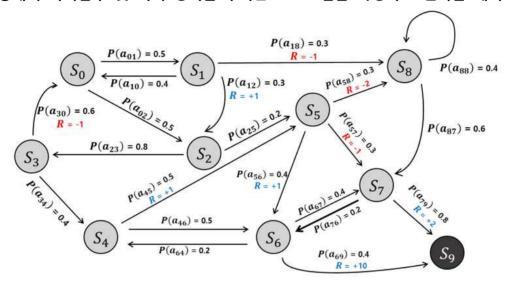
# REPORT

" 다이나믹 프로그래밍 - 정책 이터레이션 "



과 목 명	지능 시스템
담당교수	조영완 교수님
학 과	컴퓨터공학과
학 번	2016305078
이 름	최영환
제 출 일	2021.03.24

● 다음의 State diagram으로 나타난 MDP에 대해 정책 이터레이션을 이용하여 각 상태의 가치함수 및 최적 정책을 구하는 프로그램을 작성하고 결과를 제시하시오.



● 아래의 알고리즘을 참고하여 프로그램을 작성하였음.

## Policy iteration (using iterative policy evaluation)

1. Initialization

 $V(s) \in \mathbb{R}$  and  $\pi(s) \in \mathcal{A}(s)$  arbitrarily for all  $s \in \mathcal{S}$ 

2. Policy Evaluation

Repeat

$$\Delta \leftarrow 0$$

For each  $s \in S$ :

$$v \leftarrow V(s)$$

$$V(s) \leftarrow \sum_{s',r} p(s',r|s,\pi(s))[r + \gamma V(s')]$$

$$\Delta \leftarrow \max(\Delta, |v - V(s)|)$$

until  $\Delta < \theta$  (a small positive number)

3. Policy Improvement

$$policy$$
-stable  $\leftarrow true$ 

For each  $s \in \mathcal{S}$ :

$$old\text{-}action \leftarrow \pi(s)$$

$$\pi(s) \leftarrow \operatorname{arg\,max}_a \sum_{s',r} p(s',r|s,a) [r + \gamma V(s')]$$

If old-action  $\neq \pi(s)$ , then policy-stable  $\leftarrow$  false

If policy-stable, then stop and return  $V \approx v_*$  and  $\pi \approx \pi_*$ ; else go to 2

## 1. 초기화 단계

## 1. Initialization

# $V(s) \in \mathbb{R}$ and $\pi(s) \in \mathcal{A}(s)$ arbitrarily for all $s \in \mathcal{S}$

가치함수 V(s): 실수 집합 R에 포함

정책  $\pi(s)$  : 각각의 행동 집합 A(s)에 포함

상태집합 S 의 모든 상태 s 에 대하여 임의로 V(s) 와  $\pi(s)$ 를 초기화함

- ▶ 상태 집합 S는 MDP에 제시된 숫자를 사용하여 초기화하였음.
- ▶ 가치함수 집합 V는 0으로 초기화하였음.
- ightharpoonup 정책 집합 a는 각 상태에서 설정할 수 있는 첫 번째 행동을 0과 1을 통해 표현하였음. 예를 들어  $S_0$  에서  $S_1$  로 가는 경우, a0에 저장된 리스트와 같이 해당 행동의 번호에 1을 넣어서 초기화하였음.
- ight
  ight
  ight
  ho 각 상태의 상태변환확률집합인 p는 MDP에 제시된  $P(a_{ss'})$  의 값을 통해 초기화하였음.
- ▶ 각 상태의 보상 집합 r 역시 MDP에 제시된 R 값을 통해 초기화하였음.

## 2. 정책 평가

```
2. Policy Evaluation Repeat  \Delta \leftarrow 0  For each s \in \mathcal{S}:  v \leftarrow V(s)   V(s) \leftarrow \sum_{s',r} p(s',r|s,\pi(s)) \big[ r + \gamma V(s') \big]   \Delta \leftarrow \max(\Delta,|v-V(s)|)  until \Delta < \theta (a small positive number)
```

