

UNIVERSIDAD CAMPUS SUR

Universidad del Valle de Guatemala - UVG

Facultad de Ingeniería - Computación Curso: CC3104 - Aprendizaje por Refuerzo Sección: 10

Laboratorio 4: Métodos de Monte Carlo

• Linda Inés Jiménez Vides - 21169

• Mario Antonio Guerra Morales - 21008

• Diego Alexander Hernández Silvestre - **21270**

Autores:

UVG

de no hacer una correcta exploración.

1. ¿Cómo afecta la elección de la estrategia de exploración (exploring starts vs soft policy) a la precisión de la evaluación de políticas en los métodos de Monte Carlo? Considere la posibilidad de comparar el desempeño de las políticas evaluadas con y sin explorar los inicios o con diferentes niveles de exploración en políticas blandas. • La elección de estrategia de exploración sí tiene un impacto directo en la evaluación de políticas al usar los métodos de Monte Carlo. Si se utiliza Exploring Starts, se garantiza una mayor diversidad en las trayectorias debido a que se puede iniciar desde distintas combinaciones de estados y de acciones. Mientras que, con Soft Policies se añade un equilibrio entre la exploración y la exploración de acciones aleatorias, se añade la posibilidad de seguir explorando nuevas y aleatorias trayectorias, aún priorizando acciones de mayor valor. 2. En el contexto del aprendizaje de Monte Carlo fuera de la póliza, ¿cómo afecta la razón de muestreo de importancia a la convergencia de la evaluación de políticas? Explore cómo la razón de muestreo de importancia afecta la estabilidad y la convergencia. • La razón de muestreo de importancia ajusta las estimaciones de retorno para que la política objetivo se refleje utilizando datos de manera diferente. Esta afecta al permitirse aprender sobre una política objetivo sin hacer un seguimiento directo, pero también es capaz de hacer inestables las razones si tanto el comportamiento como el objetivo difieren demasiado. 3. ¿Cómo puede el uso de una soft policy influir en la eficacia del aprendizaje de políticas óptimas en comparación con las políticas deterministas en los métodos de Monte Carlo? Compare el desempeño y los resultados de aprendizaje de las políticas derivadas de estrategias épsilon-greedy con las derivadas de políticas deterministas. • Una soft policy puede influir con una mayor exploración, esto para ayudar al descubrimiento de acciones que no son efectivas a corto plazo. Mientras que, una política determinista elegirá la misma acción siempre, lo que puede llegar a darse el riesgo

4. ¿Cuáles son los posibles beneficios y desventajas de utilizar métodos de Monte Carlo off-policy en comparación con los on-policy en términos de eficiencia de la muestra, costo computacional y velocidad de aprendizaje?

• Los métodos de Monte Carlo off-policy ofrecen una mejor eficiencia al existir la posibilidad de usar datos previos o simulados, pero ello contempla un mayor costo computacional. Sin embargo, esto a su vez permite una gran flexibilidad y con ello una velocidad de > Task 2

aprendizaje considerable, si es que las políticas no difieren mucho con el objetivo. En este ejercicio, simulará un sistema de gestión de inventarios para una pequeña tienda minorista. La tienda minorista. La tienda minorista de diferentes productos. Utilizará métodos de Monte Carlo para la evaluación de pólizas, exploring starts, soft policies y aprendizaje off-policy para estimar el valor de diferentes estrategias de gestión de inventarios. Su objetivo es implementar una solución en Python y responder preguntas específicas en función de los resultados.

