

Lecture Codes - 高仿张巍的代码dddd

课程代码的高仿版本。

3.? ? () 记不清楚了：高仿了张巍课程中的rnn代码。 `sdm_rnn`

3.24：高仿了张巍课程中regressor的代码，实现了一个简单的线性回归模型。 `regressor`

4.9：高仿了张巍课程中，path-planning和lqr的代码。 `pathplaining` and `lqr`

RNN

Regressor

Path Planning

Optimal Control Problem

Notation

abbr.		备注
$l(x_k, u_k)$	running cost function	步开销。
$V_j(z)$	minimized cost function	被最小化之后的代价函数值。
$g(x_N)$	terminal cost function	终端代价函数，即结束的时候，对应的开销。
$J_N(x_0, u)$	N-horizon cost	目标函数。我们需要将它进行最小化。
x		
u		

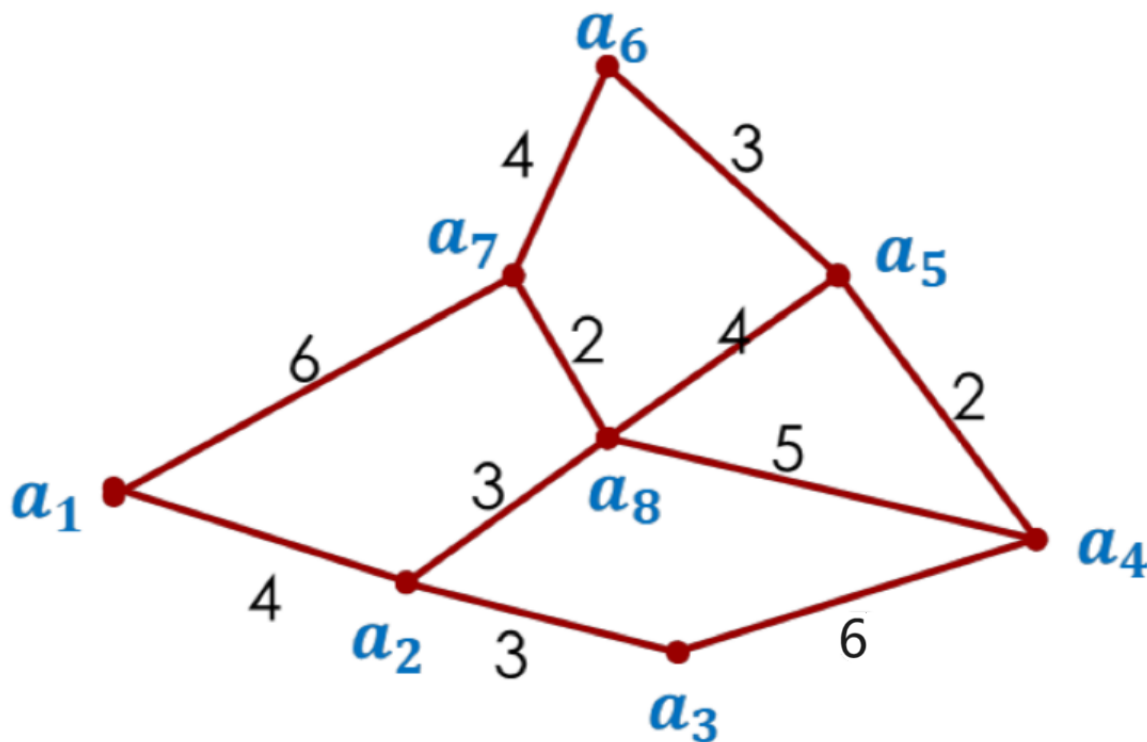
在张巍的课堂中，我们学习了：

$$J_N(x_0, u) = g(x_N) + \sum_{k=0}^{N-1} l(x_k, u_k) \tag{3-1}$$

我们要做的是，最小化我们的**目标函数**。

在张巍老师的课堂上，其提出了这样几个问题：

现在以Path-planning问题，作为一个例子，来引入对这个问题的解答。（注意，原来课件中， a_3 到 a_4 的距离是5，在这里为了稍后方便讲解，我将其改为了6）



现在，我希望，从 a_1 走到 a_4 的最短路径。

最开始的状态，我们只知道相邻两点间的距离，而不相邻两点间的最短距离我们暂时不知道。现在我们假设Running cost用来表示： $l(z, u)$ 代表着 z 到 u 点的最短距离。如果没有遍历到，默认设置为 ∞ 。

