

RL INSANE

Esse resumo é e será completamente baseado no livro “Reinforcement Learning An Introduction - 2ed” de Richard S. Sutton e Andrew G. Barto e das aulas e do github do professor Flávio Codeço Coelho.

Se alguém for ler, considere que eu estou aprendendo a matéria, e não a cursei totalmente ainda, provavelmente terão erros.

1 - Introdução

1.1 - Reinforcement Learning

Em vez de ser teórico, o livro gostaria de começar ensinando diretamente como simular o aprendizado computacionalmente, sem ficar dando exemplos da vida real, como o aprendizado de bebês, etc. “O agente não terá a certeza de qual ação fazer, mas descobrirá qual a ação trará a maior recompensa por tentá-la. Nos desafios mais interessantes, as ações não irão afetar apenas o momento atual, mas sim todas as ações subsequentes”.

O problema de aprendizado por reforço será formalizado usando ideias da Teoria de Sistemas Dinâmicos, especificamente, controle ótimo do processo de decisão incompleto de Markov.

“Um agente de aprendizagem deve ser capaz de sentir o estado de seu ambiente até certo ponto e deve ser capaz de tomar ações que afetem o estado. O agente também deve ter um ou mais objetivos relacionados ao estado do ambiente. Os processos de decisão markovianos visam incluir apenas esses três aspectos — sensação, ação e objetivo — em suas formas mais simples possíveis, sem banalizar nenhum deles. “

Vale lembrar que Aprendizado por Reforço é diferente do Aprendizado Supervisionado, já que o supervisionado é um aprendizado feito com um conjunto de dados já rotulados dado por um supervisor externo (basicamente o que foi feito em Técnicas e Algoritmos para Ciência de Dados, com o Pacannaro). Além disso, Aprendizado por reforço também não é o mesmo que Aprendizado Não Supervisionado, já que essa busca encontrar estruturas escondidas em dados não rotulados.

Aprendizado por reforço é considerado como o terceiro paradigma do Aprendizado de Máquina, ao lado do Aprendizado Supervisionado e Não Supervisionado, e outros paradigmas.

Uma característica específica do Aprendizado por reforço, é o trade-off da exploração de novas possibilidades e da exploração do que já se sabe. “Para obter uma grande recompensa, um agente de aprendizagem por reforço deve preferir ações que já tentou no passado e que se mostraram eficazes na produção de recompensa. Mas, para descobrir tais ações, ele precisa tentar ações que não selecionou antes. O agente precisa explorar o que já experimentou para obter recompensa, mas também precisa explorar para fazer melhores seleções de ações no futuro.”

“Outra característica fundamental do aprendizado por reforço é que ele considera explicitamente todo o problema de um agente orientado a um objetivo interagindo com um ambiente incerto. Isso contrasta com muitas abordagens que consideram subproblemas

sem abordar como eles podem se encaixar em um cenário mais amplo. Por exemplo, mencionamos que grande parte da pesquisa em aprendizado de máquina se concentra no aprendizado supervisionado sem especificar explicitamente como tal habilidade seria útil.”

O aprendizado por reforço começa com um agente completo, interativo e objetivo. Todos os agentes tem metas explícitas, podem sentir os aspectos do seu ambiente e conseguem escolher suas ações para influenciar seus resultados.

1.2 Exemplos

1. Um mestre em xadrez faz um movimento. A escolha é baseada tanto no planejamento — antecipando possíveis respostas e contra-respostas — quanto em julgamentos imediatos e intuitivos sobre a conveniência de determinadas posições e movimentos.
2. Um controlador adaptativo ajusta os parâmetros da operação de uma refinaria de petróleo em tempo real. O controlador otimiza a relação rendimento/custo/qualidade com base nos custos marginais especificados, sem se ater estritamente aos pontos de ajuste originalmente sugeridos pelos engenheiros.
3. Uma gazela luta para ficar de pé após acabar de nascer. 20 minutos depois, ela consegue correr a 20 milhas por hora.
4. Phil prepara seu café da manhã. Abrir o armário, selecionar o cereal, pegá-lo, fechar o armário, pegar uma tigela, encontrar o leite, misturar... Uma série de julgamentos são feitos, ele deve se locomover, acessar informações do seu corpo, como força, preferência de alimentação, nível de fome, etc.

Todos esses exemplos envolvem interação entre um agente tomador de decisão e seu ambiente, com o agente buscando atingir uma meta mesmo sem saber tudo sobre seu ambiente.

1.3 - Elementos do Aprendizado de Máquina

Por trás do agente e do ambiente, podemos identificar quatro subelementos de um sistema de Aprendizado por reforço:

1. A **política** define o aprendizado do agente e o comportamento que ele deverá ter em dado momento. Grossamente falando, a política é um mapeamento de estados percebidos do ambiente para as ações que podem ser tomadas quando nesse estado. Em geral, pode ser estocástica, determinando probabilidades de cada ação.
2. Um sinal de **recompensa** define a meta do problema de aprendizado. A cada passo, o ambiente envia ao agente um número chamado de recompensa. O objetivo do agente é maximizar essa recompensa por todo o caminho que ele percorre. Logo, o sinal de recompensa mostra o que são eventos ruins e bons para o agente.
 - O sinal de recompensa é a base principal para alterar a política; se uma ação selecionada pela política for seguida de uma recompensa baixa, a política pode ser alterada para selecionar alguma outra ação naquela situação no futuro. Em geral, os sinais de recompensa podem ser funções estocásticas do estado do ambiente e das ações tomadas.