Definición del entorno

In [56]: **import** numpy as np

import random

class InventoryEnvironment: def __init__(self):

self.max_stock = 10

self.state = None

return self.state

for product in self.products:

stock = self.state[product] restock = action[product]

self.state[product] -= sales

return self.state.copy(), reward

Elegir acción según la política

next_state, reward = env.step(action)

'product_A': random.randint(0, 3), 'product_B': random.randint(0, 3)

In [59]: def generate_episodes(env, policy, num_episodes=100, num_days=10):

for day, (state, action, reward) in enumerate(ep):

In [61]: def generate_episode_exploring_starts(env, policy, num_days=10):

product: random.randint(0, env.max_stock)

Acción inicial aleatoria solo en el primer paso

episode.append((state.copy(), action.copy(), reward))

In [62]: def generate_episodes_exploring_starts(env, policy, num_episodes=5, num_days=7):

print(f"\n--- Episodio (Exploring Starts) {i+1} ---") for day, (state, action, reward) in enumerate(ep):

In [64]: Q = {} # Q-table para almacenar valores de acción-estado = [list of returns]

def epsilon_greedy_policy(Q, state, epsilon=0.1):

Seleccionar acción aleatoria

return eval(best action)

for _ in range(num_episodes): state = env.reset()

for _ in range(num_days):

state = next_state episodes.append(episode)

if state_key not in Q or random.random() < epsilon:</pre>

'product_A': random.randint(0, 3), 'product_B': random.randint(0, 3)

Seleccionar la mejor acción basada en Q

episode = generate_episode_exploring_starts(env, policy, num_days)

In [63]: episodes_es = generate_episodes_exploring_starts(env, random_policy, num_episodes=3, num_days=5)

print(f"Día {day+1}: Estado={state}, Acción={action}, Recompensa={reward}")

Día 1: Estado={'product A': 2, 'product B': 4}, Acción={'product A': 3, 'product B': 1}, Recompensa=-22 Día 2: Estado={'product_A': 5, 'product_B': 5}, Acción={'product_A': 0, 'product_B': 2}, Recompensa=6 Día 3: Estado={'product_A': 3, 'product_B': 7}, Acción={'product_A': 1, 'product_B': 2}, Recompensa=11 Día 4: Estado={'product_A': 4, 'product_B': 7}, Acción={'product_A': 3, 'product_B': 3}, Recompensa=-1 Día 5: Estado={'product_A': 5, 'product_B': 9}, Acción={'product_A': 3, 'product_B': 0}, Recompensa=25

Día 1: Estado={'product_A': 6, 'product_B': 8}, Acción={'product_A': 0, 'product_B': 1}, Recompensa=8 Día 2: Estado={'product_A': 6, 'product_B': 8}, Acción={'product_A': 0, 'product_B': 0}, Recompensa=20 Día 3: Estado={'product_A': 4, 'product_B': 8}, Acción={'product_A': 3, 'product_B': 0}, Recompensa=5 Día 4: Estado={'product_A': 5, 'product_B': 8}, Acción={'product_A': 1, 'product_B': 2}, Recompensa=6 Día 5: Estado={'product_A': 5, 'product_B': 9}, Acción={'product_A': 2, 'product_B': 1}, Recompensa=-2

Día 1: Estado={'product_A': 10, 'product_B': 0}, Acción={'product_A': 0, 'product_B': 3}, Recompensa=-6 Día 2: Estado={'product_A': 10, 'product_B': 2}, Acción={'product_A': 1, 'product_B': 0}, Recompensa=10 Día 3: Estado={'product_A': 10, 'product_B': 1}, Acción={'product_A': 3, 'product_B': 0}, Recompensa=-15 Día 4: Estado={'product_A': 10, 'product_B': 1}, Acción={'product_A': 3, 'product_B': 0}, Recompensa=10 Día 5: Estado={'product_A': 9, 'product_B': 0}, Acción={'product_A': 3, 'product_B': 1}, Recompensa=13

• Utilice una soft policy (como epsilon-greedy) para garantizar un equilibrio entre la exploración y la explotación.

best_action = max(Q[state_key], key=lambda a: np.mean(Q[state_key][a]))

def generate_episodes_soft_policy(env, Q, num_episodes=5, num_days=7, epsilon=0.1):

action = epsilon_greedy_policy(Q, state, epsilon)

episode.append((state.copy(), action.copy(), reward))

next_state, reward = env.step(action)

for state, action, reward in reversed(episode):

if (state key, action key) not in visited:

if action_key not in Q[state_key]:

Q[state_key][action_key].append(G)

