

12-Reinforcement Learning (強化 學習)

1. 甚麼是 RL?

1.1 Actor

Example 1: Space Invader

Example 2: 圍棋

1.2 訓練三步驟

Step 1: Function with Unknown

Step 2: Define "Loss"

Step 3: Optimization

與 GAN 的異同之處

- 2. Optimization: Policy Gradient
 - 2.1 如何控制 Actor
 - 2.2 收集訓練資料
 - 2.3 如何定義 A

Version 0 (不正確)

Version 1 (Cumulated Reward)

Version 2 (Discounted Cumulated Reward)

Version 3 (標準化:-b)

Version 3.5 (b = value funtion)

Version 4 (Advantage Actor-Critic)

- 2.4 訓練過程
 - 2.4.1 On-policy vs Off-policy
 - 2.4.2 Exploration (增加 actor 做 action 的隨機性)
- 3. Critic
 - 3.1 Value Function
 - 3.2 How to train critic
 - 3.2.1 Monte Carlo (MC) Based Approach
 - 3.2.2 Temporal-Difference (TD) Approach
 - 3.2.3 MC vs TD
- 4. Tip of Actor-Critic
- 5. To Learn More: DQN
- 6. Reward Shaping
 - 6.1 Sparse Reward
 - 6.2 Curiosity
- 7. No Reward: Imitation Learning
 - 7.1 Imitation Learning
 - 7.1.1 Behavior Cloning
 - 7.1.2 Inverse Reinforcement Learning

1. 甚麼是 RL?

應用場景:

- 給機器一個輸入,但我們不知道最佳輸出為何
- 收集有標註的資料有難度

例如叫機器學習下圍棋,最好的下一步可能人類根本不知道。在不知道正確答案是什麼的情況下,就可以使用 RL



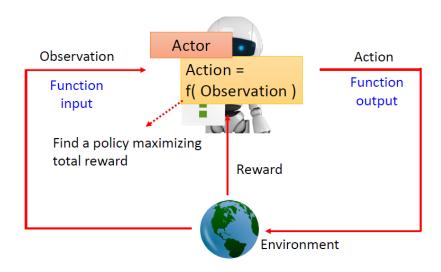
It is challenging to label data in some tasks.

..... machine can know the results are good or not.

1.1 Actor

Reinforcement Learning 中有 <u>Actor</u> 及 <u>Environment</u>, <u>Actor</u> 跟 <u>Environment</u> 會進行互動。

actor 就是 RL 中要找的 **function**,輸入為 observation,輸出為 action,function 的目標是最大化從 environment 獲得的 reward 總和



actor 以 environment 提供的 **observation 作為輸入**,而 actor 收到 observation 後,會**輸出 action** 影響 environment,environment 受到 action 的影響**產生新的 observation, environment 會不斷地給 actor 一些 reward**,告訴他採取的 action 好不好

Example 1: Space Invader





• actor:搖桿操控者

• environment:遊戲主機

• observation:遊戲畫面

• action:母艦向左、向右及開火

• reward:獲得的分數

要找一個 actor(function),可以使得到的 reward 的總和最大

Example 2: 圍棋

Find an actor maximizing expected reward.



• actor : AlphaGo

• environment:人類對手

• observation:棋盤

• action:在 19×19 的棋盤上的落子

• reward:整局結束以後,贏得1分,輸得0分。過程中不會得到 reward

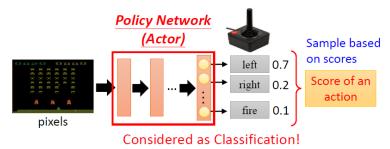
要找一個 actor(function),可以使得到的 reward 的總和最大

1.2 訓練三步驟

Step 1: Function with Unknown

actor 就是一個 network,稱為 Policy Network

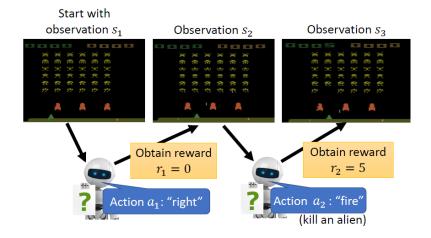
Step 1: Function with Unknown



- Input of neural network: the observation of machine represented as a vector or a matrix
- Output neural network : each action corresponds to a neuron in output layer
- 架構:FC、CNN、Transformer、......
- 輸入:遊戲的畫面 pixels
- 輸出:每個可採取行為的分數(向左 0.7 分、向右 0.2 分、開火 0.1 分,相加為 1)

