

	UC	CC	AE	DQ
sGARCH N	0.019	0.062	1.144	0.031
gjrGARCH N	0.035	0.098	1.129	0.255
eGARCH N	0.072	0.153	1.110	0.190
csGARCH N	0.041	0.087	1.125	0.046
sGARCH Std	0.002	0.006	1.193	0.001
gjrGARCH Std	0.002	0.006	1.193	0.020
eGARCH Std	0.005	0.014	1.174	0.056
csGARCH Std	0.002	0.004	1.189	0.002
GM N - U	0.030	0.092	1.133	0.027
GM-skew N - U	0.106	0.238	1.098	0.091
GM Std - U	0.003	0.010	1.186	0.001
GM-skew Std - U	0.004	0.011	1.178	0.023
DAGM N - U	0.063	0.161	1.114	0.015
DAGM-skew N- U	0.072	0.166	1.110	0.144
GM N - Real GDP	0.047	0.130	1.121	0.044
GM-skew N - Real GDP	0.035	0.098	1.129	0.067
GM Std - Real GDP	0.003	0.010	1.186	0.001
GM-skew Std - Real GDP	0.004	0.011	1.178	0.030
DAGM N - Real GDP	0.047	0.130	1.121	0.042
DAGM N-skew - Real GDP	0.093	0.212	1.102	0.286
GM N - Bond Yields	0.047	0.130	1.121	0.031
GM-skew N - Bond Yields	0.135	0.296	1.091	0.297
GM Std - Bond Yields	0.000	0.000	1.337	0.000
DAGM N - Bond Yields	0.014	0.044	1.152	0.009
DAGM-skew N - Bond Yields	0.106	0.238	1.098	0.245
SAV	0.900	0.438	1.008	0.111
AS	0.900	0.594	1.008	0.504
IG	0.950	0.579	1.004	0.138
Lin. ARCH	0.950	0.579	1.004	0.585
HS (w=250)	0.054	0.000	1.117	0.000