

Fuente: Control 1 (Soluciones propuestas) de Econometría II 2023

2. (20 puntos) El test de Rao en este contexto (normalidad de residuos y restricciones lineales) adopta la forma:

$$extLM = (T - 2) \frac{\sum_T - \sum_T(\hat{\beta})}{\sum_T} = (T - 2) \frac{b\hat{\sigma}_1^2 - b\hat{\sigma}_2^2}{b\hat{\sigma}_1^2} \xrightarrow{d} \chi_1^2. \quad (1)$$