

ADF	Var.2	Lasso 1	Lasso 2	Lasso 5	Lasso 6	Lasso 7	Lasso 8	Lasso 9
	<i>y.lag1</i>	<i>0</i>	<i>1</i>	<i>1</i>	<i>1</i>	<i>0</i>	<i>0</i>	<i>0</i>
	<i>D.y.lags</i>	<i>0</i>	<i>4</i>	<i>2</i>	<i>1</i>	<i>4</i>	<i>0</i>	<i>0</i>
	<i>I(0).lags</i>	<i>1</i>	<i>1</i>	<i>2</i>	<i>1</i>	<i>4</i>	<i>1</i>	<i>4</i>
	<i>D.I(1).lags</i>	<i>0</i>	<i>0</i>	<i>2</i>	<i>1</i>	<i>4</i>	<i>0</i>	<i>4</i>
	<i>D2.I(2).lags</i>	<i>0</i>	<i>0</i>	<i>2</i>	<i>1</i>	<i>4</i>	<i>0</i>	<i>4</i>
	<i>I(1).lags</i>	<i>1</i>	<i>1</i>	<i>0</i>	<i>0</i>	<i>1</i>	<i>1</i>	<i>4</i>
	<i>D.I(2).lags</i>	<i>1</i>	<i>1</i>	<i>0</i>	<i>0</i>	<i>1</i>	<i>1</i>	<i>4</i>
	<i>#obs</i>	<i>222</i>	<i>219</i>	<i>220</i>	<i>221</i>	<i>218</i>	<i>222</i>	<i>218</i>
	<i>#regressors</i>	<i>144</i>	<i>149</i>	<i>291</i>	<i>146</i>	<i>712</i>	<i>141</i>	<i>701</i>
	<i>Fixed Lambda</i>	<i>0.1496</i>	<i>0.1512</i>	<i>0.1606</i>	<i>0.1502</i>	<i>0.1736</i>	<i>0.1493</i>	<i>0.1734</i>
	<i>MSE.in</i>	<i>0.70411</i>	<i>0.68589</i>	<i>0.59677</i>	<i>0.59622</i>	<i>0.59605</i>	<i>0.74641</i>	<i>0.6251</i>
	<i>MSE.out</i>	<i>0.71127</i>	<i>0.70478</i>	<i>0.40269</i>	<i>0.40021</i>	<i>0.42093</i>	<i>0.7173</i>	<i>0.60294</i>
0	Ch. Inv/GDP.lag1	-0.001141	-0.007624	NA	NA	NA	-0.051336	NA
1	IP: Dur gds	-0.039385	-0.026835	NA	NA	NA	NA	NA
	materials.level.lag1							
0	NAPM:ORD.lag1	0.16236	0.176353	0.017495	0.022724	NA	0.241731	0.027814
0	CP_TBILL Spread.lag1	-0.195691	-0.194012	-0.228155	-0.225425	-0.209559	NA	NA
0	Ex rate: major.level.lag1	0.01477	0.006054	NA	NA	NA	NA	NA
1	Cons. Expectations.lag1	0.111206	0.109475	NA	NA	0.000174	0.172487	0.049802
1	UnfOrders(DurGds).level.lag1	NA	-0.033004	NA	NA	NA	NA	-0.03766
0	Cons:Svc.lag1	NA	NA	0.186365	0.187835	0.170904	NA	0.168982
0	FixedInv:Res.lag1	NA	NA	0.139126	0.146951	0.147944	NA	0.188342
0	IP: Nondur gds materials.lag1	NA	NA	0.031471	0.035677	0.047378	NA	0.064345
0	Emp:SlackWk.lag1	NA	NA	NA	NA	-0.015472	NA	-0.016769
0	CPI_LFE.lag2	NA	NA	-0.006863	NA	NA	NA	NA
0	S&P 500.lag1	NA	NA	NA	0.000865	NA	NA	0.030307
0	DJIA.lag1	NA	NA	NA	0.000148	NA	NA	NA
1	Emp: Const.level.lag1	NA	NA	NA	NA	NA	-0.001799	NA