

# Aprendizaje por refuerzo y técnicas generativas.

---

Deep Q Network (DQN)

# Introducción a Deep Q-learning

# Introducción

---

Previamente en "Aprendizaje por refuerzo", se ha introducido una de sus técnicas más populares: el *Q-learning*. Y además, se han establecido las bases hablando de procesos de decisión de Markov, políticas y funciones de valor.

En este apartado extenderemos las técnicas de ***Q-Learning*** clásico incorporando el uso de *redes neuronales*, dando pie a la evolución a los modelos de ***Deep Q Network***.

Algunos conocimientos de Deep Learning y recursos recomendados de interes:

- <https://www.coursera.org/learn/neural-networks-deep-learning>
- [https://www.tensorflow.org/guide/core/mlp\\_core](https://www.tensorflow.org/guide/core/mlp_core)
- [https://www.tensorflow.org/agents/tutorials/0\\_intro\\_rl?hl=es-419](https://www.tensorflow.org/agents/tutorials/0_intro_rl?hl=es-419)

# Un poco de historia

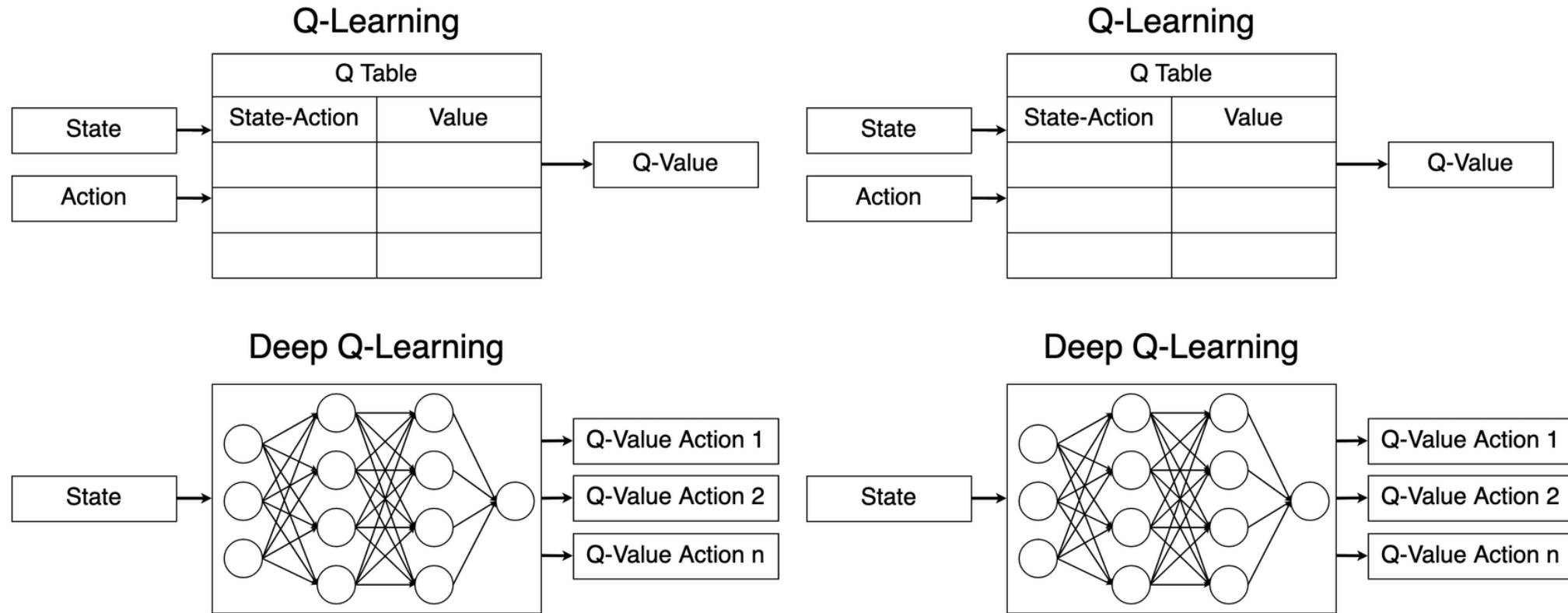
---

En **2015**, *DeepMind*, siendo ya parte de Google, presentó un avance en el campo del aprendizaje por refuerzo profundo con la introducción de **Deep Q Network (DQN)**, marcando el comienzo del campo conocido hoy como *Deep Reinforcement Learning*.

**DQN** cambia la forma en que se aborda el aprendizaje automático en entornos de toma de decisiones secuenciales.

- En lugar de procesar datos estáticos (imágenes o texto), el aprendizaje por refuerzo implica aprender a tomar decisiones secuenciales mientras se maximiza una recompensa acumulativa.
- **DQN** se lanzó en un videojuego de **Atari**, utilizando solo píxeles de la pantalla y retroalimentación de recompensa sencilla, logrando superar el rendimiento de los "expertos/frikies" en varios juegos, incluidos títulos icónicos como Breakout, Space Invaders y Pong.
- La capacidad de **DQN** radica aprender directamente de la experiencia, o más bien del escenario que se crea en cada instantem, y tomar decisiones óptimas en entornos complejos.
- Todo esto allanó el camino para aplicaciones en campos como la robótica, los sistemas de control, la gestión de inventario, los vehículos autónomos y más.

# Q-Learning vs. Deep Q-Learning



- En **Q-Learning** usamos la tablas de estados y acciones, o Q-valores.
- En **Deep Q-Learning** utilizamos una red neuronal que aproxima o minimiza la función que aproxima esos Q-valores.

