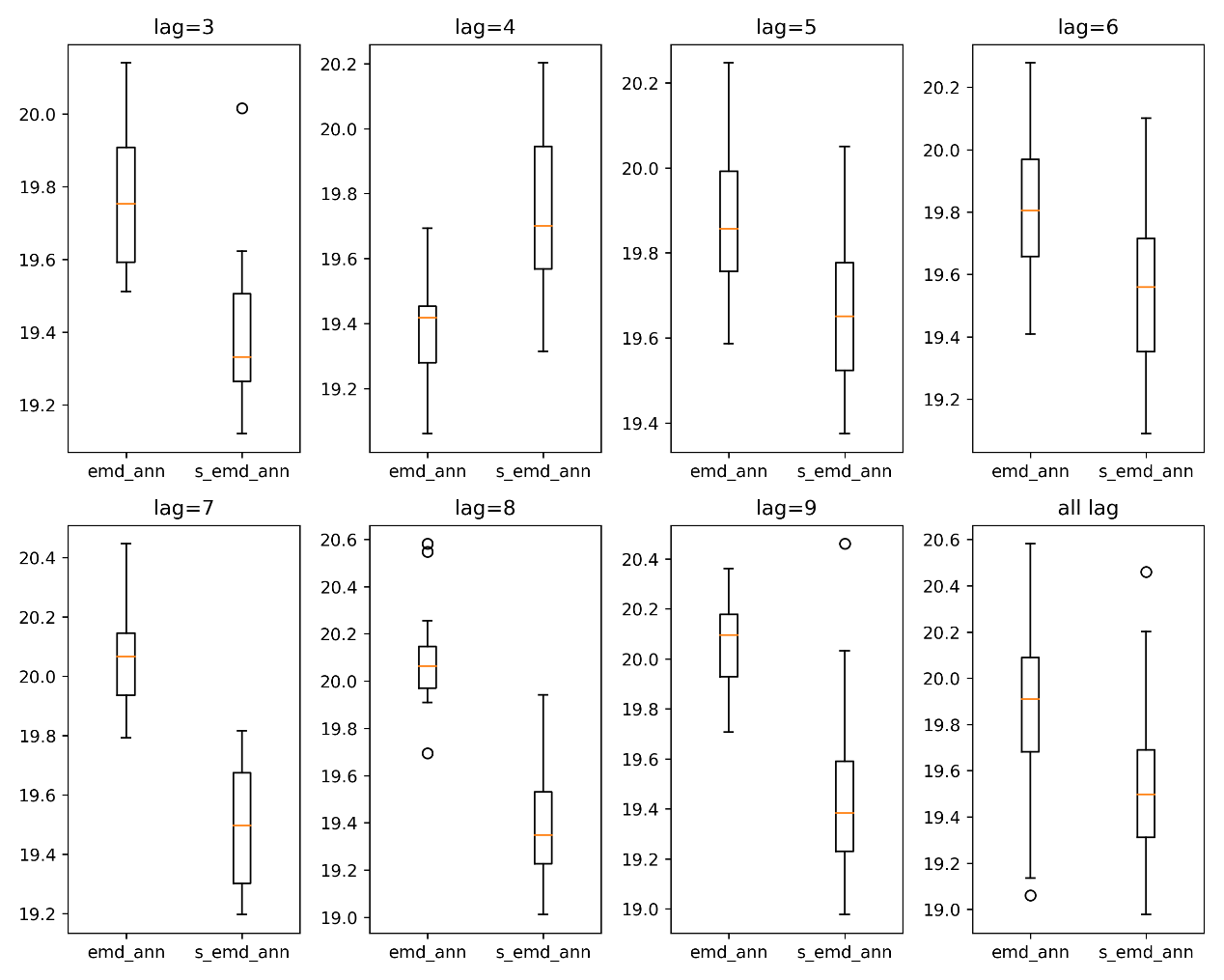
附录1

|  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 数据 | ADF检验 | 自相关检验 | | | | p | q |
| 1 | 2 | 3 | 4 |  |  |
| 上证指数 | 6.56\*10-25 | 2.73\*10-3 | 9.29\*10-5 | 3.71\*10-7 | 4.20\*10-14 | 13 | 9 |
| 标普500 | 0.0 | 4.72\*10-5 | 2.10\*10-6 | 7.49\*10-6 | 9.69\*10-6 | 14 | 2 |

