

УДК 519.714 + 681.514
ББК 22.1

АНИЗОТРОПИЙНЫЙ АНАЛИЗ ДЕСКРИПТОРНЫХ СИСТЕМ С ИСПОЛЬЗОВАНИЕМ ЛМН

Белов А.А.¹ Андрианова О.Г.²,
(ФГБУН Институт проблем управления
им. В.А. Трапезникова РАН, Москва)

В работе предлагается метод анизотропийного анализа дискретных дескрипторных систем, основанный на одном из эквивалентных представлений в пространстве состояний дескрипторных систем. При этом полученные условия являются выпуклыми.

Ключевые слова: Анизотропийная норма, дескрипторные системы, линейные матричные неравенства.

1. Введение

При составлении математических моделей систем в физических переменных можно получить модели, сочетающие в себе дифференциальные и алгебраические уравнения. Такие системы, называемые дескрипторными, нашли свое применение в различных областях науки и техники [6, 8].

Несмотря на очевидное удобство в составлении математических моделей, методы анализа и синтеза таких систем существенно отличаются и бывают достаточно сложны в реализации. Это вызвано тем, что из-за алгебраических уравнений связи дескрипторные системы приобретают свойства, не характерные для обыкновенных систем в пространстве состояний. К таким свойствам можно отнести невозможность разрешить систему относительно производной, необходимость подачи на вход системы до-

¹ Белов Алексей Анатольевич, с.н.с. лаб.№1, (a.a.belov@inbox.ru),

² Андрианова Ольга Геннадьевна, математик лаб.№1, (andrianovaog@gmail.com).

статочны гладких сигналов, а также непричинное в дискретном случае (импульсное в непрерывном случае) поведение.

Перечисленные выше особенности создают трудности при обобщении методик, успешно разработанных для обыкновенных систем. Некоторые задачи до сих пор являются нерешенными для дескрипторных систем. К одной из таких задач относится создание вычислительно эффективных методов анализа и синтеза. В данной работе разработан алгоритм анизотропийного анализа, основанный на методах выпуклой оптимизации.

Анизотропийная теория берет свое начало из работ [2, 10]. В основе подхода лежит теоретико-информационное представление случайных сигналов. Анизотропийная теория изучает реакцию системы на воздействующие на нее «цветные» шумы. Под «цветностью» понимается информационное отклонение Кульбака-Лейблера от гауссовского белого шума [2]. Критерием качества в данном случае выступает анизотропийная норма системы. Задача анизотропийного анализа для обыкновенных систем с использованием линейных матричных неравенств была решена в [9]. Этот результат был обобщен на дескрипторные системы в [4]. Однако условия, полученные в перечисленных работах, являются нестрогими, а также из-за наличия вырожденных матриц в ограничениях — невыпуклыми. В данной работе сформулирована новая частотная теорема в терминах линейных матричных неравенств, позволяющая разработать вычислительно эффективный алгоритм анизотропийного анализа дескрипторных систем.

Структура работы следующая. В разделе 2 приведены предварительные сведения по теории анизотропийного анализа и основы теории дискретных дескрипторных систем. В разделе 3 получены условия новой частотной теоремы в терминах линейных матричных неравенств для обыкновенных систем. В разделе 4 сформулирована новая частотная теорема для дескрипторных систем и приведен численный пример.

2. Основные теоретические сведения

2.1. Дескрипторные системы

Дискретная дескрипторная система в пространстве состояний имеет вид

$$(1) \quad \begin{aligned} Ex(k+1) &= Ax(k) + Bf(k), \\ y(k) &= Cx(k) + Df(k), \end{aligned}$$

где $x(k) \in \mathbb{R}^n$ – вектор состояния, $f(k) \in \mathbb{R}^m$ и $y(k) \in \mathbb{R}^p$ – входной и выходной сигналы соответственно. E, A, B, C, D – постоянные матрицы соответствующих размерностей. $E \in \mathbb{R}^{n \times n}$ – вырожденная матрица, $\text{rank } E = r \leq n$.

