CoGP $\mathsf{Var}(f(\mathbf{x})) \ \mathsf{on} \ x\text{-}y$ $\mathsf{Var}(f(\mathbf{x})) \ \mathsf{on} \ y \mathsf{-} \theta$ $Var(f(\mathbf{x}))$ on θ -x5 x0 -5-50 5 0 5 5 -5-50 x $\mathsf{Var}(g(\mathbf{x})_{:,1})$ on x-y $\mathsf{Var}(g(\mathbf{x})_{:,1})$ on $y\text{-}\theta$ $\operatorname{Var}(g(\mathbf{x})_{:,1})$ on θ -x5 s-55 5 0 5 -50 -5-5x $Var(g(\mathbf{x})_{:,2})$ on x-y $\mathsf{Var}(g(\mathbf{x})_{:,2})$ on $y\text{-}\theta$ $Var(g(\mathbf{x})_{:,2})$ on θ -x5 -- 8 0 -5-50 5 -50 5 -50 5 θ xy