reconciliador

August 2, 2020

0.1 Aulas 10 e 11 - Reconciliação de Dados

Aluno: Vitor Barbosa

Teoria: Multiplicadores de Lagrange Seja uma função f = f(x, y, z) sujeita à restrição $g = g(x, y, z) = k, k \in \mathbb{R}$ Definimos a Lagrangiana ou função auxiliar $J(x, y, z, \lambda) = f - \lambda g$.

Desejamos encontrar pontos estacionários da Langrangiana (máximos ou mínimos), o que ocorre quando o gradiente desaparece:

$$\nabla (f - \lambda g) = 0 \iff \nabla f = \lambda \nabla g$$

Interpretação: O gradiente de uma isosuperfície (uma função da forma h(x, y, z) = k) representa seu vetor normal, e para que f e g se toquem (sejam tangentes), seus vetores normais precisam ser paralelos, ou seja, isso garante que a restrição será satisfeita.

No nosso caso, f é uma função custo comumente encontrada no problema dos Mínimos Quadrados Ponderados (Weighted Least Squares):

$$f(x_i, \hat{x}_i) = \sum_{i=1}^{N} \frac{(x_i - \hat{x}_i)^2}{\sigma_i^2}$$

Aqui, \hat{x}_i são os valores reconciliados que desejamos obter e σ_i^2 são as variâncias das medições.

A restrição g é a Equação da Continuidade para o fluxo incompressível (Balanço de Massa).

Passando para forma matricial, temos:

$$f(\hat{X}) = (X - \hat{X})^T V^{-1} (X - \hat{X})$$

V é a matrix de covariância. Para variáveis independentes, ela é uma matriz diagonal com as variâncias das medidas na diagonal principal. X é o vetor com as medidas da planta. A restrição é o balanço de massas reescrito na forma matricial, com a Matriz de Incidência A. Para m restrições (nós) e n variáveis (sensores), temos m linhas e n columas.

$$g(\hat{X}) = A\hat{X} = 0$$

A função auxiliar será:

$$J(\hat{X}, \lambda) = (X - \hat{X})^T V^{-1} (X - \hat{X}) - 2\lambda^T A \hat{X}$$

1

Note que há um $2\lambda^T$ na equação em vez de λ^T . Creio que isso foi feito para simplificar

$$\frac{\partial (Y^TBY)}{\partial Y} = 2BY$$

Uma vez que λ_i é um multiplicador arbitrário, não há problema nisso.

Após as devidas manipulações, temos:

$$\hat{X} = X - VA^T (AVA^T)^{-1}AX$$

Vista a teoria, vamos implementar o código.

```
[1]: #Exercício 2
     #Reconciliando o sistema com 2 nós proposto nos slides do professor
     from numpy import zeros, transpose
     from numpy.linalg import inv,qr
     X = [161,79,80,20,63]
     V = zeros((5,5))
     V[0,0] = 0.05*X[0]
     V[1,1] = 0.01*X[1]
     V[2,2] = 0.01*X[2]
     V[3,3] = 0.10*X[3]
     V[4,4] = 0.05*X[4]
     #Multiplicação elemento-a-elemento para transformar desvio padrão em variância
     V = V*V;
     #X1-X2-X3 = X3-X4-X5 = 0
     A = [[1,-1,-1,0,0],[0,0,1,-1,-1]]
     Xhat = X-V@transpose(A)@inv(A@V@transpose(A))@A@X
     Xhat
```

