DS4001 · 人工智能原理与技术

Homework 3 贝叶斯网络

中国科学技术大学·2024 春季学期 May 8, 2024

作业要求

本实验由书面部分(回答问题)和编程部分(代码填空)组成。其中:

• 编程部分: 完整代码可在 code 文件夹中找到。你只需要在 submission.py 的

1 # BEGIN_YOUR_CODE

2

3 # END YOUR CODE

部分完成代码编写。不要对除 submission.py 以外的文件进行更改。在完成所有代码编写 后, 你可以运行 python grader.py 得到最终分数。

你也可以运行单个测试 (例如,1d-0-basic,更多测试样例见 grader.py)python grader.py 1d-0-basic。最后助教将依据代码的评测结果(包括隐藏测试)以及代码的正确性综合评定你的分数。

注意: 在编程部分, 建议使用 python=3.10。

• **书面部分**:本次书面部分工作量较大,可以使用 markdown 或手写拍照,不再提供报告模板。 你需要在提交的报告中写出所有问题的答案,包括代码。最后请提交 pdf 报告,确保工整清晰。

在完成所有题目后, 你需要在 bb 系统上传一个命名为学号 _ 姓名 _HW3.zip 的压缩包, 里面只用包含 submission.py 和 report.pdf 两个文件。助教会据此对你的作业进行评分。**注意事项**:

- 本次作业需独立完成,不允许任何形式的抄袭。如被发现,互相抄了一份作业的几名同学分配 此作业的分数。
- 本次作业的截止时间为 {2024/6/2}. 在此之后延迟 1/2/3/4 天会有 10/30/60/100 的额外扣分。

如果在做作业时任何问题,可以通过 腾讯文档 向助教提问,也欢迎同学帮助解答问题。

0. 导入

0.1 自动驾驶

世界卫生组织的一项研究发现,全球每年有 124 万人死于路交通事故。为此,人们对可以精确计算的自动驾驶技术表现出了极大的兴趣。构建一个自动驾驶系统是一项极其复杂的任务。在这项作业中,你将专注于传感系统,它允许我们基于噪声传感器读数追踪其他汽车。

在这项作业中,你将运行两个文件——grader.py 和 drive.py。drive.py 文件不用于任何评分目的,它只是用来可视化你将要编写的代码,并帮助你观察不同方法如何导致不同的行为(并且获得乐趣!)。

让我们开始尝试手动驾驶:

python drive.py -l lombard -i none

你可以使用箭头键或'w'、'a'和'd'来操控。向上键和'w'会使你的车向前加速,向左键和'a'会使方向盘向左转,向右键和'd'会使方向盘向右转。请注意,你不能倒车或原地转弯。按'q'退出。你的目标是从起点驾驶到终点(绿色框)而不发生事故。在道路上还有其他车辆,但是你不知道其他车辆的位置,你能安全地驾驶到终点吗?如果你做得不是很好也不要担心;教学人员只能 10 次中有 4 次到达终点。60%的事故率相当糟糕,这就是为什么我们要用 AI 来做这件事。

python drive.py的参数:

- -a: 启用自动驾驶(与手动相对)。
- -i < 推理方法 >: 使用 none, exactInference 来计算对其他汽车位置的信念分布。
- -l < 地图 >: 使用此地图 (例如 small 或 lombard)。默认为 small。
- -d: 通过在地图上显示所有汽车来调试。
- -p: 所有其他汽车保持静止(因此它们不会移动)。

0.2 问题描述

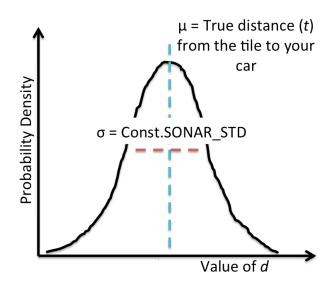
我们假设世界是一个二维矩形网格,你的车和其他 K 辆车就在这个网格上。在每一个时间步长 t,你的车会得到对每辆其他车距离的带有噪声的估计。为了简化假设,我们认为其他 K 辆车是独立移动的,对每辆车距离估计中的噪声也是独立的。因此,在下文中,我们将首先独立地对每辆其他车 进行推理。在下面的符号中,我们将假设只有一辆其他车,然后再进行推广。在每一个时间步长 t,设 $C_t \in \mathbb{R}^2$ 是一对坐标,代表单个其他车辆的实际位置(未被观察到)。我们假设有一个局部条件分布 $p(c_t|c_{t-1})$ 来控制其他车辆的移动。设 $a_t \in \mathbb{R}^2$ 是你的车的位置,你可以观察并控制它。

