Diebold-Mariano Test p-values (gross returns)

	LinearRegression	Ridge	LogisticRegression	RandomForest	LightGBM	MLP	LSTM	MomentumBaseline	MeanReversionBaseline	BuyAndHold_SPY	EqualWeight	Ensemble
LinearRegression		1.00	0.83	0.77	0.58	0.65	0.15	0.65	0.21	0.40	0.98	0.74
Ridge	1.00		0.83	0.77	0.58	0.65	0.15	0.65	0.21	0.40	0.98	0.74
LogisticRegression	0.83	0.83		0.70	0.54	0.58	0.15	0.59	0.20	0.43	0.94	0.64
RandomForest	0.77	0.77	0.70		0.86	0.87	0.28	0.80	0.30	0.27	0.79	0.89
LightGBM	0.58	0.58	0.54	0.86		0.98	0.32	0.87	0.33	0.20	0.67	0.72
MLP	0.65	0.65	0.58	0.87	0.98		0.27	0.87	0.40	0.18	0.65	0.75
LSTM	0.15	0.15	0.15	0.28	0.32	0.27		0.60	0.98	0.03	0.17	0.16
MomentumBaseline	0.65	0.65	0.59	0.80	0.87	0.87	0.60		0.69	0.25	0.63	0.76
MeanReversionBaseline	0.21	0.21	0.20	0.30	0.33	0.40	0.98	0.69		0.05	0.20	0.25
BuyAndHold_SPY	0.40	0.40	0.43	0.27	0.20	0.18	0.03	0.25	0.05		0.00	0.30
EqualWeight	0.98	0.98	0.94	0.79	0.67	0.65	0.17	0.63	0.20	0.00		0.86
Ensemble	0.74	0.74	0.64	0.89	0.72	0.75	0.16	0.76	0.25	0.30	0.86	