

## *Author Index*

- Abbott, M. 42, 45, 53, 60, 65, 66  
Adcock, R. J. xxviii  
Allen, R. C. xxix, 512  
Amemiya, T. 439, 467  
Anderson, R. G. 550, 551, 552, 555  
Anderson, T. W. 212, 330  
Arrow, K. J. 321, 510, 550  
Ash, R. B. 471  
Ashenfelter, O. 42, 45, 53, 60, 65, 66  
Ashley, R. A. 506, 561, 563, 564, 576, 577, 591, 602, 614  
Atkinson, S. E. 289, 291, 292, 295  
Bahadur, R. R. 457  
Baltensperger, E. 354  
Banker, R. D. 294  
Bard, Y. 450  
Barnett, W. A. xxii, 9, 12, 20, 21, 22, 24, 25, 36, 41, 43, 44, 45, 47, 48, 50, 53, 57, 59, 60, 65, 66, 67, 68, 75, 79, 80, 82, 83, 84, 85, 89, 94, 95, 96, 99, 100, 101, 102, 103, 106, 109, 111, 112, 113, 114, 115, 116, 117, 118, 122, 123, 127, 135, 136, 137, 138, 141, 143, 144, 145, 146, 148, 149, 151, 153, 154, 155, 159, 160, 163, 165, 166, 167, 168, 169, 170, 171, 176, 183, 184, 187, 188, 190, 191, 192, 193, 194, 195, 196, 203, 204, 205, 206, 207, 216, 224, 225, 226, 233, 243, 246, 257, 258, 265, 267, 271, 272, 284, 285, 286, 289, 293, 294, 295, 303, 305, 306, 307, 308, 309, 310, 311, 312, 313, 314, 316, 317, 331, 337, 341, 351, 352, 353, 356, 357, 358, 362, 366, 372, 373, 375, 381, 382, 383, 384, 385, 387, 390, 394, 395, 396, 397, 405, 408, 412, 420, 425, 426, 429, 430, 431, 433, 436, 438, 439, 442, 449, 457, 458, 459, 460, 461, 462, 463, 464, 467, 472, 473, 487, 488, 508, 509, 510, 511, 512, 513, 514, 515, 527, 529, 530, 531, 532, 533, 535, 536, 540, 541, 549, 550, 551, 552, 553, 555, 559, 563, 569, 570, 571, 577, 581, 583, 586, 589, 596, 598, 599  
Bartelsman, E. J. xxvii  
Barten, A. P. 28, 50, 258, 373  
Basmann, R. L. 114  
Bell, F. W. 355  
Belongia, M. T. 362  
Benhabib, J. 488  
Ben-Mizrachi, A. 499, 500, 502, 504, 523  
Bennettin, G. 504  
Benston, G. J. 355, 368, 371  
Berge, C. 163, 316  
Berger, A. N. 355  
Berger, J. O. 208, 327, 368  
Berndt, E. R. 37, 48, 70, 96, 137, 263, 321, 360, 362, 450, 512, 515  
Betancourt, R. R. 45  
Bickel, P. J. 460, 589  
Bierens, H. 597  
Billingsley, P. 471  
Binner, J. M. xxxiii, 3, 299, 447, 485  
Birbaum, Z. W. 472  
Blackorby, C. xxii, 35, 80, 112, 142, 160, 167, 171, 190, 195, 235, 258, 259, 260, 261, 268, 284, 285, 309, 360, 362, 363, 365, 373, 384, 394, 396, 397, 458  
Blatt, J. M. 493  
Bliss, C. J. xxi  
Bowden, R. 468  
Bowman, K. O. 470  
Box, G. E. P. 572

- Boyce, R. 458  
 Brainard, W. 383  
 Bramble, W. J. 363  
 Brandstater, A. 500, 502  
 Brillinger, D. R. 559, 561  
 Brock, W. 488, 504, 531, 532, 534, 536, 550,  
     563, 570, 572, 586, 587, 592, 593  
 Brockwell, P. 563  
 Brooks, R. B. 28  
 Broomhead, D. S. 595  
 Brown, M. 6, 82, 114, 294  
 Brown, R. S. 360, 364, 515  
