

Table 1: Coverage(Valid)

$\gamma \backslash \rho$	0	0.05	0.10	0.15	0.20	0.25	0.30	0.35	0.40
0.0	0.98	0.98	0.98	0.98	0.98	0.98	0.98	0.98	0.98
0.1	0.99	0.98	0.98	0.98	0.99	0.98	0.98	0.98	0.98
0.2	0.98	0.99	0.98	0.98	0.98	0.98	0.98	0.98	0.98
0.3	0.98	0.99	0.99	0.98	0.99	0.98	0.98	0.98	0.98
0.4	0.98	0.99	0.99	0.99	0.99	0.98	0.99	0.99	0.98
0.5	0.99	0.98	0.99	0.99	0.99	0.99	0.98	0.99	0.99
0.6	0.99	0.99	0.99	0.99	0.99	0.99	0.99	0.99	0.99
0.7	0.99	0.99	0.99	0.99	0.99	0.99	0.99	0.99	0.99
0.8	0.99	0.99	0.99	0.99	0.99	0.99	0.99	0.99	0.99
0.9	0.99	0.99	0.99	0.99	0.99	0.99	0.99	0.99	0.99
1.0	0.99	0.99	0.99	0.99	0.99	0.99	0.99	0.99	0.99
1.1	0.99	0.99	0.99	0.99	0.99	0.99	0.99	0.99	0.99
1.2	0.99	0.99	0.99	0.99	0.99	0.99	0.99	0.99	0.99
1.3	0.99	0.99	0.99	0.99	0.99	0.99	0.99	0.99	0.99

Table 2: Coverage(Full)

$\gamma \backslash \rho$	0	0.05	0.10	0.15	0.20	0.25	0.30	0.35	0.40
0.0	0.98	0.98	0.97	0.97	0.96	0.95	0.94	0.92	0.89
0.1	0.98	0.98	0.98	0.97	0.97	0.96	0.95	0.93	0.91
0.2	0.96	0.97	0.97	0.97	0.97	0.96	0.95	0.94	0.92
0.3	0.95	0.96	0.96	0.96	0.96	0.96	0.95	0.94	0.92
0.4	0.94	0.95	0.96	0.95	0.95	0.95	0.95	0.94	0.94
0.5	0.93	0.94	0.95	0.95	0.95	0.95	0.95	0.94	0.94
0.6	0.94	0.94	0.95	0.94	0.94	0.95	0.94	0.94	0.94
0.7	0.93	0.94	0.94	0.94	0.94	0.94	0.94	0.94	0.94
0.8	0.94	0.93	0.94	0.94	0.94	0.94	0.94	0.94	0.93
0.9	0.94	0.94	0.93	0.94	0.94	0.94	0.94	0.93	0.93
1.0	0.93	0.94	0.93	0.94	0.93	0.93	0.94	0.94	0.94
1.1	0.93	0.93	0.94	0.93	0.93	0.93	0.94	0.93	0.94
1.2	0.93	0.93	0.93	0.93	0.94	0.93	0.93	0.94	0.93
1.3	0.93	0.93	0.93	0.93	0.93	0.93	0.93	0.93	0.93

Table 3: Coverage(FMSC)

$\gamma \backslash \rho$	0	0.05	0.10	0.15	0.20	0.25	0.30	0.35	0.40
0.0	0.98	0.97	0.97	0.97	0.97	0.97	0.96	0.97	0.96
0.1	0.98	0.98	0.98	0.97	0.97	0.96	0.96	0.95	0.95
0.2	0.96	0.97	0.97	0.97	0.97	0.96	0.95	0.94	0.93
0.3	0.96	0.96	0.96	0.96	0.96	0.95	0.94	0.92	0.91
0.4	0.95	0.96	0.96	0.95	0.95	0.95	0.94	0.92	0.91
0.5	0.94	0.94	0.95	0.95	0.95	0.94	0.93	0.92	0.89
0.6	0.93	0.94	0.94	0.94	0.94	0.94	0.93	0.92	0.90
0.7	0.93	0.94	0.94	0.94	0.94	0.93	0.93	0.92	0.89
0.8	0.92	0.93	0.93	0.94	0.94	0.94	0.93	0.92	0.90
0.9	0.91	0.92	0.93	0.94	0.93	0.94	0.93	0.92	0.90
1.0	0.91	0.92	0.92	0.93	0.93	0.93	0.93	0.92	0.90
1.1	0.90	0.91	0.93	0.93	0.93	0.93	0.93	0.91	0.90
1.2	0.90	0.91	0.92	0.92	0.93	0.93	0.93	0.92	0.90
1.3	0.90	0.91	0.92	0.93	0.93	0.93	0.92	0.91	0.90

