

EM algoritmus je velmi cenným nástrojem pro výpočty statistických problému, kde nám nejsou k dispozici všechna data. Jedná se o iterací algoritmus, který v prvním kroku hledá odhady chybejících hodnot na základe podoby parametru z predchozí iterace a zadaných dat. Činí tak přes podmínené střední hodnoty. V další fázi metodami maximální verohodnosti hledá odhad parametru maximalizující logaritmicou verohodnostní funkci, který předá do další iterace. Tento postup je opakován až do bodu, kdy jsou přírůstky funkce mezi iteracemi tak malé, že se ukončení postupu na výsledku závažněji neprojeví. Důležitou charakteristikou je monotónní konvergence za značné obecných podmínek, ale ta na druhou stranu nepatří mezi nejrychlejší, a proto je mnohokrát zapotřebí velkého množství iterací.