
Commande optimale et apprentissage par renforcement

UNE APPROCHE UNIFIÉE POUR LES PROBLÈMES DE PRISES DE DÉCISIONS SÉQUENTIELLES

préparé par

Pr. Alexandre GIRARD



Dernière mise à jour le 1^{er} septembre 2025

Préface

Ces notes présentent les diverses approches pour prendre des décisions intelligentes sous un cadre théorique unifié dont le pilier central est le **programmation dynamique**. L'objectif est de construire un pont entre deux mondes qui partagent les mêmes fondations mathématiques : le domaine de l'**ingénierie** (la science des asservissements et la commande optimale), où l'on dispose souvent d'un modèle mathématique précis du système, et le domaine des **sciences informatiques** (recherche opérationnelle et apprentissage par renforcement). Ces notes visent principalement à donner à un lecteur issu du domaine de l'ingénierie les bases pour comprendre et utiliser ces puissantes approches numériques.



Capsule vidéo

Série de capsules vidéos associées

<https://youtube.com/playlist?list=PL6adNeJOA8UtNs1NQfAHAzcjHcQixBSnu>

Sources externes utiles

- **Livre Fondamental - Commande Optimale** : *Dynamic Programming and Optimal Control* [Bertsekas, 2017]
- **Livre Fondamental - Apprentissage par Renforcement** : *Reinforcement Learning : An Introduction* [Sutton and Barto, 2018]
- **Notes de Cours Appliquées** : *Underactuated Robotics* [Tedrake, 2023]
- **Vidéos d'Introduction au RL** : Cours de David Silver [Silver, 2015]

Table des matières

1	Introduction	5
1.1	La prise de décision en séquence	5
1.1.1	Un comportement défini par une politique à concevoir	5
1.1.2	Un objectif formulé avec une fonction scalaire cumulative	6
1.2	Tour d'horizon	7
1.2.1	Le problème canonique de commande optimale	8
1.2.2	Le problème canonique d'apprentissage par renforcement	8
1.3	Exemples de mise en œuvre	10
2	Programmation dynamique	11
2.1	Formulation du problème	11
2.1.1	Dynamique	11
2.1.2	Politique (Loi de commande)	11
2.1.3	Fonction objectif (coût ou récompense)	12
2.1.4	Contraintes	12
2.1.5	Coût-àvenir	13
2.1.6	Solution optimale	13
2.1.7	Terminologie	14
2.2	Principe d'optimalité	16
2.3	Programmation dynamique excate	16
2.4	Variations sur un thème de Bellman	19
2.5	Forces et limites de la programmation dynamique	20
2.6	Programmation dynamique approximée	20
3	Commande stochastique	21
3.1	Dynamique stochastique	21
3.2	Optimisation de l'espérance	23
3.3	Formulation minimax (commande robuste)	23
3.4	Observations Partielles	24
3.4.1	Espace croyance	25
3.5	Politique Stochastique	25
4	Modèles d'évolution	26
4.1	Équations différentielles (temps continus)	26
4.1.1	Conversion en temps discret	27
4.2	Équations de différence	27
4.3	Graphes (états discrets déterministes)	27
4.3.1	Discrétisation de variables continues	28
4.4	Chaînes de Markov (états discrets stochastiques)	28
4.4.1	Coût déterministe	28
4.4.2	Coût stochastique	29

5 Équations de Bellman	30
5.1 Horizon de temps infini	30
5.2 Équations de Bellman	31
5.2.1 Variantes pour un processus de décision de Markov	31
5.3 Coût-àvenir d'une politique	32
5.3.1 Variantes pour une processus de décision de Markov	32
5.3.2 Solution matricielle	32
5.4 Équation de Hamilton–Jacobi–Bellman	33
6 Solutions Analytiques	34
6.1 LQR à temps discret	34
6.1.1 Horizon infini	35
6.2 LQR à temps continu	35
6.2.1 Horizon infini	37
6.2.2 Stabilisation de trajectoires	37
7 Algorithmes de planification	39
7.1 Algorithme d'itération de valeurs	39
7.1.1 Conditions de convergence	39
7.1.2 Évaluation de politique	40
7.2 Algorithme d'itération de politique	40
8 Algorithmes d'apprentissage	41
8.1 Évaluation	41
8.1.1 Monte-carlo	41
8.1.2 TD-Learning	41
8.1.3 Sarsa	41
8.2 Q-Learning	41
8.3 Exploration	41
8.3.1 Exploitation vs. exploration	41
9 Politiques Stochastiques	42
10 Approximation de fonctions	43
A Outils mathématiques	44
A.1 Ensembles	44
A.2 Probabilités	44
A.2.1 Probabilité pour une variable discrète	45
A.2.2 Probabilité pour une variable continue	45
A.2.3 Espérance	46
A.2.4 Probabilité jointe et conditionnelle	46
A.2.5 Loi de Bayes	46
B Approximation de fonctions	47
B.1 Approximation linéaires	48
B.1.1 Polynômes	48
B.1.2 Fourier	48
B.1.3 Base radiales	48
B.2 Approximations non-linéaires	48

C Exercises	49
C.1 Introduction et formulation du problème	49
C.1.1 Fonction coût vs récompense	49
C.1.2 Limites de la formulation coût/récompense cumulative	49
C.1.3 Formes possibles des politiques optimales	49
C.1.4 Apprendre à voler	50
C.1.5 Fonction de coût pour un pendule	50
C.2 Programmation dynamique exacte	51
C.2.1 Navigation optimale dans un graphe	51
C.2.2 Loi de commande pour une suspension active	52
C.2.3 Politique optimale pour un thermostat	53
C.2.4 Chemin le plus court dans un graphe	54
C.3 Commande stochastique	55
C.3.1 Loi de commande pour une suspension active II	55
C.3.2 Commande stochastique pour une diva à l'opéra	56
C.3.3 Stratégie optimale aux échecs	57
C.4 Commande robuste	58
C.4.1 Commande minimax pour tic-tac-toe	58
C.5 Solutions analytiques	59
C.5.1 Solution LQR par programmation dynamique	59
C.5.2 LQR en temps continu	61
C.5.3 Implémentation LQR	62
C.6 Algorithmes de planification	63
C.6.1 Gestion d'un barrage optimale pour un horizon de temps infini par itération de valeur	63
C.6.2 Algorithme d'itération de valeurs	64
C.6.3 Évaluation d'une politique	64
C.7 Algorithmes d'apprentissage	65
C.7.1 <i>Q-learning</i> pour une navigation optimale	65
C.7.2 Apprentissage d'une fonction $Q(x, u)$ approximée	66
C.7.3 <i>Q-Learning</i> à partir de l'algorithme DP	67
C.7.4 <i>Q-Learning</i> avec échantillonnage	67
C.7.5 Descente du gradient stochastique	68
C.7.6 Approximation d'un coût-àvenir	68
C.8 Apprentissage par renforcement appliqué	69
C.8.1 Hands-on PPO	69
C.8.2 Tutorial pour la librairie <i>Gymnasium</i>	69
C.8.3 Environnement à partir d'une définition de problème	69

Chapitre 1

Introduction

L'apprentissage par renforcement est un domaine qui développe des algorithmes capables d'apprendre automatiquement des stratégies, appelées politiques, qui déterminent pour un agent les actions à choisir en fonction de ses observations. Le domaine de la commande optimale propose également des méthodes pour résoudre ce même problème, mais dans un contexte plus structuré où un modèle de l'environnement, comme les équations du mouvement, est généralement connu. De façon générale, l'apprentissage par renforcement offre des outils très génériques qui apprennent par l'expérience, mais avec peu de garanties formelles. À l'inverse, la commande optimale fournit des outils assortis de garanties solides, mais souvent pour des situations plus spécifiques et en s'appuyant sur des approximations du modèle. Leur fondement commun est la science de la programmation dynamique, qui offre un cadre théorique très général pour traiter tout problème de prise de décision en séquence. Ce principe est si fondamental qu'il s'applique aussi bien à l'analyse d'un système asservi classique, comme le contrôle d'un bras robot ; qu'à des problèmes probabilistes en finance, comme la décision d'acheter ou de vendre une action ; ou encore à un problème d'intelligence artificielle, comme le choix de la pièce à déplacer aux échecs.



Capsule vidéo

Introduction

<https://youtu.be/1ThWOUmkVyY?si=wWIa0-0YpvR-vYbL>

1.1 La prise de décision en séquence

Au cœur de tout problème de prise de décision en séquence se trouve une interaction fondamentale entre un **agent** et son **environnement**. L'objectif de l'agent est d'influencer l'évolution de cet environnement, que l'on considère comme un **système dynamique**. Pour ce faire, l'agent choisit continuellement des **actions** en se basant sur les **observations** qu'il reçoit de l'environnement. Cette interaction constante — observer, décider, agir — crée un **système dynamique en boucle fermée** qui évolue dans le temps, tel qu'illustré à la figure 1.1.

1.1.1 Un comportement défini par une politique à concevoir

L'objectif principal est de concevoir une fonction, notée π et appelée la **politique**, qui définit le comportement de l'agent. La politique agit comme une règle de décision ou une "carte" qui détermine l'action à entreprendre en fonction de l'état observé de l'environnement :

$$\underbrace{u}_{\text{action}} = \pi(\underbrace{x}_{\text{observation}}) \quad (1.1)$$

où u représente l'action choisie et x représente l'état de l'environnement que l'agent observe. Dans le domaine de l'asservissement, le terme équivalent pour la fonction π est la *loi de commande*. La forme concrète de cette politique est très flexible et peut aller d'une simple équation analytique ou d'un tableau de données (*look-up table*) à un réseau de neurones complexe.

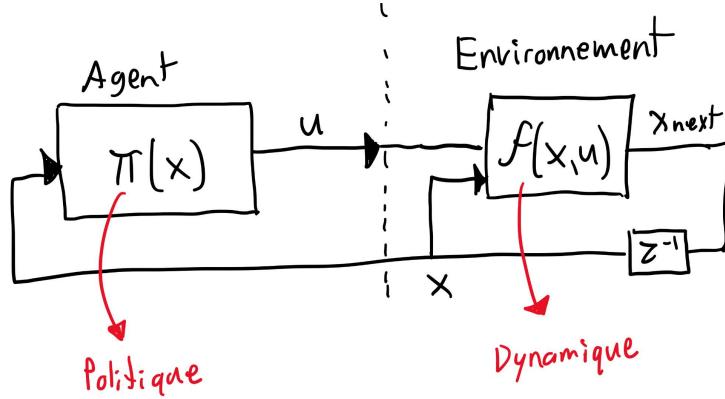


FIGURE 1.1 – Dynamique en boucle fermée avec un agent

1.1.2 Un objectif formulé avec une fonction scalaire cumulative

Pour définir le comportement désiré de l'agent, son objectif est formulé mathématiquement par une fonction additive qui cumule une valeur sur l'ensemble d'une trajectoire. Typiquement, en **commande optimale**, on cherche à minimiser une fonction de **coût**, tandis qu'en **apprentissage par renforcement**, on vise à maximiser une fonction de **récompense**. Ces deux formulations sont équivalentes — maximiser une récompense revient à minimiser son opposé — et nous utiliserons par défaut la minimisation de coût dans ces notes. Cette fonction objectif, le coût cumulatif, est notée J et se définit comme la somme des coûts instantanés $g(x, u)$ à chaque étape :

$$\underbrace{J}_{\text{Coût cumulatif}} = \sum \underbrace{g(x, u)}_{\text{Coût instantané}} \quad (1.2)$$

où $g(x, u)$ représente le coût ponctuel pour se trouver dans l'état x et avoir choisi l'action u . La forme cumulative de cette fonction est un prérequis essentiel pour appliquer le principe de la programmation dynamique (toutefois ce n'est pas restrictif les problèmes peuvent tous être reformuler sous cette forme, typiquement avec des états augmentés si nécessaire). Par conséquent, une politique est dite **optimale** lorsqu'elle guide l'agent à prendre la séquence de décisions qui minimise la valeur de ce coût cumulatif J .

Exemple 1. Loi de commande pour un robot

Considérons un exemple d'asservissement classique : le contrôle d'un bras robotique. On peut décomposer ce problème en plusieurs éléments clés :

- **État (x)** : Un vecteur représentant l'état actuel du robot, qui inclut typiquement les positions et les vitesses de ses diverses articulations.
- **Action (u)** : Le vecteur de couples (forces de rotation) que la politique détermine qu'il faut appliquer aux moteurs électriques de chaque articulation.
- **Objectif (J)** : L'objectif est formulé comme la minimisation d'une fonction de coût. Ce coût combine généralement deux termes : l'erreur de position du robot par rapport à une cible, et une pénalité pour l'énergie consommée (l'amplitude des couples).
- **Politique (π)** : La politique $u = \pi(x)$, ou loi de commande, est la fonction qui calcule l'action à partir de l'état. Pour ce type de problème, la solution est souvent une équation analytique.

Exemple 2. Navigation d'un véhicule

Un exemple de prise de décision à un plus haut niveau est le choix d'un trajet sur une carte routière. Les composantes de ce problème peuvent être définies comme suit :

- **État (x)** : La position actuelle du véhicule sur la carte, par exemple à une intersection donnée.
- **Action (u)** : La direction à prendre à partir de la position actuelle (ex : "tourner à gauche", "continuer tout droit").
- **Objectif (J)** : Atteindre la destination le plus rapidement possible. Cet objectif est formulé comme la minimisation du temps de trajet total.
- **Politique (π)** : La politique est la solution globale qui, pour chaque intersection possible sur la carte (chaque état), spécifie la direction optimale à prendre. Elle peut être stockée sous la forme d'une table de correspondance (look-up table).

Exemple 3. Achats d'une action

Dans un tout autre contexte, un algorithme d'investissement peut aussi être vu comme un agent prenant des décisions séquentielles :

- **État (x)** : L'observation principale est le prix actuel de l'action. Un état plus complexe pourrait aussi inclure l'historique des prix ou d'autres indicateurs de marché.
- **Action (u)** : La décision à prendre à un instant donné. Dans ce cas simple, ce serait "Acheter" ou "Ne pas acheter".
- **Objectif (J)** : L'objectif est la maximisation des gains financiers. C'est un exemple typique de problème formulé en termes de maximisation de récompense.
- **Politique (π)** : La règle de décision. Elle pourrait être un simple seuil de prix qui, potentiellement, varie dans le temps : si le prix observé passe en dessous de ce seuil, l'agent décide d'acheter.

1.2 Tour d'horizon

Une politique optimale doit satisfaire une relation fondamentale appelée l'**équation de Bellman**, qui peut prendre plusieurs formes selon la formulation de l'objectif et la méthode utilisée pour décrire l'évolution du système. Cette équation est la condition qui garantit l'optimalité d'une prise de décision par rapport à la fonction de coût choisie. D'un certain point de vue, toutes les méthodes de commande et d'apprentissage par renforcement ont donc pour objectif commun de trouver une solution, même approximative, à cette équation centrale.

$$J^*(x) = \min_u E [g(x, u) + J^*(f(x, u))]$$

Tâche définie par un coût/récompense
Évolution définie par des équations/échantillons

FIGURE 1.2 – Équation de Bellman, qui caractérise si une politique est optimale

L'équation de Bellman est un principe flexible qui s'adapte à de nombreux contextes. Par exemple, lorsqu'on modélise l'évolution d'un système dans un **domaine continu**, comme c'est le cas en asservissement, elle peut se réduire sous certaines hypothèses à la célèbre solution linéaire quadratique (LQR). À l'inverse, l'intelligence artificielle d'un jeu comme les échecs, qui évolue en **états et actions discrets**, se base aussi sur cette équation ; en considérant les actions de l'adversaire comme une perturbation, le principe mène directement à l'**algorithme minimax**. Finalement, en apprentissage par renforcement, où le modèle d'évolution est souvent **stochastique** et inconnu, on cherche à approximer une solution à l'équation de Bellman à partir

d'échantillons obtenus par observation. Une bonne partie de ces notes a donc pour objectif de présenter cette équation dans ces divers contextes, et d'explorer les algorithmes permettant de la résoudre.

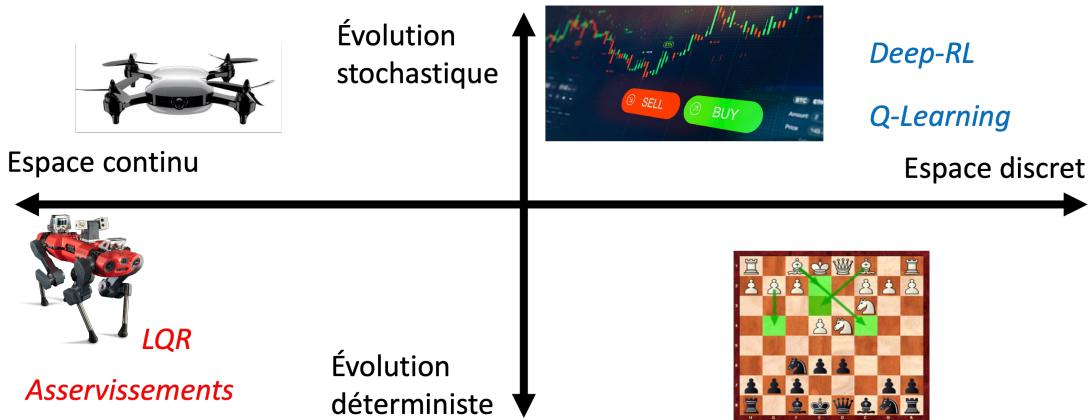


FIGURE 1.3 – Différentes contextes de prise de décision en séquence

1.2.1 Le problème canonique de commande optimale

Dans un problème typique de commande optimale, la politique est synthétisée entièrement *a priori*, c'est-à-dire avant que l'agent n'interagisse avec l'environnement. Comme l'illustre la figure 1.4, cette phase de synthèse (ou de planification) requiert la connaissance préalable de deux éléments : un **modèle de la dynamique** \hat{f} du système et la **fonction de coût** \hat{g} qui définit l'objectif. Dans la littérature sur l'apprentissage par renforcement, cette approche est parfois désignée par *model-based reinforcement learning* (apprentissage par renforcement basé sur un modèle).

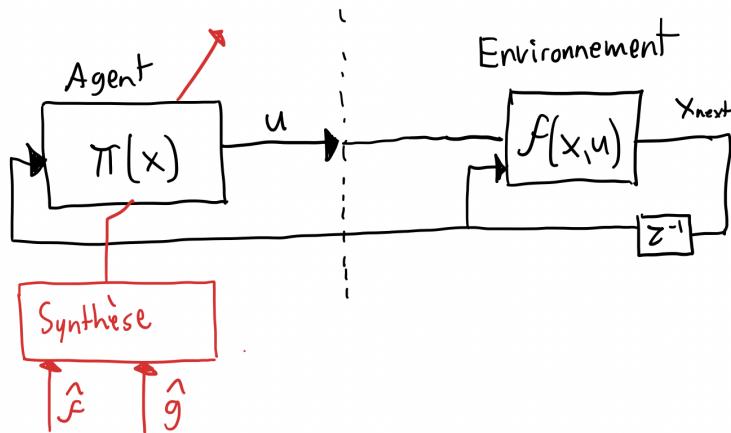


FIGURE 1.4 – Aperçu du problème de commande optimale

1.2.2 Le problème canonique d'apprentissage par renforcement

À l'opposé de la commande optimale, un problème d'apprentissage par renforcement suppose que la dynamique de l'environnement et la fonction de coût sont initialement **inconnues**. La politique ne peut donc pas être calculée *a priori*. Au lieu de cela, l'agent doit apprendre une politique optimale en interagissant directement avec l'environnement par un processus d'essai et erreur, comme le montre la figure 1.5. La politique est ainsi mise à jour progressivement à mesure que l'agent accumule de l'expérience. Dans le domaine de

la commande, une approche similaire où des données sont utilisées en ligne pour ajuster une politique ou identifier les paramètres d'un modèle est souvent appelée *commande adaptative* ou *identification de système*.

