

HOCHSCHULE BREMERHAVEN

EXPOSÉ FÜR EINE BACHELORARBEIT ZUM THEMA:

# Reinforcement Learning

*Theoretische Grundlagen der tabellarischen Lernmethoden  
und praktische Umsetzung am Beispiel eines  
Ameisen-Agentenspiels*

Autor: Jan Löwenstrom  
Matrikelnr.: 34937  
Erstprüfer: Prof. Dr.-Ing. Henrik Lipskoch  
Zweitprüfer: Prof. Dr. Mathias Lindemann

9. März 2020

# Inhaltsverzeichnis

|          |   |           |
|----------|---|-----------|
| <b>1</b> | <b>Einleitung</b>                                     | <b>5</b>  |
| <b>2</b> | <b>Grundlagen</b>                                     | <b>6</b>  |
| 2.1      | Markov Entscheidungsprozess . . . . .                 | 6         |
| 2.2      | Markov-Eigenschaft und Zustandsmodellierung . . . . . | 9         |
| 2.3      | Belohnungen und Zielstrebigkeit . . . . .             | 12        |
| 2.4      | Gewinn und Episoden . . . . .                         | 13        |
| 2.5      | Strategie und Nutzenfunktion . . . . .                | 16        |
| 2.6      | Optimalität . . . . .                                 | 17        |
| 2.7      | Generalized Policy Iteration . . . . .                | 19        |
| 2.8      | Exploration-Exploitation Dilemma . . . . .            | 20        |
| 2.9      | Zusammenfassung . . . . .                             | 22        |
| <b>3</b> | <b>Lernmethoden</b>                                   | <b>22</b> |
| 3.1      | Dynamische Programmierung . . . . .                   | 22        |
| 3.1.1    | Strategieevaluierung . . . . .                        | 23        |
| 3.1.2    | Strategieverbesserung . . . . .                       | 23        |
| 3.1.3    | Strategieiteration . . . . .                          | 24        |
| 3.1.4    | Nutzeniteration . . . . .                             | 24        |
| 3.2      | Monte-Carlo Methoden . . . . .                        | 25        |
| 3.2.1    | Vorhersageproblem . . . . .                           | 26        |
| 3.2.2    | Exploration . . . . .                                 | 27        |
| 3.2.3    | Pseudocode . . . . .                                  | 29        |
| 3.2.4    | BlackJack Beispiel . . . . .                          | 30        |
| 3.2.5    | Zusammenfassung . . . . .                             | 30        |
| 3.3      | Temporal Difference Learning . . . . .                | 30        |
| 3.3.1    | Vorhersageproblem . . . . .                           | 30        |
| 3.3.2    | SARSA . . . . .                                       | 31        |
| 3.3.3    | Q-Learning . . . . .                                  | 32        |
| 3.3.4    | Zusammenfassung . . . . .                             | 33        |

|          |                                |           |
|----------|--------------------------------|-----------|
| <b>4</b> | <b>Praktischer Teil</b>        | <b>33</b> |
| 4.1      | Implementierung . . . . .      | 33        |
| 4.2      | Jumping Dino . . . . .         | 34        |
| 4.2.1    | Problemstellung . . . . .      | 34        |
| 4.2.2    | Zustandsmodellierung . . . . . | 34        |
| 4.2.3    | Konvergenzverhalten . . . . .  | 34        |
| 4.3      | Ant-Game . . . . .             | 34        |
| 4.3.1    | Problemstellung . . . . .      | 34        |
| 4.3.2    | Zustandsmodellierung . . . . . | 34        |
| 4.3.3    | Konvergenzverhalten . . . . .  | 34        |
| <b>5</b> | <b>Fazit</b>                   | <b>34</b> |
| <b>6</b> | <b>Ausblick</b>                | <b>34</b> |

## Abbildungsverzeichnis

|   |  |    |
|---|--|----|
| 1 | Agent-Umwelt Interface . . . . .                       | 7  |
| 2 | Zwei-Wege Beispiel zu der Markov-Eigenschaft . . . . . | 10 |
| 3 | Zwei-Wege Beispiel Forts. . . . .                      | 11 |
| 4 | GPI nach (Sutton & Barto, 2018, S. 86f) . . . . .      | 20 |
| 5 | Interfaces . . . . .                                   | 33 |

# 1 Einleitung

//TODO

## 2 Grundlagen

Bei dem Bestärkenden Lernen (*Reinforcement Learning*) interagiert ein Softwareagent (*Agent*) mit seiner Umwelt (*Environment*), die wiederum nach jeder Aktion (*Action*) Feedback an den Agenten zurückgibt. Dieses Feedback wird als Belohnung (*Reward*) bezeichnet, einem numerischen Wert, der sowohl positiv als auch negativ sein kann. Der Agent beobachtet zudem den Folgezustand (*State*) in dem sich die Umwelt nach der vorigen Aktion befindet, um so seine nächste Entscheidung treffen zu können. Ziel des Agenten ist es eine Strategie (*Policy*) zu entwickeln, so dass die Folge seiner Entscheidungen die Summe aller Belohnungen maximiert.

### 2.1 Markov Entscheidungsprozess

Die Umwelt wird in dieser Arbeit als Markov'scher Entscheidungsprozess (*Markov Decision Process, MDP*) definiert. Dieses Framework findet häufig Verwendung in der stochastischen Kontrolltheorie (Gosavi, 2009, S. 3) und bietet im Bezug auf das *Reinforcement Learning* Problem den mathematischen Rahmen, um u.a. präzise theoretische Aussagen treffen zu können. Als *MDP* versteht sich die Formalisierung von sequentiellen Entscheidungsproblemen, bei denen eine Entscheidung nicht nur die sofortige Belohnung beeinflusst, sondern auch alle Folgezustände und somit auch alle zukünftigen Belohnungen (Sutton & Barto, 2018, S. 47). Ein Entscheidungsfinder muss somit das Konzept von verspäteten Belohnungen (*delayed rewards*) durchdringen. Vermeintlich schlecht erscheinende Entscheidungen in der Gegenwart können sich im Nachhinein als optimal herausstellen, angesichts der gesamten Handlung. Ein\*e Skatspieler\*in könnte z.B. alle Trümpfe direkt am Anfang spielen, um einen sofortigen Vorteil zu erhalten. Für den Spielausgang ist es aber womöglich besser, die Trümpfe für einen späteren Zeitpunkt aufzubewahren und zu Beginn „schlechte“ Entscheidungen zu treffen, die dazu führen, ein paar Stiche zu verlieren.

Probleme, die als *MDP* definiert werden, müssen die Markov-Eigenschaft erfüllen, da diese gewissermaßen als Erweiterung von Markov-Ketten zu betrachten sind, mit dem Zusatz von Aktionen und Belohnungen. Bei den sog. Markov-Ketten führt das System

zufällige Zustandswechsel durch (Gosavi, 2009, S. 3). Dabei sind die Übergangswahrscheinlichkeiten zu den einzelnen Folgezuständen ausschließlich von dem aktuellen Zustand abhängig und nicht aufgrund des historischen Verlaufs (Gosavi, 2009, S. 3). Da die Markov-Eigenschaft eine essentielle Voraussetzung bei der Problemmodellierung ist, wird sie in Kapitel X näher erläutert. Die Beziehung zwischen Agent und Umwelt, kann durch folgendes Interface dargestellt werden (Sutton & Barto, 2018, S. 48):

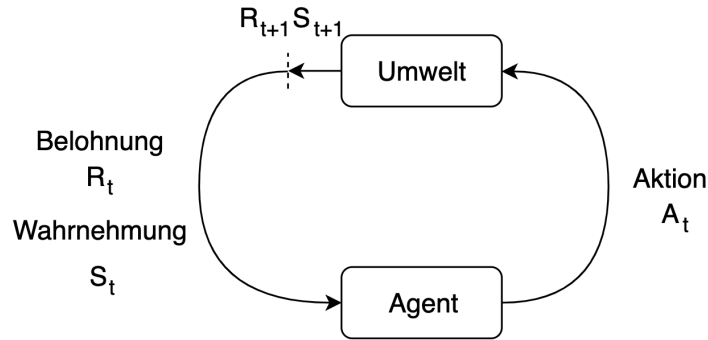


Abbildung 1: Agent-Umwelt Interface

Der Agent interagiert mit dem *MDP* jeweils zu diskreten Zeitpunkten  $t = 0, 1, 2, 3, \dots$ . Zu jedem Zeitpunkt  $t$  beobachtet der Agent den Zustand seiner Umgebung  $S_t \in \mathcal{S}$  und wählt aufgrund dessen eine Aktionen  $A_t \in \mathcal{A}$ . Als Konsequenz seiner Aktion erhält er einen Zeitpunkt später eine Belohnung  $R_{t+1} \in \mathcal{R} \subset \mathbb{R}$  und stellt den Folgezustand  $S_{t+1}$  fest.

In der Literatur findet sich jedoch auch eine abweichende Definition im Bezug auf den Zeitpunkt der Belohnungsvergabe. Watkins (1989), Wiering & van Otterlo (2012) und Yu et al. (2009) z.B. binden die Belohnung  $R_t$  an das Zustands-Aktions-Paar  $(S_t, A_t)$ . Die Definition  $R_{t+1}$  bei Aktion  $A_t$  von Sutton & Barto (2018) wird allerdings im Verlauf dieser Arbeit verwendet, da sie besser beschreibt, dass die Belohnung und der Folgezustand gemeinsam berechnet werden und einen Zeitpunkt später, nach Aktion  $A_t$ , für den Agenten sichtbar sind.

