

## DAFTAR PUSTAKA

- Box, G dan Gwilym J. 1976. *Time Series Analisis Forecasting and Control*. San Fransisco: Holden-Day.
- Crato, N dan Bonnie K.R. 1995. *Some problems in the overspecification of ARMA and ARIMA processes using ARFIMA models*. Departement of Mathematics, New Jersey Institute of Technology.
- Granger, C.W.J. dan Joyeux, R. 1980. *An Introduction to long-range time series models and fractional differencing*. Journal of Time Series Analysis.
- Hasanah, I. 2005. *Analisis Runtun Waktu Bivariat Dengan Metode Box-Jenkins Pada Pemodelan VAR (Vektor Autoregresif)*. Bandung: Tugas Akhir FPMIPA UPI.
- Hosking, J.R.M. 1981. *Fractional differencing*. Biometrika.
- Iriawan, N. dan Astuti, S.P. 2006. *Mengolah Data Statistik dengan Mudah Menggunakan Minitab 14*. Yogyakarta : ANDI.
- Makridakis, S. dan Wheelwright, S.C. 1992. *Metode dan Aplikasi Peramalan* (terjemahan). Jakarta: Erlangga.
- Mohammad, T.Y.R. 2008. *Metode Runtun Waktu Musiman Seasonal Autoregressive Integrated Moving Average (SARIMA) Box-Jenkins*. Bandung: Tugas Akhir FPMIPA UPI.
- Muhtarulloh, F. 2008. *Pembaharuan Model Peramalan Pada Metode Box – Jenkins*. Tugas Akhir FPMIPA UPI. Bandung: Tidak diterbitkan.

- Panji, M. 2008. *Multifraktalitas Dan Studi Komparatif Prediksi Indeks Dengan Metode ARIMA Dan Neural Network*. Semarang: Skripsi FE UNDIP.
- Rindang. 2008. *ARIMA (Autoregressive Integrated Moving Average)*. Mengunduh dari [www.indoskripsi.com](http://www.indoskripsi.com) pada tanggal 28 september 2008.
- Rosadi, D. 2006. *Diktat Kuliah Pengantar Analisis Runtun Waktu*. Yogyakarta: FMIPA Universitas Gajah Mada.
- Rose, O. 1996. *Estimation of the Hurst Parameter of Long-Range Dependent Time Series*. Mengunduh pada tanggal 10 september 2008 di <http://citeseerx.ist.psu.edu/viewdoc/summary?doi=10.1.1.53.2336>.
- Soejoeti, Z. 1987. *Analisis Runtun Waktu*. Jakarta: Karunika Universitas Terbuka.
- Suhartono dan Atok. 2007. *Bahan Ajar Analisis Time Series*. Surabaya: Institut Teknologi Surabaya.
- Wei, W.W.S. 1994. *Time Series Analysis: Univariate and Multivariate Methods*. California : Addison-Wesley Publishing Company Inc.