

隐马尔可夫模型 (Hidden Markov Model)

1. 背景 (Background)

1.1 概率图模型 (Probabilistic Graphical Model)

概率图模型 (PGM) 大致可以分为两类：

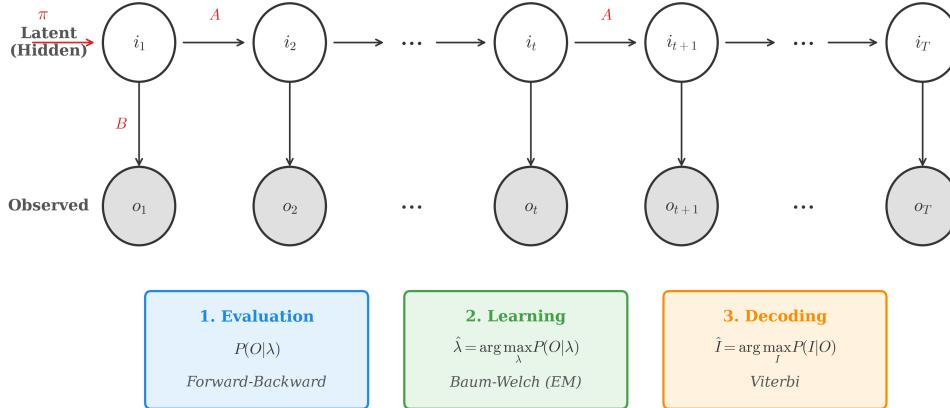
- **有向图 (Directed Graph):** 贝叶斯网络 (Bayesian Network)。
- **无向图 (Undirected Graph):** 马尔可夫随机场 (Markov Random Field, MRF)。

隐马尔可夫模型 (HMM) 属于有向图模型中的动态模型 (Dynamic Model)，主要用于处理序列数据（如时间序列）。根据状态变量 (State Variable) 的不同性质，动态模型可以进一步划分：

- **HMM (Hidden Markov Model):** 状态变量是离散 (Discrete) 的。
- **Kalman Filter:** 状态变量是连续 (Continuous) 的，且系统是线性 (Linear) 的，噪声服从高斯分布 (Gaussian)。
- **Particle Filter:** 状态变量是连续 (Continuous) 的，系统是非线性 (Non-linear) 的，噪声服从非高斯分布 (Non-Gaussian)。

1.2 HMM 模型定义 (Definition)

Hidden Markov Model (HMM)



HMM 由两个序列组成：

1. 状态序列 (State Sequence): $I = (i_1, i_2, \dots, i_T)$, 其中 $i_t \in Q = \{q_1, q_2, \dots, q_N\}$ 。状态序列是隐变量 (Latent Variable), 不可观测。
2. 观测序列 (Observation Sequence): $O = (o_1, o_2, \dots, o_T)$, 其中 $o_t \in V = \{v_1, v_2, \dots, v_M\}$ 。观测序列是可见的。

HMM 的参数 λ 可以表示为三元组：

$$\lambda = (\pi, A, B) \quad (1)$$

其中：

- **π (Initial State Distribution):** 初始概率分布。

$$\pi = (\pi_1, \pi_2, \dots, \pi_N), \quad \pi_i = P(i_1 = q_i) \quad (2)$$

- **A (State Transition Matrix):** 状态转移矩阵。

$$A = [a_{ij}]_{N \times N}, \quad a_{ij} = P(i_{t+1} = q_j | i_t = q_i) \quad (3)$$

- B (Emission Matrix): 发射矩阵 (观测概率矩阵)。

$$B = [b_j(k)]_{N \times M}, \quad b_j(k) = P(o_t = v_k | i_t = q_j) \quad (4)$$

1.3 两个基本假设 (Two Assumptions)

HMM 的推导基于以下两个重要假设：

1. 齐次马尔可夫假设 (Homogeneous Markov Assumption):

任意时刻的状态只依赖于前一时刻的状态，与其他时刻的状态和观测无关，也与时刻 t 无关。

$$P(i_{t+1}|i_t, i_{t-1}, \dots, i_1, o_t, \dots, o_1) = P(i_{t+1}|i_t) \quad (5)$$

2. 观测独立假设 (Observation Independence Assumption):

任意时刻的观测只依赖于该时刻的状态，与其他时刻的状态和观测无关。

$$P(o_t|i_t, i_{t-1}, \dots, i_1, o_t, \dots, o_1) = P(o_t|i_t) \quad (6)$$

1.4 三个基本问题 (Three Basic Problems)

