

$$\hat{\alpha}\hat{\beta}\sum_t\varepsilon_t w_t\sigma_\varepsilon^2$$

# Propriétés des estimateurs des MCO

September 16, 2021

## Contents

<b>1</b>	<b>Les estimateurs des MCO sont des fonctions linéaires de <math>Y_t</math> de <math>Y</math></b>	<b>3</b>
<b>2</b>	<b><math>\hat{\alpha}</math> et <math>\hat{\beta}</math> sont des estimateurs sans biais</b>	<b>3</b>
<b>3</b>	<b><math>\hat{\alpha}</math> et <math>\hat{\beta}</math> sont des estimateurs à variance minimale de <math>\alpha</math> et <math>\beta</math></b>	<b>3</b>
<b>4</b>	<b><math>\hat{\alpha}</math> et <math>\hat{\beta}</math> sont des estimateurs convergents</b>	<b>3</b>
<b>5</b>	<b>Détermination d'un estimateur sans biais de <math>\sigma_\varepsilon^2</math></b>	<b>3</b>
<b>6</b>	<b>Les estimateurs des moindres carrés <math>\hat{\alpha}</math> et <math>\hat{\beta}</math> de <math>\alpha</math> et <math>\beta</math> correspondant au maximum de vraisemblance</b>	<b>3</b>

- 1 Les estimateurs des MCO sont des fonctions linéaires de  $Y_t$  de  $Y$
- 2  $\hat{\alpha}$  et  $\hat{\beta}$  sont des estimateurs sans biais
- 3  $\hat{\alpha}$  et  $\hat{\beta}$  sont des estimateurs à variance minimale de  $\alpha$  et  $\beta$
- 4  $\hat{\alpha}$  et  $\hat{\beta}$  sont des estimateurs convergents
- 5 Détermination d'un estimateur sans biais de  $\sigma_\varepsilon^2$
- 6 Les estimateurs des moindres carrés  $\hat{\alpha}$  et  $\hat{\beta}$  de  $\alpha$  et  $\beta$  correspondant au maximum de vraisemblance