 Buck, R. C. 27, 252  
 Bühlmann, P. 589  
 Bunow, B. 488, 492  
 Burgess, D. F. 363  
 Byron, R. P. 258  
 Casdagli, M. 595  
 Caves, D. W. 79, 81, 86, 89, 91, 101, 112,  
     133, 142, 146, 167, 170, 190, 194, 258,  
     289, 291, 292, 295, 308, 314, 360, 364,  
     381, 512, 515  
 Chalfant, J. A. 167, 190, 309, 362  
 Charnes, A. 294  
 Chen, P. 487, 488, 530, 531, 536, 540, 541,  
     550, 569, 577, 583  
 Chipman, J. S. 20  
 Choi, S. 257, 305, 362, 488, 571  
 Christensen L. R. xxii, 10, 36, 37, 44, 45, 76,  
     78, 79, 81, 86, 89, 91, 101, 112, 122, 133,  
     142, 146, 167, 170, 190, 194, 258, 263,  
     289, 291, 292, 295, 308, 314, 360, 362,  
     364, 371, 512, 515  
 Christiano, L. J. 555  
 Chrystal, K. A. 553  
 Chung, K. L. 470, 471  
 Clark J. A. 355  
 Collet, P. 488  
 Cooper, W. W. 294  
 Crutchfield, J. P. 504  
 Daiaí, A. 268  
 Dalle Molle, J. W. 588  
 Darrough, M. N. 37, 45, 48, 59, 70  
 Davidson, R. xxv, xxvi, xxvii, xxviii  
 Davis, R. 563  
 Day, R. H. 488, 490, 530, 613  
 Deaton, A. 28, 34, 37, 96, 137, 293, 294  
 Debreu, G. xxi, 21, 166, 189, 392, 393  
 Dechert, W. D. 504, 531, 532, 534, 563, 570,  
     572, 586, 587, 588, 592  
 DeCoster, G. P. 530, 569, 583  
 Delong, J. 493  
 Denny, M. 235, 265, 268, 360, 362, 363, 396,  
     510, 515  
 Dhrymes, P. J. 464  
 Diamond, D. W. 383  
 Diewert, W. E. xxii, xxiii, xxix, xxxv, 21, 37,  
     45, 48, 70, 76, 82, 84, 95, 96, 101, 102,  
     103, 114, 115, 117, 135, 137, 139, 167,  
     171, 190, 195, 204, 259, 261, 263, 299,  
     300, 304, 309, 363, 364, 371, 382, 384,  
     387, 396, 397, 398, 399, 400, 403, 509,  
     512, 551, 552  
 Driscoll, J. C. 384, 395, 412, 531  
 Duffie, D. 392  
 Dufour, J. M. 207, 306  
 Dugundji, J. 474  
 Dybvig, P. H. 383  
 Eastwood, B. J. 191, 194, 309, 313, 488,  
     595  
 Eisenberg, E. 20  
 Eisenpress, H. 235  
 Ellner, S. 531, 537, 587, 595, 596, 608  
 Engle, R. 553, 563  
 Enochson, L. 506  
 Epstein, L. 335  
 Eubank, S. 595  
 Ewis, N. A. 375  
 Fair, R. C. 53, 504  
 Farmer, J. D. 595  
 Fayyad, S. 508, 510, 515  
 Feigenbaum, M. J. 491  
 Feller, W. 471  
 Finke, R. 80  
 Fischer, S. 510  
 Fisher, D. 375, 550, 555  
 Fisher, F. M. 442, 443  
 Fisher, T. 171, 195, 259, 285, 353, 362, 363,  
     365, 373, 384, 394, 397  
 Flood, L. R. 80

- Fraser, A. 497  
 Fraumeni, B. M. 96, 363  
 Friedman, A. 474  
 Friedman, B. M. 555  
 Fuss, M. A. 268, 293, 360, 362, 396, 512  
 Gabr, M. 506, 561, 588  
 Galgani, L. 504  
 Gallant, A. R. 5, 6, 80, 96, 112, 137, 138, 142,  
 154, 155, 160, 167, 170, 181, 190, 191,  