把輸出的分數當做機率,依照這些機率 sample 出一個 action

Step 2: Define "Loss"





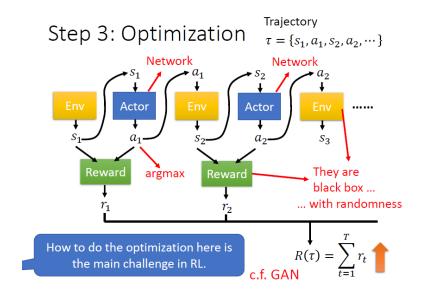
一整局遊戲稱為一個 episode,遊戲中每個行為都可能得到 reward,把**所有的 reward 相加得 到整場遊戲的 total reward**,又稱為 return

• Reward:每個行為得到的反饋

• **Return:**整場遊戲得到的 reward 之和,目標是最大化 return,所以 **loss 即為** -R

Step 3: Optimization

對環境的 observation s_1 ,會變成 actor 的輸入,actor 依此輸出 action a_1 , a_1 又作為環境的輸入,根據 a_1 輸出 s_2 ,以此類推,直至滿足遊戲終止條件



s 跟 a 所形成的 sequence $\{s_1,a_1,s_2,a_2,...\}$ 稱作 Trajectory,以 τ 表示

定義 reward function **會考慮** action **和** observation **兩者**,把所有的 r 相加得到 R,即是要去最大化的對象

目標:

找到 actor 的一組參數,使得 $R(\tau)$ 越大越好

問題:

- 1. **actor** 具有隨機性:由於 action 是 sample 產生的,給定相同的 s,產生的 a 可能不一樣
- 2. **environment 和 reward 是黑盒子**: environment 和 reward 都不是 network,也都**具有** 隨機性

總之,還是可以把 RL 看成三個階段,只是在 optimization 時,如何最小化 loss(最大化 return)跟之前學到的方法是不太一樣的

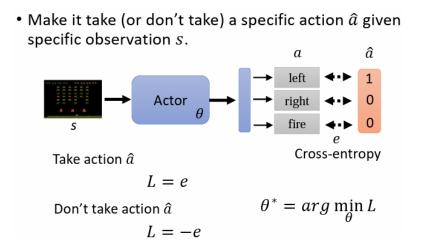
與 GAN 的異同之處

	GAN	RL
相同	訓練 generator 時,會把 generator 跟 discriminator 接 在一起,調整 generator 的參數 讓 discriminator 的輸出越大越 好	RL 中,actor 如同 generator,environment 跟 reward 如同 discriminator, 調整 actor 的參數,讓 environment 跟 reward 的輸出 越大越好
相異	GAN 的 discriminator 是一個 neural network	reward 跟 environment 不是 network,是一個黑盒子,無法 用一般 gradient descent 調整 參數,來得到最大的輸出

2. Optimization: Policy Gradient

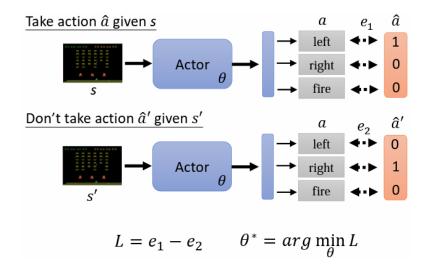
更詳細介紹 Policy Gradient: https://youtu.be/W8XF3ME8G2I

2.1 如何控制 Actor



- 若希望 actor 在看到某個 s 時採取某一 action,只需將其看做一般的分類問題即可,為其 設定 ground truth \hat{a} ,loss e 採用 cross-entropy
- 若希望 actor 在看到某個 s 時**不採取某一 action**,只需**將 cross-entropy 乘一個負號**,最 小化 L 等同於最大化 e,以使 actor 的 action 離 \hat{a} 更遠

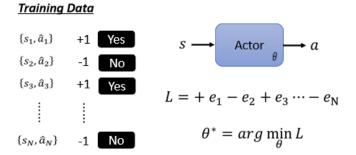
綜合以上兩種情況,可將 L 定義為 e_1-e_2 ,找到一組參數最小化 e_1 ,同時最大化 e_2 ,即可最小化 loss L



