

УДК 62—50

НЕКОТОРЫЕ ЗАДАЧИ ИДЕНТИФИКАЦИИ ДЛЯ ЛИНЕЙНЫХ ДИСКРЕТНЫХ СИСТЕМ С КВАДРАТИЧНЫМИ ОГРАНИЧЕНИЯМИ

Исаков А. И.

Для линейных дискретных систем рассматривается задача оценивания матричных параметров при условии, что доступная информация ограничена измерением функции координат системы [1—7]. Получено описание информационного множества весовых функций, совместимых с результатами измерений, а также матричное уравнение для его центра. Показано, что разрешающий оператор данной задачи оценивания допускает факторизацию, свойства которой позволяют свести решение полученных матричных уравнений к решению векторных уравнений. По постановке и методам решения работа примыкает к исследованиям [1, 2].

1. Постановка задачи и основные определения. Дана линейная управляемая система с дискретным временем

$$(1.1) \quad \begin{aligned} x(1) &= K(1)x(0) + Bu(0) \\ x(k+1) &= K(k+1)x(0) + \sum_{i=0}^{k-1} K(k-i)Bu(i) + Bu(k), \\ k &= 1, \dots, p-1 \end{aligned}$$

Здесь $K(i)$ ($i = 1, \dots, p$) — заранее неизвестные весовые ($n \times n$)-матрицы, $x(0)$ — известный n -мерный вектор начального положения системы (1.1), $u(i)$ ($i = 0, \dots, p-1$) — известные r -векторные управляющие воздействия. Матрица B размера $n \times r$ известна.

Дополнительная информация о системе (1.1) может быть получена по ходу процесса за счет дополнительных измерений в силу уравнения

$$(1.2) \quad y(k+1) = Gx(k+1) + \xi(k+1), \quad k = 0, 1, \dots, p-1$$

где $\xi(i)$ ($i = 1, \dots, p$) — m -векторные помехи в измерительном устройстве, G — известная ($m \times n$)-матрица.

Предполагается, что априори неизвестные параметры системы (1.1), (1.2) стеснены совместными квадратичными ограничениями

$$(1.3) \quad \sum_{i=1}^p \{ \langle K(i) - K_0(i), N_*(K(i) - K_0(i)) \rangle + (\xi(i), \xi(i)) \} \leq \mu^2$$

Здесь N_* — линейный симметричный положительный оператор на пространстве ($n \times n$)-матриц (в частности, это может быть оператор левого или правого умножения на симметричную положительную ($n \times n$)-матрицу), $K_0(i)$ ($i = 1, \dots, p$) — известные ($n \times n$)-матрицы, μ — заданное число. Символ $\langle \cdot, \cdot \rangle$ означает здесь и далее скалярное произведение на

матричных пространствах, определенное $\langle A, B \rangle = \text{tr} (AB^*)$ [8—14], а (\cdot, \cdot) — скалярное произведение на векторных пространствах.

Введем следующие определения и обозначения.

Определение 1.1. Информационным множеством $K(p) = K(p | y(1), \dots, y(p))$ весовых функций системы (1.1) — (1.3) назовем семейство всех тех и только тех последовательностей $\{K(1), \dots, K(p)\}$ матриц $K(i)$, для которых существуют m -векторы $\xi(1), \dots, \xi(p)$, такие, что выполняются ограничения (1.1) — (1.3).

Всюду далее измерения $y(1), \dots, y(p)$ фиксированы, $p \geq 1$ — фиксированное число.

Пусть X — конечно-мерное евклидово пространство, A — выпуклый компакт, лежащий в X , функция $\varphi(x) = \max \{\|x - z\| | z \in A\}$.

Определение 1.2. Назовем $a \in X$ центром выпуклого компакта A , если $\varphi(a) = \min \{\varphi(x) | x \in A\}$.

Видно, что выпуклый компакт A всегда имеет центр $a \in A$ и a — центр эллипсоида $(x - a, M(x - a)) \leq v^2$, если M — линейный положительный оператор на X .

