

```

// T42mixDesNor.sce
// MIXTURE ESTIMATION (descriptive, normal)
// - static normal componens
// - two-dimensional variables
// Experiments
// - change simulated expectations thS
// - change initial expectations thE (through the statistics S, ka)
// -----
exec("ScIntro.sce",-1),
getd(), mode(0)

nd=500; // 1
// PARAMETERS // 2
c(1).thS=[1 2]; // simulated expectations // 3
c(2).thS=[8 2]; // second component // 4
c(3).thS=[7 9]; // third component // 5
c(4).thS=[2 9]; // fourth component // 6
sd=[1.5 .8 1.2 .9]*1; // magnitude of covariance // 7
nc=length(sd); // number of components // 8
for j=1:nc // 9
    c(j).sdS=sd(j)*eye(2,2); // component covariances // 10
end // 11
alS=[.1 .2 .4 .3]; // parameters of pointer model // 12

```

```

// 13
// SIMULATION // 14
for t=1:nd // 15
    jS=sampCat(a1S); // pointer value // 16
    cS(t)=jS; // stor pointer value // 17
    y(t,:)=c(jS).thS+randn(1,2)*c(jS).sdS; // output // 18
end // 19
// 20
// ESTIMATION // 21
// initialization // 22
c(1).th=[0 4]; // initial parameters // 23
c(2).th=[9 0]; // second component // 24
c(3).th=[9 8]; // third component // 25
c(4).th=[0 7]; // fourth component // 26
ka=[1 1 1 1]; // initial counter // 27
for j=1:nc // 28
    c(j).V=eye(3,3); // initial inf. matrix // 29
    c(j).V(3,1:2)=c(j).th'; // 30
    c(j).V(1:2,3)=c(j).th; // 31
    c(j).thE=v2thN(c(j).V/ka(j),2); //initial point estimates // 32
end // 33
// 34
// time loop of estimation // 35

```

```

for t=1:nd // 36
    for j=1:nc // 37
        [nill,q(j)]=GaussN(y(t,:),c(j).thE,.1*eye(2,2)); // log-proximity // 38
    end // 39
    qn=exp(q-max(q)); // normalized proximity // 40
    w=qn/sum(qn); // weights // 41
    wt(:,t)=w; // remember weights // 42
    for j=1:nc // 43
        Ps=[y(t,:) 1]; // extended regression vector // 44
        c(j).V=c(j).V+w(j)*Ps'*Ps; // update of inf. matrix // 45
        ka(j)=ka(j)+w(j); // update of counter // 46
        c(j).thE=v2thN(c(j).V/ka(j),2); // point estimates // 47
        c(j).th=[c(j).th; c(j).thE]; // remember point estimates // 48
    end // 49
    // 50
    // prediction // 51
    ypp=0; // 52
    for j=1:nc // 53
        select 2 // type of prediction: 1-point, 2-generated; // 54
        case 1, ypp=ypp+w(j)*c(j).thE; // 55
        case 2, ypp=ypp+w(j)*(randn(1,2)*c(j).sdS+c(j).thE); // 56
    end // 57
end // 58

```

```

    yp(t,:)=ypp;                                // prediction           // 59
end                                              // 60
                                              // 61
// RESULTS                                     // 62
tx=['b';'r';'g';'k'];                          // 63
set(scf(1),'position',[600 10 600 400])         // evolution of par. est.      // 64
for j=1:nc                                       // 65
    plot(c(j).th(:,1),c(j).th(:,2),'.':+tx(j))   // 66
    plot(c(j).th(1,1),c(j).th(1,2),'o'+tx(j),'markersize',8) // 67
    plot(c(j).th(nd,1),c(j).th(nd,2),'x'+tx(j),'markersize',12) // 68
end                                              // 69
title 'Evolution of the estimated parameters'    // 70
mi=min([c(1).th;c(2).th;c(3).th;c(4).th], 'r'); // 71
ma=max([c(1).th;c(2).th;c(3).th;c(4).th], 'r'); // 72
set(gca(),'data_bounds',[mi(1)-1 ma(1)+1 mi(2)-1 ma(2)+1]); // 73
for j=1:nc                                       // 74
    plot(c(j).thS(1),c(j).thS(2),'p'+tx(j),'markersize',16); // 75
end                                              // 76
                                              // 77
set(scf(2),'position',[1200 10 600 400])        // plot data clusters          // 78
plot(y(:,1),y(:,2),'.')                        // 79
title 'Data'                                    // 80
                                              // 81

```

```

disp 'The final parmeter estimates are' // 82
for j=1:nc // 83
    c(j).th($,:) // 84
end // 85
// 86
[nill,cp]=max(wt,'r'); // accuracy of classification // 87
disp 'Accuracy of classification' // 88
ACC=acc(cS,cp) // 89
// 90
set(scf(3),'position',[600 500 1200 400]) // plot data and predictions // 91
subplot(121),plot([y(:,1) yp(:,1)]) // 92
title 'First output and its prediction' // 93
subplot(122),plot([y(:,2) yp(:,2)]) // 94
title 'Second output and its prediction' // 95
// 96
disp 'Accuracy of prediction' // accuracy of prediction // 97
RPE=rpe(y(:),yp(:)) // 98

```

Description of the program