

מבוא לאקונומטריקה א
ד"ר ניר דגן

תרגיל מס' 4

להגשה ביום 11 בדצמבר 2005

13. יהי X משתנה מקרי עם תוחלת $\mu = E(X)$ ושונות σ^2 . מצא את התוחלת והשונות של ממוצע המדגם של מדגם עם n תצפיות.

14. חוקר מעוניין לאמוד את המודל $Y_i = \beta X_i + u_i$. חשב את נוסחת אומד ריבועים פחותים לפרמטר β ע"י פיתרון בעיית המינימיזציה של סכום ריבועי הסטיות.