#### МОНГОЛ УЛСЫН ИХ СУРГУУЛЬ ХЭРЭГЛЭЭНИЙ ШИНЖЛЭХ УХААН, ИНЖЕНЕРЧЛЭЛИЙН СУРГУУЛЬ МЭДЭЭЛЭЛ, КОМПЬЮТЕРИЙН УХААНЫ ТЭНХИМ

Батбаярын Бямбаням

# DDPG бататгасан сургалтын үйлдлийн шуугианыг турших, харьцуулах

(Effect of action space noise for DDPG RL algorithm)

Мэдээллийн технологи (D061304) Бакалаврын судалгааны ажил

Улаанбаатар

2021 оны 02 сар

#### МОНГОЛ УЛСЫН ИХ СУРГУУЛЬ ХЭРЭГЛЭЭНИЙ ШИНЖЛЭХ УХААН, ИНЖЕНЕРЧЛЭЛИЙН СУРГУУЛЬ МЭДЭЭЛЭЛ, КОМПЬЮТЕРИЙН УХААНЫ ТЭНХИМ

# DDPG бататгасан сургалтын үйлдлийн шуугианыг турших, харьцуулах

(Effect of action space noise for DDPG RL algorithm)

Мэдээллийн технологи (D061304) Бакалаврын судалгааны ажил

Удирдагч:	Г.Гантулга
Хамтран удирдагч:	
Гуйцэтгэсэн:	Б.Бямбаням (17B1NUM1479

Улаанбаатар

2021 оны 02 сар

### Зохиогчийн баталгаа

Миний бие Батбаярын Бямбаням "DDPG бататгасан сургалтын үйлдлийн шуугианыг турших, харьцуулах " сэдэвтэй судалгааны ажлыг гүйцэтгэсэн болохыг зарлаж дараах зүйлсийг баталж байна:

- Ажил нь бүхэлдээ эсвэл ихэнхдээ Монгол Улсын Их Сургуулийн зэрэг горилохоор дэвшүүлсэн болно.
- Энэ ажлын аль нэг хэсгийг эсвэл бүхлээр нь ямар нэг их, дээд сургуулийн зэрэг горилохоор оруулж байгаагүй.
- Бусдын хийсэн ажлаас хуулбарлаагүй, ашигласан бол ишлэл, зүүлт хийсэн.
- Ажлыг би өөрөө (хамтарч) хийсэн ба миний хийсэн ажил, үзүүлсэн дэмжлэгийг дипломын ажилд тодорхой тусгасан.
- Ажилд тусалсан бүх эх сурвалжид талархаж байна.

Гарын үсэг:	
Огноо:	

#### ГАРЧИГ

УДИРТГАЈ	I	1
0.1	Зорилго	1
0.2	Зорилтууд	1
1. СУД	[АЛГАА	2
1.1	DDPG алгоритм	2
1.2	Ашигласан технологи	7
2. ХЭН	ЭГЖҮҮЛЭЛТ ТЛЕПҮҮЖҮЕ	9
3. YP ,	<b>ДҮНГИЙН БОЛОВСРУУЛАЛТ</b>	13
3.1	Туршилтын үр дүн	13
3.2	Үр дүнгийн харьцуулалт	16
ДҮГНЭЛТ		17
НОМ ЗҮЙ		17
ХАВСРАЛ	Γ	18
A. A		19
В. КОД	ДЫН ХЭРЭГЖҮҮЖЛЭЛТ	20

### ЗУРГИЙН ЖАГСААЛТ

1.1	Бататгасан сургалтын бүтэц	2
2.1	BiPedalWalker-V3 орчин	9
3.1	Correlated noise	13
3.2	Uncorrelated noise	14
3.3	Uncorrelated noise 2	15
3.4	Uncorrelated noise 0.4	16

### ХҮСНЭГТИЙН ЖАГСААЛТ

## Кодын жагсаалт

2.1	Орчин үүсгэх
2.2	Actor critic сүлжээ үүсгэх
	Replay buffer үүсгэх
	Шуугиан үүсгэх
	Үйлдэл дээр шуугиан нэмэх
	Үйлдэл хийх
2.7	Critic сүлжээг сургах шинэчлэх
	Actor сүлжээг сургах

