9	32	9	13	0.815	0.653	0.815	0.653
10	31	10	10	1.155	0.648	1.155	0.648

TABLE OF G_WPID5*G_W1, 93(78Q1)<=OBS<=129(87Q1)

LAG	N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_OLS1	F_OLS2
1	36	1	33	0.433	8.216**	0.433	8.216**
2	35	2	30	0.427	3.588*	0.427	3.588*
3	34	3	27	0.939	2.357	0.939	2.357
4	33	4	24	0.670	1.964	0.670	1.964
5	32	5	21	0.319	1.387	0.319	1.387
6	31	6	18	0.275	1.182	0.275	1.182
7	30	7	15	0.677	1.408	0.677	1.408
8	29	8	12	1.265	1.616	1.265	1.616
9	28	9	9	0.274	1.388	0.274	1.388
10	27	10	6	0.386	1.144	0.386	1.144

付表17-9 総合卸売物価指数(消費財)

TABLE WPI:FINAL GOODS-CONSUMER GOODS, JPN

TABLE OF G_WPID6*G_W1, 25(61Q1)<=OBS<=52(67Q4)

LAG N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_OLS1	F_OLS2
1 27	1 24		0.863	2.338	0.863	2.338
2 26	2 21		0.156	3.592*	0.156	3.592*
3 25	3 18		0.834	2.024	0.834	2.024
4 24	4 15		1.235	1.199	1.235	1.199
5 23	5 12		0.528	0.876	0.528	0.876
6 22	6 9		0.284	0.720	0.284	0.720
7 21	7 6		0.393	0.669	0.393	0.669
8 20	8 3		0.613	1.541	0.613	1.541
9 19	9 0	
10 18	10 -3	

TABLE OF G_WPID6*G_W1, 25(61Q1)<=OBS<=56(68Q4)

LAG N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_OLS1	F_OLS2
1 31	1 28		0.529	4.706*	0.529	4.706*
2 30	2 25		0.173	6.072**	0.173	6.072**
3 29	3 22		1.066	3.368*	1.066	3.368*
4 28	4 19		1.264	2.579	1.264	2.579
5 27	5 16		0.608	2.024	0.608	2.024
6 26	6 13		0.481	1.541	0.481	1.541
7 25	7 10		0.832	1.559	0.832	1.559
8 24	8 7		1.612	1.459	1.612	1.459
9 23	9 4		2.547	0.926	2.547	0.926
10 22	10 1		3.491	200.115	3.491	200.115

TABLE OF G_WPID6*G_W1, 25(61Q1)<=OBS<=60(69Q4)

LAG N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_OLS1	F_OLS2
1 35	1 32		0.581	4.417*	0.581	4.417*
2 34	2 29		0.310	4.946*	0.310	4.946*
3 33	3 26		1.591	2.450	1.591	2.450
4 32	4 23		1.648	1.614	1.648	1.614
5 31	5 20		0.956	1.198	0.956	1.198
6 30	6 17		0.803	1.320	0.803	1.320
7 29	7 14		1.495	1.449	1.495	1.449
8 28	8 11		2.802	1.026	2.802	1.026
9 27	9 8		3.752	0.972	3.752	0.972
10 26	10 5		4.465	0.891	4.465	0.891

付表17-10 総合卸売物価指数（消費財）

TABLE WPI:FIANL GOODS-CONSUMER GOODS, JPN

TABLE OF G_WPID6*G_W1, 85(76Q1)<=OBS<=129(87Q1)

LAG N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_ULS1	F_ULS2
1	44	1 41	1.279	8.045**	1.279	8.045**
2	43	2 38	1.075	4.003*	1.075	4.003*
3	42	3 35	1.111	2.405	1.111	2.405
4	41	4 32	1.065	1.830	1.065	1.830
5	40	5 29	0.718	1.566	0.718	1.566
6	39	6 26	0.857	1.337	0.857	1.337
7	38	7 23	1.284	1.515	1.284	1.515
8	37	8 20	3.218*	1.183	3.218*	1.183
9	36	9 17	2.385	1.232	2.385	1.232
10	35	10 14	1.821	0.968	1.821	0.968