Задача. Определить информационное множество $K(p)$ для системы (1.1) — (1.3) по заданному начальному состоянию $x(0)$, входному воздействию $\{u(0), \dots, u(p-1)\}$, результатам измерений $\{y(1), \dots, y(p)\}$. Найти условия, определяющие центр $K(p)$.

Ниже будет показано, что в данной задаче информационное множество есть эллипсоид в соответствующем пространстве матриц.

Удобно ввести следующие обозначения (всюду далее звездочка означает транспонирование):

$$u = \{u(0), \dots, u(p-1)\}^* \in \prod_{i=0}^{p-1} R^r, \quad x = \{x(1), \dots, x(p)\}^* \in \prod_{i=1}^p R^n$$

$$y = \{y(1), \dots, y(p)\}^* \in \prod_{i=1}^p R^m, \quad \xi = \{\xi(1), \dots, \xi(p)\} \in \prod_{i=1}^p R^m$$

$$K = \{K(1), \dots, K(p)\}^* \in \prod_{i=1}^p M_n,$$

$$K_0 = \{K_0(1), \dots, K_0(p)\}^* \in \prod_{i=1}^p M_n$$

Здесь M_n — гильбертово пространство $(n \times n)$ -матриц со скалярным произведением, как определено выше. На произведении гильбертовых пространств скалярное произведение определяется обычным образом, например

$$\langle K_1, K_2 \rangle = \sum_{i=1}^p \langle K_1(i), K_2(i) \rangle, \quad K_1, K_2 \in \prod_{i=1}^p M_n$$

Обозначим полученное гильбертово пространство через H .

2. Построение информационного множества. Перед построением информационного множества приведем следующие определения.

Пусть $x \in R^n$, $y \in R^k$.

Определение 2.1. Тензорным произведением векторов x , y назовем линейный оператор $x \otimes y$ из R^n в R^k , заданный формулой

$$(2.1) \quad (x \otimes y) z = (x, z) y, \quad z \in R^n$$

Оператор $x \otimes y$ может быть записан в матричном виде как yx^* .

Далее пусть A — линейный оператор из R^n в R^m , B — линейный оператор из R^k в R^l , $R^n \otimes R^k$ и $R^m \otimes R^l$ — тензорные произведения соответствующих гильбертовых пространств [8—14].

Определение 2.2. Тензорным произведением линейных операторов A , B назовем линейный оператор $A \otimes B$ из $R^n \otimes R^k$ в $R^m \otimes R^l$, заданный на операторах вида $x \otimes y$, $x \in R^n$, $y \in R^k$ формулой

$$(2.2) \quad (A \otimes B)(x \otimes y) = Ax \otimes By$$

и продолженный по линейности на все пространство $R^n \otimes R^k$.

Отметим, что тензорное произведение векторов из определения 2.1 не есть тензорное произведение соответствующих одностолбцовых матриц из определения 2.2. Пространство $R^n \otimes R^k$ и пространство линейных операторов из R^n в R^k , а также пространство $M_n \otimes M_n$ и пространство линейных операторов из M_n в M_n изоморфны. Линейные операторы на пространствах R^n и M_n допускают представление вида $\sum x_i \otimes y_i$ и $\sum A_i \otimes B_i$ соответственно. Матричная запись оператора $A \otimes B$, где $A \in M_p$, B — линейный оператор из M_n в M_n , имеет вид

$$(2.3) \quad A \otimes B = \begin{vmatrix} a_{11}B & \dots & a_{1p}B \\ \vdots & & \vdots \\ a_{p1}B & \dots & a_{pp}B \end{vmatrix}$$

и, в частности, можно рассматривать оператор $A \otimes B$ на пространстве H . Соответствующее отображение из $R^p \otimes M_n$ на H строится по правилу

$$x \otimes X \rightarrow \{x_1 X, \dots, x_p X\}, \quad x \in R^p, \quad X \in M_n$$

с последующим продолжением на все пространство $R^p \otimes M_n$ по линейности.