2.2 收集訓練資料

方法:

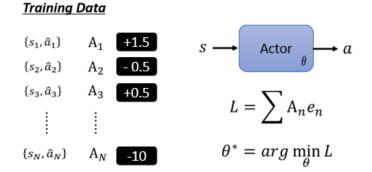
1. 為每個行為標註為"好"或"不好"(+1、-1)



收集一堆某一 observation 下應該採取或不採取某一 action 的資料 定義 loss

$$L=+e_1-e_2+e_3-\ldots-e_N$$

2. 每個行為給定一個分數 A_n



係數不再是只有正負 1 定義 loss

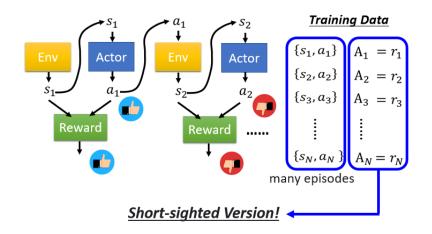
$$L=\sum A_n e_n$$

問題:

- 如何定義 A_i (by Version 0 ~ Version 4)
- 如何產生 s 與 a 的 pair

2.3 如何定義 A

Version 0 (不正確)

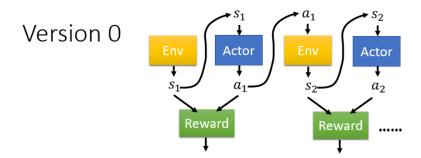


- 1. 首先定義一個隨機的 actor,**記錄若干個 episodes** 中 actor 與環境互動時,面對每一個 observation s 產生的 **action a**
- 2. 對記錄下來的每個 action 計算 reward
- 3. 將 reward 作為 A 用於定義 loss

問題:

短視近利,沒有長程規劃的概念

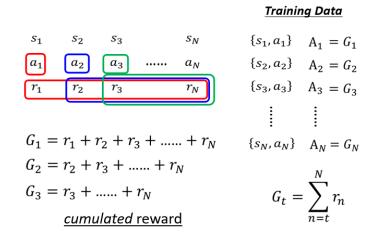
使用 Version 0,只要採取向左跟向右,得到的 reward 會是 0;只有開火時得到的 reward 是正的,導致機器會學到只有瘋狂開火才是對的,會一直傾向於射擊



- An action affects the subsequent observations and thus subsequent rewards.
- Reward delay: Actor has to sacrifice immediate reward to gain more long-term reward.
- In space invader, only "fire" yields positive reward, so vision 0 will learn an actor that always "fire".
- 每一個行為並不是獨立的,每一個行為都會**影響到接下來發生**的事情
- Reward Delay:需要犧牲短期的利益,以換取更長程的目標

Version 1 (Cumulated Reward)

Version 1 中, a_t 有多好,**不僅取決於** r_t **,也取決於** a_t **之後所有的 reward**,也就是把 a_t 當下及之後的所有 action 得到的 reward 通通加起來,得到 G_t (cumulated reward)

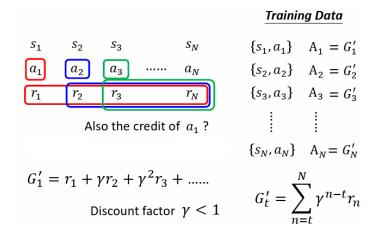


問題:

假設遊戲非常長,把 r_N 歸功於 a_1 也不合適

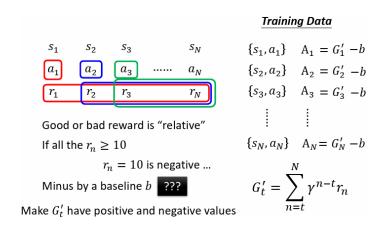
Version 2 (Discounted Cumulated Reward)

改良 Version 1 的問題,**新增 discount factor** γ ($\gamma < 1$) ,離 a_t 比較近的 reward 給予較大的權重,較遠的 reward 給予較小的權重,使較遠的 reward 影響較小



