

Supplement to

A frequency domain wild bootstrap for dependent data

James Davidson and Rami Chehab

The tables show warp-speed Monte Carlo estimates with 50,000 replications. See Section 4 of the paper for details of models and test procedures. The columns of the tables show the alternative autocorrelation schemes, the rows show alternative shock distributions and sample sizes. The Cramér-von Mises statistics compare the p -value distribution of the test statistics with the uniform distribution.

Regression model with two regressors, t statistics computed with HAC variances.

Pages 2-7: Rejection rates under H_0 in nominal 5% test.

Pages 8-13: Powers in true 5% tests under H_A : $\beta_i = 3/\sqrt{n}$, $i = 0, 1, 2$

Pages 14-19: Cramér-von Mises statistics.

Page 20. Empirical variances of series means, sample vs. AFB bootstrap

ADF test of unit root, lag lengths chosen by Akaike criterion.

Pages 21-22: Rejection rates under H_0 in nominal 5% test.

Pages 23-24: Powers in true 5% tests under H_A : series $I(0)$ or $I(d)$.

Pages 25-26: Cramér-von Mises statistics.

Regression Model: 5% Test Size

Augmented Fourier Bootstrap

		Indep.	AR (Rho)			MA (lag)			Frac (d)	
	Sample		0.3	0.6	0.9	1	2	4	0.1	0.3
<i>Normal</i>										
Int.	50	0.052	0.062	0.057	0.079	0.014	0.059	0.122	0.110	0.271
	200	0.048	0.058	0.051	0.073	0.022	0.068	0.099	0.164	0.383
	800	0.049	0.056	0.049	0.056	0.031	0.064	0.078	0.188	0.474
X1	50	0.051	0.048	0.050	0.049	0.051	0.043	0.057	0.046	0.046
	200	0.049	0.051	0.047	0.049	0.051	0.048	0.050	0.049	0.050
	800	0.052	0.049	0.052	0.050	0.050	0.051	0.048	0.050	0.049
X2	50	0.050	0.056	0.052	0.059	0.055	0.054	0.058	0.049	0.056
	200	0.052	0.053	0.050	0.052	0.053	0.062	0.056	0.054	0.049
	800	0.053	0.051	0.047	0.050	0.052	0.058	0.051	0.048	0.051
<i>t(3)</i>										
Int.	50	0.041	0.053	0.052	0.095	0.042	0.076	0.130	0.098	0.302
	200	0.046	0.053	0.053	0.081	0.042	0.078	0.101	0.162	0.408
	800	0.046	0.053	0.048	0.058	0.044	0.069	0.083	0.195	0.484
X1	50	0.048	0.044	0.042	0.048	0.047	0.037	0.051	0.0426	0.0407
	200	0.050	0.049	0.046	0.048	0.047	0.045	0.047	0.047	0.048
	800	0.051	0.049	0.047	0.048	0.050	0.047	0.046	0.049	0.049
X2	50	0.047	0.051	0.048	0.056	0.044	0.052	0.057	0.047	0.053
	200	0.048	0.047	0.048	0.051	0.048	0.055	0.051	0.049	0.047
	800	0.049	0.049	0.048	0.049	0.049	0.053	0.052	0.048	0.048

Regression Model: 5% Test Size

Residual TFT Bootstrap		Indep.	AR (Rho)			MA (lag)			Frac (d)	
			0.3	0.6	0.9	1	2	4	0.1	0.3
Sample										
<i>Normal</i>										
Int.	50	0.134	0.161	0.215	0.454	0.140	0.176	0.237	0.226	0.435
	200	0.161	0.171	0.192	0.331	0.148	0.162	0.211	0.309	0.560
	800	0.167	0.166	0.167	0.258	0.150	0.152	0.156	0.351	0.614
X1	50	0.052	0.049	0.043	0.039	0.046	0.042	0.056	0.050	0.044
	200	0.051	0.051	0.051	0.053	0.049	0.048	0.049	0.049	0.050
	800	0.048	0.051	0.053	0.052	0.053	0.053	0.052	0.049	0.053
X2	50	0.052	0.053	0.063	0.071	0.057	0.057	0.061	0.054	0.054
	200	0.049	0.055	0.056	0.056	0.051	0.057	0.054	0.052	0.056
	800	0.047	0.052	0.052	0.052	0.052	0.052	0.053	0.050	0.047
<i>t(3)</i>										
Int.	50	0.135	0.163	0.225	0.472	0.135	0.183	0.240	0.235	0.444
	200	0.159	0.177	0.197	0.343	0.155	0.163	0.211	0.310	0.563
	800	0.167	0.168	0.169	0.254	0.159	0.153	0.159	0.355	0.622
X1	50	0.042	0.041	0.039	0.038	0.042	0.034	0.050	0.0382	0.0357
	200	0.045	0.046	0.047	0.049	0.046	0.045	0.043	0.046	0.047
	800	0.047	0.048	0.050	0.049	0.047	0.046	0.046	0.048	0.053
X2	50	0.043	0.045	0.054	0.066	0.046	0.050	0.053	0.045	0.049
	200	0.044	0.049	0.048	0.050	0.048	0.052	0.049	0.048	0.054
	800	0.048	0.050	0.049	0.050	0.049	0.050	0.052	0.048	0.051

Regression Model: 5% Test Size

Hidalgo 1 Bootstrap

		Indep.	AR (Rho)			MA (lag)			Frac (d)	
Sample			0.3	0.6	0.9	1	2	4	0.1	0.3
<i>Normal</i>										
X1	50	0.052	0.049	0.049	0.047	0.051	0.051	0.052	0.051	0.052
	200	0.050	0.047	0.050	0.049	0.051	0.051	0.052	0.049	0.048
	800	0.050	0.048	0.050	0.052	0.050	0.049	0.051	0.051	0.050
X2	50	0.054	0.058	0.058	0.058	0.054	0.057	0.053	0.056	0.053
	200	0.052	0.052	0.051	0.050	0.049	0.051	0.047	0.050	0.048
	800	0.051	0.051	0.047	0.049	0.052	0.050	0.051	0.049	0.049
<i>t(3)</i>										
X1	50	0.052	0.049	0.049	0.047	0.051	0.055	0.051	0.052	0.052
	200	0.050	0.047	0.050	0.049	0.054	0.050	0.050	0.051	0.049
	800	0.050	0.048	0.050	0.052	0.050	0.050	0.050	0.047	0.049
X2	50	0.054	0.058	0.058	0.058	0.056	0.053	0.053	0.056	0.054
	200	0.052	0.052	0.051	0.050	0.050	0.050	0.050	0.050	0.051
	800	0.051	0.051	0.047	0.049	0.051	0.051	0.049	0.051	0.048

