

实例：上证指数预测 与 GDP增长率预测

2025年7月13日 9:06

上证指数预测。

剔除异常值再建模。

然对于上证指数这种波动大数值，时间序列分析并不能很好的对数据进行预测。

GDP增长率预测。

1. 绘制序列图，作出对模型选择的初步分析（加分）。



2. SPSS专家建模器。

模型描述

模型类型

模型 ID	GDP增长率	模型_1	ARIMA(0,0,1)
-------	--------	------	--------------

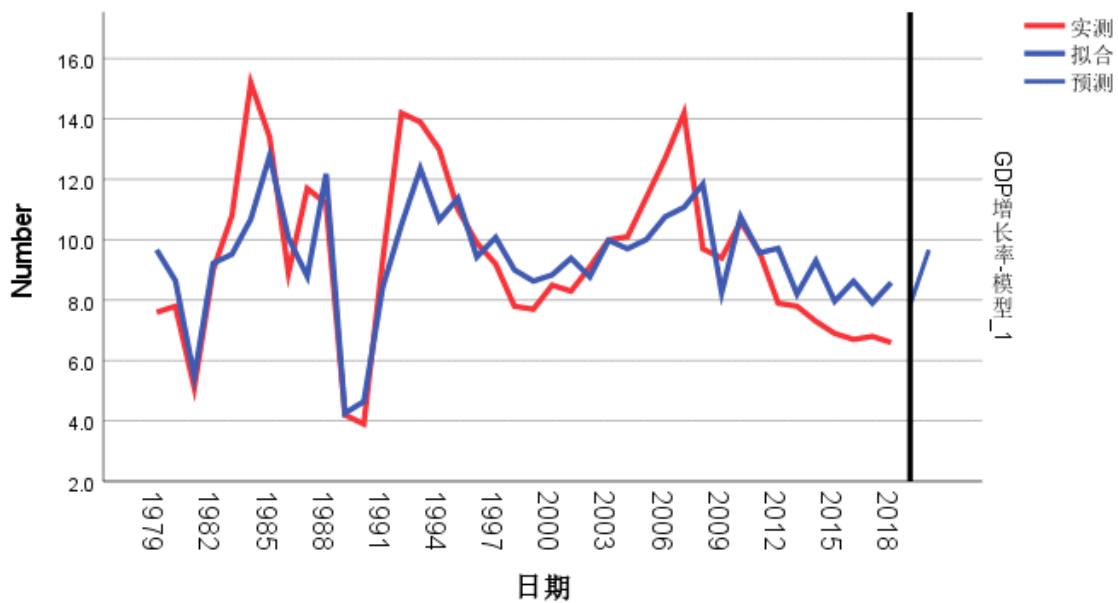
模型统计

模型	预测变量数	模型拟合度统计	杨-博克斯 Q(18)			离群值数
		平稳 R 方	统计	DF	显著性	
GDP增长率-模型_1	0	.731	14.268	17	.648	3

Q检验, $p\text{值}=0.648 > 0.05$ (显著性水平)：无法拒绝原假设，认为残差无自相关性。

平稳R方：越大越好 (趋近1)。

3. 结果解释。



观察SPSS的拟合图，发现与实际值偏差较大。

不要照搬模型（SPSS专家建模的结果并不理想），要结合背景，作出合理的解释。

作者给出的理由：习近平、2014年“不以GDP论英雄”

我认为，GDP预测本身受政策影响大（领导班子都换了三轮）。

解释的理由合理即可（事后诸葛亮）。

预测本身也是极不合理的事情 《反脆弱》。