# Q-Learning vs. Deep Q-Learning

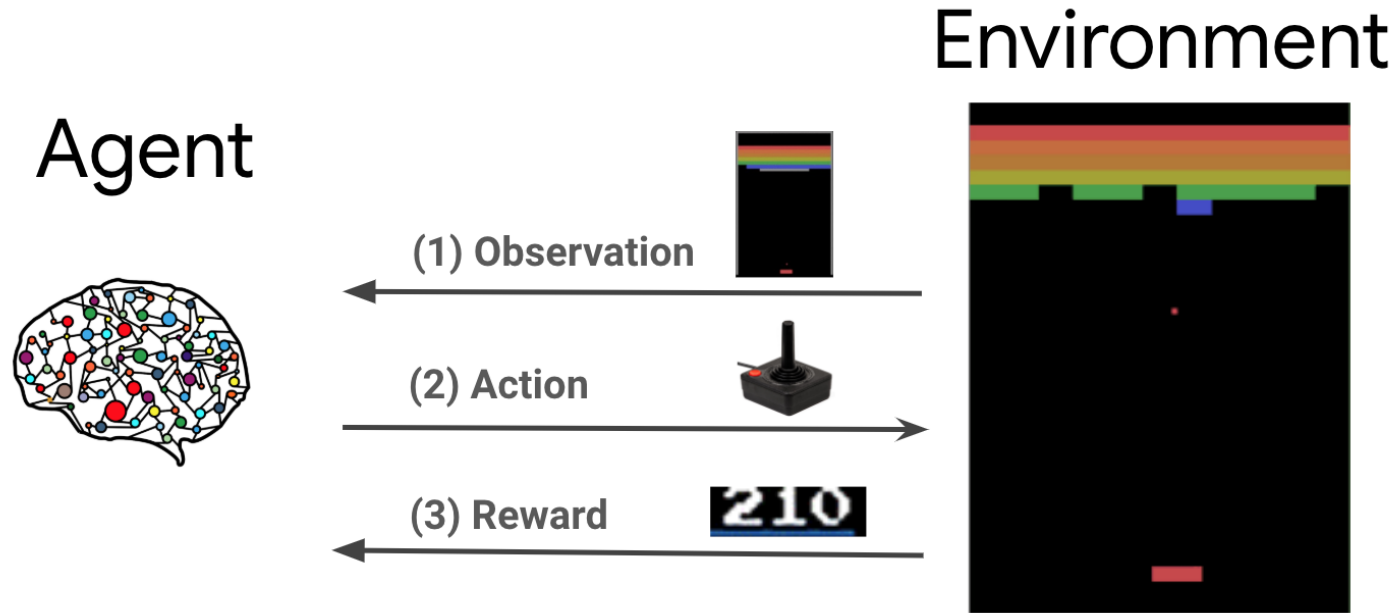
---

El uso de **redes neuronales** tiene varios propósitos importantes en comparación con el enfoque tradicional de Q-Learning:

- **Aproximación de la función Q:** En Q-Learning la tabla que almacena los Q-valores de cada par estado-acción posible, haciendo dependiente de la complejidad del problema. Una **red neuronal** permite aproximar la función Q, lo que significa que **cedemos** a la red el aprender una representación de la función Q, como si generase su propia Q-tabla.
- **Generalización y abstracción:** Las redes neuronales por definición buscan generalizar a partir de ejemplos y extraer características relevantes de los datos de entrada.
- **Escalabilidad:** en Q-Learning vemos limitadas nuestras acciones por como de compleja podamos generar nuestra Q-tabla, las redes neuronales permiten manejar datos de alta dimensionalidad y extraer características relevantes para la toma de decisiones.
- **Aprendizaje de representaciones jerárquicas:** aprenden representaciones jerárquicas de los datos, lo que les permite capturar características tanto a nivel bajo (como bordes y texturas en una imagen) como a nivel alto (como objetos y patrones).

# El agente y su entorno

---



El **agente** y el **entorno** interactúan continuamente entre sí, cada iteración el agente toma una acción en el entorno donde varía la observación actual, y recibe una recompensa y la siguiente observación desde el entorno.

El objetivo es mejorar el agente en cada iteración para maximizar la suma de recompensas.

# El entorno de Cartpole

**Cartpole** es uno de los problemas de aprendizaje de refuerzo **clásicos** ("Hola, mundo!"). Un poste está sujeto a un carro, que puede moverse a lo largo de una pista sin fricción. El poste comienza en posición vertical y el objetivo es evitar que se caiga controlando el carro.

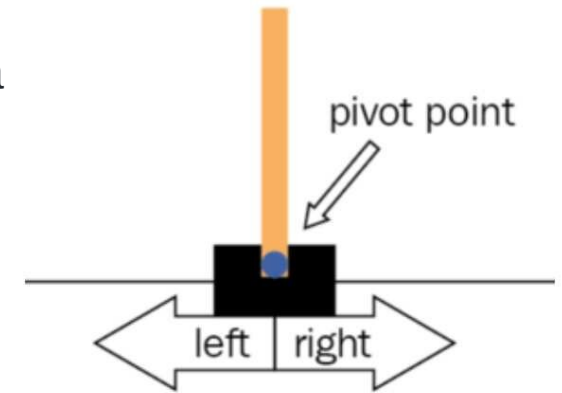
La observación del entorno es un vector 4D representa la posición y la velocidad del carro, y el ángulo y la velocidad angular del polo. El agente puede controlar el sistema mediante 2 acciones, empujar a la derecha (1) o izquierda (-1).

Las claves del juego vienen dadas por:

- La recompensa se da según pasa el tiempo y el palo permanece vertical.
- El juego termina cuando el poste se inclina por encima de algún límite o el carro se mueve fuera de los bordes del mundo.
- El objetivo del agente es aprender a maximizar la suma de recompensas.

["Tutorial DQN de Cartpole en Tensorflow"](#)

["Tutorial DQN de Cartpole en Pytorch"](#)





# Deep Q-Learning

---

**Deep Q-Network o DQN** combina la idea del Q-learning aplicando *redes neuronales*.

- Usa ***una red neuronal*** para aproximar la ***función  $Q$***  (En realidad, utiliza dos redes neuronales para estabilizar el proceso de aprendizaje).
- La ***red neuronal principal (main Neural Network)***, representada por los parámetros  $\theta$ , se utiliza para estimar los ***valores- $Q$***  del estado  $s$  y acción  $a$  actuales:  $Q(s, a; \theta)$ .
- La ***red neuronal objetivo (target Neural Network)***, parametrizada por  $\theta'$ , tendrá la misma arquitectura que la red principal pero se usará para aproximar los ***valores- $Q$***  del siguiente estado  $s'$  y la siguiente acción  $a'$ .

# Deep Q-Learning - Ecuación de Bellman

---

La función de Bellman cambia para adaptarse a las redes neuronales partiendo de:

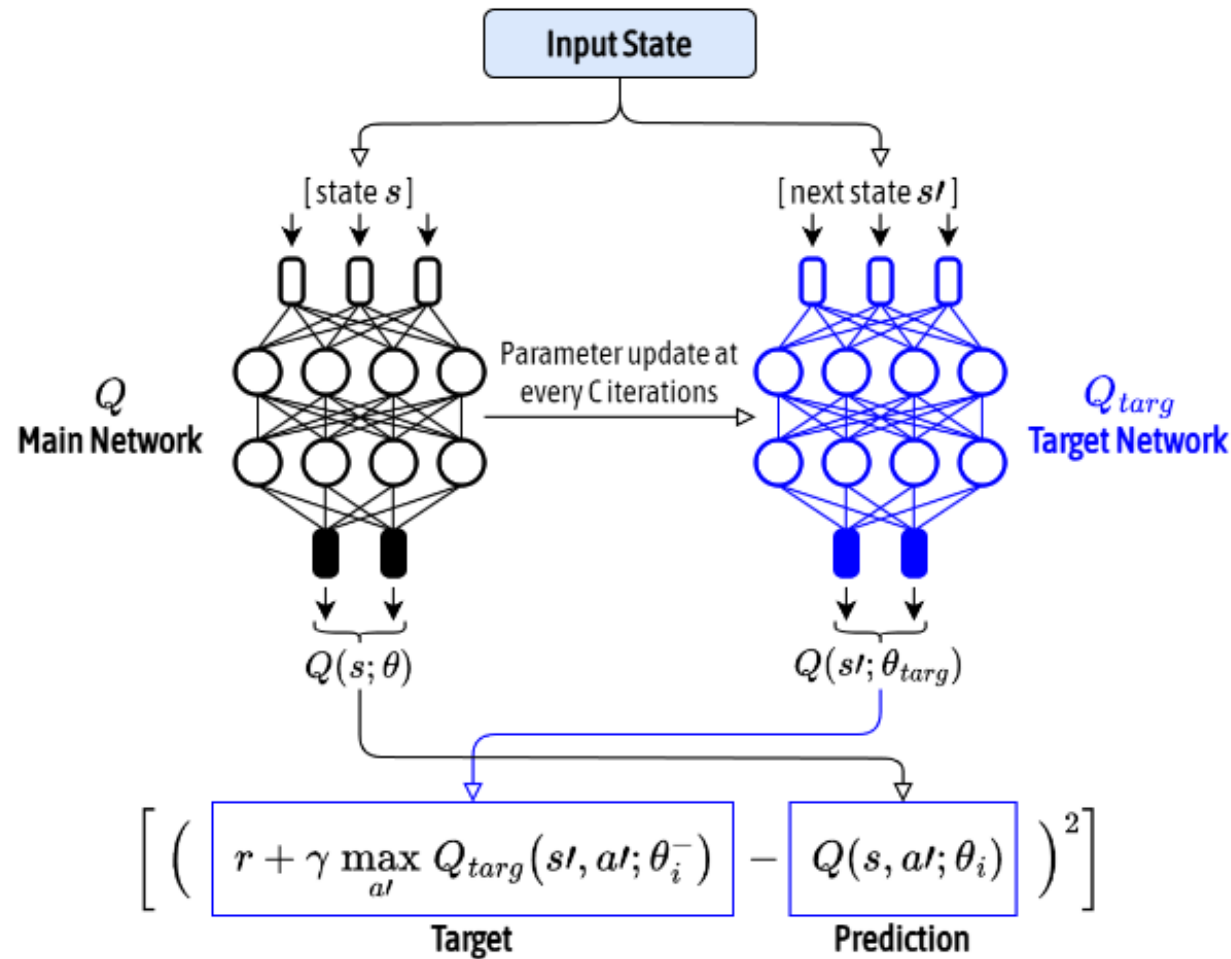
$$Q(s, a; \theta) = r + \gamma \max_{a'} Q(s', a'; \theta')$$

La adaptación de la ecuación se debe a la necesidad de una **función de pérdida** (**loss function**) definida como el cuadrado de la diferencia entre ambos lados de la ecuación.

$$\left[ \left( \underbrace{r + \gamma \max_{a'} Q_{targ}(s', a'; \theta_i^-)}_{\text{Target}} - \underbrace{Q(s, a'; \theta_i)}_{\text{Prediction}} \right)^2 \right]$$

Al convertirlo en una **loss function** el objetivo de la red será minimizar usando el algoritmo de descenso de gradientes (viene definida dentro de las librerías de **TensorFlow** o **PyTorch**).

# Deep Q-Learning - [wikidocs](#)



# Deep Q-Learning - train()

---

La función *train()*, *fit()*, *train\_on\_batch()* solo ocurre **en la red principal** y en la objetivo se utilizará *predict()*.

- El entrenamiento tiene un paso inicial o **arranque en frío** para generar los primeros escenarios.
- La **red objetivo se congela** (sus parámetros) durante varias iteraciones (2000~10000).
- Después de las iteraciones predefinidas, **los parámetros de la red principal se copian** a la **red objetivo**, transmitiendo así el aprendizaje de una a otra, haciendo que las estimaciones calculadas por la red objetivo sean más precisas.

# Deep Q-Learning - pseudo-código *step 1*

---

## 1. Inicialización o *arranque en frío*:

- i. Inicializar la red neuronal profunda Q (*main\_nn*) con pesos aleatorios.
- ii. Inicializar el estado inicial del entorno (p.e. Cartpole).
- iii. Realizar un "arranque en frío" para ***poblar el búfer de reproducción***:
  - a. Realizar acciones aleatorias en el entorno durante un número predefinido de pasos.
  - b. Almacenar cada transición (estado, acción, recompensa, nuevo estado) en el búfer de reproducción.

# Deep Q-Learning - pseudo-código *step 2*

---

2. Para cada episodio (¡Recordar! - para cada grabación de diferentes jugadas):

i. **Reiniciar el estado inicial del entorno.**

ii. **Para cada paso del episodio:**

a. Elegir una acción utilizando una política de exploración/exploitación (por ejemplo, epsilon-greedy).

b. Ejecutar la acción en el entorno y observar la recompensa y el nuevo estado.

c. Almacenar la transición (estado, acción, recompensa, nuevo estado) en el búfer de reproducción.

d. Muestrear un lote de transiciones del búfer de reproducción.

e. Para cada transición en el lote:

a. Calcular el valor objetivo:

$$target = reward + discount\_factor * max(Q(new\_state, action))$$

- reward es la recompensa recibida por tomar la acción.

- discount\_factor es el factor de descuento que pondera las recompensas futuras.

- $Q(new\_state, action)$  es el valor de la acción óptima estimada para el nuevo estado.

b. Calcular el error cuadrático medio (MSE) entre el valor objetivo y el valor estimado:

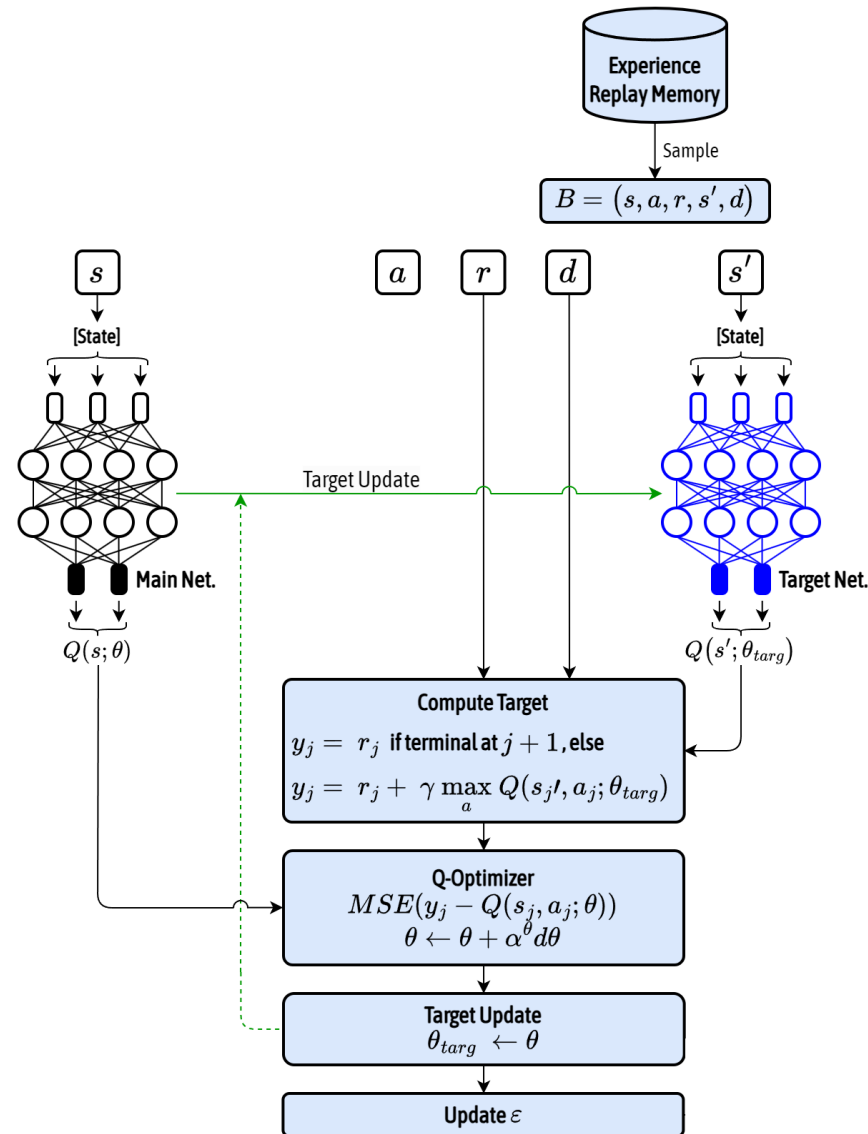
$$loss = (target - Q(state, action))^2$$

c. Realizar un paso de retropropagación (backpropagation) para minimizar el error cuadrático medio.

f. Actualizar el estado actual al nuevo estado.

iii. **Reducir el valor de epsilon si se está utilizando una política epsilon-greedy.**

# Deep Q-Learning - esquema del entrenamiento



# DQN: Creación de las redes neuronales

```
class DQN(tf.keras.Model):
    """Perceptron multicapa de 2 capas de 32 y una se salida"""
    def __init__(self):
        super(DQN, self).__init__()
        self.dense1 = tf.keras.layers.Dense(32, activation="relu")
        self.dense2 = tf.keras.layers.Dense(32, activation="relu")
        self.dense3 = tf.keras.layers.Dense(num_actions, dtype=tf.float32) # No activation

    def call(self, x):
        """Construcción de las capas"""
        x = self.dense1(x)
        x = self.dense2(x)
        return self.dense3(x)

main_nn = DQN() # Red principal
target_nn = DQN() # Red objetivo

optimizer = tf.keras.optimizers.Adam(1e-4) #Optimizados Adam
mse = tf.keras.losses.MeanSquaredError() #Loss function MSE
```



# DQN: Creación del buffer para la experiencia

```
class ReplayBuffer(object):
    """Experience replay buffer that samples uniformly."""
    def __init__(self, size):
        self.buffer = deque(maxlen=size)

    def add(self, state, action, reward, next_state, done):
        self.buffer.append((state, action, reward, next_state, done))

    def __len__(self):
        return len(self.buffer)

    def sample(self, num_samples):
        states, actions, rewards, next_states, dones = [], [], [], [], []
        idx = np.random.choice(len(self.buffer), num_samples)
        for i in idx:
            elem = self.buffer[i]
            state, action, reward, next_state, done = elem
            states.append(np.array(state, copy=False))
            actions.append(np.array(action, copy=False))
            rewards.append(reward)
            next_states.append(np.array(next_state, copy=False))
            dones.append(done)
        states = np.array(states)
        actions = np.array(actions)
        rewards = np.array(rewards, dtype=np.float32)
        next_states = np.array(next_states)
        dones = np.array(dones, dtype=np.float32)
        return states, actions, rewards, next_states, dones
```

# DQN: función *epsilon-greedy()* y *train\_step()*

```
def select_epsilon_greedy_action(state, epsilon):
    """Acción aleatoria con probabilidad menor que epsilon, en otro caso la mejor."""
    result = tf.random.uniform((1,))
    if result < epsilon:
        return env.action_space.sample() # Elegimos una acción aleatoria
    else:
        return tf.argmax(main_nn(state)[0]).numpy() # Elección de acción Greedy.

@tf.function # Configuración de cada iteración de entrenamiento
def train_step(states, actions, rewards, next_states, done):
    # Cálculo de los objetivos (segunda red)
    next_qs = target_nn(next_states)
    max_next_qs = tf.reduce_max(next_qs, axis=-1)
    target = rewards + (1. - done) * discount * max_next_qs
    with tf.GradientTape() as tape:
        qs = main_nn(states)
        action_masks = tf.one_hot(actions, num_actions)
        masked_qs = tf.reduce_sum(action_masks * qs, axis=-1)
        loss = mse(target, masked_qs)
    grads = tape.gradient(loss, main_nn.trainable_variables)
    optimizer.apply_gradients(zip(grads, main_nn.trainable_variables))
    return loss
```

# DQN: Hyperparámetros y entrenamiento

```
# Hyperparámetros
num_episodes = 1000
epsilon = 1.0
batch_size = 32
discount = 0.99
buffer = ReplayBuffer(100000)
cur_frame = 0

# Comienzo del entrenamiento. Jugamos una vez y entrenamos con un batch.
last_100_ep_rewards = []
for episode in range(num_episodes+1):
    state = env.reset() #reseteo del ecosistema
    ep_reward, done = 0, False
    while not done:
        state_in = tf.expand_dims(state, axis=0)
        action = select_epsilon_greedy_action(state_in, epsilon)
        next_state, reward, done, info = env.step(action)
        ep_reward += reward
        # Guardamos el juego.
        buffer.add(state, action, reward, next_state, done)
        state = next_state
        cur_frame += 1
    # CoCopiamos los pesos de main_nn a target_nn.
    if cur_frame % 2000 == 0:
        target_nn.set_weights(main_nn.get_weights())
```

# DQN: resto del código

```
# Entrenamiento de la red neuronal.
if len(buffer) >= batch_size:
    states, actions, rewards, next_states, done = buffer.sample(batch_size)
    loss = train_step(states, actions, rewards, next_states, done)

if episode < 950:
    epsilon -= 0.001

if len(last_100_ep_rewards) == 100:
    last_100_ep_rewards = last_100_ep_rewards[1:]
    last_100_ep_rewards.append(ep_reward)

if episode % 50 == 0:
    print(f'Episode {episode}/{num_episodes}. Epsilon: {epsilon:.3f}. '
          f'Reward in last 100 episodes: {np.mean(last_100_ep_rewards):.3f}')
env.close()
```

# Double DQN y Dueling DQN

# Algoritmos avanzados de DQN

---

El algoritmo de ***Deep Q-Network***, es capaz de solucionar problemas complejos, pero también tiene deficiencias.

