HMM模型--预测问题

在https://github.com/Casey1203/ml-ease/blob/master/hmm/HMM%E6%A8%A1%E5%9E%8B-%E5%AE%9A%E4%B9%89.md文档中，对HMM模型应用的三种问题，分为概率计算、参数学习、预测。在本文中对预测问题进行介绍。

4. 预测算法

4.1 近似算法

这个算法的思想比较简单，并且在概率计算部分，简单提及了。

回顾$\gamma_t(i)$的定义，表示在时刻t，处于状态i的概率

$$\begin{aligned}\gamma_t(i) &= \frac{P(i_t=i,O|\lambda)}{\sum_{i=1}^N P(i_t=i,O|\lambda)} = P(i_t=i|O,\lambda) \\ &= \frac{\alpha_t(i)\beta_t(i)}{\sum_{j=1}^N \alpha_t(j)\beta_t(j)}\end{aligned}$$

因此，每个时刻，都有N个γ，选择可以使γ取到最大的状态作为最有可能的状态$i_t^\star$。

$$i_t^\star = \arg\max_{1\leq \leq N} \gamma_t(i), \quad t=1,2,\dots,T$$

从而可以得到最有可能的序列$I^\star=(i_1^\star,i_2^\star,\dots,i_T^\star)$

这种方法仅是对单独的每个时间点作预测，没有考虑前后状态的联系。因此，得到的序列$I^\star$从整体上，不能保证是最有可能的状态序列。同时，由于不考虑整理，可能出现相邻的状态，转移概率为0。

4.2 维特比算法

维特比算法实际上是用动态规划，求解HMM的预测问题。

根据动态规划的原理，最优路径的特点：如果最优路径在时刻t通过结点$i_t^\star$，那么整条路径$I^\star$中，从结点$i_t^\star$到结点$i_T^\star$的部分$I_{t\to T}^\star$，相比于从$i_t^\star$到$i_T^\star$的所有可能的路径来说，一定是最优的。否则，如果存在一条从$i_t^\star$到$i_T^\star$的路径$I_{t\to T}$，要好于当前找到的路径中结点$i_t^\star$到结点$i_T^\star$的部分$I_{t\to T}^\star$，那用$I_{t\to T}$去替换$I_{t\to T}^\star$，可以得到一条比$I^\star$更好的路径。

定义，在时刻t，状态为i的所有单个路径$(i_1,i_2,\dots,i_t)$中概率最大值为

$$\delta_t(i) = \max_{i_1,i_2,\dots,i_{t-1}} P(i_t=i,i_{t-1},\dots,i_1,o_t,\dots,o_1|\lambda), \quad i=1,2,\dots,N$$

这个$\max$的意思是，在t时刻的状态已经确定为i的情况下，从总体上遍历$i_{t-1},\dots,i_1$，找到使得概率最大的路径$I_{1\to t-1}$。

因此$\delta_t(i)$的递推公式为

$$\begin{aligned}\delta_{t+1}(i) &= \max_{i_1,i_2,\dots,i_t} P(i_{t+1}=i,i_t,\dots,i_1,o_{t+1},\dots,o_1|\lambda) \\ &= \max_{1\leq j\leq N}[\delta_t(j)a_{ji}]b_i(o_{t+1}), \quad i=1,2,\dots,N; t=1,2,\dots,T-1\end{aligned}$$

表示，时刻t位于某个状态j，并且在时刻$t+1$状态转移至i。外层$\max$选择$t+1$时刻位于状态j，内层循环要保证在第t时刻确定了状态为j的情况下，路径$I_{1\to t}$是概率最大的。完成了两层$\max$之后，确定了路径，还要再考虑观测概率$b_i(o_{t+1})$，这就与路径无关了。

同时定义

$$\psi_t(i) = \arg\max_{1\le j\le N}[\delta_{t-1}(j)a_{ji}], \quad i=1,2,\dots,N$$

表示，时刻t位于状态i的最优路径中，第$t-1$时刻（倒数第二个结点）位于j的状态。因此是对$1\le j\le N$求$\arg max$。

因此维特比算法的框架是

初值

$$\delta_1(i) = \pi_i b_i(o_i), \quad i=1,2,\dots,N$$
$$\psi_1(i) = 0, \quad i=1,2,\dots,N$$