Table 4: Coverage(BIC)

$\gamma \backslash \rho$	0	0.05	0.10	0.15	0.20	0.25	0.30	0.35	0.40
0.0	0.98	0.97	0.97	0.97	0.96	0.95	0.94	0.94	0.92
0.1	0.98	0.97	0.97	0.97	0.96	0.96	0.95	0.93	0.92
0.2	0.96	0.97	0.97	0.97	0.96	0.96	0.95	0.93	0.91
0.3	0.95	0.96	0.96	0.96	0.96	0.95	0.94	0.92	0.91
0.4	0.95	0.96	0.95	0.95	0.95	0.94	0.94	0.92	0.92
0.5	0.94	0.94	0.95	0.95	0.95	0.94	0.93	0.93	0.91
0.6	0.94	0.94	0.95	0.94	0.94	0.94	0.93	0.93	0.91
0.7	0.93	0.94	0.94	0.94	0.93	0.93	0.93	0.92	0.91
0.8	0.93	0.93	0.94	0.94	0.94	0.94	0.93	0.92	0.90
0.9	0.93	0.93	0.93	0.94	0.93	0.94	0.93	0.92	0.90
1.0	0.92	0.93	0.93	0.94	0.93	0.93	0.93	0.92	0.90
1.1	0.91	0.93	0.93	0.94	0.93	0.94	0.93	0.92	0.91
1.2	0.92	0.93	0.93	0.93	0.94	0.93	0.93	0.93	0.91
1.3	0.92	0.92	0.93	0.93	0.94	0.93	0.93	0.92	0.91

Table 5: Coverage(AIC)

$\gamma \backslash \rho$	0	0.05	0.10	0.15	0.20	0.25	0.30	0.35	0.40
0.0	0.97	0.97	0.97	0.97	0.96	0.96	0.95	0.95	0.94
0.1	0.98	0.97	0.97	0.96	0.96	0.95	0.95	0.94	0.94
0.2	0.96	0.97	0.96	0.96	0.96	0.95	0.94	0.92	0.91
0.3	0.96	0.97	0.96	0.95	0.96	0.94	0.93	0.90	0.90
0.4	0.95	0.96	0.96	0.95	0.94	0.93	0.92	0.90	0.89
0.5	0.94	0.95	0.95	0.95	0.95	0.93	0.92	0.90	0.87
0.6	0.94	0.94	0.95	0.95	0.95	0.94	0.91	0.90	0.88
0.7	0.93	0.94	0.94	0.95	0.94	0.93	0.92	0.90	0.88
0.8	0.92	0.93	0.94	0.95	0.94	0.94	0.92	0.90	0.86
0.9	0.91	0.93	0.94	0.94	0.94	0.94	0.92	0.90	0.87
1.0	0.91	0.93	0.94	0.94	0.94	0.93	0.92	0.91	0.87
1.1	0.90	0.92	0.94	0.95	0.94	0.94	0.93	0.90	0.88
1.2	0.91	0.92	0.93	0.94	0.95	0.93	0.93	0.92	0.89
1.3	0.90	0.92	0.93	0.94	0.94	0.94	0.93	0.90	0.88

Table 6: Coverage(HQ)

$\gamma \backslash \rho$	0	0.05	0.10	0.15	0.20	0.25	0.30	0.35	0.40
0.0	0.97	0.97	0.97	0.97	0.96	0.95	0.95	0.94	0.94
0.1	0.98	0.97	0.97	0.96	0.96	0.96	0.94	0.94	0.93
0.2	0.96	0.97	0.96	0.96	0.96	0.95	0.94	0.93	0.91
0.3	0.96	0.97	0.96	0.95	0.96	0.94	0.93	0.91	0.91
0.4	0.95	0.96	0.96	0.95	0.94	0.94	0.93	0.91	0.90
0.5	0.94	0.94	0.95	0.95	0.95	0.93	0.92	0.91	0.89
0.6	0.94	0.94	0.95	0.94	0.94	0.94	0.92	0.91	0.89
0.7	0.93	0.94	0.94	0.95	0.94	0.93	0.92	0.91	0.89
0.8	0.92	0.93	0.94	0.94	0.94	0.94	0.92	0.91	0.88
0.9	0.92	0.93	0.93	0.94	0.94	0.94	0.92	0.90	0.88
1.0	0.91	0.93	0.93	0.94	0.93	0.93	0.92	0.91	0.89
1.1	0.90	0.92	0.94	0.94	0.94	0.94	0.92	0.91	0.89
1.2	0.91	0.92	0.93	0.93	0.94	0.93	0.92	0.92	0.90
1.3	0.91	0.92	0.93	0.94	0.94	0.93	0.93	0.91	0.89

