$$\mu = \begin{bmatrix} 0 & 0 & 0 \\ \Sigma = \begin{bmatrix} 1 & -0 & 0 \\ 1 & -0 & 0 \end{bmatrix} \\ \begin{bmatrix} -0 & 1 & 0 \\ 0 & 0 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 0.20 & 0.20 \\ 0.00 & 0.00 \end{bmatrix}$$