HMM 主要解决三个问题：

1. Evaluation (概率计算问题):

- 已知: 模型参数 $\lambda = (\pi, A, B)$ 和观测序列 O 。
- 求解: 观测序列出现的概率 $P(O|\lambda)$ 。
- 方法: 前向-后向算法 (Forward-Backward Algorithm)。

2. Learning (参数估计问题):

- 已知: 观测序列 O 。
- 求解: 模型参数 λ , 使得 $P(O|\lambda)$ 最大。即 $\hat{\lambda} = \arg \max_{\lambda} P(O|\lambda)$ 。
- 方法: EM 算法 (Baum-Welch Algorithm)。

3. Decoding (解码问题/预测问题):

- 已知: 模型参数 λ 和观测序列 O 。
- 求解: 最有可能的状态序列 I 。即 $\hat{I} = \arg \max_I P(I|O)$ 。
- 方法: 维特比算法 (Viterbi Algorithm)。

2. Evaluation Problem (概率计算问题)

2.1 问题定义 (Problem Definition)

Evaluation Problem: 给定模型参数 $\lambda = (\pi, A, B)$ 和观测序列 $O = (o_1, o_2, \dots, o_T)$, 计算观测序列出现的概率 $P(O|\lambda)$ 。

2.2 暴力求解 (Naive Solution)

最直接的方法是按照概率公式, 将所有可能的隐状态序列 $I = (i_1, i_2, \dots, i_T)$ 进行求和。

$$P(O|\lambda) = \sum_I P(O, I|\lambda) = \sum_I P(O|I, \lambda)P(I|\lambda) \quad (7)$$

我们分别对这两项进行推导：

1. 状态序列概率 $P(I|\lambda)$:

根据齐次马尔可夫假设, 状态 i_t 只依赖于前一时刻的状态 i_{t-1} :

$$\begin{aligned} P(I|\lambda) &= P(i_1, i_2, \dots, i_T|\lambda) \\ &= P(i_1|\lambda)P(i_2|i_1, \lambda)P(i_3|i_2, \lambda) \dots P(i_T|i_{T-1}, \lambda) \\ &= \pi_{i_1} \prod_{t=2}^T a_{i_{t-1}, i_t} \end{aligned} \quad (8)$$

2. 观测序列概率 $P(O|I, \lambda)$:

根据观测独立假设，观测 o_t 只依赖于当前时刻的隐状态 i_t :

$$\begin{aligned} P(O|I, \lambda) &= P(o_1, o_2, \dots, o_T | I, \lambda) \\ &= \prod_{t=1}^T P(o_t | i_t, \lambda) \\ &= \prod_{t=1}^T b_{i_t}(o_t) \end{aligned} \tag{9}$$

将上述两部分代入求和公式:

$$P(O|\lambda) = \sum_{i_1, i_2, \dots, i_T} \pi_{i_1} b_{i_1}(o_1) \prod_{t=2}^T a_{i_{t-1}, i_t} b_{i_t}(o_t) \tag{10}$$

复杂度分析 (Complexity): 状态序列共有 N^T 种可能。对于每一个序列，计算概率需要 $O(T)$ 的时间。也就是总的时间复杂度为 $O(TN^T)$ 。这个复杂度是指数级的，对于较大的 T 是不可行的。

2.3 前向算法 (Forward Algorithm)

为了降低复杂度，我们利用动态规划的思想，引入前向算法 (Forward Algorithm)。

定义 (Definition):

记 $\alpha_t(i)$ 为时刻 t 部分观测序列为 o_1, \dots, o_t 且状态为 q_i 的概率:

$$\alpha_t(i) = P(o_1, o_2, \dots, o_t, i_t = q_i | \lambda) \tag{11}$$

算法步骤 (Algorithm Steps):

1. **初始化 (Initialization):**

$$\alpha_1(i) = \pi_i b_i(o_1), \quad 1 \leq i \leq N \tag{12}$$

2. **递推 (Recursion)** (对于 $t = 1, 2, \dots, T - 1$):

$$\alpha_{t+1}(j) = \left[\sum_{i=1}^N \alpha_t(i) a_{ij} \right] b_j(o_{t+1}), \quad 1 \leq j \leq N \tag{13}$$

解释: 为了在时刻 $t + 1$ 到达状态 q_j ，我们可以从时刻 t 的任意状态 q_i 转移而来。我们需要对所有可能的路径进行求和:

1. $\alpha_t(i)$: 时刻 t 处于状态 q_i 且观测到 $o_1 \dots o_t$ 的概率。
2. a_{ij} : 从 q_i 转移到 q_j 的概率。
3. $b_j(o_{t+1})$: 在状态 q_j 发射观测 o_{t+1} 的概率。

详细推导过程:

$$\begin{aligned}
\alpha_{t+1}(j) &= P(o_1, \dots, o_t, o_{t+1}, i_{t+1} = q_j | \lambda) \\
&= \sum_{i=1}^N P(o_1, \dots, o_t, o_{t+1}, i_{t+1} = q_j, i_t = q_i | \lambda) \\
&= \sum_{i=1}^N P(o_{t+1} | o_1, \dots, o_t, i_{t+1} = q_j, i_t = q_i, \lambda) \cdot P(o_1, \dots, o_t, i_{t+1} = q_j, i_t = q_i | \lambda) \\
&= \sum_{i=1}^N P(o_{t+1} | i_{t+1} = q_j) \cdot P(o_1, \dots, o_t, i_{t+1} = q_j, i_t = q_i | \lambda) \\
&= \sum_{i=1}^N b_j(o_{t+1}) \cdot P(i_{t+1} = q_j | o_1, \dots, o_t, i_t = q_i, \lambda) \cdot P(o_1, \dots, o_t, i_t = q_i | \lambda) \\
&= \sum_{i=1}^N b_j(o_{t+1}) \cdot P(i_{t+1} = q_j | i_t = q_i) \cdot \alpha_t(i) \\
&= \sum_{i=1}^N b_j(o_{t+1}) a_{ij} \alpha_t(i) \\
&= \left[\sum_{i=1}^N \alpha_t(i) a_{ij} \right] b_j(o_{t+1})
\end{aligned} \tag{14}$$

3. 终止 (Termination):

记 $\alpha_T(i)$ 为时刻 T 时, 观测序列为 O 且状态为 $i_T = q_i$ 的联合概率:

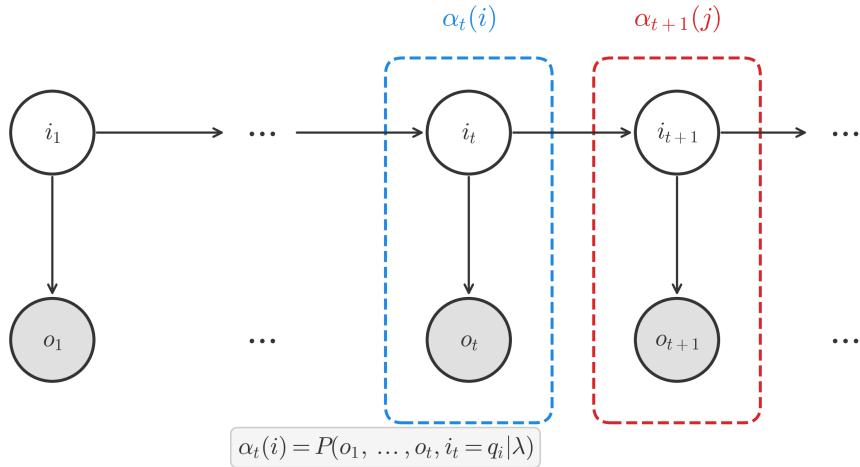
$$\alpha_T(i) = P(o_1, \dots, o_T, i_T = q_i | \lambda) = P(O, i_T = q_i | \lambda) \tag{15}$$

对所有可能的最终状态 i_T 进行求和, 即可得到观测序列的概率 $P(O | \lambda)$:

$$P(O | \lambda) = \sum_{i=1}^N P(O, i_T = q_i | \lambda) = \sum_{i=1}^N \alpha_T(i) \tag{16}$$

复杂度 (Complexity):

利用前向算法, 计算复杂度降低到了 $O(TN^2)$, 使得计算变得高效可行。



2.4 后向算法 (Backward Algorithm)

除了前向算法, 我们也可以从后往计算, 称为后向算法 (Backward Algorithm)。

定义 (Definition):

记 $\beta_t(i)$ 为时刻 t 状态为 q_i 的条件下, 从时刻 $t + 1$ 到 T 的部分观测序列为 o_{t+1}, \dots, o_T 的概率:

$$\beta_t(i) = P(o_{t+1}, o_{t+2}, \dots, o_T | i_t = q_i, \lambda) \tag{17}$$

算法步骤 (Algorithm Steps):

