

財務時間序列 HW2

請上網收集 3 個不同洲的國家大盤指數（10 年日資料），與這 3 個國家之間的匯率指數（10 年日資料），並執行以下步驟：

1. 針對每一筆資料，繪製其 time plot, ACF, and PACF 圖
2. 針對每一筆資料，取對數報酬率後，再繪製其 time plot, ACF, and PACF 圖，同時進行 L-B test $Q(10)$ ，看看是否存在序列相關
3. 分別對每一筆資料建立一適合的 AR 模型，並討論是否有 business cycle