- ▶ Δ(델타, delta) : 값 비교를 위한 임의의 변수, 현재 상태 s와 다음 상태 s'의 가치함수 간의 차이의 최댓값이 저장되는 변수.
- ▶ θ(세타, theta) : 임의의 양의 실수.
- Δ(델타)가 θ(세타)의 값보다 작아질 때까지 평가를 반복한다.

```
# 정책 평가 (Policy Evaluation)
while True:
    evaluation_step += 1
    print(f'\n정책 평가 스텝 수 : {evaluation_step} 스텝 ')
    delta = 0
    for s in S:
        v = V[s]
        value = 0
        i = 0
        for percentage, reward in zip(p[s], r[s]):
            value += percentage * (reward + 0.9 * V[i])
            i += 1
        V[s] = value
        delta = max(delta, abs(v - V[s]))
        print(f'V[s{s}] = {V[s]}')

print(f'Delta = max(v- V[s]) = {delta}')
if delta < theta:
        break
```

- ▶ i는 다음 상태 s'을 의미함.
- ▶ p[s] 와 r[s] 는 현재 상태 s 에서 다음 상태 s'으로 이동할 때의 확률과 보상.
- ▶ 감가율은 0.9로, θ(세타)의 값은 0.001로 설정하였음.

### 3. 정책 발전

```
3. Policy Improvement  \begin{array}{l} policy\text{-stable} \leftarrow true \\ \text{For each } s \in \mathcal{S} \colon \\ old\text{-}action \leftarrow \pi(s) \\ \pi(s) \leftarrow \arg\max_{a} \sum_{s',r} p(s',r|s,a) \big[ r + \gamma V(s') \big] \\ \text{If } old\text{-}action \neq \pi(s), \text{ then } policy\text{-}stable \leftarrow false \\ \text{If } policy\text{-}stable, \text{ then stop and return } V \approx v_* \text{ and } \pi \approx \pi_*; \text{ else go to } 2 \\ \end{array}
```

- ▶ policy-stable : 정책 발전의 반복 여부를 결정함. 이전의 정책과 새로운 정책이 같으면 정책 발전 단계를 종료하고, 그렇지 않으면 정책 평가 단계로 되돌아간다.
- ▶ old-action : 정책 발전 이전의 상태 s에서 다음 상태 s'으로 가는 행동이 저장된 정책  $\pi(s)$
- ightharpoonup 큐 함수를 통해 상태 s에서 선택 가능한 각각의 행동에 대하여, 큐 함수의 값이 가장 큰 행동을 정책  $m \pi(s)$ 에 저장함.

```
# 정책 발전 (Policy Improvement)
print(f'\n정책 발전 ')
policy_stable = True
for s in S:
    print(f'a[s{s}] = {a[s]}', end=' ---> ')
    old_action = a[s].index(1)
    q_list = []
    for percentage, reward in zip(p[s], r[s]):
        q_{value} = percentage * (reward + 0.9 * V[i])
        q_list.append(q_value)
    index = g_list.index(max(g_list))
    a[s][old_action] = 0
    a[s][index] = 1
    print(f'a[s(s]] = {a[s]}')
    if old_action != index:
        policy_stable = False
if policy_stable == True:
    break
```

- ▶ old\_action에는 상태 s의 이전 정책 a[s]가 어떤 상태로 갈지의 행동이 저장됨.
- ▶ i는 다음 상태 s'를, p[s]와 r[s]는 현재 상태에서 다음 상태로 가는 확률과 보상이 저장됨.
- ▶ index는 큐 함수의 값이 큰 행동을 의미하며, 이전의 정책을 0으로, 새로운 정책을 1로 함.
- ▶ 이전의 정책과 새로운 정책이 다르면 정책 평가 단계로 돌아가며, 이전의 정책과 새로운 정책이 같으면 정책 이터레이션을 종료한다.

```
< 전체 소스 코드 >
a1 = [1, 0, 0, 0, 0, 0, 0, 0, 0, 0]
a3 = [1, 0, 0, 0, 0, 0, 0, 0, 0, 0]
       기터레이션 (Policy Iteration)
evaluation_step = 0
   policy_iteration_step += 1
       print(f'\n정책 평가 스텝 수 : {evaluation_step} 스텝 ')
        for s in S:
           v = V[s]
           for percentage, reward in zip(p[s], r[s]):
               value += percentage * (reward + 0.9 * V[1])
        if delta < theta:
   policy_stable = True
       old_action = a[s].index(1)
       for percentage, reward in zip(p[s], r[s]):
           q_value = percentage * (reward + 0.9 * V[i])
       a[s][old_action] = 0
       a[s][index] = 1
           policy_stable = False
   if policy_stable == True:
```