Regression Model: 5% Test Size

		Moving Blocks Bootstrap Indep.	AR (Rho)			MA (lag)			Frac (d)	
			0.3	0.6	0.9	1	2	4	0.1	0.3
Sample										
<i>Normal</i>										
Int.	50	0.048	0.059	0.088	0.280	0.050	0.085	0.142	0.105	0.276
	200	0.053	0.055	0.065	0.182	0.052	0.080	0.108	0.157	0.387
	800	0.047	0.052	0.052	0.109	0.052	0.072	0.080	0.185	0.466
X1	50	0.050	0.045	0.045	0.046	0.047	0.038	0.055	0.049	0.043
	200	0.049	0.048	0.053	0.055	0.052	0.050	0.048	0.050	0.048
	800	0.051	0.051	0.050	0.049	0.047	0.050	0.046	0.051	0.049
X2	50	0.050	0.054	0.058	0.069	0.052	0.051	0.060	0.051	0.056
	200	0.051	0.051	0.053	0.054	0.051	0.059	0.053	0.052	0.056
	800	0.049	0.050	0.051	0.050	0.052	0.057	0.052	0.054	0.052
<i>t(3)</i>										
Int.	50	0.039	0.050	0.073	0.279	0.039	0.079	0.131	0.096	0.267
	200	0.044	0.049	0.060	0.181	0.045	0.076	0.100	0.154	0.384
	800	0.047	0.047	0.050	0.107	0.047	0.068	0.086	0.187	0.464
X1	50	0.050	0.042	0.042	0.047	0.042	0.039	0.052	0.0437	0.0408
	200	0.051	0.050	0.048	0.050	0.049	0.046	0.048	0.048	0.051
	800	0.048	0.051	0.050	0.050	0.048	0.046	0.048	0.049	0.051
X2	50	0.051	0.053	0.055	0.068	0.547	0.511	0.583	0.049	0.057
	200	0.049	0.050	0.054	0.052	0.609	0.602	0.598	0.052	0.053
	800	0.052	0.049	0.047	0.050	0.596	0.579	0.585	0.051	0.049

Regression Model: 5% Test Size

Sieve AR Bootstrap

		Indep.	AR (Rho)			MA (lag)			Frac (d)	
Sample	0.3		0.6	0.9	1	2	4	0.1	0.3	
<i>Normal</i>										
Int.	50	0.050	0.052	0.063	0.134	0.030	0.083	0.134	0.096	0.251
	200	0.048	0.050	0.052	0.061	0.068	0.042	0.109	0.149	0.367
	800	0.047	0.050	0.048	0.051	0.060	0.060	0.070	0.192	0.455
X1	50	0.047	0.050	0.048	0.047	0.049	0.037	0.053	0.044	0.044
	200	0.048	0.047	0.049	0.048	0.047	0.048	0.048	0.050	0.048
	800	0.051	0.049	0.050	0.052	0.049	0.049	0.051	0.050	0.046
X2	50	0.048	0.052	0.052	0.057	0.050	0.057	0.059	0.051	0.052
	200	0.050	0.050	0.050	0.050	0.050	0.053	0.056	0.053	0.049
	800	0.049	0.052	0.048	0.052	0.049	0.052	0.051	0.048	0.052
<i>t(3)</i>										
Int.	50	0.040	0.044	0.052	0.133	0.025	0.076	0.122	0.084	0.247
	200	0.045	0.044	0.046	0.059	0.062	0.044	0.107	0.144	0.366
	800	0.049	0.046	0.045	0.051	0.059	0.061	0.077	0.182	0.452
X1	50	0.047	0.043	0.045	0.050	0.043	0.033	0.050	0.04204	0.04008
	200	0.049	0.048	0.049	0.048	0.043	0.043	0.047	0.046	0.050
	800	0.049	0.048	0.050	0.048	0.048	0.047	0.046	0.049	0.048
X2	50	0.049	0.048	0.050	0.059	0.042	0.053	0.058	0.049	0.053
	200	0.049	0.048	0.049	0.050	0.048	0.053	0.051	0.052	0.051
	800	0.050	0.052	0.048	0.050	0.049	0.053	0.052	0.052	0.048

Regression Model: 5% Test Size

Asymptotic test		Indep.	AR (Rho)			MA (lag)			Frac (d)	
			0.3	0.6	0.9	1	2	4	0.1	0.3
<i>Normal</i>										
Int.	50	0.088	0.122	0.199	0.474	0.120	0.148	0.205	0.170	0.383
	200	0.061	0.084	0.124	0.285	0.081	0.102	0.125	0.184	0.469
	800	0.052	0.072	0.084	0.159	0.068	0.078	0.091	0.219	0.526
X1	50	0.096	0.090	0.083	0.080	0.090	0.083	0.102	0.093	0.085
	200	0.063	0.060	0.060	0.064	0.059	0.059	0.060	0.059	0.060
	800	0.054	0.051	0.055	0.056	0.054	0.052	0.052	0.054	0.057
X2	50	0.102	0.119	0.134	0.162	0.122	0.113	0.115	0.106	0.122
	200	0.064	0.076	0.087	0.098	0.078	0.076	0.065	0.068	0.082
	800	0.055	0.062	0.065	0.069	0.064	0.063	0.060	0.058	0.063
<i>t(3)</i>										
Int.	50	0.083	0.117	0.197	0.486	0.116	0.146	0.204	0.168	0.397
	200	0.056	0.085	0.127	0.291	0.080	0.101	0.121	0.185	0.476
	800	0.053	0.071	0.083	0.158	0.067	0.080	0.090	0.223	0.531
X1	50	0.087	0.081	0.074	0.077	0.078	0.076	0.095	0.0823	0.0764
	200	0.057	0.053	0.057	0.062	0.056	0.053	0.056	0.057	0.057
	800	0.053	0.051	0.052	0.055	0.051	0.050	0.051	0.052	0.053
X2	50	0.093	0.108	0.128	0.163	0.113	0.104	0.109	0.097	0.115
	200	0.060	0.070	0.083	0.094	0.074	0.072	0.065	0.065	0.077
	800	0.052	0.059	0.063	0.066	0.061	0.060	0.054	0.057	0.064

Regression Model: Powers vs alternatives $3/\sqrt{n}$.