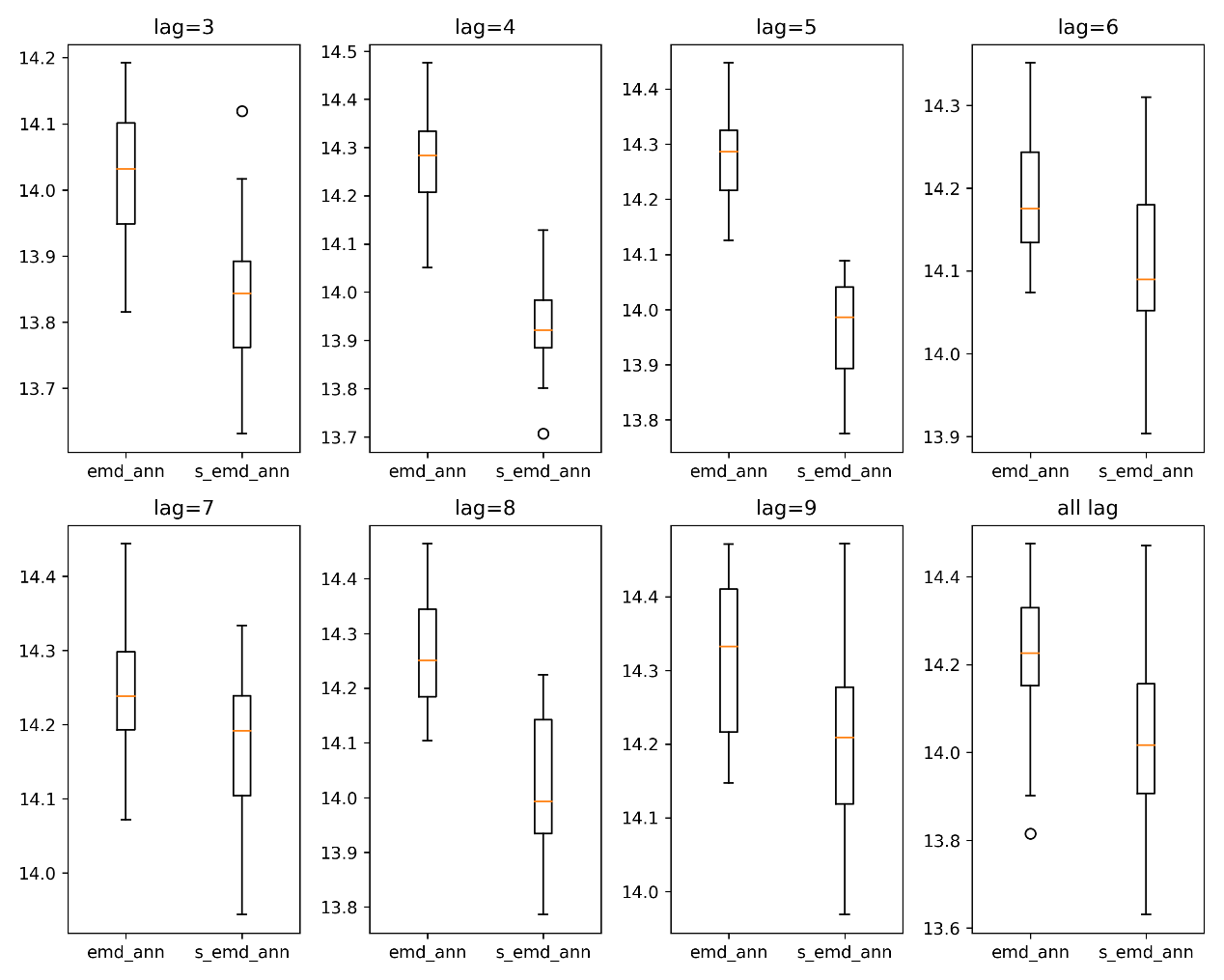
注：表中为ADF检验和自相关检验的p值

从表中ADF检验的p值可以知道差分后的序列是平稳的序列，从自相关检验的p值我们知道差分后的序列不是白噪声序列。