Table 7: Coverage(CC-BIC)

$\gamma \backslash \rho$	0	0.05	0.10	0.15	0.20	0.25	0.30	0.35	0.40
0.0	0.98	0.98	0.98	0.98	0.97	0.97	0.96	0.96	0.95
0.1	0.98	0.98	0.98	0.97	0.97	0.96	0.95	0.94	0.93
0.2	0.97	0.98	0.97	0.97	0.96	0.95	0.94	0.93	0.91
0.3	0.96	0.97	0.97	0.96	0.96	0.96	0.95	0.94	0.93
0.4	0.96	0.96	0.96	0.96	0.95	0.95	0.96	0.95	0.94
0.5	0.94	0.94	0.95	0.95	0.95	0.95	0.95	0.95	0.94
0.6	0.94	0.94	0.95	0.94	0.94	0.95	0.95	0.95	0.94
0.7	0.93	0.94	0.94	0.94	0.94	0.94	0.94	0.94	0.94
0.8	0.94	0.93	0.94	0.94	0.94	0.94	0.94	0.94	0.93
0.9	0.94	0.94	0.93	0.94	0.94	0.94	0.94	0.93	0.93
1.0	0.93	0.94	0.93	0.94	0.93	0.93	0.94	0.94	0.94
1.1	0.93	0.93	0.94	0.93	0.93	0.93	0.94	0.93	0.94
1.2	0.93	0.93	0.93	0.93	0.94	0.93	0.93	0.94	0.93
1.3	0.93	0.93	0.93	0.93	0.93	0.93	0.93	0.93	0.93

Table 8: Coverage(CC-AIC)

$\gamma \backslash \rho$	0	0.05	0.10	0.15	0.20	0.25	0.30	0.35	0.40
0.0	0.98	0.98	0.97	0.97	0.96	0.96	0.95	0.94	0.92
0.1	0.98	0.98	0.98	0.97	0.97	0.96	0.95	0.94	0.92
0.2	0.97	0.98	0.97	0.97	0.97	0.96	0.96	0.94	0.94
0.3	0.96	0.97	0.97	0.96	0.97	0.96	0.96	0.95	0.94
0.4	0.95	0.95	0.96	0.96	0.95	0.95	0.95	0.95	0.94
0.5	0.94	0.94	0.95	0.95	0.95	0.95	0.95	0.94	0.94
0.6	0.94	0.94	0.95	0.94	0.94	0.95	0.94	0.94	0.94
0.7	0.93	0.94	0.94	0.94	0.94	0.94	0.94	0.94	0.94
0.8	0.94	0.93	0.94	0.94	0.94	0.94	0.94	0.94	0.93
0.9	0.94	0.94	0.93	0.94	0.94	0.94	0.94	0.93	0.93
1.0	0.93	0.94	0.93	0.94	0.93	0.93	0.94	0.94	0.94
1.1	0.93	0.93	0.94	0.93	0.93	0.93	0.94	0.93	0.94
1.2	0.93	0.93	0.93	0.93	0.94	0.93	0.93	0.94	0.93
1.3	0.93	0.93	0.93	0.93	0.93	0.93	0.93	0.93	0.93

Table 9: Coverage(CC-HQ)