Augmented Fourier Bootstrap

		Indep.	AR (Rho)			MA (lag)			Frac (d)	
Sample			0.3	0.6	0.9	1	2	4	0.1	0.3
<i>Normal</i>										
Int.	50	0.753	0.566	0.235	0.140	0.034	0.318	0.597	0.755	0.722
	200	0.825	0.585	0.216	0.114	0.110	0.407	0.534	0.800	0.758
	800	0.842	0.581	0.214	0.075	0.186	0.390	0.457	0.768	0.811
X1	50	0.736	0.722	0.639	0.428	0.492	0.415	0.496	0.707	0.695
	200	0.827	0.806	0.665	0.322	0.559	0.535	0.539	0.814	0.765
	800	0.847	0.818	0.668	0.269	0.561	0.557	0.545	0.837	0.760
X2	50	0.793	0.718	0.523	0.255	0.453	0.511	0.573	0.771	0.694
	200	0.904	0.785	0.525	0.184	0.506	0.631	0.660	0.876	0.692
	800	0.923	0.803	0.513	0.158	0.518	0.627	0.661	0.877	0.680
<i>t(3)</i>										
Int.	50	0.759	0.605	0.275	0.201	0.285	0.496	0.670	0.789	0.780
	200	0.832	0.603	0.255	0.138	0.290	0.489	0.577	0.814	0.790
	800	0.840	0.587	0.225	0.079	0.289	0.439	0.496	0.788	0.824
X1	50	0.817	0.777	0.707	0.464	0.588	0.514	0.574	0.790	0.759
	200	0.858	0.823	0.700	0.338	0.601	0.585	0.593	0.843	0.801
	800	0.854	0.819	0.690	0.286	0.599	0.571	0.575	0.847	0.783
X2	50	0.860	0.781	0.586	0.289	0.495	0.612	0.667	0.835	0.765
	200	0.918	0.806	0.568	0.184	0.539	0.670	0.696	0.890	0.722
	800	0.933	0.817	0.562	0.165	0.540	0.638	0.695	0.888	0.694

Regression Model: Powers vs alternatives $3/\sqrt{n}$.

Residual TFT		Bootstrap	AR (Rho)			MA (lag)			Frac (d)	
Sample		Indep.	0.3	0.6	0.9	1	2	4	0.1	0.3
<i>Normal</i>										
Int.	50	0.954	0.857	0.709	0.840	0.644	0.730	0.821	0.911	0.866
	200	0.975	0.872	0.655	0.705	0.678	0.709	0.799	0.913	0.897
	800	0.976	0.868	0.606	0.551	0.688	0.688	0.707	0.900	0.910
X1	50	0.741	0.707	0.582	0.331	0.453	0.428	0.510	0.732	0.679
	200	0.824	0.791	0.662	0.329	0.541	0.527	0.529	0.817	0.769
	800	0.835	0.809	0.667	0.279	0.568	0.571	0.557	0.836	0.779
X2	50	0.814	0.694	0.539	0.325	0.443	0.542	0.600	0.786	0.690
	200	0.902	0.794	0.543	0.197	0.494	0.600	0.656	0.870	0.716
	800	0.918	0.811	0.529	0.162	0.504	0.594	0.668	0.886	0.665
<i>t(3)</i>										
Int.	50	0.954	0.879	0.747	0.856	0.688	0.778	0.842	0.925	0.882
	200	0.972	0.883	0.681	0.721	0.714	0.733	0.812	0.919	0.899
	800	0.976	0.875	0.621	0.556	0.705	0.703	0.723	0.902	0.915
X1	50	0.780	0.761	0.663	0.397	0.535	0.474	0.556	0.767	0.730
	200	0.839	0.823	0.699	0.351	0.599	0.583	0.559	0.840	0.790
	800	0.851	0.821	0.698	0.301	0.576	0.577	0.565	0.846	0.792
X2	50	0.834	0.752	0.604	0.366	0.513	0.607	0.652	0.819	0.754
	200	0.902	0.808	0.566	0.206	0.555	0.651	0.685	0.874	0.754
	800	0.925	0.819	0.553	0.171	0.540	0.616	0.689	0.887	0.701

Regression Model: Powers vs alternatives $3/\sqrt{n}$.

Hidalgo 1 Bootstrap

		Indep.	AR (Rho)			MA (lag)			Frac (d)	
	Sample		0.3	0.6	0.9	1	2	4	0.1	0.3
<i>Normal</i>										
X1	50	0.806	0.785	0.676	0.478	0.558	0.549	0.555	0.798	0.784
	200	0.841	0.801	0.683	0.343	0.556	0.565	0.568	0.827	0.776
	800	0.848	0.819	0.679	0.284	0.563	0.555	0.564	0.847	0.772
X2	50	0.875	0.751	0.553	0.296	0.462	0.565	0.629	0.835	0.719
	200	0.918	0.788	0.537	0.202	0.496	0.579	0.637	0.874	0.700
	800	0.930	0.805	0.523	0.171	0.517	0.586	0.661	0.884	0.677
<i>t(3)</i>										
X1	50	0.845	0.820	0.737	0.531	0.620	0.640	0.618	0.838	0.823
	200	0.855	0.822	0.707	0.365	0.625	0.598	0.599	0.857	0.806
	800	0.856	0.824	0.688	0.303	0.587	0.592	0.587	0.846	0.781
X2	50	0.885	0.805	0.613	0.361	0.556	0.621	0.690	0.864	0.768
	200	0.918	0.824	0.569	0.217	0.539	0.613	0.694	0.885	0.739
	800	0.929	0.815	0.541	0.167	0.529	0.615	0.675	0.890	0.702

Regression Model: Powers vs alternatives $3/\sqrt{n}$.