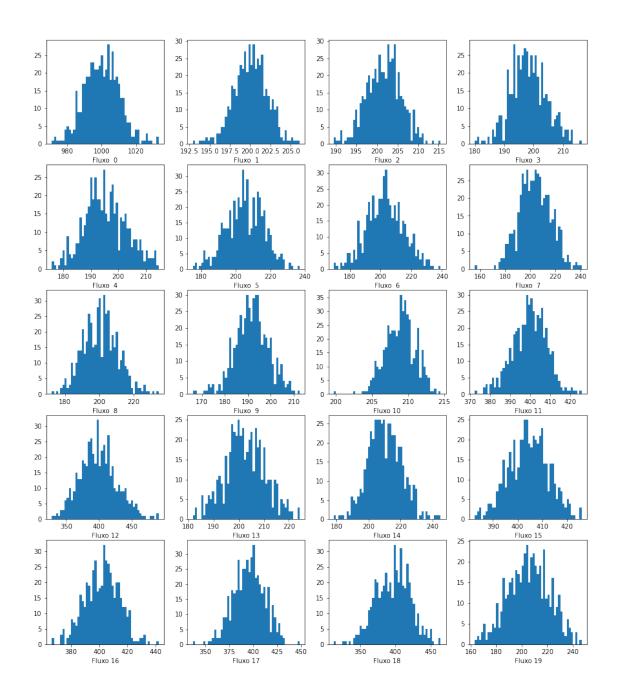
[1]: array([159.16680979, 79.01765509, 80.14915469, 19.18093868, 60.96821601])

```
/-f4-o10-f9---/
   \-f5-011-f10-012-f13-013-f14-014-f19
#Médias dos fluxos em m^3/s
f = zeros(20)
s = zeros(20)
f[0] = 1000
f[1] = 200; f[2] = 202; f[3] = 198; f[4] = 195; f[5] = 205
f[6] = 203; f[7] = 204; f[8] = 201; f[9] = 192; f[10] = 209
f[11] = 400; f[12] = 399; f[13] = 203; f[14] = 210; f[16] = 403
f[15] = 405; f[17] = 395; f[18] = 397; f[19] = 206
#Desvios padrões normalizados
s[0] = 0.01; s[1] = 0.01; s[2] = 0.02; s[3] = 0.03; s[4] = 0.04; s[5] = 0.05;
\rightarrows[6] = 0.06
s[7] = 0.06; s[8] = 0.05; s[9] = 0.04; s[10] = 0.01; s[11] = 0.02; s[12] = 0.07;
\rightarrow s[13] = 0.04; s[14] = 0.05
s[15] = 0.02; s[16] = 0.03; s[17] = 0.04; s[18] = 0.06; s[19] = 0.08
#Pré-alocando memória para 500 medidas
X = zeros((20,500))
for i in range(500):
    for j in range(20):
        X[j,i] = gauss(f[j],s[j]*f[j])
#Plotando a distribuição de valores graficamente
n = linspace(0,500,500)
plt.subplots_adjust(top=1.4,bottom=0.1)
for i in range(20):
    plt.subplot(5,4,i+1)
    plt.hist(X[i,:],bins=50)
    plt.xlabel("Fluxo %2d"%(i))
    #plt.plot(n,X[i,:]) # plota valores diretamente
# Calculando valores das medidas
#Mé.d.i.a.
mu = zeros(20)
#Desvio padrão = Precisão
sigma = zeros(20)
#Bias
bias = zeros(20)
for i in range(500):
    for j in range(20): mu[j] = mu[j] + X[j,i]
mu = mu/500
for i in range(500):
    for j in range(20): sigma[j] = sigma[j] + (X[j,i] - mu[j])**2
sigma = (sigma/500)**0.5
bias = mu-f
```

```
#Incerteza = erro padrão = sigma/sqrt(N)
incert = (sigma/500)**0.5

for i in range(20):
    print("Sensor %2d - mu=%7.2f sigma=%6.2f Incert=%2.2f Bias=%5.
    \( \to 2f\) "%(i,mu[i], sigma[i], incert[i], bias[i]))
    #print("Sensor %2d - \u03BC=%7.2f \u03c3=%6.2f Incert=%2.2f Bias=%5.
    \( \to 2f\) "%(i,mu[i], sigma[i], incert[i], bias[i]))
```

```
Sensor 0 - mu= 999.98 sigma= 10.13 Incert=0.14 Bias=-0.02
Sensor 1 - mu= 200.06 sigma= 2.05 Incert=0.06 Bias= 0.06
Sensor 2 - mu= 201.67 sigma= 4.19 Incert=0.09 Bias=-0.33
Sensor 3 - mu= 198.30 sigma= 6.06 Incert=0.11 Bias= 0.30
Sensor 4 - mu= 195.37 sigma= 7.65 Incert=0.12 Bias= 0.37
Sensor 5 - mu= 205.35 sigma= 10.61
                                  Incert=0.15 Bias= 0.35
Sensor 6 - mu= 203.10 sigma= 12.06 Incert=0.16
                                               Bias= 0.10
Sensor 7 - mu= 203.81 sigma= 12.59 Incert=0.16
                                               Bias=-0.19
Sensor 8 - mu= 200.56 sigma= 10.11
                                   Incert=0.14
                                               Bias=-0.44
Sensor 9 - mu= 191.77 sigma= 7.27 Incert=0.12 Bias=-0.23
Sensor 10 - mu= 208.95 sigma= 2.05 Incert=0.06 Bias=-0.05
Sensor 11 - mu= 399.74 sigma= 8.41 Incert=0.13 Bias=-0.26
Sensor 12 - mu= 399.23 sigma= 28.17 Incert=0.24 Bias= 0.23
Sensor 13 - mu= 202.65 sigma= 7.94 Incert=0.13 Bias=-0.35
Sensor 14 - mu= 210.14 sigma= 10.36 Incert=0.14 Bias= 0.14
Sensor 15 - mu= 404.49 sigma= 8.00 Incert=0.13 Bias=-0.51
Sensor 16 - mu= 402.15 sigma= 12.15 Incert=0.16 Bias=-0.85
Sensor 17 - mu= 395.60 sigma= 16.18 Incert=0.18 Bias= 0.60
Sensor 18 - mu= 396.73 sigma= 24.34 Incert=0.22 Bias=-0.27
Sensor 19 - mu= 205.50 sigma= 16.13 Incert=0.18 Bias=-0.50
```



```
[30]: #Reconciliação de Dados
from numpy import diag, append
# As matrizes:
#V é matriz de covariancia diagonal, quadrada, com a dimensão do número de

→ sensores

V = diag(sigma*sigma)
# A matriz das restrições vamos tirar do mapa:
''' Mapa do sistema. Cada "o" é um nó, cada "f" é um fluxo
f0-o0-f1-o1-f6-o2-f11-o3-f15-o4-f16
```

```
1-f2-o5-f7--/
  /-f3-o6-f8----o7-f12-o8-f17-o9-f18
  /-f4-o10-f9---/
   \-f5-011-f10-012-f13-013-f14-014-f19
#Temos A com 15 linhas(restrições) e 20 colunas(variáveis)
#A pode ser obtida diretamente analisando os balanços de massa nos nós
# Vamos percorrer os nós linha a linha, da esquerda para a direita
nRest = 15;
nFlux = 20;
A = zeros((nRest,nFlux))
#Rest 0
A[0,0] = 1; A[0,1:6] = -1
#Rest 1
A[1,1] = 1; A[1,6] = -1
#Rest 2
A[2,6] = 1; A[2,7] = 1; A[2,11] = -1
#Demais restrições
A[3,11]=1; A[3,15]=-1
A[4,15]=1; A[4,16]=-1
A[5,2]=1; A[5,7]=-1
A[6,3]=1; A[6,8]=-1
A[7,8]=1; A[7,9]=1; A[7,12]=-1
A[8,12]=1; A[8,17]=-1
A[9,17]=1; A[9,18]=-1
A[10,4]=1;A[10,9]=-1
A[11,5]=1; A[11,10]=-1
A[12,10]=1; A[12,13]=-1
A[13,13]=1; A[13,14]=-1
A[14,14]=1; A[14,19]=-1
X1 = mu
# A matriz de dados reconciliados
Xhat = X1-V@transpose(A)@inv(A@V@transpose(A))@A@X1
print("\nMatrizes Geradas----\n")
print("A matriz de covariância V:\n")
print(V)
print("\nMatriz de medidas X1:\n")
print(X1)
print("\nA Matriz de restrições A:\n")
print(A)
print("\n----\n")
print("\nOs fluxos reconciliados:\n")
```

