



UNIVERSIDADE FEDERAL DO AMAZONAS  
FACULDADE DE ESTUDOS SOCIAIS  
DEPARTAMENTO DE ECONOMIA E ANÁLISE



## **DISCIPLINA: ECONOMETRIA II**

Código: FAE 204

Nº. de créditos: 04

Carga horária: 60 horas

Pré-requisito: FAE174 ECONOMETRIA I

**I - EMENTA:** Modelos Auto-regressivos e Defasagem Distribuída. Análise de séries temporais. Previsão com modelos de séries temporais.

**II - OBJETIVOS:** O objetivo deste curso é dotar os alunos de um conhecimento das técnicas de análise de modelos econométricos de dados defasados, e modelos de séries temporais, de modo que possam formar uma base de sua compreensão e aplicação em estudos econômicos.

### **III - BIBLIOGRAFIA BÁSICA**

GUAJARATI, D.N. **Econometria Básica**. São Paulo: Makronbooks, 2000.

MADALA, G.S. **Introdução à Econometria**. 3 ed. São Paulo. LTC Editora, 2003.

MATOS, O. C. **Econometria Básica, teoria e aplicações**. 3. ed. São Paulo: Atlas, 2000.

PINDYCK, R. S. e RUBINFELD, D. L. **Econometria**: modelos e previsões. Rio de Janeiro: Elsevier, 2004.

VASCONCELLOS, M. A. S. E ALVES, D. (editores). **Manual de econometria**: nível intermediário. São Paulo: Atlas, 2000.

WOOLDRIDGE, J.M. **Introdução à econometria**: uma abordagem moderna. São Paulo: Pioneira Thomson Learning, 2006.