

---

# 高级量化交易技术

---

闫涛  
科技有限公司  
北京  
{yt7589}@qq.com

## 第一篇深度强化学习

# 第1章强化学习概述

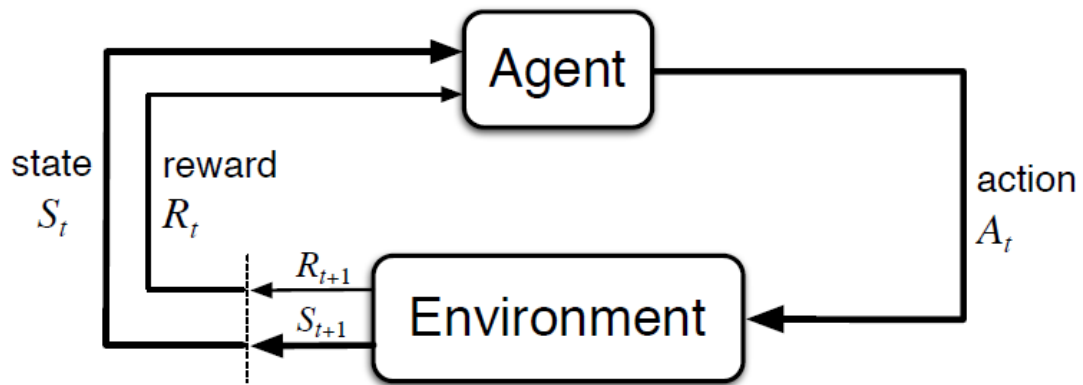
## Abstract

在本章中我们将讨论强化学习中的环境、Agent、状态、Action和奖励，并重点讨论MDP相关内容。

## 1 MDP概述

一个典型的强化学习系统结构如下所示：

图 1: 典型强化学习系统架构图



如图所示：

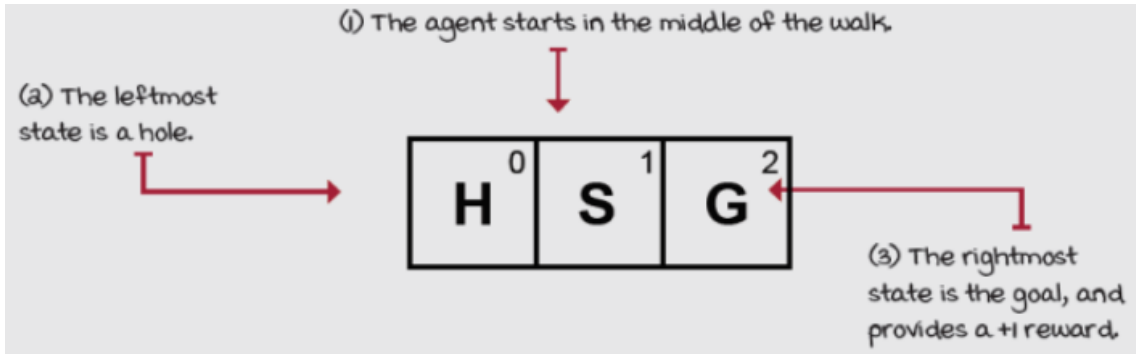
1. 在 $t$ 时刻Agent观察到环境状态 $S_t$ ，并得到上一时刻所采取的行动 $A_{t-1}$ （在图中未画出）所得到的奖励 $r_t$ ；
2. Agent根据环境状态 $S_t$ ，根据某种策略 $\pi$ ，选择行动 $A_t$ ；
3. 环境接收到Agent的行动 $A_t$ 后，根据环境的动态特性，转移到新的状态 $S_{t+1}$ ，并产生 $R_t$ 的奖励信号；