1. 初始化 (Initialization) (时刻 T):

$$\beta_T(i) = 1, \quad 1 \leq i \leq N \quad (18)$$

解释: 在时刻 T 之后没有观测数据, 故规定概率为 1。

2. 递推 (Recursion) (对于 $t = T - 1, T - 2, \dots, 1$):

$$\beta_t(i) = \sum_{j=1}^N a_{ij} b_j(o_{t+1}) \beta_{t+1}(j), \quad 1 \leq i \leq N \quad (19)$$

解释: 为了计算从时刻 t 的状态 q_i 出发观测到未来序列 $o_{t+1} \dots o_T$ 的概率, 我们需要考虑他在时刻 $t + 1$ 可能转移到的所有状态 q_j 。

对于每一个可能的下一状态 q_j :

1. a_{ij} : 从 q_i 转移到 q_j 。
2. $b_j(o_{t+1})$: 在状态 q_j 发射观测 o_{t+1} 。
3. $\beta_{t+1}(j)$: 从状态 q_j 出发观测到剩余序列 $o_{t+2} \dots o_T$ 的概率。

详细推导过程:

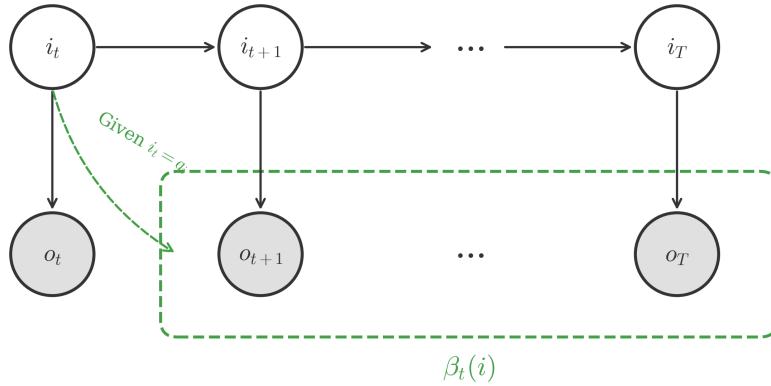
$$\begin{aligned} \beta_t(i) &= P(o_{t+1}, \dots, o_T | i_t = q_i, \lambda) \\ &= \sum_{j=1}^N P(o_{t+1}, \dots, o_T, i_{t+1} = q_j | i_t = q_i, \lambda) \\ &= \sum_{j=1}^N P(o_{t+1}, o_{t+2}, \dots, o_T | i_{t+1} = q_j, i_t = q_i, \lambda) \cdot P(i_{t+1} = q_j | i_t = q_i, \lambda) \\ &= \sum_{j=1}^N P(o_{t+1}, o_{t+2}, \dots, o_T | i_{t+1} = q_j, \lambda) \cdot a_{ij} \\ &= \sum_{j=1}^N P(o_{t+1} | o_{t+2}, \dots, o_T, i_{t+1} = q_j, \lambda) \cdot P(o_{t+2}, \dots, o_T | i_{t+1} = q_j, \lambda) \cdot a_{ij} \\ &= \sum_{j=1}^N P(o_{t+1} | i_{t+1} = q_j) \cdot \beta_{t+1}(j) \cdot a_{ij} \\ &= \sum_{j=1}^N b_j(o_{t+1}) a_{ij} \beta_{t+1}(j) \end{aligned} \quad (20)$$

3. 终止 (Termination):

利用时刻 1 的后向概率计算 $P(O|\lambda)$:

$$P(O|\lambda) = \sum_{i=1}^N \pi_i b_i(o_1) \beta_1(i) \quad (21)$$

$$\boxed{\beta_t(i) = P(o_{t+1}, \dots, o_T | i_t = q_i, \lambda)}$$



3. Learning Problem (参数估计问题)

Learning Problem: 给定观测序列 $O = (o_1, o_2, \dots, o_T)$, 估计模型参数 $\lambda = (\pi, A, B)$, 使得 $P(O|\lambda)$ 最大。即极大似然估计 (MLE)。

由于存在隐变量 I , 我们无法直接使用 MLE, 而是采用 **EM 算法 (Expectation-Maximization Algorithm)**, 在 HMM 中称为 **Baum-Welch 算法**。