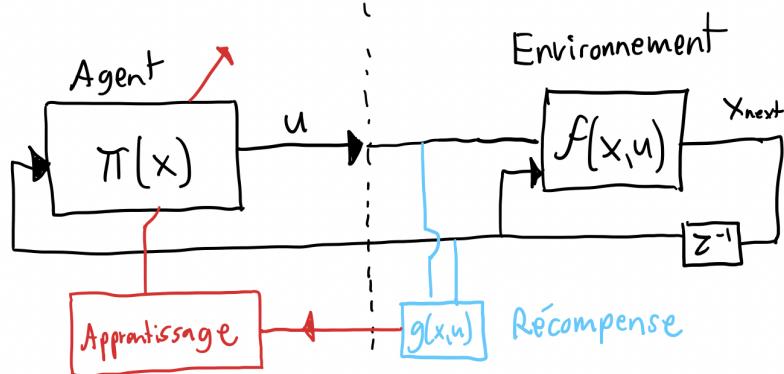


FIGURE 1.5 – Aperçu du problème d'apprentissage par renforcement



Capsule vidéo

Commande optimale vs. apprentissage par renforcement

<https://youtu.be/Zm4hGWqC5dI>

Exploration vs. exploitation

Puisque l'agent en apprentissage par renforcement ne connaît pas l'environnement *a priori*, il fait face à un dilemme fondamental : le compromis entre l'**exploitation** et l'**exploration**. L'exploitation consiste à appliquer la meilleure stratégie découverte jusqu'à présent pour maximiser les gains immédiats. L'exploration, à l'inverse, consiste à tenter de nouvelles actions — au risque d'obtenir un moins bon résultat à court terme — dans le but de découvrir une stratégie potentiellement encore plus performante pour l'avenir. La gestion de cet arbitrage est un des défis centraux de l'apprentissage par renforcement.

La place de l'apprentissage par renforcement dans l'apprentissage machine

Bien que l'apprentissage par renforcement soit une branche de l'apprentissage machine, il se distingue fondamentalement des branches classiques. soit l'apprentissage supervisées ou non supervisées. L'apprentissage **supervisé** requiert un expert pour fournir des "bonnes réponses", comme des paires état-action correctes à imiter dans le contexte d'une politique (une technique nommée *Behavioral Cloning*). L'apprentissage **non supervisé**, quant à lui, cherche à découvrir la structure cachée dans des données non étiquetées (ex : clustering) sans notion d'objectif ou d'actions. L'apprentissage par renforcement est tout autre : l'agent apprend par **essai et erreur** en interagissant avec un environnement, guidé uniquement par un **signal de performance scalaire** (un coût ou une récompense). Cette interaction introduit une complexité majeure qui le distingue des autres formes d'optimisation : la gestion des **conséquences à long terme**. Une action peut avoir des répercussions qui ne se manifestent que bien plus tard, et le cœur du sujet est de développer des méthodes pour attribuer correctement un résultat futur à une décision passée.

1.3 Exemples de mise en œuvre

La meilleure façon de solidifier la théorie est de la mettre en pratique. Les page *colab* suivantes sont conçus pour une exploration interactive. Il est recommandé de les parcourir, d'analyser le code pour en comprendre le fonctionnement, et de tenter d'y faire des modifications pour valider votre compréhension.



Exercice de code

Optimal control intro with a pendulum swing-up

[https://colab.research.google.com/drive/
1mcExyc25P_0im4iU_wVEFnkzgw4UTVaq?usp=sharing](https://colab.research.google.com/drive/1mcExyc25P_0im4iU_wVEFnkzgw4UTVaq?usp=sharing)



Exercice de code

Drone learning to fly with PPO

[https://colab.research.google.com/drive/
1-EuRPiyf2Gv0n8p_17jlvvEIE188WT1m?usp=sharing](https://colab.research.google.com/drive/1-EuRPiyf2Gv0n8p_17jlvvEIE188WT1m?usp=sharing)



Exercice de code

DP and PPO for a pendulum swing-up

[https://colab.research.google.com/drive/
1umk613li2ts_Ny9icRL-SjFTHq-a5mAJ?usp=sharing](https://colab.research.google.com/drive/1umk613li2ts_Ny9icRL-SjFTHq-a5mAJ?usp=sharing)

Chapitre 2

Programmation dynamique

Dans ce chapitre, les fondements mathématiques de la science de la prise de décisions séquentielles sont introduites. La formulation mathématique de base, qui sera utilisée pour introduire les principes et les différentes approches de solution, est une approche en temps discret où on va considérer qu'on veut optimiser une politique pour un nombre fini de N d'étapes futures. De plus, on va débuter avec l'hypothèse que l'agent observe directement l'état de l'environnement.

Note sur l'ordre de présentation des concepts Dans ces notes je présente d'abord les concepts et algorithmes dans le contexte d'une évolution déterministe et d'un horizon de temps fini. On pourrait considérer que c'est un petit détour, plusieurs autres ouvrages sur l'apprentissage par renforcement présentent directement les concepts dans le contexte de chaînes de Markov (évolution probabiliste) et d'un horizon de temps infini. Toutefois, je crois que les concepts de base sont mieux introduits ainsi, et de plus, avec cette formulation les liens sont plus direct à faire avec les concepts de la science des asservissements. On va donc débuter avec une représentation mathématique basée sur des équations de différences déterministes, et introduire l'aspect probabiliste dans un deuxième temps. On traitera plus tard les situations où l'horizon de temps est infini (Chapitre 5), l'évolution est stochastique (Chapitre 3) et quand l'agent a accès à une observation partielle ou bruitée de l'état (Chapitre 3.4).

2.1 Formulation du problème

Voici les ingrédients de base pour analyser mathématiquement un problème de prise de décisions en séquence :

2.1.1 Dynamique

L'évolution dynamique du système est représentée par une équation de différence :

$$x_{k+1} = f_k(x_k, u_k) \quad k = 0, 1, \dots, N - 1 \tag{2.1}$$

où x est l'état du système, k un indice représentant le temps ou l'étape, et u une variable représentant les actions que l'agent peut prendre. C'est la représentation de comment l'environnement évolue. Certains algorithmes utilisent cette fonction, d'autres l'assument inconnue.

2.1.2 Politique (Loi de commande)

La politique est une fonction notée π , qui dictent l'action u à prendre lorsque l'état du système x est observé. De façon général on peut avoir une politique spécifique pour chaque étape k .

$$u_k = \pi_k(x_k) \tag{2.2}$$

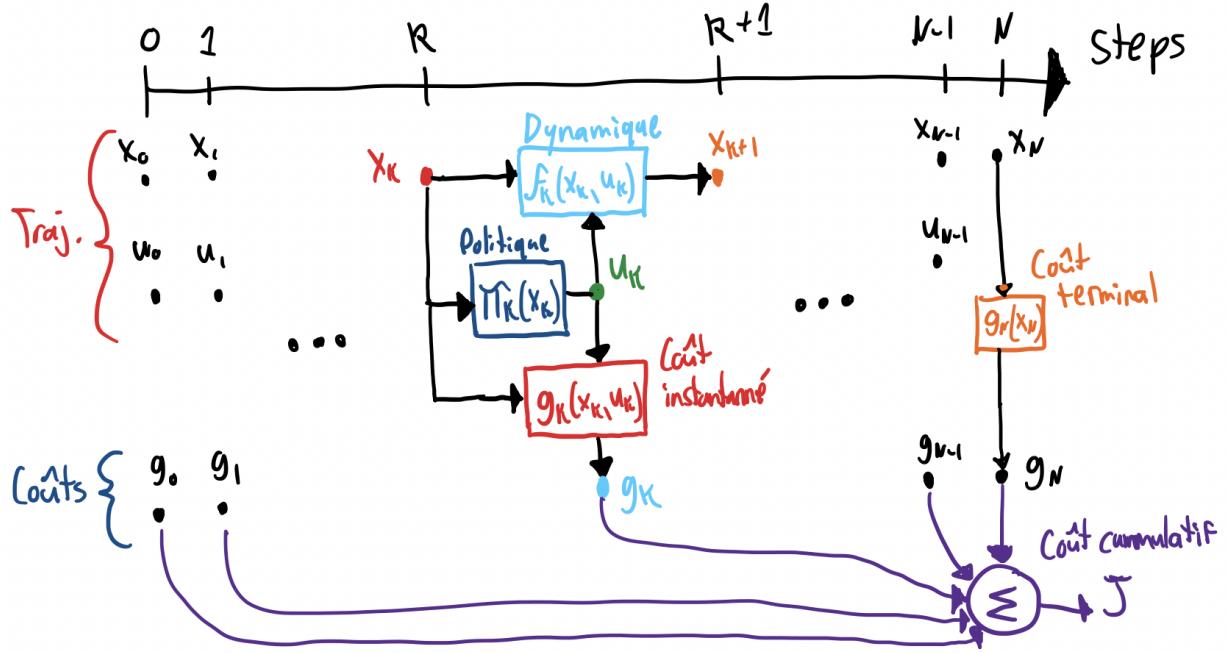


FIGURE 2.1 – Évolution du système en boucle fermée étape par étape.

Un politique qui change en fonction de l'étape, peut être interprétée comme une politique qui varie dans le temps. On va noter π sans indices l'ensemble des fonctions politiques pour toutes les étapes :

$$\pi = \{\pi_0, \dots, \pi_{N-1}\} \quad (2.3)$$

2.1.3 Fonction objectif (coût ou récompense)

La fonction objectif, dépend des états visités et action exécutées sur une trajectoire, est définie par :

$$J(\underbrace{x_0, \dots, x_N, u_0, \dots, u_{N-1}}_{\text{Trajectoire}}, u_{N-1}) = \sum_{k=0}^{N-1} g_k(x_k, u_k) + g_N(x_N) \quad (2.4)$$

où N est l'horizon qui représente ici un nombre d'étape, g_k la fonction de coût instantané à l'étape k et g_N une fonction coût terminale qui dépend de l'état final x_N . Un art en apprentissage par renforcement est de bien représenté l'objectif avec les fonctions coûts g_k et g_N appropriées, plusieurs formulations sont théoriquement équivalentes, mais certaines variantes peuvent faciliter la tâche des algorithmes.

2.1.4 Contraintes

Il est souvent nécessaire pour bien caractériser l'objectif, d'inclure des contraintes dures dans le formulation d'un problème, on va donc considérer qu'à une étape k , il y a un certain ensemble \mathcal{X}_k d'états permis et un ensemble \mathcal{U}_k d'action possibles, qui peut dépendre de l'état actuel :

$$x_k \in \mathcal{X}_k \quad u_k \in \mathcal{U}_k(x_k) \quad (2.5)$$

On va appeler une politique admissible si elle respecte les contraintes, et l'ensemble des politiques admissibles est noté :

$$\pi \in \Pi \quad (2.6)$$

2.1.5 Coût-à-venir

Un concept important est celui du coût-à-venir, noté $J^\pi(x)$, qui représente le coût cumulatif total associé à débuter à l'état x et exécuter la politique π sur un horizon N :

$$J^\pi(x) = \sum_{k=0}^{N-1} g_k(x_k, u_k) + g_N(x_N) \quad \text{avec } x_0 = x \quad \text{et} \quad x_{k+1} = f_k(x_k, \pi_k(x_k)) \quad (2.7)$$

Notez ici que le coût-à-venir est une fonction seulement de l'état actuel, c'est le coût prévu de la trajectoire future, i.e. le coût à venir.

Important ! Prenez le temps de prendre un bon café et de bien comprendre la définition du coût-à-venir. C'est une notion fondamentale sur lequel le principe de la programmation dynamique est bâtit. De plus, une grande catégorie d'algorithmes d'apprentissage par renforcement ont comme principe de base d'essayer d'approximer cette fonction avec un réseau de neurones.

2.1.6 Solution optimale

La politique optimale est définie par celle qui minimise le coût-à-venir. On va noter J^* la fonction coût-à-venir optimale et π^* la politique optimale.

$$J^*(x) = \min_{\pi \in \Pi} J^\pi(x) \quad (2.8)$$

$$\pi^* = \arg \min_{\pi \in \Pi} J^\pi(x) \quad (2.9)$$

$$(2.10)$$

2.1.7 Terminologie

Variable	Termes	Définition
$f_k(x_k, u_k)$	Dynamique, Système, Environnement, Processus, <i>Plant</i> ,	Équations qui définit l'évolution du système, i.e. de l'environnement de l'agent.
$u = \pi_k(x)$	Loi de commande, contrôleur, politique de l'agent, <i>policy</i>	Fonction qui définit la décision de l'agent comme une fonction de l'observation de l'état.
x	État, <i>State</i>	Variable qui représente toute l'information pour prédire l'évolution future du système.
u	Action, décision, entrée du système, <i>control input</i>	Variable qui représente la décision de l'agent.
k	index	Entier correspondant à l'étape actuelle (i.e. souvent représentant le temps discréteisé).
$\mathcal{U}_k(x)$	Contraintes, <i>control set</i>	Ensemble représentant les actions qui sont possible lorsque l'état du système est x à l'étape k
$g_k(x_k, u_k)$	Coût instantanée, récompense (problème de maximisation)	Fonction scalaire qui définit le coût instantané à l'étape k
$g_N(x_N)$	Coût terminal	Fonction scalaire qui définit le coût final en fonction de l'état terminal.
$J(x_0, \dots, x_N)$	Fonction de coût cumulative, (opposé de la) fonction de récompense	Fonction scalaire qui représente à quel point une trajectoire est bonne en fonction de l'objectif.
$J^\pi(x)$	Coût à venir, <i>cost-to-go</i> , <i>value fonction</i>	Fonction scalaire qui représente la prédition de coût cummulative d'une trajectoire qui débute à x en utilisant la politique π
$J^*(x)$	Coût à venir optimal	Fonction scalaire qui représente la prédition de coût cummulative d'une trajectoire qui débute à x si toutes les actions dans le futur sont optimales

Exemple 1. Pendule Simple en temps minimum

Le concept de coût-àvenir ce visualise bien avec un problème de temps minimal. Supposons qu'on s'intéresse à positionner un pendule en appliquant un couple à la base et que notre critère c'est de ce rendre à la position cible le plus vite possible. La fonction coût-àvenir $J^\pi(x)$ représenterait le temps-àvenir, i.e. le temps prévu avant d'atteindre la cible, lorsqu'on débute à l'état x . La figure 2.2, représente une temps-àvenir optimal calculé numériquement.

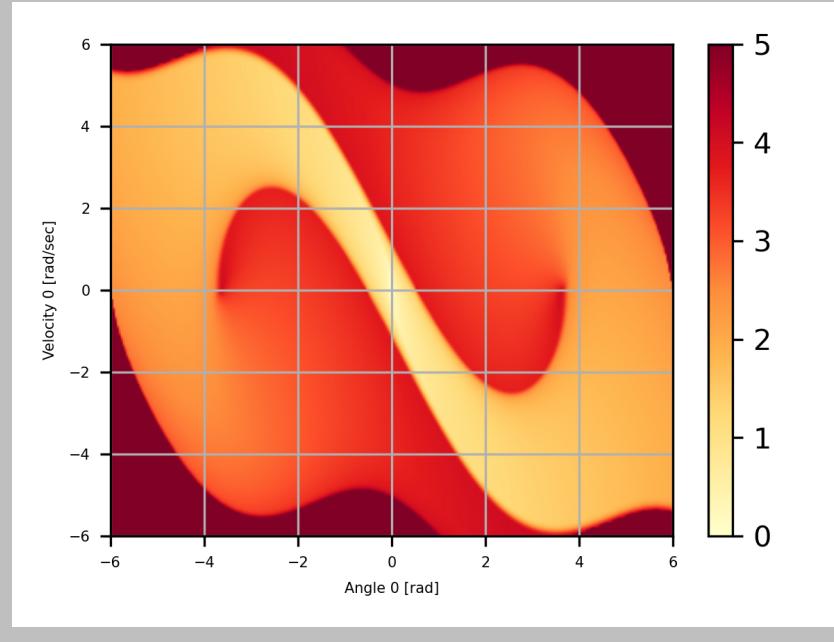


FIGURE 2.2 – Coût-àvenir optimal pour un pendule (temps-minimum)

2.2 Principe d'optimalité

Le principe d'optimalité formalise une notion qui peut sembler assez simple :

Si une trajectoire est optimale de x_0 à x_N en passant par x_i . Alors nécessairement la séquence de fin de cette trajectoire correspond aussi à la solution optimale d'une trajectoire qui débuterait à x_i pour aller à x_N .

$$[x_0, \dots, x_i, \dots, x_N] \quad (2.11)$$

$$[x_i, \dots, x_N] \quad (2.12)$$



Capsule vidéo

Le principe d'optimalité

<https://youtu.be/EMkpkMTg4U?si=eDITgpq50NhRD8-f>

Par exemple, disons qu'on a trouvé le chemin optimal entre Montréal et Québec, et que ce chemin passe par Drummondville. Alors, le principe d'optimalité dit que le chemin optimal entre Drummondville et Québec est nécessairement la séquence de fin du chemin optimal entre Montréal et Québec. Le principe de la programmation dynamique est d'exploiter ces séquences de queue dans une boucle récursive.

2.3 Programmation dynamique excente

L'algorithme de programmation dynamique permet de résoudre exactement le problème de décision en séquence formulé à la section 2.1. L'idée est de partir de la fin, et de calculer le coût-àvenir en reculant étape par étape :

$$J_N^*(x_N) = g_N(x_N) \quad \forall x_N \in \mathcal{X}_N \quad (2.13)$$

$$\vdots \quad (2.14)$$

$$J_k^*(x_k) = \min_{u_k \in \mathcal{U}_k(x_k)} \left[g_k(x_k, u_k) + J_{k+1}^*(\underbrace{f_k(x_k, u_k)}_{x_{k+1}}) \right] \quad \forall x_k \in \mathcal{X}_k \quad (2.15)$$

$$\vdots \quad (2.16)$$

$$J_0^*(x_0) = \min_{u_0 \in \mathcal{U}_0(x_0)} \left[g_0(x_0, u_0) + J_1^*(\underbrace{f_0(x_0, u_0)}_{x_1}) \right] \quad \forall x_0 \in \mathcal{X}_0 \quad (2.17)$$

La politique optimale est calculé simultanément en gardant en mémoire l'action qui minimise le coût-àvenir :

$$\pi_k^*(x_k) = \operatorname{argmin}_{u_k \in \mathcal{U}_k(x_k)} \left[g_k(x_k, u_k) + J_{k+1}^*(\underbrace{f_k(x_k, u_k)}_{x_{k+1}}) \right] \quad \forall x_k \in \mathcal{X}_k \quad (2.18)$$

Si on décortique, chaque expression dans l'opération *min* représente un coût instantané plus le coût-àvenir de se retrouver sur le prochain état à l'étape suivante, pour une option d'action. La politique optimale est de choisir l'action qui minimise cette expression et le coût-àvenir optimal est la valeur minimale :

$$\underbrace{J_k^*(x_k)}_{\substack{\text{Coût-àvenir optimal} \\ \text{Minimum possible}}} = \min_{u_k \in \mathcal{U}_k(x_k)} \left[\underbrace{g_k(x_k, u_k)}_{\substack{\text{Coût instantané}}} + \underbrace{J_{k+1}^*(\underbrace{f_k(x_k, u_k)}_{x_{k+1}})}_{\substack{\text{Coût-àvenir optimal à l'étape suivante}}} \right] \underbrace{\text{Valeur } Q_k^*(x_k, u_k)}_{(2.19)}$$

La valeur de la parathèse, notée $Q_k^*(x_k, u_k)$ est souvent appelée la *valeur-Q* et est une quantité centrale en apprentissage par renforcement. Elle correspond au coût-àvenir de choisir une action u_k à l'état x_k . Un algorithme de base en apprentissage par renforcement ce nomme Q-Learning et a comme principe d'apprendre ces valeurs.



Capsule vidéo
Algorithme de programmation dynamique
<https://youtu.be/d fz9k3BGrH0?si=MBxJzpKPOUjnaERe>

J vs Q La valeur $J^*(x)$ est une fonction qui donne le coût-àvenir optimal pour un état donné en assumant qu'on choisi l'action optimale à partir de ce point. La valeur $Q^*(x, u)$ est une fonction qui donne le coût-àvenir optimal en assumant que l'action u à déjà été sélectionnée, et que par la suite les actions seront optimales.