 193, 194, 207, 258, 285, 294, 306, 307,  
 308, 309, 310, 311, 313, 314, 330, 331,  
 341, 396, 426, 439, 450, 458, 467, 529,  
 531, 532, 535, 537, 550, 553, 563, 581,  
 583, 585, 586, 587, 589, 595, 596, 598,  
 599, 608  
 Gencay, R. 531, 586, 588  
 Geweke, J. 183, 187, 188, 209, 210, 211, 212,  
 213, 224, 285, 303, 306, 328, 329, 330,  
 331, 332, 396, 433  
 Gibson, G. 505  
 Gibson, J. 595  
 Gilbert, A. R. 355  
 Gilligan, T. 355  
 Giorgilli, A. 504  
 Glass, L. 505  
 Godfrey, L. G. 556  
 Godfrey, M. D. 559  
 Goldberger A. S. 44  
 Goldfeld, S. M. 450, 456  
 Goldman, S. M. 46, 260, 360  
 Golub, G. H. xxviii, 6, 96, 154, 191, 194, 306,  
 307, 310, 311, 330, 331, 341, 396  
 Gorman, W. M. 20  
 Gourieroux, C. 181, 208, 306  
 Grandmont, J. M. 488, 490  
 Granger, C. W. J. 493, 553, 554, 563, 566,  
 590, 597, 598  
 Grassberger, P. 499, 500, 502, 504, 523  
 Green, H. A. J. 20, 21, 23, 46, 237, 258, 293,  
 361  
 Greenstadt, J. 235  
 Grossman, M. 44, 506  
 Groves, G. W. 562  
 Guckenheimer, J. 488, 490, 492, 493, 496,  
 497, 506  
 Guilkey, D. K. 80, 112, 142, 160,  
 167, 170, 190, 194, 258, 267,  
 286, 308, 314  
 Hahm, H. J. 351, 397, 405, 408, 412, 426  
 Hahn, F. H. 510, 550  
 Hall, B. H. 450  
 Hall, R. E. 363, 387, 439, 442, 450  
 Ham, J. C. 66  
 Hammersley, J. M. 209, 328  
 Hancock, D. 354, 355, 356, 358, 362, 363,  
 368, 375, 382, 383, 386, 405, 412, 426,  
 509, 513  
 Handscomb, D. C. 209, 328  
 Hannan, E. J. 562  
 Hansen, L. P. 384, 404  
 Hanweck, G. A. 355, 368, 371  
 Hao, B.-L. 488  
 Hartley, H. O. 456  
 Hasenkamp, G. 239  
 Hatanaka, M. 450  
 Hausman, J. A. 450  
 Hayes, K. 268, 269  
 Heckman, J. J. xxv, xxviii, 43  
 Heien, D. H. 6, 82, 114, 294  
 Helleman, R. 494  
 Henon, M. 505  
 Hillinger, C. 261  
 Hinich, M. J. 382, 383, 412, 420, 425,  
 426, 493, 506, 507, 510, 515, 529,  
 530, 531, 532, 533, 535, 540, 550,  
 553, 559, 560, 561, 562, 563, 564,  
 569, 570, 572, 574, 576, 577, 581,  
 583, 586, 588, 589, 590, 591, 596,  
 598, 599, 603  
 Hoa T. V. 62  
 Hofstadter, D. 488  
 Holly, A. 181, 207, 306, 467  
 Holmes, P. 488, 490, 492, 493, 496, 497, 506  
 Hong, Y. 563  
 Hoppensteadt, F. 488  
 Hsieh, D. A. 536, 593, 594, 606  
 Huke, J. P. 595  
 Hulten, C. R. 261  
 Humphrey, D. B. 80, 112, 142, 355, 368, 371  
 Hunter, W. C. 355

- Hyman, J. 488  
 Ingersoll, J. E. 390  
 Jeffries, C. 505  
 Jenkins, G. M. 572  
 Jennrich, R. I. 450, 453, 460  
 Jensen, M. J. 426, 529, 531, 532, 535, 550, 553, 581, 583, 586, 589, 596, 598, 599  
 Johansen, S. 486, 553, 554, 555, 556, 559  
 Jonas, A. 82, 100, 114, 136, 143, 155, 159, 168, 169, 191, 192, 196, 285, 294, 310, 312, 316  