3.1 EM 算法框架

EM 算法的迭代公式为:

$$\lambda^{(t+1)} = \arg \max_{\lambda} \int_Z \log P(O, Z|\lambda) P(Z|O, \lambda^{(t)}) dZ \quad (22)$$

在 HMM 中, 隐变量 Z 即为状态序列 I 。公式转化为:

$$\lambda^{(t+1)} = \arg \max_{\lambda} \sum_I \log P(O, I|\lambda) P(I|O, \lambda^{(t)}) \quad (23)$$

为了简化计算, 我们定义辅助函数 $Q(\lambda, \lambda^{(t)})$ 。由于 $P(O|\lambda^{(t)})$ 对于 λ 是常数, 我们可以直接使用 联合概率 $P(O, I|\lambda^{(t)})$ 作为权重 (省略分母) :

Q 函数 (Q-Function):

$$Q(\lambda, \lambda^{(t)}) = \sum_I \log P(O, I|\lambda) P(O, I|\lambda^{(t)}) \quad (24)$$

3.2 Q 函数展开

首先展开 $\log P(O, I|\lambda)$:

$$P(O, I|\lambda) = \pi_{i_1} b_{i_1}(o_1) a_{i_1 i_2} b_{i_2}(o_2) \dots a_{i_{T-1} i_T} b_{i_T}(o_T) \quad (25)$$

取对数:

$$\log P(O, I|\lambda) = \log \pi_{i_1} + \sum_{t=2}^T \log a_{i_{t-1} i_t} + \sum_{t=1}^T \log b_{i_t}(o_t) \quad (26)$$

代入 Q 函数:

$$Q(\lambda, \lambda^{(t)}) = \sum_I \left[\log \pi_{i_1} + \sum_{t=2}^T \log a_{i_{t-1} i_t} + \sum_{t=1}^T \log b_{i_t}(o_t) \right] P(O, I|\lambda^{(t)}) \quad (27)$$

我们可以将 Q 函数分解为三部分, 分别对 π, A, B 进行最大化。

3.3 M-Step: 求解 π (Initial State Distribution)

我们需要最大化 Q 函数中的第一项:

$$\begin{aligned} \pi^{(t+1)} &= \arg \max_{\pi} Q(\lambda, \lambda^{(t)}) \\ &= \arg \max_{\pi} \sum_I \left[\log \pi_{i_1} P(O, I|\lambda^{(t)}) \right] \\ &= \arg \max_{\pi} \sum_{i_1} \dots \sum_{i_T} \left[\log \pi_{i_1} \cdot P(O, i_1, \dots, i_T|\lambda^{(t)}) \right] \\ &= \arg \max_{\pi} \sum_{i=1}^N \left[\log \pi_i P(O, i_1 = q_i|\lambda^{(t)}) \right] \end{aligned} \quad (28)$$

解释: 求和是对所有可能的状态序列 $I = (i_1, i_2, \dots, i_T)$ 进行的。由于 π 只与初始状态 i_1 有关, 我们可以将 i_2, \dots, i_T 边缘化 (Marginalize):

$$\sum_{i_2, \dots, i_T} P(O, i_1, i_2, \dots, i_T|\lambda^{(t)}) = P(O, i_1|\lambda^{(t)}) \quad (29)$$

因此, 原来的多重求和简化为仅对 i_1 的求和。

约束条件: $\sum_{i=1}^N \pi_i = 1$ 。

拉格朗日乘子法 (Lagrange Multipliers):

构造拉格朗日函数:

$$\mathcal{L}(\pi, \eta) = \sum_{i=1}^N \log \pi_i P(O, i_1 = q_i | \lambda^{(t)}) + \eta \left(\sum_{i=1}^N \pi_i - 1 \right) \quad (30)$$

对 π_i 求偏导并令其为 0:

$$\frac{\partial \mathcal{L}}{\partial \pi_i} = \frac{1}{\pi_i} P(O, i_1 = q_i | \lambda^{(t)}) + \eta = 0 \quad (31)$$

$$P(O, i_1 = q_i | \lambda^{(t)}) + \pi_i \eta = 0 \quad (32)$$

对所有 i 求和 (利用 $\sum \pi_i = 1$) :

$$\sum_{i=1}^N P(O, i_1 = q_i | \lambda^{(t)}) + \eta \sum_{i=1}^N \pi_i = 0 \quad (33)$$

$$P(O | \lambda^{(t)}) + \eta \cdot 1 = 0 \implies \eta = -P(O | \lambda^{(t)}) \quad (34)$$

