

Literatura existente

Marcelo

August 18, 2017

Tópicos de interesse

1. Seleção de modelos em regressão quantílica

Baseados na norma ℓ_1 , como o Lasso e Adalasso. Belloni 2011, Li 2015, Li 2008 e Ciuperca 2013

2. Utilização de Programação Inteira para Seleção de variáveis

Baseado no trabalho recentes do Bertsimas (2016). Hastie (2017) trás uma comparação com outros métodos.

3. Quantile Autoregression

O texto original do Koenker (2006) possui 300 citações, das quais muito poucas são interessantes para a gente.

4. Aplicação de regressão quantílica em energia, com foco na distribuição condicional

Artigo do chinês, Wan (2016), que utiliza redes neurais. Anastasiades (2013) aplica QAR. Discute como avaliar o fit em distribuição.

5. Estimação da distribuição condicional

Gaglianone e Lima

GAP: Seleção de modelo para QARX (QAR regression com variáveis exógenas)