

СПИСОК ИСТОЧНИКОВ С ПОЯСНЕНИЯМИ

1. Dempster A. P., Laird N. M., Rubin D. B. Maximum likelihood from incomplete data via the EM algorithm // Journal of the Royal Statistical Society: Series B (Methodological). – 1977. – Vol. 39. – No. 1. – P. 1-38.
Истоки ЕМ-алгоритма
2. Wu C. F. J. On the convergence properties of the EM algorithm // The Annals of Statistics. – 1983. – Vol. 11. – No. 1. – P. 95–103.
Доказательство корректности Generalized EM
3. Louis T. A. Finding the observed information matrix when using the EM algorithm // Journal of the Royal Statistical Society: Series B (Methodological). – 1982. – Vol. 44. – No. 2. – P. 226–233.
Идея для Е-шага в моем случае
4. Ross S. M. A first course in probability. 8th ed. – Upper Saddle River, N. J.: Prentice Hall, 2010. – 640р., р. 348.
Закон полной дисперсии
5. Little R. J. A., Rubin D. B. Statistical analysis with missing data. 2nd ed. – Hoboken, N. J.: Wiley-Interscience, Jon Wiley & Sons, Inc., 2002. – 381р.
Применение ЕМ-алгоритма для оценки пропусков (книгу нужно скачать, есть и 3-е издание)
6. Schreier P. J., Scharf L. L. Statistical Signal Processing of Complex-Valued Data: The Theory of Improper and Noncircular Signals – Cambridge: Cambridge University Press, 2010. – 309р., pp. 41-42.
Условное распределение комплексного нормального распределения.
7. Nocedal J., Wright S.J. Numerical Optimization. 2nd ed. – New York: Springer, 2006. – 664р., pp. 10-37.
Важность Backtracking line search и знака производной по направлению.