#### **УДИРТГАЛ**

Reinforcement learning буюу бататгасан сургалтад тасралттай үйлдлийн хувьд суралцах үйл явц нь санамсаргүй үйлдлийг сонгох замаар явагддаг. Харин үргэлжилсэн үйлдлийн хувьд суралцах үйл явц нь үйлдэлд шуугианыг нэмэх замаар явагддаг. Deep Deterministic Policy Gradient (DDPG) бол тасралтгүй, үргэлжилсэн үйлдлүүдийг сурахад зориулагдсан алгоритм тул action space noise буюу үйлдлийн шуугиан ашиглагдана. Энэ судалгааны ажлаар энэхүү үйлдлийн шуугианыг туршин, харьцуулах бөгөөд ямар үр нөлөөтэй болохыг тодорхойлоно.

#### 0.1 Зорилго

DDPG бататгасан сургалтын үйлдлийн шуугианыг туршин, харьцуулж энэ шуугиан моделийг сургах үйл явцад хэрхэн нөлөөлж буйг харах, дүгнэлт гаргах

#### 0.2 Зорилтууд

•

•

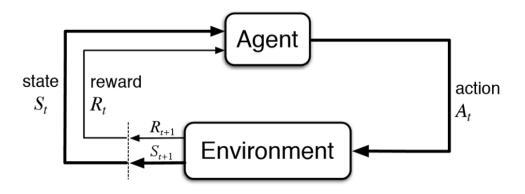
### 1. СУДАЛГАА

#### 1.1 DDPG алгоритм

Алгоритмыг тайлбарлахаас өмнө Reinforcement Learning буюу бататгасан сургалтын талаар бага зэрэг тайлбарлая. Цаашдаа RL гэж товчилон бичинэ.

#### 1.1.1 Бататгасан сургалтын алгоритм

RL нь агент болон орчин гэсэн хоёр хэсгээс тогтдог. Орчин гэдэг нь агент ажиллаж байгаа объектыг, агент гэдэг нь RL алгоритмыг илэрхийлнэ.



Зураг 1.1: Бататгасан сургалтын бүтэц

Орчин нь агент руу төлөвийг илгээх байдлаар эхлэдэг бөгөөд агент нь мэдлэг дээрээ тулгуурлан тухайн нөхцөл байдалд хариу үйлдэл үзүүлэнэ. Үүний дараа орчин агент руу дараагийн төлөв болон reward-ыг илгээнэ. Агент нь орчиноос хүлээн авсан reward-аар мэдлэгээ шинэчлэнэ. Энэ давталт нь орчиноос дуусгах төлөв илгээх хүртэл үргэлжилнэ. Ихэнх RL алгоритмууд дээрх байдлаар ажилладаг.

#### 1.1.2 Бататгасан сургалттай холбоотай нэр томъёо

- Action (A): Агентийн хийх боломжтой бүр алхамууд
- State (S): Орчиноос буцаж ирэх тухайн нөхцөл байдал
- Reward (R): өмнөх үйлдлийн үр дүнд гарсан ололт
- Policy  $(\pi)$ : Агент одоогийн төлөв байдалд үндэслэн дараагийн үйлдлийг тодорхойлоход ашигладаг стратеги.
- Value (V): урт хугацааны ололт
- Q-value эсвэл action-value(Q): Value-тай төстэй. Гэхдээ одоогийн үйлдэлийг нэмэлт параметрээр авдаг.

#### Model-free болон Model-based

Model нь орчны динамик загварчлалыг илэрхийлдэг. Загвар нь шилжилтийн магадлалыг T(s1 | (s0, a)) одоогийн төлөв s0 ба үйлдэл а хоёроос сурч, дараагийн s1 төлөвт шилждэг.

Model-free гэдэг нь мэдлэгээ шинэчлэхийн тулд туршилт ба алдаанд тулгуурладаг. Төлөвүүд болон үйлдлүүдийг хадгалах шаардлагагүй.

#### On-policy болон off-policy

On-policy агент нь value-г одоогийн policy-г ашигласан одоогийн үйлдэлд тулгуурлан сурдаг. Харин off-policy агент өөр нэг policy-г ашигласан үйлдэл а\*-д тулгуурлан сурдаг.

