

QUIZ 3 EAE 324

1. Dado o estimador

$\hat{\beta} = (X'X)^{-1}X'y$ onde $\hat{\beta}$ [$1 \times (K+1)$], X [$n \times (K+1)$] e $y = X\beta + u$, onde y e u são ($n \times 1$), com as hipóteses de H1 a H5 mantidas, demonstre que $\hat{\beta}$ é um estimador não viesado de β .

2. Deduza a variância do estimador definido na questão 1, onde as hipóteses de 1 a 5 também se mantêm.