Das Zusammenspiel zwischen Agenten und MDP erzeugt somit folgende Reihenfolge (Sutton & Barto, 2018, S.48):

$$S_0, A_0, R_1, S_1, A_1, R_2, S_2, A_2, R_3, \dots \quad (2.1)$$

Wird einfach nur von *MDPs* gesprochen, ist die endliche Variante (*finite MDP*) gemeint, bei dem die Mengen der Zustände, Aktionen und Belohnungen ( $\mathcal{S}, \mathcal{A}, \mathcal{R}$ ) eine endliche Anzahl an Elementen besitzen. In diesem Fall haben die Zufallsvariablen  $R_t$  und  $S_t$  wohl definierte, diskrete Wahrscheinlichkeitsverteilungen, die nur von dem vorigen Zustand und der vorigen Aktion abhängig sind. Die Wahrscheinlichkeit, dass die bestimmten Werte für diese Variablen  $s' \in \mathcal{S}$  und  $r \in \mathcal{R}$  eintreten, für einen bestimmten Zeitpunkt  $t$  und dem vorigen Zustand  $s$  und Aktion  $a$ , kann somit durch folgende Funktion beschrieben werden (Sutton & Barto, 2018, S.48):

$$p(s', r \mid s, a) \doteq \Pr\{S_t = s', R_t = r \mid S_{t-1} = s, A_{t-1} = a\}, \quad (2.2)$$

für alle  $s', s \in \mathcal{S}, r \in \mathcal{R}$  und  $a \in \mathcal{A}(s)$ . Diese Funktion  $p$  definiert die sog. Dynamiken (*Dynamics*) eines *MDP*. Sie ist eine gewöhnliche deterministische Funktion mit vier Parametern  $p : \mathcal{S} \times \mathcal{R} \times \mathcal{S} \times \mathcal{A} \rightarrow [0, 1]$ . Das „ $\mid$ “ Zeichen kommt ursprünglich aus der Notation für bedingte Wahrscheinlichkeiten, soll hier aber andeuten, dass es sich um eine Wahrscheinlichkeitsverteilung handelt für jeweils alle Kombinationen von  $s$  und  $a$  (Sutton & Barto, 2018, S.49f):

$$\forall s \in \mathcal{S} : \forall a \in \mathcal{A}(s) : \sum_{s' \in \mathcal{S}} \sum_{r \in \mathcal{R}} p(s', r \mid s, a) = 1 \quad (2.3)$$

Ist das Entscheidungsproblem nicht stochastischer Natur, sondern deterministisch, so ist für jedes Paar  $(s, a)$  genau ein bestimmtes Paar  $(s', r)$  gleich 1. Für alle weiteren Kombinationen von  $(s', r)$  im Bezug auf dieses Zustands-Aktions-Paar  $(s, a)$  ist  $p$  folglich gleich 0. Mit anderen Worten, wird im Zustand  $s$  die Aktion  $a$  gewählt, führt dies in jedem Fall zu einem bestimmten Folgezustand  $s'$ .

Sutton & Barto (2018) erläutern, dass das MDP Framework als extrem flexibel gilt und es demzufolge auf die unterschiedlichsten Probleme angewendet werden kann. Sie führen weiter aus, dass es die nötige Abstraktion für Probleme bietet, bei denen



unter Vorgabe eines Ziels mittels Interaktionen gelernt wird. Einzelheiten über das eigentliche Ziel, die Zustände oder die Form des Agenten sind dabei unerheblich. Letztendlich kommen die zwei Autoren zu dem Schluss, dass „jedes zielgerichtete Lernen auf drei Signale reduziert werden kann, die zwischen dem Agenten und der Umwelt ausgetauscht werden. Ein Signal repräsentiert die Entscheidung, die der Agent getroffen hat (die Aktion), ein Signal repräsentiert die Basis, auf der er zu dieser Entscheidung gekommen ist (der Zustand) und ein Signal definiert das zu erreichende Ziel (die Belohnung)“ (S. 50).

## 2.2 Markov-Eigenschaft und Zustandsmodellierung

Die Markov-Eigenschaft erhält ein eigenes Kapitel, da sie wichtig zum Verständnis dieser Arbeit ist und bei der Modellierung eines Reinforcement Learning Problems eine besondere Rolle spielt. Verbinden lässt sich dies sehr gut mit einem Einblick über die grundsätzliche Modellierung von Zuständen bei einem Reinforcement Learning Problem.

The future is independent of the past given the present

Dieser Satz erscheint oft in der Literatur, wenn es um die Markov-Eigenschaft geht, so z.B. in den Arbeiten von Feldman & Valdez-Flores (2010), Kumar (2014), Capela et al. (2019) und Saul & Jordan (1999), oder auch in der Vorlesung der Stanford-Professorin Emma Brunskill (2019). Er fasst prägnant zusammen, was die Markov-Eigenschaft aussagt. Im Zusammenhang von MDPs lässt sich dieser Satz so übersetzen, dass ein Folgezustand nicht abhängig von Aktionen bzw. Zuständen in der Vergangenheit ist, sondern ausschließlich von dem aktuellen Zustand und der aktuell gewählten Aktion.

Sutton & Barto (2018) sehen die Markov-Eigenschaft als Einschränkung für die Zustände und nicht für den Entscheidungsprozess als solches. Ausschlaggebend ist, dass der Zustand, auf dessen Basis der Agent seine Entscheidung trifft, alle notwendigen Informationen der Vergangenheit beinhaltet, die für die Zukunft relevant sind (S.49). Die Umwelt ist somit nicht notwendigerweise gezwungen, Markov-konforme Zustände zu liefern. Brunskill (2019) wählt ausgedessen die Bezeichnung „Beobachtung“ (Observation  $O_t$ ) als Feedback der Umwelt nach einer Aktion. Jene Beobachtungen können

anschließend durch eine interne Repräsentation zu Markov-Zuständen verarbeitet werden, die dann dem Entscheidungsfinder zugrunde liegen.

Folgendes Beispiel, basierend auf der Vorlesung von Brunskill (2019), liefert einen guten Einblick in die Zustandsmodellierung und der Problematik, die mit der Markov-Eigenschaft einhergeht.

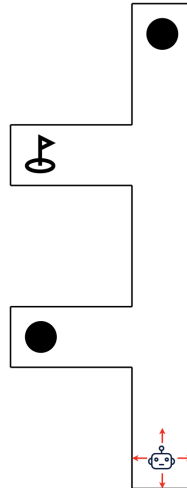


Abbildung 2: Zwei-Wege Beispiel zu der Markov-Eigenschaft

Gegeben ist ein beweglicher Roboter und eine Strecke mit zwei Korridoren. Der Roboter ist mit vier Sensoren ausgestattet, die jeweils eine Himmelsrichtung abdecken. Diese Sensoren sind in der Lage, angrenzende Wände zu erkennen und bilden den Zustand der Umwelt ab. Wahlweise ist der Zustand im Uhrzeiger definiert  $\{N, O, S, W\}$ , wobei 1 angibt, dass eine Wand erkannt wurde und 0, dass sich keine Wand in der unmittelbaren Nähe befindet. Es ergeben sich folglich 16 unterschiedliche Zustände, die der Agent unterscheiden und auf dessen Basis er Entscheidungen treffen kann (vier Aktionen: Fahrt in jeweils eine Richtungen). Der Roboter soll sein Ziel erreichen, markiert mit einer Flagge, ohne dabei in eine der beiden Fallen zu navigieren.

Eine potentielle Startposition, wie in Abb. 2 dargestellt, liefert somit den Zustand  $\{0, 1, 1, 1\}$ . Angenommen der Agent hat gelernt in diesem Zustand Richtung Norden zu fahren, dann ist der Folgezustand ebenfalls  $\{0, 1, 1, 1\}$ . Schließlich erreicht er den ersten

Korridor. Der westliche Sensor liefert folgerichtig 0 und der Zustand ist  $\{0, 1, 0, 0\}$ . Da der Agent nicht den ersten Korridor folgen darf, sondern dem zweiten, muss der Zustand  $\{0, 1, 0, 0\}$  ebenfalls die Aktion „nach Norden fahren“ auslösen. Das Besondere hier ist jedoch, dass der Zustand bei dem zweiten Korridor identisch mit dem Zustand bei dem ersten Korridor ist und der Agent somit keine Chance hat, zu unterscheiden, vor welchem er sich gerade befindet, siehe Abb. 3. Er würde ebenfalls, wie schon bei dem ersten Korridor, weiter nach Norden und letztendlich in die Falle fahren.

Bezogen auf diesen Entscheidungsprozess ist die Modellierung der Zustände über den Sensorinput alleine nicht ausreichend, um die gestellte Aufgabe zu lösen. Die Kombination von Aufgabenstellung und dem Format der Zustände in dieser Form erfüllt insofern nicht die Markov-Eigenschaft, dass auf Basis der erkannten Zustände keine Möglichkeit besteht, die optimalen Entscheidungen zu treffen.