#### 1.1.3 DDPG алгоритм

Deep Deterministic Policy Gradient (DDPG) бол үргэлжилсэн, тасралтгүй үйлдлүүдийг сурахад зориулагдсан model-free off-policy алгоритм юм. Q-функц ба policy-ыг зэрэг сурдаг алгоритм

юм. Q-функцыг сурахын тулд off-policy өгөгдөл болон Bellman тэгшитгэлийг ашигладаг. Мөн policy-г сурахын тулд Q-функцыг ашигладаг.

DDPG алгоритм дараах 4 неороны сүлжээг ашигладаг:

- $\theta^Q$ :Q-network
- $\theta^{\mu}$ :Deterministic policy function
- $\theta^{Q'}$ :target Q network
- $\theta^{\mu'}$ :target policy network

Q-network болон policy network хоёр нь Actor-critic аргатай маш төстөй.

- Actor (Deterministic policy function) төлөвөөс хамааран үйлдлийг санал болгоно. Төлөвийг оролтоор авч үйлдлийг гаргана.
- Critic (Q-network) төлөвөөс хамаарсан үйлдэл нь сайн эсвэл муу болохын урьдчилан таамагладаг. Төлөв болон үйлдлийг оролтоор авч Q-value-г гаргадаг.

Target network нь суралцсан сүлжээнүүдийг хянаж байдаг эх сүлжээнүүдийнхээ цагийн хоцрогдолтой хуулбарууд юм. Эдгээр сүлжээг ашиглан тогтвортой сурах байдлыг сайжруулдаг.

Доорх зурагт DPDG алгоритмын pseudo-code-ыг харууллаа. Үүнийг 4 хэсэгт задлан тайлбарлаж болно.

- Туршлагаа хадгалах (Experience replay)
- Actor болон critic сүлжээг шинэчлэх
- Target сүлжээг шинэчлэх
- Судалгаа, шинжилгээ хийх (Exploration)

#### DDPG алгоритмын pseudo code

 $\theta^Q$  болон  $\theta^\mu$  жинтэйгээр critic сүлжээ  $Q(s_i,a_i|\theta^Q)$  болон actor сүлжээ  $\mu(s|\theta^mu)$  -г үүсгэнэ  $\theta^{Q'}\longleftarrow\theta^Q,\,\theta^{\mu'}\longleftarrow\theta^\mu$  жинтэйгээр target сүлжээ Q' болон  $\mu'$ -г үүсгэнэ

Replay buffer-аа үүсгэнэ

for episode = 1, M do

Анхны төлөв болох s1-г авна

for t = 1, T do

Тухайн policy болон шуугиан дээрээ үндэслэн үйлдэлээ сонгоно  $a_t = \mu(s_t|\theta^\mu) + N_t$ 

Үйлдэл  $a_t$ -гээ гүйцэтгээд reward  $r_t$  болон шинэ төлөв  $s_t+1$ -ээ авна

Replay buffer-даа төлөв, үйлдэл, reward, шинэ төлөвөө  $(s_t, a_t, r_t, s_t + 1)$  хадгалж авна

Replay buffer-аасаа N тооны санамсаргүй утгыг авна

$$y_i = r_i + \gamma Q^{'}(s_i + 1, \mu^{'}(s_i + 1|\theta^{\mu^{'}})|\theta^{Q^{'}})$$
 утгыг онооно

Loss-ыш багасгаж critic сүлжээг шинэчлэнэ:  $L = \frac{1}{N} \sum_i (y_i - Q(s_i, a_i | \theta^Q))^2$ 

Actor policy-г шинэчлэнэ:

$$\nabla_{\theta} \mu J(\theta) \approx \frac{1}{N} \sum_{i} [\nabla_{a} Q(s, a | \theta^{Q})|_{s} = s_{i}, a = \mu(s_{i}) \nabla_{\theta} \mu \mu(s | \theta^{\mu})|_{s} = s_{i}]$$

Target сүлжээнүүдийг шинэчлэнэ:

$$\theta^{Q'} \longleftarrow \tau \theta^Q + (1 - \tau)\theta^{Q'}$$

$$\theta^{\mu'} \longleftarrow \tau \theta^{\mu} + (1 - \tau) \theta^{\mu'}$$

end for

end for

#### Replay buffer

DDPG алгоритм нь replay buffer-ыг туршлагыг цуглуулахад ашигладаг. Цуглуулсан туршлагаа неороны сүлжээний параметрүүдийг шинэчлэхэд ашигладаг. Value болон policy сүлжээг шинэчлэхдээ

replay buffer дахь туршлагуудаас санамсаргүй байдлаар цуглуулан ашигладаг.