代回原式求解 π_i :

$$\pi_i = \frac{-P(O, i_1 = q_i | \lambda^{(t)})}{\eta} = \frac{P(O, i_1 = q_i | \lambda^{(t)})}{P(O | \lambda^{(t)})} \quad (35)$$

故 π 的更新公式为:

$$\pi_i^{(t+1)} = \frac{P(O, i_1 = q_i | \lambda^{(t)})}{P(O | \lambda^{(t)})} \quad (36)$$

3.4 M-Step: 求解 A (Transition Matrix)

我们需要最大化 Q 函数中的第二项:

$$\sum_I \left[\sum_{t=1}^{T-1} \log a_{i_t i_{t+1}} \right] P(O, I | \lambda^{(t)}) \quad (37)$$

(注: 这里求和下标调整为 $t = 1$ 到 $T - 1$, 对应 $a_{i_t i_{t+1}}$)

这一项可以重写为:

$$\sum_{i=1}^N \sum_{j=1}^N \sum_{t=1}^{T-1} \log a_{ij} P(O, i_t = q_i, i_{t+1} = q_j | \lambda^{(t)}) \quad (38)$$

约束条件: $\sum_{j=1}^N a_{ij} = 1$ (对于每个 i)。

构造拉格朗日函数 (针对每一行 i):

$$\mathcal{L}(a_{ij}, \eta_i) = \sum_{j=1}^N \log a_{ij} \sum_{t=1}^{T-1} P(O, i_t = q_i, i_{t+1} = q_j | \lambda^{(t)}) + \eta_i \left(\sum_{j=1}^N a_{ij} - 1 \right) \quad (39)$$

对 a_{ij} 求偏导并令其为 0:

$$\frac{\partial \mathcal{L}}{\partial a_{ij}} = \frac{1}{a_{ij}} \sum_{t=1}^{T-1} P(O, i_t = q_i, i_{t+1} = q_j | \lambda^{(t)}) + \eta_i = 0 \quad (40)$$

$$\sum_{t=1}^{T-1} P(O, i_t = q_i, i_{t+1} = q_j | \lambda^{(t)}) + a_{ij} \eta_i = 0 \quad (41)$$

对 j 求和:

$$\sum_{j=1}^N \sum_{t=1}^{T-1} P(O, i_t = q_i, i_{t+1} = q_j | \lambda^{(t)}) + \eta_i \sum_{j=1}^N a_{ij} = 0 \quad (42)$$

$$\sum_{t=1}^{T-1} P(O, i_t = q_i | \lambda^{(t)}) + \eta_i = 0 \implies \eta_i = -\sum_{t=1}^{T-1} P(O, i_t = q_i | \lambda^{(t)}) \quad (43)$$

代回求解 a_{ij} :

$$a_{ij}^{(t+1)} = \frac{\sum_{t=1}^{T-1} P(O, i_t = q_i, i_{t+1} = q_j | \lambda^{(t)})}{\sum_{t=1}^{T-1} P(O, i_t = q_i | \lambda^{(t)})} \quad (44)$$

为了方便书写，我们定义两个辅助变量：

- $\xi_t(i, j) = P(i_t = q_i, i_{t+1} = q_j | O, \lambda)$
- $\gamma_t(i) = P(i_t = q_i | O, \lambda) = \sum_{j=1}^N \xi_t(i, j)$

则 A 的更新公式为：

$$a_{ij}^{(t+1)} = \frac{\sum_{t=1}^{T-1} \xi_t(i, j)}{\sum_{t=1}^{T-1} \gamma_t(i)} \quad (45)$$

3.5 M-Step: 求解 B (Emission Matrix)

我们需要最大化 Q 函数中的第三项：

$$\sum_I \left[\sum_{t=1}^T \log b_{i_t}(o_t) \right] P(O, I | \lambda^{(t)}) \quad (46)$$

这一项可以重写为：

$$\sum_{j=1}^N \sum_{t=1}^T \log b_j(o_t) P(O, i_t = q_j | \lambda^{(t)}) \quad (47)$$

进一步按照观测值 v_k 分组：

$$\sum_{j=1}^N \sum_{k=1}^M \sum_{t \text{ s.t. } o_t=v_k} \log b_j(v_k) P(O, i_t = q_j | \lambda^{(t)}) \quad (48)$$