Matrizes Geradas-----

A matriz de covariância V:

[[102.60790425		0.	0.	0.	0.	
	0.	0.	0.	0.	0.	
	0.	0.	0.	0.	0.	
	0.	0.	0.	0.	0.]
[0.	4.19985415	0.	0.	0.	
	0.	0.	0.	0.	0.	
	0.	0.	0.	0.	0.	
	0.	0.	0.	0.	0.]
Γ	0.	0.	17.57493865	0.	0.	
	0.	0.	0.	0.	0.	
	0.	0.	0.	0.	0.	
	0.	0.	0.	0.	0.]
[0.	0.	0.	36.77545451	0.	
	0.	0.	0.	0.	0.	
	0.	0.	0.	0.	0.	
	0.	0.	0.	0.	0.]
[0.	0.	0.	0.	58.456	19424
	0.	0.	0.	0.	0.	
	0.	0.	0.	0.	0.	
	0.	0.	0.	0.	0.]
[0.	0.	0.	0.	0.	
1	12.61893251	0.	0.	0.	0.	
	0.	0.	0.	0.	0.	
	0.	0.	0.	0.	0.]
[0.	0.	0.	0.	0.	
-	0.	145.36557111	0.	0.	0.	
	0.	0.	0.	0.	0.	
	0.	0.	0.	0.	0.]
[0.	0.	0.	0.	0.	
-	0.	0.	158.5112549	0.	0.	
	0.	0.	0.	0.	0.	
	0.	0.	0.	0.	0.]
[0.	0.	0.	0.	0.	
	0.	0.	0.	102.30275102	0.	
	0.	0.	0.	0.	0.	
	0.	0.	0.	0.	0.]
[0.	0.	0.	0.	0.	_
-	0.	0.	0.	0.	52.831	70658
	0.	0.	0.	0.	0.	
	0.	0.	0.	0.	0.]

