# Rješenja zadataka sa drugog međuispita iz Teorije estimacije

Srećko Jurić-Kavelj

Sveučilište u Zagrebu Fakultet elektrotehnike i računarstva

31. svibnja 2010.





# Zadatak a)

#### Primjer

Antena za praćenje satelita opisana je sljedećim matematičkim modelom:

$$J\ddot{\Theta} + B\dot{\Theta} = M_m + M_v ,$$

gdje je J moment inercije antene, B faktor prigušenja (usred trenja),  $M_m$  moment motora i  $M_v$  moment smetnje (usred naleta vjetra).

a)  $(1 \ bod)$  Zadani sustav prikažite u prostoru stanja. U sustavu se mjeri kut  $\Theta$ . Koristite oznake  $a=\frac{B}{J}$  i  $u=\frac{M_m}{B}$ . Diskretizirajte sustav uz vrijeme diskretizacije T=0.1s, koje je dovoljno malo za razmatrani sustav (a=0.02).

$$J\ddot{\Theta} + B\dot{\Theta} = M_m + M_v ,$$

$$J\ddot{\Theta} + B\dot{\Theta} = M_m + M_v$$
,

$$\ddot{\Theta} = -\frac{B}{J}\dot{\Theta} + \frac{M_m}{J} + \frac{M_v}{J} \ ,$$

$$J\ddot{\Theta} + B\dot{\Theta} = M_m + M_v ,$$

$$\ddot{\Theta} = -\frac{B}{J}\dot{\Theta} + \frac{M_m}{J} + \frac{M_v}{J} ,$$

$$a = \frac{B}{J}, \ u = \frac{M_m}{B}$$

$$J\ddot{\Theta} + B\dot{\Theta} = M_m + M_v ,$$
 
$$\ddot{\Theta} = -\frac{B}{J}\dot{\Theta} + \frac{M_m}{J} + \frac{M_v}{J} ,$$
 
$$a = \frac{B}{J}, \ u = \frac{M_m}{B}$$
 
$$\ddot{\Theta} = -a\dot{\Theta} + \frac{M_mB}{IB} + \frac{M_v}{J} ,$$

$$J\ddot{\Theta} + B\dot{\Theta} = M_m + M_v ,$$
 
$$\ddot{\Theta} = -\frac{B}{J}\dot{\Theta} + \frac{M_m}{J} + \frac{M_v}{J} ,$$
 
$$a = \frac{B}{J}, \ u = \frac{M_m}{B}$$

 $\ddot{\Theta} = -a\dot{\Theta} + au + \frac{M_v}{I} .$ 

$$\left[\begin{array}{c} \\ \end{array}\right] = \left[\begin{array}{c} \\ \end{array}\right] \left[\begin{array}{c} \\ \\ \\ \end{array}\right] + \left[\begin{array}{c} \\ \end{array}\right]$$

$$\begin{bmatrix} \dot{\Theta} \\ \ddot{\Theta} \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} & & \\ \end{bmatrix} \begin{bmatrix} \Theta \\ \dot{\Theta} \end{bmatrix} + \begin{bmatrix} & \\ \end{bmatrix} u$$

$$\begin{bmatrix} \dot{\Theta} \\ \ddot{\Theta} \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 0 & 1 \\ \end{bmatrix} \begin{bmatrix} \Theta \\ \dot{\Theta} \end{bmatrix} + \begin{bmatrix} 0 \\ \end{bmatrix} u$$

$$\begin{bmatrix} \dot{\Theta} \\ \ddot{\Theta} \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 0 & 1 \\ 0 & -a \end{bmatrix} \begin{bmatrix} \Theta \\ \dot{\Theta} \end{bmatrix} + \begin{bmatrix} 0 \\ a \end{bmatrix} u$$

$$\begin{bmatrix} \dot{\Theta} \\ \ddot{\Theta} \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 0 & 1 \\ 0 & -a \end{bmatrix} \begin{bmatrix} \Theta \\ \dot{\Theta} \end{bmatrix} + \begin{bmatrix} 0 \\ a \end{bmatrix} u$$

$$y = \begin{bmatrix} 1 & 0 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} \Theta \\ \dot{\Theta} \end{bmatrix}$$

# Zadatak b)

## Primjer

b) (3 boda) Projektirajte diskretni neprediktivni estimator stanja tako da u prvom slučaju svi polovi dinamike pogreške estimacije budu u nuli  $(z_p = 0)$ , a u drugom u 0.6  $(z_p = 0.6)$ .