Q[state_key][action_key] = []

episodes_soft = generate_episodes_soft_policy(env, Q, epsilon=0.1, num_episodes=5, num_days=5)

print(f"Día {day+1}: Estado={state}, Acción={action}, Recompensa={reward}")

Día 1: Estado={'product_A': 4, 'product_B': 9}, Acción={'product_A': 3, 'product_B': 1}, Recompensa=3 Día 2: Estado={'product_A': 4, 'product_B': 9}, Acción={'product_A': 1, 'product_B': 1}, Recompensa=-2 Día 3: Estado={'product_A': 4, 'product_B': 10}, Acción={'product_A': 0, 'product_B': 0}, Recompensa=30 Día 4: Estado={'product_A': 4, 'product_B': 8}, Acción={'product_A': 3, 'product_B': 0}, Recompensa=5 Día 5: Estado={'product_A': 5, 'product_B': 8}, Acción={'product_A': 3, 'product_B': 2}, Recompensa=-9

Día 1: Estado={'product_A': 4, 'product_B': 0}, Acción={'product_A': 0, 'product_B': 2}, Recompensa=26 Día 2: Estado={'product_A': 4, 'product_B': 0}, Acción={'product_A': 0, 'product_B': 0}, Recompensa=20 Día 3: Estado={'product_A': 2, 'product_B': 0}, Acción={'product_A': 3, 'product_B': 0}, Recompensa=-15 Día 4: Estado={'product_A': 5, 'product_B': 0}, Acción={'product_A': 0, 'product_B': 3}, Recompensa=-1 Día 5: Estado={'product_A': 3, 'product_B': 3}, Acción={'product_A': 1, 'product_B': 2}, Recompensa=11

Día 1: Estado={'product_A': 4, 'product_B': 10}, Acción={'product_A': 3, 'product_B': 3}, Recompensa=-16 Día 2: Estado={'product_A': 4, 'product_B': 10}, Acción={'product_A': 0, 'product_B': 0}, Recompensa=20 Día 3: Estado={'product_A': 2, 'product_B': 10}, Acción={'product_A': 0, 'product_B': 1}, Recompensa=-7 Día 4: Estado={'product_A': 2, 'product_B': 10}, Acción={'product_A': 3, 'product_B': 1}, Recompensa=-22 Día 5: Estado={'product_A': 5, 'product_B': 10}, Acción={'product_A': 3, 'product_B': 0}, Recompensa=10

Día 1: Estado={'product_A': 4, 'product_B': 3}, Acción={'product_A': 0, 'product_B': 2}, Recompensa=36 Día 2: Estado={'product_A': 4, 'product_B': 3}, Acción={'product_A': 3, 'product_B': 0}, Recompensa=20 Día 3: Estado={'product_A': 5, 'product_B': 2}, Acción={'product_A': 3, 'product_B': 1}, Recompensa=18 Día 4: Estado={'product_A': 7, 'product_B': 1}, Acción={'product_A': 3, 'product_B': 1}, Recompensa=13 Día 5: Estado={'product_A': 8, 'product_B': 1}, Acción={'product_A': 3, 'product_B': 0}, Recompensa=5

Día 1: Estado={'product_A': 8, 'product_B': 7}, Acción={'product_A': 0, 'product_B': 1}, Recompensa=28 Día 2: Estado={'product_A': 8, 'product_B': 7}, Acción={'product_A': 1, 'product_B': 1}, Recompensa=-12 Día 3: Estado={'product_A': 9, 'product_B': 8}, Acción={'product_A': 2, 'product_B': 3}, Recompensa=-11 Día 4: Estado={'product_A': 8, 'product_B': 10}, Acción={'product_A': 3, 'product_B': 1}, Recompensa=18 Día 5: Estado={'product_A': 9, 'product_B': 8}, Acción={'product_A': 1, 'product_B': 3}, Recompensa=-16

• Implemente el aprendizaje off-policy para evaluar una política objetivo utilizando datos generados

action_space = [{'product_A': a, 'product_B': b} for a in range(0, 4) for b in range(0, 4)]

episode.append((state.copy(), action.copy(), reward, prob_b))

visited.add((state_key, action_key))

product: random.randint(0, 3) for product in env.products

Estado inicial aleatorio

env.state = state.copy()

for day in range(num_days):

action = {

state = next_state

for _ in range(num_episodes):

for i, ep in enumerate(episodes es):