Por ello, aparecen algoritmos aportando mejoras como lo son ***Double Deep Q-Network*** (Double DQN) y ***Dueling Deep Q-Network*** (Dueling DQN).

Ambos modelos tienen la capacidad para ***mejorar la estabilidad y eficacia del aprendizaje*** por refuerzo en entornos desafiantes.

# Double Deep Q-Network

---

**Double DQN** surge para mitigar el sesgo que **comete algoritmo DQN** al sobreestimar las recompensas reales; es decir, los valores-Q que genera, piensa que va a obtener una recompensa mayor de la que tendrá en realidad.

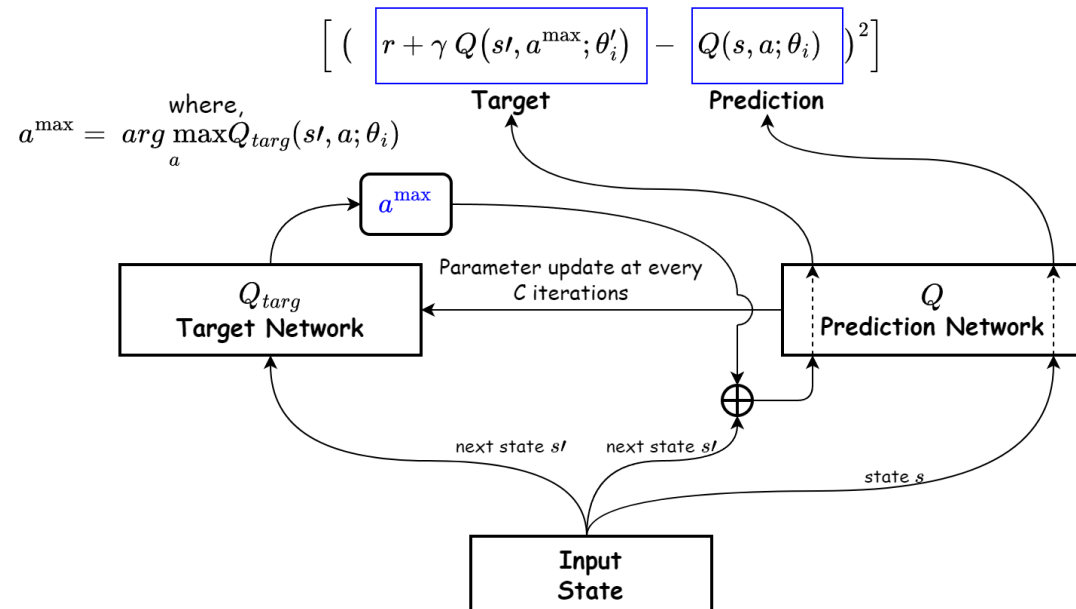
**Double DQN** propone separar la selección y la evaluación de una acción en dos pasos, usando **dos redes neuronales** para estimar los valores de acción y actualizarlas de manera independiente.

$$Q(s, a; \theta) = r + \gamma Q(s', \operatorname{argmax}_{a'} Q(s', a'; \theta); \theta')$$

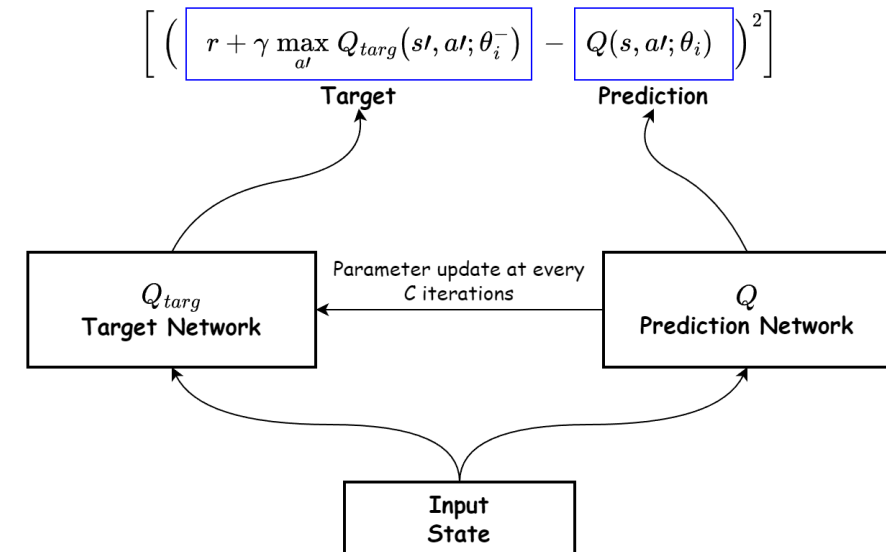
Este modelo añade un paso, de la red neuronal principal  $\theta$  que decide cuál es la mejor acción entre todas las posibles, hace pasar ese resultado sobre la **red objetivo** que evalúa esa acción para conocer su **valor-Q**.

# Double Deep Q-Network

## Double Deep Q-Network



## Deep Q-Network





# Dueling Deep Q-Network

---

Este algoritmo divide los **valores-Q en dos partes distintas**, la función de valor (value function)  $V(s)$  y la función de ventaja (advantage function)  $A(s, a)$ .

