

最大期望算法

张卓立、吴天阳

强基数学 001& 002

2022 年 11 月 14 日

EM 算法是用于解决含有隐变量的参数估计方法, 分为求取期望 (E 步骤) 和期望最大化 (M 步骤) 两个步骤:

- ▶ E 步骤: 先假设模型参数初始值, 估计隐变量取值;
- ▶ M 步骤: 基于观测数据、模型参数和隐变量取值一起来最大化“拟合”数据, 更新模型参数.