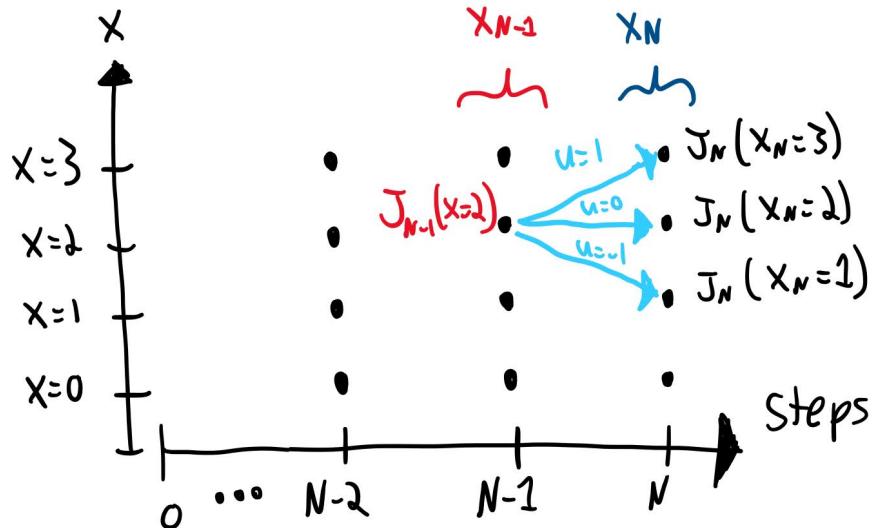


FIGURE 2.3 – Exemple de calcul de coût-àvenir pour l'état $x = 2$ à l'étape $k = N - 1$. Ici pour cet exemple on a 4 états discrets possibles et trois actions possibles. Comme illustré, on doit d'abord avoir évalué le coût terminal de tous les états à l'étape $k = N$, ensuite on calcule de coût-àvenir de chaque action possible et on minimise.

Exemple 2. Navigation optimale



Capsule vidéo
Exemple de navigation optimale sur un graphe
<https://youtu.be/1GXUNWVgZOU?si=P4hDvWSWoav6nW4x>

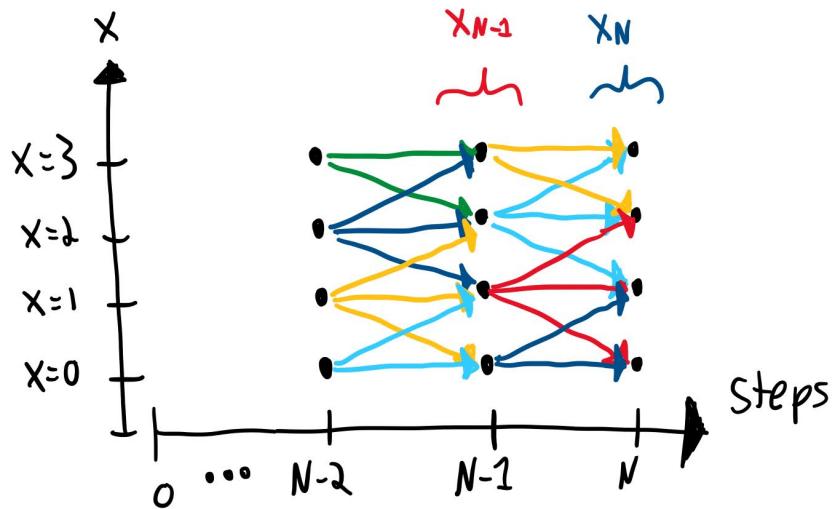


FIGURE 2.4 – L’algorithme de programmation dynamique consiste à exécuter ce calcul pour chaque état à chaque étape en débutant par la fin. Ici chaque couleur représente une étape de minimisation pour un état. Il y a une valeur $Q(x, u)$ pour chaque état-action qui sont ici les arcs, et une valeurs $J(x)$ pour chaque état qui sont les noeuds.

Exemple 3. Chauffage optimale



Capsule vidéo

Exemple pour une politique de chauffage optimale

<https://youtu.be/QuXjiAzDENs?si=mQcKeWkjxUU-bBuM>

Exemple 4. Pendule inverse



Exercice de code

Démo de programmation dynamique

https://colab.research.google.com/drive/1mcExyc25P_0im4iU_wVEFnkzgw4UTVaq?usp=sharing

2.4 Variations sur un thème de Bellman

L'algorithme de programmation dynamique a plusieurs variantes, voici un petit tour d'horizon rapide :

Stochastique

Si l'environnement est stochastique on va rajouter un calcul de l'espérance pour optimiser une moyenne pondérée des coûts futurs possibles :

$$J_k^*(x_k) = \min_{u_k} \mathbb{E}_{\mathbf{w}_k} \left[g_k(x_k, u_k, \mathbf{w}_k) + J_{k+1}^* \left(\underbrace{f_k(x_k, u_k, \mathbf{w}_k)}_{x_{k+1}} \right) \right] \quad (2.20)$$

Robuste

Dans certaines situations, on peut préférer une formulation où l'espérance est remplacée par une opération de maximisation. C'est en fait la formulation *minimax* utilisée dans plusieurs algorithmes de jeux comme les échecs :

$$J_k^*(x_k) = \min_{u_k} \max_{\mathbf{w}_k} \left[g_k(x_k, u_k, \mathbf{w}_k) + J_{k+1}^* \left(\underbrace{f_k(x_k, u_k, \mathbf{w}_k)}_{x_{k+1}} \right) \right] \quad (2.21)$$

À horizon de temps infini

Dans la plupart des situations on va s'intéresser aux politiques optimales lorsque l'horizon de temps n'est pas limité et inclure un facteur qui priorise le futur proche vs. le futur lointain :

$$J^*(x) = \min_u \left[g(x, u) + \alpha J^* \left(\underbrace{f(x, u)}_{x_{k+1}} \right) \right] \quad (2.22)$$

Sans modèles (apprentissage par renforcement)

Si on n'a pas de modèle dynamique de l'environnement, on va travailler avec les valeurs Q , représentant un coût-àvenir de choisir une action à un certain état :

$$Q^*(x, u) = g(x, u) + \min_{u_{k+1}} \left[Q^* \left(\underbrace{f(x, u)}_{x_{k+1}}, u_{k+1} \right) \right] \quad (2.23)$$

À temps continu

La programmation dynamique a un équivalent en temps continu, qui est en fait une équation différentielle partielle :

$$-\frac{\partial J^*(x, t)}{\partial t} = \min_u \left[g(x, u) + \frac{\partial J^*(x, t)}{\partial x} \underbrace{f(x, u, t)}_{\dot{x}} \right] \quad (2.24)$$

2.5 Forces et limites de la programmation dynamique

Forces

- **Formulation très flexible** : On peut inclure toute forme de fonction d'évolution, coût et contraintes : des non-linéarités dures, des variables discrètes et même stochastique.
- **Solution globale** : On trouve la solution globale au problème

Limites

- **Malédiction des dimensions** : La mise en oeuvre de l'algorithme de programmation dynamique exacte est possible seulement pour des problèmes de petites dimensions.
- **Modèle du système** : Il faut connaître les équations de la dynamique du système.

2.6 Programmation dynamique approximée

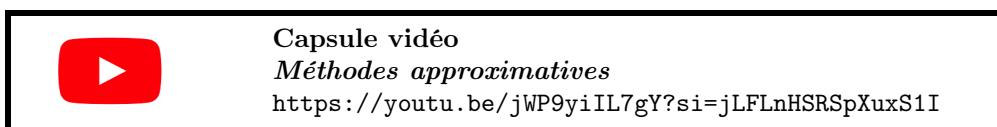
Comme illustré à la Figure 2.5, la plupart des outils visant à prendre des décisions intelligentes pour un agent, peuvent être vu comme une certaine forme de stratégie pour approximer un algorithme de programmation dynamique.

$$u^* = \arg \min_u \mathbb{E}_w \left[g(x, u, w) + J_{k+1}^*(x_{k+1}) \right]$$

discretisation des actions
 Monte carlo
 Calcul déterministe

discretisation
 dégrégation
 Approximation hors-ligne
 (deep reinforcement learning)
 Recherche en-ligne
 (Rollout, MPC, etc.)

FIGURE 2.5 – Différentes stratégies pour approximer la programmation dynamique exacte.



Chapitre 3

Commande stochastique

"The true Logic for this world is the calculus of probabilities"
– James Clerk Maxwell

3.1 Dynamique stochastique

La formulation du problème de décisions séquentielles peut être légèrement modifiée pour représenter une évolution stochastique. Une représentation possible d'une évolution stochastique, est de considérer que la fonction dynamique a une entrée additionnelle qui est une variable aléatoire w_k , que l'on peut interpréter comme une perturbation :

$$x_{k+1} = f_k(x_k, u_k, w_k) \quad (3.1)$$

ou la variable w_k appartient à un ensemble $\mathcal{W}_k(x)$:

$$w_k \in \mathcal{W}_k(x) \quad (3.2)$$

Un modèle dynamique de l'environnement inclut donc les valeurs possibles de la perturbation w et la probabilité associée à chacune de ces valeurs. Ce modèle a la forme de probabilités (possiblement conditionnelles à l'état, l'action et l'étape actuelle) si w_k prend des valeurs discrète, ou d'une fonction de densité de probabilité si la variable w_k est dans le domaine continu :

$$P(w_k|x_k, u_k, k) \quad \text{ou} \quad p(w_k|x_k, u_k, k) \quad (3.3)$$

Note Si vos notions de probabilité sont endormies, l'annexe A.2 présente une synthèse des notions de probabilités importantes pour cette section.



Capsule vidéo
Commande stochastique
<https://youtu.be/wvwrxsCbGwU?si=cqnH8BDjGGBLmx15>

Ce modèle d'évolution stochastique est une représentation possible de ce qu'on appelle une *Chaîne de Markov*. En effet, il est possible de convertir les équations (3.1) et (3.3) en probabilités de transitions, la représentation habituelle d'une chaîne de Markov :

$$P(x_{k+1}|x_k, u_k, k) \quad (3.4)$$

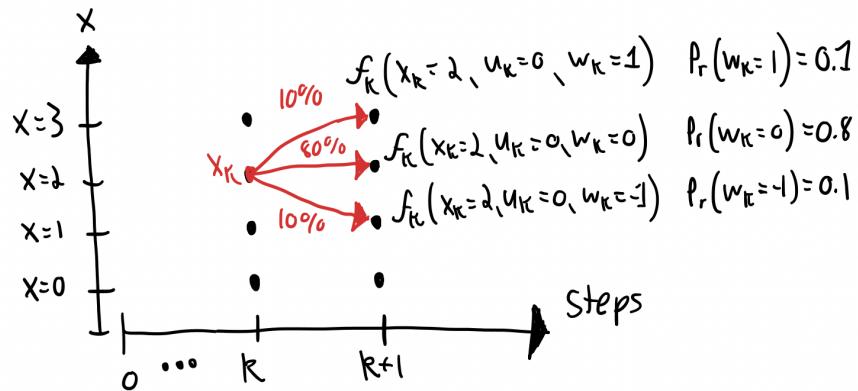


FIGURE 3.1 – Évolution stochastique avec des domaines discrets

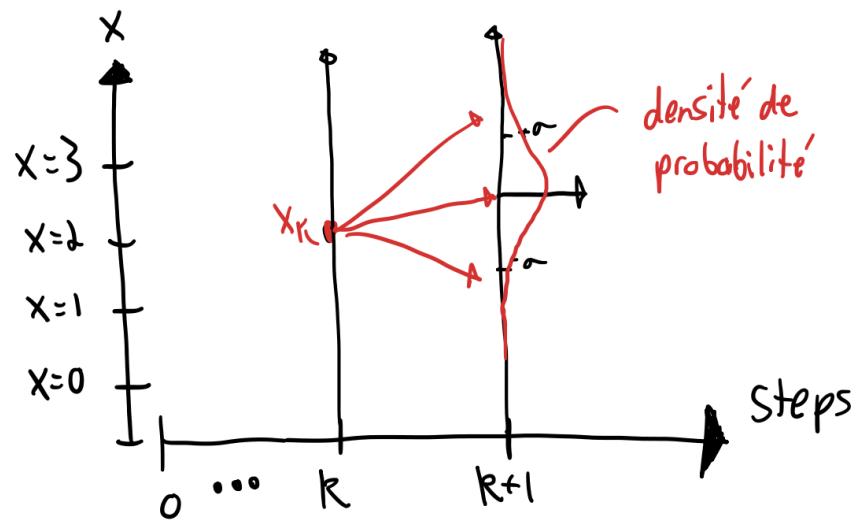


FIGURE 3.2 – Évolution stochastique avec des domaines continus

puisque :

$$P(x_{k+1} = f_k(x_k, u_k, w_k) \mid x_k, u_k, k) = P(w_k \mid x_k, u_k, k) \quad (3.5)$$

C'est un choix de modélisation de définir l'environnement directement par des probabilités de transition (équation (3.4)) ou bien une équation dynamique (équation (3.1)) plus des perturbations probabilistes (équation (3.3)).

Propriété de Markov Les fondements théoriques de la programmation dynamique sont basés sur l'hypothèse que l'état observé x a la propriété de Markov, c'est à dire que le l'état x est choisi de sorte à contenir toute l'information nécessaire pour prédire l'évolution future du système. Cette définition est consistante avec la définition d'un vecteur d'état utilisé dans le domaine de la dynamique et la commande. Formellement, dans un contexte probabiliste cette propriété est équivalente à dire que la probabilité de transitionner sur un état futur x_{k+1} , conditionnelle à l'état x_k et l'action u_k , est la même que la probabilité conditionnelle à tout l'historique du système :

$$P(x_{k+1} \mid x_k, u_k, k) = P(x_{k+1} \mid x_k, u_k, k, \underbrace{x_{k-1}, u_{k-1}, x_{k-2}, u_{k-2}, \dots, x_1, u_1, x_0, u_0}_{\text{historique}}) \quad (3.6)$$

Autrement dit, tout l'information possible sur l'environnement est compris dans l'état, il n'y a pas de variables cachées qui peuvent influencer le futur.

3.2 Optimisation de l'espérance

La formulation la plus standard pour un problème de décisions séquentielles dans un contexte stochastique, qu'on appelle dans la littérature un processus de décision de Markov (MDP), est de chercher à minimiser l'espérance du coût-à-venir. On modifie donc la définition de l'équation (2.7), pour rajouter un calcul de l'espérance par rapport à toutes les valeurs possibles que peuvent prendre les perturbations :

$$J^\pi(x) = \mathbb{E}_{w_0, w_1, \dots, w_{N-1}} \left[\sum_{k=0}^{N-1} g_k(x_k, u_k, w_k) + g_N(x_N) \right] \quad \text{avec } x_0 = x \quad \text{et} \quad x_{k+1} = f_k(x_k, \pi_k(x_k), w_k) \quad (3.7)$$

ce qui représente une moyenne des coût-à-venir possible, pondérés en fonction de leurs probabilités d'occurrence. Le problème à résoudre devient alors de trouver la politique qui minimise cette définition stochastique du coût-à-venir donnée par l'équation (3.7). Par chance, on peut réutiliser l'approche récursive de programmation dynamique qui débute par la fin, il suffit de modifier l'algorithme de programmation dynamique exacte pour ajouté un calcul d'espérance pour chaque option d'action :

$$J_k^*(x_k) = \min_{u_k} \mathbb{E}_{w_k} \left[g_k(x_k, u_k, w_k) + J_{k+1}^* \left(\underbrace{f_k(x_k, u_k, w_k)}_{x_{k+1}} \right) \right] \quad (3.8)$$

$$\pi_k^*(x_k) = \operatorname{argmin}_{u_k} \mathbb{E}_{w_k} \left[g_k(x_k, u_k, w_k) + J_{k+1}^* \left(\underbrace{f_k(x_k, u_k, w_k)}_{x_{k+1}} \right) \right] \quad (3.9)$$

3.3 Formulation minimax (commande robuste)

Une autre formulation possible, associée aux concepts de commande robuste, est de plutôt vouloir minimiser le pire scénario possible, i.e. minimiser le coût- à-venir avec la formualation suivante :

$$J^\pi(x) = \max_{w_0, w_1, \dots, w_{N-1}} \left[\sum_{k=0}^{N-1} g_k(x_k, u_k, w_k) + g_N(x_N) \right] \quad \text{avec } x_0 = x \quad \text{et} \quad x_{k+1} = f_k(x_k, \pi_k(x_k), w_k) \quad (3.10)$$

Similairement, l'algorithme de programmation dynamique est modifié en incluant une maximisation (remplaçant l'espérance) :

$$J_k^*(x_k) = \min_{u_k} \max_{w_k} \left[g_k(x_k, u_k, w_k) + J_{k+1}^*(\underbrace{f_k(x_k, u_k, w_k)}_{x_{k+1}}) \right] \quad (3.11)$$

$$\pi_k^*(x_k) = \operatorname{argmin}_{u_k} \max_{w_k} \left[g_k(x_k, u_k, w_k) + J_{k+1}^*(\underbrace{f_k(x_k, u_k, w_k)}_{x_{k+1}}) \right] \quad (3.12)$$

Cette formulation est utilisée typiquement pour les intelligences artificielles de jeux comme les échecs. En effet, dans ce contexte, les actions de l'adversaire peuvent être vues comme des perturbations, et puisqu'on assume que l'adversaire va choisir des actions pour nuire à l'autre joueur, il est plus logique d'assumer que la perturbation va nous nuire le plus possible.

3.4 Observations Partielles

Si l'observation de l'agent n'est pas l'état complet de l'environnement, ou est bruité, le problème prend une dimension de complexité supplémentaire. On peut modéliser cette situation avec une fonction observation, pour représenter le lien entre les états et l'observation :

$$y_k = h_k(x_k, u_k, v_k) \quad (3.13)$$

où v_k est une variable aléatoire représentant du bruit, voir Figure 3.3.

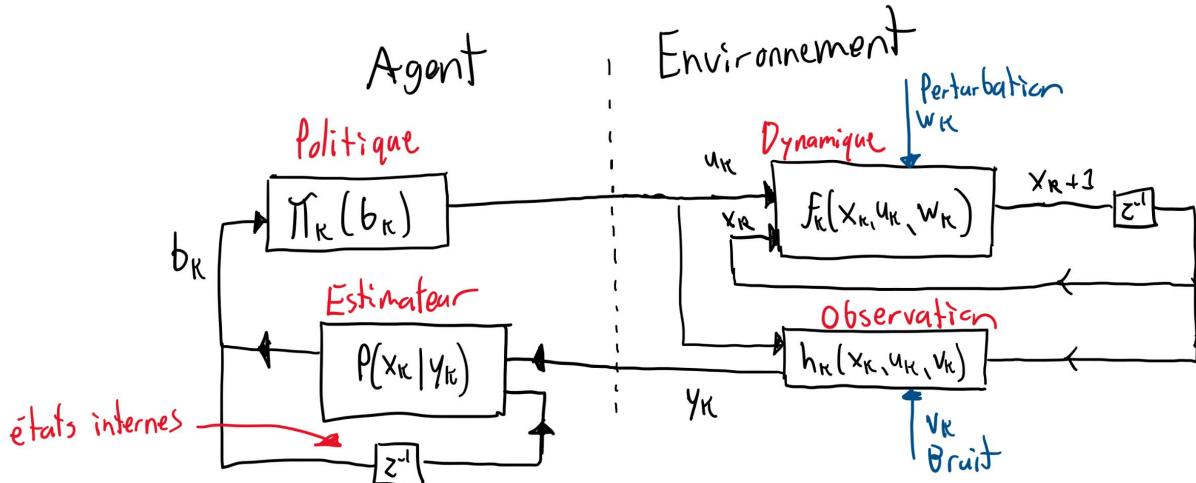


FIGURE 3.3 – Formulation mathématique incluant une fonction observation (utile pour représenter quand l'agent n'observe pas les états directement) et politique qui contient ses propres états et sa dynamique.

Le problème est appelé dans la littérature processus de décision markovien partiellement observable (POMDP), lorsque les états sont discrets. Dans la littérature sur la commande, on nomme souvent les observations les sorties du système.



Capsule vidéo
Observations partielles
<https://youtu.be/ZzT0L1Lqjio>

3.4.1 Espace croyance

Le problème générique peut être structuré en remplaçant l'état x (qu'on ne connaît pas avec certitude) par un espace de croyance (*belief state*) qui représente la distribution de probabilité de se trouver sur un état x basé sur les observations antérieures y_k :

$$P(x_k = x_i | u_k, y_k, \dots, u_1, y_1, u_0, y_0) \quad (3.14)$$

On va qualifier de **statistique suffisante** une représentation b de cet espace, si elle rencontre la propriété suivante :

$$P(x_{k+1} | b_k, u_k, k) = P(x_{k+1} | b_k, u_k, k, \underbrace{y_{k-1}, u_{k-1}, y_{k-2}, u_{k-2}, \dots, y_1, u_1, y_0, u_0}_{\text{historique}}) \quad (3.15)$$

Autrement dit, si elle encode toute l'information possible sur l'évolution possible du système dynamique. La bonne nouvelle c'est qu'on peut convertir le problème original (POMDP) en un problème régulier (MDP) en considérant que l'état du système est la représentation de l'espace de croyance b . On peut utiliser les outils habituels et la politique optimale peut être alors exprimée comme une carte statique à partir de cet espace croyance :

$$u_k = \pi_k^*(b_k) \quad (3.16)$$

Il est toutefois à noter que le processus de mettre à jour l'espace croyance en fonction de nouvelles observations est un processus dynamique qui doit être mis en oeuvre par l'agent. Jusqu'à maintenant on assumait pouvoir observer directement l'état de l'environnement et la politique optimale était toujours une fonction statique entre les observations et les actions. Avec des observations partielles, ce n'est plus le cas, la politique optimale va avoir sa propre dynamique et ses états internes, qui est associée avec le processus de mise à jour de la distribution de probabilité de l'espace de croyance.

