

これより $y = N(y | \mu, \Sigma)$ が「サンプリング」可能な方法は、

① Σ をコレスキー分解する。 $\Sigma = LL^T$

② $p(z) = N(z_1 | 0, 1) \cdots N(z_D | 0, 1)$ が「サンプリング」可能な $z = (z_1, \dots, z_D)$

③ z のサンプリングを用いて y のサンプリング $y = \mu + Lz$ で求める。

④ 一方、この場合 y のサンプリングは $N(y | \mu, \Sigma)$ に従っている。
とわかる。