Определение 1. Дескрипторная система (1) называется допустимой, если она регулярная ($\exists \lambda \neq 0 : \det(\lambda E - A) \neq 0$), причинная ($\deg \det(zE - A) = \text{rank } E$) и устойчивая ($\rho(E, A) = \max_{\lambda \in \{z \mid \det(zE - A) = 0\}} |\lambda| < 1$). Более подробную информацию можно найти в [6, 11].

Предполагаем, что система (1) является регулярной, тогда существуют две невырожденные матрицы \overline{W} и \overline{V} такие, что $\overline{W}E\overline{V} = \text{diag}(I_r, 0)$ [6]. Преобразование координат имеет вид

$$(2) \quad \overline{V}^{-1}x(k) = \begin{pmatrix} x_1(k) \\ x_2(k) \end{pmatrix},$$

где $x_1(k) \in \mathbb{R}^r$ и $x_2(k) \in \mathbb{R}^{n-r}$. Система (1) во второй эквивалентной форме (ЭФ2) задается следующими уравнениями [6]:

$$(3) \quad \begin{aligned} x_1(k+1) &= A_{11}x_1(k) + A_{12}x_2(k) + B_1u(k), \\ 0 &= A_{21}x_1(k) + A_{22}x_2(k) + B_2u(k), \\ y(k) &= C_1x_1(k) + C_2x_2(k) + Du(k), \end{aligned}$$

где

$$(4) \quad \overline{W}A\overline{V} = \begin{pmatrix} A_{11} & A_{12} \\ A_{21} & A_{22} \end{pmatrix}, \quad \overline{W}B = \begin{pmatrix} B_1 \\ B_2 \end{pmatrix}, \quad C\overline{V} = (C_1 \ C_2).$$

Матрицы \overline{W} и \overline{V} находятся из сингулярной декомпозиции

$$E = U \text{diag}(S, 0) Z^T,$$

Также следует заметить, что система является ~~причинной~~ ^{диссипативной}, если $\det(A_{22}) \neq 0$, и устойчивой, если $\rho(A_{11} - A_{12}A^{-1})$

2.2. Средняя анизотропия последовательности и анизотропийная норма системы

Пусть задана стационарная последовательность $W = \{w(k)\}_{k \geq 0}$ интегрируемых с квадратом случайных векторов из \mathbb{R}^m , представляющих собой дискретные случайные процессы. Составим из элементов W на интервале времени $[0, N]$ случайный вектор

$$W_{0:N-1} = \begin{bmatrix} w(0) \\ \vdots \\ w(N-1) \end{bmatrix},$$

все конечномерные вероятностные распределения которого абсолютно непрерывны.

Анизотропия случайного вектора $\mathbf{A}(W_{0:N-1})$ есть минимальное значение относительной энтропии [10] относительно гауссовских распределений в \mathbb{R}^m с нулевым математическим ожиданием и скалярной ковариационной матрицей:

$$\mathbf{A}(W_{0:N-1}) = \frac{m}{2} \ln \left(\frac{2\pi e}{m} \mathbf{E}(|W_{0:N-1}|^2) \right) - h(W_{0:N-1}),$$

где $h(W_{0:N-1}) = \mathbf{E} \ln f(W_{0:N-1}) = - \int_{\mathbb{R}^{mN}} f(w) \ln f(w) dw$ – дифференциальная энтропия, а $f : \mathbb{R}^{mN} \rightarrow \mathbb{R}_+$ – плотность распределения вероятности mN -мерного вектора $W_{0:N-1}$.

