

## FORECAST EXTRACTION

LAFC ABK MCM

Here are the models for daily data

```
mod.smpl <- matrix(rbind(c("var", 1, "Lasso", "none", "dj.cens.lcov", 1000,
  "none"), c("var", 1, "Lasso", "none", "dj.cens.lcov.W", 263, "none"), c("var",
  1, "Lasso", "none", "dj.none.lcov.M", 60, "none")), ncol = 7, dimnames = c(list(Model
  spec = c("Model", "Lag", "Estimator", "Adaptive", "Data", "Est.smpl", "Restrictions")
```

```
parmat <- fc.xtpar(mod.smpl, dates.all = NULL)
```

```
## diagonal equations
## % latex table generated in R 3.1.0 by xtable 1.7-3 package
## % Fri Aug 29 16:54:38 2014
## & Basic Materials & Communications & Consumer, Cyclical & Consumer, Non-cyclical & En
## \hline
## 1 & 0.75 & 0.40 & 0.14 & 0.52 & 0.23 & 0.35 & 0.57 & 0.39 \\\
## 2 & 0.17 & 0.48 & 0.37 & 0.37 & 0.24 & 0.20 & 0.26 & 0.32 \\\
## 3 & 0.00 & 0.42 & 0.99 & 0.24 & 0.64 & 0.20 & 0.12 & 0.48 \\\
## 4 & 0.32 & 0.23 & 0.10 & 0.57 & 0.19 & 0.14 & 0.27 & 0.19 \\\
## 5 & 0.00 & 0.19 & 0.28 & 0.16 & 1.00 & 0.08 & 0.07 & 0.18 \\\
## 6 & 0.58 & 0.45 & 0.46 & 0.33 & 0.02 & 1.00 & 0.38 & 0.55 \\\
## 7 & 0.34 & 0.19 & 0.09 & 0.24 & 0.02 & 0.05 & 0.63 & 0.12 \\\
## 8 & 0.34 & 0.54 & 0.35 & 0.29 & 0.30 & 0.20 & 0.31 & 0.70 \\\
## 9 & 0.00 & 0.00 & 0.00 & 0.00 & 0.02 & 0.00 & 0.01 & 0.01 \\\
## 10 & 0.00 & 0.01 & 0.00 & 0.00 & 0.00 & 0.00 & 0.00 & 0.00 \\\
## 11 & 0.00 & 0.01 & 0.02 & 0.00 & 0.00 & 0.00 & 0.01 & 0.00 \\\
## 12 & 0.00 & 0.00 & 0.00 & 0.00 & 0.00 & 0.00 & 0.00 & 0.00 \\\
## 13 & 0.02 & 0.01 & 0.01 & 0.02 & 0.03 & 0.00 & 0.03 & 0.02 \\\
## 14 & 0.01 & 0.03 & 0.01 & 0.03 & 0.01 & 0.01 & 0.02 & 0.03 \\\
## 15 & 0.00 & 0.00 & 0.00 & 0.01 & 0.00 & 0.00 & 0.01 & 0.00 \\\
## 16 & 0.00 & 0.00 & 0.00 & 0.00 & 0.00 & 0.00 & 0.00 & 0.00 \\\
## \hline
## off-diagonal equations
## % latex table generated in R 3.1.0 by xtable 1.7-3 package
## % Fri Aug 29 16:54:38 2014
## & Basic Materials & Communications & Consumer, Cyclical & Consumer, Non-cyclical & En
## \hline
## 1 & 0.81 & 0.27 & 0.10 & 0.24 & 0.24 & 0.93 & 0.26 & 0.29 \\\
## 2 & 0.48 & 0.71 & 0.56 & 0.32 & 0.28 & 0.35 & 0.36 & 0.41 \\\
## 3 & 0.13 & 0.25 & 0.64 & 0.16 & 0.06 & 0.32 & 0.15 & 0.17 \\\
## 4 & 0.62 & 0.57 & 0.54 & 0.65 & 0.51 & 0.70 & 0.61 & 0.58 \\\
```

*Date:* August 29, 2014.