Moving Blocks		Bootstrap Indep.	AR (Rho)			MA (lag)			Frac (d)	
			0.3	0.6	0.9	1	2	4	0.1	0.3
Sample										
<i>Normal</i>										
Int.	50	0.735	0.556	0.377	0.608	0.262	0.464	0.636	0.751	0.737
	200	0.831	0.564	0.283	0.388	0.316	0.464	0.559	0.789	0.765
	800	0.840	0.558	0.224	0.210	0.320	0.433	0.473	0.764	0.807
X1	50	0.736	0.686	0.606	0.391	0.463	0.386	0.497	0.726	0.674
	200	0.831	0.791	0.672	0.339	0.551	0.535	0.528	0.810	0.760
	800	0.847	0.809	0.675	0.274	0.548	0.556	0.542	0.840	0.759
X2	50	0.788	0.708	0.526	0.304	0.425	0.510	0.590	0.779	0.696
	200	0.904	0.779	0.523	0.192	0.497	0.620	0.644	0.870	0.708
	800	0.924	0.798	0.522	0.161	0.510	0.637	0.659	0.889	0.686
<i>t(3)</i>										
Int.	50	0.739	0.587	0.388	0.616	0.261	0.505	0.670	0.786	0.755
	200	0.833	0.587	0.285	0.399	0.319	0.488	0.580	0.810	0.771
	800	0.841	0.558	0.220	0.209	0.319	0.435	0.500	0.778	0.811
X1	50	0.820	0.771	0.695	0.474	0.547	0.511	0.583	0.793	0.766
	200	0.864	0.836	0.722	0.359	0.609	0.602	0.598	0.845	0.819
	800	0.855	0.835	0.701	0.296	0.596	0.579	0.585	0.849	0.789
X2	50	0.865	0.789	0.621	0.359	0.538	0.617	0.680	0.841	0.785
	200	0.914	0.827	0.594	0.221	0.570	0.671	0.703	0.892	0.749
	800	0.927	0.813	0.550	0.175	0.552	0.662	0.700	0.895	0.705

Regression Model: Powers vs alternatives $3/\sqrt{n}$.

Sieve AR Bootstrap

		Indep.	AR (Rho)			MA (lag)			Frac (d)	
	Sample		0.3	0.6	0.9	1	2	4	0.1	0.3
<i>Normal</i>										
Int.	50	0.728	0.468	0.250	0.304	0.129	0.451	0.613	0.708	0.700
	200	0.819	0.530	0.215	0.083	0.388	0.265	0.562	0.777	0.750
	800	0.837	0.540	0.208	0.061	0.390	0.376	0.416	0.772	0.798
X1	50	0.710	0.706	0.604	0.391	0.473	0.382	0.472	0.675	0.675
	200	0.818	0.779	0.649	0.300	0.511	0.529	0.527	0.809	0.757
	800	0.845	0.805	0.664	0.271	0.548	0.549	0.557	0.840	0.744
X2	50	0.795	0.679	0.483	0.256	0.410	0.530	0.585	0.769	0.670
	200	0.907	0.773	0.509	0.167	0.478	0.573	0.660	0.870	0.682
	800	0.924	0.804	0.522	0.167	0.496	0.602	0.658	0.876	0.673
<i>t(3)</i>										
Int.	50	0.735	0.511	0.265	0.310	0.134	0.486	0.644	0.738	0.725
	200	0.826	0.551	0.214	0.083	0.426	0.304	0.594	0.790	0.756
	800	0.848	0.542	0.206	0.060	0.395	0.396	0.468	0.778	0.804
X1	50	0.803	0.776	0.699	0.474	0.555	0.463	0.554	0.776	0.754
	200	0.856	0.825	0.707	0.346	0.569	0.582	0.587	0.844	0.800
	800	0.859	0.814	0.703	0.280	0.583	0.584	0.567	0.848	0.776
X2	50	0.858	0.765	0.585	0.325	0.472	0.628	0.665	0.843	0.759
	200	0.914	0.815	0.577	0.191	0.541	0.648	0.698	0.891	0.745
	800	0.931	0.829	0.554	0.173	0.534	0.633	0.695	0.896	0.690

Regression Model: Powers vs alternatives $3/\sqrt{n}$.

Asymptotic Test

		Indep.	AR (Rho)			MA (lag)			Frac (d)	
	Sample		0.3	0.6	0.9	1	2	4	0.1	0.3
<i>Normal</i>										
Int.	50	0.895	0.779	0.655	0.805	0.563	0.636	0.734	0.856	0.822
	200	0.866	0.703	0.498	0.574	0.466	0.538	0.603	0.824	0.833
	800	0.856	0.662	0.371	0.329	0.412	0.460	0.505	0.807	0.853
X1	50	0.900	0.876	0.788	0.558	0.690	0.670	0.716	0.892	0.862
	200	0.868	0.835	0.714	0.383	0.604	0.601	0.602	0.858	0.812
	800	0.860	0.819	0.694	0.306	0.580	0.573	0.572	0.850	0.792
X2	50	0.939	0.896	0.789	0.592	0.721	0.762	0.797	0.928	0.887
	200	0.938	0.865	0.686	0.350	0.635	0.696	0.717	0.917	0.820
	800	0.936	0.846	0.605	0.234	0.589	0.657	0.693	0.907	0.739
<i>t(3)</i>										
Int.	50	0.904	0.815	0.694	0.817	0.618	0.688	0.772	0.877	0.844
	200	0.872	0.737	0.528	0.590	0.496	0.565	0.631	0.839	0.844
	800	0.865	0.680	0.384	0.333	0.431	0.482	0.524	0.817	0.857
X1	50	0.910	0.892	0.821	0.610	0.743	0.729	0.761	0.903	0.881
	200	0.878	0.852	0.756	0.422	0.654	0.637	0.645	0.874	0.834
	800	0.866	0.832	0.712	0.324	0.603	0.603	0.599	0.858	0.799
X2	50	0.938	0.912	0.826	0.632	0.769	0.805	0.836	0.930	0.902
	200	0.933	0.876	0.726	0.372	0.675	0.735	0.757	0.919	0.839
	800	0.932	0.855	0.636	0.242	0.611	0.677	0.710	0.911	0.765

