

Fuente: Control 2 de Econometría II 2023

2. (40 puntos) Considere la factorización triangular de $\Omega = ADA^\top$, donde A es triangular inferior y D es diagonal. Defina $v_\tau = A^{-1}u_\tau$. Encuentre $E(v_\tau)$, $E(v_\tau v_\tau^\top)$.