$\gamma \backslash \rho$	0	0.05	0.10	0.15	0.20	0.25	0.30	0.35	0.40
0.0	0.98	0.98	0.97	0.98	0.97	0.96	0.95	0.95	0.93
0.1	0.98	0.98	0.98	0.97	0.97	0.96	0.95	0.93	0.92
0.2	0.97	0.98	0.97	0.97	0.97	0.96	0.95	0.94	0.93
0.3	0.96	0.97	0.97	0.96	0.97	0.96	0.96	0.95	0.94
0.4	0.95	0.96	0.96	0.96	0.95	0.95	0.95	0.95	0.94
0.5	0.94	0.94	0.95	0.95	0.95	0.95	0.95	0.95	0.94
0.6	0.94	0.94	0.95	0.94	0.94	0.95	0.95	0.95	0.94
0.7	0.93	0.94	0.94	0.94	0.94	0.94	0.94	0.94	0.94
0.8	0.94	0.93	0.94	0.94	0.94	0.94	0.94	0.94	0.93
0.9	0.94	0.94	0.93	0.94	0.94	0.94	0.94	0.93	0.93
1.0	0.93	0.94	0.93	0.94	0.93	0.93	0.94	0.94	0.94
1.1	0.93	0.93	0.94	0.93	0.93	0.93	0.94	0.93	0.94
1.2	0.93	0.93	0.93	0.93	0.94	0.93	0.93	0.94	0.93
1.3	0.93	0.93	0.93	0.93	0.93	0.93	0.93	0.93	0.93

Table 10: Coverage(J 90)

$\gamma \backslash \rho$	0	0.05	0.10	0.15	0.20	0.25	0.30	0.35	0.40
0.0	0.98	0.97	0.97	0.97	0.96	0.95	0.94	0.93	0.92
0.1	0.98	0.98	0.98	0.97	0.97	0.96	0.95	0.94	0.92
0.2	0.96	0.97	0.97	0.97	0.96	0.96	0.95	0.93	0.92
0.3	0.96	0.96	0.96	0.96	0.96	0.95	0.95	0.93	0.92
0.4	0.95	0.96	0.96	0.96	0.95	0.95	0.95	0.93	0.92
0.5	0.94	0.94	0.95	0.95	0.95	0.95	0.94	0.93	0.92
0.6	0.94	0.94	0.95	0.94	0.94	0.95	0.94	0.93	0.92
0.7	0.93	0.94	0.94	0.94	0.94	0.93	0.94	0.93	0.92
0.8	0.94	0.94	0.94	0.94	0.94	0.94	0.93	0.93	0.92
0.9	0.93	0.94	0.93	0.94	0.94	0.94	0.93	0.93	0.91
1.0	0.93	0.93	0.93	0.94	0.93	0.94	0.94	0.93	0.92
1.1	0.92	0.93	0.94	0.94	0.94	0.94	0.94	0.92	0.92
1.2	0.93	0.93	0.93	0.93	0.94	0.93	0.93	0.93	0.92
1.3	0.92	0.93	0.93	0.94	0.94	0.93	0.93	0.93	0.92

Table 11: Coverage(J 95)

$\gamma \backslash \rho$	0	0.05	0.10	0.15	0.20	0.25	0.30	0.35	0.40
0.0	0.98	0.97	0.97	0.97	0.96	0.95	0.94	0.93	0.91
0.1	0.98	0.98	0.98	0.97	0.97	0.96	0.95	0.93	0.92
0.2	0.96	0.97	0.97	0.97	0.97	0.96	0.95	0.94	0.92
0.3	0.95	0.96	0.96	0.96	0.96	0.96	0.95	0.94	0.92
0.4	0.95	0.95	0.95	0.96	0.95	0.95	0.95	0.94	0.93
0.5	0.94	0.94	0.95	0.95	0.95	0.95	0.94	0.94	0.93
0.6	0.94	0.94	0.95	0.94	0.94	0.95	0.94	0.94	0.93
0.7	0.93	0.94	0.94	0.94	0.94	0.93	0.94	0.94	0.93
0.8	0.94	0.94	0.94	0.94	0.94	0.94	0.94	0.93	0.93
0.9	0.93	0.94	0.93	0.94	0.93	0.94	0.93	0.93	0.92
1.0	0.93	0.94	0.93	0.94	0.93	0.93	0.94	0.93	0.93
1.1	0.93	0.93	0.94	0.94	0.93	0.94	0.94	0.93	0.93
1.2	0.93	0.93	0.93	0.93	0.94	0.93	0.93	0.94	0.93
1.3	0.93	0.93	0.93	0.94	0.93	0.93	0.93	0.93	0.93

Table 12: Coverage(CC-MS-C-BIC)