- La **función de valor  $V(s)$**  nos dice cuánta recompensa obtendremos desde el estado  $s$ .
- La **función de ventaja  $A(s, a)$**  nos dice cuánto mejor es una acción respecto a las demás.
- Combinando el valor  $V$  y la ventaja  $A$  de cada acción, obtenemos los valores-Q:

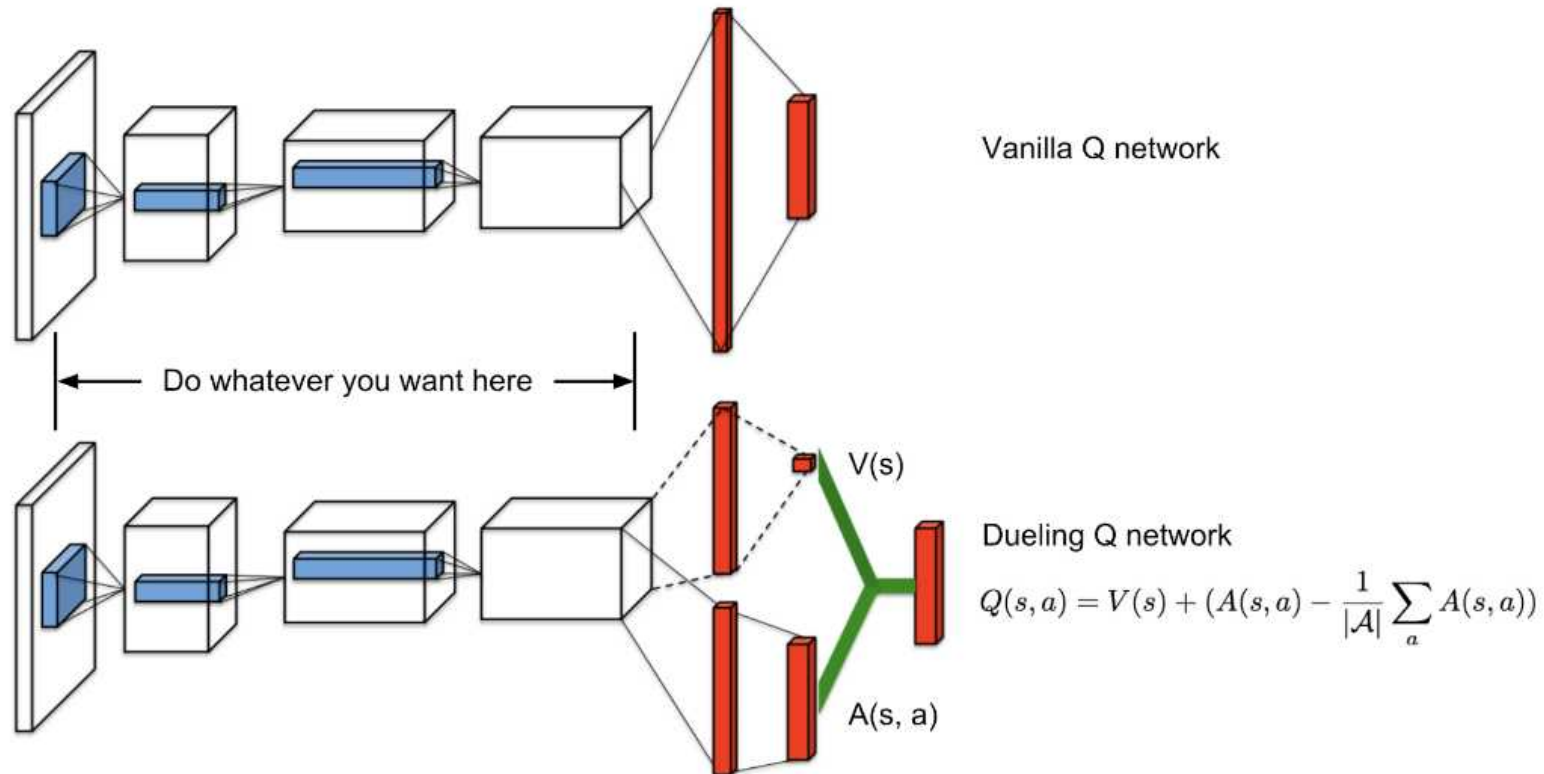
$$Q(s, a) = V(s) + A(s, a)$$

# Dueling Deep Q-Network

**Dueling DQN** divide la capa final de la red en dos:

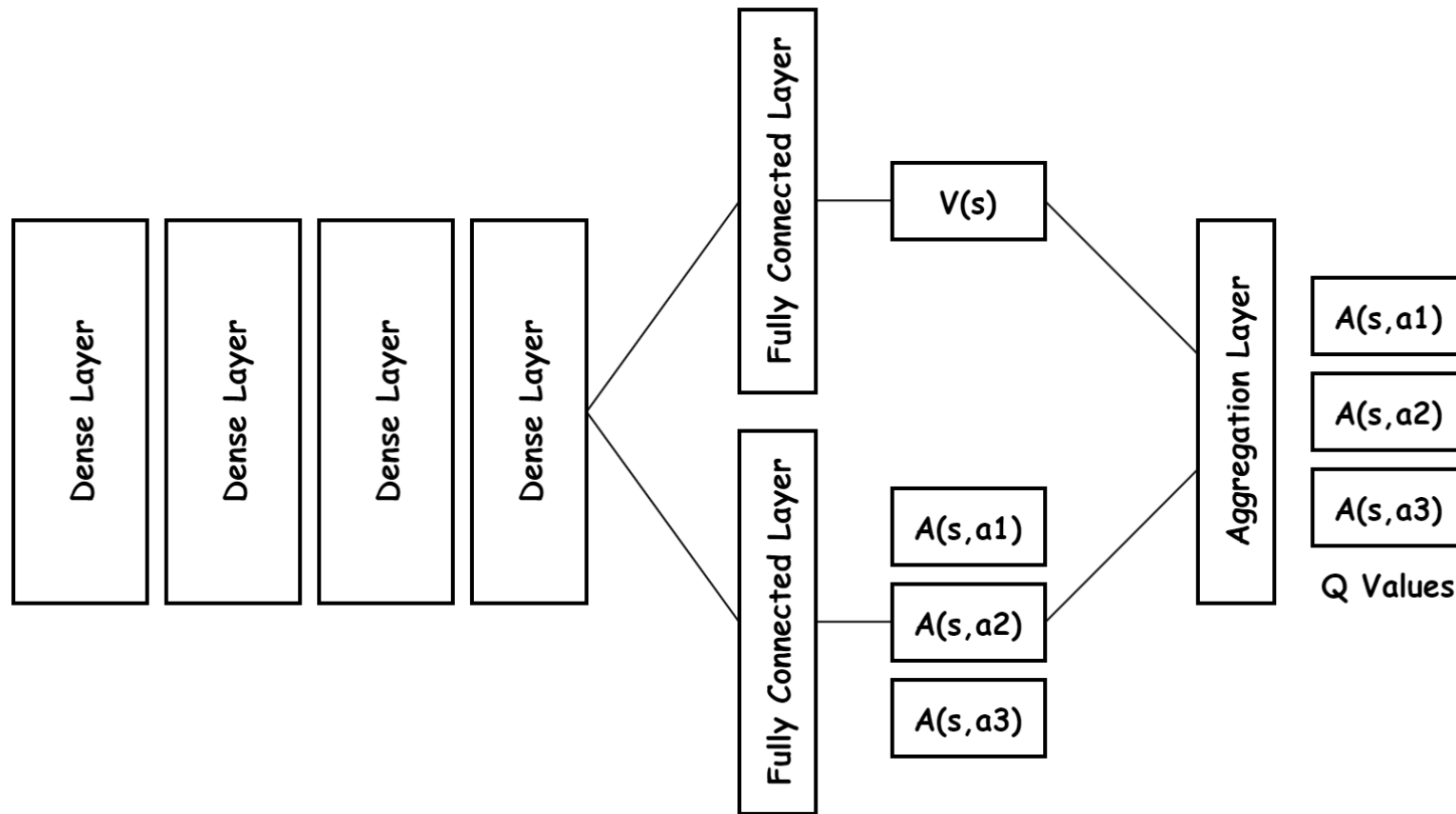
1. Estima el valor del estado  $s \rightarrow V(s)$
2. Estima la ventaja de cada acción  $a \rightarrow A(s, a)$

