

ABSTRAKSI

Model peramalan yang baik bagi suatu risiko obligasi adalah model yang memiliki taraf akurasi peramalan yang akurat. Terdapat empat model peramalan yang diujikan dalam penelitian ini, yaitu *Standard Deviation*, *Simple Moving Average*, *Exponential Weighted Moving Average*, dan *Autoregressive Conditional Heterocedasticity* atau *Generalized Autoregressive Conditional Heterocedasticity*. Model-model tersebut merupakan model yang biasa digunakan untuk meramalkan risiko obligasi. Penelitian ini mengkaji mengenai peramalan bagi suatu volatilitas *return* obligasi INDON 14 dalam rangka mengukur nilai risiko dimasa yang akan datang. Seperti kesimpulan yang dihasilkan dari penelitian terdahulu, dalam penelitian ini menemukan bahwa hanya model GARCH (2,1) yang mampu meramalkan *return* obligasi INDON 14 secara akurat.

Keyword: model peramalan, obligasi, risiko, *return*, GARCH (2,1), akurat