In der Theorie ist es jedoch möglich diesen Entscheidungsprozess als MDP umzumodellieren. Dabei werden die Sensordaten als Beobachtungen der Umwelt betrachtet und eine interne Repräsentation von Markov-Zuständen gepflegt. Möglich ist z.B. die gesamte Historie der Zustände und Aktionen zu speichern, damit der Roboter zurückverfolgen kann, wo er sich zur Zeit befindet. Ein Prozess als MDP zu definieren bedeutet aber gerade darauf zu verzichten, nämlich die gesamte Vergangenheit in einen Zustand zu verarbeiten. Denkbar ist auch, dass der Agent eine interne Repräsentation nach jeder Beobachtung pflegt und die Umwelt sukzessive nachbildet.

//TODO Schlussfolgerung; Modellierung  
Letztendlich sollte

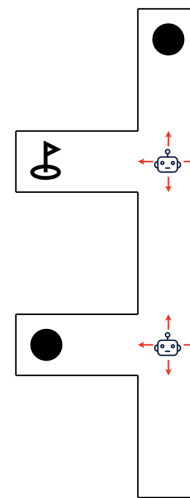


Abbildung 3: Zwei-Wege Beispiel Forts.

## 2.3 Belohnungen und Zielstrebigkeit

Das Besondere an dem Reinforcement Learning ist das Belohnungssignal (*Reward*), welches der Agent nach jeder Aktion erhält. Zu jedem diskreten Zeitpunkt wird dem Agenten eine Belohnung in Form einer einfachen Zahl  $R_t \in \mathbb{R}$  zugestellt. Aufgabe eines jeden RL-Algorithmus ist es, die Summe aller gesammelten Belohnungen zu maximieren. Dabei ist entscheidend, dass der Fokus nicht ausschließlich auf die sofortigen Belohnungen gerichtet ist, sondern auf die erwartbare Summe aller Belohnungen über einen langen Zeitraum. Entscheidungen, die in der Gegenwart eine hohe sofortige Belohnungen versprechen sind verführerisch, können sich aber in der Zukunft in Bezug auf den gesamten Prozess als suboptimal herausstellen. (Sutton & Barto, 2018, S.53)

Eine Belohnungsfunktion wird in der Regel von einem Menschen definiert und hat den größten Einfluss darauf, wie der Agent sich verhalten soll. Die Festlegung von Belohnung bei bestimmten Events ist die einzige Möglichkeit, die der Agent hat, zu verstehen, welches Ziel er verfolgen soll. Somit ist die Modellierung der passenden Belohnungsfunktion zur korrekten Abbildung der eigentlichen Aufgabenstellung von gravierender Bedeutung.

//TODO Belege Grundsätzlich gibt es zwei Ansätze, um eine Belohnungsfunktion zu formulieren. Verständlich werden diese durch ein Beispiel, bei dem ein Agent lernen soll, eine Partie Schach zu gewinnen. Die erste Möglichkeit besteht darin, dem Agenten ausschließlich eine Belohnung aufgrund des Spielausgangs zu geben. Er erhält +1 wenn er gewinnt, -1 bei einer Niederlage und 0 bei Unentschieden (und jeder Aktion zuvor). Auf den ersten Blick erscheint dieser Ansatz trivial, ist aber die direkte Übersetzung des Ziels in eine Belohnungsfunktion. Die größte erwartbare Summe aller Belohnungen erhält der Agent nur, wenn er lernt, das Spiel zu gewinnen. Größter Nachteil dieser Methode ist allerdings, dass der Agent keinerlei Hilfe oder Richtung bei dem Erkunden des Spiels erhält. Je größer der Zustands- und Aktionraum ist, desto länger braucht er um überhaupt einmal ein Spiel gewinnen zu können und zu lernen, welche Aktionen vorteilhaft sind und welche nicht.

Um dem entgegenzuwirken, werden dem Agenten bei der zweiten Möglichkeit feingranularere Belohnungen mitgeteilt, statt diese ausschließlich auf das Endresultat zu

reduzieren. Bestimmte Belohnungen zeigen dann, ob der Agent seinem Ziel näher gekommen ist oder eine ungünstige Entscheidung getroffen hat. Zum Beispiel könnte dem Agenten eine hohe Belohnung von +10 gegeben werden, wenn er die gegnerische Dame aus dem Spiel nimmt. Es ist auch denkbar, dass jede Spielfeldkonstellation bewertet wird. Dieser Ansatz benötigt somit spezielles Vorwissen über das Problem und kann sich zugleich sehr negativ auf das Verfolgen des eigentlichen Ziels auswirken. Der Agent könnte zum Beispiel nur lernen in jedem Spiel die Dame des Gegners zu schlagen und dabei trotzdem immer die Partie zu verlieren.

Die korrekte Modellierung der Belohnungsfunktion hat somit eine besondere Bedeutung. Sutton & Barto (2018) sind der Meinung, dass ein Schachagent nur angesichts des Spieldaustauschs bewertet werden sollte und nicht aufgrund von Zwischenzielen wie z.B. dem Herausnehmen einer gegnerischen Spielfigur oder der Kontrolle über das Zentrum des Spielfelds (S. 53).

Für eine korrekte Übersetzung der Aufgabenstellung zu einer geeigneten Belohnungsfunktion gibt es keine klaren, formalen Regeln. Ein\*e Designer\*in muss auf Erfahrungswerte und einen gewissen Grad an Kreativität zurückgreifen. Soll ein Agent z.B. ein Labyrinth durchlaufen und so schnell wie möglich hinausfinden, dann muss nach jeder Aktion eine negative Belohnung von -1 verteilt werden. Somit wird der Agent gezwungen, auf direktem Wege den Ausgang zu erreichen. Würde lediglich für das Erreichen des Ausgangs eine positive Belohnung vergeben werden, dann wäre die Summe aller Belohnungen für jede Abfolge von Aktionen gleich. Der Agent „trödelt“. Hat er durch Zufall aus dem Labyrinth gefunden, so könnte er bei weiteren Durchläufen keinen effektiveren Weg finden, denn für ihn haben alle Aktionsfolgen den gleichen Nutzen.

Prinzipiell gilt, dass „das Belohnungssignal dazu dient, dem Agenten mitzuteilen *was* er erreichen soll, nicht *wie* er es erreichen soll“ (Sutton & Barto, 2018, S. 54).

## 2.4 Gewinn und Episoden

In Kapitel 2.1 wurde gezeigt, dass die Interaktion eines Agenten mit seiner Umwelt als bestimmte Abfolge beschrieben werden kann (2.1). In ihr werden letztendlich alle

Triple von Zustand, ausgeführter Aktion aufgrund dieses Zustands und anschließende Belohnung chronologisch aufgezeichnet. Ist diese Reihenfolge endlich, so wird sie auch als Episode (*Episode*) bezeichnet. Eine Episode fasst somit alle Informationen zusammen, die ein Agent erlebt, während er von einem beliebigen Startzustand aus anfängt die Umwelt zu erkunden. Das Ende einer Episode wird durch das Erreichen eines beliebigen Zielzustands erreicht. Ist eine Episode zu Ende, dann wird das Szenario zurückgesetzt und der Agent startet erneut im Startzustand. Episoden sind komplett unabhängig voneinander und erzeugen Abfolgen, die nicht durch vorrige Episoden beeinflusst sind.

Bisher wurde erwähnt, dass das Ziel eines Agenten sei, die Summe der zu erwartenden Belohnungen zu maximieren. Formal betrachtet, versucht er somit die Sequenz der Belohnungen, die er nach dem Zeitpunkt  $t$  erhält, den sog. erwarteten Gewinn (*Return*), zu maximieren. Im einfachsten Fall sieht  $G_t$  wie folgt aus, wobei  $T$  der finale Zeitstempel ist (Sutton & Barto, 2018, S.55):

$$G_t = R_{t+1} + R_{t+2} + R_{t+3} + \dots + R_T \quad (2.4)$$

Bei episodialen Problemen lässt sich der Gewinn durch diese Addition von nachfolgenden Belohnungen für jeden Zeitpunkt  $t$  ermitteln. Grund hierfür ist, dass während der Berechnung, nach Abschluss der Episode, alle Belohnungen bekannt sind.

Jedoch existieren auch Probleme, die keine Endzustände definiert haben und daher einen sog. unendlichen Zeithorizont (*infinite horizon*) besitzen. Sie lassen sich nicht in natürliche Sequenzen unterteilen und werden auch mit „kontinuierlich“ betitelt, wobei dadurch ausschließlich beschrieben wird, dass die Interaktion zwischen Agenten und Umwelt kein definiertes Ende besitzt, die Zeitstempel sind weiterhin diskret. Folglich ist  $T = \infty$ , was wiederum bedeutet, dass der Gewinn unendlich ist.