La unión de ambas partes estima los **valores-Q**  $\rightarrow Q = V + A - \text{mean}(A)$ .



# Dueling Deep Q-Network

Es importante mantener el número de Q-valores tanto en la capa final como en la interna de evaluación de acciones.



# DDQN: estructura CNN de la red

```
class DuelingDQN(tf.keras.Model):  
    """CNN para juegos de Atari."""  
    def __init__(self, num_actions):  
        super(DuelingDQN, self).__init__()  
        self.conv1 = tf.keras.layers.Conv2D(  
            filters=32, kernel_size=8, strides=4, activation="relu",  
        )  
        self.conv2 = tf.keras.layers.Conv2D(  
            filters=64, kernel_size=4, strides=2, activation="relu",  
        )  
        self.conv3 = tf.keras.layers.Conv2D(  
            filters=64, kernel_size=3, strides=1, activation="relu",  
        )  
        self.flatten = tf.keras.layers.Flatten()  
        self.dense1 = tf.keras.layers.Dense(units=512, activation="relu")  
        self.V = tf.keras.layers.Dense(1)  
        self.A = tf.keras.layers.Dense(num_actions)
```

# Dueling Deep Q-Network: Código

---

```
@tf.function
def call(self, states):
    """Forward pass of the neural network with some inputs."""
    x = self.conv1(states)
    x = self.conv2(x)
    x = self.conv3(x)
    x = self.flatten(x)
    x = self.dense1(x)
    V = self.V(x)
    A = self.A(x)
    Q = V + tf.subtract(A, tf.reduce_mean(A, axis=1, keepdims=True))
    return Q
```

[Código en tensorflow](#)

[Código en Pytorch](#)

# Dueling Deep Q-Network: Código entrenamiento

```
@tf.function
def train_step(states, actions, rewards, next_states, done):
    # Selección de la proxima mejor acción con main_nn.
    next_qs_main = main_nn(next_states)
    next_qs_argmax = tf.argmax(next_qs_main, axis=-1)
    next_action_mask = tf.one_hot(next_qs_argmax, num_actions)

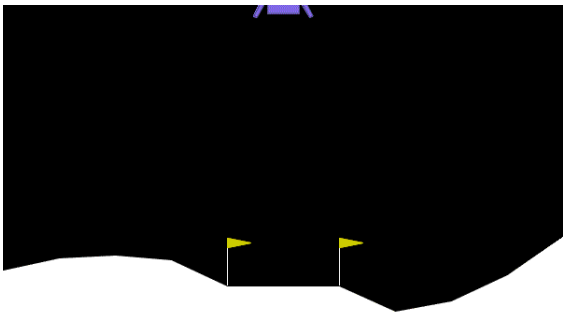
    # Evaluamos la mejor acción con target_nn para sacar el Q-value.
    next_qs_target = target_nn(next_states)
    masked_next_qs = tf.reduce_sum(next_action_mask * next_qs_target, axis=-1)

    # Creamos el objetivo usando la recompensa y el descuento del proximo Q-value.
    target = rewards + (1. - done) * discount * masked_next_qs
    with tf.GradientTape() as tape:
        qs = main_nn(states) # Q-values del estado actual.
        action_mask = tf.one_hot(actions, num_actions)
        masked_qs = tf.reduce_sum(action_mask * qs, axis=-1)
        loss = loss_fn(target, masked_qs)

    grads = tape.gradient(loss, main_nn.trainable_variables)
    optimizer.apply_gradients(zip(grads, main_nn.trainable_variables))
    return loss
```

# Lunar Lander

Es parte de la libreria de Gymnasium, y uno de los entornos dentro de Box2D.



Action Space	Discrete(4)
Observation Shape	(8,)
Observation High	[1.5 1.5 5. 5. 3.14 5. 1. 1. ]
Observation Low	[-1.5 -1.5 -5. -5. -3.14 -5. -0. -0. ]
Import	<code>gym.make("LunarLander-v2")</code>

s[0]	s[1]	s[2]	s[3]	s[4]	s[5]	s[6]	s[7]
X	Y	Speed X	Speed Y	Ángulo	Ang. Speed	1º pata tiene contacto sino 0	2º pata tiene contacto sino 0

**Acciones:**

- 1. no hacer nada
- 2. encender motor izquierdo
- 3. encender motor principal
- 4. encender motor derecho

# Actor-Critic



# Recopilando

---

Desde el principio hemos obviado como clasificar los modelos de Aprendizaje por refuerzo, pero hay que situarse en contexto para seguir avanzando:

## 1. Modelos basados en el conocimiento del entorno

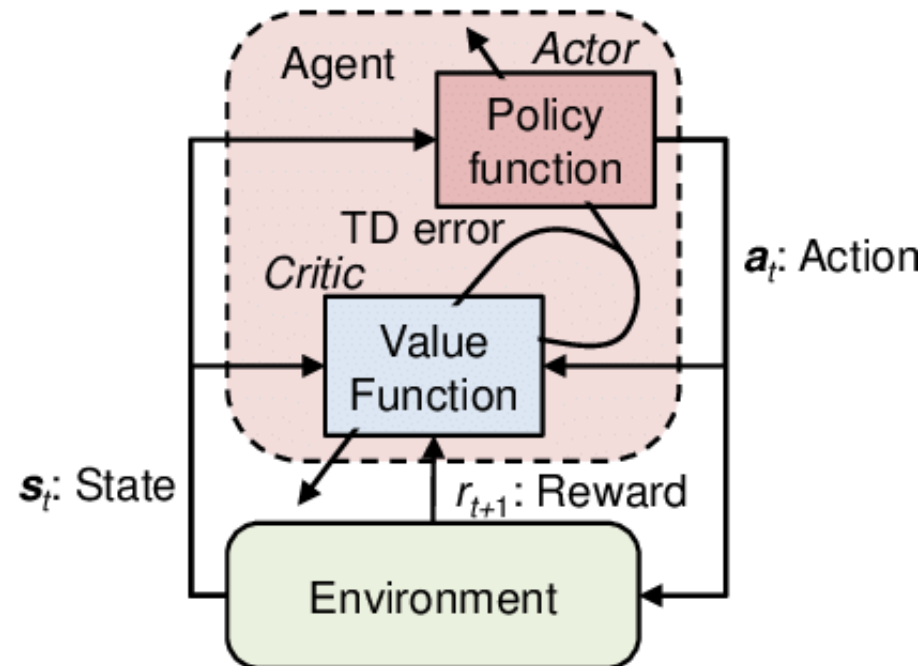
- ***Aprendizaje basado en el modelo***: el agente tiene un conocimiento explícito del entorno y puede predecir como reacciona el entorno para cada acción. (Model-Based Reinforced Learning)
- ***Aprendizaje basado en el modelo libre***: el agente no tiene un conocimiento explícito y debe aprender a partir de la interacción directa con él. (Q-Learning)

## 2. Modelos basados en el tipo de aprendizaje

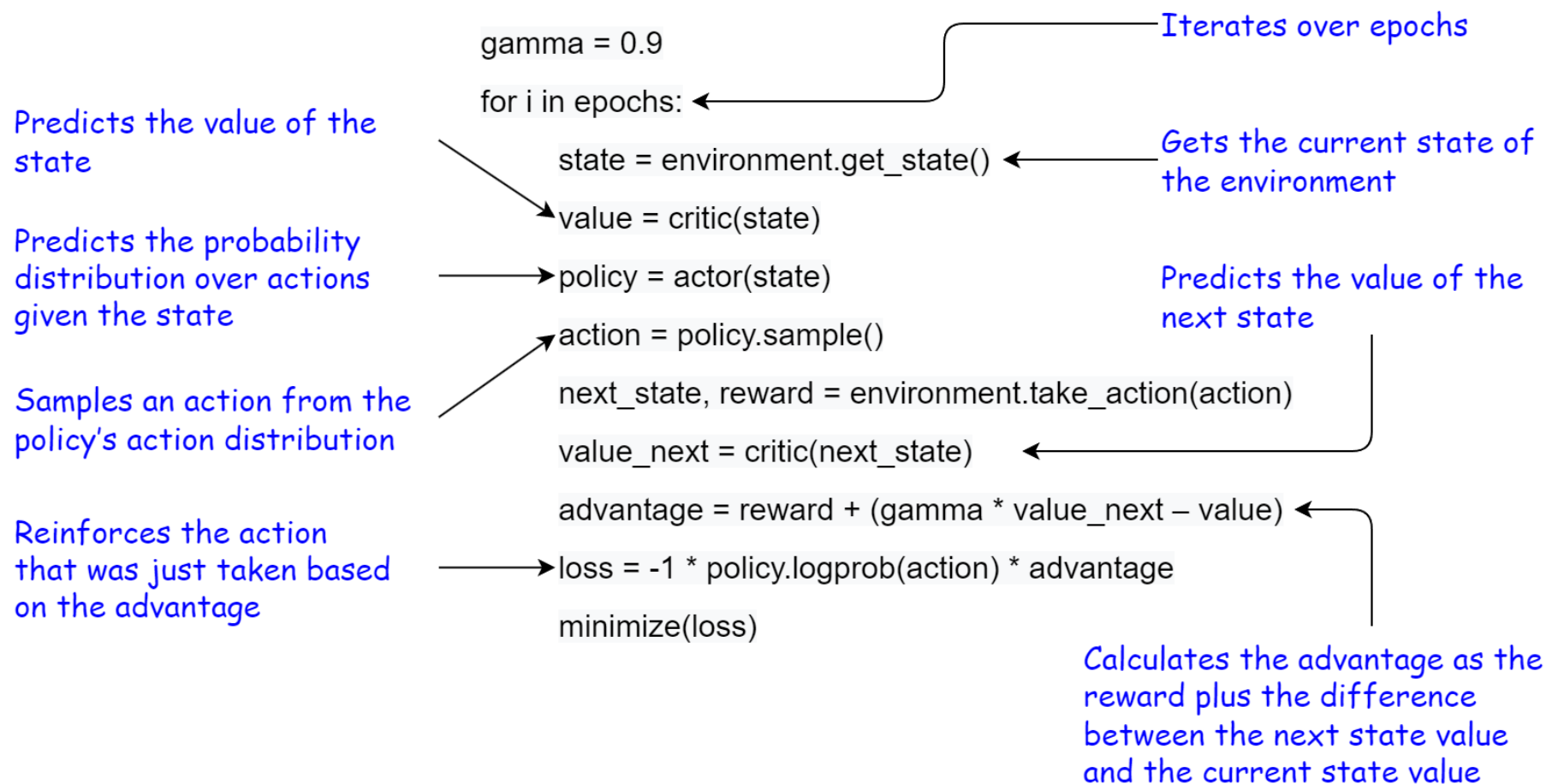
- ***Aprendizaje de valor***: el agente aprende a estimar la función de valor, la información que recibe en cada decisión guía el comportamiento del agente. (Deep Q-Learning)
- ***Aprendizaje de política***: el agente aprende una política óptima sin necesidad de estimar la función de valor, la política puede ser determinista o estocástica (Policy Gradiente o Advantage Actor-Critic)

# Actor-Critic [5]

**Actor-Critic** es una combinación de métodos basados en el valor y basados en la política, donde **el Actor controla cómo se comporta nuestro agente** utilizando Policy gradient, y **el Crítico evalúa qué tan buena es la acción tomada** por el Agente basándose en la función de valor.



# Actor-Critic



# Recursos didácticos

---

1. Mnih, V. et al. (2015). Human-level control through deep reinforcement learning. Nature, 518(7540), 529.
2. Wang, Ziyu, et al. “Dueling network architectures for deep reinforcement learning.” arXiv preprint arXiv:1511.06581 (2015)
3. Van Hasselt, Hado, Arthur Guez, and David Silver. “Deep reinforcement learning with double q-learning.” Thirtieth AAAI conference on artificial intelligence. 2016
4. Tensorflow tutoriales de agentes para aprendizaje por refuerzo
5. Deep Multi-Agent Reinforcement Learning using DNN-Weight Evolution to Optimize Supply Chain Performance