### 1.1 典型环境

#### 1.1.1 Bandit Walk环境

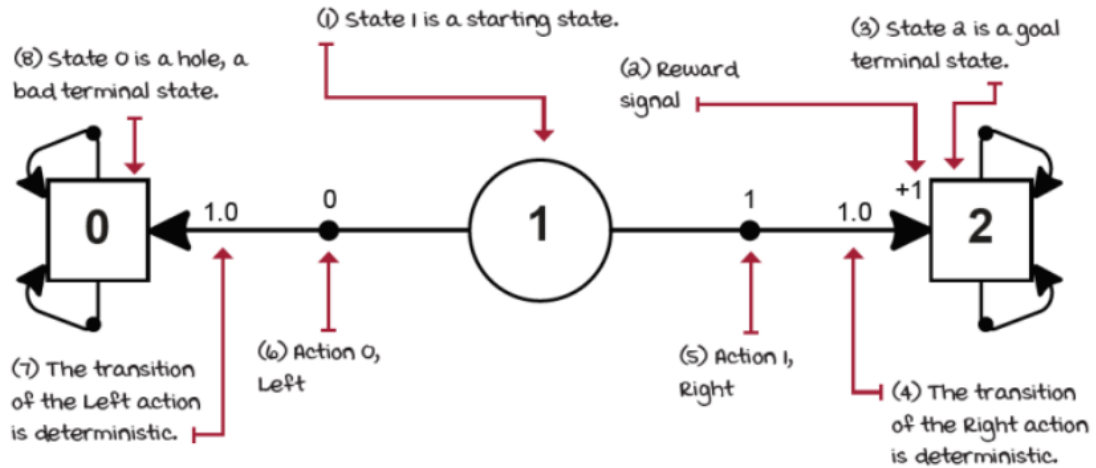
下面我们来研究一个最简单的强化学习环境，叫Bandit Walk，如下所示：

图 2: Bandit Walk环境图



如图所示，Agent初始时位于中间的S格，状态编号为 $S_0$ ，其可以采取向左、向右两个动作，向左则进入状态H，其是一个洞，就会掉到洞里，过程就会结束，此时得到的奖励为0；当Agent采取向右行动时，就会进入G状态，此时会获得奖励+1，由此可见其是一个确定性的环境，就是说当Agent采取向右行动时，会100%确定进行G状态。我们可以通过如下的图来表示上述过程：

图 3: Bandit Walk环境MDP图



如图所示：

- 在初始状态 $S_0$ 时，有两个可选行动，分别表示为向左、向右的直线；
- 当采取向右行动时，就会到达小黑点位置，然后由环境决定将转到哪个状态，以及转到这个状态的概率，以本例为例，其就是以100% 的概率转到G状态 $S_2$ ，其中小黑点上面的1代表行动编号，向右简头上面的1.0代表100%的概率，向右简头处的1代表奖励为+1；

我们首先安装所需要的库：

```
pip install gym -i https://pypi.tuna.tsinghua.edu.cn/simple
```

Listing 1: 安装gymy库

下面我们用Python对象来表示这一过程：

```
1 P = {  
2     0: {  
3         0: [(1.0, 0, 0.0, True)],  
4         1: [(1.0, 0, 0.0, True)]  
5     },  
6     1: {  
7         0: [(1.0, 0, 0.0, True)],  
8         1: [(1.0, 2, 1.0, True)]  
9     },  
10    2: {  
11        0: [(1.0, 2, 0.0, True)],  
12        1: [(1.0, 2, 0.0, True)]  
13    }  
14 }  
15 print(P)
```

Listing 2: Bandit Walk python程序

代码解读如下所示：

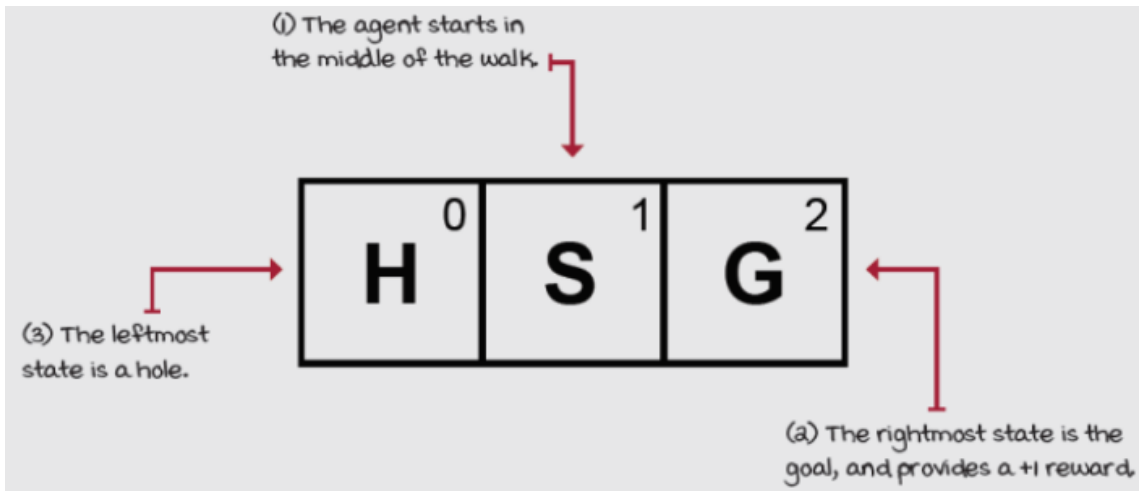
- P为一个字典对象，其键值0、1、2代表三个状态；
- P的键值0：其同样是一个字典对象，键值代表可以采取的行动，0代表向右，1代表向右；
- P的键值0下键值0：即在状态0下面采取行动0，其值为一个数组，代表由环境决定要转到哪个状态，转到每个状态为一个Tuple，含义为：（概率, 目的状态, 获得奖励, 新状态是否为终止状态），注意：我们规定在终止状态采取任何行动都会回到自身；