Средняя анизотропия последовательности W – это усредненная по времени анизотропия случайного вектора, она может быть найдена по формуле

$$5) \quad \overline{\mathbf{A}}(W) = \lim_{N \rightarrow +\infty} \frac{\mathbf{A}(W_{0:N-1})}{N}.$$

Пусть случайная последовательность W генерируется из гауссовского белого шума V с помощью формирующего фильтра G , передаточная функция $G(z)$ которого принадлежит пространству Харди $H_2^{m \times m}$ матричнозначных функций, аналитических в открытом единичном круге на комплексной плоскости и имеющих конечную H_2 -норму, определяемую выражением

$$\|G\|_2 = \left(\frac{1}{2\pi} \int_{-\pi}^{\pi} \text{Trace } S(\omega) d\omega \right)^{1/2},$$

где $S(\omega) = \widehat{G}(\omega)\widehat{G}(\omega)^* (-\pi \leq \omega \leq \pi)$ – спектральная плотность W , $\widehat{G}(\omega) = \lim_{l \rightarrow 1} G(le^{i\omega})$ – граничное значение передаточной

функции G .

Средняя анизотропия (5) случайной стационарной гауссовской последовательности $W = GV$ может быть определена в терминах спектральной плотности $S(\omega)$ и H_2 -нормы формирующего фильтра G по формуле

$$\overline{\mathbf{A}}(W) = -\frac{1}{4\pi} \int_{-\pi}^{\pi} \ln \det \frac{mS(\omega)}{\|G\|_2^2} d\omega.$$

Средняя анизотропия характеризует «расстояние» между сигналом и гауссовским белым шумом. Более подробную информацию можно найти в [1, 2].

Обозначим за $Y = PW$ выход линейной дискретной системы $P \in H_\infty^{p \times m}$, передаточная функция $P(z)$ которой аналитична в открытом единичном круге $|z| < 1$, $P(z)$ имеет конечную H_∞ -норму.

Определение 2. α -Анизотропийная норма системы P при заданном значении $\alpha \geq 0$ определена как

$$(6) \quad \|P\|_\alpha = \sup \{ \|PG\|_2 / \|G\|_2 : G \in \mathbf{G}_\alpha \},$$

т.е. как наибольший коэффициент усиления по отношению к классу формирующих фильтров

$$\mathbf{G}_\alpha = \{ G \in H_2^{m \times m} : \overline{\mathbf{A}}(G) \leq \alpha \}.$$

Итак, a -анизотропийная норма $\|P\|_a$ описывает стохастический коэффициент усиления системы P относительно входной последовательности W .

Замечание 1. Случайная последовательность W полностью определяется формирующим фильтром G , следовательно, обозначения $\overline{A}(G)$ и $\overline{A}(W)$ эквивалентны.

3. Новая анизотропийная частотная теорема для обыкновенных систем

Рассмотрим обыкновенную дискретную систему, записанную в следующем виде:

$$(7) \quad \begin{aligned} x(k+1) &= Ax(k) + Bw(k), \\ y(k) &= Cx(k) + Dw(k), \end{aligned}$$

где $x(k) \in \mathbb{R}^n$ — состояние системы, $w(k) \in \mathbb{R}^m$ — случайная стационарная последовательность с известным уровнем средней анизотропии $\overline{A}(W) = a$, $y(k) \in \mathbb{R}^q$ — наблюдаемый выход. A, B, C, D — постоянные матрицы соответствующих размерностей. Передаточная функция системы (7) определяется выражением

$$F(z) = C(zI - A)^{-1}B + D.$$

Для устойчивой системы (7) справедлива следующая теорема [9].