最终状态，我们假设，到了我们的目标点的时候，直接代价设为0，否则成本为 ∞ 。即：

$$g(z) = \begin{cases} 0, & \text{if } z = a_4 \\ \infty, & \text{else} \end{cases} \quad (3-2)$$

因而，我们的目的变成了，求取 $J_N(x_0, u)$ 的最小值的时候，对应的各参数值。

Dynamic Programming (动态规划)

事实上，如果将我们的函数进行进行“动态步骤移动”，具体到这道题目，假如每次我们都更新一轮到 a_4 点每个点最小距离（每次只走一步，这里的一步是指基于已经知道到 a_4 距离最近的点，更新其相邻点到 a_4 的距离。例如，第一步更新了 a_3 a_5 a_8 到 a_4 的距离，第二步更新 a_2 到 a_3 ， a_6 到 a_5 ， a_2 a_7 到 a_8 的距离，从而可以更新 a_2 a_6 a_7 到 a_4 的最短距离，将这样的距离保存下来，同时更新其对应的“下一步”。），这样的思想叫做动态规划（例如式3-4就是一种常见的动态规划思想，从第 i 步迭代到第 $i + 1$ 步，以此类推）。

例如：

表3-1 动态规划迭代示例

迭代次数	a_1/next	a_2/next	a_3/next	a_4/next	...	a_8/next
0	$\infty/?$	$\infty/?$	$\infty/?$	0/ a_4		$\infty/?$
1	$\infty/?$	$\infty/?$	6/ a_4	0/ a_4		5/ a_4
2	$\infty/?$	8/ a_8	6/ a_4	0/ a_4		5/ a_4
3	12/ a_2	8/ a_8	6/ a_4	0/ a_4		5/ a_4

给定：上一步的各个点到目标点的代价函数`vfunc`，地图`costMatrix`，终点下标`xf`

初始化：

`n` - 地图大小

`mustar` - 每个点到`xf`最近的下一步的点的下标

for `i` in `n`:

 初始化: `J` - 当前代价函数，初始化为一个`n*1`，值为无穷大的代价函数

 if `i == xf`(这个点是终点):

`vnex[i] = vfunc[i]`

`mustar[i] = i`

 continue

 endif

for `j` in `n`:

 if `i == j` (起始点和目标点重合):

 continue 跳转到下一步

`J[j] = costMatrix[i,j]+Vfun[j]`

endfor

`vnex[i] = J`的最小值

`mustar[i] = J`最小值的下标

return `vnex, mustar`

实现：

```
def valueIter(vfunc, costMatrix, xf):
```

```
    '''
```

```
    迭代计算代价函数。
```

```
    :param vfunc: 上一步的cost
```

```
    :param costMatrix: 地图
```

```
    :param xf: 终点下标。例如张巍老师的课程中，终点是4号点，在计算机里xf=3，
```

```
    :return: 这一步的cost（各点到目标点的距离集合），和到a_xf最近的点的集合。
```

```
    '''
```

```
    n = costMatrix.shape[0]
```

```
    vnex = np.inf*np.ones(n) # max values
```

```
    mustar = -1*np.ones(n) # target indexs
```

```
    # 遍历起点a_i
```

```
    for i in range(n):
```

```
        J = np.inf * np.ones(n) # 点i经过8个点到目标点的新的距离
```

```
        # 如果起点就是目标点，那么代价就是上一次传进来的目标点的代价，下一步将会是它自己。
```

```
        if i == xf:
```

```
            vnex[i] = vfunc[i]
```

```
            mustar[i] = i
```

```
            continue
```

```
        # 否则，遍历目标点a_j
```

```
        for j in range(n):
```

```
            if i == j: # 起点和目标点相同，跳过，此时的J默认为最大值，这样可以避免选择最短路径时选到自己，进入死循环。
```

```
                continue
```

```
            # a_i经过a_j到达目标点a_xf的代价为: a_j到a_xf的代价加上a_i到a_j的代价（距离）
```

```
            J[j] = vfunc[j]+costMatrix[j,i]
```

```
        vnex[i] = np.min(J) # a_i到a_xf最近的时候的cost。即i到xf的最短距离。
```

```
        mustar[i] = np.argmin(J) # a_i到a_xf最近的时候，下一步的下标。
```

```
    return vnex, mustar
```

这样，我们通过迭代，就可以知道怎么走了。例如，经过第一轮迭代后：

```
vnex= [inf,inf, 6, 0, 2, inf, inf, 5]
mustar= [-1, -1, 3, 3, 3, -1, -1, 3]
```