TABLE OF G_WPID6*G_W1, 89(77Q1)<=OBS<=129(87Q1)

LAG N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_ULS1	F_ULS2
1	40	1 37	1.644	7.092*	1.644	7.092*
2	39	2 34	0.741	3.653*	0.741	3.653*
3	38	3 31	0.618	2.415	0.618	2.415
4	37	4 28	0.786	2.237	0.786	2.237
5	36	5 25	0.289	1.871	0.289	1.871
6	35	6 22	0.558	1.505	0.558	1.505
7	34	7 19	1.181	1.451	1.181	1.451
8	33	8 16	4.016*	1.033	4.016*	1.033
9	32	9 13	2.339	1.092	2.339	1.092
10	31	10 10	2.057	0.981	2.057	0.981

TABLE OF G_WPID6*G_W1, 93(78Q1)<=OBS<=129(87Q1)

LAG N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_ULS1	F_ULS2
1	36	1 33	0.972	7.514*	0.972	7.514*
2	35	2 30	1.356	3.297	1.356	3.297
3	34	3 27	0.742	1.853	0.742	1.853
4	33	4 24	0.634	2.053	0.634	2.053
5	32	5 21	0.356	1.764	0.356	1.764
6	31	6 18	0.549	1.535	0.549	1.535
7	30	7 15	1.000	1.487	1.000	1.487
8	29	8 12	2.863*	1.391	2.863*	1.391
9	28	9 9	0.612	1.397	0.612	1.397
10	27	10 6	0.655	1.360	0.655	1.360

付表19-1 GDPデフレーター

TABLE GDP-DEFLATOR, UK

TABLE OF G_P1*G_W1, 1856<=YEAR<=1895

LAG	N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_ULS1	F_ULS2
1	39	1	36	2.876	3.150	2.876	3.150
2	38	2	33	6.460**	5.342**	6.460**	5.342**
3	37	3	30	4.440*	7.186**	4.440*	7.186**
4	36	4	27	2.697	4.083*	2.697	4.083*
5	35	5	24	2.171	2.809*	2.171	2.809*

TABLE OF G_P1*G_W1, 1856<=YEAR<=1900

LAG	N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_ULS1	F_ULS2
1	44	1	41	3.057	4.136*	3.057	4.136*
2	43	2	38	5.881**	5.499**	5.881**	5.499**
3	42	3	35	4.728**	7.915**	4.728**	7.915**
4	41	4	32	2.853*	4.817**	2.853*	4.817**
5	40	5	29	2.462	3.265*	2.462	3.265*

TABLE OF G_P1*G_W1, 1856<=YEAR<=1905

LAG	N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_ULS1	F_ULS2
1	49	1	46	4.797*	5.654*	4.797*	5.654*
2	48	2	43	5.632**	5.711**	5.632**	5.711**
3	47	3	40	5.542**	9.235**	5.542**	9.235**
4	46	4	37	3.113*	5.582**	3.113*	5.582**
5	45	5	34	2.998*	4.001**	2.998*	4.001**

TABLE OF G_P1*G_W1, 1856<=YEAR<=1910

LAG	N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_ULS1	F_ULS2
1	54	1	51	5.484*	7.094*	5.484*	7.094*
2	53	2	48	4.722*	6.405**	4.722*	6.405**
3	52	3	45	4.748**	10.153**	4.748**	10.153**
4	51	4	42	2.898*	6.165**	2.898*	6.165**
5	50	5	39	3.433*	4.404**	3.433*	4.404**

付表19-2 GDPデフレーター

TABLE GDP-DEFLATOR, UK

TABLE OF G_P1*G_W1, 1935<=YEAR<=1965

LAG N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_ULS1	F_ULS2	
1	30	1	27	7.092*	0.372	7.092*	0.372
2	29	2	24	5.138*	0.122	5.138*	0.122
3	28	3	21	2.774	0.679	2.774	0.679
4	27	4	18	4.681**	0.717	4.681**	0.717
5	26	5	15	3.593*	0.565	3.593*	0.565