La mise à jour de l'espace de croyance, peut être vue théoriquement comme implémenter la règle de Bayes (voir Section A.2.5).

$$P(x_{k+1} | y_k) = \frac{P(y_k | x_{k+1}) P(x_{k+1})}{P(y_k)} \quad (3.17)$$

Je dit théoriquement car en pratique c'est généralement insoluble exactement même pour des problèmes très simples. Il y a toutefois des outils pour des situations particulières, par exemple le filtre de Kalman est une solution à ce problème lorsque le système est linéaire et avec du bruit gaussien. On va généralement utiliser des méthodes approximées pour implémenter un estimateur, un exemple est le filtre de particules.

3.5 Politique Stochastique

Dans certaines situations, il peut avoir un avantage à avoir une politique qui est stochastique. Ça peut sembler contre-intuitif à première vue, et en fait si on regarde l'équation (3.9) il semblerait que agir optimalement doit être une fonction déterministe (sauf si plusieurs actions minimiseraient le cout-àvenir, alors choisir aléatoirement dans ce sous-ensemble serait aussi optimal). En effet, si on observe directement l'état d'un système la politique optimale est déterministe. Toutefois, lorsqu'on a de l'information partielle (soit on observe pas directement les états, soit on ne connaît pas la dynamique du système) il peut avoir un avantage à agir stochastiquement.

Lorsqu'on est dans un contexte de politique stochastique, on va réutiliser π mais pour indiquer la fonction de probabilité :

$$\pi_k(u|x) = P(u_k = u | x_k = x) \quad (3.18)$$

un petit abus de notation pour éviter d'introduire un nouveau symbole.

Chapitre 4

Modèles d'évolution

Dans ce chapitre on va faire des liens entre les différences représentations possible de l'environnement, des équations différentielles qu'on utilise quand on modélise un robot basé sur des principes physiques, jusqu'aux tenseurs de probabilités utilisés dans le contexte de processus de décision de Markov.



Capsule vidéo

Types de modèles d'évolution

https://youtu.be/D_HLuoPrD4w?si=CH3TcFrPsE6CH1DB

4.1 Équations différentielles (temps continus)

Lorsqu'on modélise le mouvement d'un système physique, sur lequel nos actions sont des forces, on va naturellement travailler en temps continu. En effet, lorsqu'on applique les lois de Newton et de conservation sur des systèmes mécaniques, on va typiquement obtenir des équations différentielles d'ordre deux de la forme :

$$\underbrace{M(q)\ddot{q}}_{m\vec{a}} = \underbrace{\sum f(q, \dot{q}, u, w, t)}_{\vec{f}} \quad (4.1)$$

La représentation d'état pour ce système est alors un vecteur qui comprend des variables positions et vitesses :

$$x = \begin{bmatrix} q \\ \dot{q} \end{bmatrix} \quad (4.2)$$

et on peut retrouver une équation différentielle d'ordre un sous la forme :

$$\frac{d}{dt} \begin{bmatrix} \dot{q} \\ q \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} M(q)^{-1} \sum f(q, \dot{q}, u, w, t) \\ \dot{q} \end{bmatrix} \quad (4.3)$$

qui est la forme d'un modèle d'état en temps continu :

$$\dot{x} = f(x, u, w, t) \quad (4.4)$$

Dans le domaine de la commande, on travaille très souvent avec une approximation linéaire d'un modèle dynamique sous cette forme :

$$\dot{x} = A(t)x + B(t)u + w \quad (4.5)$$

qu'on appelle LTI (*linear time invariant*) quand il n'y pas pas de dépendance directe au temps :

$$\dot{x} = Ax + Bu + w \quad (4.6)$$

Aussi, une fonction de transfert dans le domaine de Laplace, peut être convertit sous cette forme et vice-versa exactement sans approximation.

4.1.1 Conversion en temps discret

Ensuite, il est possible de convertir le modèle d'état en temps continu vers un modèle en temps discret en intégrant le modèle continu sur un certain pas de temps. L'approximation la plus simple pour faire cette conversion est l'intégration d'Euler, ou on aurait :

$$x_{k+1} \approx x_k + \dot{x}_k \Delta t = \underbrace{x_k + f(x_k, u_k, w_k, t_k) \Delta t}_{f_k(x_k, u_k, w_k)} \quad (4.7)$$

Pour retrouver la forme d'évolution de base utilisée dans ces notes, i.e. une équation de différence.

Note Il y a des schémas d'intégration plus complexes, par exemple Runge-Kutta, qui sont plus précis pour une pas de temps donné Δt .

4.2 Équations de différence

La formulation de base utilisée dans ces notes, est une équation de différence, qui définit l'état à l'étape suivante basé sur l'état actuel et une action choisie :

$$x_{k+1} = f_k(x_k, u_k, w_k) \quad k = 0, 1, \dots, N - 1 \quad (4.8)$$

C'est une formulation qu'on obtient naturellement pour des environnements artificiels comme des jeux où il y a une notion de tour (comme les échecs). On arrive aussi à cette formulation lorsqu'on modélise des asservissements et qu'on se place du point de vue d'un micro-contrôleur qui prend des décisions dans une boucle qui s'exécute en temps fini. Par exemple, une fonction de transfert utilisant la transformée en Z prend directement cette forme lorsqu'on utilise la représentation d'état. Dans le domaine des asservissements, on travaille souvent avec une approximation linéaire de ce type d'équation que l'on note :

$$x_{k+1} = A_k x_k + B_k u_k + w_k \quad k = 0, 1, \dots, N - 1 \quad (4.9)$$

4.3 Graphes (états discrets déterministes)

Pour les systèmes où les états et les actions sont discrets, il est possible de représenter les états comme des noeuds sur un graphe et les actions possibles comme des arcs qui nous mène vers un autre état. Cette section présente le cas déterministe. Par exemple pour un jeu d'échec, il y a un nombre fini de positions pour une pièce, et un nombre fini d'actions possibles, et rien n'est stochastique. On peut donc utiliser le concept d'un graphe où les noeuds sont des états discrets possibles (numéroté avec un index s et les arcs des actions possibles (qu'on identifiera directement avec l'index de la destination de l'arc).

Notation : On va utiliser une notation spécifique pour les systèmes discrets, pour s'aligner partiellement avec la littérature en apprentissage par renforcement basée sur [Sutton and Barto, 2018]. Globalement, on va garder la notation alignée avec les ouvrages de programmation dynamique et commande optimale comme [Bertsekas, 2017] pour les valeurs réelles comme le coût instantané g et le coût à venir J , mais on va utiliser les variables s , s' , a et r pour référer aux indexes identifiant un état actuel, un état futur, une action et un coût (récompense). **Attention !** Certaines parties antérieures du matériel (comme les capsules vidéos) utilisent la notation i et j plutôt que s et s' .

$$x_k \Leftrightarrow s \text{ index du noeud de départ} \quad (4.10)$$

$$u_k \Leftrightarrow s' \text{ index de la destination de l'arc d'action} \quad (4.11)$$

$$x_{k+1} \Leftrightarrow s' \text{ index du noeud d'arrivé} \quad (4.12)$$

$$J_k^*(x_k) \Leftrightarrow J_k^*(s) \quad (4.13)$$

$$\pi_k^*(x_k) \Leftrightarrow \pi_k^*(s) \quad (4.14)$$

$$g_k(x_k, u_k) \Leftrightarrow g_k(s, s') \text{ longueur de l'arc } ss' \quad (4.15)$$

L'algorithme de programmation dynamique peut alors être écrit comme :

$$J_N^*(s) = g_N(s) \quad \forall s \quad (4.16)$$

$$\vdots \quad (4.17)$$

$$J_k^*(s) = \min_{s' \in \mathcal{U}(s)} [g_k(s, s') + J_{k+1}^*(s')] \quad \forall s \quad (4.18)$$

$$\pi_k^*(s) = \operatorname{argmin}_{s' \in \mathcal{U}(s)} [g_k(s, s') + J_{k+1}^*(s')] \quad \forall s \quad (4.19)$$

Pour le cas discret, les fonctions peuvent être représentées par des vecteurs. Le coût-àvenir J peut être représenté par un vecteur où chaque élément $J(s)$ est le coût-àvenir de l'état s , la politique par un vecteur d'index où chaque élément $\pi(s)$ est un index de l'action optimale.

4.3.1 Discréétisation de variables continues

À venir !

4.4 Chaînes de Markov (états discrets stochastiques)

Lorsque les états sont discrets mais avec des transitions probabilistes, la formulation est appelée *chaîne de Markov* dans la littérature, et le problème de concevoir une politique est appelé un *processus de décision de Markov* (MDP). On peut encore utiliser le concept de graphe pour illustrer le système, mais dans ce cas les arcs sont associées à des probabilités de transitions.

$$x_k \Leftrightarrow s \text{ index du noeud de départ} \quad (4.20)$$

$$u_k \Leftrightarrow a \text{ index de l'action} \quad (4.21)$$

$$x_{k+1} \Leftrightarrow s' \text{ index du noeud d'arrivé} \quad (4.22)$$

$$f_k(x_k, u_k, w_k) \Leftrightarrow p_k(s'|s, a) \text{ probabilités de transitionner vers } s' \quad (4.23)$$

$$g_k(x_k, u_k, w_k) \Leftrightarrow p_k(r|s, a) \text{ probabilités d'obtenir un coût instantané correspondant à l'index } r \quad (4.24)$$

4.4.1 Coût déterministe

Dans un premier temps, supposons que le coût (ou son espérance) est pleinement déterminé pour une transition de s vers s' avec l'action a . Dans ce cas, le problème est pleinement déterminé par les probabilités de transition vers s' :

$$p_k(s'|s, a) = P(x_{k+1} = s' | x_k = s, u_k = a) \quad (4.25)$$

et une carte des coûts donnée par

$$g_k = g_k(s, s', a) \quad (4.26)$$

qu'on peut encore voir comme les longueurs des arcs sur le graphe, mais avec comme différence avec le cas déterministe qu'il y a des arcs pour chaque action a . L'algorithme de programmation dynamique peut alors prendre la forme suivante, où l'opérateur de l'espérance peut être remplacé par une somme avec les probabilités :

$$J_k^*(s) = \min_{a \in \mathcal{U}(s)} \sum_{s'} p_k(s'|s, a) [g_k(s, s', a) + J_{k+1}^*(s')] \quad (4.27)$$

$$\pi_k^*(s) = \operatorname{argmin}_{a \in \mathcal{U}(s)} \sum_{s'} p_k(s'|s, a) [g_k(s, s', a) + J_{k+1}^*(s')] \quad (4.28)$$

Concrètement, le modèle de l'environnement dans cette situation peut être encodé comme un tenseur d'ordre 3 (si les probabilités sont constantes d'une étape à l'autre), où chaque élément $p(s'|s, a)$ représente une probabilité de transition.



Capsule vidéo
Programmation dynamique pour un MDP
https://youtu.be/xHoLePda478?si=5kJxeVALBuu0n_JW

Le concept de valeur Q , représentant le coût-àvenir d'exécuter une action, peut alors aussi être défini par une somme :

$$Q(s, a) = \sum_{s'} p_k(s'|s, a) [g_k(s, s', a) + J_{k+1}^*(s')] \quad (4.29)$$

4.4.2 Coût stochastique

Pour la définition la plus large, on va considérer que le coût instantané est aussi probabiliste, mais peut prendre un nombre fini de valeurs $g(r) \in \mathbb{R}$ ou $r \in \mathbb{N}$ est l'index de la valeur de coût instantané. On peut alors définir le système par des probabilités de transiter de l'état s à l'état s' avec un coût $g(r)$ qui peuvent dépendre de l'action a et de l'étape actuelle k dans le cas le plus générique :

$$p_k(s', r|s, a) = P(x_{k+1} = s', g_k = g_r | x_k = s, u_k = a) \quad (4.30)$$

avec

$$x_k \Leftrightarrow s \text{ index du noeud de départ} \quad (4.31)$$

$$u_k \Leftrightarrow a \text{ index de l'action} \quad (4.32)$$

$$x_{k+1} \Leftrightarrow s' \text{ index du noeud d'arrivé} \quad (4.33)$$

$$f_k(x_k, u_k, w_k) \Leftrightarrow p_k(s', r|s, a) \text{ probabilités de transitionner vers } s' \text{ avec un coût } g_k(r) \quad (4.34)$$

$$g_k(x_k, u_k, w_k) \Leftrightarrow g_k(r) \text{ liste de coût possibles} \quad (4.35)$$

L'algorithme de programmation dynamique prend alors la forme suivante :

$$J_k^*(s) = \min_{a \in \mathcal{U}(s)} \sum_{s'} \sum_r p_k(s', r|s, a) [g_k(r) + J_{k+1}^*(s')] \quad (4.36)$$

$$\pi_k^*(s) = \operatorname{argmin}_{a \in \mathcal{U}(s)} \sum_{s'} \sum_r p_k(s', r|s, a) [g_k(r) + J_{k+1}^*(s')] \quad (4.37)$$

Notation du livre de Sutton et Barto On retrouve ici exactement la forme des équations qui est utilisée dans le livre séminal de Sutton et Barto [Sutton and Barto, 2018], la différence étant seulement la notation de coût g_k et coût-àvenir J vs. Sutton et Barto utilisent une récompense r et une valeur v . De plus, le livre de Sutton et Barto utilise directement le cas où l'horizon de temps est infini et rien n'est dépendant de l'étape actuelle, la situation spécifique qu'on explore au chapitre suivant.

Chapitre 5

Équations de Bellman

5.1 Horizon de temps infini

Dans un grand nombres de problèmes, on s'intéresse à concevoir une politique qui va bien performer en continu dans un environnement statique, et non pas sur un horizon de temps fini comme c'était le cas dans les sections précédentes. L'environnement statique veux dire ici que la dynamique et la fonction coût sont les mêmes pour toutes les étapes :

$$f_k(x_k, u_k, w_k) \Rightarrow f(x, u, w) \quad (5.1)$$

$$g_k(x_k, u_k, w_k) \Rightarrow g(x, u, w) \quad (5.2)$$

Dans cette situation, une façon de définir ce problème est de formuler le coût à optimiser comme la limite suivante :

$$J^\pi(x) = \lim_{N \rightarrow \infty} \mathbb{E} \left[\sum_{k=0}^N \alpha^k g(x_k, u_k, w_k) \right] \quad \text{avec } x_0 = x \quad \text{et} \quad x_{k+1} = f_k(x_k, \pi_k(x_k), w_k) \quad (5.3)$$

ou on introduit un facteur d'escampte $0 \leq \alpha \leq 1$ qui représente un biais pour moins prendre en considération les coûts/récompenses loins dans le futur. Le facteur d'escampte peut aussi être interprété comme une probabilité $(1 - \alpha)$ d'atteindre un état terminal sans coûts.

Dans ce contexte, sous certaines conditions, la limite existe et la politique optimale est aussi statique :

$$u_k = \pi_k(x_k) \Rightarrow u = \pi(x) \quad (5.4)$$

Un façon de voir les choses est que, pour un état actuel, le futur est équivalent peut importe l'étape actuelle, donc les décisions optimales n'ont pas de raisons d'être conditionnelles à l'étape actuelle.



Capsule vidéo

Horizon infini

<https://youtu.be/WbpSBaChigQ?si=AtAWuNlo2xDQyznT>

Existence de la solution Un problème va être mal défini si il y a une possibilité que le coût/récompense diverge lorsque $N \rightarrow \infty$, concrètement cela implique aussi que les algorithmes d'apprentissages divergeraient eux aussi en tentant de résoudre le problème. Pour s'assurer que le problème est bien défini, la méthode la plus simple est de définir $\alpha < 1$, une autre est de garantir que le système va atteindre un état terminal avec un coût fini, sinon il existe aussi des formulations alternatives de coût moyen, voir [Bertsekas, 2017] pour les détails.

5.2 Équations de Bellman

La solution aux problèmes de commande optimale sur un horizon de temps infini, tel que décrit à la section précédente, est caractérisée par l'équation de Bellman :

$$J^*(x) = \min_u \mathbb{E}_w \left[g(x, u, w) + \alpha J^*(\underbrace{f(x, u, w)}_{x_{k+1}}) \right] \quad \forall x \quad (5.5)$$

$$\pi^*(x) = \operatorname{argmin}_u \mathbb{E}_w \left[g(x, u, w) + \alpha J^*(\underbrace{f(x, u, w)}_{x_{k+1}}) \right] \quad \forall x \quad (5.6)$$

qui est nécessaire et suffisante pour confirmer l'optimalité d'un coût-àvenir et d'une politique. Il est à noter, que les équations de Bellman, sont en fait tout simplement les itérations de l'algorithme de programmation dynamique mais sans les indexés ! En effet, plus on se projette sur un horizon de temps lointain, plus nos itérations de programmation dynamique vont converger vers une solution statique et l'équation de Bellman représente l'équilibre qui serait atteint.



Capsule vidéo
Équation de Bellman
<https://youtu.be/18KrN1HHT3E?si=F100xS1UC0KATgCs>



Capsule vidéo
Éléments de l'équation de Bellman
<https://youtu.be/18KrN1HHT3E?si=2ccHURCR-f8hHRUR>

La solution aux équations de Bellman est deux fonctions, J^* et π^* , qui peuvent être représentées par des vecteurs lorsque l'espace d'état \mathcal{X} est discret. Lorsque l'espace d'état est continu, il est possible de trouver des solutions exactes seulement dans des cas particuliers, discutés à la section 6. Lorsque l'espace d'état est discret, trouvez la solution implique de résoudre $N = |\mathcal{X}|$ (nombre d'états) équations non-linéaires (5.5), et il existe des algorithmes (présentés à la section 7) qui sont tractables lorsque N est relativement petit. Lorsque trouver des solutions exactes est impossible, on va plutôt tenter de trouver des approximations de fonction

Note : La solution J^* est unique, mais pas la politique π^* . En effet, deux actions peuvent être équivalentes et minimiser le coût, par exemple passer à gauche ou à droite d'un poteau bien centré sur notre chemin.

5.2.1 Variantes pour un processus de décision de Markov

Il existe plusieurs version des équations de Bellman, selon les hypothèses et le type de modèle.



Capsule vidéo
Variantes de l'équation de Bellman
https://youtu.be/98I0SI_jWyY?si=skah-1-PRdZibSPT

La forme la plus générique, pour un processus de décision de Markov, tel que décrit à la section 4.4, est

$$J^*(s) = \min_a \sum_{s'} \sum_r p(s', r | s, a) [g(r) + J^*(s')] \quad (5.7)$$

$$\pi^*(s) = \operatorname{argmin}_a \sum_{s'} \sum_r p(s', r | s, a) [g(r) + J^*(s')] \quad (5.8)$$

Si on suppose que le coût est déterminé par une transition, alors on peut écrire :

$$J^*(s) = \min_a \sum_{s'} p(s'|s, a) [g(s, s', a) + J^*(s')] \quad (5.9)$$

$$\pi^*(s) = \operatorname{argmin}_a \sum_{s'} p(s'|s, a) [g(s, s', a) + J^*(s')] \quad (5.10)$$

, et si l'évolution est déterministe, alors :

$$J^*(s) = \min_{s'} [g(s, s') + J^*(s')] \quad (5.11)$$

$$\pi^*(s) = \operatorname{argmin}_{s'} [g(s, s') + J^*(s')] \quad (5.12)$$

Aussi, on peut réécrire l'équation (5.10), fonction des facteurs Q :

$$Q^*(s, a) = \sum_{s'} p(s'|s, a) [g(s, s', a) + \min_{a'} Q^*(s', a')] \quad (5.13)$$

$$\pi^*(s) = \operatorname{argmin}_a Q^*(s, a) \quad (5.14)$$

5.3 Coût-àvenir d'une politique

Supposons que l'on cherche à évaluer le coût-àvenir d'une politique spécifique arbitraire :

$$u = \pi(x) \quad (5.15)$$

l'équation de Bellman peut être modifiée pour la tâche. Dans ce cas, l'opération de minimisation est retirée, et le calcul est plutôt de seulement calculer l'espérance d'exécuter la politique π à l'état x .

$$J^\pi(x) = \mathbb{E} \left[g(x, \underbrace{\pi(x)}_u, w) + \alpha J^\pi(f(x, \underbrace{\pi(x)}_u, w)) \underbrace{\qquad\qquad\qquad}_{x_{k+1}} \right] \quad (5.16)$$

À noter, que dans le cas où la politique est stochastique, il faut calculer l'espérance selon les probabilités de choix actions en plus des probabilités de perturbations.