`mustar[i]` 代表从第*i*点以最短的姿态走到目标点的下一步的点的下标。例如 `mustar[2]=3` 表示的是 `a[2]` 以最短路径走到 `a[3]` 的下一步需要走 `a[3]`。

假设我们迭代四次（这样相当于最多可以走四步），让我们来试试效果。

```
if __name__ == "__main__":
    N = 4 # Max steps
    n = 8 # size of the graph (cost matrix)
    xf = 3 # final place index, we want to go to a_4, so the index is 3.

    # step cost function
    # v[xi] represents the minimum distance from a_xi to a_xf
    # i.e. v[0] represents the minimum distance from a_0 to a_3
    v = np.inf * np.ones(n)
    v[xf] = 0 # a_xf to a_xf: distance is 0. else, are inf.
    path = []
    lastStep = 0
    steps = -1 * np.ones(n)
    x0 = -1 * np.zeros(N)
    for i in range(N-1):
        v, steps = pl.valueIter(v, pl.costMatrix, xf)
    # start to go, from a_0.
    path.append(lastStep)
    for i in range(N-1):
        target = int(steps[lastStep])
        path.append(target)
        lastStep = target
    print(path)
```

result: 0, 1, 7, 3

它实现的，就是如表3-1的过程。例如，经过几轮迭代后，代价函数和下一步的走向为：

第一轮循环已经展示过了。

第二轮循环：

```
vnex= [inf,8, 6, 0, 2, 5, 5, 7]
mustar= [-1, 7, 3, 3, 3, 4, 7, 3]
```

第三轮循环：

```
vnex= [12,8, 6, 0, 2, 5, 5, 7]
mustar= [1, 7, 3, 3, 3, 4, 7, 3] # 例如，mustar[0]表示a[0]到a[3]最近的话，下一个点是a[1]。
```

我们找到了几个点之后，我们的起点是 a_1 (`a[0]`)，然后下一步根据 `mustar[0]=1` 将会是 a_2 (`a[1]`)，再下一步根据 `mustar[1]=7` 得知是 a_8 (`a[7]`)，最后根据 `mustar[7]=3` 得知下一步是 a_4 (`a[3]`)，到达终点。

Notation

abbr.	含义	备注
L		
Q	状态参数惩罚项系数	正定矩阵
R		正定矩阵
x		
u		
P_j	第j次的全状态参数惩罚项	正定矩阵
Q_f	最终状态参数的惩罚项系数	
V_j	某一步的cost	

Concepts

考虑离散状态空间矩阵（很多节课前， $A_{discrete} = A_{continue} - I$ ），假设我们设计的控制器有 $u_k = -Kx_k$

$$\begin{aligned} x_{k+1} &= Ax_k + Bu_k = (A - BK)x_k \\ y_k &= Cx_k + Du_k \end{aligned} \quad (4-1)$$

我们对过程进行“惩罚”，设定惩罚项。

$$l(x, u) = x^T Q x + u^T R u \quad (4-2)$$

Q, R 需要是正定矩阵。这个式子告诉我们，只有 x, u 趋近于零的时候， l 才能取到最小值。此外，惩罚项的大小也对对应的被惩罚项衰减速率造成影响。例如，如果 $Q > R$ ，那么 x 的衰减会比 u 更快，因为若每次希望降低相同的 l ，那么需要降低更多的 x 才能使 l 相对降低。

我们定义，经过 N 步之后：

$$J_N(x_0, u) = x_N^T Q_f x_N + \sum_{k=0}^{N-1} [x_k^T Q x_k + u_k^T R u_k] \quad (4-3)$$

我们需要完成的，便是最小化代价函数，求出此时的参数 x, u 。离散空间中，我将会使用 z 而不是 x 。所以接下来的推到中将出现的状态变量是 z 。我们假定我们每一步的cost function为：

$$V_j(z) = z^T P_j z \quad (4-4)$$

并定义迭代到下一步的cost为：

$$\begin{aligned} V_{j+1}(z) &= \min\{l(z, u) + V_j(f(z, u))\} \\ &= \min\{z^T Q z + u^T R u + (Az + Bu)^T P_j (Az + Bu)\} \\ &= \min\{u^T (R + B^T P_j B) u + 2z^T A^T P_j B u + z^T (Q + A^T P_j A) z\} \end{aligned} \quad (4-5)$$

如果 $V_{j+1}(z)$ 对 u 的偏导数为0，那么将会取得它关于 u 的极小值（证明略）。

$$\begin{aligned}\frac{\partial h(u)}{\partial u} &= 2u^T(R + B^T P_j B) + 2z^T A^T P_j B = 0 \\ u^T &= -z^T A^T P_j B (R + B^T P_j B)^{-1}\end{aligned}\quad (4-6)$$