Regression Model: Cramér-von Mises statistics

Augmented Fourier Bootstrap

		Indep.	AR (Rho)			MA (lag)			Frac (d)	
Sample			0.3	0.6	0.9	1	2	4	0.1	0.3
<i>Normal</i>										
Int.	50	0.0012	0.0079	0.0042	0.0203	0.0384	0.0148	0.0395	0.0347	0.0890
	200	0.0017	0.0040	0.0017	0.0078	0.0249	0.0123	0.0265	0.0500	0.1172
	800	0.0017	0.0041	0.0025	0.0020	0.0160	0.0096	0.0156	0.0597	0.1419
X1	50	0.0021	0.0012	0.0023	0.0022	0.0015	0.0040	0.0049	0.0025	0.0025
	200	0.0029	0.0034	0.0017	0.0028	0.0017	0.0016	0.0018	0.0020	0.0014
	800	0.0011	0.0012	0.0019	0.0015	0.0011	0.0016	0.0036	0.0012	0.0012
X2	50	0.0011	0.0062	0.0069	0.0072	0.0041	0.0069	0.0053	0.0024	0.0053
	200	0.0017	0.0016	0.0026	0.0013	0.0013	0.0058	0.0035	0.0024	0.0016
	800	0.0018	0.0022	0.0022	0.0013	0.0014	0.0038	0.0031	0.0015	0.0016
<i>t(3)</i>										
Int.	50	0.0080	0.0147	0.0167	0.0406	0.0080	0.0258	0.0481	0.0368	0.0993
	200	0.0033	0.0052	0.0035	0.0136	0.0036	0.0169	0.0293	0.0520	0.1238
	800	0.0019	0.0015	0.0025	0.0028	0.0044	0.0122	0.0187	0.0621	0.1439
X1	50	0.0034	0.0075	0.0085	0.0039	0.0070	0.0057	0.0035	0.0041	0.0059
	200	0.0015	0.0053	0.0049	0.0044	0.0055	0.0023	0.0020	0.0024	0.0035
	800	0.0021	0.0028	0.0025	0.0025	0.0038	0.0027	0.0020	0.0024	0.0021
X2	50	0.0032	0.0078	0.0113	0.0071	0.0080	0.0065	0.0050	0.0035	0.0084
	200	0.0035	0.0048	0.0065	0.0020	0.0060	0.0071	0.0029	0.0046	0.0059
	800	0.0016	0.0028	0.0024	0.0045	0.0033	0.0050	0.0017	0.0022	0.0018

Regression Model: Cramér-von Mises statistics

Residual TFT Bootstrap

		Indep.	AR (Rho)			MA (lag)			Frac (d)	
Sample	0.3		0.6	0.9	1	2	4	0.1	0.3	
<i>Normal</i>										
Int.	50	0.0426	0.0530	0.0763	0.1513	0.0514	0.0745	0.0905	0.0745	0.1333
	200	0.0488	0.0521	0.0599	0.1157	0.0506	0.0645	0.0856	0.0949	0.1646
	800	0.0504	0.0524	0.0516	0.0847	0.0491	0.0524	0.0645	0.1077	0.1792
X1	50	0.0426	0.0530	0.0763	0.1513	0.0029	0.0046	0.0035	0.0018	0.0023
	200	0.0488	0.0521	0.0599	0.1157	0.0023	0.0015	0.0022	0.0009	0.0010
	800	0.0504	0.0524	0.0516	0.0847	0.0014	0.0022	0.0031	0.0016	0.0019
X2	50	0.0018	0.0038	0.0128	0.0172	0.0046	0.0076	0.0049	0.0036	0.0060
	200	0.0021	0.0012	0.0030	0.0065	0.0032	0.0046	0.0039	0.0018	0.0053
	800	0.0023	0.0023	0.0012	0.0014	0.0018	0.0015	0.0021	0.0016	0.0017
<i>t(3)</i>										
Int.	50	0.0457	0.0572	0.0807	0.1540	0.0541	0.0796	0.0953	0.0790	0.1366
	200	0.0493	0.0541	0.0630	0.1191	0.0535	0.0665	0.0874	0.0951	0.1657
	800	0.0500	0.0529	0.0512	0.0855	0.0502	0.0537	0.0672	0.1078	0.1810
X1	50	0.0078	0.0084	0.0095	0.0071	0.0075	0.0081	0.0031	0.0088	0.0095
	200	0.0044	0.0046	0.0038	0.0074	0.0046	0.0051	0.0035	0.0049	0.0054
	800	0.0020	0.0028	0.0015	0.0017	0.0031	0.0027	0.0030	0.0019	0.0050
X2	50	0.0069	0.0109	0.0135	0.0190	0.0074	0.0111	0.0067	0.0089	0.0089
	200	0.0042	0.0064	0.0055	0.0063	0.0056	0.0062	0.0074	0.0069	0.0062
	800	0.0033	0.0034	0.0049	0.0042	0.0033	0.0030	0.0048	0.0049	0.0019

Regression Model: Cramér-von Mises statistics

Hidalgo 1 Bootstrap

		Indep.	AR (Rho)			MA (lag)			Frac (d)	
	Sample		0.3	0.6	0.9	1	2	4	0.1	0.3
<i>Normal</i>										
X1	50	0.0011	0.0018	0.0018	0.0024	0.0016	0.0016	0.0014	0.0028	0.0029
	200	0.0017	0.0023	0.0018	0.0017	0.0014	0.0012	0.0017	0.0023	0.0026
	800	0.0017	0.0015	0.0024	0.0033	0.0012	0.0015	0.0016	0.0030	0.0012
X2	50	0.0032	0.0045	0.0061	0.0054	0.0041	0.0037	0.0020	0.0045	0.0034
	200	0.0020	0.0028	0.0025	0.0022	0.0012	0.0017	0.0023	0.0022	0.0017
	800	0.0016	0.0017	0.0011	0.0014	0.0013	0.0035	0.0013	0.0025	0.0020
<i>t(3)</i>										
X1	50	0.0010	0.0023	0.0020	0.0042	0.0026	0.0026	0.0024	0.0019	0.0033
	200	0.0011	0.0013	0.0020	0.0018	0.0017	0.0023	0.0012	0.0030	0.0025
	800	0.0012	0.0025	0.0015	0.0025	0.0020	0.0033	0.0012	0.0014	0.0011
X2	50	0.0021	0.0032	0.0052	0.0068	0.0026	0.0041	0.0035	0.0047	0.0050
	200	0.0022	0.0021	0.0015	0.0019	0.0018	0.0015	0.0017	0.0011	0.0018
	800	0.0028	0.0027	0.0019	0.0018	0.0025	0.0020	0.0013	0.0019	0.0022

