

Author index

B

- Baba, Y. 137
Bae, K.-H. 131
Bauwens, L. 82, 133
Belanger, A. J. 13
Bera, A. K. 126
Berkowitz, J. 218
Black, F. 114
Boffelli, S. 218
Bollerslev, T. . . . 1, 28, 82, 86, 101, 131,
133, 134, 136, 137, 149, 186
Box, G. E. P. 23
Bozdogan, H. 32

C

- Cappiello, L. 186
Chan, K. 37
Chiang, T. C. 237, 238
Christoffersen, P. F. . . . 217, 218, 224,
225
Colacito, R. 186

D

- D'Agostino, R. B. 13
D'Agostino, R. B., Jr. 13
Dickey, D. A. 17
Ding, Z. 118, 119
Dufour, J.-M. 225

E

- Elliott, G. 19
Engle, R. F. . . . 1, 82, 86, 115, 118, 119,
131, 134, 136, 137, 149, 158,
159, 163, 174, 186, 225

F

- Fisher, R. A. 22
Forbes, K. J. . . . 227, 229–231, 235, 237,
238, 251–253
Fry, R. 230, 251, 252, 254
Fuller, W. A. 17

G

- Ghysels, E. 186
Glosten, L. R. 117
Goldfeld, S. M. 244
Gonzalez-Rivera, G. 86
Granger, C. W. J. 82, 118, 119

H

- Hafer, C. 82
Hamilton, J. D. 244
Hansson, B. 131
Harvey, C. R. 251
Higgins, M. L. 126
Hordahl, P. 131
Hurlin, C. 218

J

- Jagannathan, R. 117
Jeon, B. N. 237, 238

K

- Karolyi, G. A. 131
Kraft, D. F. 137
Kroner, K. F. 137
Kupiec, H. 217

L

- Laurent, S. 82, 133
 Leccadito, A. 218
 Li, H. 237, 238
 Ljung, G. M. 23

M

- Martin, V. L. 230, 251, 252, 254

N

- Nelson, D. B. 137
 Newey, W. K. 21
 Ng, V. K. 115

O

- O'Brien, J. 218

P

- Patton, A. J. 123
 Pelletier, D. 217, 218, 224, 225
 Perignon, C. 218
 Perron, P. 17
 Phillips, P. C. B. 17

Q

- Quandt, R. E. 244

R

- Rigobon, R. 227, 229–231, 235, 237,
 238, 251–253
 Rombouts, J. V. K. 133
 Rothenberg, T. J. 19
 Runkle, D. E. 117
 Russell, J. R. 225

S

- Santa-Clara, P. 186
 Sheppard, K. 163, 186
 Siddique, A. 251
 Silvennoinen, A. 131, 133
 Sinko, A. 186
 Smith, D. 218
 Stock, J. H. 19
 Stulz, R. M. 131

T

- Tang, C. 230, 251, 252, 254
 Teräsvirta, T. 82, 131, 133
 Tokpavi, S. 218
 Tse, Y. K. 131, 149, 158, 164, 174,
 186
 Tsui, A. K. C. 131, 149, 158, 174, 186

U

- Urga, G. 218

V

- Valkanov, R. 186

W

- Weiss, A. A. 86
 West, K. D. 21
 Wooldridge, J. M. 86, 131, 134, 136

Z

- Zakoian, J. M. 116
 Zivot, E. 82