Um diese kontinuierlichen und die zuvor beschriebenen episodialen Aufgaben im Bezug auf den Gewinn zu vereinheitlichen, wird das Konzept der Diskontierung (*discounting*) verwendet. Dabei gibt der Parameter  $\gamma$ ,  $0 \leq \gamma \leq 1$ , Auskunft darüber, wie die Gewichtung zwischen sofortigen und zukünftigen Belohnungen verteilt ist. Der zukünftige diskontierte Gewinn, der durch die Aktion  $A_t$  maximiert werden soll,

berechnet sich somit wie folgt (Sutton & Barto, 2018, S.55):

$$G_t = R_{t+1} + \gamma R_{t+2} + \gamma^2 R_{t+3} + \dots = \sum_{k=0}^{\infty} \gamma^k R_{t+k+1} \quad (2.5)$$

Eine wichtige Erkenntnis ist, dass Gewinne aufeinanderfolgender Zeitpunkte in Verbindung stehen. Vor allem Algorithmen, die nach jedem Zeitstempel updaten, profitieren von dieser Eigenschaft. Sie verwenden den geschätzten Gewinn des Folgezustands, also  $G_{t+1}$ , zur Berechnung von  $G_t$ , dem geschätzten Gewinn des aktuellen Zustands. Dieses Verfahren, bei dem ein Schätzwert aufgrund eines anderen Schätzwertes aktualisiert wird, wird auch als *bootstrapping* bezeichnet.

Durch simple Umformung wird der Zusammenhang von Gewinnen deutlich (Sutton & Barto, 2018, S.55):

$$\begin{aligned} G_t &= R_{t+1} + \gamma R_{t+2} + \gamma^2 R_{t+3} + \gamma^3 R_{t+4} + \dots \\ &= R_{t+1} + \gamma(R_{t+2} + \gamma R_{t+3} + \gamma^2 R_{t+4} + \dots) \\ &= R_{t+1} + \gamma G_{t+1} \end{aligned} \quad (2.6)$$

Ist  $\gamma = 0$ , dann wählt der Agent seine Aktionen ausschließlich aufgrund der sofortigen Belohnung  $R_{t+1}$ . Je näher  $\gamma$  an 1 ist, desto „weitsichtiger“ wird der Agent, da der Gewinn für den Zeitpunkt  $t$  sich zusätzlich aus zukünftigen Belohnungen zusammensetzt.  $\gamma = 1$  führt zu der gleichen Summe wie (2.4) und wird bei Problemen bestimmt, die Episoden erzeugen. Dadurch trifft der Agent seine Entscheidungen immer aufgrund jeglicher Konsequenzen in der Zukunft bzw. bis zum Ende der jeweiligen Episode. Um zu erreichen, dass die unendliche Summe in (2.5) bei kontinuierlichen Aufgaben einen endlichen Wert annimmt, muss  $\gamma < 1$  gegeben sein.

Probleme mit unendlichem Zeithorizont können durch die Vergabe einer künstlichen Schranke zu einer episodischen Aufgabe umformuliert werden. Denkbar z.B. durch die Festlegung der maximalen Anzahl an Aktionen oder besuchten Zustände.

//TODO TD-Episodic tasks?! Weglassen?

Die Algorithmen der Monte-Carlo-Methoden, die in Kapitel X vorgestellt werden, können ausschließlich auf Basis von Episoden lernen. Jedoch existieren auch Methoden,

wie das Temporal-Difference-Learning (Kapitel X), die neben dem episodischen Lernen, zusätzlich in der Lage sind, mit kontinuierlichen Aufgaben zurechtzukommen.

## 2.5 Strategie und Nutzenfunktion

Fast alle Lernalgorithmen des Reinforcement Learning versuchen eine sog. Nutzenfunktion (*Value Function*) zu schätzen. Diese Funktion sagt aus, „wie gut“ es ist, dass sich der Agent in einem bestimmten Zustand befindet oder eine bestimmte Aktion in einem Zustand ausführt. Dabei bezieht sich das „wie gut“ darauf, welche Belohnungen in der Zukunft erwartbar sind, also wie groß der erwartete Gewinn ist. Zukünftige Belohnungen sind natürlicherweise abhängig davon, wie sich der Agent verhalten bzw. welche Entscheidungen er in der Zukunft treffen wird. Nutzenfunktion sind deshalb immer in Bezug auf eine bestimmte Strategie definiert (Sutton & Barto, 2018, S. 58).

Eine Strategie (*Policy*) kann als Abbildung verstanden werden, die jedem Zustand eine diskrete Wahrscheinlichkeitsverteilung über Aktionen zuordnet. Folgt der Agent einer Strategie  $\pi$  zum Zeitpunkt  $t$ , dann gibt  $\pi(a \mid s)$  an, mit welcher Wahrscheinlichkeit  $A_t = a$  ausgeführt wird, wenn  $S_t = s$  (Sutton & Barto, 2018, S. 58). Neben solchen stochastischen Strategien, existieren auch simplere, deterministische Strategien, die jedem Zustand nur genau eine Aktion zuordnen,  $\pi(s) = a$  (Brunskill, 2019).

Wie anfangs erwähnt, gibt es zwei Varianten der Nutzenfunktion. Die erste sagt aus, wie groß der Erwartungswert des Gewinns für den Zustands  $s$  ist, wenn in diesem gestartet und anschließend aufgrund der Strategie  $\pi$  gehandelt wird. Dieser *Zustands-Nutzen* kann für alle  $s \in \mathcal{S}$  folgendermaßen definiert werden (Sutton & Barto, 2018, S. 58):

$$v_\pi(s) = \mathbb{E}_\pi[G_t \mid S_t = s] = \mathbb{E}_\pi \left[ \sum_{k=0}^{\infty} \gamma^k R_{t+k+1} \mid S_t = s \right] \quad (2.7)$$

Die zweiten Variante gibt Auskunft darüber, wie groß der Nutzen ist, wenn im Zustand  $s$  gestartet, daraufhin die Aktion  $a$  ausgeführt und anschließend der Strategie  $\pi$  gefolgt wird.  $q_\pi$  wird auch als *Aktions-Nutzenfunktion* für die Strategie  $\pi$  bezeichnet und wird



formal ausgedrückt durch (Sutton & Barto, 2018, S. 58):

$$q_\pi(s, a) = \mathbb{E}_\pi[G_t \mid S_t = s, A_t = a] = \mathbb{E}_\pi \left[ \sum_{k=0}^{\infty} \gamma^k R_{t+k+1} \mid S_t = s, A_t = a \right] \quad (2.8)$$

//TODO der Erwartungswert auf ? //TODO funktionsapproximation hier?

## 2.6 Optimalität

Ein Reinforcement Learning Problem zu lösen bedeutet, eine Strategie zu finden, die den größten Gewinn bringt. Dabei lassen sich Strategien vergleichen, insofern, dass eine Strategie besser ist als eine andere, wenn der erwartete Gewinn für alle Zustände größer oder gleich ist (Sutton & Barto, 2018, S. 62f). Mit anderen Worten,  $\pi \geq \pi'$  gilt, wenn  $v_\pi(s) \geq v_{\pi'}(s)$  für alle  $s \in \mathcal{S}$ . Es existiert mindestens eine Strategie die besser oder gleich gegenüber allen anderen Strategien ist. Diese ist die optimale Strategie  $\pi_*$ . Optimale Strategien teilen die selbe (optimale) Zustands-Nutzenfunktion  $v_*$  und (optimale) Aktions-Zustands-Nutzenfunktion  $q_*$  (Sutton & Barto, 2018, S. 62f):

$$v_*(s) = \max_{\pi} v_\pi(s) \quad (2.9)$$

$$q_*(s, a) = \max_{\pi} q_\pi(s, a) \quad (2.10)$$

Nutzenfunktionen sind, wie im vorigen Kapitel (2.5) erläutert, immer abhängig von einer bestimmten Strategie, da diese die gesammelte Erfahrung beeinflusst und somit auch die erwarteten, geschätzten Gewinne. Die optimale Nutzenfunktion kann jedoch auch ohne Referenz auf eine bestimmte Strategie beschrieben werden, da der Gewinn eines Zustands unter einer optimalen Strategie gleich dem erwarteten Gewinn für die beste Aktion in diesem Zustand ist.  $v_*(s)$  referenziert somit  $v_*(s')$ , den besten Folgezustand, wodurch eine rekursive Beziehung zustande kommt. Eine optimale Nutzenfunktion  $v_*$  kann formal folgendermaßen beschrieben werden (Sutton & Barto, 2018, S. 63):

$$\begin{aligned}
v_*(s) &= \max_a \mathbb{E}_{\pi_*} [G_t | S_t = s, A_t = a] \\
&= \max_a \mathbb{E} \pi_* [R_{t+1} + \gamma G_{t+1} | S_t = s, A_t = a] \\
&= \max_a \mathbb{E} [R_{t+1} + \gamma v_*(S_{t+1}) | S_t = s, A_t = a] \\
&= \max_a \sum_{s', r} p(s', r | s, a) [r + \gamma v_*(s')]
\end{aligned} \tag{2.11}$$

Diese Gleichung ist die sog. *Bellman Optimality Equation* und lässt sich auch als Gleichungssystem interpretieren, welches eine Gleichung pro Zustand besitzt. Für ein Problem mit  $n$  Zuständen ergeben sich somit  $n$  Gleichung mit  $n$  Unbekannten (Sutton & Barto, 2018, S. 63). Eine Berechnung der optimalen Nutzenfunktion ist folglich in der Theorie möglich, jedoch muss die Übergangsfunktion  $p$  bekannt sein. Ist  $p$  gegeben wird von einem perfekten Modell gesprochen, eine Voraussetzung, die nicht immer erfüllt ist.

