ROC Curves: All Models

LR (Fusion) (AUC=0.688)
LR (WSV) (AUC=0.682)
SVM (WSV) (AUC=0.651)
XGB (Fusion) (AUC=0.669)
GARCH(1,1) (AUC=0.556)
EGARCH(1,1) (AUC=0.557)
GJR-GARCH (AUC=0.551)
HAR (AUC=0.520)
Random Classifier