约束条件： $\sum_{k=1}^M b_j(k) = 1$ (对于每个状态 j)。

构造拉格朗日函数 (针对状态 j)：

$$\mathcal{L}(b_j(k), \eta_j) = \sum_{k=1}^M \log b_j(k) \sum_{t \text{ s.t. } o_t=v_k} P(O, i_t = q_j | \lambda^{(t)}) + \eta_j \left(\sum_{k=1}^M b_j(k) - 1 \right) \quad (49)$$

对 $b_j(k)$ 求偏导并令其为 0：

$$b_j(k) \eta_j + \sum_{t \text{ s.t. } o_t=v_k} P(O, i_t = q_j | \lambda^{(t)}) = 0 \quad (50)$$

对 k 求和，可得 $\eta_j = -\sum_{t=1}^T P(O, i_t = q_j | \lambda^{(t)})$.

代回得 B 的更新公式：

$$b_j(k)^{(t+1)} = \frac{\sum_{t=1, o_t=v_k}^T P(O, i_t = q_j | \lambda^{(t)})}{\sum_{t=1}^T P(O, i_t = q_j | \lambda^{(t)})} \quad (51)$$

用 $\gamma_t(j)$ 表示：

$$b_j(k)^{(t+1)} = \frac{\sum_{t=1, o_t=v_k}^T \gamma_t(j)}{\sum_{t=1}^T \gamma_t(j)} \quad (52)$$

4. Decoding Problem (解码问题)

Decoding Problem: 给定模型参数 $\lambda = (\pi, A, B)$ 和观测序列 $O = (o_1, o_2, \dots, o_T)$, 找到最有可能的状态序列 $I = (i_1, i_2, \dots, i_T)$ 。即 $\hat{I} = \arg \max_I P(I|O, \lambda)$ 。

我们采用 **维特比算法 (Viterbi Algorithm)**, 这是一种动态规划算法。

4.1 两个变量 (Two Variables)

1. 最大概率 $\delta_t(i)$:

定义为在时刻 t 状态为 q_i 的所有单一路径 (i_1, \dots, i_t) 中概率最大值:

$$\delta_t(i) = \max_{i_1, i_2, \dots, i_{t-1}} P(o_1, o_2, \dots, o_t, i_1, i_2, \dots, i_{t-1}, i_t = q_i | \lambda) \quad (53)$$

2. 回溯指针 $\psi_t(i)$:

用于记录时刻 t 状态为 q_i 的最优路径中, 前一个时刻 $(t-1)$ 的状态:

$$\psi_t(i) = \arg \max_{1 \leq j \leq N} [\delta_{t-1}(j) a_{ji}] \quad (54)$$

4.2 算法步骤 (Algorithm Steps)

1. 初始化 (Initialization):

$$\begin{aligned} \delta_1(i) &= \pi_i b_i(o_1), \quad 1 \leq i \leq N \\ \psi_1(i) &= 0 \end{aligned} \quad (55)$$

2. 递推 (Recursion) (对于 $t = 1, \dots, T-1$):

$$\begin{aligned} \delta_{t+1}(j) &= \max_{i_1, \dots, i_t} P(o_1, \dots, o_{t+1}, i_1, \dots, i_t, i_{t+1} = q_j | \lambda) \\ &= \max_{1 \leq i \leq N} [\delta_t(i) a_{ij}] b_j(o_{t+1}), \quad 1 \leq j \leq N \end{aligned} \quad (56)$$

记录最优路径回溯指针:

$$\psi_{t+1}(j) = \arg \max_{1 \leq i \leq N} [\delta_t(i) a_{ij}] \quad (57)$$

3. 终止 (Termination):

最优路径的概率:

$$P^* = \max_{1 \leq i \leq N} \delta_T(i) \quad (58)$$

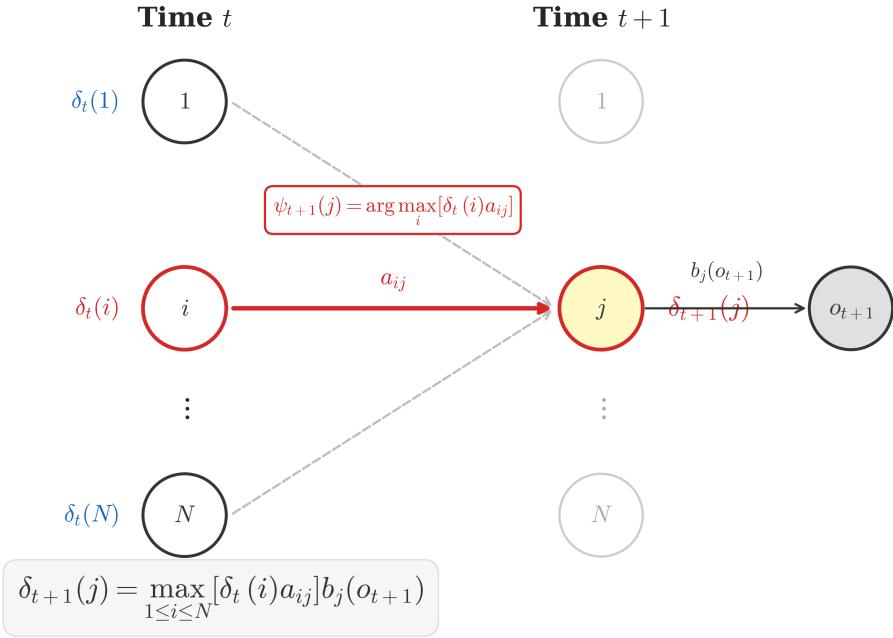
最优路径的终点:

$$i_T^* = \arg \max_{1 \leq i \leq N} \delta_T(i) \quad (59)$$

4. 回溯 (Path Backtracking) (对于 $t = T-1, \dots, 1$):

$$i_t^* = \psi_{t+1}(i_{t+1}^*) \quad (60)$$

最终得到最优状态序列 $I^* = (i_1^*, i_2^*, \dots, i_T^*)$ 。



5. 总结 (Summary)

我们将 HMM 的主要任务总结如下。注意：在某些文献中（如 whiteboard），观测变量记为 x ，隐变量记为 z 。为了保持一致性，本节我们将符号对照如下：

- 观测变量: $O \leftrightarrow x$
- 隐变量: $I \leftrightarrow z$
- 模型参数: λ

5.1 任务概览 (Tasks Overview)

1. Learning (学习):

- 目标: 已知观测 x ，估计参数 λ 。
- 算法: Baum-Welch Algorithm (EM Algorithm)。

2. Decoding (解码):

- 目标: 已知 x 和 λ ，找到最可能的隐状态序列 z 。
- 算法: Viterbi Algorithm。

3. Evaluation (概率计算):

- 目标: 已知 O 和 λ ，计算 $P(O|\lambda)$ 。
- 算法: Forward Algorithm。

4. Filtering (滤波):

- 目标: Online 地估计当前时刻的隐状态 $P(z_t|x_1, \dots, x_t)$ 。
- 公式:

$$P(z_t|x_{1:t}) = \frac{P(x_{1:t}, z_t)}{P(x_{1:t})} \propto P(x_{1:t}, z_t) = \alpha_t \quad (61)$$

- 算法: Forward Algorithm。通常用于实时系统中，根据过去和现在的观测推断当前状态。

5. Smoothing (平滑):

- 目标: Offline 地估计过去某时刻的隐状态 $P(z_t|x_1, \dots, x_T)$ 。
- 公式:

$$\begin{aligned}
P(z_t|x_{1:T}) &= \frac{P(x_{1:T}, z_t)}{P(x_{1:T})} \\
&= \frac{P(x_{t+1:T}|x_{1:t}, z_t)P(x_{1:t}, z_t)}{P(x_{1:T})} \\
&= \frac{P(x_{t+1:T}|z_t)P(x_{1:t}, z_t)}{P(x_{1:T})} \quad (\text{由齐次马尔可夫性}) \\
&\propto P(x_{1:t}, z_t)P(x_{t+1:T}|z_t) \\
&= \alpha_t \cdot \beta_t
\end{aligned} \tag{62}$$

- 算法: Forward-Backward Algorithm。利用了未来的信息，比单纯的 Filtering 更准确。

6. Prediction (预测):

- 目标: 预测未来的状态或观测。
- 状态预测: $P(z_{t+1}|x_{1:t})$

$$P(z_{t+1}|x_{1:t}) = \sum_{z_t} P(z_{t+1}, z_t|x_{1:t}) = \sum_{z_t} P(z_{t+1}|z_t)P(z_t|x_{1:t}) \tag{63}$$

- 观测预测: $P(x_{t+1}|x_{1:t})$

$$P(x_{t+1}|x_{1:t}) = \sum_{z_{t+1}} P(x_{t+1}|z_{t+1})P(z_{t+1}|x_{1:t}) \tag{64}$$