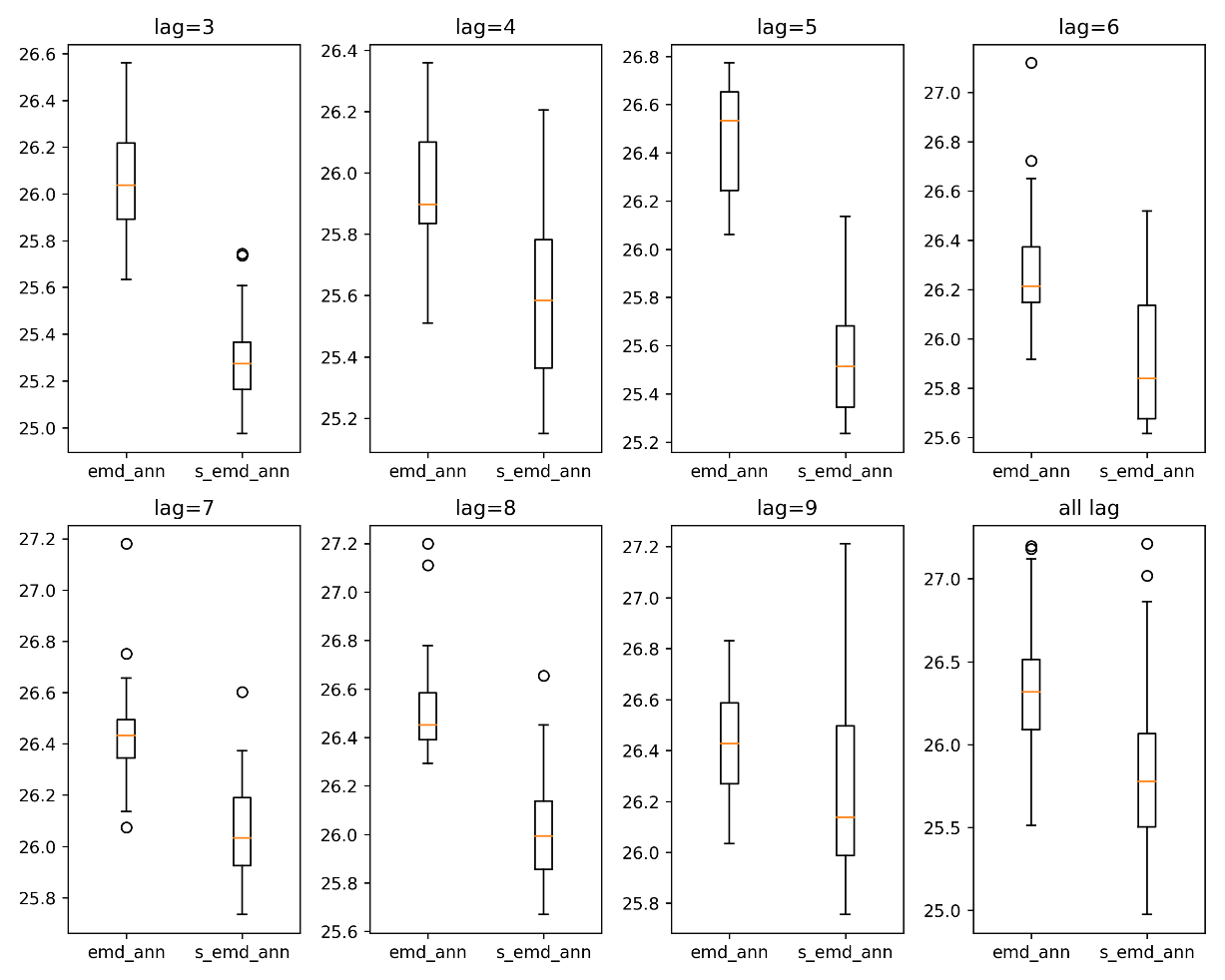
附录2



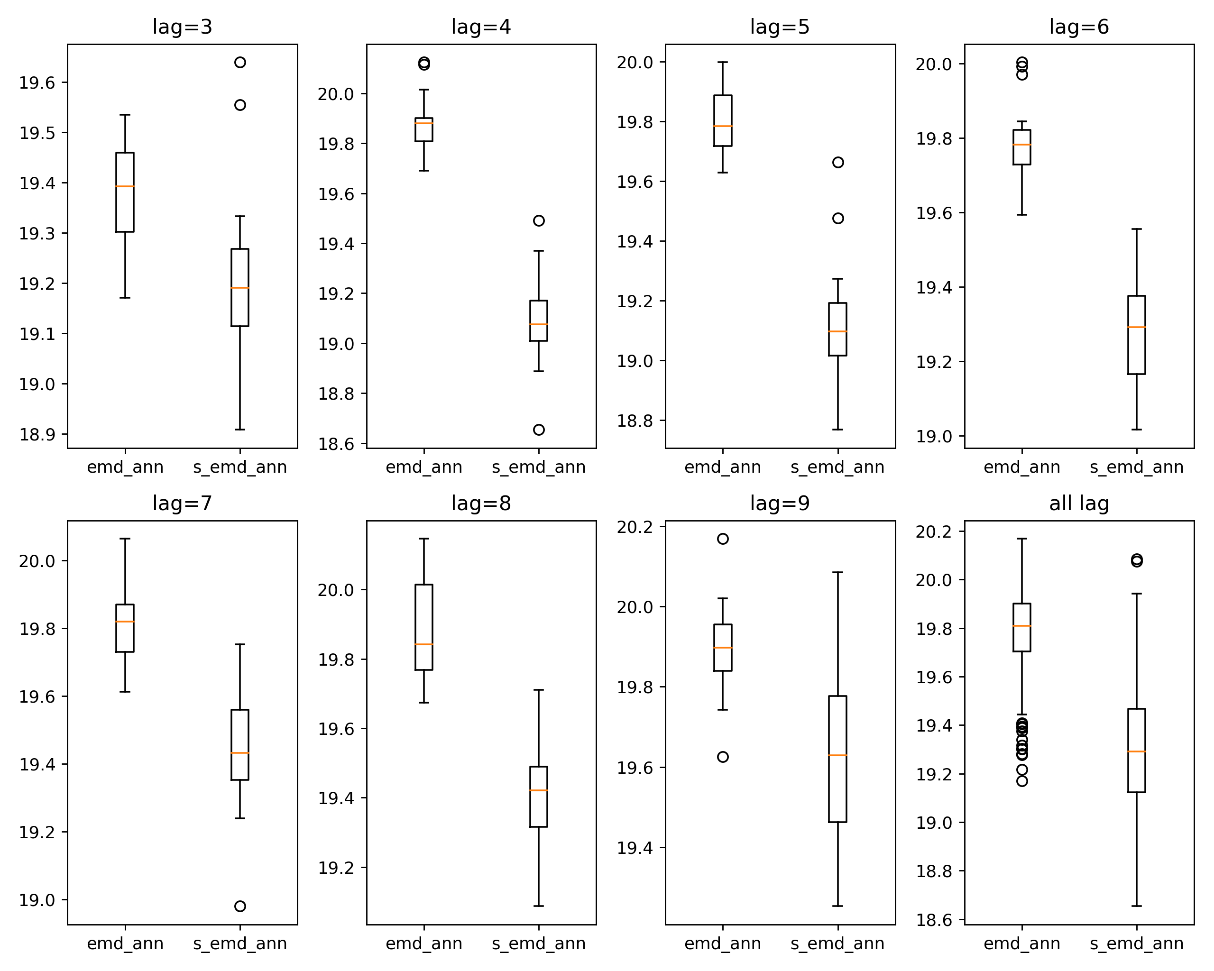
上证指数数据中EMD-ANN与S-EMD-ANN模型的MAE指标值



标普500指数数据中EMD-ANN与S-EMD-ANN模型的MAE指标值



上证指数数据中EMD-ANN与S-EMD-ANN模型RMSE指标值



标普500指数数据中EMD-ANN与S-EMD-ANN模型RMSE指标值