Теорема 1. Пусть система (7) с передаточной функцией $F(z)$ является устойчивой и принадлежит пространству Харди ($F \in \mathcal{H}_\infty^{q \times m}$). Для заданных скалярных величин $a \geq 0$ и $\gamma > 0$ a -анизотропийная норма системы ограничена сверху числом γ , т.е.

$$\|F\|_a \leq \gamma,$$

если существует такой скаляр $\eta > \gamma^2$ и $n \times n$ -матрица $\Phi = \Phi^T > 0$, для которых справедливы следующие неравенства

$$(8) \quad \eta - (e^{-2a} \det(\eta I_m - B^T \Phi B - D^T D))^{1/m} < \gamma^2,$$

$$(9) \quad \begin{bmatrix} A^T \Phi A - \Phi + C^T C & A^T \Phi B + C^T D \\ B^T \Phi A + D^T C & B^T \Phi B + D^T D - \eta I_m \end{bmatrix} < 0.$$

Перепишем неравенство (9) в следующей форме:

$$(10) \quad \begin{bmatrix} C^T C & C^T D \\ D^T C & D^T D \end{bmatrix} - \begin{bmatrix} A^T \\ B^T \end{bmatrix} \Phi (-\Phi)^{-1} \Phi \begin{bmatrix} A & B \end{bmatrix} + \begin{bmatrix} -\Phi & 0 \\ 0 & -\eta I_m \end{bmatrix} < 0.$$

Так как $\Phi = \Phi^T > 0$, то $\begin{bmatrix} -\Phi & 0 \\ 0 & -\eta I_m \end{bmatrix} < 0$. Значит,

$$(11) \quad \begin{bmatrix} C^T C & C^T D \\ D^T C & D^T D \end{bmatrix} - \begin{bmatrix} A^T \\ B^T \end{bmatrix} \Phi (-\Phi)^{-1} \Phi \begin{bmatrix} A & B \end{bmatrix} < 0.$$

Используя лемму Шура, получим неравенство, эквивалентное неравенству (11):

$$(12) \quad \begin{bmatrix} -\Phi & \Phi A & \Phi B \\ A^T \Phi & C^T C & C^T D \\ B^T \Phi & D^T C & D^T D \end{bmatrix} < 0.$$

Таким образом,

$$(13) \quad \begin{bmatrix} -\Phi & \Phi A & \Phi B \\ A^T \Phi & C^T C - \Phi & C^T D \\ B^T \Phi & D^T C & D^T D - \eta I_m \end{bmatrix} < 0,$$

откуда имеем $M^T \Xi M < 0$

$$\text{при} \quad M^T = \begin{bmatrix} 0 & I_n & 0 & 0 \\ 0 & 0 & I_m & 0 \\ -I_n & 0 & 0 & I_n \end{bmatrix}, \quad \Xi = \begin{bmatrix} 0 & 0 & 0 & \Phi \\ 0 & C^T C - \Phi & C^T D & 0 \\ 0 & D^T C & D^T D - \eta I_m & 0 \\ \Phi & 0 & 0 & 0 \end{bmatrix}.$$

С другой стороны, неравенство (9) может быть записано в виде $N^T \Xi N < 0$,

$$\text{где} \quad N^T = \begin{bmatrix} I_n & 0 & 0 & -\frac{1}{2} I_n \\ 0 & I_n & 0 & A^T \\ 0 & 0 & I_m & B^T \end{bmatrix}.$$

Применяя лемму о проекции [5], получим

$$\Xi + \Upsilon^T \Upsilon^T \Psi + \Psi^T \Upsilon \Upsilon < 0,$$

где $\Psi = \begin{bmatrix} I_n & 0 & 0 & I_n \end{bmatrix}$, $\Upsilon = \begin{bmatrix} -\frac{1}{2}I_n & A & B & -I_n \end{bmatrix}$, а $Y \in \mathbb{R}^{n \times n}$ — произвольная матрица.

Используя предыдущие выкладки, сформулируем новую анизотропийную частотную теорему для обыкновенных систем.