#### Definicija

Dinamika diskretnog neprediktivnog estimatora stanja dana je:

$$\tilde{x}(k+1|k+1) = (\Phi - KH\Phi)\tilde{x}(k|k) .$$

#### Definicija

Dinamika diskretnog neprediktivnog estimatora stanja dana je:

$$\tilde{x}(k+1|k+1) = (\Phi - KH\Phi)\tilde{x}(k|k) .$$

Karakteristična jednadžba glasi:

$$P_{NPE}(z) = |zI - \Phi + KH\Phi|$$
.

## Definicija

Dinamika diskretnog neprediktivnog estimatora stanja dana je:

$$\tilde{x}(k+1|k+1) = (\Phi - KH\Phi)\tilde{x}(k|k) .$$

Karakteristična jednadžba glasi:

$$P_{NPE}(z) = |zI - \Phi + KH\Phi|$$
.

 $(z_p = 0) P_{NPE}(z) = z^2$ 

## Definicija

Dinamika diskretnog neprediktivnog estimatora stanja dana je:

$$\tilde{x}(k+1|k+1) = (\Phi - KH\Phi)\tilde{x}(k|k) .$$

Karakteristična jednadžba glasi:

$$P_{NPE}(z) = |zI - \Phi + KH\Phi|$$
.

- $(z_p = 0) P_{NPE}(z) = z^2$
- $(z_p = 0.6) P_{NPE}(z) = (z 0.6)^2 = z^2 1.2z + 0.36$



# Rješenje u Matlabu

## Rješenje u Matlabu

ACKER Pole placement gain selection using Ackermann's formula.

K = ACKER(A,B,P) calculates the feedback gain matrix K such that the single input system

$$x = Ax + Bu$$

with a feedback law of u = -Kx has closed loop poles at the values specified in vector P, i.e., P = eig(A-B\*K).

## Rješenje u Matlabu

ACKER Pole placement gain selection using Ackermann's formula.

K = ACKER(A,B,P) calculates the feedback gain matrix K such that the single input system

$$x = Ax + Bu$$

with a feedback law of  $\, u = -Kx \,$  has closed loop poles at the values specified in vector P, i.e., P = eig(A-B\*K).

$$\Phi - KH\Phi \stackrel{?}{=} A - BK$$

$$(\Phi - KH\Phi)^T =$$

$$(\Phi - KH\Phi)^T = \Phi^T$$

$$(\Phi - KH\Phi)^T = \Phi^T - \Phi^T$$

$$(\Phi - KH\Phi)^T = \Phi^T - \Phi^T H^T$$

$$(\Phi - KH\Phi)^T = \Phi^T - \Phi^T H^T K^T$$

$$(\Phi - KH\Phi)^T = \Phi^T - \Phi^T H^T K^T$$

$$(\Phi - KH\Phi)^T = \Phi^T - \Phi^T H^T K^T$$

```
>> K1T = acker(F', F'*H', [0 0])
>> K2T = acker(F', F'*H', [0.6 0.6])
```

$$(\Phi - KH\Phi)^T = \Phi^T - \Phi^T H^T K^T$$

>> K1T = acker(F', F'\*H', [0 0])  
>> K2T = acker(F', F'\*H', [0.6 0.6])  
$$K_1^T = [1 \ 9.98]$$

$$(\Phi - KH\Phi)^T = \Phi^T - \Phi^T H^T K^T$$

>> K1T = acker(F', F'\*H', [0 0])  
>> K2T = acker(F', F'\*H', [0.6 0.6])  
$$K_1^T = [1 \ 9.98]$$

$$K_2^T \approx [0.64 \ 1.59]$$



# Zadatak c)

## Primjer

c)  $(2\ boda)$  Pretpostavimo da u sustavu postoji mjerni šum  $v_k$  očekivane vrijednosti nula i varijance  $R\ (v_k \sim N(0,R))$ . Obrazložite koji bi od dvaju projektiranih estimatora imao bolje vladanje s obzirom na šum. Napišite izraz za dinamiku pogreške estimacije uz postojanje mjernog šuma u sustavu.

## Utjecaj mjernog šuma

Dinamika estimatora uz pretpostavku mjernog šuma dana je jednadžbom:

$$\tilde{x}(k+1|k+1) = (\Phi - KH\Phi)\tilde{x}(k|k)$$

## Utjecaj mjernog šuma

Dinamika estimatora uz pretpostavku mjernog šuma dana je jednadžbom:

$$\tilde{x}(k+1|k+1) = (\Phi - KH\Phi)\tilde{x}(k|k) - K\nu($$
)

## Utjecaj mjernog šuma

Dinamika estimatora uz pretpostavku mjernog šuma dana je jednadžbom:

$$\tilde{x}(k+1|k+1) = (\Phi - KH\Phi)\tilde{x}(k|k) - K\nu(k+1) .$$

#### Zadatak

#### Primjer

U akvariju se nalaz  $x_p$  pirana i  $x_g$  akvarijskih ribica. Ribice hranite jednom tjedno hranom u. Također, svaki tjedan pirane pojedu nekoliko ribica. Natalitet pirana proporcionalan je populaciji ribica, a mortalitet je proporcionalan njihovoj vlastitoj populaciji (zbog prenapučenosti). Natalitet ribica proporcionalan je količini hrane u (uz konstantu proporcionalnosti 1), a mortalitet je proporcionalan populaciji pirana.