上面我们仅举了一个例子，其他状态读者可以自己解析出来。

### 1.1.2 Bandit Slippery Walk环境

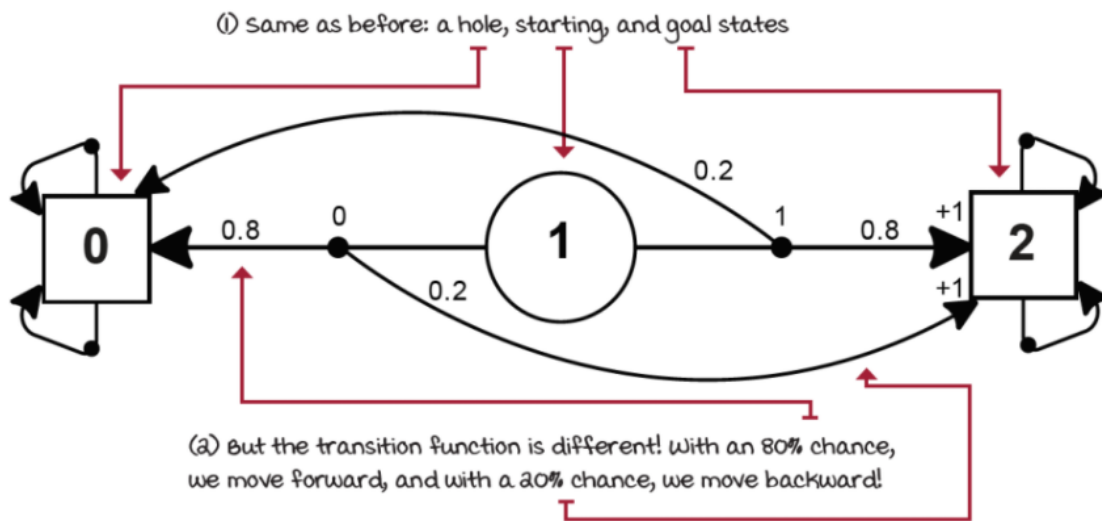
在上面的环境中，我们向左移动，环境会确定地向左移动。但是在本节中，当我们向左移动时，环境在80%的情况下会向左移动，20%的情况会向右移动。如下图所示：

图 4: Bandit Slippery Walk环境图



除了环境的随机性之外，环境与上一节相同。其MDP图如下所示：

图 5: Bandit Slippery Walk环境MDP图



如上图所示，在开始时Agent位于状态S，其可以采取的行动为向左编号为0或向右编号为1，我们以向右为例，当Agent采取向右行动时，其达到状态S右侧的小黑点，上面的1代表是编号为1的行动，此时环境将以80%的概率转变为状态G，得到+1的奖励，如图中的右箭头所示，同时环境还可能将以20%的概率变为状态H，其所获得的奖励为0，如图中向左的曲线箭头所示。读者可以按照上面的描述，自己补充出其他状态变化情况。由前面的讨论可以看出，在这个例子中，当Agent采取向右行动Action时，环境仅以80%的概率完成该Action，同时还可能以20%的概率向相反的方向变化，既环境具有一定的随机性。我们可以通过如下的Python代码来表示这一过程：

```
1 def bandit_slippery_walk(self):
2     P = {
```

```

3         0: {
4             0: [(1.0, 0, 0.0, True)],
5             1: [(1.0, 0, 0.0, True)]
6         },
7         1: {
8             0: [(0.8, 0, 0.0, True), (0.2, 2, 1.0, True)],
9             1: [(0.8, 2, 1.0, True), (0.2, 0, 0.0, True)]
10        },
11        2: {
12            0: [(1.0, 2, 0.0, True)],
13            1: [(1.0, 2, 0.0, True)]
14        }
15    }
16    print(P)

```

Listing 3: Bandit Slippery Walk python程序

如上所示，在状态S时，如果采取编号为0的向左行动，则有80%的概率会进入到状态H，奖励为0.0，并且是终止状态，当采用编号为1的向右行动时，将进入状态G，获得奖励为1.0，并且为终止状态，采用这种方式我们就表示了环境的随机性。

## 1.2 典型交互

Agent与环境的交互分为分段的或连续的，由一系列时间步聚组成，在时间 $t$ 时刻：

- Agent得到环境给的奖励信号 $R_t$ ，其由Agent在上一时刻 $S_{t-1}$ 采取行动 $A_{t-1}$ 时所获得的，并且Agent观察到环境状态 $S_t$ ；
- Agent根据所观察到的环境状态 $S_t$ ，选择采取行动 $A_t$ ；
- 环境接收到行动 $A_t$ 后，会转移到新的状态 $S_{t+1}$ ，并且会给Agent奖励 $R_{t+1}$ ；
- 依次循环.....