[0.	0.	0.	0.	0.	
	0.	0.	0.	0.	0.	
	4.18234032	0.	0.	0.	0.	
	0.	0.	0.	0.	0.]
[0.	0.	0.	0.	0.	
	0.	0.	0.	0.	0.	
	0.	70.75648163	0.	0.	0.	
	0.	0.	0.	0.	0.]
[0.	0.	0.	0.	0.	
	0.	0.	0.	0.	0.	
	0.	0.	793.28138694	0.	0.	
	0.	0.	0.	0.	0.]
[0.	0.	0.	0.	0.	
	0.	0.	0.	0.	0.	
	0.	0.	0.	63.12289211	0.	
	0.	0.	0.	0.	0.]
[0.	0.	0.	0.	0.	
	0.	0.	0.	0.	0.	
	0.	0.	0.	0.	107.25584	259
	0.	0.	0.	0.	0.]
[0.	0.	0.	0.	0.	
	0.	0.	0.	0.	0.	
	0.	0.	0.	0.	0.	
	64.04557929	0.	0.	0.	0.]
[0.	0.	0.	0.	0.	
	0.	0.	0.	0.	0.	
	0.	0.	0.	0.	0.	
	0.	147.57411359	0.	0.	0.]
[0.	0.	0.	0.	0.	
	0.	0.	0.	0.	0.	
	0.	0.	0.	0.	0.	
	0.	0.	261.94741234	0.	0.]
[0.	0.	0.	0.	0.	
	0.	0.	0.	0.	0.	
	0.	0.	0.	0.	0.	
	0.	0.	0.	592.2288072	0.]
[0.	0.	0.	0.	0.	
	0.	0.	0.	0.	0.	
	0.	0.	0.	0.	0.	
	0.	0.	0.	0.	260.22231	692]]

Matriz de medidas X1:

[999.98068317 200.06446321 201.66529692 198.30495248 195.36861487 205.3455356 203.09509339 203.80963746 200.56319438 191.77421124 208.94655554 399.737448 399.22761704 202.64618889 210.14457352 404.49397929 402.15277209 395.59594308 396.73132428 205.49782709]

A Matriz de restrições A:

```
0. 0.]
0. 0.]
[0. 0. 0. 0. 0. 1. 1. 0. 0. 0. -1. 0. 0. 0. 0. 0.
 0. 0.1
[0. 0. 0. 0. 0. 0. 0. 0. 0. 0. 1. 0. 0. 0. -1. 0.
 0. 0.]
0. 0.]
[0. 0. 1. 0. 0. 0. -1. 0. 0. 0. 0. 0. 0. 0. 0. 0. 0. 0.
 0. 0.]
[0. 0. 0. 1. 0. 0. 0. -1. 0. 0. 0. 0. 0. 0. 0. 0. 0. 0.
 0. 0.]
[0. 0. 0. 0. 0. 0. 0. 1. 1. 0. 0. -1. 0. 0. 0. 0. 0.
 0. 0.]
[0. 0. 0. 0. 0. 0. 0. 0. 0. 0. 0. 1. 0. 0. 0. -1.
 0. 0.1
[ \ 0. \ \ 0. \ \ 0. \ \ 0. \ \ 0. \ \ 0. \ \ 0. \ \ 0. \ \ 0. \ \ 0. \ \ 0. \ \ 0.
-1. 0.]
0. 0.]
0. 0.]
[\ 0.\ \ 0.\ \ 0.\ \ 0.\ \ 0.\ \ 0.\ \ 0.\ \ 1.\ \ 0.\ \ 0.\ \ -1.\ \ 0.\ \ 0.\ \ 0.
 0. 0.]
[ \ 0. \ \ 0. \ \ 0. \ \ 0. \ \ 0. \ \ 0. \ \ 0. \ \ 0. \ \ 0. \ \ 0. \ \ 1. \ -1. \ \ 0. \ \ 0. \ \ 0.
 0. 0.]
[0. 0. 0. 0. 0. 0. 0. 0. 0. 0. 0. 0. 0. 1. 0. 0. 0.
 0. -1.]]
```