$\gamma \backslash \rho$	0	0.05	0.10	0.15	0.20	0.25	0.30	0.35	0.40
0.0	0.98	0.98	0.98	0.98	0.97	0.97	0.97	0.97	0.96
0.1	0.98	0.98	0.98	0.97	0.97	0.96	0.95	0.95	0.94
0.2	0.97	0.98	0.97	0.96	0.96	0.95	0.93	0.91	0.90
0.3	0.96	0.97	0.96	0.96	0.96	0.94	0.93	0.90	0.89
0.4	0.95	0.96	0.96	0.95	0.95	0.94	0.93	0.91	0.90
0.5	0.94	0.95	0.95	0.95	0.95	0.94	0.93	0.92	0.90
0.6	0.94	0.94	0.95	0.94	0.94	0.94	0.93	0.93	0.91
0.7	0.93	0.94	0.94	0.94	0.94	0.93	0.93	0.92	0.90
0.8	0.93	0.93	0.94	0.94	0.94	0.94	0.93	0.92	0.90
0.9	0.93	0.93	0.93	0.94	0.93	0.94	0.93	0.92	0.90
1.0	0.92	0.93	0.93	0.94	0.93	0.93	0.93	0.92	0.90
1.1	0.91	0.93	0.93	0.94	0.93	0.94	0.93	0.92	0.91
1.2	0.92	0.93	0.93	0.93	0.94	0.93	0.93	0.93	0.91
1.3	0.92	0.92	0.93	0.93	0.94	0.93	0.93	0.92	0.91

Table 13: Coverage(CC-MS-C-AIC)

$\gamma \backslash \rho$	0	0.05	0.10	0.15	0.20	0.25	0.30	0.35	0.40
0.0	0.98	0.98	0.97	0.97	0.97	0.96	0.96	0.96	0.95
0.1	0.98	0.97	0.97	0.97	0.96	0.95	0.95	0.94	0.94
0.2	0.97	0.97	0.97	0.96	0.96	0.94	0.93	0.92	0.90
0.3	0.96	0.97	0.96	0.95	0.96	0.94	0.92	0.90	0.89
0.4	0.96	0.96	0.96	0.95	0.94	0.93	0.92	0.89	0.88
0.5	0.94	0.95	0.95	0.95	0.95	0.93	0.92	0.90	0.87
0.6	0.94	0.94	0.95	0.95	0.95	0.94	0.91	0.90	0.88
0.7	0.93	0.94	0.94	0.95	0.94	0.93	0.92	0.90	0.88
0.8	0.92	0.93	0.94	0.95	0.94	0.94	0.92	0.90	0.86
0.9	0.91	0.93	0.94	0.94	0.94	0.94	0.92	0.90	0.87
1.0	0.91	0.93	0.94	0.94	0.94	0.93	0.92	0.91	0.87
1.1	0.90	0.92	0.94	0.95	0.94	0.94	0.93	0.90	0.88
1.2	0.91	0.92	0.93	0.94	0.95	0.93	0.93	0.92	0.89
1.3	0.90	0.92	0.93	0.94	0.94	0.94	0.93	0.90	0.88

Table 14: Coverage(CC-MS-C-HQ)

$\gamma \backslash \rho$	0	0.05	0.10	0.15	0.20	0.25	0.30	0.35	0.40
0.0	0.98	0.98	0.97	0.98	0.97	0.97	0.96	0.96	0.95
0.1	0.98	0.97	0.97	0.97	0.97	0.95	0.95	0.94	0.94
0.2	0.97	0.98	0.97	0.96	0.96	0.94	0.93	0.91	0.90
0.3	0.96	0.97	0.96	0.95	0.96	0.94	0.92	0.89	0.89
0.4	0.95	0.96	0.96	0.95	0.94	0.93	0.93	0.90	0.89
0.5	0.94	0.95	0.95	0.95	0.95	0.93	0.92	0.91	0.88
0.6	0.94	0.94	0.95	0.94	0.94	0.94	0.92	0.91	0.89
0.7	0.93	0.94	0.94	0.95	0.94	0.93	0.92	0.91	0.89
0.8	0.92	0.93	0.94	0.94	0.94	0.94	0.92	0.91	0.88
0.9	0.92	0.93	0.93	0.94	0.94	0.94	0.92	0.90	0.88
1.0	0.91	0.93	0.93	0.94	0.93	0.93	0.92	0.91	0.89
1.1	0.90	0.92	0.94	0.94	0.94	0.94	0.92	0.91	0.89
1.2	0.91	0.92	0.93	0.93	0.94	0.93	0.92	0.92	0.90
1.3	0.91	0.92	0.93	0.94	0.94	0.93	0.93	0.91	0.89