5.3.1 Variantes pour une processus de décision de Markov

Sur une chaîne de Markov, pour évaluer une politique spécifique caractérisée par une politique déterministe $a = \pi(s)$, on a la forme :

$$J^\pi(s) = \sum_{s'} p(s'|s, \pi(s)) [g(s, s', \pi(s)) + \alpha J^\pi(s')] \quad (5.17)$$

Si la politique est stochastique et caractérisée par une probabilité $\pi(a|s)$, alors le calcul de l'espérance doit être modifié et on aurait :

$$J^\pi(s) = \sum_a \pi(a|s) \sum_{s'} p(s'|s, a) [g(s, s', a) + \alpha J^\pi(s')] \quad (5.18)$$

5.3.2 Solution matricielle

Les équations (5.17) et (5.18) peuvent être ramenée à un gros système d'équation linéaire. En effet, chaque termes peuvent être représentés par des vecteurs, matrices ou tenseurs. La politique serait une matrice où chaque élément π_{as} représente la probabilité de choisir l'action a à l'état s , les probabilités de transitions

seraient groupée dans un tenseur d'ordre 3 où chaque élément $p_{s'as}$ serait la probabilité de transitionner à l'état s' à partir de l'état s avec l'action a et un autre tenseur d'ordre 3 avec chaque élément $g_{s'as}$ représentant le coût instantanné d'une transition.

On pourrait d'abord calculer un vecteur d'espérance du coup instantané :

$$r_s^\pi = \sum_a \pi_{as} \sum_{s'} p_{s'as} g_{s'as} \quad (5.19)$$

et une matrice de probabilité de transition pour la politique :

$$p_{s's}^\pi = \sum_a \pi_{as} \sum_{s'} p_{s'as} \quad (5.20)$$

On peut alors réécrire le système d'équation (5.18) sous la forme :

$$J^\pi = r^\pi + \alpha P^\pi J^\pi \quad (5.21)$$

et on peut isoler le vecteur de coup-àvenir :

$$J^\pi = [I - \alpha P^\pi]^{-1} r^\pi \quad (5.22)$$

5.4 Équation de Hamilton–Jacobi–Bellman

En temps continu, on retrouve des équations qui sont similaires, mais impliquant des dérivées partielles par rapport au temps. L'équation est habituellement présentée dans un contexte déterministe. Pour un horizon de temps fini l'équivalent de l'algorithme de programmation dynamique exacte est une équation différentielle partielle qu'on peut intégrer de la fin vers le début pour trouver le coût-àvenir $J^*(x, t)$ et la politique $\pi^*(x, t)$ avec :

$$-\frac{\partial J^*(x, t)}{\partial t} = \min_u \left[g(x, u) + \frac{\partial J^*(x, t)}{\partial x} \underbrace{f(x, u, t)}_{\dot{x}} \right] \quad (5.23)$$

$$\pi^*(x, t) = \operatorname{argmin}_u \left[g(x, u) + \frac{\partial J^*(x, t)}{\partial x} \underbrace{f(x, u, t)}_{\dot{x}} \right] \quad (5.24)$$

Ensuite, si l'horizon de temps est infini, l'équivalent de l'équation de Bellman est :

$$0 = \min_u \left[g(x, u) + \frac{\partial J^*(x)}{\partial x} \underbrace{f(x, u)}_{\dot{x}} \right] \quad (5.25)$$

$$\pi^*(x) = \operatorname{argmin}_u \left[g(x, u) + \frac{\partial J^*(x)}{\partial x} \underbrace{f(x, u)}_{\dot{x}} \right] \quad (5.26)$$

qui représente l'équilibre lorsque l'horizon de temps tend vers l'infini.

Chapitre 6

Solutions Analytiques

Ce chapitre présente les solutions analytiques à l'équation de Bellman, pour les situations particulières où la dynamique est une relation linéaire et le coût une relation quadratique, connue sous l'acronyme LQR pour *Linear Quadratic Regulator* dans le domaine de la commande.

6.1 LQR à temps discret



Capsule vidéo
LQR temps discret
<https://youtu.be/gg0IYkQwXWs?si=tgL0d6LhGVq5KAal>

Dans le contexte d'un système dynamique linéaire à états/actions continus représenté par :

$$\underline{x}_{k+1} = f_k(\underline{x}_k, \underline{u}_k, \underline{w}_k) = A_k \underline{x}_k + B_k \underline{u}_k + \underline{w}_k \quad (6.1)$$

où \underline{x}_k et \underline{w}_k sont des vecteurs de dimension n et \underline{u}_k un vecteur de dimension m . Le vecteur \underline{w}_k représente des perturbations aléatoires, indépendantes de l'état actuel, de l'action actuelle et de tous les états passés, et avec des distributions centrées autour de zéro :

$$\mathbb{E}[\underline{w}_k] = \underline{0} \quad (6.2)$$

Si on cherche donc à minimiser l'espérance du coût-àvenir :

$$J = \mathbb{E} \left[\sum_{k=0}^{N-1} \left(\underbrace{\underline{x}_k^T Q_k \underline{x}_k + \underline{u}_k^T R_k \underline{u}_k}_{g_k(\underline{x}_k, \underline{u}_k, \underline{w}_k)} \right) + \underbrace{\underline{x}_N^T Q_N \underline{x}_N}_{g_N(\underline{x}_N)} \right] \quad (6.3)$$

où les matrices Q_k et R_k sont symétriques et définies positives :

$$Q_k \geq 0 \quad R_k > 0 \quad (6.4)$$

En appliquant l'algorithme de programmation dynamique on trouve que :

1) le coût-àvenir d'un état \underline{x}_k a la forme quadratique suivante :

$$J_k^*(\underline{x}_k) = \underline{x}_k^T S_k \underline{x}_k + c_k \quad S_k = S_k^T > 0 \quad \forall k \quad (6.5)$$

où S_k est une matrice symétrique qui caractérise le coût-àvenir à l'état \underline{x}_k et c_k est une constante qui ne dépend pas de l'état actuel.

2) la loi de commande optimale a la forme linéaire suivante :

$$\pi_k^*(\underline{x}_k) = -K_k \underline{x}_k \quad (6.6)$$

où K_k est la matrice de gain égale à

$$K_k = [R_k + B_k^T S_{k+1} B_k]^{-1} B_k^T S_{k+1} A_k \quad (6.7)$$

3) la matrice S_k dans les équations précédentes peut être calculée en partant du coût final à $k = N$ et en remontant dans le temps avec la récursion suivante :

$$S_k = Q_k + A_k^T \left(S_{k+1} - S_{k+1} B_k [R_k + B_k^T S_{k+1} B_k]^{-1} B_k^T S_{k+1} \right) A_k \quad (6.8)$$

Une équation nommée l'équation de Riccati en temps discret.

6.1.1 Horizon infini

Si le problème ne dépend pas directement de l'étape, i.e. toutes les matrices A , B , Q et R sont constantes, et qu'on cherche la solution optimale sur un horizon de temps infini, alors la politique optimale va aussi être une matrice de gain constant :

$$\pi^*(\underline{x}) = -K \underline{x} \quad (6.9)$$

où K est la matrice de gain égale à

$$K = [R + B^T S B]^{-1} B S A \quad (6.10)$$

avec S étant la solution de l'équation nommée l'équation de Riccati algébrique en temps discret (DARE) :

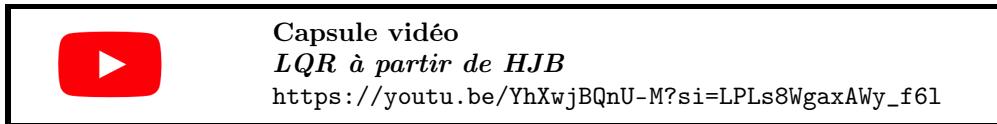
$$S = Q + A^T \left(S - S^T B^T [R + B^T S B]^{-1} B S \right) A \quad (6.11)$$

qui est en fait l'équation de Bellman pour ce cas particulier.

Existence de la solution Dans ce contexte, il n'est pas typique d'utiliser un facteur d'escompte α . L'existence d'un coût-àvenir fini peut être garantie par le critère de contrôlabilité du système, qui est une propriété qui se calcule basé sur la matrice A et B . Celle-ci garantie qu'il existe une séquence d'action possible pour amener le système dynamique sur un état cible arbitraire. Dans ce cas c'est relié au fait qu'il existe donc nécessairement une solution ou un coût-àvenir arrête de croître dans le temps si on amène l'état à l'origine $x = 0$ qui est un point sans coût.

6.2 LQR à temps continu

En temps continu, on trouve aussi une équation analytique à l'équation HJB (voir section 5.4), si la dynamique est linéaire et le coût quadratique.



Donc, plus précisément, dans le contexte d'un système dynamique à états et actions continues où la dynamique est linéaire :

$$\dot{\underline{x}} = A(t)\underline{x} + B(t)\underline{u} + \underline{w} \quad (6.12)$$

où \underline{x} et \underline{w} sont des vecteurs de dimension n et \underline{u} un vecteur de dimension m . Le vecteur \underline{w} représente des perturbations aléatoires, indépendantes de l'état actuel, de l'action actuelle et de tous les états passés, et avec des distributions centrées autour de zéro :

$$\mathbb{E} [\underline{w}] = 0 \quad (6.13)$$

De plus A et B sont des matrices caractérisant la dynamique, qui peuvent dépendre du temps. Si on cherche donc à minimiser l'espérance du coût-à-venir :

$$J = \mathbb{E} \left[\int_{t=0}^{t_f} \left(\underbrace{\underline{x}^T Q(t) \underline{x} + \underline{u}^T R(t) \underline{u}}_{g(\underline{x}, \underline{u}, t)} \right) + \underbrace{\underline{x}_f^T S_f \underline{x}_f}_{h(\underline{x}_f, t_f)} \right] \quad (6.14)$$

où les matrices $Q(t)$ et $R(t)$ sont symétriques et définies positives :

$$Q(t) \geq 0 \quad R(t) > 0 \quad \forall t \quad (6.15)$$

et peuvent déprendre du temps.

Note : La solution qu'on dérive ici est valide même si les matrice A , B , Q et R sont des fonctions du temps. On va toutefois omettre le (t) dans les équations suivantes pour alléger la présentation.

En partant du coût-à-venir optimal au temps terminal, qui est nécessairement directement la fonction de coût terminal définie par le problème :

$$J^*(x, t_f) = \underline{x}^T S_f \underline{x} \quad (6.16)$$

on peut retrouver la solution optimale en intégrant l'équation de HJB (voir section 5.4) qui peut être simplifiée :

$$-\frac{\partial J^*(x, t)}{\partial t} = \min_u \mathbb{E} \left[g(x, u) + \frac{\partial J^*(x, t)}{\partial x} \underbrace{f(x, u, w, t))}_{\dot{x}} \right] \quad (6.17)$$

$$-\frac{\partial J^*(x, t)}{\partial t} = \min_u \mathbb{E} \left[\underline{x}^T Q \underline{x} + \underline{u}^T R \underline{u} + \frac{\partial J^*(x, t)}{\partial x} \underbrace{(A \underline{x} + B \underline{u} + \underline{w})}_{\dot{x}} \right] \quad (6.18)$$

Un résultat, **probablement le plus important de tout le domaine de la commande optimale !**, est que la fonction coût-à-venir optimale va avoir la forme quadratique suivante :

$$J^*(x, t) = \underline{x}^T S(t) \underline{x} \quad (6.19)$$

et la politique optimale va avoir la forme linéaire suivante :

$$\pi^*(x, t) = - \underbrace{[R^{-1} B^T S(t)]}_{K(t)} \underline{x} \quad (6.20)$$

Les deux solutions décrites ci-dessous sont fonctions d'une matrice variable dans le temps $S(t)$ qui peut être calculée en intégrant dans le temps l'équation différentielle suivante :

$$-\dot{S}(t) = S(t)A + A^T S(t) - S(t)BR^{-1}B^T S(t) + Q \quad (6.21)$$

qui est la condition pour que l'équation (6.18) soit respectée. Cette équation est connue sous le nom d'équation de Riccati différentiel en temps continu. On intègre cette équation à partir de la valeur au temps terminal qui correspond au coût terminal défini par le problème :

$$S(t_f) = S_f \quad (6.22)$$

6.2.1 Horizon infini

Si le problème ne dépend pas directement de l'étape, i.e. toutes les matrices A , B , Q et R sont constantes, et qu'on cherche la solution optimale sur un horizon de temps infini, alors la politique optimale va aussi être une matrice de gain constant :

$$\pi^*(\underline{x}) = -K^* \underline{x} \quad (6.23)$$

où K est la matrice de gain égale à

$$K^* = R^{-1} B^T S \quad (6.24)$$

avec S étant la solution de l'équation nommée l'équation de Riccati algébrique en temps continu (CARE) :

$$0 = SA + A^T - SBR^{-1}B^T S + Q \quad (6.25)$$

qui est en fait l'équation de Bellman pour ce cas particulier. Il existe des méthodes numériques efficaces pour résoudre cette équation matricielle quadratique. La solution existe si le système dynamique a une propriété qu'on appelle la contrôlabilité, reliée aux matrices A et B .

Note : Lorsqu'on parle d'un contrôleur LQR en général sans précision, on réfère généralement à la solution statique pour un horizon de temps infini.

6.2.2 Stabilisation de trajectoires

La solution LQR pour un horizon de temps fini, permet de résoudre des problèmes de commande non-linéaire en linéarisant autour d'une trajectoire temporelle. En effet, supposons qu'on désire concevoir une politique pour stabiliser un système dynamique non-linéaire :

$$\dot{\underline{x}} = f(\underline{x}, \underline{u}) \quad (6.26)$$

sur une trajectoire nominale :

$$\underline{x}_d(t) \quad \underline{u}_d(t) \quad \text{avec} \quad \dot{\underline{x}}_d = f(\underline{x}_d, \underline{u}_d) \quad (6.27)$$

La dynamique de l'erreur :

$$\underline{x}_e = \underline{x}_d - \underline{x} \quad (6.28)$$

est égale à

$$\dot{\underline{x}}_e = \dot{\underline{x}}_d - \dot{\underline{x}} \quad (6.29)$$

$$\dot{\underline{x}}_e = f(\underline{x}_d, \underline{u}_d) - f(\underline{x}, \underline{u}) \quad (6.30)$$

Et si on fait une expansion de Taylor pour approximer la dynamique autour de la trajectoire nominale, on trouve que la dynamique de l'erreur prend une forme linéaire mais dépendant du temps qui peut être résolu avec la solution LQR pour un horizon de temps fini.

$$\dot{\underline{x}}_e = f(\underline{x}_d, \underline{u}_d) - f(\underline{x}, \underline{u}) \quad (6.31)$$

$$\dot{\underline{x}}_e \approx f(\underline{x}_d, \underline{u}_d) - \left(f(\underline{x}_d, \underline{u}_d) + \left[\frac{\partial f(x, u)}{\partial x} \right]_{(\underline{x}_d, \underline{u}_d)} \Delta \underline{x} + \left[\frac{\partial f(x, u)}{\partial u} \right]_{(\underline{x}_d, \underline{u}_d)} \Delta \underline{u} + h.o.t. \right) \quad (6.32)$$

$$\dot{\underline{x}}_e \approx A(t) \Delta \underline{x} + B(t) \Delta \underline{u} \quad (6.33)$$

Donc pour un système non-linéaire, sur une trajectoire nominale spécifique, le problème de stabilisation d'une erreur relative à cette trajectoire peut être attaqué avec la solution LQR à horizon de temps fini, en

linéarisant la dynamique sur plusieurs points pour obtenir une approximation qui correspond à un système linéaire avec des matrices A et B qui varient dans le temps.

Exemple d'implémentation : Voir <https://github.com/SherbyRobotics/pyro/blob/master/pyro/control/lqr.py>

Chapitre 7

Algorithmes de planification

Ce chapitre présente des algorithmes pour trouver des solutions exactes aux équations de Bellman, lorsque les états et les actions ont des domaines discrets.

7.1 Algorithme d’itération de valeurs



Capsule vidéo
Iteration de valeurs
<https://youtu.be/SpWKHB4GupU?si=Ewb6MwRTTE0lero0>

L’algorithme d’itération de valeurs, consiste à initialiser arbitrairement un vecteur $J(x)$ de valeurs de coûts-àvenir pour chaque état x , et ensuite itérer avec l’opération de programmation dynamique suivante :

$$J(x) \leftarrow \min_u \mathbb{E}_w \left[g(x, u, w) + \alpha J(\underbrace{f(x, u, w)}_{x_{next}}) \right] \quad \forall x \quad (7.1)$$

jusqu’à la convergence des valeurs du vecteur $J(x)$ selon un certain seuil de tolérance. Le point fixe de ces itérations correspond à l’équation de Bellman et donc $J(x)$ converge vers le cout-àvenir optimal $J^*(x)$. Ensuite, la politique optimale peut être calculée avec :

$$\pi^*(x) = \operatorname{argmin}_u \mathbb{E}_w \left[g(x, u, w) + \alpha J^*(\underbrace{f(x, u, w)}_{x_{next}}) \right] \quad \forall x \quad (7.2)$$

On peut interpréter l’algorithme d’itération de valeur comme simplement utiliser l’algorithme de programmation dynamique exacte pour calculer les valeurs optimales en reculant dans le temps étape par étapes, jusqu’à atteindre un point au l’horizon de temps est très très grand et donc que la solution correspond approximativement à un horizon de temps infini. Il est toutefois à noter que la valeur d’initialisation, qui correspond à un coût terminal selon cette interprétation, n’a pas d’impact sur la valeur finale après convergence de l’algorithme.

7.1.1 Conditions de convergence

L’algorithme d’itération de valeur peut ne pas converger si il y a possibilité d’une situation où un coût peut tendre vers l’infini sur une trajectoire. Une première façon de garantir que ce n’est pas le cas est si la fonction de coût instantanée est bornée par une valeur finie (i.e. n’est jamais infini) et si le facteur d’escompte est inférieur à 1 :

$$g(x, u, w) < G \quad \text{et} \quad 0 < \alpha < 1 \quad (7.3)$$

Alternativement, si on veut utiliser un facteur d'escompte égale à un, une autre méthode pour garantir la convergence est de s'assurer que le système va inévitablement converger sur un état terminal avec un coût fini.

7.1.2 Évaluation de politique

On peut aussi utiliser cet algorithme pour évaluer le cout-àvenir d'une politique spécifique avec les itérations suivantes :

$$J(x) \Leftarrow \mathbb{E}_w \left[g(x, \pi(x), w) + \alpha J(\underbrace{f(x, \pi(x), w)}_{x_{next}}) \right] \quad \forall x \quad (7.4)$$

pour converger sur $J^\pi(x)$.

7.2 Algorithme d'itération de politique



Capsule vidéo
Iteration de politique

<https://youtu.be/5b1o8808e44?si=5r8Wm3s0jHHCtXe5>

Un algorithme alternatif est l'algorithme d'itération de politique. L'idée est de débuter avec une politique arbitraire π . Ensuite on alterne entre une étape d'évaluation et une étape d'amélioration. L'étape d'évaluation consiste à faire un certain nombre d'itérations avec l'algorithme d'évaluation de politique :

$$J^\pi(x) \Leftarrow \mathbb{E}_w \left[g(x, \pi(x), w) + \alpha J^\pi(\underbrace{f(x, \pi(x), w)}_{x_{next}}) \right] \quad \forall x \quad (7.5)$$

Ensuite, on va améliorer la politique en choisissant l'action qui optimise le coût-àvenir estimé actuel :

$$\pi'(x) = \operatorname{argmin}_u \mathbb{E}_w \left[g(x, u, w) + \alpha J^\pi(\underbrace{f(x, u, w)}_{x_{next}}) \right] \quad \forall x \quad (7.6)$$

Ensuite on retourne à l'étape d'amélioration, ou bien l'algorithme termine si l'algorithme la politique est fixe à l'étape d'amélioration.