#### < 실행 결과 >

```
정책 이터레이션 스텝: 1
                                       정책 평가 스텝 수 : 2 스텝
정책 평가 스텝 수 : 1 스텝
                                                                              정책 평가 스텝 수 : 3 스텝
V[s0] = 0.0
V[s1] = 0.0
                                       V[s1] = 0.34061796000000005
V[s2] = 0.0
                                                                              V[s2] = 0.04748255280000002
V[s4] = 0.5
V[s5] = -0.4999999999999999
V[s7] = 2.3362000000000000
                                                                              V[s7] = 2.6052619833448
V[s8] = 1.26154800000000001
정책 평가 스텝 수 : 4 스텝
                                       정책 평가 스텝 수 : 5 스텝
                                                                              정책 평가 스텝 수 : 6 스텝
                                       V[s0] = 0.5288541362563717
                                                                              V[s2] = 1.3640970802616152
V[s3] = 0.8307643992705843
V[s5] = 2.771251725744848
                                      V[s6] = 5.719709942672757
V[s7] = 2.629547789681096
V[s7] = 2.6237512998610173
V[s8] = 2.1599017333278185
Delta = max(v- V[s]) = 0.7132602349905843 Delta = max(v- V[s]) = 0.5518282021810532 Delta = max(v- V[s]) = 0.3791227678907252
                                     정책 평가 스텝 수 : 8 스텝
                                                                              정책 평가 스텝 수 : 9 스텝
정책 평가 스텝 수 : 7 스텝
                                      V[s2] = 1.6640680399903567
V[s3] = 1.5935827152989581
                                      V[s3] = 1.6854213234253632
V[s5] = 2.8704915831950384
```

```
< 실행 결과 >
 책 평가 스텝 수 : 10 스텝
                                                                    정책 평가 스텝 수 : 12 스텝
V[s0] = 1.480892583791461
                                  V[s0] = 1.5169288396319196
                                                                   V[s2] = 1.8090501895913755
                                                                   V[s3] = 1.8055324835793427
V[s4] = 4.3741545717078925
                                                                   V[s5] = 2.8749816896556855
                                                                   V[s7] = 2.6323062333700538
                                  V[s8] = 2.2209416075780286
                                                                   V[s8] = 2.2209843447479196
정책 평가 스텝 수 : 13 스텝
                                 정책 평가 스텐 수 : 14 스텐
                                                                   정책 평가 스텝 수 : 15 스텝
V[s0] = 1.5512164818791232
                                 V[s0] = 1.5588123075284601
V[s1] = 1.6465472577480942
V[s2] = 1.8174800923151504
V[s3] = 1.8124681122877457
                                 V[s3] = 1.8165812898226377
V[s4] = 4.374507343770192
V[s5] = 2.8750009228319597
V[s6] = 5.735041565891854
                                                                   V[s7] = 2.6323081162761888
V[s8] = 2.2210086995621228
V[s7] = 2.6323074818605336
V[s8] = 2.2210004043139393
정책 평가 스텝 수 : 16 스텝
                                 정책 평가 스텝 수 : 17 스텝
                                                                   정책 평가 스텝 수 : 18 스텝
                                                                   V[s2] = 1.8288509167780385
                                 V[s3] = 1.8213176807973672
V[s6] = 5.73504544664798
V[s7] = 2.6323081803966364
                                                                   V[s8] = 2.2210099876961396
정책 발전
a[s0] = [0, 1, 0, 0, 0, 0, 0, 0, 0, 0] ---> a[s0] = [0, 0, 1, 0, 0, 0, 0, 0, 0, 0]
a[s1] = [1, 0, 0, 0, 0, 0, 0, 0, 0, 0] ---> a[s1] = [0, 0, 1, 0, 0, 0, 0, 0, 0, 0]
a[s2] = [0, 0, 0, 1, 0, 0, 0, 0, 0, 0] ---> a[s2] = [0, 0, 0, 1, 0, 0, 0, 0, 0, 0]
a[s3] = [1, 0, 0, 0, 0, 0, 0, 0, 0, 0] ---> a[s3] = [0, 0, 0, 0, 1, 0, 0, 0, 0]
a[s4] = [0, 0, 0, 0, 0, 1, 0, 0, 0, 0] ---> a[s4] = [0, 0, 0, 0, 0, 0, 1, 0, 0, 0]
a[s5] = [0, 0, 0, 0, 0, 0, 1, 0, 0, 0] ---> a[s5] = [0, 0, 0, 0, 0, 0, 1, 0, 0, 0]
a[s6] = [0, 0, 0, 0, 1, 0, 0, 0, 0, 0] ---> a[s6] = [0, 0, 0, 0, 0, 0, 0, 0, 1]
a[s7] = [0, 0, 0, 0, 0, 0, 1, 0, 0, 0] ---> a[s7] = [0, 0, 0, 0, 0, 0, 0, 0, 1]
a[s8] = [0, 0, 0, 0, 0, 0, 0, 1, 0, 0] ---> a[s8] = [0, 0, 0, 0, 0, 0, 0, 1, 0, 0]
```