3. Enquanto a recompensa indica o que é bom no senso imediato do agente, a **função de valor** mostra o que é bom no longo prazo. Por exemplo, um estado pode dar uma recompensa baixa de imediato, mas ter um alto valor pois os estados que se seguem trazem recompensas maiores.
 - Podemos dizer que a recompensa são de senso primário, enquanto valores são secundários. No entanto, são os valores que mais nos preocupam ao tomar e avaliar decisões. As escolhas de ação são feitas com base em julgamentos de valor. Por isso, buscamos ações que gerem estados de maior valor, não de maior recompensa, porque essas ações nos proporcionam a maior recompensa a longo prazo.
4. O elemento final é o **modelo do ambiente**. Isso é algo que imita o comportamento do ambiente ou, de forma mais geral, que permite fazer inferências sobre como o ambiente se comportará. Por exemplo, dado um estado e uma ação, o modelo do ambiente deveria prever o próximo estado e a próxima recompensa. Os métodos para resolver problemas de aprendizagem por reforço que utilizam modelos e planejamento são chamados de métodos baseados em modelos, e são o contrário de métodos mais simples sem modelos que são explicitamente aprendizes de tentativa e erro.

1.4 - Limitações e escopo

O estado é um conceito central em aprendizado por reforço, servindo como entrada para a política, a função de valor e o modelo. Informalmente, pode ser entendido como o sinal que descreve “como o ambiente está” em um dado momento.

Embora muitos métodos de aprendizado por reforço se baseiem em funções de valor, isso não é obrigatório. Métodos evolutivos (como algoritmos genéticos e programação genética) não usam funções de valor: eles testam várias políticas em paralelo, selecionam as mais recompensadas e geram novas políticas a partir delas, de forma análoga à evolução biológica. Esses métodos podem ser eficazes em certos contextos (por exemplo, quando o espaço de políticas é pequeno ou quando há bastante tempo disponível), e podem lidar bem com situações em que o agente não percebe o estado completo do ambiente.

1.5 - Tic-Tac-Toe (jogo da velha)

Vamos considerar que empates e perdas são igualmente ruins. Como construir um jogador que encontre as falhas nas jogadas de um oponente (considerando um que consiga perder), que aprenda a maximizar as chances de vitória? Basicamente, esse jogo pode ser resolvido de outra forma, mas não de forma satisfatória sem o Aprendizado por Reforço. Enfim, vamos resolver usando um método de função de valor.

Primeiro fazemos uma tabela de números, um para cada estado possível do jogo. O estado A será escolhido se for maior que o estado B, e, assumindo que sempre jogaremos com os X's, se tivermos 3 X's em uma diagonal, linha ou coluna, então nossa probabilidade de ganhar é 1. No caso inverso, onde tem 3 bolas nessas posições, então a probabilidade de vencer é 0. Definimos o restante dos estados, inicialmente valendo 0.5, representando 50% de chance.

Continuamos jogando várias partidas contra o oponente, e para, selecionarmos os estados que iremos escolher, normalmente nos moveremos gananciosamente (greedy), buscando

o maior valor. Por vezes, mudaremos isso e escolheremos um valor aleatório, significando movimentos exploratórios, com o objetivo de experienciar outros estados.

Durante o jogo, os valores dos estados são atualizados continuamente para refletirem melhor a probabilidade de vitória. Isso é feito por meio de um processo de backup: o valor de um estado anterior $V(S_t)$ é ajustado para ficar mais próximo do valor do estado seguinte $V(S_{t+1})$

$$V(S_t) \leftarrow V(S_t) + \alpha[V(S_{t+1}) - V(S_t)] \quad (1)$$

onde α é uma pequena fração positiva chamada de parâmetro de taxa de passo(step-size), que influencia a velocidade do aprendizado. Essa regra de atualização é um exemplo de um método de aprendizado por diferença temporal (temporal-difference learning), assim chamado porque suas mudanças se baseiam em uma diferença, $V(S_{t+1}) - V(S_t)$, entre estimativas em dois instantes sucessivos.