Осталось заметить, что справедливы следующие соотношения:

$$(2.4) \quad Ax \otimes By = B(x \otimes y)A^*, \quad \langle A, x \otimes y \rangle = (Ax, y) \\ (A \otimes B)^* = A^* \otimes B^*, \quad (A \otimes B)K = BKA^*$$

Здесь x , y — векторы, A , B , K — матрицы, такие, что соответствующие выражения в (2.4) имеют смысл.

Перейдем к построению информационного множества. Из (2.1) — (2.4) можно получить, что линейное многообразие, задаваемое условиями (1.1), (1.2), имеет вид

$$(2.5) \quad TK + \xi = z; \quad z = y - (E_p \otimes GB)u$$

$$(2.6) \quad T = (E_p \otimes G) \left\{ T_{x(0)} + \sum_{i=0}^{p-2} T_{u(i)} B S_{i+1} \right\}, \quad B = E_p \otimes (B^* \otimes E_n) \\ T_{x(0)} = E_p \otimes (x^*(0) \otimes E_n), \quad T_{u(i)} = E_p \otimes (u^*(i) \otimes E_n)$$

$$S_i \{K_1, \dots, K_p\} = \{0_n, \dots, 0_n, K_1, \dots, K_{p-i}\}, \{K_1, \dots, \dots, K_p\} \in H$$

Здесь T — линейный оператор на пространстве H , S_i — оператор правого сдвига на H , 0_n — нулевой элемент пространства M_n . При этом ограничение (1.3) может быть записано следующим образом:

$$\langle K - K_0, N(K - K_0) \rangle + (\xi, \xi) \leq \mu^2, N = E_p \otimes N_*$$

где N — линейный оператор на пространстве H .

Проведя типичные для линейно-квадратичных задач выкладки, можно установить справедливость следующего утверждения.

Теорема 2.1. Информационное множество $K(p)$ — эллипсоид в пространстве H , определяемый равенством

$$K(p) = \{K \in H \mid \langle K - K_*, M(K - K_*) \rangle \leq \mu^2 - \kappa^2\}$$

Здесь M — блочная $(p \times p)$ -матрица с элементами

$$A_{ii} = N_* + x(0)x^*(0) + \sum_{k=0}^{p-1-i} Bu(k)u^*(k)B^* \otimes G^*G, \quad i = 1, \dots, p$$

$$A_{ij} = (Bu(j-i-1)x^*(0) + \sum_{k=j-i}^{p-1-i} Bu(k)u^*(k-j-i)B^*) \otimes G^*G,$$

$$i < j = 1, \dots, p$$

$$A_{ij} = A_{ji}, \quad j < i = 1, \dots, p$$

Центр K_* информационного множества $K(p)$ есть решение матричного уравнения

$$(2.7) \quad MK = K(y)$$

Правая часть определяется соотношением

$$K(y) = NK_0 + \{G^*z(1)x^*(0), \dots, G^*z(p)x^*(0)\}^* + \\ + \left\{ G^* \left(\sum_{k=2}^p z(k)u^*(k-2) \right) B^*, G^* \left(\sum_{k=3}^p z(k)u^*(k-3) \right) B^*, \dots \right. \\ \left. \dots, G^*z(p)u^*(0)B^*, 0_n \right\}^*$$

$z(1), \dots, z(p)$ — координаты блочного p -вектора z .

Число κ^2 определяется формулой

$$(2.8) \quad \kappa^2 = (z, z) + \langle K_0, NK_0 \rangle - \langle K_*, K(y) \rangle$$

где вектор z строится по сигналу в силу второго соотношения в (2.5).

Решение уравнения (2.7) для центра K_* , а также определение числа κ^2 из (2.8) может быть сведено к более простой задаче, так как оператор M^{-1} допускает удобную факторизацию, к построению которой и переходим.

3. Факторизация оператора M^{-1} , определяющего центр информационного множества $K(p)$. Непосредственно проверяется следующее утверждение.

