

EM 算法

吴天阳 张卓立

XJTU

强基数学

2022 年 11 月 13 日



目录

1 前置知识

2 EM 算法详解

- 问题引入
- 算法思路
- 算法大致流程
- EM 算法推导

3 EM 算法流程

定义 1 (极大似然估计)

设 x_1, \dots, x_n 是来自密度函数为 $f(x; \theta)$ 的独立随机样本, 称

$\mathcal{L}(\theta) = f(x_1, \dots, x_n; \theta) = \prod_{i=1}^n f(x_i; \theta)$ 为关于 θ 的**似然函数**, 则 θ 的极大似然估计为

$$\hat{\theta} = \arg \max_{\theta \in \Theta} L(\theta)$$

其中 Θ 为参数空间.

前置知识

定义 1 (极大似然估计)

设 x_1, \dots, x_n 是来自密度函数为 $f(x; \theta)$ 的独立随机样本, 称

$\mathcal{L}(\theta) = f(x_1, \dots, x_n; \theta) = \prod_{i=1}^n f(x_i; \theta)$ 为关于 θ 的**似然函数**, 则 θ 的极大似然估计为

$$\hat{\theta} = \arg \max_{\theta \in \Theta} L(\theta)$$

其中 Θ 为参数空间.

注 1

(1) θ 可以是一个参数向量 $(\theta_1, \dots, \theta_n)$, 包含多个参数.

(2) 计算时一般采用**对数似然函数** $l(\theta) = \log \mathcal{L}(\theta) = \sum_{i=1}^n \log f(x_i; \theta)$.

定理 2 (Jensen 不等式)

设 $f(x)$ 是 \mathbb{R} 上的实值凸函数, X 为随机变量, 若 $\mathbb{E}X$ 存在, 则

$$\mathbb{E}[f(X)] \geq f(\mathbb{E}X)$$

上式取到等号, 当且仅当, X 为常量.

定理 2 (Jensen 不等式)

设 $f(x)$ 是 \mathbb{R} 上的实值凸函数, X 为随机变量, 若 $\mathbb{E}X$ 存在, 则

$$\mathbb{E}[f(X)] \geq f(\mathbb{E}X)$$

上式取到等号, 当且仅当, X 为常量.

注 2

(1) 当 $f(x)$ 为凹函数时, 上述不等号反向, 即 $\mathbb{E}[f(X)] \leq f(\mathbb{E}X)$.

问题引入

假设有 A 和 B 两个硬币，每轮选择一个硬币，进行 N 次投掷得到一个样本集，包含 N 个样本 X_1, \dots, X_n ， X_i 表示每次的投掷结果（正面或反面），设硬币 A, B 分别服从不同的 Bernoulli 分布，记为 $B(1, p_1)$, $B(1, p_2)$ 。则样本中每个样本 X_1, \dots, X_n 来自这两个分布中的一个，但无法确定具体是哪一个分布，即不知道是投掷硬币 A 还是硬币 B 得到的 x_i 。

问题引入

假设有 A 和 B 两个硬币，每轮选择一个硬币，进行 N 次投掷得到一个样本集，包含 N 个样本 x_1, \dots, x_n ， x_i 表示每次的投掷结果（正面或反面），设硬币 A, B 分别服从不同的 Bernoulli 分布，记为 $B(1, p_1)$, $B(1, p_2)$ 。则样本中每个样本 x_1, \dots, x_n 来自这两个分布中的一个，但无法确定具体是哪一个分布，即不知道是投掷硬币 A 还是硬币 B 得到的 x_i 。

- 可以将该问题分为以下两个：

- ① 这轮投掷是使用硬币 A 还是硬币 B？
- ② 硬币 A 正面的概率 p_1 和硬币 B 正面的概率 p_2 分别是多少？

问题引入

假设有 A 和 B 两个硬币，每轮选择一个硬币，进行 N 次投掷得到一个样本集，包含 N 个样本 X_1, \dots, X_n ， X_i 表示每次的投掷结果（正面或反面），设硬币 A, B 分别服从不同的 Bernoulli 分布，记为 $B(1, p_1)$, $B(1, p_2)$ 。则样本中每个样本 X_1, \dots, X_n 来自这两个分布中的一个，但无法确定具体是哪一个分布，即不知道是投掷硬币 A 还是硬币 B 得到的 x_i 。

- 可以将该问题分为以下两个：
 - ① 这轮投掷是使用硬币 A 还是硬币 B？
 - ② 硬币 A 正面的概率 p_1 和硬币 B 正面的概率 p_2 分别是多少？
- 已知：
 - ① 模型的分布（均满足二项分布）
 - ② 观察到的样本（投掷结果）
- 未知：
 - ① 每个个体来自于哪个分布（投掷 A 还是 B）
 - ② 模型参数 (p_1, p_2)

- 通过引入隐变量 $Z = (Z_1, \dots, Z_n)$ 来将描述未被观测到的隐含数据, 表示上文中每个个体来自于哪个分布, 是由隐变量 Z 控制的.