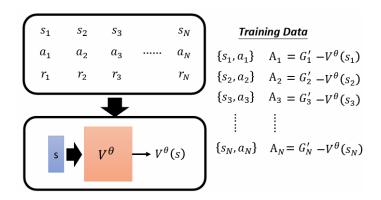
Version 3 (標準化:-b)

假設某一遊戲得到的 reward 永遠都是正的,只是有大有小不同,因此每個 G 都會是正的,就算某些行為是不好的,還是會鼓勵機器採取某些行為,所以**需要做標準化,改良 Version 2,把所有** G' **減一個 baseline** b

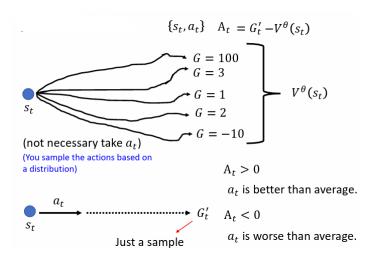


Version 3.5 (b = value funtion)

訓練一個 $\operatorname{\underline{critic}}$,給一個 observation s,輸出 $V^{ heta}(s)$,讓 Version 3 的 $b=V^{ heta}(s)$



解釋:



 $V^{ heta}(s_t)$ 可以視為在 observation s_t 下,actor 採取各種可能的 action 後得到的 G_t' **期望值** G_t' 則是真正結束一個 episode 後,得到的 discounted cumulated reward

 A_t 是對 actor 在 observation s_t 下,採取 action a_t 的評價:

- 若 $A_t>0$,表示 $G_t'>V^{\theta}(s_t)$,意義為採取特定 action a_t 得到的 G_t' 比隨機選擇一個 action 的期望值 $V^{\theta}(s_t)$ 好,所以給予**正的評價** A_t
- 若 $A_t < 0$,表示 $G_t' < V^{\theta}(s_t)$,意義為採取特定 action a_t 得到的 G_t' 比隨機選擇一個 action 的期望值 $V^{\theta}(s_t)$ 不好,所以給予**負的評價** A_t

問題:

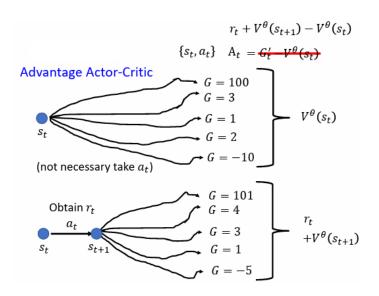
 $A_t = G_t' - V^ heta(s_t)$ 表示用一次 sample 的結果減去所有的"平均",似乎不夠準確

解決:

Version 4 (Advantage Actor-Critic)

Version 4 (Advantage Actor-Critic)

在 observation s_t 下,採取 action a_t 到 s_{t+1} ,考慮在 s_{t+1} 下採取各種 action a_{t+1} 的情况,並求所有 G'_{t+1} 的平均值(期望值)



因為 value function 意義上可以代表各種 action 的平均 discounted cumulated reward,因 此直接使用 $V^{ heta}(s_{t+1})$ 表示 s_{t+1} 下各種 a_{t+1} 得到的 G'_{t+1} 的平均值(期望值),所以將 G'_t 替 換為 $r_t + V^{\theta}(s_{t+1})$

$$\Rightarrow A_t = r_t + V^{ heta}(s_{t+1}) - V^{ heta}(s_t)$$

2.4 訓練過程

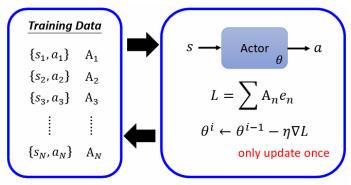
- Initialize actor network parameters θ^0
- For training iteration i=1 to T
 - Using actor θ^{i-1} to interact
 - Obtain data $\{s_1, a_1\}, \{s_2, a_2\}, \dots, \{s_N, a_N\}$
 - Compute A_1, A_2, \dots, A_N Compute loss L

 - $\bullet \ \theta^i \leftarrow \theta^{i-1} \eta \nabla L$

Data collection is in the "for loop" of training iterations.