```
## 5 & 0.13 & 0.13 & 0.18 & 0.18 & 0.34 & 0.08 & 0.10 & 0.07 \\
## 6 & 0.12 & 0.08 & 0.21 & 0.06 & 0.03 & 0.56 & 0.11 & 0.12 \\
## 7 & 0.74 & 0.49 & 0.51 & 0.52 & 0.43 & 0.34 & 0.82 & 0.53 \\
## 8 & 0.14 & 0.52 & 0.55 & 0.37 & 0.37 & 0.51 & 0.29 & 0.90 \\
## 9 & 0.09 & 0.12 & 0.12 & 0.11 & 0.09 & 0.12 & 0.09 & 0.11 \\
## 10 & 0.04 & 0.05 & 0.05 & 0.04 & 0.03 & 0.05 & 0.04 & 0.03 \\
## 11 & 0.11 & 0.14 & 0.18 & 0.11 & 0.07 & 0.10 & 0.10 & 0.10 \\
## 12 & 0.07 & 0.09 & 0.09 & 0.11 & 0.04 & 0.10 & 0.08 & 0.08 \\
## 13 & 0.17 & 0.14 & 0.15 & 0.14 & 0.24 & 0.11 & 0.14 & 0.15 \\
## 14 & 0.16 & 0.16 & 0.16 & 0.15 & 0.10 & 0.24 & 0.15 & 0.16 \\
## 15 & 0.08 & 0.07 & 0.09 & 0.08 & 0.05 & 0.07 & 0.08 & 0.06 \\
## 16 & 0.05 & 0.05 & 0.05 & 0.06 & 0.04 & 0.08 & 0.05 & 0.06 \\
## \hline
```

```
## diagonal equations
```

```
## % latex table generated in R 3.1.0 by xtable 1.7-3 package
```

```
## % Fri Aug 29 16:54:39 2014
```

```
## & Basic Materials & Communications & Consumer, Cyclical & Consumer, Non-cyclical & En
```

```
## \hline
```

```
## 1 & 0.75 & 0.13 & 0.08 & 0.35 & 0.08 & 0.00 & 0.41 & 0.19 \\
## 2 & 0.12 & 0.43 & 0.08 & 0.15 & 0.04 & 0.00 & 0.02 & 0.08 \\
## 3 & 0.17 & 0.54 & 0.78 & 0.33 & 0.66 & 0.19 & 0.18 & 0.51 \\
## 4 & 0.26 & 0.08 & 0.04 & 0.27 & 0.04 & 0.00 & 0.08 & 0.04 \\
## 5 & 0.00 & 0.00 & 0.00 & 0.00 & 0.69 & 0.00 & 0.01 & 0.00 \\
## 6 & 0.47 & 0.20 & 0.19 & 0.20 & 0.00 & 0.81 & 0.31 & 0.32 \\
## 7 & 0.22 & 0.17 & 0.01 & 0.07 & 0.00 & 0.02 & 0.55 & 0.00 \\
## 8 & 0.19 & 0.32 & 0.06 & 0.20 & 0.25 & 0.06 & 0.23 & 0.64 \\
## 9 & 0.00 & 0.00 & 0.00 & 0.00 & 0.00 & 0.00 & 0.00 & 0.00 \\
## 10 & 0.00 & 0.00 & 0.00 & 0.00 & 0.00 & 0.00 & 0.00 & 0.01 \\
## 11 & 0.00 & 0.01 & 0.02 & 0.01 & 0.00 & 0.00 & 0.01 & 0.00 \\
## 12 & 0.00 & 0.00 & 0.00 & 0.00 & 0.00 & 0.00 & 0.00 & 0.00 \\
## 13 & 0.00 & 0.00 & 0.00 & 0.00 & 0.02 & 0.00 & 0.00 & 0.00 \\
## 14 & 0.01 & 0.01 & 0.00 & 0.01 & 0.00 & 0.00 & 0.01 & 0.01 \\
## 15 & 0.00 & 0.00 & 0.00 & 0.00 & 0.00 & 0.00 & 0.01 & 0.00 \\
## 16 & 0.00 & 0.00 & 0.00 & 0.00 & 0.00 & 0.00 & 0.00 & 0.00 \\
## \hline
```