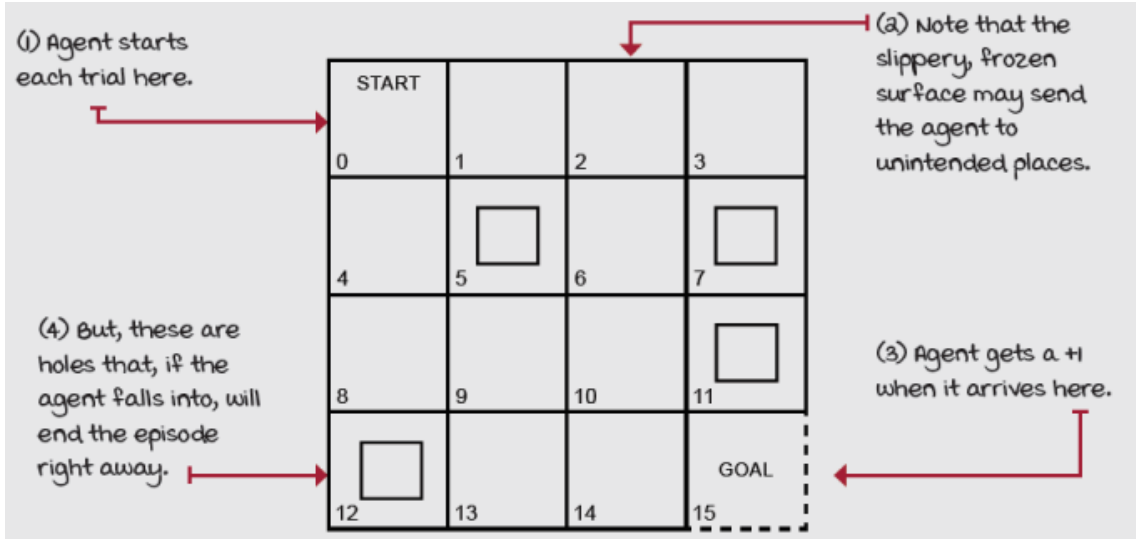
上述过程可以表示为：

$$(R_0, S_0, A_0), (R_1, S_1, A_1), (R_2, S_2, A_2), \dots, (R_t, S_t, A_t), \dots, (R_T, S_T, A_T) \quad (1)$$

## 1.3 MDP定义

我们以Frozen Lake为例来定义MDP过程。该环境如下所示：

图 6: Frozen Lake环境图



如图所示：

- Agent从状态Start开始；
- 在每个状态，Agent可以采取向左、向上、向下、向右行动，当在边缘状态时，走出环境的行动会100%使Agent留在原状态；
- 由于是冻冰的湖面，例如当Agent选择向下行动时，其有33.3%的概率向下运动，还有66.7%的概率会向垂直的方向运动，既以33.3%的概率向左运动，33.3%的概率向右运动；
- 当Agent到达有洞的状态时，过程立即结束；
- 当Agent到达最终节点时，可以获得+1的奖励；

### 1.3.1 环境状态建模

时刻 $t$ 环境状态的状态表示为 $S_t$ ，环境所有可能的状态用集合 $\mathcal{S}$ 表示，通常我们用 $n$ 维向量来表示一个状态：

$$S_t = \mathbf{s} = \begin{bmatrix} s_1 \\ s_2 \\ \dots \\ s_n \end{bmatrix} \in R^n \quad (2)$$

对于我们当前研究的这个问题，环境状态只需要表示Agent处于哪个状态即可，我们采用0~15来对状态进行编号，因此状态可以用0~15来表示：

$$S_t = \mathbf{s} = [i] \in R^1, i \in \{0, 1, 2, 3, \dots, 15\} \quad (3)$$

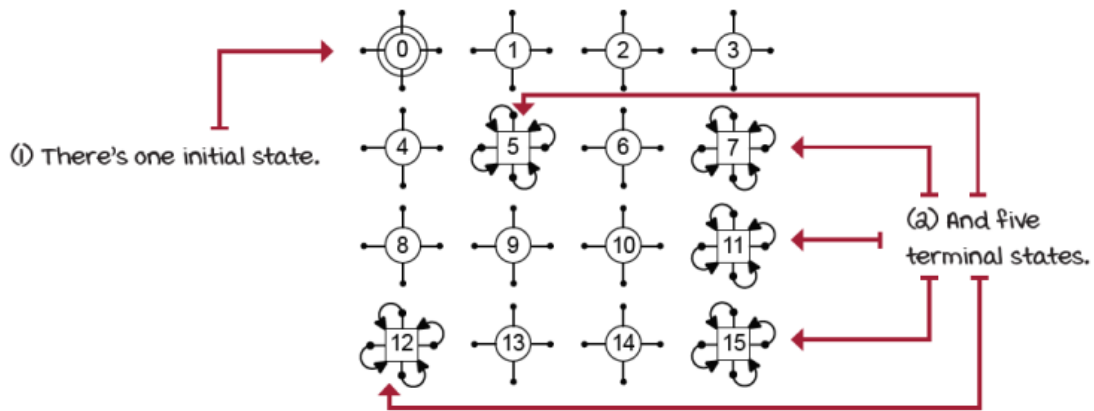
我们规定环境只与当前状态有关，而与过去的历史无关，这就是马可夫特性，即我们研究的过程是无记忆的。乍一看，这是一个非常严重的限制条件，但是在实际应用中，我们通常可以通过设计合适的状态，使所研究的问题变为无记忆的。用数学语言可以表示为：