 Jones, B. E. 95, 549, 550, 551, 552, 555, 556, 586, 589, 596  
 Jorgensen, C. 555  
 Jorgenson, D. W. 10, 36, 37, 76, 78, 85, 96, 268, 451  
 Joshi, V. M. 474  
 Jungeilges, J. A. 426, 529, 531, 532, 535, 538, 550, 553, 581, 583, 586, 589, 596, 597, 598, 599  
 Juselius, K. 486, 554  
 Kadiyala, K. R. 235, 265  
 Kalaba, R. 507  
 Kaplan, D. T. 426, 529, 531, 535, 581, 598, 599, 612, 613  
 Kaplan, J. 505, 532, 533, 540, 550, 553, 563, 583, 588, 589, 596  
 Katzner, D. W. 20, 46, 250, 252  
 Kay, S. M. 562  
 Keller, W. J. 239  
 Kendall, D. G. 474  
 Kendall, M. G. 456  
 Khaled M. S. 96, 137, 321, 515  
 Kiefer, N. M. 45, 48, 59, 239, 468  
 Kinderman, A. J. 584  
 King, M. 553  
 King, R. G. 549, 555  
 Kirova, M. 430, 431, 550  
 Klein, B. 371  
 Kloek, T. 209, 328  
 Kodde, D. A. 207, 306  
 Kongsted, H. C. 555  
 Koopmans, L. H. 562  
 Koopmans, T. C. 443, 450, 459, 467  
 Kopecky, K. J. 295, 467, 509  
 Kostelich, E. J. 504  
 Kuan, C. 597  
 Kuttner, K. N. 555  
 Kuznets, S. 59, 65  
 la Cour, L. F. 553  
 Laffont, J-J. 451  
 Lakonishok, J. 593  
 Lange, O. 250  
 Lau, L. J. 10, 36, 37, 76, 78, 85, 96, 138, 154, 268, 304, 307, 364, 365, 396, 400, 401, 403, 515  
 Lawrence, D. A. xxiii  
 LeBaron, B. 536, 563, 572, 586, 587, 592, 593, 594, 606  
 Lee, T-H. 556, 590  
 Lee, Y. W. 79, 100, 101, 109, 111, 114, 127, 135, 138, 141, 143, 144, 145, 146, 153, 167, 170, 171, 190, 194, 195, 258, 272, 284, 308, 309, 313, 314, 341, 363, 597, 598  
 Leipnik, R. B. 443, 459, 467  
 Leontief, W. W. 395  
 Lewbel, A. 167, 190, 309  
 Li, T-Y. 491  
 Lluch, C. 12  
 Loeve, M. 471  
 Lorenz, E. N. 488  
 Lovell, C. A. K. 80, 112, 142, 160, 167, 170, 190, 194, 258, 267, 286, 308, 314  
 Lucas, R. E. 493  
 MacDonald, R. 553  
 Mackey, M. C. 505  
 MacKinlay A. C. 404  
 Mackinnon, J. G. xxv, xxvi, xxvii, xxviii, 239  
 Madanski, A. xxviii  
 Magill, M. 392  
 Maindiratta, A. 294  
 Malinvaud, E. 24, 450, 451, 452, 453, 454, 455, 460, 461, 463, 464  
 Mandelbrot, B. 494  
 Manser, M. E. 10, 80, 112, 142, 294  
 Mantel, R. R. 21  
 Maravall, A. 493, 506  
 Marple Jr, S. L. 562  
 Marshall, W. 355

- MasColell, A. 21  
 Massey, F. J. 472  
 Matheron, G. 474  
 Matsumoto, K. 504  
 May, K. xxi  
 May, R. M. 488  
 McCaffrey, D. F. 531, 537, 585, 587, 595, 596, 608  
 McFadden, D. 21, 33, 168, 190, 192, 309, 311, 363, 397  
 Mendel, J. M. 559  
 Messer, G. R. 559, 560, 562  
 Michael, E. 474  
 Mitchell, D. W. 530, 569, 583  
 Miyao, R. 555  
 Molina, D. J. 114  
 Monahan, J. F. 181, 207  
 Monfort, A. 181, 207, 306  
 Moroney, J. R. 80, 112, 142  
