
Econometría de Cuantiles

Profesor: Javier Alejo

Temario:

1. Distribuciones condicionales y regresión por cuantiles (quantile regression). Fundamentos e interpretación. Estimación, propiedades asintóticas e inferencia.
2. Usos y extensiones de quantile regression: regresiones censuradas, modelos de duración, modelos binarios, datos en panel.
3. Regresión por cuantiles no condicionales (unconditional quantile regression). Funciones de influencia y regresiones RIF.

Bibliografía:

Alejo, J., Gabrielli, F., y Sosa Escudero, W., 2011, *The Distributive Effects of Education: An Unconditional Quantile Regression Approach*, mimeo.

Canay, I.A. (2011): *A Simple Approach to Quantile Regression for Panel Data*, *The Econometrics Journal*, 14 (3), 368-386.

* Firpo, S., Fortin, N., and Lemieux, T., 2009, *Unconditional Quantile Regressions*, *Econometrica*, vol. 77(3), pages 953-973.

Lamarche, C., 2010. *Robust Penalized Quantile Regression Estimation for Panel Data*. *Journal of Econometrics* 157, pp. 396-408.

Koenker, R., 2004. *Quantile regression for longitudinal data*. *Journal of Multivariate Analysis* 91, 7489.

* Koenker, R., 2005, *Quantile Regression*, Cambridge University Press, Cambridge.

Koenker, R. and Biliias, Y. (2001). *Quantile Regression for Duration Data: A Reappraisal of the Pennsylvania Reemployment Bonus Experiments*. *Empirical Economics*, 26, 199-220.

Kordas, G. 2006, *Smoothed binary regression quantiles*, *Journal of Applied Econometrics*, Volume 21, Issue 3, pages 387-407.

Powell, J. L. 1986, *Censored Regression Quantiles*, *Journal of Econometrics*, 32, 143-155.

* Bibliografía obligatoria. El primero es un libro con un amplio contenido sobre regresión por cuantiles, se usarán algunos capítulos. El segundo es el paper seminal del método de regresiones para cuantiles no condicionales.