

Fuente: Control 6 de Econometría II 2021

1. (10 puntos) Derive la función objetivo $\Theta_T(\alpha)$ a utilizar para obtener los estimadores de β_0 y σ_0^2 . Dado el modelo:

$$\psi_\tau = \beta_0 + u_\tau \tag{1}$$

$$u_\tau \sim N(0, \sigma_0^2) \tag{2}$$