$$P(S_{t+1}|S_t, A_t) = P(S_{t+1}|S_t, A_t, S_{t-1}, A_{t-1}, \dots) \quad (4)$$

以Frozen Lake为例，其每个状态和在状态上可以采取的行动如下所示：

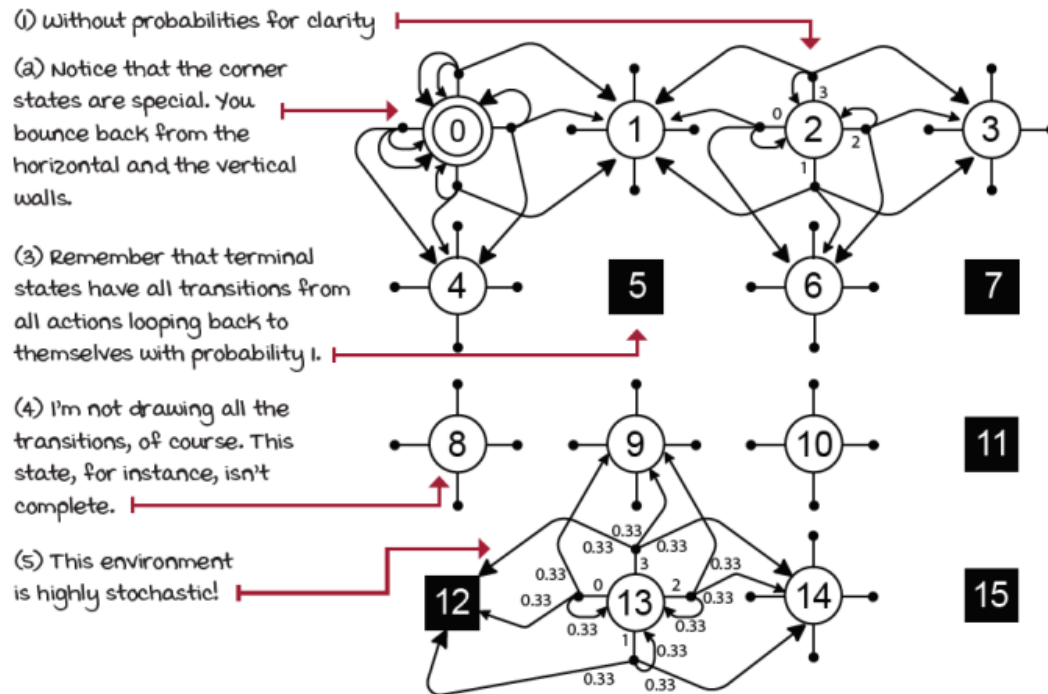


图 7: Frozen Lake状态和行动图



当Agent采取行动后，环境会根据自身的动态特性，转移到下一个状态，我们称之为转移函数，如下图所示：

图 8: Frozen Lake状态转移图



在状态13时，共有向左、向下、向右、向上编号分别为0、1、2、3的四种行动，当Agent采取行动0向左时，将到达左侧的小黑点，

- 行动0（向左）：到达左侧小黑点，由于冻冰原因，其有如下三种可能性：
  - 33.3%：向左，进入状态12，获取奖励0.0，并且为终止状态，用(0.333, 12, 0.0, True)表示；

- 33.3%: 向下, 由于是边缘节点, 其仍然在状态13, 获取奖励0.0, 不为终止状态, 用(0.333, 13, 0.0, False)表示;
- 33.3%: 向上, 进入状态9, 获取奖励为0.0, 不是终止状态, 用(0.33, 9, 0.0, False)表示;
- 行动1 (向下): 到达下面小黑点, 有如下三种可能性:
  - 33.3% (向下): 由于是边缘节点, 其仍然在状态13, 获得奖励为0.0, 不是终止状态, 用(0.333, 13, 0.0, False)表示;
  - 33.3% (向左): 进入状态12, 获得奖励0.0, 并且为终止状态, 用(0.333, 12, 0.0, True)表示;
  - 33.3% (向右): 进入状态14, 获得奖励0.0, 不是终止状态, 用(0.333, 14, 0.0, False)表示;

我们这里仅举了两个例子, 其余内容读者可以自己补全。环境的状态转移函数如下所示:

$$p(s'|s, a) = P(S_t = s' | S_{t-1} = s, A_{t-1} = a)$$

$$\sum_{s' \in S} p(s'|s, a) = 1, \forall s \in S, \forall a \in A(s) \quad (5)$$

上式表明在任意时刻, 环境状态为 $S_{t-1} = s$ , Agent采取行动为 $A_{t-1} = a$ 时, 环境由于具有随机性, 以一个确定的概率分布进入新状态 $S_t = s'$ , 并且如果我们将所有可能到达的新状态的概率相加, 其值为1。当Agent根据自己的策略, 在任意时刻采取行动后, 系统会给Agent一个奖励Reward, 其是一个标量, 越大代表该行动决策越好, 越小代表越差, 甚至可以为负值, 代表需要尽力避免的情况。需要注意的是, Agent不仅要关注当前获得的奖励, 还要关注最终获得的累积的奖励, Agent的目标就是使最终获得的累积奖励最大。环境的奖励函数如下表示:

$$r(s, a) = E\left(R_t | S_{t-1} = s, A_{t-1} = a\right) \quad (6)$$

上式表明在 $t-1$ 时刻, 环境状态为 $S_{t-1} = s$ , Agent采取行动 $A_{t-1} = a$ , 环境在 $t$ 时刻给出奖励 $R_t$ , 由于环境具有随机性, 环境可能进入不同的状态, 从而获得不同的奖励, 而且即使是进入同一个状态, 获得的奖励也有可能不同, 因此在这种情况下, 下的奖励就是所有这种情况下获得奖励的期望值。在 $t-1$ 时刻, 环境状态为 $S_{t-1} = s$ , Agent采取行动 $A_{t-1} = a$ , 环境进入 $S_t = s'$ 时, 获得的奖励为:

$$r(s, a, s') = E\left(R_t | S_{t-1} = s, A_{t-1} = a, S_t = s'\right) \quad (7)$$

从上式就可以看出, 即使是转移到同一个状态, 也可能获得不同的奖励, 所以我们将奖励定义所有这些值的期望。在上面我们定义在任意时刻, Agent通过与环境交互, 获得的奖励为 $R_t$ , 同时我们知道, Agent的目标是使整个过程, 所有时刻所获得奖励的累加值最大, 我们将其定义为回报 $G_t$ 。但是由于未来具有更大的不确定性, 因此距离当前时间点越近, 获得的奖励就越有价值, 越远则价值越小, 因此我们引入折扣的概念, 如下所示:

$$G_t = R_{t+1} + \gamma R_{t+2} + \gamma^2 R_{t+3} + \dots + \gamma^{k-1} R_{t+k} + \dots + R_T$$

$$= \sum_{k=0}^{\infty} \gamma^k R_{t+k+1} \quad (8)$$

$$= R_{t+1} + \gamma G_{t+1}$$

## 1.4 状态价值函数

我们假定Agent的策略为 $\pi$ ，我们定义当Agent在某个状态可以获得的累积奖励的期望值为该状态的值函数，如下所示：

$$v_{\pi}(s) = E_{\pi}(G_t | S_t = s) = E_{\pi}(R_{t+1} + \gamma G_{t+1} | S_t = s) \quad (9)$$

由于上式是求期望值，根据期望值定义，可以得到：

$$v_{\pi}(s) = \sum_a \pi(a|s) \sum_{s',r} p(s', r | s, a) (r + \gamma v_{\pi}(s')) \quad (10)$$

这个公式在本质上是一个递归形式的公式，我们将用递归的方法来求解。

## 1.5 行动价值函数

我们还需要知道在某个状态下，采取某个行动到底有多好，这就是行动价值函数：

$$q_{\pi}(s, a) = E_{\pi}(G_t | S_t = s, A_t = a) = E_{\pi}(R_{t+1} + \gamma G_{t+1} | S_t = s, A_t = a) \quad (11)$$

根据期望的定义可得：

$$q_{\pi}(s, a) = \sum_{s',r} p(s', r | s, a) (r + \gamma v_{\pi}(s')) \quad (12)$$

这就是所谓的Q函数，需要注意的是这个公式的含义，这个公式表示在状态 $S_t = s$ 时Agent不按照策略 $\pi$ 情况下采取 $A_t = a$ ，然后Agent会一直采用策略 $\pi$ ，这种情况下所取得的累积奖励的期望值。

## 1.6 优势函数

当在状态 $S_t = s$ 时Agent不按照策略 $\pi$ 情况下采取 $A_t = a$ ，与在状态 $S_t = s$ 时Agent按照策略 $\pi$ 相比，所取得的累积奖励的期望值的变化量定义为优势函数（Advantage Function）：

$$a_{\pi}(s, a) = q_{\pi}(s, a) - v_{\pi}(s) \quad (13)$$

## 1.7 优化

我们的目的是要找到最优策略，使得在每个状态下的状态价值函数可以最大，每个行动价值函数也达到最大，需要注意的是，最优策略可能不止一种，但是对于每个状态的状态价值函数值却是唯一的，同时每个状态采取行动的行动价值函数值也是唯一的。我们用 $\pi^*$ 来表示最优策略，定义如下所示：

$$v_*(s) = \max_{\pi} v_{\pi}(s), \forall s \in S \quad (14)$$

我们可以将 $v_{\pi}$ 的计算公式代入可得：

$$v_*(s) = \max_a \sum_{s',r} p(s', r | s, a) \left( r + \gamma v_*(s') \right) \quad (15)$$