因为只包含一个结点，没有路径，所以δ_1不存在$\max$的问题。同时，定义$t-1=0$时刻的结点ψ_1为0。

递推，对于$t=2,3,\dots,T$

$$\delta_t(i) = \max_{1\le j\le N}[\delta_{t-1}(j)a_{ji}]b_i(o_t), \quad i=1,2,\dots,N; t=1,2,\dots,T-1$$
$$\psi_t(i) = \arg\max_{1\le j\le N}[\delta_{t-1}(j)a_{ji}], \quad i=1,2,\dots,N$$

终止

根据递推过程，我们求得了$\delta_T(i)$，表示到T时刻，状态为i，最优的路径对应的概率。由于我们不关心在T具体位于哪个状态，因此

$$P^\star = \max_{1\le i\le N}\delta_T(i)$$

表示给定了观测序列O和模型参数λ，最优路径出现的概率。

同时，最优路径的最后一个结点，即T时刻的状态为

$$i_T^\star = \arg\max_{i\le i\le N}[\delta_T(i)]$$

根据ψ的定义，表示在最优路径下，倒数第二个结点的状态，因此对$t=T-1,T-2,\dots,1$

$$i_t^\star = \psi_{t+1}(i_{t+1}^\star)$$

从而得到了最优的路径$I^\star = (i_1^\star, i_2^\star, \dots, i_T^\star)$

下面给一个例子来运用维特比算法

给定模型参数$\lambda=(A,B,\pi)$

$$A = \begin{bmatrix} 0.5 & 0.2 & 0.3 \\ 0.3 & 0.5 & 0.2 \\ 0.2 & 0.3 & 0.5 \end{bmatrix}, \quad B = \begin{bmatrix} 0.5 & 0.5 \\ 0.4 & 0.6 \\ 0.7 & 0.3 \end{bmatrix}, \quad \pi = (0.2, 0.4, 0.4)^{\mathrm{T}}$$

已知观测序列$O=(\text{红，白，红})$，求最优状态序列。

初始化，在$t=1$时，对每个状态$i=1,2,3$，求状态i观测到$o_1=\text{红}$的概率。

$$\delta_1(i)=\pi_i b_i(o_1)=\pi_i b_i(\text{红}),\quad i=1,2,3$$

根据初始概率和观测概率计算

$$\begin{aligned}\delta_1(1)=0.2\times0.5=0.10\\ \delta_1(2)=0.4\times0.4=0.16\\ \delta_1(3)=0.4\times0.7=0.28\end{aligned}$$

同时，$\psi_1(i)=0,\quad i=1,2,3$

在$t=2$时刻，对每个状态$i,i=1,2,3$，求在$t=1$时刻状态为j观测为红，并且在$t=2$时刻状态为i观测$o_2=\text{白}$的路径的最大概率，记作$\delta_2(i)$，即

$$\delta_2(i)=\max_{1\le j\le3}[\delta_1(j)a_{ji}]b_i(o_2)$$

同时，前一个结点的状态j为

$$\psi_2(i)=\arg\max_{1\le j\le3}[\delta_1(j)a_{ij}],\quad i=1,2,3$$

代入模型参数计算，计算在$t=2$时刻，状态位于1的最优路径的概率

$$\begin{aligned}\delta_2(1)&=\max_{1\le j\le3}[\delta_1(j)a_{j1}]b_1(o_2)\\ &=\max_j\{0.1\times0.5,0.16\times0.3,0.28\times0.2\}\times0.5\\ &=0.028\end{aligned}$$

看到在计算$\delta_2(1)$的max时，选择了状态3作为该结点的状态，即

$$\psi_2(1)=3$$

类似的，可以计算在$t=2$时刻，状态位于2或3的情况下的最优路径的概率

$$\begin{aligned}\delta_2(2)&=\max_{1\le j\le3}[\delta_1(j)a_{j2}]b_2(o_2)\\ &=\max_j\{0.1\times0.2,0.16\times0.5,0.28\times0.3\}\times0.6\\ &=0.0504\end{aligned}$$

$$\psi_2(2)=3$$

$$\begin{aligned}\delta_2(3)&=\max_{1\le j\le3}[\delta_1(j)a_{j3}]b_3(o_2)\\ &=\max_j\{0.1\times0.3,0.16\times0.2,0.28\times0.5\}\times0.7\\ &=0.098\end{aligned}$$

$$\psi_2(3)=3$$

计算$t=3$时，

$$\delta_3(i)=\max_{1\le j\le3}[\delta_2(j)a_{ji}]b_i(o_3),\quad \psi_3(i)=\arg\max_{1\le j\le3}[\delta_2(j)a_{ij}]$$