Regression Model: Cramér-von Mises statistics

Moving Blocks Bootstrap

		Indep.	AR (Rho)			MA (lag)			Frac (d)	
	Sample		0.3	0.6	0.9	1	2	4	0.1	0.3
<i>Normal</i>										
Int.	50	0.0015	0.0089	0.0249	0.0944	0.0033	0.0252	0.0448	0.0340	0.0927
	200	0.0017	0.0039	0.0090	0.0568	0.0027	0.0160	0.0269	0.0481	0.1181
	800	0.0016	0.0019	0.0021	0.0297	0.0033	0.0102	0.0164	0.0589	0.1385
X1	50	0.0031	0.0012	0.0017	0.0034	0.0027	0.0043	0.0029	0.0010	0.0045
	200	0.0009	0.0019	0.0022	0.0051	0.0013	0.0022	0.0009	0.0014	0.0030
	800	0.0022	0.0015	0.0036	0.0023	0.0011	0.0020	0.0017	0.0030	0.0032
X2	50	0.0009	0.0060	0.0088	0.0131	0.0053	0.0068	0.0040	0.0014	0.0088
	200	0.0022	0.0038	0.0024	0.0048	0.0015	0.0060	0.0043	0.0028	0.0055
	800	0.0014	0.0011	0.0011	0.0028	0.0020	0.0031	0.0023	0.0018	0.0012
<i>t(3)</i>										
Int.	50	0.0060	0.0147	0.0256	0.0981	0.0106	0.0279	0.0486	0.0366	0.0957
	200	0.0034	0.0068	0.0097	0.0599	0.0057	0.0192	0.0297	0.0511	0.1189
	800	0.0025	0.0029	0.0050	0.0311	0.0029	0.0118	0.0186	0.0584	0.1408
X1	50	0.0047	0.0053	0.0053	0.0061	0.0071	0.0059	0.0040	0.0054	0.0042
	200	0.0018	0.0028	0.0032	0.0049	0.0020	0.0021	0.0018	0.0018	0.0018
	800	0.0024	0.0014	0.0023	0.0017	0.0015	0.0020	0.0020	0.0019	0.0013
X2	50	0.0038	0.0065	0.0099	0.0147	0.0071	0.0059	0.0040	0.0046	0.0090
	200	0.0016	0.0020	0.0032	0.0055	0.0020	0.0021	0.0018	0.0038	0.0019
	800	0.0010	0.0010	0.0020	0.0040	0.0015	0.0020	0.0020	0.0020	0.0027

Regression Model: Cramér-von Mises statistics

Sieve AR Bootstrap

		Indep.	AR (Rho)			MA (lag)			Frac (d)	
Sample	0.3		0.6	0.9	1	2	4	0.1	0.3	
<i>Normal</i>										
Int.	50	0.0034	0.0035	0.0091	0.0494	0.0163	0.0240	0.0434	0.0292	0.0839
	200	0.0021	0.0018	0.0011	0.0102	0.0102	0.0026	0.0290	0.0438	0.1135
	800	0.0017	0.0009	0.0017	0.0023	0.0073	0.0081	0.0118	0.0603	0.1363
X1	50	0.0030	0.0021	0.0014	0.0037	0.0019	0.0075	0.0012	0.0047	0.0036
	200	0.0014	0.0031	0.0016	0.0013	0.0019	0.0027	0.0017	0.0019	0.0015
	800	0.0011	0.0021	0.0021	0.0019	0.0010	0.0027	0.0019	0.0014	0.0019
X2	50	0.0016	0.0036	0.0027	0.0063	0.0033	0.0094	0.0056	0.0028	0.0036
	200	0.0018	0.0016	0.0013	0.0027	0.0024	0.0019	0.0044	0.0021	0.0015
	800	0.0020	0.0018	0.0025	0.0018	0.0010	0.0041	0.0027	0.0016	0.0014
<i>t(3)</i>										
Int.	50	0.0074	0.0072	0.0123	0.0531	0.0162	0.0262	0.0447	0.0314	0.0873
	200	0.0042	0.0036	0.0044	0.0107	0.0118	0.0070	0.0299	0.0479	0.1135
	800	0.0013	0.0024	0.0026	0.0034	0.0078	0.0088	0.0146	0.0577	0.1360
X1	50	0.0046	0.0041	0.0026	0.0040	0.0045	0.0076	0.0016	0.0048	0.0068
	200	0.0015	0.0023	0.0022	0.0030	0.0028	0.0051	0.0015	0.0022	0.0018
	800	0.0023	0.0016	0.0023	0.0019	0.0015	0.0022	0.0028	0.0024	0.0019
X2	50	0.0012	0.0041	0.0056	0.0076	0.0078	0.0095	0.0053	0.0045	0.0058
	200	0.0019	0.0037	0.0016	0.0024	0.0028	0.0055	0.0024	0.0029	0.0021
	800	0.0026	0.0019	0.0014	0.0020	0.0018	0.0034	0.0021	0.0015	0.0017

Regression Model: Cramér-von Mises statistics

Asymptotic test

		Indep.	AR (Rho)			MA (lag)			Frac (d)	
Sample	0.3		0.6	0.9	1	2	4	0.1	0.3	
<i>Normal</i>										
Int.	50	0.0155	0.0313	0.0581	0.1398	0.0291	0.0415	0.0596	0.0499	0.1160
	200	0.0054	0.0172	0.0328	0.0867	0.0164	0.0242	0.0334	0.0563	0.1388
	800	0.0013	0.0108	0.0159	0.0467	0.0102	0.0151	0.0191	0.0662	0.1547
X1	50	0.0192	0.0169	0.0148	0.0174	0.0169	0.0134	0.0193	0.0169	0.0143
	200	0.0049	0.0039	0.0047	0.0098	0.0041	0.0037	0.0052	0.0051	0.0042
	800	0.0019	0.0012	0.0035	0.0042	0.0012	0.0010	0.0018	0.0022	0.0029
X2	50	0.0210	0.0298	0.0353	0.0472	0.0290	0.0277	0.0258	0.0219	0.0316
	200	0.0063	0.0127	0.0170	0.0231	0.0142	0.0119	0.0075	0.0081	0.0153
	800	0.0025	0.0061	0.0084	0.0108	0.0072	0.0060	0.0042	0.0033	0.0064
<i>t(3)</i>										
Int.	50	0.0171	0.0339	0.0619	0.1448	0.0340	0.0452	0.0640	0.0546	0.1210
	200	0.0063	0.0199	0.0349	0.0892	0.0173	0.0254	0.0348	0.0580	0.1407
	800	0.0016	0.0127	0.0180	0.0474	0.0098	0.0149	0.0213	0.0692	0.1562
X1	50	0.0871	0.0812	0.0737	0.0775	0.0161	0.0143	0.0211	0.0176	0.0155
	200	0.0573	0.0532	0.0572	0.0624	0.0070	0.0057	0.0059	0.0075	0.0067
	800	0.0534	0.0507	0.0523	0.0546	0.0032	0.0026	0.0033	0.0035	0.0039
X2	50	0.0219	0.0294	0.0384	0.0483	0.0316	0.0276	0.0258	0.0235	0.0307
	200	0.0067	0.0143	0.0199	0.0235	0.0151	0.0133	0.0101	0.0110	0.0173
	800	0.0029	0.0071	0.0086	0.0110	0.0086	0.0076	0.0042	0.0052	0.0087

Empirical Variances of Series Means

Results for the regression model with AR(1) dependence.