```
## off-diagonal equations
```

```
## % latex table generated in R 3.1.0 by xtable 1.7-3 package
```

```
## % Fri Aug 29 16:54:39 2014
```

```
## & Basic Materials & Communications & Consumer, Cyclical & Consumer, Non-cyclical & En
```

```
## \hline
```

```
## 1 & 0.43 & 0.12 & 0.09 & 0.11 & 0.11 & 0.27 & 0.13 & 0.07 \\
## 2 & 0.07 & 0.26 & 0.07 & 0.10 & 0.03 & 0.17 & 0.08 & 0.08 \\
## 3 & 0.12 & 0.33 & 0.79 & 0.20 & 0.06 & 0.46 & 0.16 & 0.23 \\
## 4 & 0.23 & 0.17 & 0.10 & 0.28 & 0.17 & 0.14 & 0.24 & 0.18 \\
## 5 & 0.04 & 0.01 & 0.00 & 0.02 & 0.02 & 0.00 & 0.03 & 0.00 \\
## 6 & 0.25 & 0.14 & 0.31 & 0.04 & 0.02 & 0.38 & 0.18 & 0.17 \\
## 7 & 0.29 & 0.14 & 0.06 & 0.12 & 0.10 & 0.07 & 0.36 & 0.16 \\
```

```
## 8 & 0.24 & 0.26 & 0.18 & 0.15 & 0.37 & 0.29 & 0.18 & 0.51 \\
## 9 & 0.06 & 0.05 & 0.03 & 0.07 & 0.05 & 0.06 & 0.05 & 0.04 \\
## 10 & 0.03 & 0.05 & 0.04 & 0.04 & 0.04 & 0.04 & 0.04 & 0.04 \\
## 11 & 0.06 & 0.07 & 0.10 & 0.07 & 0.04 & 0.05 & 0.05 & 0.06 \\
## 12 & 0.04 & 0.04 & 0.05 & 0.06 & 0.04 & 0.05 & 0.05 & 0.04 \\
## 13 & 0.06 & 0.05 & 0.05 & 0.07 & 0.14 & 0.04 & 0.05 & 0.05 \\
## 14 & 0.04 & 0.05 & 0.03 & 0.05 & 0.04 & 0.10 & 0.07 & 0.05 \\
## 15 & 0.03 & 0.02 & 0.03 & 0.03 & 0.02 & 0.03 & 0.05 & 0.02 \\
## 16 & 0.03 & 0.03 & 0.03 & 0.03 & 0.02 & 0.03 & 0.04 & 0.04 \\
## \hline
```

```
## diagonal equations
```

```
## % latex table generated in R 3.1.0 by xtable 1.7-3 package
```

```
## % Fri Aug 29 16:54:40 2014
```

```
## & Basic Materials & Communications & Consumer, Cyclical & Consumer, Non-cyclical & En
```

```
## \hline
```

```
## 1 & 0.10 & 0.19 & 0.21 & 0.30 & 0.48 & 0.06 & 0.27 & 0.34 \\
## 2 & 0.00 & 0.10 & 0.01 & 0.01 & 0.06 & 0.00 & 0.00 & 0.02 \\
## 3 & 0.00 & 0.52 & 0.65 & 0.40 & 0.68 & 0.10 & 0.10 & 0.35 \\
## 4 & 0.14 & 0.14 & 0.09 & 0.19 & 0.19 & 0.08 & 0.17 & 0.15 \\
## 5 & 0.00 & 0.03 & 0.01 & 0.01 & 0.00 & 0.04 & 0.16 & 0.05 \\
## 6 & 0.57 & 0.35 & 0.28 & 0.31 & 0.10 & 0.61 & 0.41 & 0.37 \\
## 7 & 0.12 & 0.06 & 0.00 & 0.04 & 0.03 & 0.01 & 0.23 & 0.01 \\
## 8 & 0.01 & 0.06 & 0.09 & 0.13 & 0.08 & 0.02 & 0.11 & 0.09 \\
## 9 & 0.00 & 0.00 & 0.00 & 0.00 & 0.00 & 0.00 & 0.00 & 0.00 \\
## 10 & 0.00 & 0.00 & 0.00 & 0.00 & 0.00 & 0.00 & 0.00 & 0.00 \\
## 11 & 0.00 & 0.01 & 0.00 & 0.01 & 0.00 & 0.00 & 0.00 & 0.00 \\
## 12 & 0.00 & 0.01 & 0.00 & 0.01 & 0.01 & 0.00 & 0.01 & 0.01 \\
## 13 & 0.00 & 0.00 & 0.00 & 0.00 & 0.00 & 0.00 & 0.00 & 0.00 \\
## 14 & 0.01 & 0.01 & 0.00 & 0.01 & 0.00 & 0.01 & 0.01 & 0.01 \\
## 15 & 0.00 & 0.01 & 0.00 & 0.01 & 0.00 & 0.00 & 0.01 & 0.01 \\
## 16 & 0.00 & 0.00 & 0.00 & 0.00 & 0.00 & 0.00 & 0.00 & 0.00 \\
## \hline
```

```
## off-diagonal equations
```

```
## % latex table generated in R 3.1.0 by xtable 1.7-3 package
```

```
## % Fri Aug 29 16:54:40 2014
```

```
## & Basic Materials & Communications & Consumer, Cyclical & Consumer, Non-cyclical & En
```

```
## \hline
```

```
## 1 & 0.69 & 0.89 & 0.94 & 0.78 & 0.75 & 0.90 & 0.75 & 0.77 \\
## 2 & 0.01 & 0.00 & 0.01 & 0.00 & 0.00 & 0.00 & 0.01 & 0.00 \\
## 3 & 0.18 & 0.35 & 0.49 & 0.26 & 0.09 & 0.10 & 0.14 & 0.24 \\
## 4 & 0.29 & 0.40 & 0.42 & 0.34 & 0.29 & 0.41 & 0.35 & 0.39 \\
## 5 & 0.39 & 0.13 & 0.11 & 0.05 & 0.05 & 0.38 & 0.26 & 0.15 \\
## 6 & 0.62 & 0.63 & 0.61 & 0.52 & 0.17 & 0.70 & 0.63 & 0.57 \\
## 7 & 0.05 & 0.01 & 0.02 & 0.01 & 0.02 & 0.02 & 0.05 & 0.00 \\
## 8 & 0.42 & 0.45 & 0.50 & 0.42 & 0.38 & 0.44 & 0.40 & 0.37 \\
## 9 & 0.01 & 0.01 & 0.02 & 0.01 & 0.00 & 0.03 & 0.01 & 0.01 \\
## 10 & 0.00 & 0.00 & 0.00 & 0.00 & 0.00 & 0.00 & 0.00 & 0.00 \\
##
```

```
## 11 & 0.00 & 0.01 & 0.01 & 0.01 & 0.00 & 0.01 & 0.00 & 0.00 \\  
## 12 & 0.05 & 0.05 & 0.04 & 0.05 & 0.05 & 0.05 & 0.05 & 0.05 \\  
## 13 & 0.02 & 0.03 & 0.05 & 0.03 & 0.01 & 0.07 & 0.03 & 0.03 \\  
## 14 & 0.02 & 0.02 & 0.02 & 0.02 & 0.03 & 0.05 & 0.02 & 0.02 \\  
## 15 & 0.04 & 0.06 & 0.06 & 0.06 & 0.03 & 0.05 & 0.04 & 0.04 \\  
## 16 & 0.02 & 0.03 & 0.04 & 0.02 & 0.02 & 0.04 & 0.02 & 0.02 \\  
## \hline
```