--- Episodio (Exploring Starts) 1 ---

--- Episodio (Exploring Starts) 2 ---

--- Episodio (Exploring Starts) 3 ---

state_key = str(state)

return {

episodes = []

return episodes

G = 0

 $Q = \{\}$

def update_Q(Q, episodes):

update_Q(Q, episodes_soft)

--- Episodio (Soft Policy) 1 ---

--- Episodio (Soft Policy) 2 ---

--- Episodio (Soft Policy) 3 ---

--- Episodio (Soft Policy) 4 ---

--- Episodio (Soft Policy) 5 ---

n_actions = len(action_space)

def behavior_policy(state):

episodes = []

return episodes

valores = {} pesos = {}

> G = 0W = 1

for episodio in episodes:

else:

else:

episode = []

prob_b = 1.0 / n_actions return action, prob_b

for _ in range(num_episodes): state = env.reset()

for _ in range(num_days):

state = next_state episodes.append(episode)

def off_policy_evaluation(env, episodes, gamma=1.0):

G = gamma * G + reward

prob pi = 1.0

prob pi = 0.0

clave estado = str(state)

if clave_estado not in valores: valores[clave_estado] = 0 pesos[clave_estado] = 0

valores[clave estado] = valores[clave estado] + (W * G)

episodios_off = generate_episodes_off_policy(env, num_episodes=20, num_days=10)

1. ¿Cuál es el valor estimado de mantener diferentes niveles de existencias para cada producto?

episodes_soft = generate_episodes_soft_policy(env, Q, epsilon=0.2, num_episodes=300, num_days=10)

num_episodes=num_episodes, num_days=num_days)

En cambio, on-policy siempre evalúa la misma política que está usando para actuar, por lo que aprovecha todos los episodios y el valor promedio es más alto y estable.

3. ¿Cuál es el impacto de utilizar el aprendizaje fuera de la política en comparación con el aprendizaje dentro de la política?

eps_soft_local = generate_episodes_soft_policy(env, Q_tmp, epsilon=0.2, num_episodes=200, num_days=10)

Con una política blanda de ϵ =0.2 se calculó el promedio de retorno según el stock inicial de cada producto. Para producto. P

Al variar ε, los resultados fueron bastante parecidos, pero el mejor promedio se obtuvo con ε = 0.0 de 66.27. Con valores entre 0.1 y 0.3 el retorno bajó un poco, y con 0.5 volvió a subir pero sin superar el mejor resultado. Esto indica que, explorar más no ayudó mucho porque la

En on-policy ($\epsilon = 0.2$) obtuve un retorno promedio de 73.11. En off-policy, el promedio estimado de $V^{\pi}(s)$ fue de 14.06, calculado sobre 16 estados. Esta gran diferencia se debe a que en off-policy los episodios se generan con una política de comportamiento distinta a la política

objetivo. Como la política objetivo en este caso es determinista, solo los episodios que coinciden exactamente con sus acciones aportan valor al cálculo, y de estos, fueron pocos los que coincidieron. Esto provoca que el valor promedio calculado sea muy bajo y con más variación.

resultados más bajos, por lo que evidencia que no es lo más recomendable iniciar con esos niveles de stock. Para product_B, el mejor fue el nivel 3 de aproximadamente 80.77 y también funcionaron bien los niveles 6 y 8 ambos de aproximadamente 72. En este caso, también

iniciar en 0 o 10 no es tan viable. De esta forma se determina contar con un stock inicial "medio" da mejores ganancias, porque hay suficiente producto para vender sin que se dispare el costo de reposición.

pesos[clave_estado] = pesos[clave_estado] + W

promedio = valores[estado] / pesos[estado]

if prob_b > 0:

W = 0

break

Acumular sumas

Calcular promedio manualmente

if pesos[estado] > 0:

for estado, valor in V_pi.items():

print(f"{estado} -> {valor:.2f}")

