$$\sigma_e^2 = 0.02 - \sigma_e^2 = 0.12 - \sigma_e^2 = 1.02$$

$$\sigma_e^2 = 0.001^2 - \sigma_e^2 = 1.02$$

$$\sigma_e^2 = 0.001^2 - \sigma_e^2 = 1.02$$