

$$\begin{bmatrix} x_1 \\ x_2 \end{bmatrix} \sim \mathcal{N} \left( \begin{bmatrix} 0 \\ 0 \end{bmatrix}, \begin{bmatrix} 1 & 0.25 \\ 0.25 & 1 \end{bmatrix} \right)$$