TABLE OF G_P1*G_W1, 1940<=YEAR<=1965

LAG N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_ULS1	F_ULS2	
1	25	1	22	6.715*	0.251	6.715*	0.251
2	24	2	19	0.510	0.076	0.510	0.076
3	23	3	16	0.346	0.836	0.346	0.836
4	22	4	13	1.898	0.567	1.898	0.567
5	21	5	10	0.703	0.154	0.703	0.154

TABLE OF G_P1*G_W1, 1945<=YEAR<=1965

LAG N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_ULS1	F_ULS2	
1	20	1	17	1.903	0.626	1.903	0.626
2	19	2	14	0.301	0.134	0.301	0.134
3	18	3	11	1.245	1.158	1.245	1.158
4	17	4	8	1.092	0.413	1.092	0.413
5	16	5	5	0.768	0.502	0.768	0.502

TABLE OF G_P1*G_W1, 1950<=YEAR<=1965

LAG N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_ULS1	F_ULS2	
1	15	1	12	4.050	3.829	4.050	3.829
2	14	2	9	0.372	0.115	0.372	0.115
3	13	3	6	0.537	0.242	0.537	0.242
4	12	4	3	0.116	0.283	0.116	0.283
5	11	5	0

付表19-3 小売物価指数

TABLE INDICES OF RETAIL PRICES, UK

TABLE OF G_P2*G_W1, 1856<=YEAR<=1895

LAG	N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_ULS1	F_ULS2
1	39	1	36	3.207	0.007	3.207	0.007
2	38	2	33	4.020*	1.246	4.020*	1.246
3	37	3	30	2.555	1.699	2.555	1.699
4	36	4	27	1.021	1.980	1.021	1.980
5	35	5	24	0.868	1.405	0.868	1.405

TABLE OF G_P2*G_W1, 1856<=YEAR<=1900

LAG	N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_ULS1	F_ULS2
1	44	1	41	3.220	0.081	3.220	0.081
2	43	2	38	4.373*	1.982	4.373*	1.982
3	42	3	35	2.882*	2.081	2.882*	2.081
4	41	4	32	1.319	1.349	1.319	1.349
5	40	5	29	1.069	0.851	1.069	0.851

TABLE OF G_P2*G_W1, 1856<=YEAR<=1905

LAG	N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_ULS1	F_ULS2
1	49	1	46	2.642	0.083	2.642	0.083
2	48	2	43	3.590*	1.427	3.590*	1.427
3	47	3	40	2.523	1.579	2.523	1.579
4	46	4	37	1.264	1.233	1.264	1.233
5	45	5	34	1.049	0.813	1.049	0.813

TABLE OF G_P2*G_W1, 1856<=YEAR<=1910

LAG	N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_ULS1	F_ULS2
1	54	1	51	2.197	0.017	2.197	0.017
2	53	2	48	3.341*	1.535	3.341*	1.535
3	52	3	45	2.491	1.859	2.491	1.859
4	51	4	42	1.220	1.545	1.220	1.545
5	50	5	39	1.248	1.007	1.248	1.007

付表19-4 小売物価指数

TABLE INDICES OF RETAIL PRICES, UK

TABLE OF G_P2*G_W1, 1935<=YEAR<=1965

LAG N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_ULS1	F_ULS2	
1	30	1	27	0.350	0.097	0.350	0.097
2	29	2	24	1.284	0.226	1.284	0.226
3	28	3	21	0.922	1.352	0.922	1.352
4	27	4	18	1.017	1.262	1.017	1.262
5	26	5	15	1.082	2.065	1.082	2.065

TABLE OF G_P2*G_W1, 1940<=YEAR<=1965

LAG N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_ULS1	F_ULS2	
1	25	1	22	0.141	0.913	0.141	0.913
2	24	2	19	1.319	0.395	1.319	0.395
3	23	3	16	1.145	5.580**	1.145	5.580**
4	22	4	13	1.280	2.758	1.280	2.758
5	21	5	10	1.149	6.728**	1.149	6.728**