Selbst wenn die Dynamiken der Umwelt bekannt sind, kann die benötigte Rechenzeit zur Lösungen jedoch utopische Ausmaße annehmen. Bei einem Spiel wie „Backgammon“ sind die Regeln klar definiert, ein perfektes Modell ist demzufolge vorhanden, aber es existieren  $10^{23}$  Zustände, was die mathematische Berechnung von  $v_*$  mittels der *Bellman Optimality Equation* praktisch unmöglich macht (Sutton & Barto, 2018, S. 66). Dennoch stellt sie ein wichtiges Fundament für das Reinforcement Learning dar, da die meisten Reinforcement Learning Algorithmen als annäherungsweise Lösungsverfahren verstanden werden können (Sutton & Barto, 2018, S. 66).

Methoden des Reinforcement Learnings, die die Umwelt als Blackbox betrachten, werden auch als *model-free* beschrieben. Sie benötigen keinen Zugriff auf die Übergangsfunktion  $p$ , denn es wird ausschließlich aufgrund der erhaltenen Belohnungen und Beobachtungen gelernt wird. Hierbei bezieht sich der Lernprozess darauf, wie nah die geschätzte Nutzenfunktion der aktuellen Strategie  $\pi$  an  $v_*$  bzw.  $q_*$  ist.

Die optimale Strategie lässt sich leicht ermitteln, wenn eine optimale Nutzenfunktion gegeben ist. Ist zum Beispiel  $v_*$  gegeben und befindet sich der Agent in Zustand  $s$ , dann muss er eine Aktion vorrausschauen, um den Folgezustand  $s'$  zu finden, der den maximalen Nutzen hat. Dieses Vorrausschen benötigt jedoch ein perfektes

Modell der Umgebung, um die Übergänge für jede Aktion zu berechnen. Das ist der ausschlaggebende Grund, warum bei *model-free* Methoden  $q_*$  berechnet wird. Denn dieser Nutzen umfasst implizit den Nutzen der Folgezustände für jede Aktion. Infolgedessen muss der Agent im Zustand  $s$  nur schauen, welche Aktion  $a$  und somit welches Zustands-Aktions-Paar den größten Nutzen hat und wählt genau jene Aktion.

## 2.7 Generalized Policy Iteration

Bei der Berechnung einer optimalen Strategie  $\pi_*$  spielt ein zugrundeliegendes Konzept bei jeglichen Lernmethoden eine wichtige Rolle, die sog. *Generalized Policy Iteration* (GPI). Dieses, durch Sutton & Barto (2018) geprägte, Prinzip beschreibt die Interaktion von zwei nebenläufigen Prozessen (S. 86). Ein Prozess sorgt dafür, dass die Nutzenfunktion beständig für die aktuelle Strategie wird. Er versucht das sog. *Prediction Problem* zu lösen, bei dem die Nutzenfunktion  $v_\pi$  oder  $q_\pi$  geschätzt werden muss (Wiering & van Otterlo, 2012, S. 18). Jener Prozess wird als *Policy Evaluation* bezeichnet und unterscheidet sich je nach verwendeten Lernverfahren. *Model-based* Lernmethoden, bei denen ein perfektes Modell vorhanden ist, können den Nutzen für eine Strategie entweder direkt oder iterativ berechnen (Wiering & van Otterlo, 2012, S. 18). Hingegen benötigt die große Gruppe der *model-free* Methoden die gesammelte Erfahrung durch eine Interaktion mit der Umwelt. Hierbei konvergiert der geschätzte Gewinn zu dem tatsächlichen Gewinn, solange jedes Zustands-Aktions-Paar unendlich oft besucht wird. Die Konvergenz lässt sich durch das „Gesetz der großen Zahlen“ (*Law of large numbers*) begründen (Sutton & Barto, 2018, S. 94). Ebendies sagt aus, dass die relative Häufigkeit eines Zufallsergebnisses bei zunehmender Anzahl der Ausführungen gegen die theoretische Wahrscheinlichkeit konvergiert. Für einen kompletten mathematischen Beweis siehe (Dekking et al., 2006, S. 181-189).

Das Wissen über den Nutzen der aktuellen Strategie  $\pi$  wird von dem zweiten Prozess genutzt, um eine verbesserte Strategie  $\pi'$  zu finden. Folgerichtig wird dieser Prozess als *Policy Improvement* betitelt, der das sog. *Control Problem* zu lösen versucht (Wiering & van Otterlo, 2012, S. 18).

GPI an sich beschreibt lediglich, dass diese zwei Prozesse miteinander Interagieren.

Dabei konkurrieren sie auf der einen Seite, weil sie in unterschiedliche Richtungen ziehen. Eine Verbesserung der Strategie bei dem *Policy Improvement*, indem die Strategie gierig im Bezug auf die Nutzenfunktion gemacht wird, führt dazu, dass die evaluierte Nutzenfunktion für die verbesserte Strategie inkorrekt wird (Sutton & Barto, 2018, S. 86). Die erneute Evaluierung der Nutzenfunktion bei der *Policy Evaluation* sorgt indirekt dafür, dass die Strategie nicht mehr gierig ist (Sutton & Barto, 2018, S. 86).

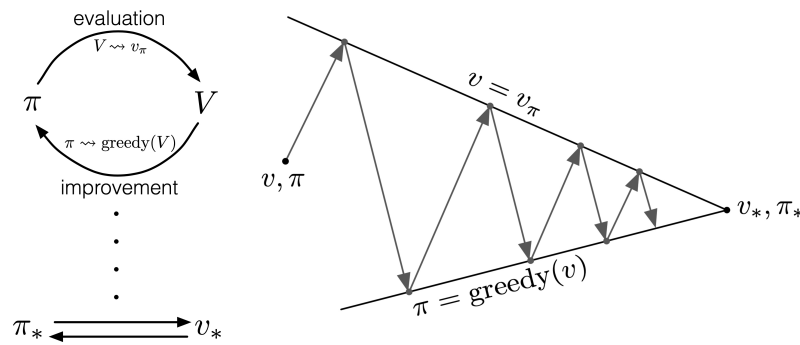


Abbildung 4: GPI nach (Sutton & Barto, 2018, S. 86f)

Auf der anderen Seite kooperieren sich jedoch in dem Sinne, dass beide Prozesse sich nur dann stabilisieren, wenn eine Strategie durch eine eigens evaluierte Nutzenfunktion gefunden worden ist, die zugleich gierig im Bezug auf genau diese ist, siehe Abb. 5. Sie haben somit ein gemeinsames Ziel, die optimale Nutzenfunktion und die optimale Strategie zu finden.

## 2.8 Exploration-Exploitation Dilemma

Durch die Vergabe von Belohnungen und dem übergeordnetem Ziel eines Agenten so viele Belohnungen wie möglich zu sammeln, ergibt sich eine spezielle Problematik bei dem Reinforcement Learning, die bei anderen Lernmethoden des Maschinellen Lernens nicht vorhanden ist. Um den Gewinn zu maximieren, muss der Agent auf der einen Seite Aktionen bevorzugen, die sich in der Vergangenheit bereits als gut herausgestellt haben. Er nutzt unvollständige Erfahrung, um so ausbeuterisch wie

möglich zu handeln (*Exploitation*). Andererseits ist der Agent dazu gezwungen, neue Aktionen auszuprobieren, damit der Zustands- und Belohnungsraum weiter erkundet wird, um bessere oder sogar optimale Entscheidungen in der Zukunft treffen zu können (*Exploration*).

Das Dilemma besteht darin, dass weder Exploration noch Exploitation ausschließlich verfolgt werden kann, ohne dabei die eigentliche Lernaufgaben zum Scheitern zu bringen. Dieses Exploration-Exploitation Dilemma wird von Mathematikern seit Jahrzehnten intensiv untersucht, bleibt allerdings ungelöst (Sutton & Barto, 2018, S. 3). Grundsätzlich muss ein Entscheidungsfinder eine Reihe von unterschiedlichen Aktionen ausführen und zunehmend jene bevorzugen, die sich als gut herausstellen. Dementsprechend muss eine Balance zwischen den beiden Prozessen gefunden werden. Eine Strategie, die ausschließlich ausbeuterisch handeln, wird auch als gierig (*greedy*) bezeichnet. Der Begriff „gierig“ bezeichnet in der Informatik eine Vorgehensweise, bei der immer die, zum Zeitpunkt der Wahl, vermeintlich beste Entscheidungen getroffen wird (Möller & Struth, 2004, S. 203). Dabei wird die Suche nach einem globalen Maximum komplett vernachlässigt. Auf den Kontext des Reinforcement Learning übertragen, wählt eine gierige Strategie für jeden Zustand immer jene Aktion, die den derzeitigen größten Nutzen besitzt. Nur wenn die Nutzenfunktion zu einer optimalen Nutzenfunktion konvergiert ist, ist eine gierige Nutzenfunktion auch gleichzeitig die optimale Strategie. Um jedoch die optimale Nutzenfunktion zu finden, muss erkundet werden.