由于R是对称矩阵（正定矩阵一定对称）， $B^T P_j B$ 这个形式也是对称矩阵的标准形式，那么必然， $(R + B^T P_j B)$ 一定是对称矩阵，因此， $(R + B^T P_j B)^{-1} = (R + B^T P_j B)^{-T}$ 。同样， P_j 也是对称矩阵。

$$u_{j+1} = -(R + B^T P_j B)^{-1} B^T P_j A z = -K_{j+1} z \quad (4-6^*)$$

通过上式我们可以知道我们的控制器 $u = -Kz$ 的反馈增益矩阵K应该如何设计了。这样设计的控制器可以保证每一步迭代都能使每一步的代价函数 $V_j(z)$ 达到最小（根据(4-6)，这样设计的控制器可以让代价函数对输入的偏导数为0，从而达到它的极小值）。现在，让我们把 $u = -Kz$ 代入（todo）：

$$\begin{aligned}V_{j+1}(z) &= \min\{h(u^*)\} \\ &= (-K_j z)^T (R + B^T P_j B) (-K_j z) + 2z^T A^T P_j B (-K_j z) + z^T (Q + A^T P_j A) z \\ &= z^T (Q + A^T P_j A - A^T P_j B (R + B^T P_j B)^{-1} B^T P_j A) z\end{aligned}\quad (4-7)$$

让我们对比（4-4）我们定义的代价函数， $V_{j+1}(z) = z^T P_{j+1} z$ ，我们震惊地发现， P_j 和 P_{j+1} 之间存在迭代关系：

$$P_{j+1} = Q + A^T P_j A - A^T P_j B (R + B^T P_j B)^{-1} B^T P_j A \quad (4-8)$$

经过蛮长的迭代之后，我们可以得到最终的 P_N 。根据式(4-6*)，写出最终的输入和状态参数的表达关系式：

$$\begin{aligned}u &= -(R + B^T P_N B)^{-1} B^T P_N A z = -K_N z \\ K_N &= (R + B^T P_N B)^{-1} B^T P_N A\end{aligned}\quad (4-9)$$

tips: (4-8)可以也被表示为：（不然代码太长了，物理意义）））

$$P_{j+1} = Q + A^T P_j A - A^T P_j B K_j \quad (4-8)$$

Coding

```
define N
define A, B, Q, R
initialize P0=0

for i in N:
    update Pi according to (4-8)
end
define KN according to (4-9)
return KN
```

根据这样的思路，在python中可以这样写：

```
def getKN(A, B, Q, R, N, nx, nu):
    """
    计算KN反馈增益矩阵。
    :param A: 状态空间矩阵A
    :param B: 状态输入矩阵B
    :param Q: 状态空间权重矩阵Q
    :param R: 状态输入权重矩阵R
    :param N: 迭代次数
```

```

:param nx: 状态空间维度
:param nu: 输入空间维度
:return: 反馈增益矩阵KN
'''

P = np.zeros((nx,nx,N))
# K = np.zeros((nu,nx,N))
for j in range(N-1):
    P[:, :, j + 1] = Q + A.T @ P[:, :, j] @ A - A.T @ P[:, :, j] @ B @
    la.inv(R + B.T @ P[:, :, j] @ B) @ B.T @ P[:, :, j] @ A
    KN = la.inv(R + B.T @ P[:, :, N - 1] @ B) @ B.T @ P[:, :, N - 1] @ A
return KN

```

或者，观察到 P_{j+1} 和 P_j 的关系，所以我们直接更新P：

```

def getSlideKN(A, B, Q, R, N, nx, nu):
    P = np.zeros((nx,nx))
    K = np.zeros((nu,nx))
    for j in range(N):
        K = la.inv(R + B.T @ P @ B) @ B.T @ P @ A
        P = Q + A.T @ P @ A - A.T @ P @ B @ K
    KN = la.inv(R + B.T @ P @ B) @ B.T @ P @ A
    return KN