Sample		<i>Rho</i>			
Sample mean		0	0.3	0.6	0.9
50		0.979	1.981	5.789	71.94
200		0.998	2.027	6.184	92.87
800		0.999	2.043	6.246	98.47
AFB bootstrap mean					
50		1.264	2.183	7.328	73.14
200		1.101	1.993	6.553	85.75
800		1.106	2.001	6.471	97.22

ADF Test: 5% Test Size

Sample		Indep.	AR (Rho)			MA (lag)			Frac (d)	
			0.3	0.6	0.9	1	2	4	0.1	0.3
Augmented Fourier Bootstrap										
<i>Normal</i>	50	0.052	0.046	0.049	0.049	0.050	0.047	0.035	0.042	0.037
	200	0.049	0.059	0.047	0.043	0.056	0.045	0.031	0.036	0.047
	800	0.050	0.061	0.049	0.043	0.061	0.048	0.029	0.048	0.071
<i>t(3)</i>	50	0.053	0.050	0.050	0.046	0.047	0.041	0.039	0.040	0.039
	200	0.051	0.059	0.051	0.046	0.058	0.047	0.031	0.038	0.049
	800	0.053	0.060	0.048	0.045	0.058	0.048	0.029	0.048	0.069
Residual TFT Bootstrap										
<i>Normal</i>	50	0.043	0.044	0.045	0.037	0.029	0.028	0.019	0.031	0.031
	200	0.044	0.044	0.041	0.029	0.032	0.041	0.014	0.030	0.027
	800	0.043	0.043	0.041	0.044	0.037	0.043	0.029	0.030	0.035
<i>t(3)</i>	50	0.043	0.043	0.045	0.038	0.028	0.028	0.023	0.034	0.032
	200	0.044	0.045	0.043	0.033	0.034	0.042	0.016	0.034	0.031
	800	0.044	0.044	0.042	0.047	0.037	0.040	0.032	0.030	0.035
Moving Blocks Bootstrap										
<i>Normal</i>	50	0.051	0.050	0.052	0.057	0.041	0.047	0.033	0.0409	0.037
	200	0.051	0.049	0.046	0.034	0.044	0.051	0.032	0.032	0.033
	800	0.050	0.046	0.046	0.030	0.047	0.050	0.030	0.033	0.043
<i>t(3)</i>	50	0.053	0.051	0.052	0.054	0.042	0.045	0.038	0.041	0.036
	200	0.049	0.052	0.049	0.036	0.046	0.046	0.033	0.036	0.034
	800	0.052	0.049	0.048	0.030	0.050	0.048	0.030	0.033	0.044

ADF Test: 5% Test Size

		Indep.	AR (Rho)			MA (lag)			Frac (d)	
Sample			0.3	0.6	0.9	1	2	4	0.1	0.3
Sieve AR Bootstrap										
<i>Normal</i>	50	0.053	0.049	0.050	0.057	0.035	0.043	0.034	0.041	0.035
	200	0.050	0.047	0.050	0.051	0.043	0.057	0.029	0.034	0.034
	800	0.052	0.051	0.049	0.050	0.044	0.046	0.031	0.031	0.041
<i>t(3)</i>	50	0.050	0.051	0.052	0.057	0.035	0.043	0.038	0.042	0.036
	200	0.052	0.053	0.054	0.052	0.044	0.052	0.030	0.036	0.036
	800	0.051	0.050	0.053	0.049	0.047	0.046	0.029	0.033	0.044
Time Domain Wild Bootstrap										
<i>Normal</i>	50	0.051	0.050	0.055	0.062	0.037	0.045	0.034	0.040	0.037
	200	0.048	0.047	0.049	0.049	0.042	0.051	0.029	0.032	0.032
	800	0.050	0.048	0.051	0.050	0.045	0.051	0.029	0.028	0.040
<i>t(3)</i>	50	0.047	0.046	0.047	0.053	0.029	0.037	0.033	0.038	0.036
	200	0.046	0.047	0.045	0.042	0.041	0.038	0.027	0.034	0.032
	800	0.047	0.049	0.044	0.045	0.046	0.044	0.026	0.028	0.040
Asymptotic Test										
<i>Normal</i>	50	0.049	0.051	0.056	0.068	0.037	0.046	0.037	0.040	0.036
	200	0.052	0.050	0.049	0.056	0.043	0.051	0.032	0.034	0.037
	800	0.050	0.049	0.052	0.052	0.047	0.052	0.029	0.030	0.056
<i>t(3)</i>	50	0.049	0.047	0.053	0.067	0.036	0.046	0.038	0.040	0.038
	200	0.052	0.052	0.053	0.058	0.044	0.049	0.034	0.036	0.042
	800	0.050	0.050	0.050	0.051	0.048	0.050	0.029	0.031	0.058

ADF Test: Powers with I(0), I(d) series

		Indep.	AR (Rho)			MA (lag)			Frac (d)	
Sample			0.3	0.6	0.9	1	2	4	0.1	0.3
Augmented Fourier Bootstrap										
<i>Normal</i>	50	0.980	0.943	0.686	0.103	0.700	0.388	0.844	0.951	0.789
	200	1.000	1.000	1.000	0.768	0.999	0.999	0.996	1.000	0.994
	800	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000
<i>t(3)</i>	50	0.984	0.961	0.715	0.095	0.714	0.347	0.874	0.957	0.825
	200	1.000	1.000	1.000	0.781	0.999	0.998	0.997	1.000	0.996
	800	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000
Residual TFT Bootstrap										
<i>Normal</i>	50	0.972	0.935	0.627	0.068	0.520	0.185	0.786	0.928	0.733
	200	1.000	1.000	1.000	0.638	0.996	0.998	0.965	1.000	0.989
	800	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000
<i>t(3)</i>	50	0.978	0.943	0.644	0.067	0.517	0.172	0.826	0.945	0.768
	200	1.000	1.000	1.000	0.681	0.996	0.998	0.977	1.000	0.994
	800	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000
Moving Blocks Bootstrap										
<i>Normal</i>	50	0.981	0.953	0.707	0.120	0.665	0.383	0.843	0.95062	0.79262
	200	1.000	1.000	1.000	0.719	0.998	0.999	0.996	1.000	0.992
	800	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000
<i>t(3)</i>	50	0.984	0.963	0.725	0.103	0.678	0.381	0.875	0.961	0.821
	200	1.000	1.000	1.000	0.720	0.998	0.999	0.997	1.000	0.994
	800	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000