Теорема 2. Пусть система (7) с передаточной функцией $F(z)$ является устойчивой и принадлежит пространству Харди ($F \in \mathcal{H}_\infty^{q \times m}$). Для заданных скалярных величин $a \geq 0$ и $\gamma > 0$ a -анизотропийная норма системы ограничена сверху числом γ , т.е.

$$\|F\|_a \leq \gamma,$$

если существует такой скаляр $\eta > \gamma^2$, $n \times n$ -матрица $\Phi = \Phi^T > 0$ и произвольная матрица $n \times n$ -матрица Y , для которых справедливы следующие неравенства

$$\eta - (e^{-2a} \det(\eta I_m - B^T \Phi B - D^T D))^{1/m} < \gamma^2$$

$$(14) \quad \begin{bmatrix} -\frac{1}{2}Y - \frac{1}{2}Y^T & YA & YB & \Phi^T - Y^T - \frac{1}{2}Y & 0 \\ A^T Y^T & -\Phi & 0 & A^T Y^T & C^T \\ B^T Y^T & 0 & -\eta I_m & B^T Y^T & D^T \\ \Phi - Y - \frac{1}{2}Y^T & YA & YB & -Y - Y^T & 0 \\ 0 & C & D & 0 & -I_q \end{bmatrix} < 0.$$

4. Основной результат

Рассмотрим дескрипторную систему, записанную в пространстве состояний

$$(15) \quad \begin{aligned} E_d x(k+1) &= A_d x(k) + B_d w(k), \\ y(k) &= C_d x(k) + D_d w(k), \end{aligned}$$

где $x(k) \in \mathbb{R}^n$ — состояние системы, $w(k) \in \mathbb{R}^m$ — случайная стационарная последовательность с известным уровнем средней

анизотропии $\bar{\mathbf{A}}(W) = a$, $y(k) \in \mathbb{R}^q$ — наблюдаемый выход. E_d, A_d, B_d, C_d, D_d — известные постоянные матрицы соответствующих размерностей. Предполагается, что $\text{rank } E_d = r < n$. Передаточная функция $P(z)$ системы записывается выражением

$$P(z) = C_d(zE_d - A_d)^{-1}B_d + D_d.$$

Основываясь на условиях новой частотной теоремы для обыкновенных систем и алгоритме приведения дескрипторных систем ко второй эквивалентной форме, сформулируем условия анизотропийной частотной теоремы для дескрипторных систем вида (15).

Теорема 3. Пусть система (15) с передаточной функцией $P(z)$ является допустимой и принадлежит пространству Харди ($P \in \mathcal{H}_{\infty}^{q \times m}$). Предполагается также, что $\text{rank } E_d = \text{rank } (E_d, B_d)$. Для заданных скалярных величин $a \geq 0$ и $\gamma > 0$ a -анизотропийная норма системы ограничена сверху числом γ , т.е.

$$\|P\|_a \leq \gamma,$$

если существуют такие матрицы $L \in \mathbb{R}^{r \times r}$, $L > 0$, $Q \in \mathbb{R}^{r \times r}$, $R \in \mathbb{R}^{r \times (n-r)}$, $S \in \mathbb{R}^{(n-r) \times (n-r)}$, скалярные величины $\eta > \gamma^2$ и $\alpha > 0$, для которых справедливы следующие неравенства

$$(16) \quad \eta - (e^{-2a} \det(\eta I_m - B_d^T \Pi B_d - D_d^T D_d))^{1/m} < \gamma^2$$

и

$$(17) \quad \begin{bmatrix} -\frac{1}{2}Q - \frac{1}{2}Q^T & \Gamma A_d & \Gamma B_d & L^T - Q^T - \frac{1}{2}Q & 0 \\ A_d^T \Gamma^T & \Pi A_d + A_d^T \Pi^T - \Theta & \Pi B_d & A_d^T \Gamma^T & C_d^T + \alpha A_d^T \Pi^T C_d^T \\ B_d^T \Gamma^T & B_d^T \Pi^T & -\eta I_q & B_d^T \Gamma^T & D_d^T + \alpha B_d^T \Pi^T C_d^T \\ L - Q - \frac{1}{2}Q^T & \Gamma A_d & \Gamma B_d & -Q - Q^T & 0 \\ 0 & C_d + \alpha C_d \Pi A_d & D_d + \alpha C_d \Pi B_d & 0 & -I_p \end{bmatrix} < 0,$$

$$\text{где } \Theta = \begin{bmatrix} L & 0 \\ 0 & 0 \end{bmatrix}, \Pi = \begin{bmatrix} 0 & 0 \\ 0 & S \end{bmatrix}, \Gamma = \begin{bmatrix} Q & R \end{bmatrix}.$$