 Mossin, A. 18  
 Mountain, D. C. 271, 472  
 Muldoon, M. R. 595  
 Muellbauer, J. 21, 48, 96, 137, 293, 294  
 Müller, P. 334  
 Mullineaux, D. J. 368  
 Mundlak, Y. 239  
 Murphy, N. B. 355  
 Murray, J. D. 355  
 Neftci, S. N. 493  
 Nesmith, T. D. 549, 550, 551, 552, 555, 586, 589, 596  
 Newbold, P. 493  
 Newey, W. K. 404  
 Nicholis, C. 488, 506  
 Nicholis, G. 488, 506  
 Nikias, C. L. 558, 560, 561, 563  
 Nissen, D. 458  
 Nychka, D. W. 531, 537, 585, 587, 595, 596, 608  
 Offenbacher, E. K. 467, 509, 553  
 Oseledec, V. 504  
 Oster, G. F. 488  
 Otnes, R. K. 506  
 Ott, E. 492, 496  
 Owen, J. D. 44, 45  
 Palm, F. C. 207, 306  
 Parkan, C. xxii  
 Parks, R. W. 70, 71  
 Parulo, P. 554, 555  
 Pasupathy, M. 430, 431, 550  
 Patterson, D. 493, 506, 507, 550, 559, 561, 563, 564, 572, 576, 577, 591, 602, 614  
 Paulus, J. D. 25, 28  
 Pearce, I. F. 250, 252  
 Philips, L. 36  
 Phillips, P. C. B. 456  
 Philips, L. 10, 12, 20, 45, 293, 510  
 Pinto, C. 360, 362, 363, 510, 515  
 Plosser, C. I. 555  
 Pollak, R. A. 238, 435  
 Poterba, J. M. 382, 384, 395, 412, 531, 577  
 Powell, A. A. 62  
 Priestley, M. 559, 572  
 Prigogine, I. 487, 495  
 Primont, D. 35, 80, 112, 142, 160, 235, 258, 260, 268, 284, 285, 360, 362, 396  
 Procaccia, I. 499, 500, 502, 504, 523  
 Pu, S. S. xxi  
 Quandt, R. E. 450, 456  
 Raghuv eer, M. R. 558, 560, 561, 563  
 Rahbek, A. 555  
 Ramage, J. G. 584  
 Ramsey, J. B. 569, 571, 583  
 Rao, C. R. xxvii, 17, 453, 457, 464, 465, 468, 470, 471, 588  
 Rao, S. T. 506, 561  
 Razin, A. 239  
 Revankar, N. S. 294  
 Richard, J. F. 183  
 Richardson, M. 404  
 Richter, M. K. 21, 261  
 Robles, B. J. 382  
 Rogosinski, W. 474  
 Rosenblatt, M. 559, 561  
 Rossi, P. E. 198  
 Rossler, O. E. 505  
 Rotemberg, J. J. 382, 384, 395, 412, 531, 540, 577  
 Rothenberg, T. J. 457, 468  
 Rothman, P. 561, 569, 571, 583

- Rubin, H. 443, 459, 467  
 Rudin, W. 161, 169, 191, 310  
 Ruelle, D. 491, 595  
 Russell, R. R. 35, 80, 112, 142, 160, 235, 258,  
 260, 261, 268, 284, 285, 360, 362, 396,  
 458  
 Sakai, H. 492  
 Salmon, M. 468  
 Samuelson, P. A. 250, 510  
 Santomero, A. M. 353, 354  
 Sargent, T. J. 388, 389  
 Sato, R. 267, 295, 509, 510  
 Sayers, C. L. 550, 569, 571, 583  
 Scheinkman, J. 532, 534, 563, 572, 586,  
 587, 592  
 Schinnar, A. 294  
 Schmetterer, L. 457  
 Schmidt, W. H. 363  
 Schuster, H. G. 488  
 Schwarz, G. 595  
 Schworm, W. 171, 195, 259, 285, 362, 363,  
 365, 373, 384, 394, 397  
 Selvanathan, E. A. 472  
 Serletis, A. xxii, 258, 353, 362, 366, 426, 510,  
 550, 552, 553, 555, 583  
 Shafer, W. 392  
 Shaw, R. 503, 506  