# Zadatak a)

#### Primjer

a) (2 boda) Napišite model zadanog sustava u prostoru stanja. Uzmite da konstante proporcionalnosti (za koje nije drugačije rečeno) iznose  $\frac{1}{2}$ , a nesigurnost modela izrazite bijelim šumom jedinične varijance uz očekivanu vrijednost 0 ( $w \sim N(0, I)$ ). Pirane zbog veličine možete točno prebrojiti, dok za ribice pretpostavljate mjerni šum jedinične varijance i nulte očekivane vrijednosti.

# Zadatak a)

## Primjer

a) (2 boda) Napišite model zadanog sustava u prostoru stanja. Uzmite da konstante proporcionalnosti (za koje nije drugačije rečeno) iznose  $\frac{1}{2}$ , a nesigurnost modela izrazite bijelim šumom jedinične varijance uz očekivanu vrijednost 0 ( $w \sim N(0, I)$ ). Pirane zbog veličine možete točno prebrojiti, dok za ribice pretpostavljate mjerni šum jedinične varijance i nulte očekivane vrijednosti.

$$x_p =$$

### Primjer

$$x_p = x_g(k)$$

### Primjer

$$x_p = + k_{np}x_g(k)$$

### Primjer

$$x_p = + k_{np} x_g(k) - k_{mp} x_p(k)$$

### Primjer

$$x_p = x_p(k) + k_{np}x_g(k) - k_{mp}x_p(k)$$

### Primjer

$$x_p(k+1) = x_p(k) + k_{np}x_g(k) - k_{mp}x_p(k)$$

### Primjer

$$x_p(k+1) = x_p(k) + k_{np}x_g(k) - k_{mp}x_p(k) + w_p(k)$$

### Primjer

$$x_p(k+1) = x_p(k) + k_{np}x_g(k) - k_{mp}x_p(k) + w_p(k)$$

$$x_g(k+1) =$$

### Primjer

$$x_p(k+1) = x_p(k) + k_{np}x_g(k) - k_{mp}x_p(k) + w_p(k)$$
  
 $x_g(k+1) = x_p(k)$ 

### Primjer

$$x_p(k+1) = x_p(k) + k_{np}x_g(k) - k_{mp}x_p(k) + w_p(k)$$
$$x_g(k+1) = -k_{mg}x_p(k)$$

### Primjer

$$x_p(k+1) = x_p(k) + k_{np}x_g(k) - k_{mp}x_p(k) + w_p(k)$$

$$x_g(k+1) = -k_{mg}x_p(k) + u(k)$$

### Primjer

$$x_p(k+1) = x_p(k) + k_{np}x_g(k) - k_{mp}x_p(k) + w_p(k)$$

$$x_g(k+1) = x_g(k) - k_{mg}x_p(k) + u(k)$$

### Primjer

$$x_p(k+1) = x_p(k) + k_{np}x_g(k) - k_{mp}x_p(k) + w_p(k)$$

$$x_g(k+1) = x_g(k) - k_{mg}x_p(k) + u(k) + w_g(k)$$

$$\begin{bmatrix} x_p(k+1) \\ x_g(k+1) \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} \frac{1}{2} & \frac{1}{2} \\ -\frac{1}{2} & 1 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} x_p(k) \\ x_g(k) \end{bmatrix} + \begin{bmatrix} 0 \\ 1 \end{bmatrix} u + w(k)$$

$$\begin{bmatrix} x_{\rho}(k+1) \\ x_{g}(k+1) \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} \frac{1}{2} & \frac{1}{2} \\ -\frac{1}{2} & 1 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} x_{\rho}(k) \\ x_{g}(k) \end{bmatrix} + \begin{bmatrix} 0 \\ 1 \end{bmatrix} u + w(k)$$
$$y(k) = \begin{bmatrix} 1 & 0 \\ 0 & 1 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} x_{\rho}(k) \\ x_{g}(k) \end{bmatrix} + \nu(k)$$