- 1. 隨機初始化 actor,參數為 $heta^0$
- 2. 迭代更新 actor

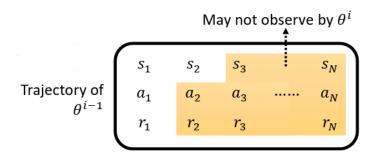
用參數為 $heta^{i-1}$ 的 actor 蒐集資料,並以此資料計算 A,再計算 loss L,做 gradient descent 更新參數



Each time you update the model parameters, you need to collect the whole training set again.

每次**更新完一次參數以後,資料就要重新再收集一次**,此舉非常花時間。而這麼做的目的是因為帶 $heta^{i-1}$ 參數的 actor 收集到的資料,不一定適合拿來做為更新 $heta^i$ 的資料

帶 θ^i 參數的 actor 與帶 θ^{i-1} 參數的 actor 採取的 action 不會一樣,因而參考過去的 trajectory 沒有意義



2.4.1 On-policy vs Off-policy

- The actor to train and the actor for interacting is the same. → On-policy
- Can the actor to train and the actor for interacting be different? → Off-policy

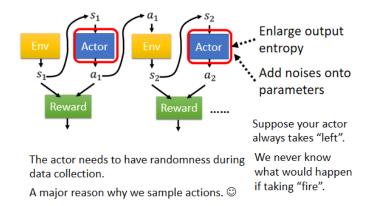
In this way, we do not have to collection data after each update.

- On-policy Learning:訓練的 actor 跟與環境互動的 actor 是同一個
- Off-policy Learning:訓練的 actor 跟與環境互動的 actor 是不同的

好處是不用一直收集資料,可以用一次收集到的資料,更新多次 actor

Proximal Policy Optimization (PPO) 即是採用 off-policy learning,細節可參考: https://youtu.be/OAKAZhFmYol

2.4.2 Exploration (增加 actor 做 action 的隨機性)



問題:

actor 所採取的 action 是 sample 而來的,因此 actor 採取的 action 具有隨機性

若一個 actor 採取行為的隨機性不夠,則一個 episode 結束後,所蒐集到的**資料中有些** actions 根本沒有被 sample 到,會導致無從知道這些 actions 的好壞

解決:

期望跟環境互動的 actor 採取 actions 的隨機性要夠大,如此才能收集到比較豐富的資料 因此在訓練時,可藉由以下方式解決:

- 1. 刻意加大 actor 輸出的 distribution 的 entropy(比較容易 sample 到機率較低的 action)
- 2. 在 actor 參數上加 noise
- 3. ...

Exploration 是 RL 訓練過程中重要的技巧

3. Critic

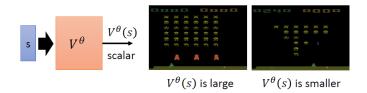
3.1 Value Function

有一 actor 參數為 θ ,當前的 observation 為 s,value function $V^{\theta}(s)$ 為基於參數為 θ 的 actor 及 observation s,所預期的 <u>discounted cumulated reward</u> (期望值的概念)

Critic

The output values of a critic depend on the actor evaluated.

- A critic does not directly determine the action.
- Given an actor θ , it evaluates how good the actor is
- Value function $V^{\theta}(s)$
 - When using actor θ , the discounted *cumulated* reward expects to be obtained after seeing s



critic 做的事就是在**只看到當前** s **而尚未完成這局遊戲前**,就得到對參數為 θ 的 actor 的評價 $V^{\theta}(s)$

3.2 How to train critic

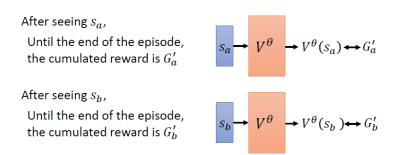
兩種方法訓練 critic: Monte Carlo 及 Temporal-Difference

3.2.1 Monte Carlo (MC) Based Approach

將 actor 拿去跟環境互動很多輪(episodes),得到一些遊戲的記錄(訓練資料)

• Monte-Carlo (MC) based approach

The critic watches actor $\boldsymbol{\theta}$ to interact with the environment.



