

CSE 691 习题

德梅萃 · P. 博赛卡斯 (Dimitri P. Bertsekas) 著

李宇超 (Yuchao Li) 译

习题 1 [Ber17, 习题 2.1] 考虑由节点 (node) $1, \dots, 6$ 以及连接它们的边 (edge) 构成的图 (graph) 如图 1 所示。请采用动态规划算法计算节点 $1, \dots, 5$ 到节点 6 的最短路径。采用编程或者手算方式均可。提示：在此问题中，阶段数目 N 应当设为多少？每阶段中应当包含哪些状态呢？

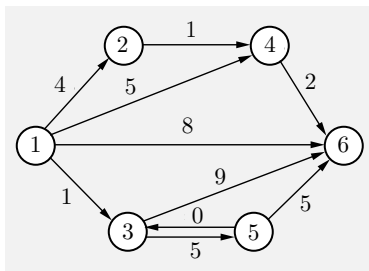


图 1: 习题 1 中涉及的图。标注于边旁的数值表示边长。

习题 2 考虑习题 1 中的最短路径问题。请采用策略前展算法 (rollout) 给出该问题的近似解。提示：可以采用贪心策略作为策略前展中的启发式方法。例如，当处于节点 3 时，可选的下一个节点包括了节点 5 和节点 6。贪心策略比较前往这两个节点的边的长度（即 5 和 9），并选择前往边长较短的后续节点（即对应于边长 5 的节点 5）。

习题 3 [Ber17, 例 3.5.1] 某智力竞赛共有 N 道题目，记作题目 $1, 2, \dots, N$ 。参赛者可以自由选择其答题次序，当答对题目 i 时，参赛者可以得 R_i 的奖励，并继续回答后续问题。一旦某题目回答错误，参赛者便不可以回答后续问题。小明答对题目 i 的概率为 p_i ，那么他应当如何安排答题顺序从而使他期望的收益最大化呢？请采用动态规划给出该问题的解析解。提示：在此问题中，什么是状态、控制和系统呢？

习题 4 [Ber22, 习题 1.5] 本习题的目的是通过一维的线性二次型问题

来体现策略迭代与牛顿法的等效性。在此问题中，系统为 $f(x, u) = x + bu$ ，阶段费用为 $g(x, u) = x^2 + ru^2$ ，其中 $b \neq 0$ 且 $r > 0$ 。

(a) 请验证贝尔曼方程

$$Kx^2 = \min_u [x^2 + ru^2 + K(x + bu)^2]$$

可以写作等效形式 $H(K) = 0$ ，其中

$$H(K) = K - \frac{rK}{r + b^2K} - 1.$$

(b) 现考虑策略迭代算法

$$K_k = \frac{1 + rL_k^2}{1 - (1 + bL_k)^2},$$

其中

$$L_{k+1} = -\frac{bK_k}{r + b^2K_k},$$

且 $\mu(x) = L_0x$ 为起始策略。证明该算法等效于通过牛顿法

$$K_{k+1} = K_k - \left(\frac{\partial H(K_k)}{\partial K} \right)^{-1} H(K_k)$$

求解贝尔曼方程 $H(K) = 0$ 。

(c) 请将上述结论推广到系统为 $f(x, u) = ax + bu$ ，阶段费用为 $g(x, u) = qx^2 + ru^2$ ，其中 $a, b \neq 0$ 且 $q, r > 0$ 的情况。

习题 5 [KG88] 本习题的目的是通过编写代码实现课程中讲解的经典形式的模型预测控制。我们考虑线性系统 $f(x, u) = Ax + Bu$ ，其中

$$A = \begin{bmatrix} 1 & 1 \\ 0 & 1 \end{bmatrix}, \quad B = \begin{bmatrix} 0 \\ 1 \end{bmatrix}.$$

阶段费用为 $g(x, u) = x'Qx + Ru^2$ ，其中

$$Q = \begin{bmatrix} 1 & 0 \\ 0 & 1 \end{bmatrix}, \quad R = 1.$$

在此基础上，我们要求状态的每个组分的绝对值小于 5，即状态 x 处于约束集 X 中，且

$$X = \{x \mid x = (y, z), |y| \leq 5, |z| \leq 5\}.$$

控制约束不随状态改变, 即 $U(x) = U$, 且

$$U = \{u \mid |u| \leq 1\}.$$

针对上述问题, 请编程实现讲义中式 (1.72)-(1.75) 所表示的经典形式的模型预测控制。其中参数 ℓ 可以设为 5。通过随机生成属于约束集 X 的初始状态 x_0 测试所得模型预测控制的性能。另外, 也可以尝试扩大或减小 ℓ 的取值, 探索其对于所得策略性能的影响。

参考文献

- [Ber17] Dimitri P. Bertsekas. *Dynamic Programming and Optimal Control*, volume 1. Athena Scientific, 4 edition, 2017.
- [Ber22] Dimitri P. Bertsekas. 策略前展、策略迭代与分布式强化学习 (*Roll-out, Policy Iteration, and Distributed Reinforcement Learning*). 清华大学出版社, 2022.
- [KG88] S. Sathya Keerthi and Elmer G. Gilbert. Optimal infinite-horizon feedback laws for a general class of constrained discrete-time systems: Stability and moving-horizon approximations. *Journal of Optimization Theory and Applications*, 57(2):265–293, 1988.