Valores estimados V^pi para algunos estados: {'product_A': 10, 'product_B': 10} -> -12.00

V final[estado] = promedio

V_pi = off_policy_evaluation(env, episodios_off)

print("Valores estimados V^pi para algunos estados:")

V_final = {}

return V_final

contador += 1

break

if contador >= 5:

In [66]: def valorPorNivelInicial(episodes):

for ep in episodes:

s0 = ep[0][0]

bucketsA, bucketsB = {}, {}

lvlA = s0['product A'] lvlB = s0['product_B']

 $G = sum(r for __,_,r in ep)$

bucketsA.setdefault(lvlA, []).append(G) bucketsB.setdefault(lvlB, []).append(G)

valorA, valorB = valorPorNivelInicial(episodes_soft) print("Valor estimado por nivel (product_A):", valorA) print("Valor estimado por nivel (product_B):", valorB)

promA = {k: sum(v)/len(v) for k, v in bucketsA.items()} promB = {k: sum(v)/len(v) for k, v in bucketsB.items()}

2. ¿Cómo afecta el valor epsilon en la política blanda al rendimiento?

eps = generate_episodes_soft_policy(env, Qtmp, epsilon=epsilon,

Retorno promedio por ε: {0.0: 66.27, 0.1: 62.07, 0.2: 64.06, 0.3: 60.78, 0.5: 65.815}

return sum(sum(r for _,_,r in ep) for ep in eps) / len(eps)

resultados = {e: retornoPromedioSoft(env, e) for e in epsilons}

In [67]: def retornoPromedioSoft(env, epsilon, num_episodes=200, num_days=10):

return dict(sorted(promA.items())), dict(sorted(promB.items()))

contador = 0

 $Q = \{\}$

42857142857146}

5217391304348}

 $Qtmp = \{\}$

In [74]: $Q_{tmp} = {}$

valores = {} conteos = {}

G = 0.0

 $V_on = {}$

for s in valores:

for ep in eps_soft_local:

for _, _, r in ep:

s0 = str(ep[0][0])if s0 not in valores:

valores[s0] += G conteos[s0] += 1

valores[s0] = 0.0conteos[s0] = 0

ON-policy - promedio de V(s): 73.11

V_on[s] = valores[s] / conteos[s]

on state avg = sum(V on.values()) / len(V on) if V on else 0.0

print(f"ON-policy - promedio de V(s): {on_state_avg:.2f}")

OFF-policy - promedio de $V^{\pi}(s)$: 14.06 -> estados: 16

off_state_avg = (sum(V_pi.values()) / len(V_pi)) if V_pi else 0.0

print(f"OFF-policy - promedio de $V^{\pi}(s)$: {off_state_avg:.2f} -> estados: {len(V_pi)}")

G += r

epsilons = [0.0, 0.1, 0.2, 0.3, 0.5]

política ya funcionaba bien sin exploración.

print("Retorno promedio por ε:", resultados)

for estado in valores:

if W == 0:

In [65]: def target_policy(state):

Aprendizaje off-policy por una política de comportamiento diferente.

def generate_episodes_off_policy(env, num_episodes=10, num_days=10):

action, prob_b = behavior_policy(state) next_state, reward = env.step(action)

for state, action, reward, prob_b in reversed(episodio):

Probabilidad según la política objetivo

if action == target_policy(state):

W = W * (prob_pi / prob_b)

return {'product_A': 1, 'product_B': 1}

action = random.choice(action_space)

for i, ep in enumerate(episodes_soft):

Ver resultados

for episode in episodes:

visited = set()

G += reward

state_key = str(state) action_key = str(action)

> if state_key not in Q: Q[state key] = {}

print(f"\n--- Episodio (Soft Policy) {i+1} ---") for day, (state, action, reward) in enumerate(ep):

episode = []

Soft Policies

else:

episodes.append(episode)

if day **==** 0:

for product in env.products

action = policy(state)

next_state, reward = env.step(action)

episode = generate_episode(env, policy, num_days)

episodes = generate_episodes(env, random_policy, num_episodes=3, num_days=5)

print(f"Día {day+1}: Estado={state}, Acción={action}, Recompensa={reward}")