Лемма 3.1. Пусть X, Y — конечно-мерные векторные пространства, E_X, E_Y — тождественные операторы на X, Y соответственно, T_1 — ли-

$$\begin{aligned}
 a_{1i} &= (x(0), N_1^{-1}Bu(i-2)), \quad a_{i1} = a_{1i}, \quad i = 2, \dots, p \\
 a_{ij} &= (x(0), N_1^{-1}Bu(j-i-1)) + \sum_{k=0}^{i-2} (u(k), B^*N_1^{-1}Bu(k+j-i)), \\
 a_{ji} &= a_{ij}, \quad 2 \leq i < j \leq p
 \end{aligned}$$

Блочный p -вектор z_* имеет вид

$$\begin{aligned}
 z_* &= z - (E_p \otimes G) \{K_0(1)x(0), K_0(2)x(0) + \\
 &+ K_0(1)Bu(0), \dots, K_0(p)x(0) + \sum_{k=0}^{p-2} K_0(k+1)Bu(k)\}^*
 \end{aligned}$$

Для доказательства теоремы 3.1 осталось заметить, что

$$\begin{aligned}
 z - z_* &= TK_0, \quad T^*l_* = \left\{ G^*l_{*1}x^*(0) + \sum_{k=2}^p G^*l_{*k}u^*(k-2)B^*, \dots \right. \\
 &\left. \dots, G^*l_{*p-1}x^*(0) + G^*l_{*p}u^*(0)B^*, G^*l_{*p}x^*(0) \right\}
 \end{aligned}$$

Теорему 3.1 можно рассматривать как утверждение о факторизации оператора M^{-1} в виде RQ^{-1} , где $R(I_*)$ — оператор вычисления (т. е. не требующий решения каких-либо уравнений, если считать, что матрицы N_1^{-1} , N_2^{-1} определены заранее), заданный формулами (3.4), а оператор $Q = A(E_p \otimes GN_2^{-1}G_p^*)$ задает уравнение (3.5) на пространстве последовательностей

$$\prod_{i=1}^p R^n$$

Тем самым теорема 3.1 позволяет избежать решения матричных уравнений, хотя исходная экстремальная задача была априорно задана на матричном пространстве H . Кроме того, число κ^2 , определяемое теоремой 2.1 по формуле (2.8), может быть вычислено только по I_* — решению уравнения (3.5) — т. е. и здесь не требуется выходить из пространства

$$\prod_{i=1}^p R^n$$

в матричное пространство H . Пример такого вычисления числа κ^2 будет рассмотрен ниже для одношаговой модели данной задачи.

Для сравнения уравнений для центра теорем 2.1 и 3.1 обратимся к одношаговой модели идентификации

$$(3.6) \quad x(1) = Ax(0) + Bu(0)$$

при ограничениях (3.7) и измеряемом сигнале (3.8)

$$(3.7) \quad \langle A - A_0, N(A - A_0) \rangle + (\xi, \xi) \leq \mu^2$$

$$(3.8) \quad y = Gx(1) + \xi$$

Положим $K(1) = A$, $z = y - GBu(0)$, $p = 1$ и воспользуемся результатами пп. 2.3. Для простоты предположим также, что N — оператор левого умножения на симметричную положительно-определенную матрицу $N \in M_n$.

В этом случае теорема 2.1 переходит в следующее утверждение.

Следствие 3.1. При $p = 1$ для системы (3.6) — (3.8) информационный эллипсоид K определяется условиями

$$(3.9) \quad K = \{A \in M_n \mid \langle A - A_1, M(A - A_1) \rangle \leq \mu^2 - \kappa^2\}$$

$$(3.10) \quad M = E_n \otimes N + x(0) x^*(0) \otimes G^*G$$

A_1 — решение матричного уравнения

$$(3.11) \quad NA + G^*GAx(0) x^*(0) = NA_0 + G^*zx^*(0), \quad z = y - GBu(0)$$

$$(3.12) \quad \kappa^2 = (z, z) + \langle A_0, NA_0 \rangle - \langle A_1, NA_0 + G^*zx^*(0) \rangle$$

При помощи рассуждений, подобных ([13], гл. 8), можно записать решение уравнения (3.10) следующим образом.