 Shenton, L. R. 470  
 Shephard, R. W. 360  
 Sickles, R. C. 80, 112, 142, 167, 170, 190,  
 194, 258, 267, 286, 308, 314  
 Silvey, S. D. 452  
 Sims, C. A. 211, 305  
 Singleton, K. J. 384, 404  
 Slotte, D. J. 114  
 Smirlock, M. 355  
 Smith, R. L. 594  
 Solari, L. 235, 236, 238  
 Sonneborn-Schmick, B. 506  
 Sonnenschein, H. 21, 23, 48, 166, 189  
 Spindt, P. A. 467, 509, 553  
 Spinnewyn, F. 510  
 Starrett, D. 321  
 Steel, M. F. J. 183  
 Stein, C. 474  
 Stengers, I. 495  
 Stock, J. H. 555  
 Stoker, T. 85  
 Stokes, H. 559, 562  
 Strelcyn, J. M. 504  
 Stuart, A. 456  
 Stutzer, M. 488  
 Summers, L. 493  
 Swift, J. 500, 502, 504  
 Swinney, H. 497, 500, 504  
 Swofford, J. L. 396  
 Taggart, Jr., R. A. 355  
 Takens, F. 491, 496, 497, 498, 503  
 Terrell, M. 334  
 Testfatsion, L. 507  
 Theil, H. 12, 13, 14, 15, 25, 27, 28, 37, 38, 44,  
 47, 49, 53, 56, 65, 68, 70, 78, 80, 103, 272,  
 468, 472, 552  
 Thornton, D. L. 384, 555  
 Timme S. G. 355  
 Tobin, J. 383  
 Tokumaru, H. 492  
 Trapani, M. J. 80, 112, 142  
 Tse, Y. 556  
 Tsuda, I. 504  
 Tucker, H. G. 470, 471  
 Uzawa, H. 46, 112, 113, 141, 188, 260, 262,  
 308, 360  
 van Dijk, H. K. 209, 328  
 Van Huffel, S. xxviii  
 Van Loan, C. F. xxviii  
 Vandewalle, J. xxviii  
 Varian, H. R. 259, 365  
 Vastano, J. 504  
 Wachter, M. L. 435  
 Walden, A. T. 588, 602  
 Wales, T. J. xxii, xxiii, xxxv, 36, 80, 82, 84,  
 95, 112, 114, 117, 135, 142, 160, 167, 170,  
 171, 190, 195, 238, 258, 259, 294, 304,  
 308, 309, 314, 363, 396, 397, 398, 399,  
 400, 403  
 Wallace, D. L. 474  
 Watson, M. W. 549, 555, 564  
 Watts, D. 572

- Weber, W. E. 382, 383, 412, 420, 425,  
510, 515  
Weiss, G. H. 488, 492  
Weiss, L. 464  
Welch, P. D. 562  
West, K. D. 404  
White, H. 167, 170, 190, 194, 308, 314, 537,  
538, 590, 596, 597, 598  
White, R. W. 355  
Whitney, G. A. 362, 396  
Wiley, D. E. 363  
Williams, M. L. 588, 602  
Willig, R. D. 33  
Wilson, G. R. 550  
Wilson, R. H. 62  
Wolak, F. A. 207, 306  
Wolf, A. 500, 502, 504  
Wolfe, M. D. 100, 101, 109, 111, 138, 141,  
143, 144, 145, 146, 153, 167, 170, 171,  
190, 194, 195, 258, 272, 284,  
303, 306, 308, 309, 313, 314, 341,  
396, 433  
Wolfowitz, J. 457  
Wolpert, R. L. 208, 327  
Wonnacott, R. J. 377  
Wonnacott, T. H. 377  
Woodland, A. D. 258, 362, 363  
Xu, H. 426, 553, 555  
Yatchew, A. 335  
Yorke, J. A. 491, 505  
Yoshihara, K. 10, 33, 293  
Yue, P. 165, 168, 169, 170, 171, 187, 192,  
193, 195, 196, 203, 205, 206, 207, 216,  
224, 225, 285, 306, 307, 311, 312, 313,  
314, 337, 382, 384, 555, 570, 577  
Zacks, S. 457, 477  
Zellner, A. 291, 294  
Zhou, G. 387