为了降低成本,我们使用了一个基于声波的简单感应系统。该系统为我们提供了 D_t ,它是一个高斯随机变量,其均值等于你的车与另一辆车之间的真实距离,方差为 σ^2 (在代码中, σ 是 Const. SONAR STD,大约是车长的三分之二)。

用数学符号表示为:

$$D_t \sim \mathcal{N}(\|a_t - C_t\|^2, \sigma^2)$$

例如,如果你的车位于 $a_t = (1,3)$ 而另一辆车位于 $C_t = (4,7)$,那么实际距离是 5,而 D_t 可能是 4.6 或 5.2 等。使用 util.pdf (mean, std, value) 来计算给定均值 mean 和标准差 std 的高斯概率密度函数 (PDF),在 value 处进行评估。请注意,评估某个值的 PDF 不会返回一个概率——密度可以超过 1——但是为了简化,你可以将返回的 PDF 值当作概率来处理。下图显示了以你与车辆距离 $\mu = \|a_t - C_t\|_2$ 为中心的噪声距离观测 D_t 的高斯概率密度函数:



你的任务是实现一个汽车追踪器,它(大致)计算后验分布 $P(C_t|D_1=d_1,...,D_t=d_t)$ (你对其他车辆位置的信念),并且对每个 t=1,2,... 进行更新。辅助代码将负责使用这些信息来实际驾驶汽车(即,设置 a_t 以避免与 c_t 碰撞),所以你不必担心这部分。

为了简化问题,我们将世界离散化为由 (row, col) 对表示的网格中,其中 $0 \le row < numRows$ 且 $0 \le col < numCols$ 。对于每个网格,我们存储一个代表我们相信该网格上有一辆车的概率。可以通过: self.belief.getProb(row, col) 访问这些值。要从一个网格转换为一个位置,使用util.rowToY(row) 和 util.colToX(col)。

0.3 贝叶斯网络

贝叶斯网络又称"信念网",它借助有向无环图来表示变量之间的依赖关系,并使用条件概率表来描述这些变量之间的联合概率分布。在这个问题中,我们将使用贝叶斯网络来描述汽车的位置和传感器读数之间的关系。

贝叶斯网络要实现两个基本问题:

- 推断: 给定一些变量的观察值,我们想要计算其他变量的后验分布。令 X 为我们想要推断的变量,E 为我们观察到的变量,已知其值为 $e = \{e_1, e_2, \ldots, e_n\}$,P(X = x | E = e) 为我们想要计算的后验分布。
- 学习: 给定一些数据, 我们想要估计贝叶斯网络的参数。需要学习的参数包括:

- 网络结构: 变量之间的依赖关系。

- 条件概率表: 描述变量之间的联合概率分布。

1. 问题 1: 概率推断 [25%]

在这个问题中,我们假设另外只有一辆车,并且它是静止的(例如,对于所有时间步 t , $C_t = C_{t-1} = C$)。我们将表示另一辆车静止位置的单一变量记为 C,并注意 p(C) 是一个已知的局部条件分布。你将实现一个函数 observe,该函数在观察到新的距离测量 $D_t = d_t$ 时,从当前的后验概率 $P(C|D_1 = d_1, ..., D_{t-1} = d_{t-1})$ 更新下一个时间步的后验概率 $P(C|D_1 = d_1, ..., D_t = d_t)$ 。当前的后验概率存储为 ExactInference 中的 self.belief。

你需要完成下面几个问题:

(a) [3 分] 画一个贝叶斯网络来描述变量 $C, D_1, D_2, D_3, a_1, a_2, a_3$ 的分布。你不需要考虑时间步长 t=3 之后的变量。

你需要回答的内容:一个贝叶斯网络的绘图,包含上述每个变量的节点。如果 p(X|Parents(X))是一个已知的局部条件分布,那么应该有一个箭头从X的每个父节点指向X。

(b) [5 分] 给出联合概率 $P(C = c, D_1 = d_1, D_2 = d_2, D_3 = d_3)$ 的表达式。你的表达式应该只使用贝叶斯网络给出的已知局部条件分布。回想一下,你的车在每个时间步的位置,即 a_1, a_2, a_3 ,是确定已知的。