Следствие 3.2. Если матрица G имеет полный ранг и коммутатор [12] $[G^*G, N] = O_n$, то решение уравнения (3.10) — центр эллипсоида K — имеет вид

$$(3.13) \quad A_1 = (G^*G)^{-1} \int_0^\infty \exp(- (G^*G)^{-1}Nt) \{NA_0 + G^* [y - GBu(0)] x^*(0)\} \times \\ \times \exp(- x(0) x^*(0)t) dt$$

Если же находить центр A_1 эллипсоида K по теореме 3.1, то полученная факторизация приводит к утверждению

Следствие 3.3. При $p = 1$ для системы (3.6) — (3.8) центр эллипсоида K можно определить по формуле

$$(3.14) \quad A_1 = A_0 + N^{-1}G^* (x(0) \otimes l_*)$$

где l_* — решение уравнения

$$(3.15) \quad l + \|x(0)\|^2 GN^{-1}G^*l = y - G \{A_0 x(0) + Bu(0)\}$$

При этом

$$(3.16) \quad \kappa^2 = (l_*, z - GA_0x(0)) = \|l_*\|^2 + \|x(0)\|^2 (l_*, GN^{-1}G^*l_*)$$

Представление (3.16) получается из (3.12), (3.14), (3.15) непосредственной проверкой. Аналогичное представление имеет место и для многошаговой модели (1.1) — (1.3).

Оператор T из (2.6) допускает и более простое представление, но для решения непрерывного аналога данной задачи идентификации путем предельного перехода, а также для сравнения результатов в дискретном и непрерывном времени представляется более удобным разложение (2.6) данной работы. Решение одной задачи идентификации в непрерывном времени может быть найдено в работе [7].

Автор благодарит Куржанского А. Б. за внимание к работе и обсуждение.

ЛИТЕРАТУРА

1. Красовский Н. Н. Теория управления движением. Линейные системы. М.: Наука, 1968. 475 с.
2. Куржанский А. Б. Управление и наблюдение в условиях неопределенности. М.: Наука, 1977. 392 с.

3. Куржанский А. Б. Об адаптивном управлении в механических системах.— Теор. и прикл. механика (Болгария), 1978, вып. 2, с. 28.
4. Kurzhanski A. B., Gusev M. I. Multicriterial game-theoretic problems of control for systems with incomplete information.— In: Proc. 7th Congress Int. Federat. Automat. Control (IFAC). v. 2. Helsinki, 1978, p. 1041.
5. Кац И. Я., Куржанский А. Б. Минимаксная многошаговая фильтрация в статистически неопределенных ситуациях.— Автоматика и телемеханика, 1978, вып. 11 с. 79.
6. Коцеев А. С. Об оценивании состояний управляемых систем в условиях неопределенности.— Дифференц. уравнения, 1977, т. 13, вып. 12, с. 2168.
7. Исаков А. И. Об оценке весовых функций линейных управляемых систем по результатам измерений.— В кн.: Оптимальное управление в динамических системах, УНЦ АН СССР. Свердловск: 1979, с. 26.
8. Schatten R. A theory of cross-spaces.— In: Ann. Math. Stud. v. 26. Princeton Univ. Press, 1950.
9. Schatten R. Norm ideals of completely continuous operators. Springer, Berlin: 1960. 81 p.
10. Бурбаки Н. Элементы математики. Т. 2. Алгебра. Алгебраические структуры. Линейная и полилинейная алгебра. М.: Физматгиз, 1962. 516 с.
11. Шефер Х. Топологические векторные пространства. М.: Мир, 1971, 359 с.
12. Глазман И. М., Любич Ю. И. Конечно-мерный линейный анализ в задачах. М.: Наука, 1969, 475 с.
13. Ланкастер П. Теория матриц. М.: Наука, 1978. 280 с.
14. Халмош П. Конечно-мерные векторные пространства. М.: Физматгиз, 1963. 262 с.

Свердловск

Поступила в редакцию
12.XII.1979