Chapitre 8

Algorithmes d'apprentissage

8.1 Évaluation

8.1.1 Monte-carlo

8.1.2 TD-Learning

8.1.3 Sarsa

8.2 Q-Learning

Bellman

Pour un système déterministe :

$$Q(x, u) \Leftarrow g_k + \min_{u_{k+1}} [Q(x_{k+1}, u_{k+1})] \quad (8.1)$$

Pour un système stochastique avec un taux d'apprentissage η :

$$Q(x, u)^{new} \Leftarrow Q^{old}(x, u) + \eta \left[g_k + \min_{u_{k+1}} Q^{old}(x_{k+1}, u_{k+1}) - Q^{old}(x_k, u_k) \right] \quad (8.2)$$

Avec approximation de fonction :

$$Q(x, u) \approx \hat{Q}(x, u|w) \quad (8.3)$$

mise à jour des poids :

$$w_i^{new} \Leftarrow w_i^{old} + \eta \left[g_k + \min_{u_{k+1}} \hat{Q}(x_{k+1}, u_{k+1}) - \hat{Q}(x_k, u_k) \right] \frac{\partial \hat{Q}}{\partial w_i} \quad (8.4)$$



8.3 Exploration

8.3.1 Exploitation vs. exploration

n-armed bandit

À venir !

Chapitre 9

Politiques Stochastiques

Chapitre 10

Approximation de fonctions



Capsule vidéo

RL avec approximation

https://youtu.be/CGbdEDGsJnU?si=BDLgkYyqqy0R_RYz



Capsule vidéo

Approximation de fonctions

<https://youtu.be/p8BiszV8apQ?si=Tj0lqSOQZwZmtn9u>

Annexe A

Outils mathématiques

A.1 Ensembles

On note qu'une variable x peut prendre des valeurs dans un ensemble X de valeurs possibles avec le symbole \in ainsi :

$$x \in \mathcal{X} \quad (\text{A.1})$$

Pour des variables discrètes on peut définir un ensemble directement avec une liste d'éléments :

$$\mathcal{X} = \{1, 2, 3, 4, 5\} \quad (\text{A.2})$$

Pour des variables continues, on peut définir des intervalles, incluant les bornes :

$$\mathcal{X} = [0, 10] \quad \Rightarrow \text{ex : } 0 \in \mathcal{X}, 2 \in \mathcal{X}, 12 \notin \mathcal{X} \quad (\text{A.3})$$

ou excluant les bornes :

$$\mathcal{X} = (0, 10) \quad \Rightarrow \text{ex : } 0 \notin \mathcal{X}, 2 \in \mathcal{X}, 9.999999999 \in \mathcal{X} \quad (\text{A.4})$$

ou bien avec une condition :

$$\mathcal{X} = \{x \in \mathbb{R} \mid 0 \leq x \leq 10\} = [0, 10] \quad (\text{A.5})$$

qu'on peut lire, l'ensemble des nombres réels qui sont plus grands ou égaux à zéro et plus petits et égaux à dix.



Capsule vidéo
Ensembles - Notions de base
<https://youtu.be/PtQNvbycVLc>

A.2 Probabilités



Capsule vidéo
Probabilités - Notions de base
<https://youtu.be/a2jBknWV1Vw>

A.2.1 Probabilité pour une variable discrète

On note la probabilité qu'une variable aléatoire X prenne la valeur x :

$$P(X = x) \in [0, 1] \quad (\text{A.6})$$

Pour avoir une notation plus compacte on va parfois écrire seulement :

$$p_i = P(X = x_i) \quad (\text{A.7})$$

la probabilité qu'une variable aléatoire discrète prenne le i -ème valeur possible dans l'ensemble. Pour un modèle probabiliste bien défini, la somme des probabilités doit être égale à 1 :

$$\sum_i p_i = 1 \quad (\text{A.8})$$

Exemple 1.

Par exemple pour un dé à six faces :

$$X \in \{1, 2, 3, 4, 5, 6\} \quad (\text{A.9})$$

et si le dé est bien équilibré :

$$P(X = 1) = 1/6 \quad (\text{A.10})$$

$$P(X = 2) = 1/6 \quad (\text{A.11})$$

$$P(X = 3) = 1/6 \quad (\text{A.12})$$

$$P(X = 4) = 1/6 \quad (\text{A.13})$$

$$P(X = 5) = 1/6 \quad (\text{A.14})$$

$$P(X = 6) = 1/6 \quad (\text{A.15})$$

A.2.2 Probabilité pour une variable continue

La probabilité pour une variable continue est définie sur un interval :

$$P(a < x < b) = \int_a^b p(x)dx \quad (\text{A.16})$$

ou $p(x)$ est une fonction de densité de probabilité, tel que :

$$\int_{-\infty}^{\infty} p(x)dx = 1 \quad (\text{A.17})$$

Exemple 2.

La fonction de densité de probabilité la plus connue, la fameuse courbe normale ou la Gaussienne, est définie par :

$$p(x) = \frac{1}{\sigma\sqrt{2\pi}} e^{-(\frac{x-\mu}{2\sigma})^2} \quad (\text{A.18})$$

ou μ est le centre de la distribution et σ l'écart type.

A.2.3 Espérance

Le concept de l'espérance, est une moyenne des valeurs d'un variable aléatoire pondérée par la probabilité d'occurrence. La définition exacte est :

$$\mathbb{E}[x] = \sum p_i x_i \quad \text{ou} \quad \mathbb{E}[x] = \int x p(x) dx \quad (\text{A.19})$$

Voici quelques propriété utile de l'opérateur espérance :

$$\mathbb{E}[x + y] = \mathbb{E}[x] + \mathbb{E}[y] \quad (\text{A.20})$$

$$\mathbb{E}[ax] = a \mathbb{E}[x] \quad a \text{ est une constante} \quad (\text{A.21})$$

$$\mathbb{E}[xy] \neq \mathbb{E}[x] \mathbb{E}[y] \quad (\text{A.22})$$

A.2.4 Probabilité jointe et conditionnelle

Une probabilité conditionnelle est une probabilité qui est une fonction d'une autre variable. On note :

$$P(B = b | A = a) \quad (\text{A.23})$$

la probabilité que la variable B prenne la valeur b , sachant que la variable A a pris la valeur a . La probabilité jointe des deux évènements, i.e. que deux choses aléatoire arrive en même temps, est notée :

$$P(B = b, A = a) \quad (\text{A.24})$$

En gros, la barre verticale veux dire "sachant que" et la virgule veux dire "et". Une probabilité jointe peut être calculée avec des probabilités conditionnelles :

$$P(A, B) = P(A|B)P(B) = P(B|A)P(A) \quad (\text{A.25})$$

A.2.5 Loi de Bayes

On peut réarranger l'équation (A.25) pour obtenir la loi de Bayes :

$$P(B|A) = \frac{P(A|B)P(B)}{P(A)} \quad (\text{A.26})$$

qui est centrale pour les problèmes de décision avec observations partielles. Typiquement on cherche à connaître la probabilité d'une cause B sachant qu'un symptôme A a été observé.

Annexe B

Approximation de fonctions



Capsule vidéo
Approximation de fonctions
<https://youtu.be/p8BiszV8apQ?si=o0I-NNueGjrwpVgr>

Une approximation de fonction tente d'approximer une fonction complexe $y = f(x)$ ou une relation observé dans des données $y_i = f(x_i)$, avec un certain nombre de paramètres w :

$$f(x) \approx \hat{f}(x|w) \quad (\text{B.1})$$

On cherche généralement les paramètres w qui vont minimiser l'erreur entre la prédiction de la fonction approximée et la vrai relation :

$$w^* = \underset{w}{\operatorname{argmin}} \mathcal{L} \quad (\text{B.2})$$

$$\mathcal{L} = \mathbb{E} \left[\frac{1}{2} \left(f(x_i) - \hat{f}(x_i|w) \right)^2 \right] \quad (\text{B.3})$$

Ce qui est équivalent sur un certain nombre N d'échantillons, dans le cas d'une relation observé sur des données, à

$$\mathcal{L} = \frac{1}{N} \sum_i^N \frac{1}{2} \left(f(x_i) - \hat{f}(x_i|w) \right)^2 \quad (\text{B.4})$$

Le gradient de la fonction perte de cet objectif est donc :

$$\frac{\partial \mathcal{L}}{\partial w} = -\frac{1}{N} \sum_i^N \left(f(x_i) - \hat{f}(x_i|w) \right) \frac{\partial \hat{f}}{\partial w} \quad (\text{B.5})$$

Descente du gradient stochastique La méthode de la descente du gradient stochastique consiste à perte à jour les paramètres de l'approximation, basé le gradient calculé un échantillon à la fois, avec un paramètre de taux d'apprentissage η :

$$w \leftarrow w + \eta \left(f(x_i) - \hat{f}(x_i|w) \right) \frac{\partial \hat{f}}{\partial w} \quad (\text{B.6})$$

B.1 Approximation linéaires

Une catégorie importante d'approximations de fonction sont construit comme la sommation pondéré de noyau qui peuvent être non-linéaire :

$$\hat{f}(x|w) = \sum_i w_i \phi_i(x) = \underline{w}^T \underline{\phi}(x) \quad (\text{B.7})$$

Si les noyaux non-linéaires sont fixés d'avance, et que les seuls paramètres de l'approximation sont les poids w_i , alors ce type de fonction a des avantages intéressants : **1)** on peut trouver les poids optimaux de façon explique avec la méthode des moindres-carrés et **2)** on peut avoir des garanties de convergence pour plusieurs méthodes en ligne.

Gradient

Le gradient de la fonction perte avec ce type de fonction est de :

$$\frac{\partial \mathcal{L}}{\partial \underline{w}} = -\frac{1}{N} \sum_i (f(x_i) - \underline{w}^T \underline{\phi}(x)) \underline{\phi}^T(x) \quad (\text{B.8})$$

lorsque calculé pour un ensemble de N échantillons, et de :

$$\frac{\partial \mathcal{L}_i}{\partial \underline{w}} = - (f(x_i) - \underline{w}^T \underline{\phi}(x)) \underline{\phi}^T(x) \quad (\text{B.9})$$

et pour un seul échantillon.

Solution des moindres-carrés

À venir !

B.1.1 Polynômes

$$\hat{f}(x|w) = w_0 + w_1 x + w_2 x^2 + w_3 x^3 + \dots \quad (\text{B.10})$$

B.1.2 Fourrier

$$\hat{f}(x|w) = \sum_i w_i \cos(i\pi x) \quad (\text{B.11})$$

B.1.3 Base radiales

$$\hat{f}(x|w) = \sum_i w_i e^{-(\frac{x-\mu_i}{2\sigma_i^2})^2} \quad (\text{B.12})$$

B.2 Approximations non-linéaires

Voir réseaux de neurones....

Annexe C

Exercices

C.1 Introduction et formulation du problème

C.1.1 Fonction coût vs récompense

Considérons un problème dont l'objectif est de minimiser la fonction de coût instantané suivante :

$$g(x, u) = (x_d - x)^2 + u^2 \quad (\text{C.1})$$

Cette fonction représente une erreur de positionnement au carré ($(x_d - x)^2$) et une pénalité quadratique sur l'énergie utilisée (u^2).

On souhaite cependant utiliser un algorithme qui est programmé pour *maximiser* une fonction de récompense.

1. Proposez une fonction de récompense $r(x, u)$ qui permettrait à l'algorithme de résoudre le problème de minimisation de coût original.
2. Prouvez formellement que la politique optimale qui minimise le coût cumulatif $\sum g(x, u)$ est la même que celle qui maximise la récompense cumulative $\sum r(x, u)$ que vous avez proposée.

C.1.2 Limites de la formulation coût/récompense cumulative

Cet exercice a pour but de réfléchir de manière critique à la généralité de la formulation de coût cumulatif. La structure d'un coût ou d'une récompense additive est-elle limitative ? Autrement dit, existe-t-il des objectifs qui ne pourraient pas être formulés sous cette forme ?

Analysez les deux situations spécifiques suivantes :

1. **Objectif multiplicatif** : Considérons un problème où les gains sont multiplicatifs à chaque étape (par exemple, un jeu où le gain de l'étape k est multiplié par celui de l'étape $k + 1$). Un tel objectif peut-il être transformé pour s'inscrire dans le cadre d'une fonction cumulative (additive) ? Si oui, comment ?
2. **Objectif multi-critères** : Considérons un problème multi-objectif, où l'on cherche à optimiser simultanément plusieurs critères, parfois contradictoires (ex : minimiser le temps de trajet *et* la consommation d'énergie). Est-il toujours possible de représenter un tel problème avec une seule fonction de coût scalaire ? Quelles sont les approches possibles et leurs limites ?

C.1.3 Formes possibles des politiques optimales

Pour chacun des cas suivants, cet exercice demande une réflexion intuitive (sans calculs formels) sur la nature de la politique optimale.

1. **Politique dépendant du temps** : Décrivez un scénario où la politique optimale doit nécessairement dépendre du temps (ou de l'étape k). Fournissez un exemple concret et un contre-exemple où une politique optimale serait stationnaire (indépendante du temps).
2. **Politique stochastique** : Décrivez un scénario où la politique optimale devrait être stochastique, c'est-à-dire qu'elle choisirait les actions selon une distribution de probabilité plutôt que de manière déterministe. Fournissez un exemple concret.

C.1.4 Apprendre à voler

Explorez l'exemple de code suivant qui utilise l'algorithme PPO pour entraîner un drone à voler.



Exercice de code
Planar Drone with PPO

https://colab.research.google.com/drive/1-EuRPiyf2Gv0n8p_17j1vvEIE188WT1m?usp=sharing

1. Combien d'étapes d'entraînement sont nécessaires pour apprendre une politique de vol adéquate ?
2. Vérifiez si la politique apprise se généralise bien en la testant avec différentes conditions initiales.
3. Observez la politique (loi de commande) qui est affichée à la fin de l'entraînement. Comment l'interprétez-vous ? Ressemble-t-elle à une loi de commande que vous connaissez ?
4. Modifiez les paramètres de la fonction de coût pour obtenir un comportement de vol plus "agressif" (par exemple, en pénalisant moins l'utilisation de l'énergie). Qu'observez-vous ?

C.1.5 Fonction de coût pour un pendule

Compétences à développer :

- Compréhension des paramètres d'une fonction de coût quadratique.
- Compréhension de la forme générique de coût additif $J = \int_0^{t_f} g(x, u, t) dt + h(x_f, t_f)$.

Pour cet exercice, le code d'amorce est disponible à la page Colab suivante :



Exercice de code
Fonction coût pour un pendule

<https://colab.research.google.com/drive/1BzMh7bBNgflchsbwgkDFkgP2s-5HNqW9?usp=sharing>

Tâches à réaliser

Pour chacune des situations décrites ci-dessous, exécutez le code et procédez à l'analyse demandée dans la section suivante.

- a) **Situation de référence** : Exécutez le code avec la fonction de coût quadratique par défaut.
- b) **Pénalité sur la position** : Ajustez les valeurs dans la matrice Q pour pénaliser plus fortement l'erreur en position du pendule.
- c) **Temps minimal** : Modifiez les fonctions $g(x, u, t)$ et $h(x, t)$ pour obtenir une solution qui minimise le temps de stabilisation.
- d) **[Optionnel] Exploration libre** : Testez et explorez d'autres variantes de fonction de coût.

Analyse demandée

Pour **chaque tâche** effectuée, analysez et interprétez les trois éléments suivants. Notez les changements par rapport à la situation de référence et tentez d'expliquer leurs causes.

1. La figure du **coût-à-venir (J^*)** : elle représente le coût minimal encouru à partir de n'importe quel état initial.
2. La **loi de commande** générée : la surface montrant le couple appliqué en fonction de l'angle et de la vitesse.
3. La **trajectoire simulée** : le comportement du système partant de la position basse.

Note : Pour plusieurs raisons, l'algorithme peut avoir de la difficulté à converger pour certaines fonctions de coût. Essayez des changements mineurs si c'est le cas. Le but ici n'est pas de vous faire ajuster les paramètres de convergence (un sujet pas encore abordé).

C.2 Programmation dynamique exacte

C.2.1 Navigation optimale dans un graphe

Compétences à développer :

- Programmation dynamique pour un problème avec des états et actions discrètes.
- Algorithmes pour déterminer un chemin le plus court dans un graphe

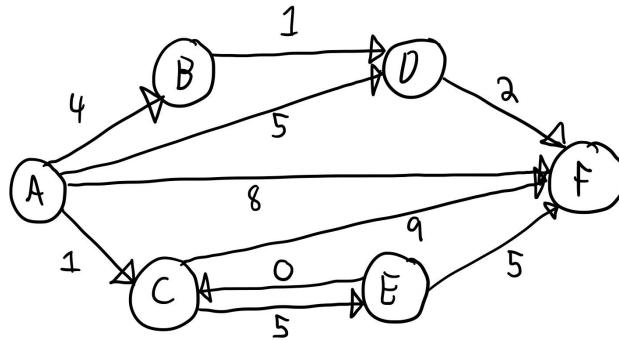


FIGURE C.1 – Graphique qui représente des chemins possibles pour aller vers la position F

Appliquez l'algorithme de programmation dynamique exacte :

$$J_k^*(x_k) = \min_{u_k} \left[g_k(x_k, u_k) + J_{k+1}^* \left(\underbrace{f_k(x_k, u_k)}_{x_{k+1}} \right) \right] \quad (C.2)$$

$$\pi_k^*(x_k) = \operatorname{argmin}_{u_k} \left[g_k(x_k, u_k) + J_{k+1}^* \left(\underbrace{f_k(x_k, u_k)}_{x_{k+1}} \right) \right] \quad (C.3)$$

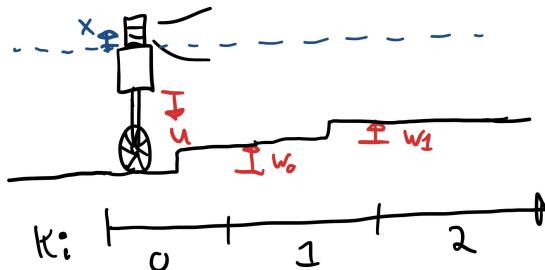
pour résoudre les actions optimales (choix de l'arc à suivre) pour se rendre à l'état cible (Noeud F) à partir de l'état actuel (les Noeuds $x_k \in [A, B, C, D, E]$) et de l'index de temps actuel k . Le coût de chaque option de chemin est représenté par le chiffre indiqué pour chaque arc sur le graphique ci-dessus. Considérez une fonction de coût sur un horizon de 5 pas de temps ($N=5$) et calculez les actions optimales pour les index de temps $k = [0, 1, 2, 3, 4]$. Considérez que le coût final est infini si on ne termine pas sur le Noeud F à $k = 5$. Le tableau suivant peut vous aider pour synthétiser les résultats :

$k =$	0	1	2	3	4	$N = 5$
$J^*(A) =$						
$\pi^*(A) =$						
$J^*(B) =$						
$\pi^*(B) =$						
$J^*(C) =$						
$\pi^*(C) =$						
$J^*(D) =$						
$\pi^*(D) =$						
$J^*(E) =$						
$\pi^*(E) =$						
$J^*(F) =$						

C.2.2 Loi de commande pour une suspension active

Compétences à développer :

- Application de la programmation dynamique pour un problème avec une dynamique linéaire et un coût quadratique
- Programmation dynamique exacte déterministe



Un robot équipé d'une suspension active roule sur un terrain accidenté. À chaque pas de temps sa suspension peut être ajustée d'une hauteur u_k . On désire calculer une loi de commande optimale pour deux pas de temps ($N=2$). L'évolution de la hauteur totale du robot par rapport à une hauteur désiré (x_k) est donnée par :

$$\text{Dynamique : } x_1 = x_0 + u_0 + w_0 \quad (\text{C.4})$$

$$x_2 = x_1 + u_1 + w_1 \quad (\text{C.5})$$

où les variables w_k sont des variations de hauteur du terrain connues d'avance car le robot a effectué un balayage LIDAR du chemin. On cherche ici à minimiser la hauteur finale du robot x_k à $N = 2$, mais aussi la variation de hauteur à chaque instant car ces changements brusques perturbent les instruments. La fonction de coût à optimiser est définie comme :

$$\text{Coûts : } g_0(x_0, u_0, w_0) = (u_0 + w_0)^2 \quad (\text{C.6})$$

$$g_1(x_1, u_1, w_1) = (u_1 + w_1)^2 \quad (\text{C.7})$$

$$g_2(x_2) = x_2^2 \quad (\text{C.8})$$

et on cherche à minimiser la somme de ces coûts additifs :

$$J = \sum_{k=0}^{N-1} g_k(x_k, u_k, w_k) + g_N(x_N) \quad (\text{C.9})$$

Utilisez l'algorithme de programmation dynamique exacte pour calculer les lois de commande optimales comme des fonctions de l'état actuel x_k mais aussi des mesures w_k qui sont des valeurs connues. Le tableau suivant peut vous aider pour synthétiser les résultats :

$k =$	0	1	$N = 2$
$J^*(x_k, w_k) =$			
$\pi^*(x_k, w_k) =$			

C.2.3 Politique optimale pour un thermostat

Compétences à développer :

- Application de la programmation dynamique pour un problème avec une dynamique linéaire et un coût quadratique
- Programmation dynamique exacte déterministe



Capsule vidéo
Politique optimale de chauffage (solution à ce problème (à quelques détails près))
<https://youtu.be/QwXjiAzDENs?si=9A9qe-DvUuZy5juw>

Nous désirons programmer un thermostat pour chauffer une maison. Imaginons une situation simplifiée suivante, vous arrivez à la maison à 17h (étape finale $N = 2$) et on cherche à optimiser la puissance de chauffage u_0 sélectionnée à 15h (étape initial $k = 0$) et u_1 sélectionnée à 16h (étape intermédiaire $k = 1$). L'évolution de la température x (relative à la température extérieure) de la maison est donné par les équations dynamiques suivantes (on utilise un pas de temps d'heure en heure) :

$$\text{Dynamique : } x_1 = ax_0 + u_0 \quad (\text{C.10})$$

$$x_2 = ax_1 + u_1 \quad (\text{C.11})$$

Supposons qu'il y a une tarification dynamique, qu'on veux sauver de l'argent, mais qu'on veut aussi avoir une température confortable à notre arrivée. On peut formuler la fonction de coût suivante :

$$\text{Coûts : } g_0(x_0, u_0) = r_0 u_0^2 \quad (\text{C.12})$$

$$g_1(x_1, u_1) = r_1 u_1^2 \quad (\text{C.13})$$

$$g_2(x_2) = q_2(x_2 - x_d)^2 \quad (\text{C.14})$$

On suppose que le coût de chauffage est proportionnel au carré de la puissance, et il y a possiblement un tarif à 15h et à 16h donnés par r_0 et r_1 . De plus, supposons que la valeur monétaire de notre confort à 17h est caractérisé par la variable q_2 qui multiplie le carré de l'écart de la température avec la température ambiante désirée x_d .