Яагаад replay buffer-ыг ашиглаж байгаа вэ гэхээр алгоритд хамааралгүй байдлаар тархсан өгөгдөл хэрэгтэй. Ийм өгөгдлүүдийг replay buffer дахь туршлагуудаас санамсаргүй байдлаар сонгон авах байдлаар цуглуулж болно.

#### Actor (Policy) болон Critic (Value) сүлжээг шинэчлэх

Value сүлжээг шинэчлэх үйл явц нь Q-learning-тэй төстэй байдлаар хийгддэг. Шинэчлэгдсэн Q value-г Bellman-ны тэгшитгэлээс гарган авна:

$$y_i = r_i + \gamma Q'(s_i + 1, \mu'(s_i + 1|\theta^{\mu'})|\theta^{Q'})$$

DDPG-д дараагийн төлөв Q утгуудыг target value network, target policy network ашиглан тооцдог. Дараа нь шинэчлэгдсэн Q утга ба анхны Q утга хоорондын дундаж квадрат алдааг хамгийн бага хэмжээнд хүртэл бууруулна:

$$Loss = \frac{1}{N} \sum_{i} (y_i - Q(s_i, a_i | \theta^Q))^2$$

Анхны Q value нь target network-оос биш value network-оос бодогдон гарна.

Policy функцын хувьд гол зорилго нь буцан ирэх үр дүн хамгийн дээд хэмжээнд байх юм:

$$J(\theta) = E[Q(s, a)|_s = s_t, a_t = \mu(s_t)]$$

Policy алдагдлыг тооцоолохын тулд зорилгын функцын деривативыг авна. Actor(policy) функц нь ялгагдах боломжтой тул гинжин дүрмийг хэрэгжүүлэх ёстой:

$$\nabla_{\theta} \mu J(\theta) \approx \nabla_{a} Q(s, a) \nabla_{\theta} \mu \mu(s | \theta^{\mu})$$

Policy-гоо off-policy байдлаар шинэчлэж байгаа учир санамсаргүй байдлаар авсан туршлагуудынхаа градиентүүдийн нийлбэрийн дундаж утгыг авна:

$$\nabla_{\theta} \mu J(\theta) \approx \frac{1}{N} \sum_{i} [\nabla_{a} Q(s, a | \theta^{Q})|_{s} = s_{i}, a = \mu(s_{i}) \nabla_{\theta} \mu \mu(s | \theta^{\mu})|_{s} = s_{i}]$$

#### Target сүлжээг шинэчлэх

Target сүлжээний параметрүүдийг хуулбарлаад, тэдгээрээр дамжуулан сурсан сүлжээнүүдээ хянана:

$$\theta^{Q'} \longleftarrow \tau \theta^Q + (1 - \tau)\theta^{Q'}$$

$$\theta^{\mu'} \longleftarrow \tau \theta^{\mu} + (1 - \tau) \theta^{\mu'}$$

au бол ихэвчлэн 1-тэй ойролцоо байхаар сонгосон параметр юм (жишээлбэл: 0.999).

#### Судалгаа шинжилгээ

Reinforcement learning буюу бататгасан сургалтад тасралттай үйлдлийн хувьд суралцах үйл явц нь санамсаргүй үйлдлийг сонгох замаар явагддаг. Харин үргэлжилсэн үйлдлийн хувьд суралцах үйл явц нь үйлдэлд шуугианыг нэмэх замаар явагддаг. DDPG алгоритмын баримт бичиг зохиогчид үйлдлийн үр дүнд дуу чимээ нэмэхийн тулд N:Ornstein-Uhlenbeck Process-г ашигласан байна:

$$\mu'(s_t) = \mu(s_t | \theta_t^{\mu}) + N$$

Ornstein-Uhlenbeck процесс нь өмнөх дуу чимээтэй уялдаатай холбоотой шуугианыг бий болгодог.