針對某一筆訓練資料,其 observation 為 s_a , $V^{ heta}(s_a)$ 要與 discounted cumulated reward G_a' 越接近越好。利用這些訓練資料,訓練 critic 以輸出期待的 $V^{ heta}(s)$

3.2.2 Temporal-Difference (TD) Approach

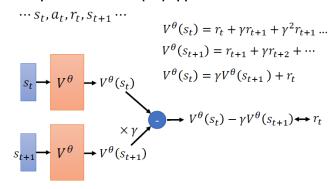
不需玩完整場遊戲(一個 episode)得到訓練資料。只要在看到 observation s_t , actor 執行 action a_t ,得到 reward r_t ,接下來再看到 observation s_{t+1} ,就能夠更新一次 critic 參數。 此方法對於很長的遊戲或玩不完的遊戲非常合適

觀察:

 $V^ heta(s_t)$ 和 $V^ heta(s_{t+1})$ 之間有著代數關係: $V^ heta(s_t)=\gamma V^ heta(s_{t+1})+r_t$ 移項後可得:

$$V^{ heta}(s_t) - \gamma V^{ heta}(s_{t+1}) = r_t$$

• Temporal-difference (TD) approach



擁有 s_t, a_t, r_t, s_{t+1} 訓練資料,即可計算 $V^{ heta}(s_t) - \gamma V^{ heta}(s_{t+1})$,目標希望與 r_t 越接近越好

3.2.3 MC vs TD

由於 MC 與 TD 的背後的假設不同,訓練得到的 critic 也不同

• The critic has observed the following 8 episodes

•
$$s_a, r=0, s_b, r=0$$
, END
• $s_b, r=1$, END
• $s_b, r=1$, END
• $s_b, r=1$, END
• $v^{\theta}(s_b)=3/4$
• $v^{\theta}(s_a)=7$

• $s_b, r=1$, END • $s_b, r=1$, END Monte-Carlo: $V^{\theta}(s_a)=0$

• $s_b, r = 1$, END Monte-Carlo: $V^{\sigma}(s_a) = 0$ • $s_b, r = 1$, END Temporal-difference:

• $s_b, r = 0$, END Temporal-difference:

(Assume γ = 1, and the actions are ignored here.) $V^{\theta}(s_a) = V^{\theta}(s_b) + r$ $3/4 \qquad 3/4 \qquad 0$

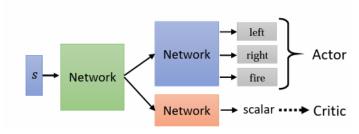
MC 與 TD 得到的 $V^{ heta}(s_b)$ 都為 3/4,但 MC 得到的 $V^{ heta}(s_a)$ 為 0,而 TD 得到的 $V^{ heta}(s_a)$ 為 3/4

使用 critic 於訓練 actor 上: Version 3.5、Version 4

4. Tip of Actor-Critic

actor 與 critic 都是一個 network,兩者皆以 observation s 作為輸入,actor 輸出每一個 action 的機率分布;critic 輸出一個數值 $V^{ heta}(s)$

 The parameters of actor and critic can be shared.



可將 actor 及 critic 兩個 network, 共用部分的 network

5. To Learn More: DQN

直接使用 critic 決定要採取什麼 action,最知名的做法就是 Deep Q Network(DQN),細節可參考:https://youtu.be/o_g9JUMw1Oc、https://youtu.be/2zGCx4iv_k

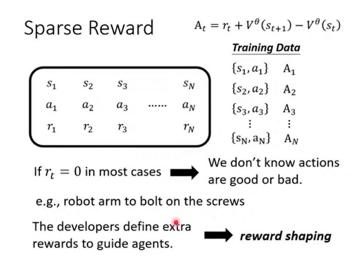
DQN 的變形: <u>Rainbow: Combining Improvements in Deep Reinforcement Learning</u> (Rainbow)

6. Reward Shaping

6.1 Sparse Reward

問題:

Sparse Reward 就是 **reward 大多數情況都是 0**,只有在少數情況是一個非常大的數值。意味 著很多 actions 無從判斷是好是壞。例如圍棋到遊戲結束才會有 reward,過程中都沒有 reward



解決:

Reward Shaping:定義一些額外的 reward 來幫助 actor 學習

舉例:

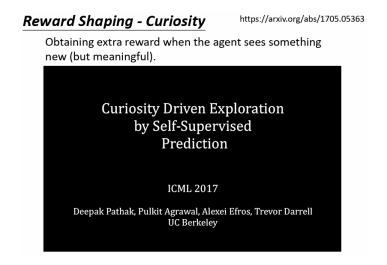
如射擊類遊戲,除贏得勝利得到 +reward 及輸掉遊戲得到 - reward 外,額外定義了其他行為可以得到正的或負的 reward,如撿到補血包(+)、待在原地(+)、存活(-)等等