- ▶ 정책 이터레이션의 첫 스텝은 총 18번의 정책 평가 반복 이후에 정책 발전으로 넘어감.
- ▶ 이 과정에서 ∆(델타)의 값이 점점 감소하는 것을 확인함.
- ▶ 정책발전에서는 각 상태 s에서의 정책도 변화함을 확인함.

```
< 실행 결과 >
정책 이터레이션 스텝: 2
정책 평가 스텝 수 : 19 스텝
V[s0] = 1.5690646629261282
V[s1] = 1.6583257228614343
V[s2] = 1.8292156752491837
V[s3] = 1.8221242698383553
V[s4] = 4.374526062987806
V[s5] = 2.8750123408896173
V[s6] = 5.735045648129082
V[s7] = 2.632308216663235
V[s8] = 2.221010032568757
Delta = max(v-V[s]) = 0.0005554312301419007
정책 발전
a[s0] = [0, 0, 1, 0, 0, 0, 0, 0, 0, 0] ---> a[s0] = [0, 0, 1, 0, 0, 0, 0, 0, 0, 0]
a[s1] = [0, 0, 1, 0, 0, 0, 0, 0, 0] ---> a[s1] = [0, 0, 1, 0, 0, 0, 0, 0, 0, 0]
a[s2] = [0, 0, 0, 1, 0, 0, 0, 0, 0] ---> a[s2] = [0, 0, 0, 1, 0, 0, 0, 0, 0]
a[s3] = [0, 0, 0, 0, 1, 0, 0, 0, 0, 0] ---> a[s3] = [0, 0, 0, 0, 1, 0, 0, 0, 0, 0]
a[s4] = [0, 0, 0, 0, 0, 0, 1, 0, 0, 0] ---> a[s4] = [0, 0, 0, 0, 0, 0, 1, 0, 0, 0]
a[s5] = [0, 0, 0, 0, 0, 0, 1, 0, 0, 0] ---> a[s5] = [0, 0, 0, 0, 0, 0, 1, 0, 0, 0]
a[s6] = [0, 0, 0, 0, 0, 0, 0, 0, 0, 1] ---> a[s6] = [0, 0, 0, 0, 0, 0, 0, 0, 1]
a[s7] = [0, 0, 0, 0, 0, 0, 0, 0, 0, 1] ---> a[s7] = [0, 0, 0, 0, 0, 0, 0, 0, 1]
a[s8] = [0, 0, 0, 0, 0, 0, 0, 1, 0, 0] ---> a[s8] = [0, 0, 0, 0, 0, 0, 0, 1, 0, 0]
▶ 정책 이터레이션은 두 번째 스텝에서 종료되었음을 확인함.
▶ 정책 이터레이션의 두 번째 스텝은 1번의 정책 평가 이후 바로 발전으로 넘어감.
                                                     V(S_0) = 1.56987137
Policy[s0] => s2
                      V[0] = 1.5690646629261282
                                                     V(S_i) = 1.65885766
Policy[s1] => s2
                      V[1] = 1.6583257228614343
                                                     V(S_2) = 1.82974539
```

```
Policy[s2] => s3
                     V[2] = 1.8292156752491837
                                                    V(S_2) = 1.82255994
Policy[s3] => s4
                     V[3] = 1.8221242698383553
                                                    V(S_4) = 4.37452611
Policy[s4] => s6
                     V[4] = 4.374526062987806
                                                    V(S_5) = 2.87501237
Policy[s5] => s6
                     V[5] = 2.8750123408896173
                                                    V(S_6) = 5.73504566
Policy[s6] => s9
                     V[6] = 5.735045648129082
                                                    V(S_7) = 2.63230822
Policy[s7] => s9
                      V[7] = 2.632308216663235
                                                    V(S_8) = 2.22101006
Policy[s8] => s7
                      V[8] = 2.221010032568757
                                                    V(S_0) = 0
```

▶ 최적 정책이 구해졌으며, 이에 대한 가치함수의 값을 과제1의 가치함수 결과와 비교한 결과 두 값이 매우 비슷함을 확인하였음.