La politique à concevoir consiste en deux fonctions qui choisissent la puissance de chauffage en fonction de la température mesurée :

$$\text{Politiques } u_0 = \pi_0(x_0) \quad (\text{C.15})$$

$$u_1 = \pi_1(x_1) \quad (\text{C.16})$$

On cherche la politique optimale qui minimise le coût cumulatif suivant :

$$J(x_0, x_1, x_2, u_0, u_1) = g_0(x_0, u_0) + g_1(x_1, u_1) + g_2(x_2) \quad (\text{C.17})$$

Calculez le coût-àvenir et la politique optimale à l'étape $k = 0$ et à l'étape $k = 1$. Le tableau suivant peut aider à synthétiser vos résultats :

$k =$	0	1	$N = 2$
$J^*(x) =$			
$\pi^*(x) =$			

Ensuite, analysez les solutions des cas limites suivants :

1. $a = 0$ une maison sans aucune isolation (simplifiez avec $r_0 = r_1 = q_2 = 1$)
2. $a = 1$ une maison parfaitement isolée (simplifiez avec $r_0 = r_1 = q_2 = 1$)

C.2.4 Chemin le plus court dans un graphe

Compétences à développer :

- Programmation dynamique pour un problème avec des états et actions discrètes.
- Algorithmes pour déterminer un chemin le plus court dans un graphe

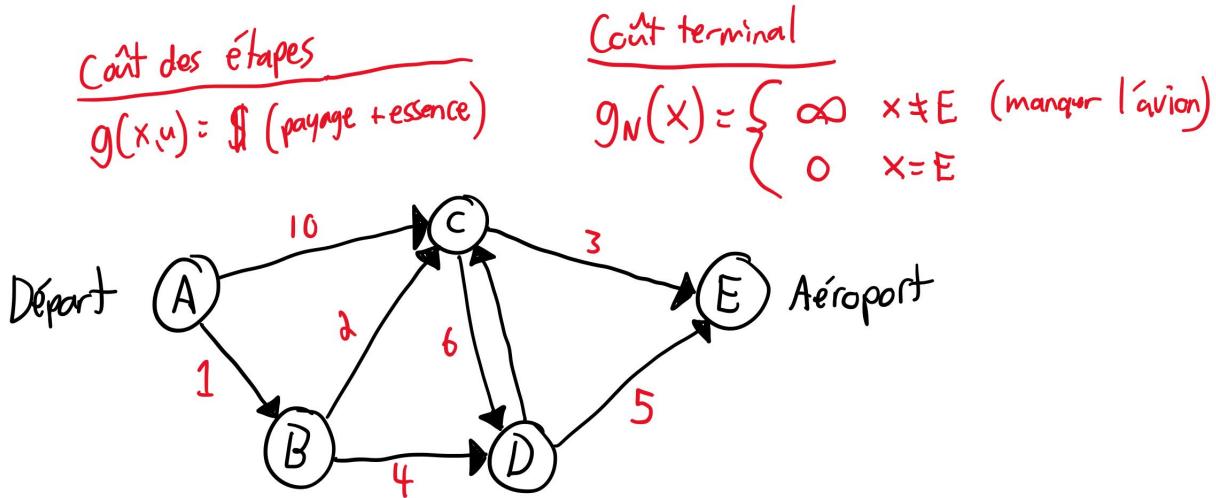


FIGURE C.2 – Problème d’optimisation d’un trajet vers l’aéroport

Appliquez l’algorithme de programmation dynamique exacte :

$$J_k^*(x_k) = \min_{u_k} \left[g_k(x_k, u_k) + J_{k+1}^* \left(\underbrace{f_k(x_k, u_k)}_{x_{k+1}} \right) \right] \quad (C.18)$$

$$\pi_k^*(x_k) = \operatorname{argmin}_{u_k} \left[g_k(x_k, u_k) + J_{k+1}^* \left(\underbrace{f_k(x_k, u_k)}_{x_{k+1}} \right) \right] \quad (C.19)$$

pour résoudre les actions optimales (choix de l’arc à suivre) pour se rendre à l’aéroport (Noeud E) à partir de l’état actuel (les Noeuds $x_k \in [A, B, C, D]$) et de l’index de temps actuel k . Le coût de chaque option de chemin est représenté par le chiffre indiqué pour chaque arc sur le graphique ci-dessus. Considérez une fonction de coût sur un horizon de 5 pas de temps ($N=5$) et calculez les actions optimales pour les index de temps $k = [0, 1, 2, 3, 4]$. Considérez que le coût final est infini si on ne termine pas sur le Noeud E à $k = 5$. Le tableau suivant peut vous aider pour synthétiser les résultats :

$k =$	0	1	2	3	4	$N = 5$
$J^*(A) =$						
$\pi^*(A) =$						
$J^*(B) =$						
$\pi^*(B) =$						
$J^*(C) =$						
$\pi^*(C) =$						
$J^*(D) =$						
$\pi^*(D) =$						
$J^*(E) =$						

C.3 Commande stochastique

C.3.1 Loi de commande pour une suspension active II

Compétences à développer :

- Programmation dynamique exacte stochastique
- Calcul de d'espérance d'une variable aléatoire

Ici on reprend le même problème qu'à l'exercice C.2.2, mais en considérant maintenant que les irrégularités du terrain w_k sont des perturbations inconnues. Supposons que nous avons des informations probabilistes sur les valeurs probables que ces perturbations peuvent prendre. Plus précisément que les perturbations ont 50% de chance de prendre la valeur 1 et 50% de chance d'être égale à zéro :

$$P(w_0 = 1) = 0.5 \quad (\text{C.20})$$

$$P(w_0 = 0) = 0.5 \quad (\text{C.21})$$

$$P(w_1 = 1) = 0.5 \quad (\text{C.22})$$

$$P(w_1 = 0) = 0.5 \quad (\text{C.23})$$

Recalculer les fonctions de commande optimales qui vont ici seulement dépendre de l'état actuel x_k , basé sur la programmation dynamique stochastique. On cherche donc ici à minimiser l'espérance du coûts-à-venir :

$$J = \mathbb{E} \left[\sum_{k=0}^{N-1} g_k(x_k, u_k, w_k) + g_N(x_N) \right] \quad (\text{C.24})$$

avec l'algorithme de programmation dynamique suivant :

$$J_k^*(x_k) = \min_{u_k} \mathbb{E}_{w_k} \left[g_k(x_k, u_k) + J_{k+1}^* \underbrace{(f_k(x_k, u_k))}_{x_{k+1}} \right] \quad (\text{C.25})$$

$$\pi_k^*(x_k) = \operatorname{argmin}_{u_k} \mathbb{E}_{w_k} \left[g_k(x_k, u_k) + J_{k+1}^* \underbrace{(f_k(x_k, u_k))}_{x_{k+1}} \right] \quad (\text{C.26})$$

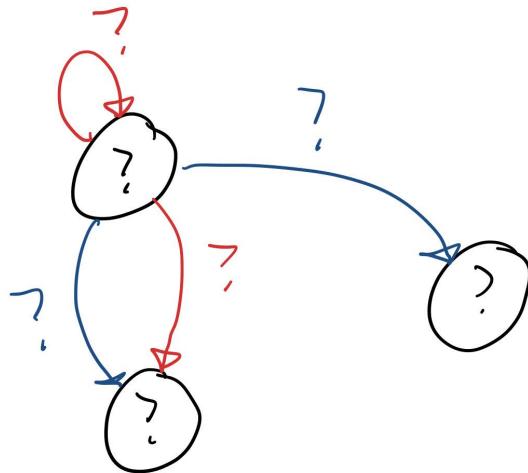
Le tableau suivant peut vous aider pour synthétiser les résultats :

$k =$	0	1	$N = 2$
$J^*(x_k) =$			
$\pi^*(x_k) =$			

C.3.2 Commande stochastique pour une diva à l'opéra

Compétences à développer :

- Modélisation d'un problème de type chaînes de Markov
- Programmation dynamique stochastique



Une diva est en résidence à votre casino pour effectuer des spectacles à tous les soirs. N représentations sont encore prévus à l'horaire. Lorsque la diva est satisfaite de sa performance (ce qui se produit aléatoirement avec une probabilité p_s) elle accepte de chanter le soir suivant. Toutefois lorsqu'elle n'est pas satisfaite, la seule façon de la convaincre de chanter le soir suivant est de lui acheter un cadeau qui coûte x dollar, une stratégie qui fonctionne avec une probabilité de p_c . Lorsque la stratégie du cadeau ne fonctionne pas (et aussi lorsqu'on ne lui offre pas de cadeau) la diva insatisfaite refuse de chanter le soir suivant et reste insatisfaite. Lorsque la diva refuse de chanter le casino perd y dollars par spectacle annulé. On considère qu'on peut offrir un cadeau à la diva pour tenter de la convaincre de chanter à nouveau une fois par jour.

1) Définissez le problèmes sous la structure d'une chaîne de markov :

1. Déterminez les états possibles
2. Déterminez les actions possibles
3. Illustrer le processus graphiquement avec des noeuds (états) et les transitions possibles
4. Déterminez les probabilités de transitions
5. Déterminez les coûts associés aux transitions.

2) Calculer le coût-àvenir et la décision optimale en fonction de l'humeur de la diva pour chaque jour si $p_s = 0.5$, $p_c = 0.5$, $x = 10000$, $y = 15000$ et $N = 4$.

C.3.3 Stratégie optimale aux échecs

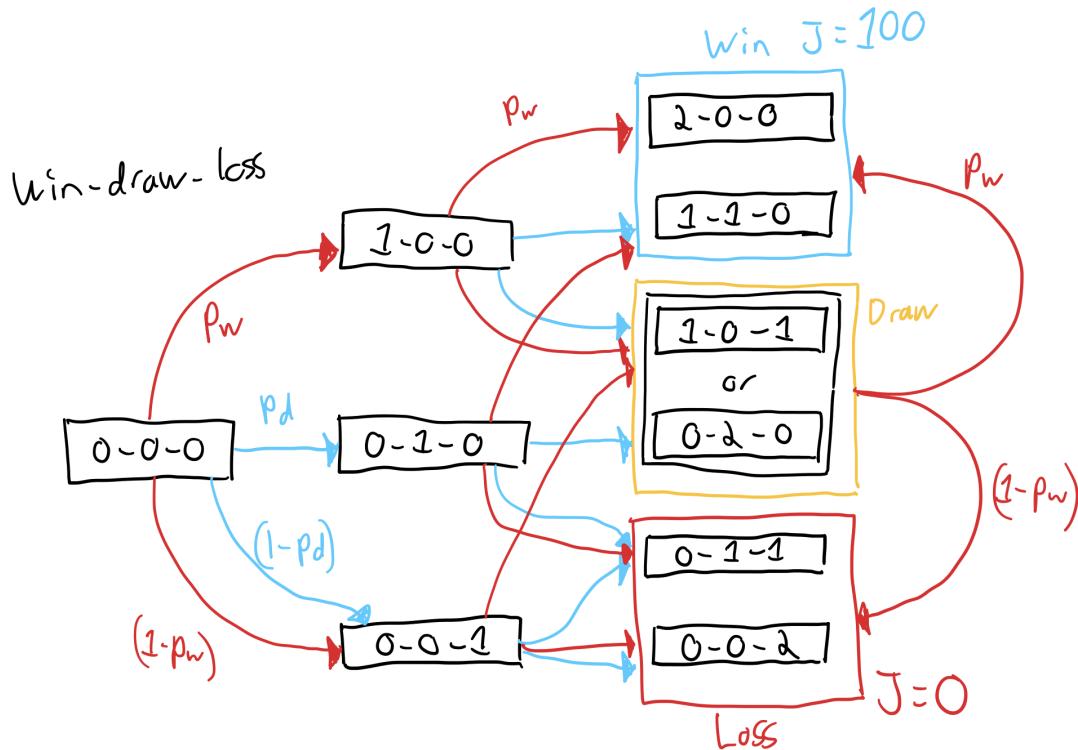
Note : Adapté d'un exemple dans le livre de D. Bertsekas

Vous allez jouer une série de deux parties d'échec, et vous voulez optimiser votre choix de stratégie à chaque partie, pour maximiser vos chances de gagner. Si après deux parties c'est l'égalité, alors on rejoue et le premier joueur qui gagne une partie gagne la série. Supposons que vous connaissez la performance de vos stratégies. Votre stratégie défensive mène à une partie nulle avec une probabilité p_d , à une défaite avec une probabilité $1 - p_d$ et jamais à une victoire. Votre stratégie agressive mène à une victoire avec une probabilité p_w , une défaite avec probabilité $1 - p_w$ et jamais à une partie nulle. Si $p_d = 0.99$ et $p_w = 0.49$, déterminez la probabilité de gagner la série avec les politiques suivantes :

1. Toujours utiliser la stratégie agressive
2. Toujours utiliser la stratégie défensive
3. Utiliser la stratégie agressive d'abord et la stratégie défensive pour la deuxième partie
4. Choisir la stratégie optimale en fonction de l'état

Note : Supposez que la stratégie agressive est toujours utilisée lors d'un bris d'égalité.

Est-ce que c'est possible d'avoir plus de 50% de chances de gagner la série même si individuellement votre probabilité de victoire est inférieur à 50% pour une partie ?

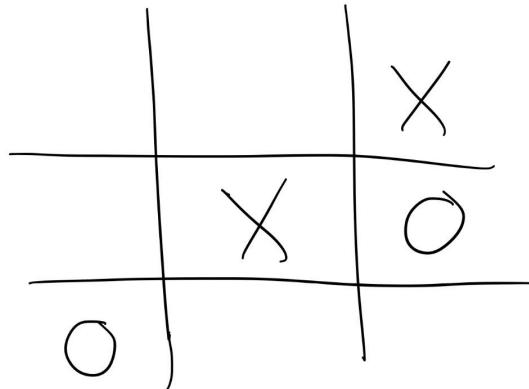


C.4 Commande robuste

C.4.1 Commande minimax pour tic-tac-toe

Compétences à développer :

- Algorithme minimax



Considérez l'état d'une partie de tic-tac-toe ci-dessus où c'est le tour des Xs à jouer. Si on considère une fonction de récompense qui consiste en seulement une valeur terminal de +1 lors d'une victoire des Xs, -1 lorsque d'une victoire des Os et 0 pour une nulle, démontrez en utilisant le principe de la programmation dynamique minimax que la valeur optimale de la récompense à venir pour cet état de jeux est de +1, i.e. la victoire est garantie pour les Xs. Décrivez une stratégie optimale qui garantie la victoire.

Note : Il n'est pas nécessaire d'évaluer toutes les branches de possibilités futures, dès qu'une action mène à un coût $J = +1$ par exemple on peut déterminer que le maximum est nécessairement +1 sans calculer les autres actions.

$$J_k^*(x_k) = \max_X \min_O \left[g_k + J_{k+1} = \begin{cases} +1 & \text{pour une position gagnante pour X} \\ 0 & \text{pour une grille pleine sans vainqueur} \\ -1 & \text{pour une position gagnante pour O} \\ J_{k+1}^*(x_{k+1}) & \text{pour une position non terminale} \end{cases} \right] \quad (\text{C.27})$$

C.5 Solutions analytiques

C.5.1 Solution LQR par programmation dynamique

Compétences à développer :

- Manipulation d'équations matricielles
- Manipulation d'équations impliquant le calcul de l'espérance
- Compréhension de la solution LQR à temps discret

Dans le contexte d'un système dynamique linéaire à états/actions continus représenté par :

$$\underline{x}_{k+1} = f_k(\underline{x}_k, \underline{u}_k, \underline{w}_k) = A_k \underline{x}_k + B_k \underline{u}_k + \underline{w}_k \quad (\text{C.28})$$

où \underline{x}_k et \underline{w}_k sont des vecteurs de dimension n et \underline{u}_k un vecteur de dimension m . Le vecteur \underline{w}_k représente des perturbations aléatoires, indépendantes de l'état actuel, de l'action actuelle et de tous les états passés, et avec des distributions centrées autour de zéro :

$$\mathbb{E}[\underline{w}_k] = 0 \quad (\text{C.29})$$

On cherche donc à minimiser l'espérance du coût-à-venir :

$$J = \mathbb{E} \left[\sum_{k=0}^{N-1} \left(\underbrace{\underline{x}_k^T Q_k \underline{x}_k + \underline{u}_k^T R_k \underline{u}_k}_{g_k(\underline{x}_k, \underline{u}_k, \underline{w}_k)} \right) + \underbrace{\underline{x}_N^T Q_N \underline{x}_N}_{g_N(\underline{x}_N)} \right] \quad (\text{C.30})$$

où les matrices Q_k et R_k sont symétriques et définies positives :

$$Q_k \geq 0 \quad R_k > 0 \quad (\text{C.31})$$

En appliquant l'algorithme de programmation dynamique (pour l'étape $N \rightarrow N - 1$ ou une étape générique $k + 1 \rightarrow k$). Démontrez que : 1) le coût-à-venir d'un état \underline{x}_k a la forme quadratique suivante :

$$J_k^*(\underline{x}_k) = \underline{x}_k^T S_k \underline{x}_k + c_k \quad S_k = S_k^T > 0 \quad \forall k \quad (\text{C.32})$$

où S_k est une matrice symétrique qui caractérise le coût-à-venir à l'état \underline{x}_k et c_k est une constante qui ne dépend pas de l'état actuel.

