

Fuente: Examen Final de Econometría II 2021 (Soluciones Propuestas)

3. (35 puntos) El modelo es: $y_{i,t} = \alpha_i + u_{i,t}$, $E(u_{i,t}) = \sigma^2$ donde $u_{i,t}$ son i.i.d. con $E(\alpha_i u_{i,t}) = 0$ para $i = 1, \dots, N$; $t = 1, \dots, T$.