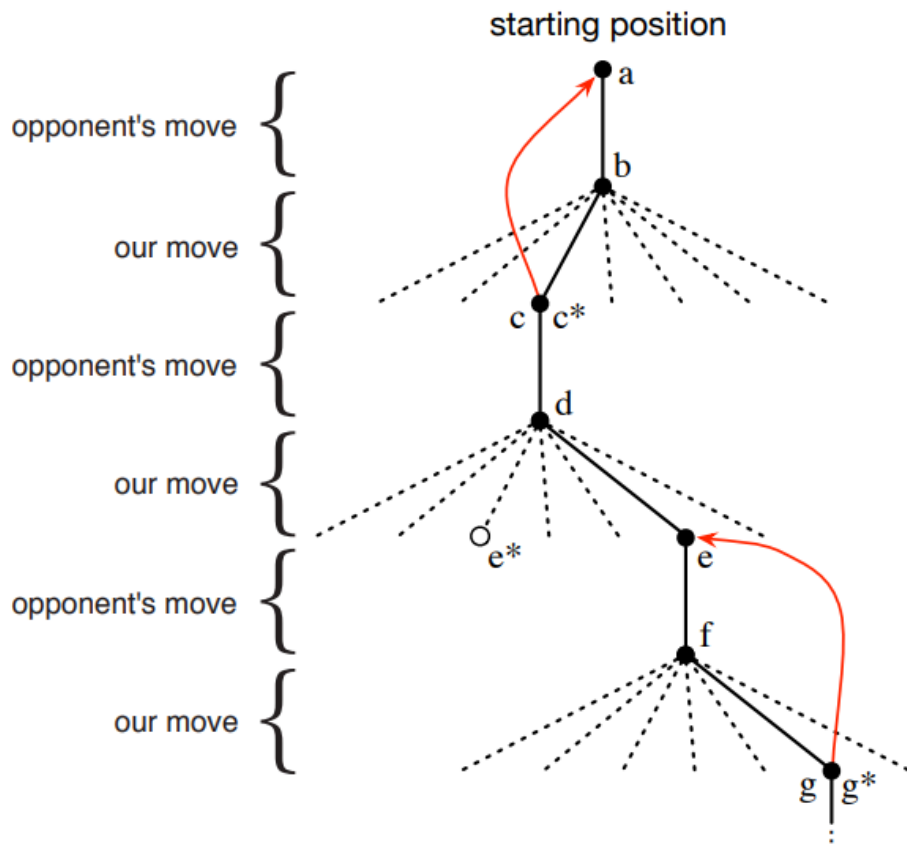


Figura 1: Uma sequência de movimentos no tic-tac-toe. As linhas pretas contínuas representam os movimentos feitos durante uma partida; as linhas tracejadas representam movimentos que nós (o agente) consideramos, mas não realizamos. Nosso segundo movimento foi um movimento exploratório, ou seja, foi realizado mesmo que outro movimento alternativo, aquele que leva a e^* tivesse classificação mais alta. Movimentos exploratórios não resultam em aprendizado, mas cada um dos outros movimentos resulta, causando atualizações conforme sugerido pelas setas vermelhas, nas quais os valores estimados são propagados para cima na árvore, de nós posteriores para nós anteriores.

- talvez um código vai ser colocado em algum lugar simulando isso??

Esse exemplo mostra a diferença entre métodos evolutivos e métodos função de valor(no caso, a solução desse problema aborda o método de função de valor, pois nós atualizamos o valor do estado a cada jogada com base na diferença temporal), onde para evoluir a política usando o método evolutivo nós usamos a mesma política e jogamos diversas vezes contra o oponente, analisando apenas a saída final (vitória/derrota). No fim, ambos os métodos buscam o espaço das políticas, mas aprender a função de valor faz com que se ganhe vantagem das informações disponíveis durante cada jogo (aparentemente, o método evolutivo não faz parte do aprendizado por reforço).

Vale lembrar que o Aprendizado por reforço é mais geral que apenas esse exemplo e que abrange vários problemas maiores com características diferentes, como os que não tem um adversário, desafios sem uma separação exata(sem começo e fim), com recompensas a qualquer momento e que também pode ser aplicado a um cenário contínuo.

“O quão bem um sistema de aprendizado por reforço pode funcionar em problemas com conjuntos de estados tão grandes está intimamente ligado à sua capacidade de generalizar adequadamente a partir de experiências passadas. É nesse papel que temos a maior necessidade de métodos de aprendizado supervisionado com aprendizado por reforço.”

Por fim, existem métodos que não precisam de nenhum tipo de modelo de ambiente em geral. O jogo da velha por si próprio é model-free no contexto de jogador, já que não há nenhum tipo de modelo para o oponente do agente. “Como os modelos precisam ser razoavelmente precisos para serem úteis, os métodos sem modelo podem ter vantagens sobre métodos mais complexos quando o verdadeiro gargalo na resolução de um problema é a dificuldade de construir um modelo de ambiente suficientemente preciso.”

1.6 - Sumário

O Aprendizado por reforço é uma abordagem computacional para entender e automatizar o aprendizado e a tomada de decisão orientados a objetivos, diferenciando-se por enfatizar o aprendizado de um agente a partir da interação direta com o ambiente, sem supervisão explícita nem modelos completos. Baseia-se no formalismo de Processos de Decisão de Markov, que descrevem a interação em termos de estados, ações e recompensas, capturando causa e efeito, incerteza e a presença de metas. Um conceito central é a função de valor, fundamental para guiar a busca eficiente no espaço de políticas, sendo justamente o uso dessas funções o que distingue os métodos de aprendizado por reforço dos métodos evolutivos, que avaliam apenas políticas inteiras.

1.7 Pequena história do Aprendizado por Reforço

Desculpe, mas eu sei tão pouco sobre isso que resumir seria um pecado, pois não sei nada de história.

