

	Lasso 1	Lasso 2	Lasso 3	Lasso 4	Lasso 5	Lasso 6	Lasso 7	Exp Lasso
<i>y.lag1</i>	<i>0</i>	<i>1</i>	<i>1</i>	<i>1</i>	<i>1</i>	<i>1</i>	<i>0</i>	<i>1</i>
<i>D.y.lags</i>	<i>0</i>	<i>4</i>	<i>4</i>	<i>3</i>	<i>2</i>	<i>1</i>	<i>4</i>	<i>0</i>
<i>I(0).lags</i>	<i>1</i>	<i>1</i>	<i>4</i>	<i>3</i>	<i>2</i>	<i>1</i>	<i>4</i>	<i>0</i>
<i>D.I(1).lags</i>	<i>0</i>	<i>0</i>	<i>4</i>	<i>3</i>	<i>2</i>	<i>1</i>	<i>4</i>	<i>0</i>
<i>D2.I(2).lags</i>	<i>0</i>	<i>0</i>	<i>4</i>	<i>3</i>	<i>2</i>	<i>1</i>	<i>4</i>	<i>0</i>
<i>I(1).lags</i>	<i>1</i>	<i>1</i>	<i>0</i>	<i>0</i>	<i>0</i>	<i>0</i>	<i>1</i>	<i>1</i>
<i>D.I(2).lags</i>	<i>1</i>	<i>1</i>	<i>0</i>	<i>0</i>	<i>0</i>	<i>0</i>	<i>1</i>	<i>1</i>
<i>#obs</i>	<i>222</i>	<i>219</i>	<i>218</i>	<i>219</i>	<i>220</i>	<i>221</i>	<i>218</i>	<i>222</i>
<i>#regressors</i>	<i>144</i>	<i>149</i>	<i>581</i>	<i>436</i>	<i>291</i>	<i>146</i>	<i>697</i>	<i>118</i>
<i>Fixed Lambda</i>	<i>0.1496</i>	<i>0.1512</i>	<i>0.1709</i>	<i>0.1666</i>	<i>0.1606</i>	<i>0.1502</i>	<i>0.1733</i>	<i>0.1466</i>
<i>MSE.in</i>	<i>0.70394</i>	<i>0.68511</i>	<i>0.59452</i>	<i>0.5988</i>	<i>0.59731</i>	<i>0.59671</i>	<i>0.59658</i>	<i>0.90665</i>
<i>MSE.out</i>	<i>0.71125</i>	<i>0.70475</i>	<i>0.41947</i>	<i>0.41371</i>	<i>0.4033</i>	<i>0.40026</i>	<i>0.42094</i>	<i>1.08194</i>
Ch. Inv/GDP.lag1	-0.001404	-0.007523	NA	NA	NA	NA	NA	NA
IP: Dur gds	-0.041608	-0.042871	NA	NA	NA	NA	NA	NA
materials.lag1								
NAPM:ORD.lag1	0.161538	0.175867	NA	0.013054	0.018576	0.022809	NA	NA
CP_TBILL Spread.lag1	-0.195966	-0.194832	-0.211758	-0.216275	-0.229112	-0.225926	-0.210526	NA
Ex rate: major.lag1	0.012483	0.00371	NA	NA	NA	NA	NA	0.012359
Cons.	0.112129	0.114151	0.002281	NA	NA	0.00028	0.001233	NA
Expectations.lag1								
UnfOrders(DurGds).lag1	NA	-0.016925	NA	NA	NA	NA	NA	-0.097738
Cons:Svc.lag1	NA	NA	0.170811	0.180467	0.185114	0.186698	0.169486	NA
FixedInv:Res.lag1	NA	NA	0.147035	0.14416	0.136704	0.144938	0.146297	NA
IP: Nondur gds	NA	NA	0.047512	0.042703	0.030665	0.035573	0.046519	NA
materials.lag1								
Emp:SlackWk.lag1	NA	NA	-0.016461	NA	NA	NA	-0.015824	NA
CPI_LFE.lag2	NA	NA	NA	-0.000116	-0.007582	NA	NA	NA
S&P 500.lag1	NA	NA	NA	NA	NA	4.3e-05	NA	NA
DJIA.lag1	NA	NA	NA	NA	NA	0.001689	NA	NA
PCED_OthNDurGds.lag1	NA	NA	NA	NA	NA	NA	NA	-0.048735
CPI_LFE.lag1	NA	NA	NA	NA	NA	NA	NA	-0.043818
Real_Price:Oil.lag1	NA	NA	NA	NA	NA	NA	NA	-0.024265