```

接下来，我们的主函数可以这样完成（示例）（lqr是自己创建的一个py文件）

```

import numpy as np
import lqr
import scipy.linalg as la
import matplotlib.pyplot as plt

if __name__ == '__main__':
    #给定矩阵。
    A = np.mat('1.95,-0.025,-1.6;16,1.1,-3.2;0.425,0.1875,0.3')
    B = np.mat('0 1 0;1 1 1').T
    nx = 3
    nu = 2
    Q = np.eye(nx)
    R = np.eye(nu)

    Nr = 20 #迭代20步，看反馈矩阵的设计。
    K = lqr.getSlideKN(A, B, Q, R, Nr, nx, nu)
    print('K:', K)

    N = 30
    x = np.zeros((nx,N))
    x[:,0] = np.array([1,2,3])
    u = np.zeros((nu,N))
    u_norm = np.zeros(N)

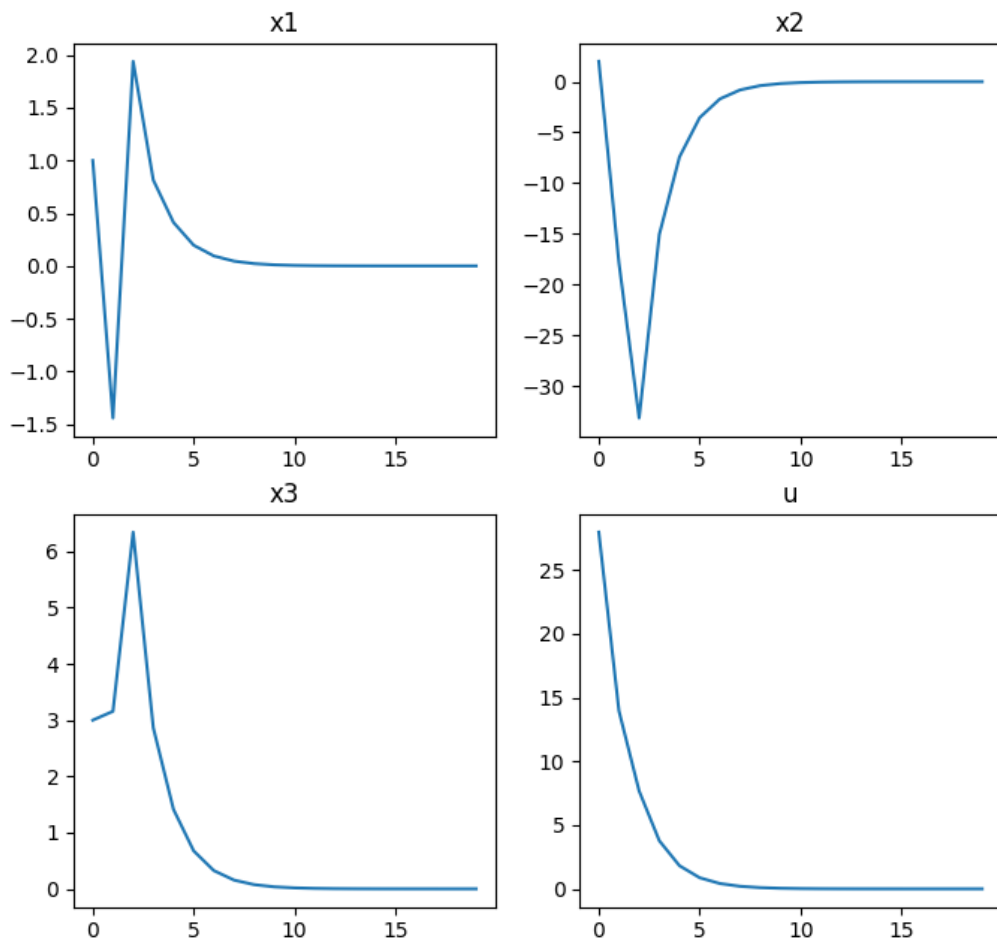
    # 根据公式（4-1）计算x。
    for k in np.arange(0,N-1):
        u[:,k] = -K @ x[:,k] # u = -Kx
        x[:,k+1] = A @ x[:,k] + B @ u[:,k] # x = Ax+Bu
        u_norm[k] = la.norm(u[:,k]) # 单纯方便画图（）

```



```
# 若低于python3.10版本, 请将subplot参数更改为(2,2,i)。
time = np.arange(N)
plt.figure()
plt.subplot(221)
plt.plot(time,x1[0,:].T)
plt.plot(time,x2[0,:].T)
plt.title('x1')
plt.subplot(222)
plt.plot(time,x1[1,:].T)
plt.title('x2')
plt.subplot(223)
plt.plot(time,x1[2,:].T)
plt.title('x3')
plt.subplot(224)
plt.plot(time,u1_norm)
plt.title('u')
plt.show()
```

图像:



将Q改为3*Q, 对比得:

