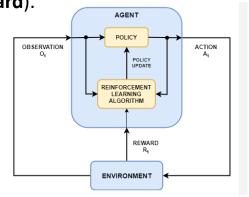
# 13 Aprendizagem por Reforço

CPereira IC, 22/23

## Princípios

 O agente observa o ambiente (estado), toma uma decisão (ação) e recebe um reforço (reward).

- Objetivo: Otimizar "reward".



https://www.mathworks.com/help/reinforcement-learning/ug/what-is-reinforcement-learning.html

## Princípios

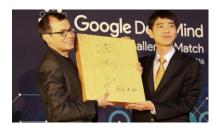
- História
  - 1950, jogos, sistemas de controlo, ...
  - 2013, DeepMind
    - Os agentes aprenderam a jogar "Atari games" do zero, superando os humanos! Nenhum conhecimento prévio!
    - Estado = Imagem representada em "pixels brutos"



» 2014, DeepMind was bought by Google (over 500 million dollars!)

## Princípios

- ...
  - -2016
    - AlphaGo, vitória contra o campeão mundial!



- https://www.deepmind.com/research/highlighted-research/alphago

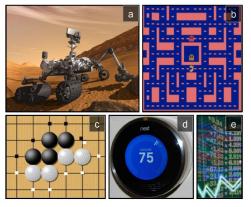
## Princípios

- Como representar o problema?
  - "Walking robot"
    - Ambiente mundo real
    - Ações andar em direções definidas
    - Reward reforço ou recompensa
      - Positiva: aproxima-se do alvo
      - Negativa: vai na direção errada, perde tempo, cai, ...



# Princípios

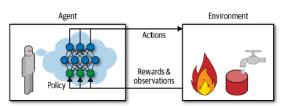
- ...
  - Controlador de temperatura da água
    - Ações: Sinal de atuação (caudal de água quente)
    - reforço
      - positivo: Aproxima-se da temperatura alvo;
      - negativo: Intervenção humana,...
  - Mercado de ações
    - Ações: Comprar ou vender (a cada segundo)
    - reforço: ganhos monetários



[1]

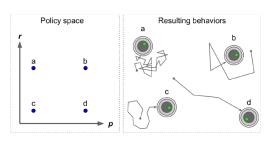
#### **Políticas**

- Política (Policy)
  - O que é
    - Algoritmo usado para determinar as ações
  - Implementação da política:
    - Regras lógicas (boolean ou fuzzy)
    - Redes neuronais
    - Qualquer outro algoritmo... determinista ou probabilístico



#### **Políticas**

- Exemplo
  - Robot Aspirador (Open AI Gym)
    - Reward: quantidade de pó que recolhe a cada 30 minutos
    - Ações (a cada segundo) "política estocástica";
      - Mover em frente
        - » Com probabiliadade p
      - Rodar
        - » Ângulo aleatório [-r +r]
        - » com probabilidade (1-p)
    - Parâmetros de política (p, r)



#### **Políticas**

• ...

- Como determinar os parâmetros p e r?
  - Força bruta experimentar muitas combinações e escolher a melhor!
  - · Algoritmo genético
    - 100 políticas aleatórias iniciais individual=(p,r)
    - Selecione os 20 melhores indivíduos
    - Cada indivíduo produz 4 descendentes (cópia do pai mais alguma variação aleatória)
    - Iterar até obter uma política "boa"
  - Gradiente do reforço em relação aos parâmetros.
    - Se aumentarmos "p" aumenta a recompensa?

#### Políticas - Exercício

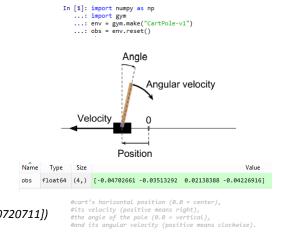
- Exemplo OpenAI Gym
  - https://github.com/openai/gym
  - Permite simular ambientes

```
>>Pip install –upgrade gym 
>>import gym
```

Vamos considerar um modelo 2D, o bem conhecido "cart-pole"

```
>>> env = gym.make("CartPole-v0")
>>> obs = env.reset()
>>> obs

array([-0.03799846, -0.03288115, 0.02337094, 0.00720711])
>>> env.render()
```



#### Políticas - Exercício

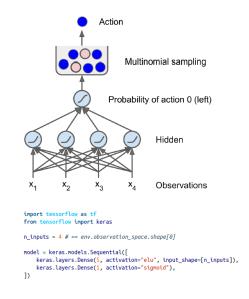
٠..

- Uma política básica:
  - <u>acelera para a esquerda</u> quando o pêndulo está inclinado para a esquerda
  - <u>acelera para a direita</u> quando o pêndulo está inclinado para a direita.
- Funciona?
  - Executamos esta política, observando a média de recompensas que recebe, para 500 episódios.
  - Nunca conseguiu equilibrar o pêndulo por mais de 72 iterações consecutivas!!

```
In [15]: def basic_policy(obs):
    ...: angle = obs[2]
               return 0 if angle < 0 else 1
     ...:
     ...:
     ...:
    ...: totals=[]
     ...: for episode in range(500):
               episode_rewards=0
     ...:
     ...:
                obs=env.reset()
     ...:
               for step in range(200):
     ...:
                    action=basic_policy(obs)
                    # visualize each step
                    #env.render()
     ...:
     ...:
                    obs, reward, done, info=env.step(action)
     ...:
                    episode_rewards+=reward
     ...:
                    if done:
     ...:
                        break
     ...:
               totals.append(episode_rewards)
...: np.mean(totals), np.std(totals), np.min(totals), np.max(totals)
Out[15]: (41.17, 8.529073806092026, 24.0, 72.0)
```

#### Políticas - Exercício

- Como aprender a política com uma rede neuronal?
  - Input: observação
    - posição, velocidade, angulo, velocidade angular
  - Output: ação a executar
    - "esq" ou "di"r (random probabilistic)
- Como treinar a rede?
  - Não conhecemos a melhor ação para cada observação, assim não podemos usar supervisão!
  - · "Credit assignment"

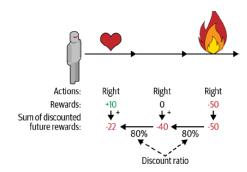


#### Políticas - Exercício

• ...

#### - Treino da rede

- "Credit assignment"
  - Avaliar um Acão com base na soma de todos os "rewards" subsequentes, aplicando "discount rates - r".
  - Um discount rate perto de zero faz com que apenas rewards imediatos sejam considerados.



#### Políticas - Exercício

- Os fatores de desconto típicos variam entre 0.9 e 0.99.
  - Com um fator de desconto de **0.95**, 13 passos no futuro contam aproximadamente metade de recompensas imediatas  $(0.95^{13} \approx 0.5)$ .
  - Com um fator de desconto de 0.99, 69 passos para o futuro valem metade das recompensas imediatas (0.99<sup>69</sup> ≈ 0,5).
  - No ambiente "Cart-Pole", as ações têm efeitos de curto prazo, assim a escolha de um fator de desconto de 0.95 parece razoável.

#### Políticas - Exercício

• ...

#### Policy Gradient

- 1. Executar a rede neuronal por vários episódios, e em cada iteração calcular os gradientes que tornariam a ação tomada mais provável.
  - 1. Probabilidade=1 para ação "left" and p=0 se ação "rigth"
  - 2. Output=0.8; ação=left; erro=1-0.8=0.2
  - 3. Não aplicar estes gradientes, por agora!!
- 2. Depois de cada episódio, calcular o reforço por ação.
  - 1. Usando a metodologia anterior, "credit assignment"
- 3. Multiplicar o gradiente pelo reforço.
  - Se reforço positivo, aplica-se o gradiente calculado anteriormente para fazer com que a ação seja mais provável!
  - 2. Se reforço negativo, aplica-se o gradiente oposto.
- Calcular a média de todos os vetores gradiente e executar um passo do algoritmo "Gradient Descent"

### Políticas: "Policy Gradient"

• ..