Для вычисления a -анизотропийной нормы дескрипторной системы необходимо решить следующую задачу оптимизации: найти $\gamma_* = \inf \gamma$ на множестве $\{L, Q, R, S, \alpha, \eta, \gamma\}$, которое удовлетворяет неравенствам (16), (17). Если минимальное значение γ_* найдено, то a -анизотропийная норма системы P может быть приближенно вычислена по формуле

$$(18) \quad \|P\|_a \approx \gamma_*.$$

Пример 1. Рассмотрим дискретную дескрипторную систему, заданную в пространстве состояний следующими матрицами:

$$E_d = \begin{bmatrix} 3 & 0 & 2 & -5 \\ 0 & 3 & -2 & 2 \\ 2 & 2 & 0 & -2 \\ 2 & -4 & 4 & -6 \end{bmatrix}, \quad A_d = \begin{bmatrix} 0.7 & -3.25 & -0.7 & 0 \\ 1.8 & 0.4 & -6.4 & 2.6 \\ 1.0 & -1.9 & -5.4 & 2.4 \\ -0.6 & -2.7 & 5.4 & -2.8 \end{bmatrix},$$

$$B_d = \begin{bmatrix} 3.2 & -3.5 \\ 2.5 & -7.9 \\ 3.8 & -7.6 \\ -1.2 & 8.2 \end{bmatrix},$$

$$C_d = [0.2 \quad 0.4 \quad 0.45 \quad 0.6], \quad D_d = [0.2 \quad 1.0], \quad \text{rank } E_d = 2.$$

Легко проверить, что система является причинной и устойчивой. Результаты вычисления α -анизотропийной нормы на основе частотной теоремы представлены на рис. 1. На рис. 2 показана абсолютная ошибка вычисления анизотропийной нормы относительно значений, полученных по алгоритму на основе Риккати-подхода [3].

5. Выводы

В работе приведена новая частотная теорема, содержащая достаточные условия ограниченности α -анизотропийной нормы обыкновенной системы. Данный результат обобщен на дескрипторные системы. Полученные условия являются выпуклыми, а алгоритм анализа системы на их основе — вычислительно эффективным.

Литература

1. ВЛАДИМИРОВ И.Г., ДАЙМОНД Ф., КЛОЕДЕН П.
Анизотропийный анализ робастного качества линейных

