

DAFTAR PUSTAKA

- Adityara, E. 2012. Pengaruh Pasar Saham Dunia Terhadap Pasar Saham Indonesia. *Jurnal Etikonomi*, 11(2): 108-125. Tersedia di: <http://journal.uinjkt.ac.id/index.php/etikonomi/article/view/1887> [diakses 28-12-2018].
- Anggraeni, D., A. Prahutama & S. Andari. 2013. Aplikasi *Generalized Space Time Autoregressive* (GSTAR) pada Pemodelan Volume Kendaraan Masuk Tol Semarang. *Jurnal Media Statistik*, 6(2): 71-80. Tersedia di http://ejournal.undip.ac.id/index.php/media_statistika/article/view/7639/6293 [diakses 28-1-2015].
- Badan Pusat Statistik Indonesia. *Data inflasi di berbagai kota di Indonesia*. Tersedia di <http://www.bps.go.id> [diakses 17-1-2018].
- Bain, L.J. & M. Engelhardt. 1992. *Introduction to Probability and Mathematical Statistics*, 2nd edition. USA: Duxbury Thomson Learning.
- Bonar, H. 2017. *Penerapan Model GSTAR-ARCH untuk Peramalan Indeks Harga Konsumen Beberapa Kota di Provinsi Sumatera Utara*. Tesis. Bandung: Universitas Padjadjaran.
- Bonar, H., B.N. Ruchjana & G. Darmawan. 2017. Pemodelan Indeks Harga Konsumen Beberapa Kota di Provinsi Sumatera Utara Menggunakan Model GSTAR – ARCH. *Prosiding SNM, 2017 Statistika dan Aplikasinya*, hal: 627-634.
- Borovkova, S., H.P. Lopuhaa & B.N. Ruchjana. 2002. Generalized STAR Model with Experimental Weights. In Stasinopoulus M., & G.Touloumi (Eds.), *Proceeding of the 17th International Workshop on Statistical Modelling*, Chania, 2002: 143-151. Tersedia di http://www.statmod.org/files/proceedings/iwsm2002_proceedings.pdf [diakses 22-1-2018].
- Borovkova, S., H.P. Lopuhaa & B.N. Ruchjana. 2008. Consistency and Asymptotic Normality of Least Squares Estimators in Generalized STAR Models. *Econometrica*, 62(4): 482-508. Tersedia di http://dutiosc.twi.tudelft.nl/~lopuhaa/homepage/stan_391.pdf [diakses 5-2-2015].
- Engle, R.F. 1982. Autoregressive Conditional Heteroscedasticity with Estimates of the Variance of United Kingdom Inflation. *Journal Compilation Statistica Neerlandica*, 50(4): 987-1008 Tersedia di <http://www.econ.uiuc.edu/~econ536/Papers/engle82.pdf> [diakses 9-9-2017].

- Gujarati, D. N. & D. C. Porter. 1995. *Dasar-dasar Ekonometrika*, 3th edition. Translated By Raden Carlos Mangunsong. 2013. Jakarta: Salemba Empat.
- Hendikawati, P. 2014. *Bahan Ajar Analisis Runtun Waktu*. Semarang: Universitas Negeri Semarang.
- Johnson, R.A. & D.W. Wichern. 2007. *Applied Multivariate Statistical Analysis*, 6th edition. Prentice Hall: New Jersey.
- Juanda, B. & Junaidi. 2012. *Ekonometrika Deret Waktu*. Bogor: PT Penerbit IPB Press.
- Kamarianakis, Y. & P. Prastacos. 2005. Space-Time Modeling of Traffic Flow. *Computers and Geoscience*, Vol. 31: 119-133. Tersedia di http://www.iacm.forth.gr/papers/Kamarianakis_Prastacos_2005_SpatialTimeSeriesModeling_ofTrafficFlow.pdf [diakses 26-2-2018].
- Min X., J. Hu & Z. Zang. 2010. Urban Traffic Network Modeling and Short-term Traffic Flow Forecasting Based on GSTARIMA Model. *Annual Conference on Intelligent Transportation Systems, Madeira Island, Portugal*. Tersedia di <http://ieeexplore.ieee.org/stamp/stamp.jsp?arnumber=5625123> [diakses 9-9-2015].
- Mulyaningsih, T., B.N. Ruchjana & Soemartini. 2012. *Pendekatan Model Time Series Untuk Pemodelan Inflasi Beberapa Kota di Jawa Tengah*. Bandung: Universitas Padjadjaran. Tersedia di <http://pustaka.unpad.ac.id/wp-content/uploads/2015/01/Makalah-Semnas-Tri-Mulyaningsih-140720131.pdf> [diakses 28-1-2015].
- Nachrowi, D.N. & H. Usman. 2006. *Pendekatan Populer dan Praktis Ekonometrika Untuk Analisis Ekonomi dan Keuangan*. Jakarta: Lembaga Penerbit Fakultas Ekonomi Universitas Indonesia.
- Nainggolan, N., B.N. Ruchjana, S.Darwis & R.E. 2010. GSTAR Models with ARCH Errors and The Simulations. *Proceedings of the Third International Conference on Mathematics and Natural Science (ICMNS 2010)*, hal: 1075-1084. Tersedia di https://www.researchgate.net/publication/265159994_GSTAR_MODELS_WITH_ARCH_ERRORS_AND_THE_SIMULATIONS [diakses 2-9-2017].
- Nainggolan, N. 2011. *Pengembangan Model GSTAR dengan Galat ARCH dan Penerapannya pada Inflasi*. Disertasi. Bandung: Universitas Padjadjaran. Tersedia di http://repository.unpad.ac.id/10959/1/disertasi_nelson_pengembangan_model_gstar_dengan_galat_arch_ind.pdf [diakses 28-1-2018].