Ein trivialer, aber dennoch effektiver Ansatz ist es, die meiste Zeit gierig zu handeln, aber mit einer geringen Wahrscheinlichkeit  $\epsilon$  eine zufällige Aktion auszuführen. Dabei spielen die geschätzten Nutzen der Aktionen keine Rolle und jede Aktion hat die gleiche Wahrscheinlichkeit ausgewählt zu werden. Zu vermerken ist, dass die gierige Aktion  $A_*$  ebenfalls in der Menge  $\mathcal{A}(S_t)$  enthalten ist. Solche Strategien werden entsprechend als  $\epsilon - greedy$  bezeichnet (Sutton & Barto, 2018, S. 28):

$$\pi(a|S_t) = \begin{cases} 1 - \epsilon + \epsilon/|\mathcal{A}(S_t)| & \text{wenn } a = A_* \\ \epsilon/|\mathcal{A}(S_t)| & \text{wenn } a \neq A_* \end{cases} \quad (2.12)$$

## 2.9 Zusammenfassung

// TODO hier kommt die Zusammenfassung

## 3 Lernmethoden

### 3.1 Dynamische Programmierung

Die Algorithmen der Dynamischen Programmierung (*Dynamic Programming*, DP) sind im Rahmen dieser Arbeit nicht implementiert und weiter untersucht worden. Dennoch ist ein grundlegendes Verständnis für die DP von Vorteil, da elementare Bestandteile auch in den nachfolgenden Kapiteln zu den Monte-Carlo Methoden und dem Temporal-Difference Learning referenziert werden.

Die grundlegende Idee der Dynamischen Programmierung ist die Aufteilung eines Optimierungsproblems in Teilprobleme. Dabei wird mit einem trivialem Problem gestartet und die optimale Lösung für jenes in einer Tabelle gespeichert, welches anschließend für die Lösung eines sukzessiv größer werdendes Problem verwendet wird (Mehlhorn & Sanders, 2008, S. 243).

Bezogen auf das Reinforcement Learning, ist dieses Problem die Suche nach der optimalen Strategie  $\pi_*$  bzw. der Lösung der *Bellman Optimality Equation*, siehe 2.11. Wie bereits in Kapitel 2.6 erwähnt, ist es möglich dieses Gleichungssystem zu lösen und somit  $v_*$  oder  $q_*$  linear zu berechnen. Mithilfe der DP erschließt sich jedoch ein iterativer Weg.

Da die Algorithmen der Dynamischen Programmierung Zugriff auf die Übergangswahrscheinlichkeiten der Umwelt sowie der Belohnungsfunktion haben müssen, ist ein perfektes Modell der Umgebung Voraussetzung. DP-Methoden sind folgerichtig immer *model-based*.

### 3.1.1 Strategieevaluierung

Wichtiger Bestandteil eines jeden RL Algorithmus ist die Berechnung der Zustands-Nutzenfunktion  $v_\pi$  (oder Aktions-Nutzenfunktion  $q_\pi$ ) für eine willkürliche Strategie  $\pi$ . Die geschätzte Nutzenfunktion (unter einer bestimmten Strategie) gegen die wahren Werte der Gewinne streben zu lassen, wird auch als Strategieevaluierung (*Policy Evaluation*) bezeichnet (Sutton & Barto, 2018, S. 74).

Die Vorgehensweise der DP um dieses Vorhersageproblem (*Prediction Problem*) zu lösen, lässt sich folgendermaßen beschreiben. Zunächst wird eine willkürliche Nutzenfunktion  $v_0$  gewählt, z.B. sind alle Nutzen zu Beginn mit 0 definiert. Die Bellman-Gleichung wird nun als Aktualisierungsregel angesehen, die Schritt für Schritt die geschätzten Nutzen verbessert. Es entsteht eine Reihenfolge von geschätzten Nutzenfunktionen  $v_0, v_1, v_2, \dots$ , die letztendlich zu  $v_\pi$  konvergiert. Sutton & Barto (2018) definieren die Aktualisierungsregel wie folgt (S. 74):

$$\begin{aligned} \forall s \in \mathcal{S} : v_{k+1}(s) &= \mathbb{E}_\pi[R_{t+1} + \gamma v_k(S_{t+1}) \mid S_t = s] \\ &= \sum_a \pi(a|s) \sum_{s', r} p(s', r \mid s, a) [r + \gamma v_k(s')] \end{aligned} \quad (3.1)$$

Mit Worten beschrieben, wird die Aktualisierungsregel in jeder Iteration auf alle Zustände  $s \in \mathcal{S}$  angewendet. Dabei wird der alte Nutzen eines Zustands durch einen neuen Nutzen ersetzt, der auf dem erwarteten Nutzen aller Nachfolgezustände und der sofortigen Belohnung beruht, gewichtet nach den Übergangswahrscheinlichkeiten (Wiering & van Otterlo, 2012, S. 20). Hierbei ist festzustellen, dass die Aktualisierung des geschätzten Nutzen für einen Zustand auf den ebenfalls geschätzten Nutzen der nachfolgenden Zustände stattfindet. DP-Methoden benutzen also das Prinzip des *bootstrapping* (Sutton & Barto, 2018, S. 89).

### 3.1.2 Strategieverbesserung

Ist eine suboptimale Strategie vollständig evaluiert worden, d.h. ist die Nutzenfunktion  $v_\pi$  präsent, dann kann diese genutzt werden, um eine besser Strategie zu finden. Dazu

wird zunächst  $q_\pi$  berechnet durch (Wiering & van Otterlo, 2012, S. 21):

$$q_\pi(s, a) = \mathbb{E}_\pi [R_{t+1} + \gamma v_\pi(S_{t+1}) \mid S_t = s, A_t = a] \quad (3.2)$$

Für den Fall, dass  $q_\pi(s, a)$  größer ist als  $v_\pi$  für ein  $a \in \mathcal{A}$ , dann ist es besser die Aktion  $a$  auszuführen, als jene Aktion, die durch die aktuelle Strategie  $\pi$  gewählt wird. Wird diese Verbesserung (*Policy Improvement*) für alle Zustände durchgeführt, dann ergibt sich die gierige (*greedy*) Strategie  $\pi'$ , die die besten Aktionen basierend auf die aktuelle Nutzenfunktion ausführt.

### 3.1.3 Strategieiteration

Eine Methode, die die zwei Prozesse zum Evaluieren und der Verbesserung einer Strategie zusammenführt, ist die sog. Strategieiteration *Policy Iteration*, die ihren Ursprung in den Arbeiten von Bellman (1957) und Howard (1960) hat.

Bei der Strategieiteration wird zunächst eine willkürliche Strategie  $\pi_0$  gewählt, die anschließend zu der Nutzenfunktionen  $v_{\pi_k}$  evaluiert wird. Ist dieser Schritt abgeschlossen, wird die Strategie gemäß der berechneten Aktions-Nutzenfunktion  $q_{\pi_k}$  (vgl. 3.2) verbessert, aus  $\pi_k$  folgt  $\pi_{k+1}$  und eine erneute Evaluation kann erfolgen. Die Schleife wird gestoppt, wenn für alle Zustände  $s$  gilt, dass  $\pi_{k+1}(s) = \pi_k(s)$  (Wiering & van Otterlo, 2012, S. 22).

Die Strategieiteration generiert somit folgende Sequenz (Wiering & van Otterlo, 2012, S. 22):

$$\pi_0 \rightarrow v_{\pi_0} \rightarrow \pi_1 \rightarrow v_{\pi_1} \rightarrow \pi_2 \rightarrow v_{\pi_2} \rightarrow \pi_3 \rightarrow v_{\pi_3} \rightarrow \dots \rightarrow \pi_* \quad (3.3)$$

### 3.1.4 Nutzeniteration

In Kapitel 3.1.1 wurde gezeigt, dass die Evaluierung einer Strategie mehrere Iteration durchlaufen muss, um letztendlich zu  $v_\pi$  zu konvergieren. Es ist jedoch möglich diesen Prozess vorzeitig abubrechen, „ohne die Garantie der Konvergenz der Strategieiteration zu verlieren“ (Sutton & Barto, 2018, S. 82).



Diese Erkenntnis macht sich die sog. Nutzeniteration (*Value Iteration*) zu nutzen, die bereits nach einer Iteration der Evaluation abbricht und den Schritt zur Verbesserung der Strategie direkt im Bezug auf diese Berechnung ausführt. Die Nutzeniteration fokussiert sich somit ausschließlich auf Schätzung der Nutzenfunktion und erzeugt im Vergleich zur Strategieiteration folgende Sequenz (Wiering & van Otterlo, 2012, S. 23):

$$v_0 \rightarrow v_1 \rightarrow v_2 \rightarrow v_3 \rightarrow \dots \rightarrow v_* \quad (3.4)$$

## 3.2 Monte-Carlo Methoden

Dieses Kapitel beschäftigt sich mit der Gruppe der Monte-Carlo Lernmethoden. Zunächst wird die Grundidee dieses *model-free* Ansatzes erläutert, gefolgt von der Darstellung des Pseudocodes für den *first-visit*-Algorithmus. Abgeschlossen wird mit einem Beispiel für das Glücksspiel *BlackJack*.

Im vorrigen Kapitel wurde die Dynamische Programmierung vorgestellt. Ein Verfahren, welches ein komplettes Modell der Umgebung benötigt und somit als *model-based* bezeichnet wird. Die Hauptdisziplin des Reinforcement Learning ist jedoch die Suche nach optimalen Verhalten, wenn kein Zugriff auf die Dynamiken der Umwelt vorhanden ist (Wiering & van Otterlo, 2012, S. 27). Diese *model-free* Methoden lernen und approximieren aufgrund der Erfahrung, die sie durch die Interaktion mit der Umwelt erwerben. Dabei kann entweder mit der tatsächlichen Umwelt interagiert werden oder mit einer Simulation.