Os fluxos reconciliados:

```
[1002.64999479 200.10448761 201.70461089 198.94596501 193.52559938 208.3693319 200.10448761 201.70461089 198.94596501 193.52559938 208.3693319 401.8090985 392.47156439 208.3693319 208.3693319 401.8090985 392.47156439 392.47156439 208.3693319 ]
```

```
[14]: # Parte 2 - Excluir 5 fluxos

# Os fluxos excluídos: 19,18,17,16,15

# Vamos remover os fluxos não mensuráveis

fexcl = [15,16,17,18,19]
```

```
fmens = [0,1,2,3,4,5,6,7,8,9,10,11,12,13,14]
nExcl = len(fexcl);
nMens = len(fmens);
#Fluxos medidos
Ay = zeros((nRest,nMens))
#Fluxos só observados (não medidos)
Az = zeros((nRest,nExcl))
i = 0; k = 0
for j in range(nFlux):
    if(j not in fexcl): #Se o fluxo não deve ser excluído
        Ay[:,i] = A[:,j] #Copia a restrição da coluna do fluxo da matriz A para∟
\rightarrow a matriz Ay
        i=i+1
    else:
        Az[:,k] = A[:,j]#Copia a restrição da coluna do fluxo para a matriz Az
        k=k+1
```

O problema de otimização agora estará sujeito a

$$A_y \hat{Y} + A_z \hat{Z} = 0$$

Sendo A_y a matriz de restrições com os fluxos mensuráveis e A_z a matriz com os fluxos não mensuráveis, mas observáveis.

Precisamos eliminar A_z , o que faremos usando a matriz de projeção P tal que $PA_z = 0$.

A matriz PA_y tem a forma de um vetor que só possui elementos não nulos para os fluxos redundantes correspondentes.

Definiremos a matriz

$$A' \mid A'_i = (PA_y)_i \ \forall \ (PA_y)_i \neq 0$$

Temos então:

$$\hat{Y} = Y - V(A')^T [(A')V(A')^T]^{-1}A'Y$$

```
[29]: #Vamos encontrar a matriz de projeção P por fatorização QR:
q,r = qr(Az,mode='complete')

P = q[:,-1] # ultima coluna de q é a matriz de projeção

#O vetor PAy indica os fluxos não redundantes
# Se um elemento é nulo, quer dizer que o fluxo não é redundante e não pode seru→reconciliado

#PAy tem o comprimento igual ao numero de fluxos mensuráveis
print("A matriz PAy indica os fluxos redundantes: \n")
PAy = P@Ay
print(PAy)
print("\n")
```

```
nRedundant=0
for i in range(nMens):
    if(PAy[i]!=0): #Se o fluxo é redundante, pode-se reconciliá-lo, outros⊔
→ fluxos podem ajudar
       nRedundant+=1
       print("A medida %2d é redundante" %i)
   else:
       print("A medida %2d não é redundante" %i)
#Alocando memória
#Matriz de variância
V=zeros((nRedundant,nRedundant))
#Matriz de medidas dos fluxos redundantes
Y=zeros((nRedundant,1))
#Matriz de restrições, é a matriz A'
A_=zeros((1,nRedundant))
#Matriz com todos os fluxos mensuráveis, após a reconciliação
Yfull=zeros((nMens,1))
n = 0
for i in range(nMens):
    if(PAy[i]!=0):#Se o fluxo é redundante
       Y[n,:] = mu[fmens[i]] #Só incluir as medidas redundantes
       V[n,n] = sigma[fmens[i]]*sigma[fmens[i]]
       A_[:,n] = PAy[i] #Construindo a matriz A' segundo sua definição
       n += 1
   else:
        #Se o fluxo não é redundante, já copiamos ele direto pra matriz final
        #Pois ele não será reconciliado
       Yfull[i,:] = mu[fmens[i]]
# Reconciliando
Yhat = Y-V@transpose(A_)@inv(A_@V@transpose(A_))@A_@Y
n = 0
for i in range(nMens):
    if(Yfull[i]==0):
       Yfull[i] = Yhat[n] # Colocando os fluxos reconciliados na matriz final
#Finalmente, reconciliamos of fluxos observáveis, mas não medidos (os excluídos)
Zhat = -inv(transpose(Az)@Az)@transpose(Az)@(Ay@Yfull)
print("\nMatrizes dos Fluxos Redundantes----\n")
print("A matriz de covariância V:\n")
print(V)
```

```
print("\nMatriz de medidas Y:\n")
print(Y)
print("\nA Matriz de restrições A':\n")
print("\n----\n")
print("\nOs fluxos mensuráveis:\n")
for n in range(nMens): print("Fluxo %2d -> %3.3f" %(fmens[n],Yfull[n]))
print("\nOs fluxos observáveis, mas excluídos (não mensuráveis):\n")
for n in range(nExcl): print("Fluxo %2d -> %3.3f" %(fexcl[n],Zhat[n]))
A matriz PAy indica os fluxos redundantes:
[-7.07106781e-01 1.41421356e+00 7.07106781e-01 7.07106781e-01
 7.07106781e-01 7.07106781e-01 -7.07106781e-01 0.00000000e+00
 0.0000000e+00 0.0000000e+00 0.0000000e+00 -5.55111512e-17
 0.0000000e+00 0.0000000e+00 0.0000000e+00]
A medida 0 é redundante
A medida 1 é redundante
A medida 2 é redundante
A medida 3 é redundante
A medida 4 é redundante
A medida 5 é redundante
A medida 6 é redundante
A medida 7 não é redundante
A medida 8 não é redundante
A medida 9 não é redundante
A medida 10 não é redundante
A medida 11 é redundante
A medida 12 não é redundante
A medida 13 não é redundante
A medida 14 não é redundante
Matrizes dos Fluxos Redundantes-----
A matriz de covariância V:
                    0.
[[102.60790425 0.
                                    Ο.
                                                0.
            0.
   0.
                         0.
             4.19985415 0.
ΓΟ.
                                     0.
                                                0.
   0.
             0.
                        0.
                               ]
                    17.57493865 0.
ΓΟ.
             0.
             0.
                        0. ]
   0.
 Γ Ο.
             0.
                        0.
                                    36.77545451
```

```
0.
                     0.
  0.
                                          58.45619424
[ 0.
            0.
                       0.
                                 0.
  0.
                      Ο.
                               ]
            0.
[ 0.
            0.
                      0.
                                           0.
                                 0.
112.61893251 0.
                      0.
[ 0.
            0.
                       0.
                                  0.
                                            0.
  0.
          145.36557111 0.
            0.
[ 0.
                      0.
                                  0.
                                            0.
  0.
            0.
                     70.75648163]]
```

Matriz de medidas Y:

[[999.98068317] [200.06446321]

[201.66529692]

[198.30495248]

[195.36861487]

[205.3455356]

[203.09509339]

[399.737448]]

A Matriz de restrições A':

[[-7.07106781e-01 1.41421356e+00 7.07106781e-01 7.07106781e-01 7.07106781e-01 7.07106781e-01 -7.07106781e-01 -5.55111512e-17]]

Os fluxos mensuráveis:

Fluxo 0 -> 999.507

Fluxo 1 -> 200.103

Fluxo 2 -> 201.746

Fluxo 3 -> 198.475

Fluxo 4 -> 195.638

Fluxo 5 -> 205.865

Fluxo 6 -> 202.424

Fluxo 7 -> 203.810

Fluxo 8 -> 200.563

Fluxo 9 -> 191.774

Fluxo 10 -> 208.947

Fluxo 11 -> 399.737

Fluxo 12 -> 399.228

Fluxo 13 -> 202.646

Fluxo 14 -> 210.145

Os fluxos observáveis, mas excluídos (não mensuráveis):

```
Fluxo 15 -> 399.737
Fluxo 16 -> 399.737
Fluxo 17 -> 399.228
Fluxo 18 -> 399.228
Fluxo 19 -> 210.145
```

Fontes:

 $https://en.wikipedia.org/wiki/Lagrange_multiplier\ https://tutorial.math.lamar.edu/classes/calciii/lagrangemultiplier.wikipedia.org/wiki/Continuity_equation.wikipedia.org/wiki/Weighted_least_squares.http://www.gatsby.ucl.ac.uk/teaching/courses/sntn/sntn-2017/resources/Matrix_derivatives_cribsheet.pdf.https://www2.southeastern.edu/Academics/Faculty/rallain/plab194/error.html$