#### 1.2 Ашигласан технологи

Gym, pytorch etc

#### 1.2.1 Gvm

Gym бол reinforcement learning буюу бататгасан сургалтын алгоритмуудыг хөгжүүлэх болон харьцуулахад зориулагдсан хэрэгсэл юм. Үүнийг ашиглан агентдаа алхах, тоглоом тоглох зэрэг бүх зүйлийг зааж болно.

#### Яагаад үүнийг ашигладаг вэ?

Бататгасан сургалт (RL) нь шийдвэр гаргахтай холбоотой машин сургалтын дэд талбар юм. Энэ нь агент нарийн төвөгтэй, тодорхойгүй орчинд хэрхэн зорилгодоо хүрч болохыг судалдаг. RL нь доорх 2 шалтгааны улмаас ихээр ашиглагдаж байна:

- RL нь дараалсан шийдвэр гаргахтай холбоотой бүхий л асуудлыг багтаасан байдаг. Жишээ нь роботын хөдөлгүүрийг удирдаж, түүнийг үсрэх чадвартай болгох, үнэ, бараа материалын менежмент гэх мэт бизнесийн шийдвэр гаргах, видео тоглоом, ширээний тоглоом тоглох гэх мэт
- RL алгоритмууд олон хүнд хэцүү орчинд сайн үр дүнд хүрч эхэлсэн

Гэсэн хэдий ч RL судалгааны ажлыг RL-ын open-source орчин хангалттай олон янз байдаггүй бөгөөд тэдгээрийг тохируулах, ашиглахад хэцүү байдал болон орчны стандартчилал дутмаг гэсэн хоёр хүчин зүйл удаашруулж байна. Gym нь эдгээр 2 асуудлыг шийдэхийг зоридог.

#### 1.2.2 Pytorch

Pytorch бол Torch сан дээр тулгуурласан open-source машин сургалтын сан юм. Python хэлэнд ихээр ашиглагддаг ч мөн C++ програмчлалын хэлд ашиглагддаг. Энэ нь GPU ашигладаг. РуТогсh нь өндөр түвшний хоёр онцлог шинж чанарыг агуулдаг:

- GPU-г ашиглан тенсорын тооцоолол хийх (NumPy гэх мэт)
- Гүнзгий неороны сүлжээг (Deep neural network) бий болгох

2016 оны 1 сард гарсан бөгөөд үүнээс хойш олон судлаачид үүнийг ашигласаар байна. Учир нь маш нарийн төвөгтэй неороны сүлжээг хялбараар бий болгодог. Мөн кодоо шалгахдаа заавал бүхлээр нь ажиллуулах шаардлагагүй болсон. Шаардлагатай тохиолдолд Pytorch-ын функцуудыг NumPy, SciPy, Cython зэргээр өргөтгөж болно.

### 2. ХЭРЭГЖҮҮЛЭЛТ

Хэрэгжүүлэлтийг python програмчлалын хэлийг ашиглан гүйцэтгэсэн. Орчинг бэлдэхдээ gym openai хэрэгсэлийг ашигласан. Pytorch санг тооцоолол хийх, неороны сүлжээ үүсгэх зэрэгт ашигласан. Дээр дурдсан DDPG алгоритмын pseudo кодын дагуу кодыг бичсэн. Чухал кодын хэсгийг доор орууллаа. Бүтэн кодыг хавсралт хэсэгт оруулсан.

BipedalWalker-v3 орчин дээр алгоритыг ажиллуулан турших болно.



Зураг 2.1: BiPedalWalker-V3 орчин

Орчинг үүсгэж төлөвийн хэмжээс, үйлдлийн хэмжээс, хийж болох үйлдлийн тоог авна.

```
env = gym.make('BipedalWalker-v3')

state_dimension = env.observation_space.shape[0]

action_dimension = env.action_space.shape[0]
```

```
action_max = env.action_space.high[0]
```

Код 2.1: Орчин үүсгэх

Actor, target actor, critic болон target critic сүлжээг optimizer (сургагч)-ын хамт үүсгэх. Үүсгэхдээ төлөвийн хэмжээс, үйлдлийн хэмжээс, хийж болох үйлдлийн тоо зэргийг ашиглана.

