

Author index

A

Abrigo, M. R. M. 281
Akaike, H. 64, 84
Alogoskoufis, G. 131
Anderson, A. P. 203
Anderson, G. J. 131
Anderson, T. W. 280
Andrews, D. W. K. 349
Angrist, J. D. 323
Anselin, L. 283, 304
Arellano, M. 280

B

Bacon, D. W. 212
Baillie, R. T. 339
Baker, C. S. 310
Bates, D. M. 217
Battaglia, F. 205, 211
Baum, C. F. xxvii,
23, 46, 49, 118, 121, 159, 170,
344, 347, 349, 351, 361
Bera, A. K. 25
Beran, J. 195, 359
Berndt, E. R. 61
Bloomfield, P. 339
Blundell, R. 280
Bojariu, R. 339
Bollerslev, T. 232
Bond, S. 280
Boot, T. 226
Borsky, S. 284, 290, 307
Bover, O. 280
Box, G. E. P. 23, 55
Breusch, T. S. 21, 23
Brockwell, P. J. 347
Bruce, N. 17

C

Cameron, A. C. 43, 309
Campbell, S. D. 253
Caporale, G. M. 354
Carson, R. T. 147
Chan, K. S. 213
Cifuentes, L. 11
Clapham, P. 310
Clemente, J. 124, 127
CME Group 130
Constantine, R. 310
Cook, R. D. 21
Cox, N. J. . . . 13, 52, 174, 235, 365, 366,
375, 384
Cumby, R. E. 23

D

Davidson, J. E. H. 131
Davies, R. B. 209, 284
Davis, R. A. 347
De Jong, P. 178
Dempster, A. P. 224
Diaz, A. 17
Dickey, D. A. 112
Diebold, F. X. 159, 253
Dolado, J. J. 129
Doornik, J. A. 26, 304
Drukker, D. M. 290
Durbin, J. 60, 205

E

Elliott, G. 119, 120
Engle, R. F. . . . 129, 133, 135, 229, 232,
248

F

Florax, R. J. G. M. 303, 304
 Folmer, H. 303, 304
 Frances, P. H. 127
 Fredriksson, P. G. 284, 337
 Freese, J. 324
 Fuller, W. A. 112

G

Ganapathiraju, P. 284
 Garrigue, C. 310
 Geweke, J. 347
 Ghaddar, D. K. 215
 Giacomini, R. 159
 Gil-Alana, L. A. 354
 Gilbert, C. L. 304
 Glosten, L. R. 239
 Godfrey, L. G. 23
 Goldfeld, S. M. 212
 Gould, W. 366
 Granger, C. W. J. . . . 85, 129, 133, 135,
 174, 201, 203, 339
 Grassi, S. 191, 193
 Gregory, A. W. 143
 Grossman, G. M. 77
 Guggenberger, P. 349

H

Haggan, V. 217
 Haldrup, N. 127
 Hall, A. D. 195
 Hall, B. H. 61
 Hall, R. E. 61
 Hamilton, J. D. 35, 177, 220, 347
 Hannan, E. J. 64, 84
 Hansen, B. E. 120, 136, 143, 209
 Hansen, H. 26
 Hansen, J. 5
 Hansen, L. P. 45, 46
 Hansen, P. R. 233
 Hardin, J. W. 171
 Harris, D. 35, 41, 127, 137, 178
 Harvey, A. C. . . . 177, 178, 184, 189, 251
 Harvey, D. I. 120, 127
 Haslett, J. 339

Hauser, N. 310
 Hausman, J. A. 49, 61, 273
 Hayashi, F. 15, 35
 Hendry, D. F. 131, 304
 Heres, D. R. 340, 355, 358
 Hilbe, J. M. 171
 Hillebrand, E. 191, 193
 Hodrick, R. J. 78
 Holtz-Eakin, D. 280, 281
 Hosking, J. R. M. 339, 341, 352
 Hoti, S. 229
 Hsiao, C. 280
 Hualde, J. 354
 Huizinga, J. 23
 Hurn, S. 35, 41, 87, 129, 137, 178,
 231, 351
 Hurst, H. 339, 343

J

Jackson, J. A. 310
 Jacob, D. J. 17
 Jaffe, A. B. 257
 Jagannathan, R. 239
 Jann, B. 380
 Jansson, M. 120
 Jarque, C. M. 25
 Jenkins, G. M. 23, 55
 Jenkinson, T. 129
 Johansen, S. 137, 146
 Joyeux, R. 339

K

Kalikoski, D. 284
 Kaufmann, R. K. 101
 Keller, W. 255
 Khan, H. 97, 100
 Knittel, C. R. 97, 100
 Kolev, G. I. 376
 Koopman, S. J. 195
 Krueger, A. B. 77
 Kuznets, S. 147
 Kwiatkowski, D. P. 117

L

| | |
|-----------------------|----------|
| Laird, N. M. | 224 |
| Lanne, M. | 106 |
| Lee, T-H. | 203 |
| LeSage, J. | 283 |
| Levinson, A. | 255 |
| Leybourne, S. J. | 120, 127 |
| Li, M. | 195 |
| Lim, K. S. | 208, 211 |
| Lin, C-F. | 201 |
| Lindsay, K. | 351 |
| Liski, M. | 106 |
| Lit, R. | 195 |
| Liu, Z. | 198 |
| Ljung, G. M. | 23 |
| Lo, A. W. | 344 |
| Lo, K. | 5 |
| Long, L. S. | 324 |
| Love, I. | 281 |
| Lunde, A. | 233 |
| Lundquist, J. | 152 |
| Luukkonen, R. | 214, 215 |