同样对于行动价值函数来说，最优策略可以定义为：

$$q_*(s, a) = \max_{\pi} q_{\pi}(s, a), \forall s \in S, \forall a \in A \quad (16)$$

代入具体的计算公式可行：

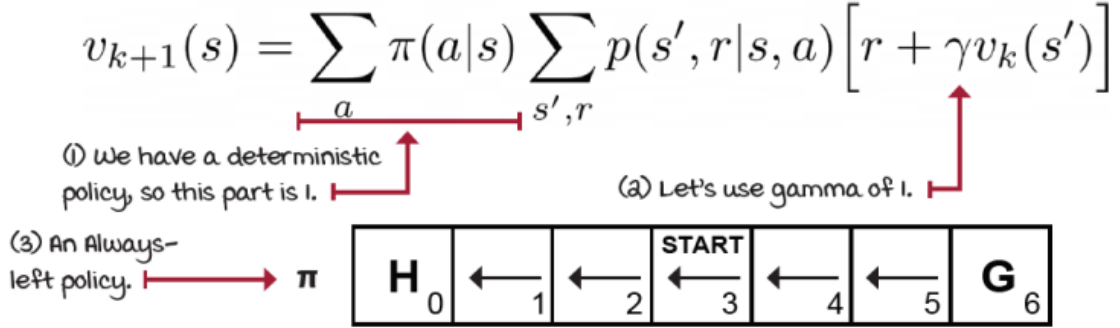
$$q_*(s, a) = \sum_{s',r} p(s', r | s, a) \left( r + \gamma \max_{a'} q_*(s', a') \right) \quad (17)$$

在有了最佳策略定义之后，我们就需要来评估策略，我们首先用状态价值函数来评估策略，我们称之为预测问题：

$$v_{k+1}(s) = \sum_a \pi(a|s) \sum_{s',r} p(s',r|s,a) \left( r + \gamma v_k(s') \right) \quad (18)$$

在上式中，下标 $k$ 代表是第几次迭代，通过迭代，我们可以求出每个状态的状态价值函数的值。我们以Slippery Walk Floor为例，来看上面公式的具体使用：

图 9: Slippery Walk Floor环境示意图



如上图所示，我们的策略是在每个状态均采取向左的行动，我们假设现在我们在状态5处，根据当前策略，我们只有一个行动既向左行动，同时由于环境具有随机性，使我们可能进入到状态4（50%概率）、状态5（33.3%概率）和状态6（16.6%概率），初始时，我们设所有状态的状态价值函数的值为0，如下所示：

$$\begin{aligned}
 v_1^\pi(5) &= \sum_a \pi(a|s) \sum_{s',r} p(s',r|s,a) \left( r + \gamma v_0^\pi(s') \right) \\
 &= \sum_{s',r} p(s',r|s,a) \left( r + \gamma v_0^\pi(s') \right) & 1 \\
 &= p(s' = 4, r = 0 | s = 5, a = Left) (r = 0 + 1.0 * v_0^\pi(4)) & 2 \\
 &+ p(s' = 5, r = 0 | s = 5, a = Left) (r = 0 + 1.0 * v_0^\pi(5)) & 3 \\
 &+ p(s' = 6, r = 1 | s = 5, a = Left) (r = 1 + 1.0 * v_0^\pi(6)) & 4 \\
 &= 0.5 * (0 + 0) + 0.33 * (0 + 0) + 0.16 * (1 + 0) = 0.16
 \end{aligned} \quad (19)$$

公式解读如下所示：

- 第1行：由于本策略只采取向左行动，因此前面的 $\sum_a \pi(a|s)$ 的概率值为1，所以可以去掉；
- 第2行：转移到状态4时的情况；
- 第3行：转移到状态5时的情况；
- 第4行：转移到状态6时的情况；

通过上面的计算过程可以看出，我们将初始状态时所有状态的状态价值函数值设置为0，然后通过上面的迭代算法，就可以算出各个状态的状态价值函数的真实值，并且收敛的速度还是比较快的。我们首先初始化强化学习环境，我们先安装所需的库：

```

1 cd /e/awork/ext
2 git clone https://github.com/mimoralea/gym-walk.git
3 cd gym-walk
4 pip install .