- 通过引入隐变量 $Z = (Z_1, \dots, Z_n)$ 来将描述未被观测到的隐含数据, 表示上文中每个个体来自于哪个分布, 是由隐变量 Z 控制的.
- 举一个例子: 我们假设还有第三个硬币 C , 也服从 Bernoulli 分布 $B(1, p_3)$, 每次试验时, 先投掷硬币 C , 若硬币 C 为正面, 则投掷硬币 A , 反之, 则投掷硬币 B . 于是, 隐变量就是硬币 C 的投掷结果, 记为随机变量 Z , 且 $Z \sim B(1, p_3)$.

- 通过引入隐变量 $Z = (Z_1, \dots, Z_n)$ 来将描述未被观测到的隐含数据, 表示上文中每个个体来自于哪个分布, 是由隐变量 Z 控制的.
- 举一个例子: 我们假设还有第三个硬币 C , 也服从 Bernoulli 分布 $B(1, p_3)$, 每次试验时, 先投掷硬币 C , 若硬币 C 为正面, 则投掷硬币 A , 反之, 则投掷硬币 B . 于是, 隐变量就是硬币 C 的投掷结果, 记为随机变量 Z , 且 $Z \sim B(1, p_3)$.
- 通过这个例子, 我们可以假设隐变量 Z_1, \dots, Z_n 是来自密度函数为 $g(z)$ 的分布.
- 由于隐变量是人为假定的, 我们假设**隐变量独立同分布于某一种分布**, 从而能进一步对其研究. 在实际应用中, 试验数据应该满足这一假设, 才能使用 EM 算法.
- 这一假设分布称为**先验分布**, 由该分布导出的方法统称为 Bayes 方法, 所以 EM 算法也是属于 Bayes 统计.

算法大致流程

以上文抛硬币问题为例

- 1 初始化参数：投掷硬币 A,B 正面的概率分别为 p_1, p_2 .

算法大致流程

以上文抛硬币问题为例

- ① 初始化参数：投掷硬币 A,B 正面的概率分别为 p_1, p_2 .
- ② 计算每个样本是来自于哪个分布：由 A 投掷出来的概率大，还是由 B 投掷出来的概率大.

算法大致流程

以上文抛硬币问题为例

- ① 初始化参数：投掷硬币 A,B 正面的概率分别为 p_1, p_2 .
- ② 计算每个样本是来自于哪个分布：由 A 投掷出来的概率大，还是由 B 投掷出来的概率大.
- ③ 重新估计参数：通过每个样本属于 A 的概率，从而得到硬币 A 正面的期望次数和反面的期望次数，通过极大似然得到对 p_1 的估计. 同理可以得到 p_2 的估计. 对它们进行更新.

算法大致流程

以上文抛硬币问题为例

- ① 初始化参数：投掷硬币 A,B 正面的概率分别为 p_1, p_2 .
- ② 计算每个样本是来自于哪个分布：由 A 投掷出来的概率大，还是由 B 投掷出来的概率大.
- ③ 重新估计参数：通过每个样本属于 A 的概率，从而得到硬币 A 正面的期望次数和反面的期望次数，通过极大似然得到对 p_1 的估计. 同理可以得到 p_2 的估计. 对它们进行更新.
- ④ 若参数变化小于阈值，退出循环；否则返回步骤 2.

算法大致流程

以上文抛硬币问题为例

- ① 初始化参数：投掷硬币 A,B 正面的概率分别为 p_1, p_2 .
- ② 计算每个样本是来自于哪个分布：由 A 投掷出来的概率大，还是由 B 投掷出来的概率大.
- ③ 重新估计参数：通过每个样本属于 A 的概率，从而得到硬币 A 正面的期望次数和反面的期望次数，通过极大似然得到对 p_1 的估计. 同理可以得到 p_2 的估计. 对它们进行更新.
- ④ 若参数变化小于阈值，退出循环；否则返回步骤 2.

上述问题算法步骤 2 最难得到，这里就需要通过引入隐变量方法对其计算（利用 Bayes 公式）.

我们直接从最大似然估计开始推导

$$\log \mathcal{L}(\theta) = \sum_{i=1}^n \log f(x_i; \theta) = \sum_{i=1}^n \log \sum_{z_i} f(x_i, z_i; \theta) \quad (2.1)$$

$$\begin{aligned} &= \sum_{i=1}^n \log \sum_{z_i} g(z_i) \frac{f(x_i, z_i; \theta)}{g(z_i)} \\ &\geq \sum_{i=1}^n \sum_{z_i} g(z_i) \log \frac{f(x_i, z_i; \theta)}{g(z_i)} \end{aligned} \quad (2.2)$$

我们直接从最大似然估计开始推导

$$\log \mathcal{L}(\theta) = \sum_{i=1}^n \log f(x_i; \theta) = \sum_{i=1}^n \log \sum_{z_i} f(x_i, z_i; \theta) \quad (2.1)$$

$$\begin{aligned} &= \sum_{i=1}^n \log \sum_{z_i} g(z_i) \frac{f(x_i, z_i; \theta)}{g(z_i)} \\ &\geq \sum_{i=1}^n \sum_{z_i} g(z_i) \log \frac{f(x_i, z_i; \theta)}{g(z_i)} \end{aligned} \quad (2.2)$$

- (2.1) 处引入了 z_i , 从而将边缘分布转化为联合分布的形式.

我们直接从最大似然估计开始推导

$$\log \mathcal{L}(\theta) = \sum_{i=1}^n \log f(x_i; \theta) = \sum_{i=1}^n \log \sum_{z_i} f(x_i, z_i; \theta) \quad (2.1)$$

$$\begin{aligned} &= \sum_{i=1}^n \log \sum_{z_i} g(z_i) \frac{f(x_i, z_i; \theta)}{g(z_i)} \\ &\geq \sum_{i=1}^n \sum_{z_i} g(z_i) \log \frac{f(x_i, z_i; \theta)}{g(z_i)} \end{aligned} \quad (2.2)$$

- (2.1) 处引入了 z_i ，从而将边缘分布转化为联合分布的形式。
- (2.2) 处，由于 $\log(x)$ 为凹函数，且

$$\sum_{z_i} g(z_i) \frac{f(x_i, z_i; \theta)}{g(z_i)} = \mathbb{E} \left[\frac{f(x_i, z_i; \theta)}{g(z_i)} \right], \text{ 由 Jensen 不等式可得.}$$

$$\log \mathcal{L}(\theta) \geq \sum_{i=1}^n \sum_{z_i} g(z_i) \log \frac{f(x_i, z_i; \theta)}{g(z_i)}$$

于是我们得到了对数似然函数的一个下界，这个下界是由期望 $\mathbb{E} \left[\frac{f(x_i, z_i; \theta)}{g(z_i)} \right]$ 构成，这里就是 EM 算法中 Expectation 部分。我们希望将最大化问题转化为对右式最大化，也就是 EM 中的 Maximum 部分，先将 θ 固定（使用上一次迭代的 θ_t ），考虑当 $g(z_i)$ 满足什么条件时，Jensen 不等式取到等号。

EM 算法推导

$$\log \mathcal{L}(\theta) \geq \sum_{i=1}^n \sum_{z_i} g(z_i) \log \frac{f(x_i, z_i; \theta)}{g(z_i)}$$

于是我们得到了对数似然函数的一个下界，这个下界是由期望 $\mathbb{E} \left[\frac{f(x_i, z_i; \theta)}{g(z_i)} \right]$ 构成，这里就是 EM 算法中 Expectation 部分。我们希望将最大化问题转化为对右式最大化，也就是 EM 中的 Maximum 部分，先将 θ 固定（使用上一次迭代的 θ_t ），考虑当 $g(z_i)$ 满足什么条件时，Jensen 不等式取到等号。

$$\begin{aligned} \frac{f(x_i, z_i; \theta)}{g(z_i)} = c &\Rightarrow f(x_i, z_i; \theta) = c g(z_i) \\ \Rightarrow f(x_i; \theta) = \sum_{z_i} f(x_i, z_i; \theta) &= c \sum_{z_i} g(z_i) = c. \end{aligned}$$

$$\text{于是 } g(z_i) = \frac{f(x_i, z_i; \theta)}{c} = \frac{f(x_i, z_i; \theta)}{f(x_i; \theta)} = f(z_i | x_i; \theta).$$

- 1 初始化参数 θ_0 .

EM 算法流程

① 初始化参数 θ_0 .

② • E 步: 计算条件概率期望 $g_i(z_i) = f(z_i|x_i; \theta_t)$,

$$\text{对数似然函数 } \log \mathcal{L}(\theta) = \sum_{i=1}^n \sum_{z_i} g_i(z_i) \log f(x_i, z_i; \theta)$$

• M 步: 极大化对数似然函数, 更新参数 θ :

$$\theta_{t+1} = \arg \max_{\theta \in \Theta} \log \mathcal{L}(\theta)$$

EM 算法流程

① 初始化参数 θ_0 .

② • E 步: 计算条件概率期望 $g_i(z_i) = f(z_i|x_i; \theta_t)$,

$$\text{对数似然函数 } \log \mathcal{L}(\theta) = \sum_{i=1}^n \sum_{z_i} g_i(z_i) \log f(x_i, z_i; \theta)$$

• M 步: 极大化对数似然函数, 更新参数 θ :

$$\theta_{t+1} = \arg \max_{\theta \in \Theta} \log \mathcal{L}(\theta)$$

③ 返回第 2 步, 直到 θ_{t+1} 收敛.