TABLE OF G_P2*G_W1, 1945<=YEAR<=1965

LAG N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_ULS1	F_ULS2	
1	20	1	17	0.353	0.830	0.353	0.830
2	19	2	14	1.715	3.717	1.715	3.717
3	18	3	11	1.564	4.684*	1.564	4.684*
4	17	4	8	0.502	1.640	0.502	1.640
5	16	5	5	0.249	2.238	0.249	2.238

TABLE OF G_P2*G_W1, 1950<=YEAR<=1965

LAG N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_ULS1	F_ULS2	
1	15	1	12	0.426	0.062	0.426	0.062
2	14	2	9	2.007	0.221	2.007	0.221
3	13	3	6	0.652	3.592	0.652	3.592
4	12	4	3	0.543	1.748	0.543	1.748
5	11	5	0

付表19-5 消費財・サービス価格指数

TABLE PRICE INDICES FOR CONSUMERS' GOODS & SERVICES, UK

TABLE OF G_P3*G_W1, 1871<=YEAR<=1895

LAG	N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_ULS1	F_ULS2
1	24	1	21	4.275	1.887	4.275	1.887
2	23	2	18	7.908**	1.079	7.908**	1.079
3	22	3	15	3.149	1.004	3.149	1.004
4	21	4	12	2.237	1.674	2.237	1.674
5	20	5	9	1.225	1.910	1.225	1.910

TABLE OF G_P3*G_W1, 1871<=YEAR<=1900

LAG	N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_ULS1	F_ULS2
1	29	1	26	2.810	2.514	2.810	2.514
2	28	2	23	4.750*	1.524	4.750*	1.524
3	27	3	20	1.769	1.100	1.769	1.100
4	26	4	17	1.529	0.998	1.529	0.998
5	25	5	14	0.709	0.927	0.709	0.927

TABLE OF G_P3*G_W1, 1871<=YEAR<=1905

LAG	N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_ULS1	F_ULS2
1	34	1	31	2.583	1.951	2.583	1.951
2	33	2	28	3.616*	0.985	3.616*	0.985
3	32	3	25	1.252	0.790	1.252	0.790
4	31	4	22	1.081	1.353	1.081	1.353
5	30	5	19	0.423	1.144	0.423	1.144

TABLE OF G_P3*G_W1, 1871<=YEAR<=1910

LAG	N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_ULS1	F_ULS2
1	39	1	36	2.740	2.208	2.740	2.208
2	38	2	33	3.864*	1.199	3.864*	1.199
3	37	3	30	1.429	0.851	1.429	0.851
4	36	4	27	1.151	1.425	1.151	1.425
5	35	5	24	0.439	1.055	0.439	1.055

付表19—6 消費財・サービス価格指数

TABLE PRICE INDICES FOR CONSUMERS' GOODS & SERVICES, UK

TABLE OF G_P3*G_W1, 1935<=YEAR<=1965

LAG	N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_OLS1	F_OLS2
1	30	1	27	0.530	1.582	0.530	1.582
2	29	2	24	0.789	0.829	0.789	0.829
3	28	3	21	0.675	1.159	0.675	1.159
4	27	4	18	0.457	2.155	0.457	2.155
5	26	5	15	0.688	2.191	0.688	2.191

TABLE OF G_P3*G_W1, 1940<=YEAR<=1965

LAG	N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_OLS1	F_OLS2
1	25	1	22	2.294	1.686	2.294	1.686
2	24	2	19	1.147	0.477	1.147	0.477
3	23	3	16	0.845	1.616	0.845	1.616
4	22	4	13	0.978	1.738	0.978	1.738
5	21	5	10	1.233	1.742	1.233	1.742

TABLE OF G_P3*G_W1, 1945<=YEAR<=1965

LAG	N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_OLS1	F_OLS2
1	20	1	17	0.758	2.069	0.758	2.069
2	19	2	14	0.657	3.539	0.657	3.539
3	18	3	11	0.450	2.849	0.450	2.849
4	17	4	8	0.397	1.219	0.397	1.219
5	16	5	5	0.342	1.285	0.342	1.285