```

Listing 4: 安装依赖库

环境初始化代码如下所示:

```

1 def startup(self):
2     env = gym.make('SlipperyWalkFive-v0')
3     P = env.env.P
4     init_state = env.reset()
5     goal_state = 6
6     LEFT, RIGHT = range(2)
7     pi = lambda s: {
8         0:LEFT, 1:LEFT, 2:LEFT, 3:LEFT, 4:LEFT, 5:LEFT, 6:LEFT
9     }[s]
10    self.print_policy(pi, P, action_symbols=('<', '>'), n_cols=7)
11
12    def print_policy(self, pi, P, action_symbols=('<', 'v', '>', '^'),
13        n_cols=4, title='Policy:'):
14        print(title)
15        arrs = {k:v for k,v in enumerate(action_symbols)}
16        for s in range(len(P)):
17            a = pi(s)
18            print("| ", end="")
19            if np.all([done for action in P[s].values()
20                for _, _, _, done in action]):
21                print(" ".rjust(9), end=" ")
22            else:
23                print(str(s).zfill(2), arrs[a].rjust(6), end=" ")
24            if (s + 1) % n_cols == 0: print("|")

```

Listing 5: SWF环境初始化(chp001/exp001\_002.py)

代码解读如下所示:

- 第2行: 生成强化学习环境, 使用的是gmy\_walk包中定义的环境;
- 第3行: P为我们在前面讨论的结构:

```

1 {
2     si:{
3         ai: [(p, s', r, False)]
4     }
5 }

```

Listing 6: SWF环境初始化(chp001/exp001\_002.py)

第一层为以状态为键的字典, 每个状态是以行动为键的字典, 值为一个列表, 代表在当前状态下采取行动后, 环境会以多大的概率, 转移动新状态, 获得的奖励以及新状态是否为终止状态;

- 第4行：重置环境状态，并获取初始状态；
- 第5行：将状态6设置为目标状态；
- 第6行：设置行动LEFT为0，RIGHT为1；
- 第7~9行：定义策略，其为lambda表达式，参数为s，定义了一个字典，策略为取出该字典中以参数s为键的元素，其中s代表状态编号，策略的类型为函数；
- 第10行：打印策略；
- 第12、13行：定义打印策略函数：，
  - pi为策略类型为函数，参数为状态编号，返回值为所采取的行动；
  - P为状态、行动的转移矩阵，即环境的MDP特性；
  - action\_symbols 行动的符号表示；
  - n\_cols 共有几个状态，这里有7个状态，0和6代表终止状态；
  - title 标题；
- 第15行：arrs的形式为：0: '<', 1: '>';
- 第16行：循环处理每个状态，s为状态编号；
- 第27行：以状态编号为参数，调用策略函数，求出该状态下采取的行动编号（在其他复杂问题中，可能是采取一系列行动的概率分布）；
- 第19、20行：通过如下代表：

```

1 def test001(self, P, state):
2     v1 = [action for action in P[state].values()]
3     print('v1: {0};'.format(v1))
4     v2 = [done for action in P[state].values() for _, _, _, done
5           in action]
6     print('v2: {0};'.format(v2))
7     v3 = np.all(v2)
8     print('v3: {0};'.format(v3))

```

Listing 7: SWF环境初始化(chp001/exp001\_002.py)

状态0时：

```

1     v1: [
2         [
3             (0.5000000000000001, 0, 0.0, True),
4             (0.3333333333333333, 0, 0.0, True),
5             (0.16666666666666666, 0, 0.0, True)
6         ],
7         [
8             (0.5000000000000001, 0, 0.0, True),
9             (0.3333333333333333, 0, 0.0, True),
10            (0.16666666666666666, 0, 0.0, True)
11        ]
12    ];
13    v2: [True, True, True, True, True, True];
14    v3: True;

```

Listing 8: SWF环境初始化(chp001/exp001\_002.py)

状态1时:

```
1     v1: [  
2         [  
3             (0.50000000000000001, 0, 0.0, True),  
4             (0.3333333333333333, 1, 0.0, False),  
5             (0.16666666666666666, 2, 0.0, False)  
6         ],  
7         [  
8             (0.50000000000000001, 2, 0.0, False),  
9             (0.3333333333333333, 1, 0.0, False),  
10            (0.16666666666666666, 0, 0.0, True)  
11        ]  
12    ];  
13    v2: [True, False, False, False, False, True];  
14    v3: False;
```

Listing 9: SWF环境初始化(chp001/exp001\_002.py)

状态2时:

```
1     v1: [  
2         [  
3             (0.50000000000000001, 1, 0.0, False),  
4             (0.3333333333333333, 2, 0.0, False),  
5             (0.16666666666666666, 3, 0.0, False)  
6         ],  
7         [  
8             (0.50000000000000001, 3, 0.0, False),  
9             (0.3333333333333333, 2, 0.0, False),  
10            (0.16666666666666666, 1, 0.0, False)  
11        ]  
12    ];  
13    v2: [False, False, False, False, False, False];  
14    v3: False;
```

Listing 10: SWF环境初始化(chp001/exp001\_002.py)

上面的代码就是确定某个状态是否是终止状态;

- 第21行: 当为终止状态时打印空;
- 第23行: 当不为终止状态时, 打印状态编号和行动的符号;

## 第二篇时序信号分析



### 第三篇 量化交易平台

## 第四篇 50ETF期权

## 第五篇 50ETF量化交易

### 2 附录X

## 参考文献