你需要回答的内容:一个数学公式,用于描述上述变量的联合概率分布,该公式仅使用问题中给出的局部条件分布。

(c) [5 分] 现在假设我们已经计算了直到时间步长 t-1 的后验分布,即我们知道 $P(C|D_1=d_1,...,D_{t-1}=d_{t-1})$ 。我们进行了一个新的观察,即 $D_t=d_t$,我们希望将我们的后验分布 更新为 $P(C|D_1=d_1,...,D_t=d_t)$ 。未归一化的更新后的后验可以计算为:

$$P(C = c|D_1 = d_1, \dots, D_t = d_t) \propto P(C = c|D_1 = d_1, \dots, D_{t-1} = d_{t-1})p(d_t|C = c)$$

请你证明这个公式。

你需要回答的内容:一个证明,证明上述公式的正确性。

(d) [12 分] 根据 (c) 中的公式

$$P(C = c | D_1 = d_1, \dots, D_t = d_t) \propto P(C = c | D_1 = d_1, \dots, D_{t-1} = d_{t-1}) p(d_t | C = c)$$

在 submission.py 的 ExactInference 类中填写 observe 方法。这个方法应该直接修改 self.belief,以更新每个网格的后验概率,给定观察到的与另一辆车的噪声距离。完成后,你应该能够通过围绕它驾驶来找到静止的车(使用标志-p 意味着车辆不移动)。

注意:

• 一旦你实现了 observe 函数, 你就可以开始使用精确推理进行驾驶。

python drive.py -a -p -d -k 1 -i exactInference

你也可以不使用 -a 来手动驾驶。

- 在开始之前,请阅读 util.py 中的 Belief 代码,你将需要在这次作业的几个代码任务中使用这个类。
- 记得在更新后对后验概率进行归一化处理。(在 util.py 中有一个有用的函数可以做到这点)。
- 在小地图上,自动驾驶车辆有时会围绕中间的障碍物转圈,然后再前往目标区域。通常,不必过于担心车辆的确切路径。相反,应专注于你的车辆追踪器是否正确地推断出其他车辆的位置。
- 如果你的车偶尔发生碰撞,也不必担心!无论是人类还是人工智能,事故都会发生。然而,即 使发生了事故,你的驾驶员也应该意识到该区域有另一辆车的可能性很高。

2. 问题 2: 转移概率 [25%]

现在,让我们考虑另一辆车根据转移概率 $p(C_{t+1}|C_t)$ 移动的情况。我们已经在 self.transProb 中为你提供了转移概率。具体来说,self.transProb[(oldTile, newTile)] 是已知另一辆车 在时间步 t 在 oldTile 的前提下,在时间步 t+1 在 newTile 的概率。

你需要完成下面几个问题:

(a) [3 分] 描述变量 $C_1, C_2, C_3, D_1, D_2, D_3, a_1, a_2, a_3$ 分布的贝叶斯网络图。你不需要考虑时间步长 t=3 之后的变量。

你需要回答的内容:一个贝叶斯网络的绘图,包含上述每个变量的节点。如果 p(X|Parents(X))是一个已知的局部条件分布,那么应该有一个箭头从X的每个父节点指向X。

(b) [5 分] 给出联合概率 $P(C_1 = c_1, C_2 = c_2, C_3 = c_3, D_1 = d_1, D_2 = d_2, D_3 = d_3)$ 的表达式,该表达式仅使用已知的局部条件分布。你的表达式应该只使用贝叶斯网络给出的已知局部条件分布。回想一下,你的车在每个时间步的位置,即 a_1 a_2 a_3 ,是确定已知的。

你需要回答的内容:一个数学公式,用于描述上述变量的联合概率分布,该公式仅使用问题中给出的局部条件分布。

(c) [5 分] 现在假设我们已经得到了直到时间步 t 的车辆位置的条件概率 $P(C_t = c_t | D_1 = d_1, ..., D_t = d_t)$,我们已知另一辆车根据转移概率 $p(C_{t+1} | C_t)$ 移动。在时间步 t+1,我们希望计算条件概率 $P(C_{t+1} = c_{t+1} | D_1 = d_1, ..., D_t = d_t)$,证明下面的公式的正确性:

$$P(C_{t+1} = c_{t+1}|D_1 = d_1, ..., D_t = d_t) \propto \sum_{c_t} P(C_t = c_t|D_1 = d_1, ..., D_t = d_t) p(c_{t+1}|c_t)$$

