

Define  $dlqr(a,b,q,r,n)=\text{Func}$

Done

© Won Bin Choi (dc07650@sogang.ac.kr)

Local  $i, \lambda, p, oldp, k$

$\lambda := \text{eigVl}(a)$

Disp "Eigen Values: ",  $\lambda$

Disp "Size of Eigen Values: ",  $|\lambda|$

$p := \text{identity}(\text{dim}(\lambda))$

$i := 0$

Loop

$oldp := p$

$i := i + 1$

$p := q + a^T \cdot p \cdot a - a^T \cdot p \cdot b \cdot (r + b^T \cdot p \cdot b)^{-1} \cdot b^T \cdot p \cdot a$

If  $i > n$

Exit

EndLoop

Disp "P: ",  $p$

$k := (r + b^T \cdot p \cdot b)^{-1} \cdot b^T \cdot p \cdot a$

Disp "K: ",  $k$

EndFunc

$dlqr\left(\begin{bmatrix} 0 & -1 \\ 1 & 1 \end{bmatrix}, \begin{bmatrix} 0 \\ 1 \end{bmatrix}, \begin{bmatrix} 1 & 0 \\ 0 & 1 \end{bmatrix}, [1], 20\right)$

Eigen Values:  $\{0.5 + 0.866025 \cdot i, 0.5 - 0.866025 \cdot i\}$

Size of Eigen Values:  $\{1., 1.\}$

P:  $\begin{bmatrix} 1.75788 & 0.610149 \\ 0.610149 & 3.13016 \end{bmatrix}$

K:  $\begin{bmatrix} 0.757879 & 0.610149 \end{bmatrix}$

$\begin{bmatrix} 0.757879 & 0.610149 \end{bmatrix}$

$\begin{bmatrix} \end{bmatrix}$