VizDoom https://openreview.net/forum?id=Hk3mPK5gg¬eId=Hk3mPK5gg			
Parameters	Description	FlatMap CIGTrack1	
living	Penalize agent who just lives	-0.008 / action	
health_loss	Penalize health decrement	-0.05 / unit	
ammo_loss	Penalize ammunition decrement	-0.04 / unit	
health_pickup	Reward for medkit pickup	0.04 / unit	
ammo_pickup	Reward for ammunition pickup	0.15 / unit	
dist_penalty	Penalize the agent when it stays	-0.03 / action	
dist_reward	Reward the agent when it moves	9e-5 / unit distance	

因此 reward shaping 都要倚靠人類的 domain knowledge 來定義

6.2 Curiosity

reward shaping 的其中一種做法:Curiosity based reward shaping



基於好奇心,讓 actor 看到有意義的新東西時獲得 reward

7. No Reward: Imitation Learning

問題:

- 遊戲中雖然容易定義 reward, 但在其他任務要定義 reward 很困難
- 人工設置一些 reward (reward shaping) 教機器學時,若 reward 沒設定好,機器可能會產生奇怪、無法預期的行為

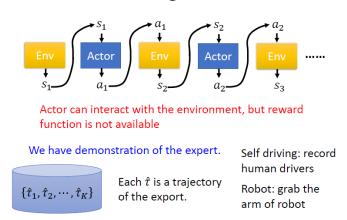
解決:

沒有 reward 的狀況下,可使用 imitation learning

7.1 Imitation Learning

在沒有 reward 的情況下訓練 actor

Imitation Learning



引入 expert(通常為人類)的示範。找很多 experts 跟環境互動,記錄互動的結果 $\hat{\tau}$,每個 $\hat{\tau}$ 代表一個 trajectory

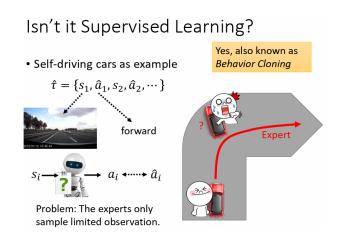
舉例:

• 自動駕駛:記錄人類的駕駛行為

• 機械手臂:拉著機器的手臂示範

7.1.1 Behavior Cloning

類似於**監督式學習**,讓機器做出的 action 跟 export 做出的 action 越接近越好,又稱作 Behavior Cloning



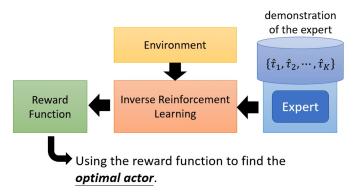
問題:

- experts 的記錄有限,若 actor 遇到從沒見過的情境,可能會做出無法預期的 action
- experts 做出的一些 actions actor 並不一定需要學習模仿,模仿的行為可能不會帶來好的 結果

7.1.2 Inverse Reinforcement Learning

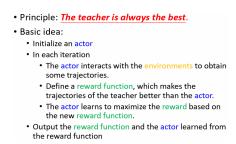
從 expert 的 demonstration,還有 environment 去反推 reward funtion,學出一個 reward funtion 後,再用一般的 RL 來訓練 actor

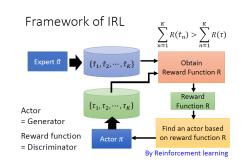
Inverse Reinforcement Learning



如何找出 reward funtion?

原則:teacher 的行為總是最好的





步驟:

- 1. 初始化一個 actor
- 2. 迭代訓練
 - 1. actor 與環境互動獲得多個 trajectory au
 - 2. 定義(更新)一個 reward function,能夠使老師的 reward 總和 $\Sigma R(\hat{ au})$ 比 actor 的 reward 總和 $\Sigma R(au)$ 更高
 - 3. 利用定義的 reward function 進行訓練,更新 actor 的參數,使 actor 能夠最大化 reward
- 3. 輸出 reward function 以及訓練得到的 actor

GAN vs IRL

IRL 就如同 GAN, actor 可視為 generator; reward function 可視為 discriminator