你需要回答的内容:一个证明,证明上述公式的正确性。

(d) [12 分] 根据 (c) 中的公式

$$P(C_{t+1} = c_{t+1} | D_1 = d_1, ..., D_t = d_t) \propto \sum_{c_t} P(C_t = c_t | D_1 = d_1, ..., D_t = d_t) p(c_{t+1} | c_t)$$

实现一个 elapseTime 函数,该函数递归更新当前时间 t 的车辆位置的条件概率到下一个时间步 t+1。同样,后验概率存储为 ExactInference 中的 self.belief。

通过实现 elapseTime 方法完成 ExactInference。当你全部完成后,你应该能够足够好地 追踪一个移动的车辆,通过运行以下命令自动驾驶:

1 python drive.py -a -d -k 1 -i exactInference

注意:

• 你也可以在多于一辆车的情况下自动驾驶:

```
python drive.py -a -d -k 3 -i exactInference
```

• 你也可以在 Lombard 地图上执行:

```
1 python drive.py -a -d -k 3 -i exactInference -l lombard
```

在 Lombard, 自动驾驶可能会尝试在前往目标区域之前沿街道上下行驶。再次强调,专注于车辆追踪组件,而不是实际的驾驶过程。

3. 问题 3: 是哪辆车?[30%]

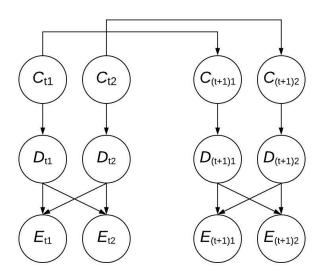
到目前为止,我们假设每辆车在每个时间步都有一个独特的噪声距离读数。实际上,我们的声波测距系统只会捕捉到这些信号的一个不加区分的集合,我们不知道哪个距离读数对应哪辆车。现在,我们将考虑这种更现实的情况。

首先,让我们扩展之前的符号: 设 $C_{ti} \in \mathbb{R}^2$ 为第 i 辆车在时间步 t 的位置,其中 i = 1, ..., K , t = 1, ..., T。回想一下,所有的车辆都根据之前的转移概率独立移动。

设 $D_{ti} \in \mathbb{R}$ 为第 i 辆车在时间步 t 的噪声距离测量值,这不再是直接观察到的。相反,我们观察到的是无序的距离集合 $\{D_{t1}, \ldots, D_{tK}\}$ 作为一个整体,因此不能将这个集合中的任何测量值确定给特定的车辆。(为了简单起见,我们假设所有距离都是不同的值。)换句话说,你可以将这种情况想象为观察列表 $E_t = [E_{t1}, \ldots, E_{tK}]$,它是噪声距离测量值 $D_t = [D_{t1}, \ldots, D_{tK}]$ 的一个均匀随机排列,其中索引 i 表示时间 t 对车 i 的噪声距离。

例如,假设 K=2 和 T=2。之前,我们可能在时间步 1 和 2 分别得到了第一辆车的距离读数 8 和 4,以及第二辆车的距离读数 5 和 7。现在,我们的传感器读数将是 8,5(在时间步 1)和 4,7(在时间步 2)的排列。因此,即使我们知道第二辆车在时间 t=1 时距离为 5,我们也不知道它在时间 t=2 是移动得更远(到距离 7)还是更近(到距离 4)。

下图显示了上述情况对应的信息,其中 K=2 并且只显示两个时间步 t 和 t+1。请注意,由于观察到的距离 E_t 是真实距离 D_t 的排列,每个 E_{ti} 依赖于所有的 D_{ti} 。另请注意,下图不是一个贝叶斯网络,因为 E_{t1} 和 E_{t2} 在给定 D_{t1} 和 D_{t2} 的情况下并不是条件独立的(然而, D_{t1} 和 D_{t2} 在给定 C_{t1} 和 C_{t2} 的情况下是条件独立的)。



你需要完成下面几个问题:

(a) [8 分]. 假设我们有 K=2 辆车和一个时间步长 T=1。写出条件概率 $p(C_{11}=c_{11},C_{12}=c_{12}|E_1=e_1)$ 关于高斯概率密度函数 $p_N(v;\mu,\sigma^2)$ 和先验概率 $p(c_{11})$ 与 $p(c_{12})$ 的函数表达式。注意,对于条件 $E_1=e_1$,我们说我们已经得到了一组观测值,但不知道哪个距离与哪辆车相关。你的最终答案不应包含变量 D_{11},D_{12} 。

注意 $p_N(v;\mu,\sigma^2)$ 是随机变量 v 在均值为 μ 和标准差为 σ 的高斯分布中的概率。

提示:对于K=1,答案将是

$$p(C_{11} = c_{11}|E_1 = e_1) \propto p(c_{11})p_N(e_{11}; ||a_1 - c_{11}||_2, \sigma^2)$$

其中 a_t 是你控制的车辆在时间 t 的位置。记住 C_{ti} 是第 i 辆观察到的车在时间 t 的位置。为了更好地使用贝叶斯网络,你可能会发现绘制贝叶斯网络并思考给定 D_{t1}, \ldots, D_{tK} 的 E_t 分布很有用。

提示: 注意观察到的变量是打乱/随机化的距离 $E_t = [E_{t1}, E_{t2}, \dots, E_{tK}]$ 。这些是未观察到的噪声距离 $D_t = [D_{t1}, D_{t2}, \dots, D_{tK}]$ 的随机排列,其中 D_{t1} 是时间步长 t 时车辆 1 的距离。注意 E_{t1} 是时间步长 t 时某辆车的测量距离,但我们不确定是哪一辆(它不一定是车辆 1,可能是任何车辆)。另一方面, D_{t1} 是车辆 1 的测量距离(我们确信它来自车辆 1),唯一的问题是我们没有直接观察到它。

提示: 为了减少符号, 你可以写 $p(c_{11}|e_{11})$ 替代 $p(C_{11}=c_{11}|E_{11}=e_{11})$ 。

你需要回答的内容:一个数学表达式,以及你推导该表达式的步骤,将 $p(C_{11} = c_{11}, C_{12} =$

 $c_{12}|E_1=e_1)$ 与高斯概率密度函数和车辆位置的先验 $p(c_{11})$ 和 $p(c_{12})$ 相关联(可以是成比例的)。

(b) [8 分]. 假设现在你更换了传感器,使得在每个时间步 t,它们返回 K 辆车的确切位置列表,但位置列表会随机移动若干个索引(并且可以环绕)。例如,如果在时间步 1 真实的车辆位置是 $c_{11}=(1,1),c_{12}=(3,1),c_{13}=(8,1),c_{14}=(5,2)$,那么 e_1 可能是 [(1,1),(3,1),(8,1),(5,2)]、[(3,1),(8,1),(5,2),(1,1)]、[(8,1),(5,2),(1,1),(3,1)] 或 [(5,2),(1,1),(3,1),(8,1)],每个都有 1/4的概率。这个移动可以从一个时间步到下一个时间步改变。

定义辅助变量 z_1, z_2, \ldots, z_t ,它们可以用来模拟 c_t 和 e_t 之间的关系。给出 $p(c_t \mid c_{t-1})$ 关于 e_1, \ldots, e_t 和 z_t 的表达式。

你需要回答的内容: 辅助变量 z_t 的描述及其域, 以及 $p(c_t \mid c_{t-1})$ 的表达式。

(c) [10 分]. 继问题 b 之后, 描述一个有效的算法来计算任何时间步长 t 和车辆 i 的 $p(c_{ti}|e_1,\ldots,e_T)$ 。 你的算法不应该是 K 或 T 的指数级别的。

你需要回答的内容: 当建模问题时,使用的因子图/贝叶斯网络的描述,包括任何相关变量和条件概率。此外,描述你如何使用因子图来计算所提供的概率。请注意,你应尽可能简化所提供信息的概率表达式。

(d) [4 分]. 虽然对小地图进行精确推断效果很好,但它浪费了大量的计算量,因为需要为每个网格计算概率,即使对于可能没有车辆的网格也是如此。我们可以使用粒子滤波器来解决这个问题。使用粒子滤波时,程序的复杂度是 O(numParticles),而不是 O(numTiles)。

