**Curso: Econometría 1**

**Profesor: Luis García (**[**lgarcia@pucp.edu.pe**](mailto:lgarcia@pucp.edu.pe)**)**

**Jefe de práctica: Nicolás Barrantes (**[**n.barrantes@pucp.pe**](mailto:n.barrantes@pucp.pe)**)**

**PRÁCTICA DIRIGIDA 10**

**Teoría asintótica, propiedades asintóticas de la estimación MCO y estimación por MV**

1. **Teoría asintótica**
2. Sea una muestra aleatoria de observaciones independientes de una variable aleatoria , que tiene media y varianza . Obtener el límite en probabilidad de la siguiente variable aleatoria:
3. **Propiedades asintóticas de la estimación MCO:**
4. Mostrar que los estimadores de los parámetros obtenidos por MCO son consistentes
5. Mostrar que la distribución asintótica de es normal, independientemente de la distribución del término de perturbación
6. Mostrar la consistencia del estimador
7. **Estimación por máxima verosimilitud:**
8. Explique intuitivamente en qué consiste el método de estimación por MV
9. Considere una muestra , que proviene de una distribución de Poisson con función de densidad:

Estimar por MV el parámetro

1. Estime el modelo clásico por MV. Motrar la distribución asintótica de los estimadores y