Día 1: Estado={'product_A': 4, 'product_B': 9}, Acción={'product_A': 0, 'product_B': 1}, Recompensa=28 Día 2: Estado={'product_A': 4, 'product_B': 9}, Acción={'product_A': 2, 'product_B': 3}, Recompensa=-21 Día 3: Estado={'product_A': 5, 'product_B': 10}, Acción={'product_A': 0, 'product_B': 2}, Recompensa=-14 Día 4: Estado={'product_A': 5, 'product_B': 10}, Acción={'product_A': 0, 'product_B': 1}, Recompensa=-7 Día 5: Estado={'product_A': 5, 'product_B': 10}, Acción={'product_A': 1, 'product_B': 2}, Recompensa=6

Día 1: Estado={'product_A': 4, 'product_B': 6}, Acción={'product_A': 0, 'product_B': 3}, Recompensa=-6 Día 2: Estado={'product_A': 4, 'product_B': 6}, Acción={'product_A': 3, 'product_B': 2}, Recompensa=6 Día 3: Estado={'product_A': 5, 'product_B': 7}, Acción={'product_A': 3, 'product_B': 0}, Recompensa=20 Día 4: Estado={'product_A': 6, 'product_B': 6}, Acción={'product_A': 3, 'product_B': 3}, Recompensa=-1 Día 5: Estado={'product_A': 7, 'product_B': 8}, Acción={'product_A': 0, 'product_B': 1}, Recompensa=3

Día 1: Estado={'product_A': 7, 'product_B': 4}, Acción={'product_A': 3, 'product_B': 2}, Recompensa=-4 Día 2: Estado={'product_A': 7, 'product_B': 4}, Acción={'product_A': 3, 'product_B': 2}, Recompensa=1 Día 3: Estado={'product_A': 10, 'product_B': 4}, Acción={'product_A': 0, 'product_B': 1}, Recompensa=-7 Día 4: Estado={'product_A': 10, 'product_B': 5}, Acción={'product_A': 2, 'product_B': 0}, Recompensa=0 Día 5: Estado={'product_A': 9, 'product_B': 5}, Acción={'product_A': 2, 'product_B': 1}, Recompensa=-7

• Implemente explorar inicios para garantizar un conjunto diverso de estados y acciones iniciales

Guardar transición: estado, acción, recompensa

episode.append((state.copy(), action.copy(), reward))

Ejecutar acción en el entorno

In [57]: def generate_episode(env, policy, num_days=10):

action = policy(state)

Actualizar estado actual

for _ in range(num_days):

state = next_state

for in range(num episodes):

for i, ep in enumerate(episodes):

episodes.append(episode)

print(f"\n--- Episodio {i+1} ---")

return episode

episodes = []

return episodes

In [60]: env = InventoryEnvironment()

--- Episodio 1 ---

--- Episodio 2 ---

--- Episodio 3 ---

Exploring Starts

state = {

episode = []

else:

return episode

episodes = []

return episodes

In [58]: def random_policy(state): return {

def step(self, action):

reward = 0

Generación de episodios

episode = []

state = env.reset()

def reset(self):

• Utilice el ambiente dado más adelante para simular el entorno de la tienda. Considere que:

■ El estado representa los niveles de existencias actuales de los productos.

self.products = ['product_A', 'product_B']

Las acciones representan decisiones sobre cuánto reponer de cada producto

self.demand = {'product_A': [0, 1, 2], 'product_B': [0, 1, 2]}

self.state[product] = min(self.max_stock, stock + restock)

self.state = {product: random.randint(0, self.max_stock) for product in self.products}

reward += sales * self.sell_price[product] - restock * self.restock_cost[product]

• Cada episodio representa una serie de días en los que la tienda sigue una política de inventario específica.

• Debe recopilar datos para varios episodios y registrar las recompensas (ganancias) de cada día

self.restock_cost = {'product_A': 5, 'product_B': 7} self.sell_price = {'product_A': 10, 'product_B': 15}

demand = random.choice(self.demand[product])

sales = min(demand, self.state[product])