Im Bezug auf Simulationen erwähnen Sutton & Barto (2018) eine interessante Aussage. Zwar müsse ein Modell der Umwelt für eine Simulation vorhanden sein, aber sie behaupten, dass es in überraschend vielen Fällen möglich sei, Erfahrung aufgrund der erwünschten Wahrscheinlichkeitsverteilung zu erzeugen ohne dabei die komplette Wahrscheinlichkeitsverteilung für alle möglichen Übergänge zu kennen wie sie z.B. bei der DP benötigt wird (S. 91).

// TODO: Lindemann; Beispiel? Würfel, BlackJack? Anstatt die Wahrscheinlichkeiten immer wieder komplett auszurechnen, kann man einfach einen Kartenstapel simulieren, von dem Karten entfernt werden. Meinen die beiden das?

### 3.2.1 Vorhersageproblem

Monte-Carlo Methoden lösen das Reinforcement Learning Problem über Durchschnittsbildung der, durch Erfahrung gesammelten, Gewinne (Sutton & Barto, 2018, S. 91). Dabei werden die Nutzen und die Strategien ausschließlich nach einer abgeschlossenen Episode aktualisiert. Folgerichtig ist das Aktualisierungsverhalten *episode-by-episode* und nicht *step-by-step* (als nach jeder Aktion) (Sutton & Barto, 2018, S. 91). Das ist zugleich der Hauptunterschied zu den in Kapitel 4 vorgestelltem Temporal-Difference Learning, welches nach jeder Aktion die geschätzten Nutzen anpasst. Daraus folgt auch, dass Monte-Carlo Methoden ausschließlich auf episodiale Probleme anwendbar sind, TD Learning jedoch zusätzlich auch bei kontinuierlichen Aufgaben zum Einsatz kommen kann.

Zur Erinnerung, eine Nutzenfunktion gibt den Nutzen eines Zustands an, also den erwarteten Gewinn. Dabei ist der erwartete Gewinn eines Zustands die erwartbare Summe aller zukünftig, diskontierten Belohnungen, wenn von diesem Zustand gestartet wird. Um den erwarteten Gewinn zu schätzen, kann der Durchschnitt über die, durch Erfahrung gesammelten, realen Gewinne gebildet werden.

Der Grundansatz ist dabei wie folgt. Eine Episode unter der Strategie  $\pi$  wird z.B. durch eine Simulation erzeugt. Es entsteht eine Reihenfolge von Triple  $(s, a, r)$ . Kommt ein Zustand  $s$  innerhalb der Episode vor, wird auch von einem Besuch (*visit*) von  $s$  gesprochen (im Rahmen der Monte-Carlo Methoden). Der Gewinn für den Zustand  $s$  ist somit die Summe aller Belohnung nach dem ersten Besuch des Zustands  $s$ . Über alle, auf diese Weise gesammelten, Gewinne von  $s$  wird der Durchschnitt berechnet, der -mit steigender Anzahl an Besuchen- gegen den tatsächlichen Nutzen von  $s$  strebt. Wird der Gewinn vom Start des ersten Besuchs von  $s$  berechnet, dann wird diese Methode auch als *First-Visit* bezeichnet. Konsequenterweise bezeichnet *Every-Visit* die Methode, bei der für jegliche Besuche von  $s$  in einer Episode der Gewinn berechnet wird. Diese beiden Methoden sind sehr ähnlich und unterscheiden sich z.B. im Pseudocode nur durch eine Abfrage, trotzdem haben sie unterschiedliche theoretische Eigenschaften (Sutton & Barto, 2018, S. 92). Diese sind jedoch im Rahmen dieser Arbeit nicht weiter dargestellt, da ausschließlich mit der *First-Visit* Variante gearbeitet wird. //TODO für mehr Infos

In Kapitel 2.6 ist erwähnt worden, dass *model-free* Lernmethoden die Aktions-Nutzenfunktion berechnen. Grund hierfür ist, dass sie nicht in der Lage sind einen Schritt vorherzusehen, weil die Übergangsfunktion  $p$  nicht gegeben ist. Monte-Carlo Methoden können sowohl, wie im vorrigen Absatz erläutert, den Nutzen von Zuständen berechnen, als auch den Nutzen von Zustands-Aktions-Paaren. Der Unterschied besteht darin, dass nicht der Besuch von  $s$  entscheidend ist, sondern der Besuch des Paares  $(s, a)$ .

### 3.2.2 Exploration

Da die Monte-Carlo Methoden mittels Durchschnittsbildung arbeiten, ist es unabdingbar, dass jeglichen Zustände respektive Zustands-Aktions-Paare ausreichend oft besucht werden. Wenn jedoch eine deterministische Strategie  $\pi$  gegeben ist, dann wird immer nur eine Aktion pro Zustand ausgeführt, nämlich jene mit dem derzeitigen höchsten, geschätzten Nutzen. Dies sorgt dafür, dass der Zustands- und Aktionsraum nicht ausreichend erkundet wird und der Algorithm sozusagen in einem lokalem Maximum festhängt.

Sutton & Barto (2018) stellen in ihrem Werk drei Ansätze vor, die die fortlaufende Exploration ermöglichen. Eine Möglichkeit ist die Verwendung einer  $\epsilon$ -greedy Strategie, wie sie auch im Kapitel 2.8 vorgestellt wurde. Mit einer bestimmten Wahrscheinlichkeit  $\epsilon$  wird nicht die vermeintlich beste Aktion gewählt (aktuell größter Aktions-Nutzen), sondern eine zufällige Aktion  $a \in \mathcal{A}$ . Diese Methodik erlaubt die fortlaufende Exploration und garantiert trotzdem eine Konvergenz zu einer optimalen Strategie, wenn  $\epsilon$  im Laufe der Zeit verringert wird (Sutton & Barto, 2018, S. 201). Welche Auswirkungen die Werte von  $\epsilon$  auf das Konvergenzverhalten haben und wie in eine „Verringerung im Laufe der Zeit“ aussehen kann, wird im Rahmen der praktischen Umsetzung anhand des JumpingDino Beispiels in Kapitel 4.2 untersucht.

Um einen Überblick über weitere Vorgehensweisen zu der fortlaufenden Erkunden zu geben, werden auch die zwei weiteren Methoden nach Sutton & Barto (2018) kurz dargestellt (S.96-108).

Anstatt die Strategie so zu verändern, dass sie suboptimale Aktionen wählt, um alle

Zustände oder Zustands-Aktions-Paare ausreichend oft zu besuchen, kann auch explizit mit einem bestimmten Zustand respektive Zustands-Aktions-Paar gestartet werden. Dabei muss jeder Zustand oder jedes Zustands-Aktions-Paar eine Wahrscheinlichkeit größer 0 haben, um als Start einer Episode ausgewählt zu werden. Dies wird auch als *Exploring Starts* bezeichnet.

Eine weitere Möglichkeit ist das sog. *off-policy learning*. Die Grundidee hierbei besteht darin, nicht eine Strategie zu benutzen, die teilweise exploriert ( $\epsilon$ -greedy), sondern zwei Strategien zu verwenden. Eine konvergiert zu der optimalen Strategie und die andere exploriert den Zustands- und Aktionsraum, sammelt somit die Erfahrung. Die Strategie, die stetig verbessert wird, wird als Zielstrategie (*target policy*) bezeichnet wohingegen die Strategie, die die Episoden erzeugt als Verhaltensstrategie (*behavior policy*) bezeichnet wird (Sutton & Barto, 2018, S. 103). Das „off“ in *off-policy learning* bezieht sich darauf, dass die Erfahrung einer anderen, von der Zielstrategie abweichenden, Strategie dazu genutzt wird, um zu lernen.

### 3.2.3 Pseudocode

Der nachfolgende Pseudocode (Sutton & Barto, 2018, S. 101) zeigt die Vorgehensweise der Monte-Carlo Methoden zur Bestimmung der optimalen Strategie  $\pi_*$  auf Basis der Aktions-Nutzenfunktion  $q$  bzw.  $Q$ . Genauer wird die *First-Visit* Variante vorgestellt, die mithilfe einer  $\epsilon$ -greedy Strategie die fortlaufende Erkunden garantiert. Wie in Kapitel 2.4 erläutert, sollte der Diskontierungsfaktor  $\gamma$  für episodiale Probleme den Wert 1 annehmen, um jegliches Handeln während einer Episode bei der Berechnung des Gewinns zu berücksichtigen.