2) la loi de commande optimale a la forme linéaire suivante :

$$\underline{u}_k^* = c_k^*(\underline{x}_k) = -K_k \underline{x}_k \quad (\text{C.33})$$

où K_k est la matrice de gain égale à

$$K_k = [R_k + B_k^T S_{k+1} B_k]^{-1} B_k^T S_{k+1} A_k \quad (\text{C.34})$$

3) la matrice S_k dans les équations précédentes peut être calculée en partant du coût final à $k = N$ et en remontant dans le temps avec la récursion suivante :

$$S_k = Q_k + A_k^T \left(S_{k+1} - S_{k+1} B_k [R_k + B_k^T S_{k+1} B_k]^{-1} B_k^T S_{k+1} \right) A_k \quad (\text{C.35})$$

Notes sur la dérivation d'un scalaire par un vecteur

Lorqu'on a une fonction scalaire $y = f(\underline{x})$ avec plusieurs entrée regroupée dans un vecteur colonne $\underline{x} \in \mathbb{R}^n$, par convention si on dérive cette fonction par rapport à un vecteur colonne \underline{x} de dimension $n \times 1$, le résultat est un vecteur rangé $1 \times n$;

$$\underline{z} = \frac{\partial y}{\partial \underline{x}} = \left[\begin{array}{ccc} \frac{\partial y}{\partial x_1} & \dots & \frac{\partial y}{\partial x_n} \end{array} \right] \Leftrightarrow z_i = \frac{\partial y}{\partial x_i} \quad (\text{C.36})$$

TABLE C.1 – Identités pour la dérivation d'une fonction scalaire par un vecteur

Fonction scalaire $y = f(\underline{x})$	Expression du gradient $\frac{\partial y}{\partial \underline{x}}$	Notes
$\underline{a}^T \underline{x} = \underline{x}^T \underline{a}$	\underline{a}^T	Si \underline{a} n'est pas une fonction de \underline{x}
$\underline{x}^T \underline{x}$	$2 \underline{x}^T$	
$\underline{x}^T A \underline{x}$	$\underline{x}^T (A + A^T)$	Si A n'est pas une fonction de \underline{x}
$\underline{x}^T A \underline{x}$	$2 \underline{x}^T A$	Si A est symétrique Si A n'est pas une fonction de \underline{x}

C.5.2 LQR en temps continu

Pour le problème de LQR en temps continu présenté à la section 6.2, démontrez que la politique optimale a la forme :

$$\underline{u} = -\frac{1}{2} R^{-1} B^T \left[\frac{\partial J^*}{\partial \underline{x}} \right]^T \quad (\text{C.37})$$

Ensuite, basée sur l'hypothèse que la solution est

$$J^*(\underline{x}, t) = \underline{x}^T S(t) \underline{x} \quad (\text{C.38})$$

1. Calculez

$$\frac{\partial J^*}{\partial \underline{x}} = ? \quad (\text{C.39})$$

2. Calculez

$$\frac{\partial J^*}{\partial t} = ? \quad (\text{C.40})$$

3. Vérifiez que J est bien une solution à l'équation HJB, sous condition que la matrice $S(t)$ soit une solution à l'équation différentielle de Riccati.
4. Vérifiez si la solution change si on considère que l'évolution dynamique est stochastique et caractérisée par un bruit additif normal w , i.e. $\dot{x} = Ax + Bu + w$ avec $w \sim \mathcal{N}(0, \sigma^2)$

Solution à un exercice similaire :



Capsule vidéo
LQR à partir de HJB
https://youtu.be/YhXwjBQnU-M?si=LPLs8WgaxAWy_f61

C.5.3 Implémentation LQR

Basé sur le code source <https://github.com/SherbyRobotics/pyro/blob/master/pyro/control/lqr.py> et l'exemple suivant :



Exercice de code
LQR cart-pole démo
<https://colab.research.google.com/drive/1-qslmY5MRogkf8YL9TRAH1R2xLgfrwNH?usp=sharing>

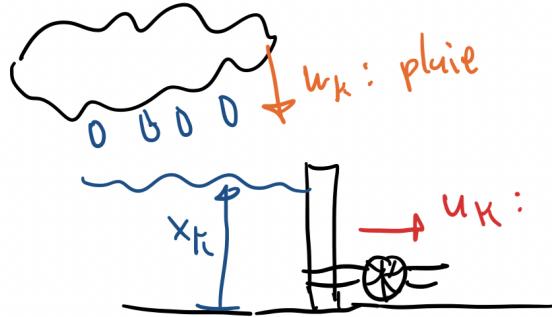
1. Analysez le code source qui implémente les solutions LQR
2. Exécutez le code de l'exemple et analysez le comportement de la politique LQR pour un horizon de temps infini
3. Simulez la trajectoire pour diverses conditions initiales
4. Exécutez le code de l'exemple et analysez le comportement de la politique LQR pour un horizon de temps fini
5. Simulez la trajectoire pour diverses conditions initiales
6. Dans le code source de la version à horizon fini, la vraie équation à intégrer pour la matrice S a été remplacée par une approximation. Quel problème peut survenir lors de cette intégration ?

C.6 Algorithmes de planification

C.6.1 Gestion d'un barrage optimale pour un horizon de temps infini par itération de valeur

Compétences à développer :

- Chaînes de Markov
- Programmation dynamique stochastique
- Optimisation sur un horizon de temps infini
- Algorithme d'itération de valeur



Vous contrôlez les vannes de la turbine d'un barrage qui alimente une usine de production d'aluminium. Lorsque les turbines ne tournent pas à pleine capacité le déficit de production entraîne des pertes de revenus. Toutefois, la pluie se fait rare et il n'est pas possible de toujours faire fonctionner les turbines à pleine capacité, on désire donc optimiser la décision d'ouvrir totalement ou partiellement les vannes en fonction du niveau actuel d'un barrage. Supposons qu'on prend la décision une fois par jour sous la forme d'un volume u_k journalier qui passe dans la turbine et que l'évolution du niveau d'eau x_k dans le barrage est donné par :

$$x_{k+1} = \min [x_k - u_k + w_k, 4] \quad (\text{C.41})$$

où

$$x_k \in \{0, 1, 2, 3, 4\} \quad (\text{C.42})$$

$$u_k \in \{0, 1, 2\} \quad (\text{C.43})$$

$$u_k \leq x_k \quad (\text{C.44})$$

$$w_k = \begin{cases} 0 & P = 0.4 \\ 1 & P = 0.4 \\ 3 & P = 0.2 \end{cases} \quad (\text{C.45})$$

Le barrage a un volume maximal de 4 unités, l'eau excédante est perdue. On peut sélectionner un volume de turbine de 0, 1 ou 2 à conditions d'avoir la quantité d'eau suffisante. L'apport en eau w_k dépendant des précipitations aléatoires avec les probabilités données.

On cherche à minimiser les pertes financières donnés par :

$$g_k = \begin{cases} 0 & \text{si } u_k = 2 & \text{Pleine production} \\ 25 & \text{si } u_k = 1 & \text{Production essentielle seulement} \\ 100 & \text{si } u_k = 0 & \text{Arrêt de la production} \end{cases} \quad (\text{C.46})$$

sur un horizon de temps infini avec un facteur d'escompte (valeur actuelle des pertes futures) $\alpha = 0.9$. Donc de minimiser le coût-à-venir suivant :

$$J = \lim_{N \rightarrow \infty} \mathbb{E} \left[\sum_{k=0}^N \alpha^k g_k \right] \quad (\text{C.47})$$

Déterminer la loi de commande optimale en fonction de cet objectif :

$$\pi^*(x) = \begin{cases} ? & \text{si } x = 1 \\ ? & \text{si } x = 2 \\ ? & \text{si } x = 3 \\ ? & \text{si } x = 4 \end{cases} \quad (\text{C.48})$$

en utilisant l'algorithme d'itération de valeur (Value-iteration).

C.6.2 Algorithme d'itération de valeurs

Basé sur la démonstration de base d'une mise en oeuvre de l'algorithme d'itération de valeur au lien ci-dessous :



Exercice de code

Positionnement d'une masse en temps minimal

https://colab.research.google.com/drive/1KQDGznPu_VtTo6Y3ZTkf1Ahr0av2zpAp?usp=sharing

1. Testez l'effet d'augmenter la valeur EPS qui détermine la zone terminale où on considère que la masse est arrivée sur la cible. Comment la solution optimale est affectée ?
2. Observez l'effet du nombre d'itération sur solution (ligne `dp.compute_steps(250)`). En particulier, analysez la solution lorsqu'on effectue seulement 25 itérations, expliquez ce qu'elle représente.
3. Il existe une solution analytique à ce problème, qu'elle est cette politique ? Validez avec l'équation de Bellman. (Bonus)

C.6.3 Évaluation d'une politique



Exercice de code

Évaluation d'une politique de positionnement

<https://colab.research.google.com/drive/1P2sj0o9T31-6rkTBHsK3ZFaGMntvBDzn?usp=sharing>

Le code ci-dessous est une amorce pour évaluer une politique de positionnement de pendule, avec une fonction de coût qui représente le temps pour atteindre la cible.

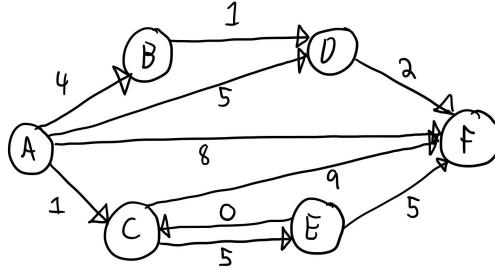
1. Comparez le coût-àvenir de cette politique avec la solution optimale (voir exercice C.6.2)
2. Comparez le coût-àvenir de plusieurs états initiaux, avec le coût d'une trajectoire simulée qui débute sur ces états initiaux.
3. Concevez une politique plus performante et validez numériquement avec l'algorithme.

C.7 Algorithmes d'apprentissage

C.7.1 *Q-learning* pour une navigation optimale

Compétences à développer :

- Comprendre les bases de la méthode d'apprentissage par renforcement *Q-Learning*



Supposons qu'on ne connaît pas le coût des transitions du graphique ci-dessus mais que plusieurs trajectoires ont été effectuée expérimentalement et que le coût de chaque transition a été mesuré :

Épisode	Trajet	Coûts mesurés pour chaque transition
1	A,C,F	1,9
2	A,B,D,F	4,1,2
3	A,D,F	5,2
4	A,C,F	1,9
5	A,C,E,F	1,5,5
6	A,B,D,F	4,1,2
7	A,F	8
8	A,C,E,C,E,F	1,5,0,5,5
9	A,B,D,F	4,1,2
10	A,C,E,C,E,F	1,5,0,5,5

Utilisez ces données expérimentales pour faire des mises à jour des valeurs $Q(x, u)$ pour chaque transition effectuées. Comme le système est déterministe, vous pouvez prendre la version déterministe de l'algorithme de *Q-learning* (i.e. un taux d'apprentissage égal à un) :

$$Q(x, u) \leftarrow g_{\text{mesure}} + \min_{u_{k+1}} [Q(x_{k+1}, u_{k+1})] \quad (\text{C.49})$$

où x est le point de départ, $u = x_{k+1}$ est la destination et g_{mesure} le coût de la transition mesurée. Le tableau suivant peut vous aider pour synthétiser les résultats des itérations :

État(x)	Action (u)	Valeurs Q
A	B	
A	D	
A	F	
A	C	
B	D	
C	F	
C	E	
D	F	
E	C	
E	F	

À partir des valeurs $Q(x, u)$ calculées, calculez le coût-àvenir $J(x)$ et la loi de commande optimale $c(x)$. Comparez avec ce que vous aviez obtenus au devoir 1 lorsque le même problème avait été résolu par programmation dynamique.

C.7.2 Apprentissage d'une fonction $Q(x, u)$ approximée

Compétences à développer :

- Descente du gradient stochastique
- Apprentissage par renforcement avec des approximations de fonctions
- Solution LQR pour un horizon de temps infini

Pour le système avec la dynamique et la fonction de coût instantané suivante :

$$x_{k+1} = 0.5x_k + u_k \quad (\text{C.50})$$

$$g_k = x_k^2 + u_k^2 \quad (\text{C.51})$$

Génération d'une base de données

Générez une base de données avec environ 1000 données (x_k, u_k, g_k, x_{k+1}) avec une ou plusieurs séquences, avec des conditions initiales aléatoires, et avec des actions aléatoires u_k .

Apprentissage d'une fonction Q approximée

L'objectif est "d'apprendre" la fonction de coût-àvenir optimale (donc indirectement la loi de commande optimale) avec seulement les données en utilisant l'approximation polynomiale d'ordre 2 suivante :

$$\hat{Q}(x, u) \approx w_1 x^2 + w_2 u^2 + w_3 x u \quad (\text{C.52})$$

Utilisez les données générées à l'étape précédente et l'équation de mise à jour des paramètres suivante :

$$w_i^{new} = w_i^{old} + \eta \left[g_k + \min_{u_{k+1}} \hat{Q}(x_{k+1}, u_{k+1}) - \hat{Q}(x_k, u_k) \right] \frac{\partial \hat{Q}}{\partial w_i} \quad (\text{C.53})$$

pour estimer les paramètres (i.e. apprendre) w_1 , w_2 et w_3 .

Notes : Si les valeurs initiales pour x et les entrées u sont entre -1 et 1, avec un taux d'apprentissage autour de 1 vous devriez converger avec moins de 1000 itérations environ. L'étape de la minimisation peut se faire analytiquement ici.

Comparaison avec la solution analytique LQR

Le système ci-dessus a une dynamique linéaire et un coût quadratique. Calculez le coût-àvenir optimal pour un horizon de temps infini de façon analytique et comparez à la fonction \hat{Q} obtenue numériquement par itérations.

Notes : La fonction $Q(x, u)$ analytique exacte pour la solution LQR correspond à la somme des termes à l'intérieur de la fonction min, il suffit de substituer la matrice S par la solution de l'équation de Riccati algébrique. Ici toutes les matrices sont 1x1 donc des scalaires.

C.7.3 *Q-Learning* à partir de l'algorithme DP

Basé sur l'opération de programmation dynamique, qui donne la relation entre le coût-àvenir d'une étape J_k et la suivante J_{k+1} :

$$J_k^*(x_k) = \min_{u_k} \mathbb{E}_{w_k} \left[g_k(x_k, u_k, w_k) + J_{k+1}^* \underbrace{(f_k(x_k, u_k, w_k))}_{x_{k+1}} \right] \quad (\text{C.54})$$

1) Décrivez cette même relation en fonction des valeurs Q_k et Q_{k+1} , qui sont définies ainsi :

$$Q_k^*(x_k, u_k) = \mathbb{E}_{w_k} \left[g_k(x_k, u_k, w_k) + Q_{k+1}^* \underbrace{(f_k(x_k, u_k, w_k))}_{x_{k+1}} \right] \quad (\text{C.55})$$

C.7.4 *Q-Learning* avec échantillonnage

Supposons qu'on obtient des échantillons de valeurs Q basé sur des données de trajectoires :

$$q_i(x_k, u_k, x_{k+1}, u_{k+1}) = g_k(x_k, u_k) + \min_{u_k} Q_{k+1}^*(x_{k+1}, u_{k+1}) \quad (\text{C.56})$$

ou q_i est une variable aléatoire et on cherche à évaluer son espérance :

$$Q^* = \mathbb{E}[q_i] = \frac{1}{N} \sum_{i=1}^N q_i \quad (\text{C.57})$$

On peut utiliser l'algorithme de descente du gradient stochastique, qui a la forme générique suivante :

$$\text{Loss function : } \mathcal{L} = \mathbb{E}[(y - \hat{y}(\theta))^2] = \frac{1}{N} \left[\sum_i \underbrace{(y_i - \hat{y}_i(\theta))^2}_{e_i^2} \right] \quad (\text{C.58})$$

$$\text{Learning law : } \theta \leftarrow \theta - \eta \frac{\partial e_i^2}{\partial \theta} \quad (\text{C.59})$$

pour estimer la valeur Q_k^* . Dans le contexte, l'algorithme du gradient stochastique cherche à minimiser la fonction perte suivante :

$$\text{Loss function : } \mathcal{L} = \mathbb{E}[(q_i - \hat{Q})^2] = \frac{1}{N} \sum_i (q_i - \hat{Q})^2 \quad (\text{C.60})$$

Si on suppose que le paramètre estimé est directement la valeur approximée de \hat{Q} :

$$\hat{Q} = \theta \quad (\text{C.61})$$

Déterminez la loi d'apprentissage.

C.7.5 Descente du gradient stochastique

L'exemple de code suivant met en oeuvre un algorithme simple de descente du gradient stochastique :



Exercice de code

Descente du gradient stochastique

https://colab.research.google.com/drive/1t2psC4eMHrm_cuX8Rs0cWq0Xfg4xATq0?usp=sharing

- 1) Analyser le code source pour comprendre l'algorithme.
- 2) Implémentez un taux d'apprentissage variable pour améliorer la performance de l'algorithme.
- 3) Vérifiez si la performance est influencé si on fait varier le nombre d'échantillon et le niveau de bruit.

C.7.6 Approximation d'un coût-à-venir

L'exemple de code suivant illustre diverses méthodes d'approximation de fonction appliquées à approximer un coût-à-venir optimal :



Exercice de code

Approximation d'un coût-à-venir

<https://colab.research.google.com/drive/1PwQXyqWxWhPN3HSQBBXVroTGOGWaRVRO?usp=sharing>

Dans cet exemple, on trouve la solution par programmation dynamique sans approximation et ensuite on utilise le résultat pour approximer la fonction coût-à-venir par apprentissage supervisé.

- 1) Analyser le code source pour comprendre les fonctions d'approximations utilisées.
- 2) Augmenter graduellement la résolution de l'approximation (multiples gaussiennes) pour obtenir une bonne approximation de la fonction coût-à-venir.
- 3) Analyser l'approximation quadratique et le coût-à-venir de la solution LQR ? Vérifiez si l'approximation est meilleure si on analyse le problème pour un plus petit domaine proche de la cible.

C.8 Apprentissage par renforcement appliqué

C.8.1 Hands-on PPO

At the following link, you will find a baseline code with a reinforcement learning algorithm able to learn a swing-up policy for an inverted pendulum. However, the way the objective is defined the solution is basically a bang-bang policy. Try to modify the objective function and the algorithm parameter to learn a swing-up policy that use less energy by swinging back-and-forth.



Exercice de code
PPO for a pendulum swing-up
https://colab.research.google.com/drive/1umk6131i2ts_Ny9icRL-SjFTHq-a5mAJ?usp=sharing

C.8.2 Tutorial pour la librairie *Gymnasium*



Exercice de code
Introduction à l'environnement Gymnasium
<https://drive.google.com/file/d/1xGLNuhxN2PN8hRSeTYpsCzsvdVGZSy3D/view?usp=sharing>

C.8.3 Environnement à partir d'une définition de problème

1) Identifiez un problème sur lequel vous voulez travailler pour votre projet de session, et décrivez-le en quelques lignes de texte.

Note : Si votre projet n'est pas encore défini, essayez de faire un choix préliminaire, ce n'est pas grave si le sujet change par la suite, mais c'est un plus pour prendre de l'avance.

2) Écrivez le pseudo-code d'une classe représentant un environnement *gymnasium*, qui définit le problème. Plus précisément les points importants sont (pour les détails voir https://gymnasium.farama.org/introduction/create_custom_env/) :

Espace observations et actions Quelle est la nature des variables (discrètes vs continues), dimensions, bornes (min/max). Il faut définir l'ensemble des possibles actions et observations. C'est un attribut nécessaire pour la classe gym : <https://gymnasium.farama.org/api/spaces/>.

Fonction step(*u*) Quelle est la nature des états (variables mémoires internes dans la classe), comment les états sont mis à jour, est-ce que l'évolution est stochastique ou déterministe, calcul des observations, calcul de la récompense, est-ce qu'il y a un état terminal ? etc.. Je vous suggère de séparer les étapes dans cette fonction en sous-étapes :

$$x_{next} = f(x, u) \quad (C.62)$$

$$reward = -g(x, u) \quad (C.63)$$

$$observations = h(x_{next}, u) \quad (C.64)$$

$$terminated = t(x_{next}, u) \quad (C.65)$$

Fonction reset Ici vous devez déterminer la distribution de l'état initial. Est-ce que l'état initial est toujours la même valeur dans votre problème, ou bien est-ce qu'il y a plusieurs conditions initiales possibles ?

Exemple Voir au lien suivant un exemple d'environnement gym basé sur les définitions standards pour un système dynamique : <https://github.com/SherbyRobotics/pyro/blob/master/pyro/tools/sys2gym.py>

Bibliographie

- [Bertsekas, 2017] Bertsekas, D. P. (2017). *Dynamic Programming and Optimal Control*. Athena Scientific, Nashua, NH, 4th edition edition.
- [Silver, 2015] Silver, D. (2015). RL Course.
- [Sutton and Barto, 2018] Sutton, R. S. and Barto, A. G. (2018). *Reinforcement Learning, second edition : An Introduction*. Bradford Books, Cambridge, Massachusetts, 2nd edition edition.
- [Tedrake, 2023] Tedrake, R. (2023). *Underactuated Robotics : Algorithms for Walking, Running, Swimming, Flying, and Manipulation*. Course Notes for MIT 6.832.