

$$P_X(x) = N(x^*, A^{-1} I A^{-T})$$

cioè  $X$  è gaussiana, con matrice di covarianza

$$\Gamma = A^{-1} A^{-T} = (A^T A)^{-1} = (B^T B)^{-1} = C^{-1}$$

Questo è un risultato di Gauss:

$\hat{C}$  viene dal fit di minimi quadrati.

La soluzione di un problema di minimi quadrati lineari ha una densità di prob. gaussiana, con media uguale alle sol. normale e matrice di covarianza uguale all'inversa della matrice normale (dei M.Q.)