

# Author index

## A

Amisano, G. .... 371

## B

Bartlett, M. S. .... 232

Bollerslev, T. .... 280, 286

Box, G. E. P. ... 71, 209, 230, 254, 263,  
330

## C

Chou, R. Y. .... 286

Cleves, M. .... 143

## D

Diaconis, P. .... xxv

Dickey, D. A. .... 382

## E

Ehrenberg, A. S. C. .... xxv

Elliott, G. .... 384

Engle, R. F. .... 277, 281, 296, 390

## F

Freese, J. .... 143

Fuller, W. A. .... 382

## G

Giannini, C. .... 371

Gould, W. .... 143

Granger, C. W. J. ... 122, 128, 218, 388,  
390

Greene, W. H. .... 78

Griffiths, W. E. .... 71

Gutierrez, R. G. .... 143

## H

Hamilton, J. D. .... 71, 209, 210, 230,  
259, 263, 285, 287, 293, 309,  
376, 380, 427

Hendry, D. F. .... 227

Hildreth, C. .... 187

Hill, R. C. .... 71

Holt, C. C. .... 131

## J

Jenkins, G. M. ... 71, 209, 230, 254, 263,  
330

Johansen, S. .... 400, 401, 405

Judge, G. G. .... 71

## K

Kroner, K. F. .... 286

## L

Lütkepohl, H. .... 71, 307, 343, 400

Lee, T.-C. .... 71

Lilien, D. M. .... 296

Long, J. S. .... 143

Lu, J. Y. .... 187

Lucas, Jr., R. E. .... 356

## M

Marchenko, Y. V. .... 143

Mitchell, M. N. .... 38, 319

## N

Nelson, D. B. .... 293

Newbold, P. .... 218, 388

## P

Perron, P. .... 385

Phillips, P. C. B. .... 385

## R

Reinsel, G. C. .... 71

Robins, R. P. .... 296

Rothenberg, T. J. .... 384

**S**

- Sargent, T. J. .... 339  
Shaman, P. .... 184  
Sims, C. A. .... 302, 339, 340, 356  
Stine, R. A. .... 184  
Stock, J. H. .... 71, 303, 304, 306, 307,  
313, 328, 338, 363, 364, 384,  
428

**T**

- Tufte, E. R. .... 425  
Tukey, J. W. .... 86, 100, 118

**W**

- Wainer, H. .... xxv  
Watson, M. W. .... 71, 303, 304, 306, 307,  
313, 328, 338, 363, 364, 428  
Winters, P. R. .... 131