

Ejercicio CM-TA.6

Supongamos el modelo correctamente especificado:

$$Y_t = \beta_1 + \beta_2 X_{1t} + \beta_3 X_{2t} + u_t \quad t = 1, 2, \dots, T$$

X_{1t}, X_{2t} no estocásticas $\forall t$, $u_t \sim iid(0, \sigma^2)$. Pero especificamos el modelo:

$$Y_t = \beta_1 + \beta_2 X_{1t} + v_t \quad t = 1, 2, \dots, T$$

1. Demuestra que el estimador MCO de β_2 en el modelo estimado es inconsistente.
2. Demuestra que el estimador MCO de β_1 en el modelo estimado es inconsistente.