Part I - Soluções de métodos tabulares

Nessa parte do livro iremos falar sobre a resolução de problemas que podem ser representados por arrays e tabelas(por isso o nome métodos tabulares). Ou seja, o espaço das ações e os estados são pequenos o suficiente para serem armazenados, cada espaço possível. Nesse caso, os métodos podem achar o valor exato das soluções, ou seja, o valor exato do valor ótimo da função e a política exata.

O primeiro capítulo dessa parte vai falar sobre problemas tabulares onde há apenas um único estado, chamado de bandit problems(ou bandidos de um braço só, ou multi-armed bandits). O segundo capítulo descreve problemas mais gerais onde iremos falar sobre processos de Markov finitos e suas principais ideias, etc.

2 - Bandidos de muitos braços (Multi-armed bandits)

A característica mais importante do Aprendizado por Reforço que a difere de outros tipos de aprendizados é que ela utiliza informações de treino que avalia as ações já tomadas, ou seja, enquanto o Aprendizado Supervisionado dá um feedback instrutivo, isto é, o feedback não depende da ação tomada, no Aprendizado por Reforço, o feedback é instrutivo, ou seja, o feedback depende inteiramente da ação tomada.

Nesse capítulo vamos ver o aspecto do feedback avaliativo simplificado, que não envolve aprender a agir em mais de uma situação, ou seja, teremos sempre apenas um estado, e depois generalizaremos.

2.1 - O problema do bandido k-armado

Considere o seguinte problema: você seguidamente tem que escolher entre k opções, ou ações, e depois de cada escolha você recebe uma recompensa de uma distribuição de probabilidade estacionária que depende da sua escolha.

Nota: o jogo da velha, explicado no capítulo passado, não é um problema que se enquadra como bandido k -armado, já que cada estado depende dos anteriores, e cada jogada muda o estado do tabuleiro. Como exemplo simples de um problema do bandido 1-armado, pense apenas num caça níquel, onde só existe uma ação(puxar o braço), as recompensas são sempre diferentes, e só existe um estado possível.

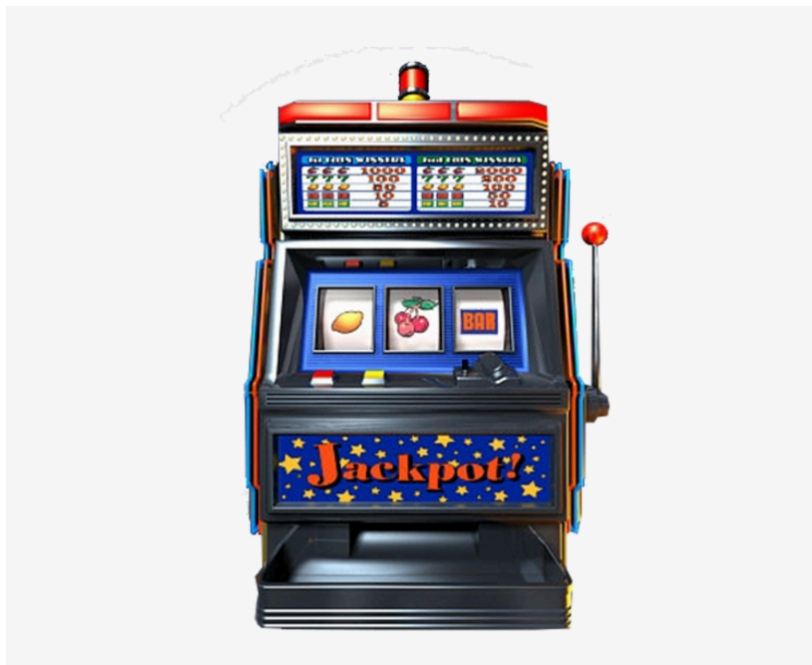


Figura 2: Caça-níquel

Nesse problema do bandido k -armado, cada uma das k -ações tem uma média esperada dada a ação selecionada(vamos chamar isso de valor da função). Nós iremos denotar a ação selecionada no tempo t como A_t , e a sua respectiva recompensa como R_t . Então, o

valor de uma ação arbitrária a , denotado $q_*(a)$, é o valor esperado da recompensa dado que a foi escolhido:

$$q_*(a) \doteq \mathbb{E}[R_t \mid A_t = a] \quad (2)$$

Se soubermos o valor de cada ação, então seria trivial para resolver o problema do bandido k -armado: basta selecionar a ação com maior recompensa. Porém, em geral, não sabemos o valor exato da ação, embora possamos ter estimadores. Denotamos o valor estimado do valor de uma ação a no tempo t como $Q_t(a)$. Nós claramente gostaríamos que $Q_t(a)$ fosse próximo de $q_*(a)$.

Se mantivermos estimativas dos valores das ações, então, em qualquer tempo t , existe pelo menos uma ação cujo valor estimado é o maior. Por isso, chamamos essas de ações gananciosas (greedy actions). Quando selecionamos uma dessas ações, dizemos que estamos explorando(exploiting) o conhecimento atual dos valores das ações.

