

PROBLEMA 6

Un alumno estima por error el modelo

$$Y_i = \beta_1 + \beta_2 X_{2i} + \mu_{1i}$$

Siendo el modelo correcto

$$Y_i = \alpha_1 + \alpha_2 X_{2i} + \alpha_3 X_{3i} + \mu_{2i}$$

¿La estimación de la varianza residual o muestral del primer modelo será menor que la del modelo correcto ? ¿Por que ? Demuestre su respuesta.

Solución