M

| | |
|--------------------------------|-----------------------|
| Maddala, G. S. | 303, 304 |
| Mandelbrot, B. | 343 |
| Mann, H. B. | 77 |
| Mariano, R. S. | 159 |
| Marinucci, D. | 354 |
| Martin, V. L. | 35, 41, 137, 178, 231 |
| Martínez-Hernández, L. C. | 340, 355, 358 |
| Mayer, T. | 289 |
| McAleer, M. | 229 |
| McCracken, J. P. | 17 |
| Metaxoglou, K. | 97, 100 |
| Mickley, L. J. | 17 |
| Millimet, D. L. | 284 |
| MMA | 11 |
| Montañés, A. | 124, 127 |
| Morfjeld, H. | 339 |
| Mosconi, R. | 146 |
| Motanari, A. | 339 |
| Mundlak, Y. | 274 |

| | |
|------------------------|-----|
| Murdoch, J. C. | 284 |
| Muscatelli, V. A. | 129 |

N

| | |
|----------------------|--------------|
| Naughton, H. T. | 284 |
| Nelson, D. B. | 240 |
| Neumayer, E. | 337 |
| Newey, W. K. | 28, 280, 281 |
| Ng, S. | 114 |
| Nickell, S. | 279 |
| Nielsen, B. | 146 |
| Nielsen, M. Ø. | 354 |

O

| | |
|-------------------|----------|
| Ord, K. | 294 |
| Orfei, L. | 205, 211 |
| Ouliaris, S. | 95 |
| Overland, J. | 339 |
| Ozaki, T. | 217 |

P

| | |
|-------------------------|-----------------------------|
| Pace, R. K. | 283 |
| Pagan, A. R. | 21, 95 |
| Papineau, M. | 97, 100 |
| Pauwels, L. L. | 229 |
| Peng, H. | 290 |
| Perales, F. | 274, 275 |
| Percival, D. | 339 |
| Pérez, J. E. P. | 144 |
| Perron, P. | 114, 116, 121, 123, 124 |
| Peterson, S. R. | 257 |
| Petrova, D. | 195 |
| Phillips, P. C. B. | 87, 116, 117, 136, 231, 348 |
| Pick, A. | 226 |
| Pischke, J.-S. | 323 |
| Pitcher, T. J. | 284 |
| Poole, M. M. | 310 |
| Porter-Hudak, S. | 347 |
| Portney, P. R. | 257 |
| Poskitt, D. S. | 208 |
| Pravan, V. | 339 |
| Prescott, E. C. | 78 |
| Pretis, F. | 148 |
| Prucha, I. R. | 290 |

Q

- Quandt, R. E. 208, 212
 Quinn, B. G. 64, 84

R

- Raciborski, R. 290
 Raftery, A. E. 339
 Rahmstorf, S. 193
 Ramanathan, R. 174
 Ramsey, J. B. 201
 Raschky, P. A. 284, 290, 307
 Restrepo, J. 95
 Rey, S. J. 303, 304
 Reyes, M. 124, 127
 Robinson, P. M. 349, 354
 Roodman, D. 280, 281
 Rööm, T. 344
 Rosen, H. S. 280, 281
 Rossi, B. 159, 160
 Rosso, R. 339
 Rothenberg, T. J. 119
 Rubin, D. B. 224
 Ruedy, R. 5
 Runkle, D. E. 239

S

- Saikkonen, P. 136, 214, 215
 Sandler, T. 284
 Sarafidis, V. 255
 Sargan, J. D. 131
 Sato, M. 5
 Schaffer, M. E. 23, 46, 49, 140
 Schmidt, P. 117
 Schreck, S. 152
 Schunck, R. 274, 275
 Schwartz, J. 17
 Schwarz, G. 64, 84
 Seber, G. A. F. 217
 Sekhposyan, T. 160
 Shaw, W. 152
 Shi, S. 87
 Shin, Y. 117
 Short, K. 284
 Silvennoinen, A. 143, 251
 Sims, C. A. 77, 89

- Skalin, J. 195
 Smith, K. R. 17
 Smith, R. 131
 Sosvilla-Rivero, S. 129
 Soupre, M. 160
 Sowell, F. 352
 Srba, F. 131
 Stavins, R. N. 257
 Stephenson, D. B. 339
 Stern, D. I. 101
 Stillman, S. 46, 49
 Stock, J. H. 119, 136
 Swanson, N. R. 87

T

- Tai, A. P. K. 17
 Taquq, M. S. 339
 Taylor, A. M. R. 120, 127
 Teräsvirta, T. 201, 213, 214, 217, 219,
 220, 226, 251
 Theil, H. 159
 Thiele, S. 251
 Thoma, M. A. 87
 Thorp, S. 143
 Tobin, J. 332
 Tong, H. 208, 211, 213, 215
 Tremayne, A. R. 208
 Trivedi, P. K. 43, 309
 Tse, Y. K. 248
 Tsui, A. K. C. 248

U

- Ujhelyi, G. 337

V

- Varkey, D. 284
 Ventosa-Santaularia, D. 191, 193, 340,
 355, 358
 Vijverberg, W. P. M. 284
 Vogelsang, T. J. 121, 123
 Volterra, V. 208
 Vuong, Q. H. 53

W

Wagner, M.....147, 148
Wald, A. 77
Wansbeek, T.....255
Watson, M. W..... 136
Watts, D. G.....212, 217
Weisberg, S. 21
West, K. D.....28
White, H. 22, 27, 203
White, W. B.....198
Whittle, P. 294, 351
Wiener, N. 208
Wiggins, V.....347, 349
Wild, C. J. 217
Wooldridge, J. M.....15, 274

Y

Yeo, S. 131
Yu, J. 231

Z

Zakoïan, J.-M..... 239
Zellner, A. 81, 102
Zerbini, A. 310
Zignago, S. 289