---

**Algorithm 1** On-policy first-visit MC control (for  $\epsilon$ -soft policies), estimates  $\pi \approx \pi_*$

---

```

1: Algorithm parameter: small  $\epsilon > 0$ 
2: Initialize:
3:    $\pi \leftarrow$  an arbitrary  $\epsilon$ -soft policy
4:    $Q(s, a) \in \mathbb{R}$  (arbitrarily), for all  $s \in \mathcal{S}, a \in \mathcal{A}(s)$ 
5:    $Returns(s, a) \leftarrow$  empty list, for all  $s \in \mathcal{S}, a \in \mathcal{A}(s)$ 
6: Repeat forever (for each episode):
7:   Generate an episode following  $\pi : S_0, A_0, R_1, \dots, S_{T-1}, A_{T-1}, R_T$ 
8:    $G \leftarrow 0$ 
9:   Loop for each step of episode,  $t = T - 1, T - 2, \dots, 0$  :
10:     $G \leftarrow \gamma G + R_{t+1}$ 
11:    Unless the pair  $S_t, A_t$  appears in  $S_0, A_0, S_1, A_1, \dots, S_{t-1}, A_{t-1}$  :
12:      Append  $G$  to  $Returns(S_t, A_t)$ 
13:       $Q(S_t, A_t) \leftarrow \text{average}(Returns(S_t, A_t))$ 
14:       $A^* \leftarrow \text{argmax}_a Q(S_t, a)$  (with ties broken arbitrarily)
15:      For all  $a \in \mathcal{A}(S_t)$  :
16:         $\pi(a|S_t) = \begin{cases} 1 - \epsilon + \epsilon/|\mathcal{A}(S_t)| & \text{if } a = A^* \\ \epsilon/|\mathcal{A}(S_t)| & \text{if } a \neq A^* \end{cases}$ 

```

---

Eine Umformung zur *Every-Visit* Variante kann durch das Entfernen der Bedingung in Zeile 11 realisiert werden.

### 3.2.4 BlackJack Beispiel

### 3.2.5 Zusammenfassung

## 3.3 Temporal Difference Learning

Dieses Kapitel

### 3.3.1 Vorhersageproblem

### 3.3.2 SARSA

---

**Algorithm 2** Sarsa (on-policy TD control) for estimating  $Q \approx q_*$ 

---

- 1: Algorithm parameter: step size  $\alpha \in (0, 1]$ , small  $\epsilon > 0$
  - 2: Initialize  $Q(s, a)$ , for all  $s \in S^+, a \in \mathcal{A}(s)$ , arbitrarily except that
  - 3:  $Q(\text{terminal}, \cdot) = 0$
  - 4:
  - 5: Loop for each episode:
  - 6:     Initialize  $S$
  - 7:     Choose  $A$  from  $S$  using policy derived from  $Q$  (e.g.,  $\epsilon$ -greedy)
  - 8:     Loop for each step of episode:
  - 9:         Take action  $A$ , observe  $R, S'$
  - 10:        Choose  $A'$  from  $S'$  using policy derived from  $Q$  (e.g.,  $\epsilon$ -greedy)
  - 11:         $Q(S, A) \leftarrow Q(S, A) + \alpha[R + \gamma Q(S', A') - Q(S, A)]$
  - 12:         $S \leftarrow S'; A \leftarrow A';$
  - 13:     until  $S$  is terminal
-

### 3.3.3 Q-Learning

---

**Algorithm 3** Q-Learning (off-policy TD control) for estimating  $\pi \approx \pi_*$

---

- 1: Algorithm parameter: step size  $\alpha \in (0, 1]$ , small  $\epsilon > 0$
  - 2: Initialize  $Q(s, a)$ , for all  $s \in S^+, a \in \mathcal{A}(s)$ , arbitrarily except that
  - 3:  $Q(\text{terminal}, \cdot) = 0$
  - 4:
  - 5: Loop for each episode:
  - 6:     Initialize  $S$
  - 7:     Loop for each step of episode:
  - 8:         Choose  $A$  from  $S$  using policy derived from  $Q$  (e.g.,  $\epsilon$ -greedy)
  - 9:         Take action  $A$ , observe  $R, S'$
  - 10:          $Q(S, A) \leftarrow Q(S, A) + \alpha[R + \gamma \max_a Q(S', a) - Q(S, A)]$
  - 11:          $S \leftarrow S'$ ;
  - 12:     until  $S$  is terminal
-



### 3.3.4 Zusammenfassung

## 4 Praktischer Teil

### 4.1 Implementierung

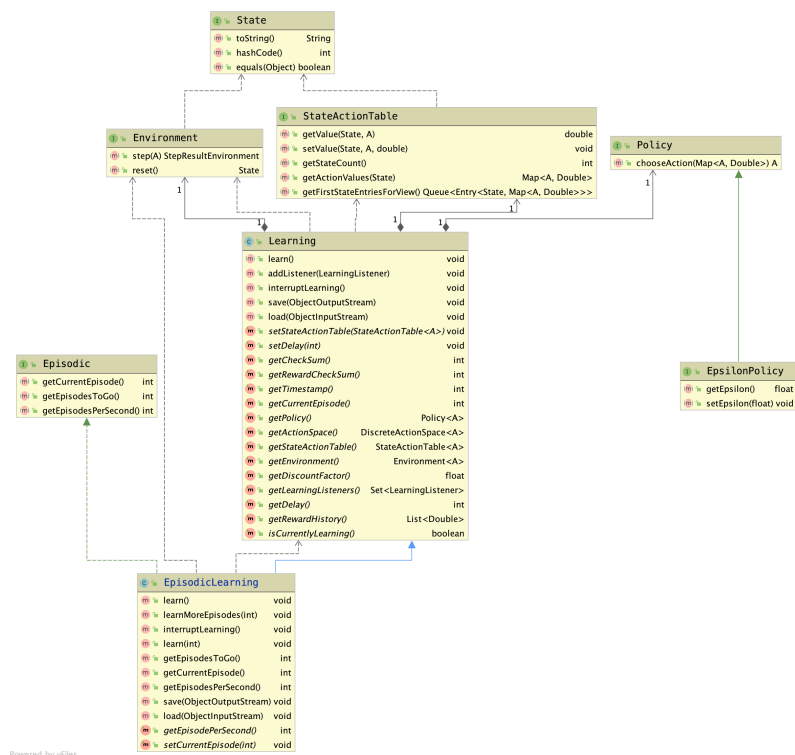


Abbildung 5: Interfaces

## 4.2 Jumping Dino

### 4.2.1 Problemstellung

### 4.2.2 Zustandsmodellierung

### 4.2.3 Konvergenzverhalten

## 4.3 Ant-Game

### 4.3.1 Problemstellung

### 4.3.2 Zustandsmodellierung

### 4.3.3 Konvergenzverhalten

## 5 Fazit

## 6 Ausblick

## Literatur

- Bellman, R. (1957). *Dynamic programming*: Princeton univ. press. NJ, 95.
- Brunskill, E. (2019). *Stanford cs234: Reinforcement learning - winter 2019*. Zugriff am 2020-02-10 auf <https://www.youtube.com/watch?v=FgzM3zpZ55o>
- Capela, M., Céleri, L. C., Modi, K. & Chaves, R. (2019). *Monogamy of temporal correlations: Witnessing non-markovianity beyond data processing*.
- Dekking, F., Kraaikamp, C., Lopuhaä, H. & Meester, L. (2006). *A modern introduction to probability and statistics: Understanding why and how*. Springer London. Zugriff auf <https://books.google.de/books?id=TEcmHJX67coC>
- Feldman, R. M. & Valdez-Flores, C. (2010). Markov processes. In *Applied probability and stochastic processes*. Berlin, Heidelberg: Springer Berlin Heidelberg.
- Gosavi, A. (2009). Reinforcement learning: A tutorial survey and recent advances. *INFORMS Journal on Computing*, 21. doi: 10.1287/ijoc.1080.0305
- Howard, R. A. (1960). *Dynamic programming and markov processes*.
- Kumar, G. (2014). *Markov chains and markov jump processes* (Unveröffentlichte Dissertation). Indian Institute of Science Education and Research Kolkata.
- Mehlhorn, K. & Sanders, P. (2008). *Algorithms and data structures: The basic toolbox*. Springer Science & Business Media.
- Möller, B. & Struth, G. (2004). Greedy-like algorithms in modal kleene algebra. In R. Berghammer, B. Möller & G. Struth (Hrsg.), *Relational and kleene-algebraic methods in computer science*. Berlin, Heidelberg: Springer Berlin Heidelberg.
- Saul, L. & Jordan, M. (1999, 10). Mixed memory markov models: Decomposing complex stochastic processes as mixtures of simpler ones. *Machine Learning*, 37, 75-87. doi: 10.1023/A:1007649326333

- Sutton, R. S. & Barto, A. G. (2018). *Reinforcement learning: An introduction* (Second Aufl.). The MIT Press. Zugriff auf <http://incompleteideas.net/book/the-book-2nd.html>
- Watkins, C. J. C. H. (1989). Learning from delayed rewards.
- Wiering, M. & van Otterlo, M. (2012). *Reinforcement learning: State-of-the-art*. Zugriff auf <https://ebookcentral.proquest.com>
- Yu, J. Y., Mannor, S. & Shimkin, N. (2009). Markov decision processes with arbitrary reward processes. *Mathematics of Operations Research* (3), 737–757. Zugriff auf <http://www.jstor.org/stable/40538443>

Bellman Optimality Equation:

$$\begin{aligned} q_*(s, a) &= \mathbb{E}[R_{t+1} + \gamma \max_{a'} q_*(S_{t+1}, a') \mid S_t = s, A_t = a] \\ &= \sum_{s', r} p(s', r \mid s, a) [r + \gamma \max_{a'} q_*(s', a')] \end{aligned} \tag{6.1}$$