

	AE	UC	CC	DQ
sGARCH N	1.742	0.000	0.000	0.000
gjrGARCH N	1.705	0.000	0.000	0.000
eGARCH N	1.723	0.000	0.000	0.000
csGARCH N	1.705	0.000	0.000	0.000
sGARCH Std	1.326	0.023	0.030	0.009
gjrGARCH Std	1.402	0.006	0.008	0.033
eGARCH Std	1.364	0.012	0.016	0.003
csGARCH Std	1.307	0.032	0.041	0.012
GM N - U	1.648	0.000	0.000	0.000
GM-skew N - U	1.648	0.000	0.000	0.000
GM Std - U	1.856	0.000	0.000	0.000
GM-skew Std - U	1.402	0.006	0.022	0.063
DAGM N - U	1.742	0.000	0.000	0.000
DAGM-skew N- U	1.686	0.000	0.000	0.000
GM N - Real GDP	1.648	0.000	0.000	0.000
GM-skew N - Real GDP	1.648	0.000	0.000	0.000
GM Std - Real GDP	1.326	0.023	0.030	0.009
GM-skew Std - Real GDP	1.345	0.017	0.022	0.097
DAGM N - Real GDP	1.705	0.000	0.000	0.000
DAGM N-skew - Real GDP	1.648	0.000	0.000	0.000
GM N - Bond Yields	1.648	0.000	0.000	0.000
GM-skew N - Bond Yields	1.686	0.000	0.000	0.000
GM Std - Bond Yields	1.705	0.000	0.000	0.000
DAGM N - Bond Yields	1.629	0.000	0.000	0.000
DAGM-skew N - Bond Yields	1.723	0.000	0.000	0.000
SAV	0.966	0.802	0.000	0.000
AS	1.023	0.869	0.570	0.952
IG	1.023	0.869	0.570	0.937
Lin. ARCH	1.023	0.869	0.299	0.201
HS (w=250)	1.610	0.000	0.000	0.000