代入模型参数计算，在$t=3$时刻，状态分别位于$1,2,3$的最优路径的概率

$$\begin{aligned}\delta_3(1)=0.00756,\quad \psi_3(1)=2\\ \delta_3(2)=0.01008,\quad \psi_3(2)=2\\ \delta_3(3)=0.0147,\quad \psi_3(3)=3\end{aligned}$$

因此最优路径的概率为

$$P^{\star}=\max_{1\leq i\leq 3}\delta_3(i)=\delta_3(3)=0.0147$$

利用ψ回溯路径

在$t=3$时，$i_3^{\star}=\arg\max_i[\delta_3(i)]=3$

在$t=2$时，$i_2^{\star}=\psi_3(i_3^{\star})=\psi_3(3)=3$

在$t=1$时，$i_1^{\star}=\psi_2(i_2^{\star})=\psi_2(3)=3$

因此最优状态序列为$I^{\star}=(i_1^{\star},i_2^{\star},i_3^{\star})=(3,3,3)$

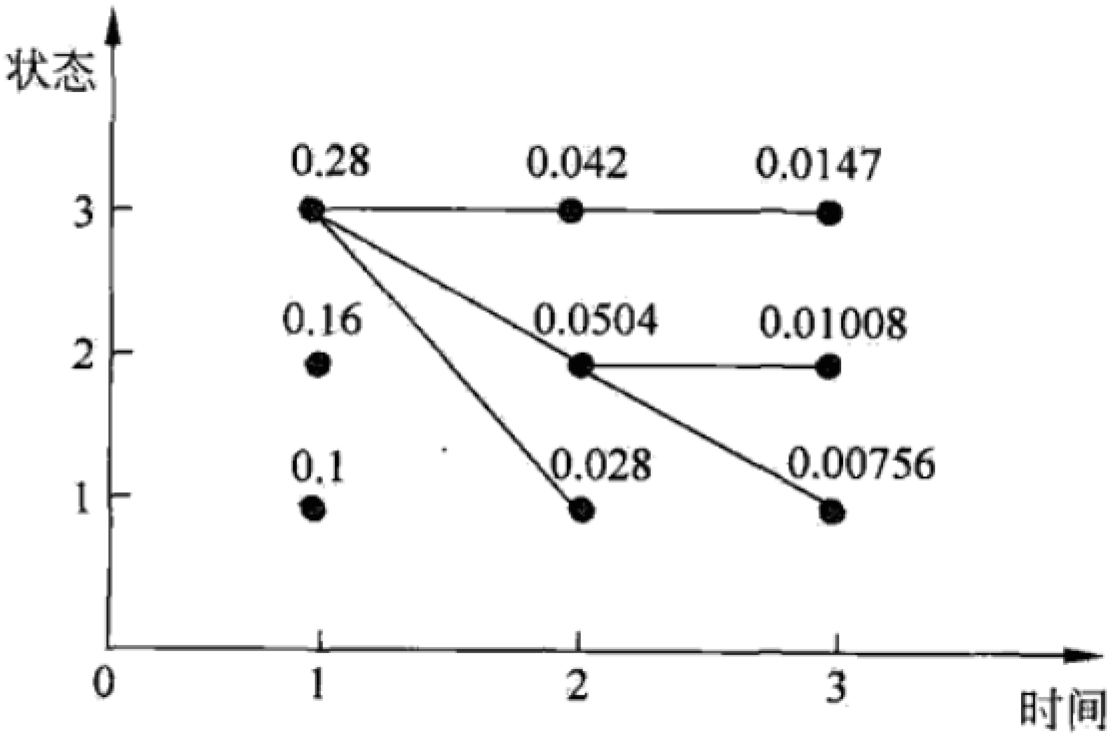

图 10.4　求最优路径