МЕТОДЫ УПРАВЛЕНИЯ ПО ПРОГНОЗИРУЮЩЕЙ МОДЕЛИ НА ОСНОВЕ ДАННЫХ

Кулешов Владислав Вячеславович

Содержание

- Определния
- Теорема
- Задача с терминальными ограничениями
- Алгоритм
- Пример
- Результаты

Определния

МОУ: кафедра методов оптимального управления

Определение

$\{x_k\}_{k=0}^{N-1}$ *с* $x_k \in \mathbb{R}^n$ *постоянно возбуждающая порядка L, если* $\operatorname{rank}(H_L(x)) = nL$.

Определение

Пара $(u^s, y^s) \in \mathbb{R}^{m+p}$ *– положение равновесия линейной стационарной системой* G, *если последовательность* $\{\overline{u}_k, \overline{y}_k\}_{k=0}^{n-1}$ *с* $(\overline{u}_k, \overline{y}_k) = (u^s, y^s)\ \forall k \in \mathbb{I}[0, n-1]$ *– траектория* G.

Теорема

Предположим, что $\{u^d_k, y^d_k\}_{k=0}^{N-1}$ *– траектория линейной стационарной системы* G, *где* u *– постоянно возбуждающее управление порядка* $L+n$.
Тогда $\{\overline{u}_k, \overline{y}_k\}_{k=0}^{L-1}$ *– траектория* G, *тогда и только тогда, когда* $\exists\alpha \in \mathbb{R}^{N-L+1}$ *такое, что*

$$\begin{bmatrix} H_L(u^d) \\ H_L(y^d) \end{bmatrix} \alpha = \begin{bmatrix} \overline{u} \\ \overline{y} \end{bmatrix}. \qquad (1)$$

Задача с терминальными ограничениями

$$J_L^*(u_{[t-n,t-1]}, y_{[t-n,t-1]}) = \min_{\alpha(t)} \min_{\overline{u}(t),\overline{y}(t)} \sum_{k=0}^{L-1} \ell(\overline{u}_k(t), \overline{y}_k(t)) \tag{2}$$

$$\begin{bmatrix} \overline{u}_{[-n,-L-1]}(t) \\ \overline{y}_{[-n,-L-1]}(t) \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} H_{L+n}(u^d) \\ H_{L+n}(y^d) \end{bmatrix} \alpha(t), \tag{3}$$

$$\begin{bmatrix} \overline{u}_{[-n,-1]}(t) \\ \overline{y}_{[-n,-1]}(t) \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} u_{[t-n,t-1]} \\ y_{[t-n,t-1]} \end{bmatrix}, \tag{4}$$

$$\begin{bmatrix} \overline{u}_{[L-n,L-1]}(t) \\ \overline{y}_{[L-n,L-1]}(t) \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} u_n^s \\ y_n^s \end{bmatrix}, \tag{5}$$

$$\ell(\overline{u}, \overline{y}) = \|\overline{u} - u^s\|_R^2 + \|\overline{y} - y^s\|_Q^2,\ Q, R \succ 0. \tag{6}$$

$$\overline{u}_k(t) \in \mathbb{U}, \overline{y}_k(t) \in \mathbb{Y}, k \in \mathbb{I}_{[0,L-1]}. \tag{7}$$

Алгоритм

Алгоритм

(Схема управления на основе MPC)

1. *В момент времени t взять прошлые n измерений $u_{[t-n,t-1]}, y_{[t-n,t-1]}$ и решить задачу.*
2. *Взять за управление $u_t = \overline{u}_0^*(t)$*
3. *Установить $t = t + 1$ и вернуться к пункту 1).*

Пример

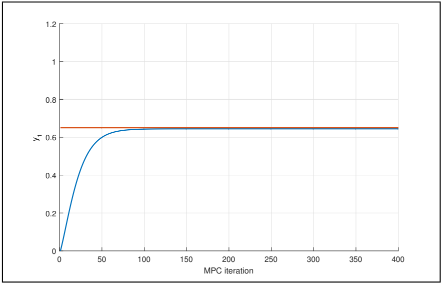
$$x_{k+1} = \begin{bmatrix} 0.921 & 0 & 0.041 & 0 \\ 0 & 0.918 & 0 & 0.033 \\ 0 & 0 & 0.924 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 0.937 \end{bmatrix} x_k + \begin{bmatrix} 0.017 & 0.001 \\ 0.001 & 0.023 \\ 0 & 0.061 \\ 0.072 & 0 \end{bmatrix} u_k,$$

$$y_k = \begin{bmatrix} 1 & 0 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & 0 & 0 \end{bmatrix} x_k.$$

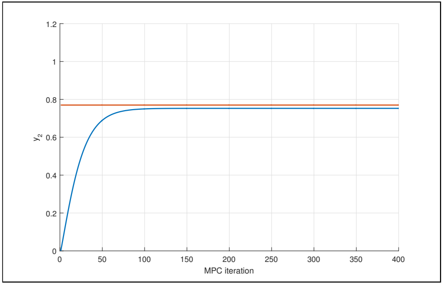
$$(u^s, y^s) = (\begin{bmatrix} 1 \\ 1 \end{bmatrix}, \begin{bmatrix} 0.65 \\ 0.77 \end{bmatrix}).$$

Предположим, что системные матрицы неизвестны, но доступна одна траектория $\{u_k^d, y_k^d\}_{k=0}^{N-1}$ длины $N = 100$, которая генерируется путем равномерной выборки u_k^d из $[-1, 1]^2$. Горизонт прогнозирования установим в $L = 25$, а матрицы затрат $Q = 3 \cdot E_2$, $R = 10^{-4} \cdot E_2$.

Результаты



1.2
1
0.8
y_1 0.6
0.4
0.2
0
0
50
100
150
200
250
300
350
400
MPC iteration



1.2
1
0.8
y_2 0.6
0.4
0.2
0
0
50
100
150
200
250
300
350
400
MPC iteration

Концовка

Спасибо за внимание!