Se, em vez disso, selecionarmos uma das ações não gananciosas, então dizemos que estamos explorando(exploring), porque permite melhorar sua estimativa do valor dessa ação não gananciosa. A exploração (exploitation) é a escolha correta para maximizar a recompensa esperada em um único passo, mas a exploração (exploration) pode gerar uma recompensa total maior a longo prazo.

Por exemplo, suponha que o valor de uma ação gananciosa seja conhecido com certeza, enquanto várias outras ações são estimadas como quase tão boas, mas com bastante incerteza. A incerteza é tal que pelo menos uma dessas outras ações provavelmente é, na verdade, melhor que a gananciosa, mas o agente não sabe qual, pois não explorou ainda.

Se o agente ainda tiver muitos passos futuros para escolher ações, pode ser melhor explorar as ações não gananciosas e descobrir quais delas são melhores que a gananciosa. A recompensa será menor no curto prazo, durante a exploração, mas maior no longo prazo porque, depois de descobrir as melhores ações, você poderá explorá-las repetidamente. Como não é possível explorar e explorar ao mesmo tempo em uma única escolha de ação, fala-se frequentemente no “conflito entre exploração(exploitation) e exploração(exploration)”.

O livro enfatiza que esse problema de balanceamento entre exploitation e exploration é recorrente, já que não podemos escolher duas ações diferentes ao mesmo tempo. Em geral, existem métodos específicos para rebalancear isso, mas normalmente são necessários fortes afirmações sobre conhecimentos do modelo que são impossíveis de verificar em aplicações completas de Aprendizado por Reforço.

2.2 - Métodos baseados em valores de ações

Qual seria uma forma natural de estimar o valor de uma ação selecionada $Q_t(a)$? Intuitivamente, uma boa resposta seria a média das recompensas de quando a ação a foi escolhida, ou seja:

$$Q_t(a) \doteq \frac{\text{soma das recompensas quando } a \text{ é tomada antes de } t}{\text{número de vezes que } a \text{ foi tomada antes de } t} = \frac{\sum_{i=1}^{t-1} R_i \cdot \mathbb{1}_{A_i=a}}{\sum_{i=1}^{t-1} \mathbb{1}_{A_i=a}} \quad (3)$$

onde $\mathbb{1}_{\text{ação}}$ denota a variável aleatória que é 1 se ação é verdadeiro e 0 caso contrário. Se o denominador for zero, então definimos $Q_t(a)$ como quisermos, normalmente 0. Se o denominador tender à infinito, pela Lei dos Grandes Números, $Q_{t(a)}$ converge a $q_*(a)$. É claro que essa não é a única abordagem para estimar o valor de uma ação, e muito menos a melhor métrica.

A ação mais simples normalmente é apenas selecionar a ação de maior valor, e em caso de empate, sortear, ou ainda selecionar alguma arbitrariamente. Nós escrevemos essa seleção de ação gananciosa como:

$$A_t \doteq \operatorname{argmax}_a Q_{t(a)} \quad (4)$$

onde argmax_a denota a ação a para a qual a expressão acima é maximizada. Ok, mas como explicado na seção anterior, normalmente escolher apenas a melhor ação sempre não é a melhor ideia.

Uma alternativa simples para escolher é se comportar de maneira gananciosa na maior parte do tempo, mas de vez em quando, com uma pequena probabilidade ε , selecionarmos aleatoriamente entre todas as ações com probabilidade igual, independentemente das estimativas de valor das ações. Nós chamamos métodos que usam essa regra de seleção quase-greedy de métodos ε -greedy.

Uma vantagem desses métodos é que, no limite, à medida que o número de passos aumenta, toda ação será amostrada um número infinito de vezes, garantindo assim que todas as estimativas convirjam para o valor verdadeiro. Isso implica que a probabilidade de selecionar a ação ótima convirja para maior que $1 - \varepsilon$ ou seja, para quase certeza.(como?)

2.3 - O banco de teste de 10 braços

Para avaliar o efeito de um método totalmente ganancioso de um método ε -ganancioso, nós os compararemos numericamente em um conjunto de problemas. Esse foi um conjunto de 2000 problemas do bandido k -armado com $k = 10$. Para cada valor da ação, $q_*(a) \sim \mathbb{N}(0, 1)$, $a = 1, \dots, 10$ (lembre que como $k = 10$, temos 10 ações possíveis). Então, quando um método de aprendizado era aplicado e selecionava a ação A_t no instante t , a recompensa real $R_t \sim \mathbb{N}(q_*(A_t), 1)$, ou seja, uma distribuição normal centrada em $q_*(A_t)$ e variância 1.