ADF Test: Powers with I(0), I(d) series

		Indep.	AR (Rho)			MA (lag)			Frac (d)	
			0.3	0.6	0.9	1	2	4	0.1	0.3
Sample										
Sieve AR Bootstrap										
<i>Normal</i>	50	0.983	0.948	0.691	0.122	0.653	0.374	0.843	0.948	0.784
	200	1.000	1.000	1.000	0.798	0.998	0.999	0.995	1.000	0.991
	800	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000
<i>t(3)</i>	50	0.984	0.962	0.732	0.117	0.660	0.361	0.874	0.961	0.812
	200	1.000	1.000	1.000	0.811	0.999	0.999	0.996	1.000	0.994
	800	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000
Time Domain Wild Bootstrap										
<i>Normal</i>	50	0.980	0.950	0.721	0.130	0.640	0.367	0.842	0.949	0.796
	200	1.000	1.000	1.000	0.787	0.999	0.999	0.994	1.000	0.991
	800	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000
<i>t(3)</i>	50	0.982	0.954	0.698	0.103	0.536	0.262	0.860	0.954	0.802
	200	1.000	1.000	1.000	0.743	0.998	0.997	0.994	1.000	0.993
	800	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000
Asymptotic Test										
<i>Normal</i>	50	0.980	0.953	0.725	0.143	0.516	0.175	0.790	0.949	0.791
	200	1.000	1.000	1.000	0.826	0.996	0.998	0.965	1.000	0.993
	800	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000
<i>t(3)</i>	50	0.984	0.955	0.719	0.129	0.656	0.376	0.871	0.957	0.817
	200	1.000	1.000	1.000	0.837	0.999	0.999	0.997	1.000	0.995
	800	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000

ADF Test: Cramér-von Mises statistic

		Indep.	AR (Rho)			MA (lag)			Frac (d)	
Sample			0.3	0.6	0.9	1	2	4	0.1	0.3
Augmented Fourier Bootstrap										
<i>Normal</i>	50	0.0016	0.0032	0.0030	0.0149	0.0054	0.0336	0.0431	0.0228	0.0573
	200	0.0023	0.0051	0.0045	0.0071	0.0044	0.0328	0.0498	0.0343	0.0712
	800	0.0017	0.0058	0.0056	0.0045	0.0055	0.0334	0.0481	0.0344	0.0876
<i>t(3)</i>	50	0.0040	0.0059	0.0044	0.0167	0.0069	0.0392	0.0466	0.0280	0.0625
	200	0.0020	0.0066	0.0062	0.0077	0.0027	0.0385	0.0511	0.0373	0.0754
	800	0.0026	0.0057	0.0046	0.0059	0.0036	0.0381	0.0523	0.0380	0.0885
Residual TFT Bootstrap										
<i>Normal</i>	50	0.0256	0.0264	0.0281	0.0510	0.0277	0.0557	0.0737	0.0472	0.0776
	200	0.0228	0.0224	0.0232	0.0223	0.0251	0.0433	0.0821	0.0608	0.1055
	800	0.0235	0.0237	0.0260	0.0213	0.0230	0.0348	0.0576	0.0719	0.1290
<i>t(3)</i>	50	0.0275	0.0267	0.0265	0.0512	0.0316	0.0619	0.0776	0.0517	0.0845
	200	0.0252	0.0266	0.0251	0.0254	0.0270	0.0484	0.0831	0.0635	0.1079
	800	0.0232	0.0269	0.0252	0.0212	0.0243	0.0382	0.0600	0.0720	0.1299
Moving Blocks Bootstrap										
<i>Normal</i>	50	0.0015	0.0029	0.0070	0.0399	0.0073	0.0317	0.0459	0.0232	0.0575
	200	0.0014	0.0015	0.0024	0.0152	0.0033	0.0310	0.0497	0.0378	0.0786
	800	0.0019	0.0014	0.0029	0.0170	0.0012	0.0298	0.0509	0.0446	0.1016
<i>t(3)</i>	50	0.0042	0.0035	0.0057	0.0381	0.0075	0.0369	0.0481	0.0285	0.0606
	200	0.0013	0.0016	0.0042	0.0173	0.0032	0.0364	0.0534	0.0398	0.0812
	800	0.0011	0.0008	0.0022	0.0195	0.0018	0.0331	0.0522	0.0467	0.1050

ADF Test: Cramér-von Mises statistic

		Indep.	AR (Rho)			MA (lag)			Frac (d)	
Sample			0.3	0.6	0.9	1	2	4	0.1	0.3
Sieve AR Bootstrap										
<i>Normal</i>	50	0.002	0.002	0.001	0.021	0.013	0.031	0.046	0.022	0.056
	200	0.001	0.002	0.002	0.004	0.004	0.012	0.051	0.037	0.079
	800	0.003	0.003	0.001	0.003	0.003	0.018	0.046	0.047	0.103
<i>t(3)</i>	50	0.003	0.002	0.002	0.020	0.018	0.038	0.050	0.025	0.060
	200	0.003	0.001	0.002	0.002	0.006	0.019	0.055	0.038	0.080
	800	0.001	0.002	0.002	0.001	0.001	0.024	0.053	0.049	0.105
Time Domain Wild Bootstrap										
<i>Normal</i>	50	0.004	0.007	0.016	0.051	0.007	0.031	0.042	0.022	0.059
	200	0.001	0.002	0.003	0.016	0.003	0.031	0.053	0.038	0.081
	800	0.002	0.002	0.001	0.003	0.002	0.031	0.054	0.052	0.106
<i>t(3)</i>	50	0.002	0.005	0.013	0.046	0.010	0.035	0.046	0.022	0.060
	200	0.002	0.003	0.003	0.012	0.004	0.035	0.055	0.037	0.083
	800	0.003	0.001	0.003	0.003	0.002	0.033	0.056	0.051	0.105
Asymptotic Test										
<i>Normal</i>	50	0.011	0.011	0.010	0.028	0.029	0.058	0.076	0.030	0.050
	200	0.009	0.009	0.010	0.008	0.027	0.044	0.082	0.042	0.062
	800	0.010	0.010	0.010	0.008	0.023	0.036	0.059	0.053	0.070
<i>t(3)</i>	50	0.014	0.015	0.013	0.029	0.025	0.043	0.056	0.036	0.054
	200	0.011	0.010	0.010	0.008	0.016	0.039	0.060	0.045	0.065
	800	0.010	0.010	0.011	0.009	0.011	0.037	0.062	0.056	0.070