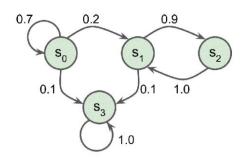
- O algoritmo de gradientes de política simples que acabamos de treinar resolveu a tarefa Cart-Pole, mas não escalaria bem para tarefas mais complexas.
- Altamente ineficiente, pois precisa de explorar o ambiente por muito tempo antes de pode fazer progressos significativos, pois deve executar vários episódios para estimar a vantagem de cada ação.
- No entanto pode ser combinado com outras técnicas:
  - AlphaGo baseou-se neste algoritmo, combinado com "Monte Carlo Tree Search"
- Baseia-se no princípio:
  - Otimizar a política para aumentar os rewards.
- Princípo alternativo:
  - O agente tenta estimar a soma esperada dos reforços (com taxa de desconto) para cada acção em cada estado!

#### MDP – Markov Decision Processes

- ..
- Princípo alternativo:
  - O agente tenta estimar a soma esperada dos reforços (com taxa de desconto) para cada acção em cada estado!
  - Como efetuar este cálculo?
- Cadeias de Markov
  - Processo estocástico tendo uma distribuição de probabilidade aleatória ou padrão que pode ser analisado estatisticamente, mas não pode ser previsto com precisão.
  - Esteprocesso tem um número fixo de estados e evolui aleatoriamente de um estado para outro a cada passo.
  - A probabilidade de ele evoluir de um estado s para um estado s' é fixa, e depende apenas do par (s,s'), não de estados passados (o sistema não possui memória).

#### Processos de Markov

- ....
  - Exemplo de uma cadeia de Markov



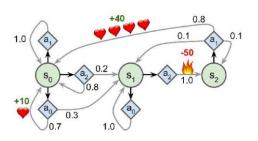
#### Processos de Markov

• ...

- Processos de decisão de Markov (MDP)
  - similar a uma cadeia mas com as seguintes diferenças:
    - A cada passo o agente pode escolher uma acção
    - As probabilidades de transição dependem da ação tomada
    - Algumas transições oferecem reforço (positivo ou negativo)
  - Objetivo do agente:
    - Maximizar o reforço ao longo do tempo!
    - Política Ótima recompensa acumulada máxima.

#### Processos de Markov

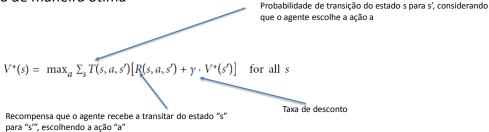
- Exemplo:
  - 3 estados e até 3 acções em cada estado.
    - Qual a melhor estratégia para otimizar a recompensa ao longo do tempo?



### Value Iteration Algorithm

• ...

- Bellman Optimality Equation
  - Calcula V\*(s) a soma de todas as recompensas futuras descontadas que o agente pode esperar em média, após atingir um estado s, supondo que ele atua de maneira ótima



## Value Iteration Algorithm

• ...

- A equação de Bellman conduz diretamente a um algoritmo que pode estimar o valor ótimo de cada estado possível:
  - Inicializa todas as estimativas do valor de estado a zero
  - Atualiza iterativamente o valor Value Iteration:

Valor na iteração k para s'

Valor estimado na iteração (k+1) para  ${\bf s}$ 

$$V_{k+1}(s) \leftarrow \max_{a} \sum_{s'} T(s, a, s') [R(s, a, s') + \gamma \cdot V_k(s')]$$
 for all  $s$ 

 Dado tempo suficiente, as estimativas convergem para os valores ótimos, correspondendo à política ótima .

## Q-Value Iteration Algorithm

• ..

- Conhecer os valores ótimos para cada estado é bastante útil, em particular para avaliar uma política, mas não informa explicitamente ao agente o que fazer - qual a ação a tomar?
  - Existe um algoritmo semelhante para estimar os valores de ação de estado ótimos, geralmente designados de Q-Values:

$$Q_{k+1}(s,a) \leftarrow \sum_{s'} T(s,a,s') \left[ R(s,a,s') + \gamma \cdot \max_{a'} Q_k(s',a') \right] \quad \text{for all } (s'a)$$

Valor para o par (s,a) na iteração (k+1):

Representa a soma das recompensas futuras descontadas que o agente pode esperar depois de **atingir o estado s e escolher a ação a**, mas antes de ver o resultado da sua ação, supondo que atua de forma ótima após essa ação!

### Q-Value Iteration Algorithm

٠..

- Implementação
  - Quando o agente está no estado s0 e escolhe a ação a1, a soma esperada de recompensas futuras descontadas é de aproximadamente 17,02
  - Politica ótima <u>para desconto de</u> <u>0.90</u>:
    - No estado s0 escolha a ação a0;
    - em s1, escolha a ação a0 (ou seja, fique parado);
    - em s2 escolha a ação a1 (a única ação possível).

### Temporal Difference Learning

• ...

#### - Observações:

- Os problemas de Aprendizagem por Reforço com ações discretas podem ser representados como Processos de decisão de Markov,
- Contudo, o agente inicialmente n\u00e3o conhece:
  - As probabilidades de transição (não sabe a priori T(s, a, s'))
  - As recompensas (não conhece a priori R(s, a, s')).

#### - Solução

- O agente deve "experimentar" cada estado e cada transição:
  - pelo menos uma vez para conhecer as recompensas;
  - várias vezes para obter uma estimativa razoável das probabilidades de transição.

### **Temporal Difference Learning**

• ..

- O algoritmo (TD Learning) é semelhante ao "Value Iteration", mas ajustado para levar em conta o fato de que o agente apenas possui conhecimento parcial do MDP.
  - O agente inicialmente conhece apenas os possíveis estados e ações.
  - O agente usa uma política de exploration por exemplo, uma política puramente aleatória - para "explorar" o MDP e atualiza as estimativas dos valores de estado com base nas transições e recompensas realmente observadas.
  - Algoritmo do "tipo" gradiente converge caso se reduza gradualmente o "learning rate".

$$V_{k+1}(s) \leftarrow (1-\alpha)V_k(s) + \alpha(r+\gamma \cdot V_k(s'))$$
  
or, equivalently:  
 $V_{k+1}(s) \leftarrow V_k(s) + \alpha \cdot \delta_k(s, r, s')$   
with  $\delta_k(s, r, s') = r + \gamma \cdot V_k(s') - V_k(s)$ 

- α is the learning rate (e.g., 0.01).
- $r + y \cdot V_k(s')$  is called the TD target.
- δ<sub>k</sub>(s, r, s') is called the TD error.

### **Q-Learning**

#### - algoritmo Q-Learning

- é uma adaptação do "Q-Value Iteration" quando as probabilidades de transição e as recompensas são inicialmente desconhecidas:
  - Observa um agente a "jogar" (por exemplo, aleatoriamente) e melhora gradualmente as suas estimativas dos valores Q.
  - Depois de obter estimativas precisas (ou próximas), a política ideal é escolher a ação com o maior Q-Value (a política "greedy"):

$$Q(s, a) \leftarrow_{\alpha} r + \gamma \cdot \max_{a'} Q(s', a')$$

```
def step(state, action):
    probas = transition_probabilities[state][action]
    next_state = np.random.choice([0, 1, 2], p=probas)
reward = rewards[state][action][next_state]
     return next_state, reward
def exploration policy(state):
    return np.random.choice(possible_actions[state])
alpha0 = 0.05 # initial learning rate
decay = 0.005 # learning rate decay
gamma = 0.90 # discount factor
state = 0 # initial state
for iteration in range(10000):
    action = exploration_policy(state)
next_state, reward = step(state, action)
     next_value = np.max(Q_values[next_state])
    alpha = alpha0 / (1 + iteration * decay)
    Q_{values[state, action]} *= 1 - alpha
    Q_values[state, action] += alpha * (reward + gamma * next_value)
    state = next state
```

### **Q-Learning**

- "Exploration vs Exploitation"
  - O algoritmo só pode funcionar se explorar suficientemente o problema MDP.
    - Embora uma política puramente aleatória garanta a visita "eventualmente frequente" a todos os estados e transições, conduz a um tempo extremamente longo para problemas de alguma complexidade!
    - Assim, opta-se por uma politica designada de ε-greedy:
      - » a cada passo age aleatoriamente com probabilidade ε, ou avidamente (i.e., escolhendo a ação com o valor-Q mais alto) com probabilidade 1–ε.
      - » Vantagem
        - comparada a uma política completamente aleatória, é que dedica cada vez mais tempo a "visitar" as partes mais interessantes do ambiente (exploitation), à medida que as estimativas melhoram, sem deixar de "visitar" as regiões desconhecidas do problema (exploration).
      - » Deve começar-se com um valor alto para ε (perto de 1.0) e depois reduzi-lo gradualmente (por exemplo, para 0.05).

### **Q-Learning**

• ...

- O algoritmo Q-Learning é designado de "off-policy" porque a política que está a ser treinada não é necessariamente aquela que está a ser executada
  - no exemplo do código anterior, a política executada (a política de exploração) é aleatória, enquanto a política treinada baseia-se na escolha das ações com os maiores valores de Q!
- Funções de "exploração":
  - para experimentar ações que não tentou antes!
    - » implementado através de um bónus adicionado às estimativas de Q-Value.



Função de exploração, por exemplo f(Q,N)=Q+k(1+N), onde o híper-parâmetro k define a "curiosidade" – grau de atração para o desconhecido!

### **Q-Learning**

•

- Algoritmos de aproximação
  - Q-Learning não é possível escalar para problemas de média ou elevada dimensão com muitos estados e ações.
  - Por exemplo como treinar um agente para jogar Pac-Man?
    - Existem cerca de 150 pellets que Pac-Man pode comer, cada um dos quais pode estar presente ou ausente (ou seja, já comido) – assim o número de estados possíveis é superior a 2e150. E se adicionar todas as combinações possíveis de posições para todos os fantasmas, o número de estados possíveis torna-se maior que o número de átomos no planeta Terra,
    - Não há nenhuma forma de gerir uma tabela de Q-Values.
  - · Solução:
    - Encontrar uma função  $Q_{\theta}$  (s,a) que aproxime os Q-values, mantendo um número razoável de parâmetros  $(\theta)$ !

#### Deep Q-Learning

• ...

- Uma rede DNN para estimar valores Q é designada de rede Q profunda (DQN)
  - A aprendizagem com DQNs é designada de "Deep Q-Learning".
- Como podemos treinar um DQN?
  - Considerando o valor Q aproximado calculado pelo DQN para um determinado par estado-ação (s, a).
  - Este valor deve estar o mais próximo possível da recompensa r observada depois de experimentar a ação a no estado s, mais o valor descontado de decidir de forma otimizada a partir de então.

$$Q_{\text{target}}(s, a) = r + \gamma \cdot \max_{a'} Q_{\theta}(s', a')$$

### Deep Q-Learning - exemplo

- Implementação Cart-Pole
  - <a href="https://github.com/ageron/handson-ml">https://github.com/ageron/handson-ml</a>
  - Em teoria, precisamos de uma rede neuronal que recebe um par "estadoação" e gera um Q-Value aproximado.
  - Na prática é mais eficiente usar uma rede que **recebe um estado** e gera um valor aproximado "Q-Value" para cada ação possível!

```
env = gym.make("CartPole-v0")
input_shape = [4] # == env.observation_space.shape
n_outputs = 2 # == env.action_space.n
model = keras.models.Sequential([
keras.layers.Dense(32, activation="elu", input_shape=input_shape),
keras.layers.Dense(32, activation="elu"),
keras.layers.Dense(n_outputs)
])
```

### Deep Q-Learning - exemplo

• ...

 Para selecionar uma ação, escolhemos a ação com o maior "Qvalue" previsto pela rede. Mas, para garantir que o agente explore o ambiente, usamos uma política "ε-greedy" (ou seja, vamos escolher uma ação aleatória com probabilidade ε, ou greedy caso contrário)

```
def epsilon_greedy_policy(state, epsilon=0):
    if np.random.rand() < epsilon:
        return np.random.randint(2)
    else:
        Q_values = model.predict(state[np.newaxis])
        return np.argmax(Q_values[0])</pre>
```

### Deep Q-Learning - exemplo

- Em vez de treinar a rede com base apenas nas experiências mais recentes, armazenamos todas as experiências numa memória de "replay", e posteriormente criamos uma amostra, aleatoriamente, em cada iteração de treino.
  - Ajuda a reduzir as correlações entre as experiências num batch de treino!
  - Cada experiência é composta por cinco elementos: estado, a ação que o agente realizou, a recompensa resultante, o próximo estado alcançado e, finalmente, uma variável booleana indicando se o episódio terminou naquele ponto (concluído).
  - Precisamos de uma função para criar uma amostra aleatória de "experiências" a partir do buffer de "replay".

### Deep Q-Learning - exemplo

• ...

- Necessitamos ainda:
  - uma função que executa uma única etapa usando a política ε-greedy, e armazena a experiência resultante no buffer de repetição.

```
def play_one_step(env, state, epsilon):
    action = epsilon_greedy_policy(state, epsilon)
    next_state, reward, done, info = env.step(action)
    replay_buffer.append((state, action, reward, next_state, done))
    return next_state, reward, done, info
```

### Deep Q-Learning - exemplo

• ...

• uma função que irá criar a amostra (batch) de experiências do buffer e treine a rede DQN executando um passo do "gradient descent" neste batch.:

```
batch_size = 32
discount_factor = 0.95
optimizer = keras.optimizers.Adam(lr=1e-3)
loss_fn = keras.losses.mean_squared_error
def training_step(batch_size):
    experiences = sample_experiences(batch_size)
    states, actions, rewards, next_states, dones = experiences
    next_Q_values = model.predict(next_states)
    max_next_0_values = np.max(next_0_values, axis=1)
target_0_values = (rewards + (1 - dones) * discount_factor * max_next_0_values)
    mask = tf.one_hot(actions, n_outputs)
    with tf.GradientTape() as tape:
        all_Q_values = model(states)
        Q_values = tf.reduce_sum(all_Q_values * mask, axis=1, keepdims=True)
        loss = tf.reduce_mean(loss_fn(target_Q_values, Q_values))
    grads = tape.gradient(loss, model.trainable_variables)
    optimizer.apply gradients(zip(grads, model.trainable variables))
```

### Deep Q-Learning - exemplo

• ...

· Treino do modelo

```
for episode in range(600):
    obs = env.reset()
    for step in range(200):
        epsilon = max(1 - episode / 500, 0.01)
        obs, reward, done, info = play_one_step(env, obs, epsilon)
        if done:
            break
    if episode > 50:
        training_step(batch_size)
```

# Deep Q-Learning - exemplo

- Outra variante...Deep SARSA
  - Existem duas políticas: de comportamento do agente e aprendizagem.
    - A política de comportamento é utilizada para gerar ações At+1; a política de aprendizagem é o que o agente aprende por meio de tais interações para atualizar Q. Na SARSA as duas políticas são iguais, sendo designado de método "on-policy".

» 
$$Q(s_t, a_t) = Q(s_t, a_t) + \alpha^*(r_t + \gamma^*Q(s_{t+1}, a_{t+1}) - Q(s_t, a_t))$$

- Implementação de um agente SARSA com biblioteca Keras-rl
  - https://keras-rl.readthedocs.io/en/latest/agents/sarsa/
  - https://www.mathworks.com/help/reinforcement-learning/ug/sarsa-agents.html

### Referências

- [1] Hands on Machine Learning with scikit learn and tensorflow, Aurelien Geron, O'Reilly, 2017.
- <a href="https://github.com/ageron/handson-ml">https://github.com/ageron/handson-ml</a>
- <a href="https://www.mathworks.com/help/reinforcement-learning">https://www.mathworks.com/help/reinforcement-learning</a>