- Pfeifer, P.E. & S.J. Deutsch. 1980. A Three-Stage Iterative Procedure for Space-Time Modeling. *Technometrics*, 22(1): 35-47. Tersedia di <https://www.ncjrs.gov/pdffiles1/Digitization/60692NCJRS.pdf> [diakses 28-1-2015].
- Prastuti, M. 2014. *Model GSTAR-SUR Musiman untuk Peramalan Jumlah Wisatawan Mancanegara di Empat Lokasi Wisata di Indonesia*. Tesis. Surabaya: Institut Teknologi Sepuluh November.
- Rosadi, D. 2011. *Analisis Ekonometrika dan Runtun Waktu Terapan dengan R*. Yogyakarta: C.V Andi.
- Rosadi, D. 2014. *Analisis Runtun Waktu dan Aplikasinya dengan R*. Yogyakarta: Gadjah Mada University Press.
- Ruchjana, B.N. 2002. Pemodelan Kurva Produksi Minyak Bumi Menggunakan Model Generalisasi S-TAR. *Forum Statistika dan Komputasi*. Bogor: IPB. Tersedia di http://repository.ipb.ac.id/bitstream/handle/123456789/29439/Budi_Nurani_R_pemodelan_kurva2002-no0_16.pdf?sequence=1 [diakses 28-1-2015].
- Suhartono. 2007. *Feedforward Neural Networks untuk Pemodelan Runtun Waktu*. Disertasi. Yogyakarta: Universitas Gadjah Mada.
- Suhartono & R.M. Atok. 2006a. Kajian Bobot Model GSTAR Menggunakan Inferensia Korelasi Silang. *Prosiding Konferensi Nasional Matematika XIII, UNNES, Semarang*, hal: 531-539.
- Suhartono & R.M. Atok. 2006b. Pemilihan Bobot Lokasi yang Optimal pada Model GSTAR. *Prosiding Konferensi Nasional Matematika XIII, UNNES, Semarang*, hal: 571-580.
- Suhartono & Subanar. 2007. Some Comments on the Theorem Providing Stationarity Condition for GSTAR Models in the Paper by Borovkova et al. *Journal of the Indonesian Mathematical Society (MIHMI)*, 13(1): 115-121.
- Suparmono. 2004. *Pengantar Ekonomi Makro, Edisi Pertama*. Yogyakarta: Unit Penerbit dan Percetakan (UPP) AMP YKPN.
- Susanti, D. & Susiswo. 2012. *Aplikasi Model GSTAR Pada Peramalan Jumlah Kunjungan Wisatawan Empat Lokasi Wisata di Batu*. Malang: Universitas Negeri Malang. Tersedia di <http://jurnalonline.um.ac.id/data/artikel/artikel4E210CECD53A5DD652E78937E6C46D3C.pdf> [diakses 28-1-2015]

- Suyuthi, M.D. 1989. *Pengantar Ekonomi Makro*. Jakarta: Departemen Pendidikan dan Kebudayaan Direktorat Jenderal Pendidikan Tinggi P2LPTK.
- Tsay, R.S., 2013. *An Introduction to Analysis of Financial Data with R*. New Jersey: John Wiley and Sons, Inc.
- Tsay, R.S., 2014. *Multivariate Time Series Analysis With R and Financial Applications*. New Jersey: John Wiley and Sons, Inc.
- Wackerly, D.D., W. Mendenhall III, & R.L. Scheaffer. 2008. *Mathematical Statistics with Applications, 7th edition*. USA: Thomson Learning, Inc.
- Wei, W.W.S. 2006. *Time Series Analysis Univariate and Multivariate Methods, 2nd edition*. New York: Pearson Education.
- Wutsqa, D.U. 2008. *Model Feedforward Neural Network untuk Data Time Series Multivariat*. Disertasi. Yogyakarta: Universitas Gadjah Mada.