Structure of the variance-covariance matrix (Slide 7)

	X_1	…	X_j	…	X_h
X_1	$\mathrm{Var}(X_1)$	…	$\mathrm{Cov}(X_1, X_j)$	…	$\mathrm{Cov}(X_1, X_h)$
…	…	…	…	…	…
X_j	$\mathrm{Cov}(X_j, X_1)$		$\mathrm{Var}(X_j)$	…	…
…	…	…	…	…	…
X_h	$\mathrm{Cov}(X_h, X_1)$	…	…	…	$\mathrm{Var}(X_h)$