

**Ejercicio CM-TA.5**

Sea modelo:  $Y_t = \alpha + \beta X_t + u_t$   $u_t \sim iid(0, \sigma^2)$ , se define el siguiente estimador del parámetro desconocido  $\beta$ :

$$\hat{\beta} = \frac{Y_T - Y_1}{X_T - X_1} \quad u_t \sim (0, \sigma^2)$$

Comprueba si  $\hat{\beta}$  es insesgado, de mínima varianza y consistente.