Код 2.2: Actor critic сүлжээ үүсгэх

Replay buffer үүсгэх

```
ram = memory.ReplayBuffer(1000000))
```

Код 2.3: Replay buffer үүсгэх

Action noise-г үүсгэхдээ Ornstein-Uhlenbeck Process-г ашигласан

```
noise = utilities.OrnsteinUhlenbeckActionNoise(action_dimension)
```

Код 2.4: Шуугиан үүсгэх

#### Үйлдэл дээр шуугианыг нэмэх

```
action_with_noise = action_without_noise.data.numpy() + (noise.sample() * action_max)
```

Код 2.5: Үйлдэл дээр шуугиан нэмэх

#### Үйлдлийг хийж шинэ төлөв, reward-г авах

```
new_observation, reward, done, info = env.step(action_with_noise)
```

#### Код 2.6: Үйлдэл хийх

#### Critic сүлжээг сургаад, шинэчлэх

#### Код 2.7: Critic сүлжээг сургах шинэчлэх

#### Actor сүлжээг сургах

```
predicted_action = actor.forward(states)

actor_loss = -1*torch.sum(critic.forward(states, predicted_action))

actor_optimizer.zero_grad()

actor_loss.backward()

actor_optimizer.step()
```

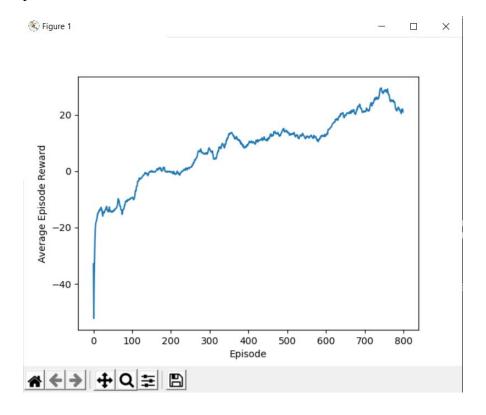
Код 2.8: Астог сүлжээг сургах

## 3. ҮР ДҮНГИЙН БОЛОВСРУУЛАЛТ

#### 3.1 Туршилтын үр дүн

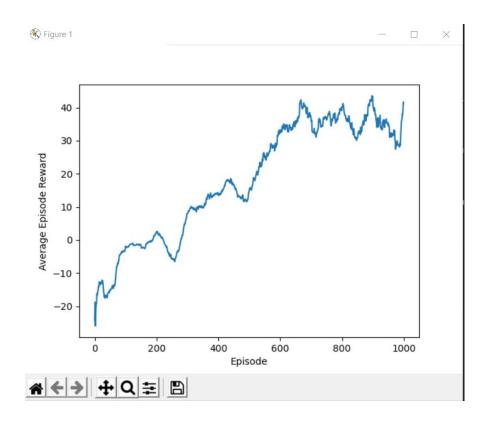
Хэрэв алгоритм зөв ажиллаж байгаа бол reward нь өсөж байх ёстой байдаг. Дундаж reward-ыг авахдаа episode болгоны reward-г олоод үүнийгээ list-д хадгалан аваад энэ list-ээс сүүлийн 40 үр дүнгийн дундажыг олж графикыг зурсан.

Доорх графикын хувьд 800 episode ажилласан бөгөөд босоо тэнхлэгийн дагуу дундаж reward, хэвтээ тэнхлэгийн дагуу episode-г авч байна. Орчны шуугианыг нэмэхдээ Ornstein-Uhlenbeck Process-г ашигласан. Энэ процесс нь бие биенээсээ хамааралтай буюу correlated шуугианыг гаргаж өгнө.



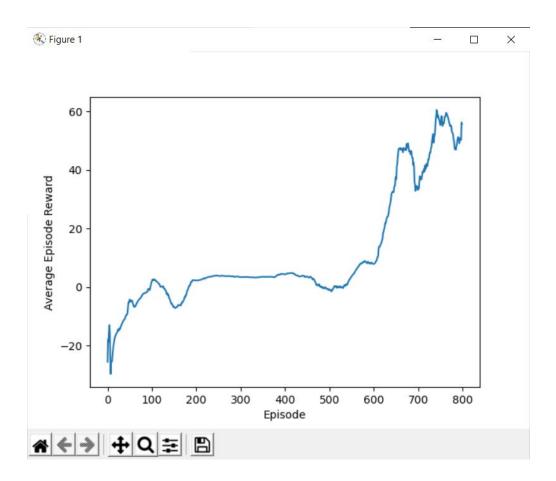
Зураг 3.1: Correlated noise

1000 episode ажиллуулсны дараа:

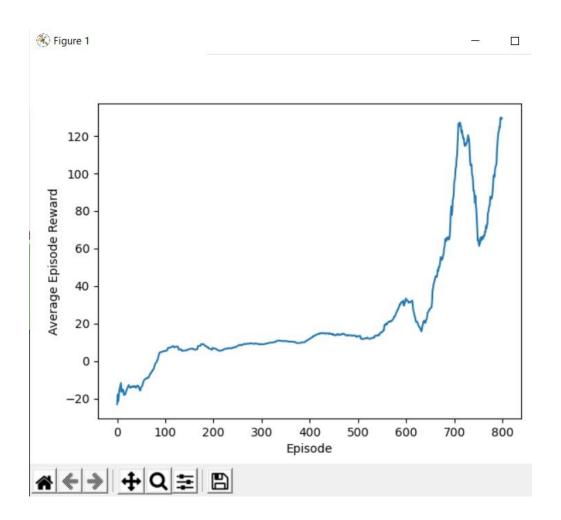


Зураг 3.2: Correlated noise

Доорх хоёр графикын хувьд 800 episode ажилласан бөгөөд орчны шуугианыг -0.2 оос 0.2-ын хооронд санамсаргүй байдлаар сонгон авч үйлдэл дээрээ нэмж байгаа. Энэ нь бие биенээсээ хамааралгүй буюу uncorrelated шуугиан гэсэн үг юм.

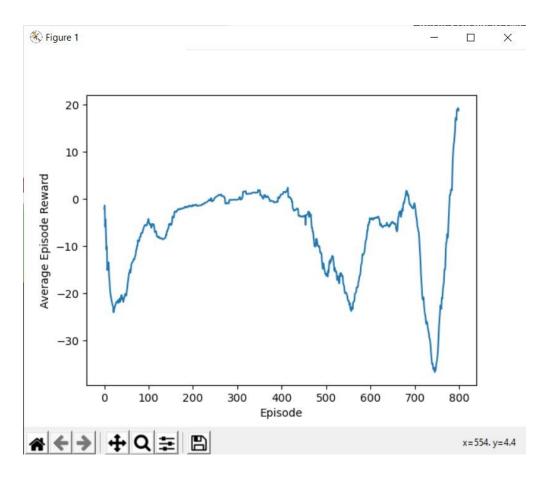


Зураг 3.3: Uncorrelated noise



Зураг 3.4: Uncorrelated noise 2

Доорх графикын хувьд 800 episode ажилласан бөгөөд орчны шуугианыг -0.4 оос 0.4-ын хооронд санамсаргүй байдлаар сонгон авч үйлдэл дээрээ нэмж байгаа. Энэ нь мөн адил бие биенээсээ хамааралгүй буюу uncorrelated шуугиан юм. Графикаас харахад 0.4 өөр сонгон авсан үед нь үр дүн муу гарч байна.



Зураг 3.5: Uncorrelated noise 0.4

### 3.2 Үр дүнгийн харьцуулалт

# Дүгнэлт

Дүгнэлтийг энд бич

### **Bibliography**

- [1] Deep Deterministic Policy Gradients Explained, TowardsDataScience, https://towardsdatascience.com/deep-deterministic-policy-gradients-explained-2d94655a9b7b
- [2] Deep Deterministic Policy Gradient (DDPG), Keras, https://keras.io/examples/rl/ddpg\_pendulum/
- [3] Deep Deterministic Policy Gradient, Spinning Up, https://spinningup.openai.com/en/latest/algorithms/ddpg.html
- [4] Continuous Control With Deep Reinforcement Learning, Lillicrap et al 2015, https://arxiv.org/pdf/1509.02971.pdf
- [5] Tables, Share LaTex, https://www.sharelatex.com/learn/Tables

### **A. A**

Хавсралтын агуулга

# В. КОДЫН ХЭРЭГЖҮҮЛЭЛТ