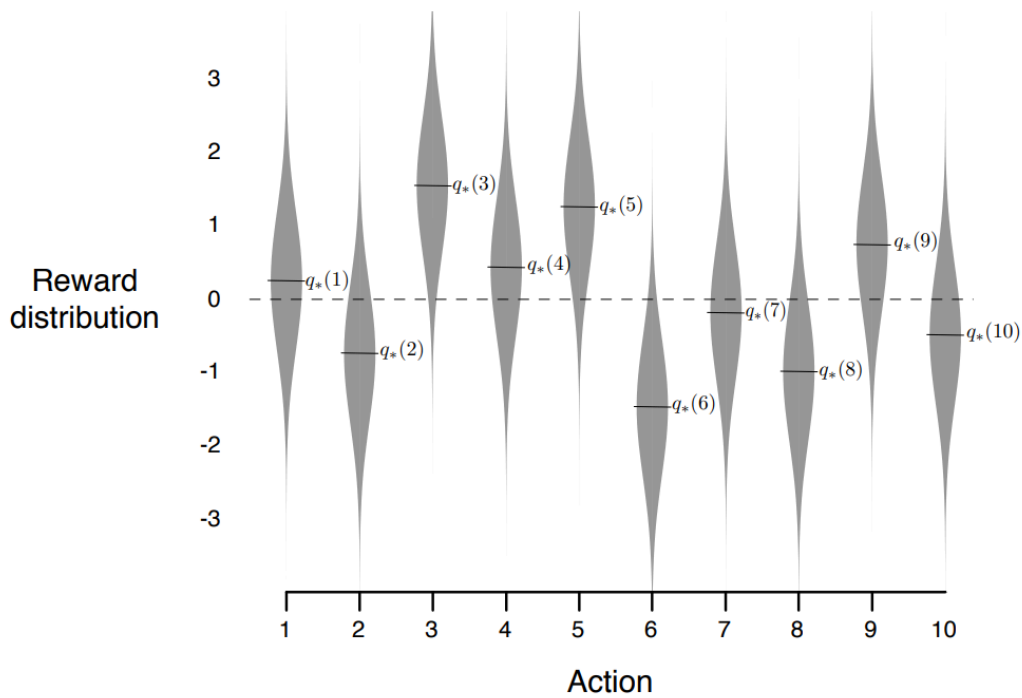


Figura 3: Um exemplo do problema do bandido 10-armado. O valor real $q_*(a)$ de cada uma das dez ações foi selecionado de acordo com uma distribuição normal com média zero e variância unitária e as recompensas reais foram selecionadas de acordo com uma distribuição normal de média $q_*(a)$ e variância unitária, conforme sugerido por essas distribuições em cinza.

Para qualquer método de aprendizado, nós podemos mensurar a performance e o comportamento realizando 1000 ações para cada bandido 10-armado. Isso é uma execução, faremos 2000 delas, pois temos 2000 bandidos 10-armados diferentes e tiraremos a média como estimativa.

A Figura 4 compara um método totalmente ganancioso com outros dois métodos ε -ganancioso ($\varepsilon = 0.01$ e $\varepsilon = 0.1$). Todos os métodos performaram usando a média amostral. o gráfico de cima mostra o crescimento da recompensa média com a experiência dos passos e o de baixo a porcentagem de ações ótimas.