$$\begin{bmatrix} x_p(k+1) \\ x_g(k+1) \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} \frac{1}{2} & \frac{1}{2} \\ -\frac{1}{2} & 1 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} x_p(k) \\ x_g(k) \end{bmatrix} + \begin{bmatrix} 0 \\ 1 \end{bmatrix} u + w(k)$$
$$y(k) = \begin{bmatrix} 1 & 0 \\ 0 & 1 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} x_p(k) \\ x_g(k) \end{bmatrix} + \nu(k)$$
$$w(k) \sim N(0, l)$$

$$\begin{bmatrix} x_p(k+1) \\ x_g(k+1) \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} \frac{1}{2} & \frac{1}{2} \\ -\frac{1}{2} & 1 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} x_p(k) \\ x_g(k) \end{bmatrix} + \begin{bmatrix} 0 \\ 1 \end{bmatrix} u + w(k)$$

$$y(k) = \begin{bmatrix} 1 & 0 \\ 0 & 1 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} x_p(k) \\ x_g(k) \end{bmatrix} + \nu(k)$$

$$w(k) \sim N(0, I)$$

$$\nu(k) \sim N\left(0, \begin{bmatrix} 0 & 0 \\ 0 & 1 \end{bmatrix}\right)$$

# Zadatak b)

#### Primjer

b) (2 boda) U početnom trenutku imamo točan broj pirana i ribica  $(x_{p0} \text{ i } x_{g0})$ . Kalmanovim filtrom estimiramo populaciju ribica. Koliko iznosi varijanca estimiranog broja ribica nakon 2 tjedna?

# Zadatak b)

### Primjer

b) (2 boda) U početnom trenutku imamo točan broj pirana i ribica  $(x_{p0} \text{ i} x_{g0})$ . Kalmanovim filtrom estimiramo populaciju ribica. Koliko iznosi varijanca estimiranog broja ribica nakon 2 tjedna?

$$P_0^+ = \begin{bmatrix} 0 & 0 \\ 0 & 0 \end{bmatrix}$$

# Zadatak b)

### Primjer

b) (2 boda) U početnom trenutku imamo točan broj pirana i ribica  $(x_{p0} \text{ i} x_{g0})$ . Kalmanovim filtrom estimiramo populaciju ribica. Koliko iznosi varijanca estimiranog broja ribica nakon 2 tjedna?

$$P_0^+ = \begin{bmatrix} 0 & 0 \\ 0 & 0 \end{bmatrix}$$

$$P_1^- = \Phi P_0^+ \Phi^T + Q = \begin{bmatrix} 1 & 0 \\ 0 & 1 \end{bmatrix}$$

# Zadatak b) - nastavak

## Zadatak b) - nastavak

$$K_1 = P_1^- H^T (HP_1^- H^T + R)^{-1} \approx \begin{bmatrix} 1 & 0 \\ 0 & \frac{1}{2} \end{bmatrix}$$

# Zadatak b) - nastavak

$$K_{1} = P_{1}^{-}H^{T}(HP_{1}^{-}H^{T} + R)^{-1} \approx \begin{bmatrix} 1 & 0 \\ 0 & \frac{1}{2} \end{bmatrix}$$
$$P_{1}^{+} = (I - K_{1}H)P_{1}^{-} \approx \begin{bmatrix} 0 & 0 \\ 0 & \frac{1}{2} \end{bmatrix}$$

### Primjer

### Primjer

$$x_p(k+1) = \frac{1}{2}x_p(k) + \frac{1}{2}x_g(k)$$

### Primjer

$$x_p = \frac{1}{2}x_p + \frac{1}{2}x_g$$

### Primjer

$$x_p = \frac{1}{2}x_p + \frac{1}{2}x_g$$

$$\frac{1}{2}x_p = \frac{1}{2}x_g$$

### Primjer

$$x_p = \frac{1}{2}x_p + \frac{1}{2}x_g$$

$$x_p = x_g$$

### Primjer

$$x_p = \frac{1}{2}x_p + \frac{1}{2}x_g$$

$$x_p = x_g$$

$$x_g(k+1) = -\frac{1}{2}x_p(k) + x_g(k) + u(k)$$

### Primjer

$$x_{p} = \frac{1}{2}x_{p} + \frac{1}{2}x_{g}$$

$$x_{p} = x_{g}$$

$$x_{g} = -\frac{1}{2}x_{p} + x_{g} + u$$

### Primjer

$$x_{p} = \frac{1}{2}x_{p} + \frac{1}{2}x_{g}$$

$$x_{p} = x_{g}$$

$$x_{g} = -\frac{1}{2}x_{p} + x_{g} + u$$

$$x_{p} = 2u$$