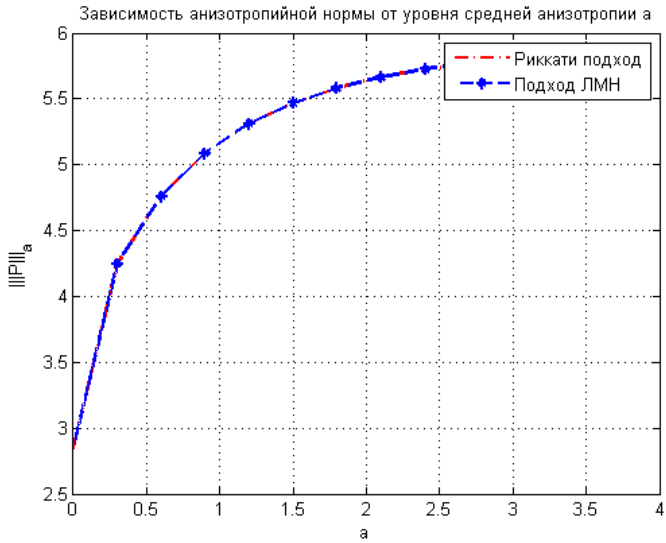


Рис. 1. a -Анизотропная норма дескрипторной системы

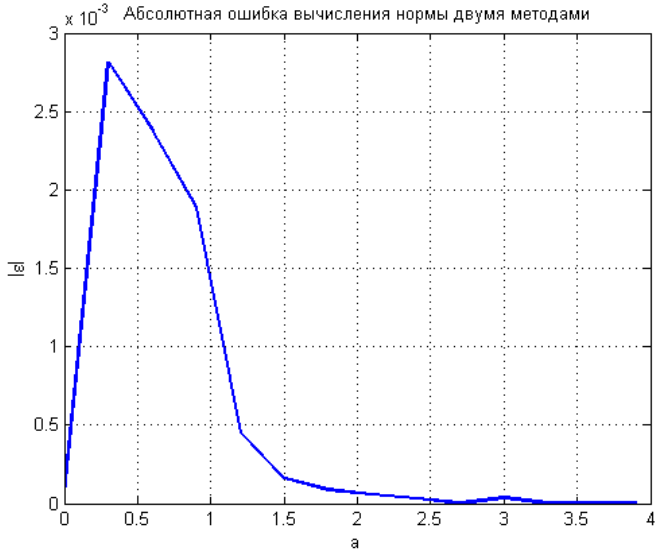


Рис. 2. Абсолютная ошибка метода относительно Риккати-подхода

- нестационарных дискретных систем на конечном временном интервале* // Автоматика и телемеханика. – 2006. – № 8. – С. 92-111.
2. ВЛАДИМИРОВ И.Г., КУРДЮКОВ А.П., СЕМЕНОВ А.В. *Анизотропия сигналов и энтропия линейных стационарных систем* // Доклады РАН. – 1995. – Т. 342. №. 3. – С. 583-585.
 3. ANDRIANOVA, O. G., BELOV, A. A. *Anisotropy-based bounded real lemma for linear discrete-time descriptor systems* // Proc. 2013 International Conference on Process Control, Strbske Pleso, Slovakia, 2013. P. 57-62.
 4. BELOV, A. A., ANDRIANOVA, O. G. *Computation of anisotropic norm for descriptor systems using convex optimization* // Proc. 2013 International Conference on Process Control, Strbske Pleso, Slovakia, 2013. P. 173-178.
 5. BOYD, S., GHAAOUI, L. E., FERON, E., AND BALAKRISHNAN, V. *Linear Matrix Inequalities in Systems and Control Theory*. SIAM Studies in Applied Mathematics, Philadelphia, Pennsylvania, 1994.
 6. DAI, L. *Singular Control Systems*. Lecture Notes in Control and Information Sciences, New York, Springer-Verlag, 1989.
 7. FENG, Y., YAGOUBI, M. *On a state feedback H_∞ control for discrete-time singular systems* // Preprint submitted to IEEE Transactions on Automatic Control. Received: March 27, 2013.
 8. STYKEL, T. *Analysis and numerical solutions of generalised Lyapunov equations*. Ph. D. thesis, Institut fur Mathematik, Technische Universitat Berlin, Berlin, 2002.
 9. TCHAIKOVSKY, M. M., KURDJUKOV, A. P., AND TIMIN, V. N. *Strict anisotropic norm bounded real lemma in terms of inequalities* // Proc. 18th IFAC World Congr., Milano, Italy, 2011. P. 2332-2337.
 10. VLADIMIROV, I. G., KURDJUKOV, A. P., AND SEMYONOV, A. V. *State-space solution to anisotropy-based stochastic H_∞ -optimization problem* // Proc. 13th IFAC World

- Congress, San-Francisco, CA, USA, 1996. – P. 427-432.
11. XU, S., LAM, J. *Robust Control and Filtering of Singular Systems*. Lecture Notes in Control and Information Sciences, Berlin, Springer-Verlag, 2006.