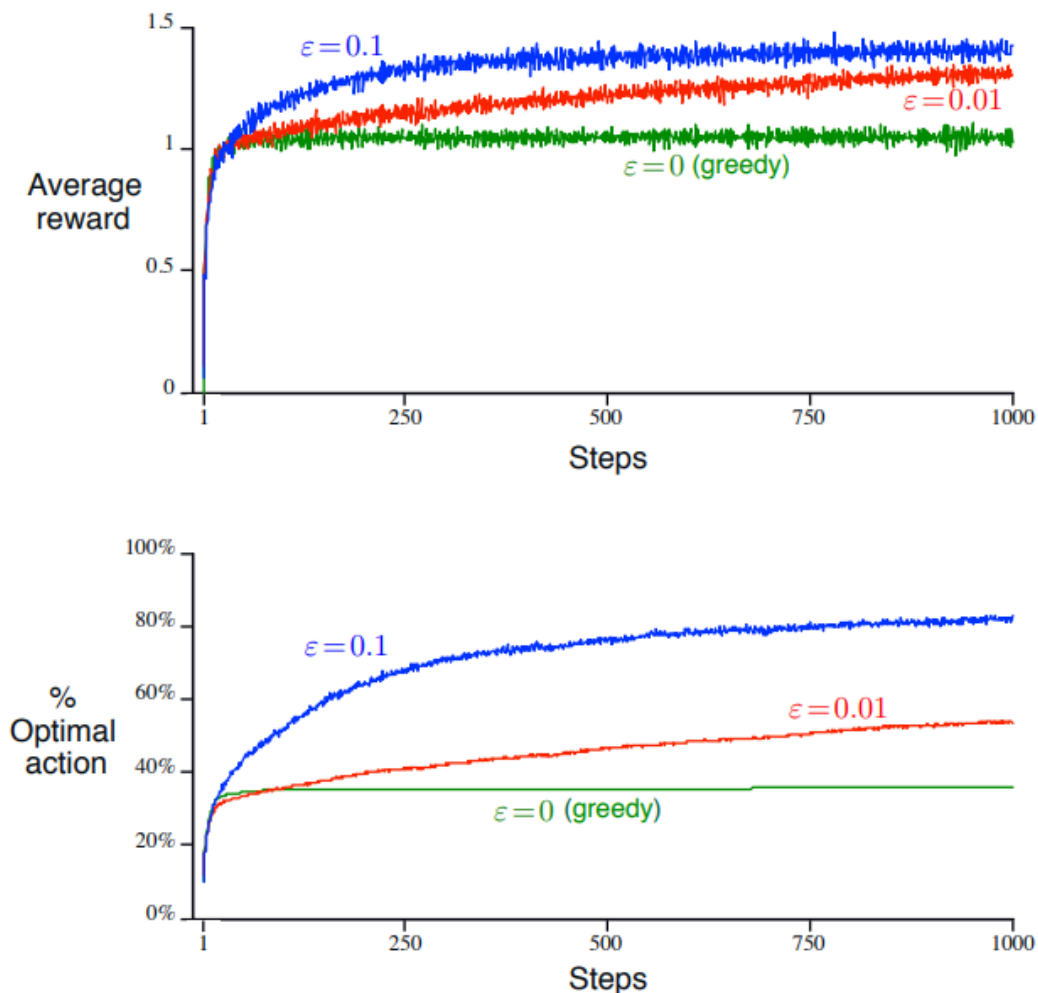


Figura 4:

Note como acontece basicamente tudo o que falamos até agora, ou seja, no extremo começo, a ação completamente gananciosa ganha, porém, depois, perde para todos os dois métodos ϵ -greedy. Além, note que a recompensa média do método completamente ganancioso se estagna em 1, enquanto o método menos ganancioso tem um valor médio de 1,5, muito próximo do valor máximo da figura 3. Ainda, perceba como a porcentagem de ações ótimas do método ganancioso fica completamente estagnada, enquanto a do 0,1-greedy chega em valores maiores que 80%.

O autor termina dizendo que em casos determinísticos, ou seja, quando a variância é 0, significa que o valor de todas as ações tem o mesmo valor, logo, o método completamente ganancioso funciona melhor. No caso contrário (não determinístico), temos uma variância (considere uma maior que 1) então usar um método ϵ -greedy será melhor para otimizar o valor das ações.

Ainda, em casos não estacionários, ou seja, quando o valor das ações pode mudar, significa que o ϵ -greedy é ainda mais importante, já que fixar-se numa ação que muda de valor é pior, sabendo que ela pode decair ainda mais, e o agente nunca saberá qual é a maior recompensa.

2.4 - Implementação incremental

Como computar de maneira eficiente todos esse valores de ações com menos cálculo e memória constante?

Vamos nos concentrar em somente uma ação. Considere que R_i denota a recompensa recebida após a i ésima seleção dessa ação, e chame de Q_n a estimativa do valor da ação depois de ela ser selecionada $n - 1$ vezes. Logo

$$Q_n \doteq \frac{R_1 + R_2 + \dots R_{n-1}}{n - 1}. \quad (5)$$

Parando para pensar, isso não resolveria o problema, já que mesmo assim, ao escolher a ação, teríamos que somar tudo novamente, guardar o valor novamente, etc... Mas, não precisamos disso, já que

$$\begin{aligned} Q_{n+1} &= \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n R_i \\ &= \frac{1}{n} \left(R_n + \sum_{i=1}^{n-1} R_i \right) \\ &= \frac{1}{n} \left(R_n + (n-1) \cdot \frac{1}{n-1} \sum_{i=1}^{n-1} R_i \right) \\ &= \frac{1}{n} (R_n + (n-1)Q_n) \\ &= \frac{1}{n} (R_n + nQ_n - Q_n) \\ &= Q_n + \frac{1}{n} [R_n - Q_n] \end{aligned} \quad (6)$$

Legal! Conseguimos chegar em uma equação pequena que depende apenas das estimativa da ação passada e da recompensa passada.

Generalizando ainda mais, nós chegamos em uma fórmula interessante:

$\text{NovaEstimativa} \leftarrow \text{EstimativaAntiga} + \text{PequenoPasso} [\text{Alvo} - \text{EstimativaAntiga}]$.

Que se parece bastante com a fórmula que vimos no Tic-Tac-Toe, mas agora entendemos de onde vêm.

- Colocar aqui o pseudocódigo talvez?

2.5 - Monitorando um problema não estacionário

Os métodos discutidos anteriormente foram para problemas de bandidos estacionários, ou seja, problemas em que as recompensas não mudam de acordo com o tempo. No caso não estacionário, talvez seja melhor dar um peso maior às recompensas mais recentes. Uma sugestão para fazer isso é mudando o PequenoPasso(step-size) da atualização da estimativa da recompensa, ou seja:

$$Q_{n+1} = Q_n + \alpha [R_n - Q_n] \quad (7)$$

onde $\alpha \in (0, 1]$ e é constante. Note que essa equação é uma média ponderada das recompensas passadas e da estimativa inicial Q_1 :

$$\begin{aligned}
Q_{n+1} &= Q_n + \alpha[R_n - Q_n] \\
&= \alpha R_n + (1 - \alpha)Q_n \\
&= \alpha R_n + (1 - \alpha)[\alpha R_{n-1} + (1 - \alpha)Q_{n-1}] \\
&= \alpha R_n + (1 - \alpha)\alpha R_{n-1} + (1 - \alpha)^2 Q_{n-1} \\
&= \alpha R_n + (1 - \alpha)\alpha R_{n-1} + (1 - \alpha)^2 \alpha R_{n-2} + \dots \\
&\quad + (1 - \alpha)^{n-1} \alpha R_1 + (1 - \alpha)^n Q_1 \\
&= (1 - \alpha)^n Q_1 + \sum_{i=1}^n \alpha (1 - \alpha)^{n-i} R_i
\end{aligned} \tag{8}$$