要了解粒子滤波器的工作原理,请查看<mark>视频</mark>,介绍如何使用粒子滤波器来估计飞机的高度。假设我们现在使用粒子滤波,这是一种更高效的基于蒙特卡洛的汽车跟踪方法。我们已经填写了粒子滤波的代码。只需运行

python drive.py -a -d -k 3 -i particleFilter

你需要回答的内容: 说明模拟与精确推理情况的不同之处, 并提供原因。

4. 问题 4: 模型学习 [10%]

上述的问题中,我们并没有涉及到如何学习贝叶斯网络的参数。因为贝叶斯网络的结构和概率表是已知的,所以我们可以直接进行推断。然而,在实际应用中,我们通常需要从数据中学习贝叶斯网络的参数。在这个问题中,我们将考虑如何从数据中学习贝叶斯网络的参数。

未观测的变量称为"隐变量" (latent variable),例如,在问题 2 中,我们的隐变量是另一个车辆的位置 C_t 。

在这个问题中,我们将考虑如何从观测到的数据中学习隐变量的分布,并且学习概率表的参数。 我们将使用 EM 算法来学习这些参数。 EM 算法的基本思想是, 我们首先初始化参数, 然后交替地进行两个步骤: E 步骤和 M 步骤。在 E 步骤中, 我们计算隐变量的后验分布, 即给定观测数据和当前参数, 隐变量的分布。在 M 步骤中, 我们更新参数, 以最大化对数似然。伪代码见下:

Algorithm 1 EM 算法

Require: 观测变量 X = x, 隐变量 Z, 最大迭代次数 T

Ensure: 模型参数 θ 1: 初始化参数 $\theta^{(0)}$

2: for t = 0 to T - 1 do

3: E **步骤**: 计算隐变量 Z 的后验分布 $q(z) = P(Z = z | X = x, \boldsymbol{\theta}^{(t)})$

4: M **步骤**:最大化对数似然函数,更新参数

$$\boldsymbol{\theta}^{(t+1)} = \arg\max_{\boldsymbol{\theta}} \mathbb{E}_{\mathbf{Z} \sim q(\mathbf{Z})}[\log P(\mathbf{X}, \mathbf{Z} | \boldsymbol{\theta})]$$

5: end for

在本次课程中,我们并不希望你实现 EM 算法,但是我们希望你了解 EM 算法的基本思想。你需要完成下面几个问题:

(a) [10 分] 考虑一个贝叶斯网络,其中包含两个二元隐变量 Z_1 和 Z_2 ,以及两个二元观测变量 X_1 和 X_2 。隐变量之间有依赖关系,观测变量依赖于隐变量。

初始的概率表见 Table 1。

概率	值
$P(Z_1 = true)$	0.6
$P(Z_1 = false)$	0.4
$P(Z_2 = true Z_1 = true)$	0.7
$P(Z_2 = false Z_1 = true)$	0.3
$P(Z_2 = true Z_1 = false)$	0.2
$P(Z_2 = false Z_1 = false)$	0.8
$P(X_1 = true Z_1 = true)$	0.9
$P(X_1 = false Z_1 = true)$	0.1
$P(X_1 = true Z_1 = false)$	0.5
$P(X_1 = false Z_1 = false)$	0.5
$P(X_2 = true Z_2 = true)$	0.3
$P(X_2 = false Z_2 = true)$	0.7
$P(X_2 = true Z_2 = false)$	0.6
$P(X_2 = false Z_2 = false)$	0.4

Table 1: 初始的概率表

假设我们有观测数据集 Table 2:

 X_1 X_2 true false true true

Table 2: 观测数据

你需要执行一步 E、M 步骤。在 E 步骤中,你需要计算隐变量的后验分布,即给定观测数据和 当前参数,隐变量的分布。在 M 步骤中,你需要更新参数,以最大化对数似然,在本题中,你 可以进行对变量进行计数和归一化来最大化似然函数。

你需要回答的内容: 执行一步 E、M 步骤后的概率表。

(b) [0 分] 请你阅读网页, 简要了解 EM 算法的收敛性

5. Feedback [10%]

引言 你可以写下任何反馈,包括但不限于以下几个方面:课堂、作业、助教工作等等。

必填 你在本次作业花费的时间大概是? 觉得难度如何?

选填 你可以随心吐槽课程不足的方面,或者给出合理的建议。若没有想法,直接忽略本小题即可。