TABLE OF G_P3*G_W1, 1950<=YEAR<=1965

LAG	N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_OLS1	F_OLS2
1	15	1	12	1.303	0.869	1.303	0.869
2	14	2	9	0.738	0.229	0.738	0.229
3	13	3	6	0.565	0.585	0.565	0.585
4	12	4	3	0.347	0.341	0.347	0.341
5	11	5	0

付表19-7 資本財價格指數

TABLE PRICE INDICES FOR CAPITAL GOODS, UK

TABLE OF G_P4*G_W1, 1871<=YEAR<=1895

LAG	N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_ULS1	F_ULS2
1	24	1	21	4.485*	0.632	4.485*	0.632
2	23	2	18	7.284**	1.074	7.284**	1.074
3	22	3	15	2.024	0.581	2.024	0.581
4	21	4	12	1.364	0.719	1.364	0.719
5	20	5	9	0.523	0.391	0.523	0.391

TABLE OF G_P4*G_W1, 1871<=YEAR<=1900

LAG	N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_ULS1	F_ULS2
1	29	1	26	1.934	2.105	1.934	2.105
2	28	2	23	6.088**	3.238	6.088**	3.238
3	27	3	20	2.359	2.118	2.359	2.118
4	26	4	17	1.698	1.682	1.698	1.682
5	25	5	14	0.353	1.109	0.353	1.109

TABLE OF G_P4*G_W1, 1871<=YEAR<=1905

LAG	N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_ULS1	F_ULS2
1	34	1	31	0.955	2.819	0.955	2.819
2	33	2	28	2.940	2.177	2.940	2.177
3	32	3	25	0.815	1.698	0.815	1.698
4	31	4	22	0.847	1.266	0.847	1.266
5	30	5	19	0.121	1.107	0.121	1.107

TABLE OF G_P4*G_W1, 1871<=YEAR<=1910

LAG	N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_ULS1	F_ULS2
1	39	1	36	0.685	3.886	0.685	3.886
2	38	2	33	2.862	2.891	2.862	2.891
3	37	3	30	0.744	2.336	0.744	2.336
4	36	4	27	0.817	1.940	0.817	1.940
5	35	5	24	0.095	1.494	0.095	1.494

付表19-8 資本財価格指数

TABLE PRICE INDICES FOR CAPITAL GOODS, UK

TABLE OF G_P4*G_W1, 1935<=YEAR<=1965

LAG	N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_ULS1	F_ULS2
1	30	1	27	1.479	1.107	1.479	1.107
2	29	2	24	1.158	1.344	1.158	1.344
3	28	3	21	1.726	2.098	1.726	2.098
4	27	4	18	1.101	6.166**	1.101	6.166**
5	26	5	15	1.671	4.916**	1.671	4.916**

TABLE OF G_P4*G_W1, 1940<=YEAR<=1965

LAG	N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_ULS1	F_ULS2
1	25	1	22	0.490	5.290*	0.490	5.290*
2	24	2	19	0.444	3.822*	0.444	3.822*
3	23	3	16	1.280	2.861	1.280	2.861
4	22	4	13	0.329	6.527**	0.329	6.527**
5	21	5	10	0.873	3.016	0.873	3.016

TABLE OF G_P4*G_W1, 1945<=YEAR<=1965

LAG	N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_ULS1	F_ULS2
1	20	1	17	0.018	0.987	0.018	0.987
2	19	2	14	0.657	2.865	0.657	2.865
3	18	3	11	0.417	4.697*	0.417	4.697*
4	17	4	8	0.471	1.530	0.471	1.530
5	16	5	5	0.200	1.302	0.200	1.302

TABLE OF G_P4*G_W1, 1950<=YEAR<=1965

LAG	N	DF1	DF2	F_OLS1	F_OLS2	F_ULS1	F_ULS2
1	15	1	12	0.028	0.026	0.028	0.026
2	14	2	9	0.718	0.098	0.718	0.098
3	13	3	6	0.658	0.766	0.658	0.766
4	12	4	3	0.713	0.937	0.713	0.937
5	11	5	0