Às vezes vale a pena variar o step-size de ação para ação. Considere que $\alpha_n(a)$ o parâmetro step-size na n -ésima seleção da ação a . Um resultado conhecido na aproximação estocástica nos dá as condições requeridas para garantir convergência para o valor real da ação com probabilidade 1.

$$\sum_{n=1}^{\infty} \alpha_n(a) = \infty \quad \text{e} \quad \sum_{n=1}^{\infty} \alpha_n(a)^2 < \infty \tag{9}$$

A primeira condição garante que os passos sejam grandes o suficiente para eventualmente superar qualquer condição inicial ou flutuações aleatórias. A segunda condição garante que eventualmente os passos sejam pequenos o suficiente para garantir convergência. Geralmente essas condições são pouco usadas na prática pois podem demorar demais.

2.6 - Valores Iniciais Ótimos

Todos os métodos discutidos até agora tem uma forte dependência nas estimativas iniciais de recompensa $Q_1(a)$. Na linguagem estatística, esses métodos são chamados de enviesados por suas estimativas iniciais de recompensa. Para métodos que calculam a estimativa pela (5) usando $\alpha_n(a) = \frac{1}{n}$, chegamos na fórmula (6), e, após a primeira estimativa, nosso $Q_n(a)$ não depende mais diretamente de Q_1 , ou seja, ele não é mais enviesado. Já com outro α , no caso, chegamos na fórmula (8), que é diretamente enviesado por Q_1 .

Um enviesamento pode ser bom ou ruim. Suponha que em vez de iniciar a estimativa inicial $Q_1(a) = 0$, como fazemos anteriormente, considere que colocaremos todos como +5 (lembre que estávamos usando $q^*(a) \sim \mathbb{N}(0, 1)$, ou seja, uma estimativa desse tamanho é bem otimista). Esse otimismo encoraja o agente a explorar, já que de início, todas as estimativas são mais altas do que qualquer valor real da ação. Então, ao escolher certa ação, o agente recebe uma recompensa menor do que o esperado, ficando desapontado e diminuindo o valor da recompensa esperada. Ao escolher a próxima ação, todas as outras têm uma estimativa maior do que a primeira selecionada. Assim, o sistema fará explorar todas as ações, mesmo se sempre selecionarmos a mais gananciosa sempre.

Nós chamamos essa estratégia de Valores Iniciais Ótimos. Vamos comparar esse método com o método ε -greedy explicados anteriormente:

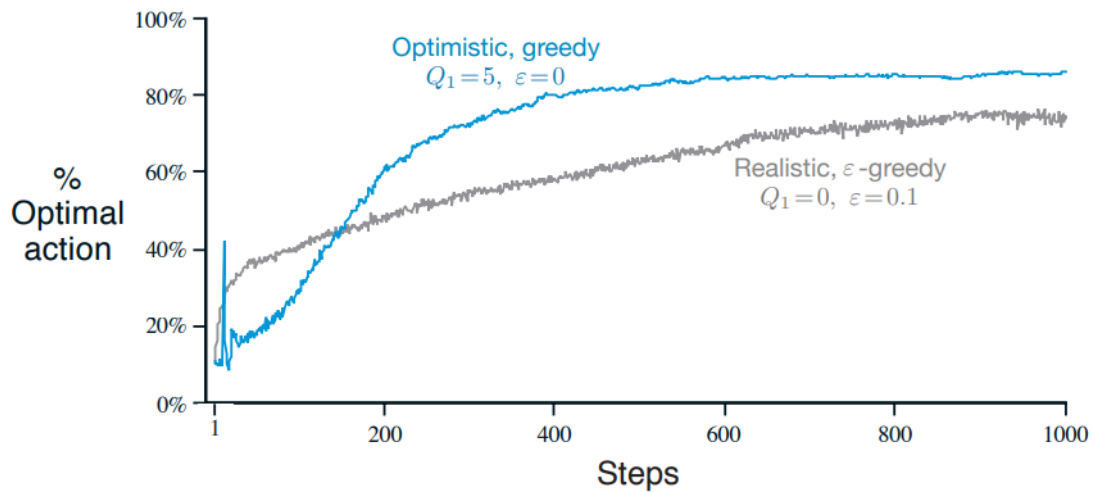


Figura 5: Efeito da inicialização otimista do valor da ação no banco de teste de 10 braços. Ambos usaram o step-size $\alpha = 0.1$

Note como o método otimista começa pior, pois o agente fica inicialmente apenas explorando várias ações, mas eventualmente performa melhor porque acaba parando de explorar. Essa estratégia pode ser boa às vezes, mas não é a mais adequada em casos não estacionários (valor das ações muda) pois a exploração de outras ações é temporário.