



TTK 4115/SIE3015 - Linear Systems

Løsningsforslag til eksamen 5. Des, 2003

Oppgave 1

a)(5%) Styrbarhetsmatrisen er gitt ved:

$$\mathcal{C} = [\mathbf{B} \quad \mathbf{AB}] = \begin{bmatrix} 1 & 1 \\ \alpha & -1 + 2\alpha \end{bmatrix} \quad (1)$$

For at systemet skal være styrbart må vektorene være lineært uavhengige. Krever da $\alpha \neq -1 + 2\alpha \Rightarrow \alpha \neq 1$. Ekvivalent er å regne ut determinanten og kreve den ulik 0.

b)(5%) Det karakteristiske polynomet blir:

$$(s + 2 - i)(s + 2 + i) = s^2 + (2 + i)s + (2 - i)s + (2 + i)(2 - i) = s^2 + 4s + 5 \quad (2)$$

Systemmatrisen med tilstandstilbakekoplingen blir:

$$\tilde{\mathbf{A}} = \mathbf{A} - \mathbf{BK} = \begin{bmatrix} 1 - k_1 & -k_2 \\ -1 + 4k_1 & 2 + 4k_2 \end{bmatrix} \quad (3)$$

Regner så ut det karakteristiske polynomet til $\tilde{\mathbf{A}}$:

$$\begin{aligned} \det(s\mathbf{I} - \tilde{\mathbf{A}}) &= (s - 1 + k_1)(s - 2 - 4k_2) - k_2(1 - 4k_1) & (4) \\ &= s^2 + (-1 + k_1)s + (-2 - 4k_2)s + (-1 + k_1)(-2 - 4k_2) - k_2(1 - 4k_1) \\ &= s^2 + (-3 + k_1 - 4k_2)s + 2 - 2k_1 + 3k_2 \Rightarrow \\ -3 + k_1 - 4k_2 &= 4 \Rightarrow k_1 = 7 + 4k_2 \\ 2 + 3k_2 - 2k_1 &= 5 \Rightarrow k_2 = -\frac{17}{5} \Rightarrow k_1 = -\frac{33}{5} \end{aligned}$$

Oppgave 2

a)(5%) Definisjonen på egenverdier og egenvektorer er:

$$\mathbf{A}\mathbf{x}_i = \lambda_i\mathbf{x}_i \quad (5)$$

hvor λ_i er egenverdien og \mathbf{x}_i er tilhørende egenvektor.

Vi kan da skrive $\mathbf{A}\mathbf{Q}$ som:

$$\begin{aligned} \mathbf{A}\mathbf{Q} &= \mathbf{A} \begin{bmatrix} | & | & \dots & | \\ \mathbf{x}_1 & \mathbf{x}_2 & \dots & \mathbf{x}_n \\ | & | & & | \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} | & | & \dots & | \\ \lambda_1\mathbf{x}_1 & \lambda_2\mathbf{x}_2 & \dots & \lambda_n\mathbf{x}_n \\ | & | & & | \end{bmatrix} \\ &= \begin{bmatrix} | & | & \dots & | \\ \mathbf{x}_1 & \mathbf{x}_2 & \dots & \mathbf{x}_n \\ | & | & & | \end{bmatrix} \begin{bmatrix} \lambda_1 & & & \\ & \lambda_2 & & \\ & & \ddots & \\ & & & \lambda_n \end{bmatrix} = \mathbf{Q}\bar{\mathbf{A}} \end{aligned} \quad (6)$$

Som ved å post multiplisere med \mathbf{Q}^{-1} gir oss

$$\mathbf{A} = \mathbf{Q}\bar{\mathbf{A}}\mathbf{Q}^{-1} \quad (7)$$

Altså, \mathbf{Q} er en matrise med egenvektorene som kolonner og $\bar{\mathbf{A}}$ er en matrise med tilhørende egenverdier på diagonalen.

b)(3%) For at \mathbf{A} skal være diagonaliserbar må det eksistere n lineært uavhengige egenvektorer slik at \mathbf{Q} er inverterbar.

c)(4%) Systemet $\dot{\mathbf{x}} = \mathbf{A}\mathbf{x}$ er stabilt hvis og bare hvis $Re[\lambda_i(\mathbf{A})] \leq 0$, $\forall i$ og alle egenverdier med realverdi lik null er enkle røtter i det minimale polynomet av \mathbf{A} .

Ekvivalent er: Systemet $\dot{\mathbf{x}} = \mathbf{A}\mathbf{x}$ er stabilt hvis og bare hvis $Re[\lambda_i(\mathbf{A})] \leq 0$, $\forall i$ og for alle egenverdier med realverdi lik null og algebraisk multiplisitet $q_i \geq 2$, $rank(\mathbf{A} - \lambda_i) = n - q_i$, hvor n er dimensjonen til \mathbf{x} .

Ekvivalent er: Jordan blokk argumenter, se side 130 i Chen.

d)(3%) Systemet $\dot{\mathbf{x}} = \mathbf{A}\mathbf{x}$ er asymptotisk stabilt hvis og bare hvis $Re[\lambda_i(\mathbf{A})] < 0$, $\forall i$.

e)(5%) La $\mathbf{M} = \mathbf{M}^T$ siden det er en av betingelsene i teorem 5.5 i chen. Vi har ligningen:

$$\begin{bmatrix} -1 & 2 \\ 1 & 3 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} m_{11} & m_{12} \\ m_{12} & m_{22} \end{bmatrix} + \begin{bmatrix} m_{11} & m_{12} \\ m_{12} & m_{22} \end{bmatrix} \begin{bmatrix} -1 & 1 \\ 2 & 3 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} -1 & 0 \\ 0 & -1 \end{bmatrix} \quad (8)$$

Dette gir oss 3 likninger med 3 ukjente:

$$\begin{aligned} -2m_{11} + 4m_{12} &= -1 \\ 2m_{12} + 2m_{22} + m_{11} &= 0 \\ 2m_{12} + 6m_{22} &= -1 \Rightarrow \\ m_{11} &= \frac{1}{2} + 2m_{12} \\ m_{22} &= -\frac{1}{6} - \frac{1}{3}m_{12} \Rightarrow \\ 2m_{12} + 2m_{22} + m_{11} &= 2m_{12} + 2\left(-\frac{1}{6} - \frac{1}{3}m_{12}\right) + \frac{1}{2} + 2m_{12} = 0 \Rightarrow \\ m_{12} &= -\frac{1}{20} \Rightarrow m_{11} = \frac{4}{10} \Rightarrow m_{22} = -\frac{3}{20} \end{aligned} \quad (9)$$

\mathbf{M} blir altså:

$$\mathbf{M} = \begin{bmatrix} 0.4 & -0.05 \\ -0.05 & -0.15 \end{bmatrix} \quad (10)$$

Dersom matrisen \mathbf{M} er positiv definit er alle egenverdiene til \mathbf{A} i venstre halvplan.

Hver og en av de 4 følgende tester er nødvendig og tilstrekkelig for at en matrise er p.d.:

1. $\mathbf{x}^T \mathbf{M} \mathbf{x} > 0, \forall \mathbf{x} \neq 0$
2. $\lambda_i(\mathbf{M}) > 0, \forall i$
3. Alle øvre submatriser \mathbf{M}_k har positive determinanter
4. Alle pivot elementene, uten rad bytter, er positive.

Determinanten til \mathbf{M} er ikke positiv og matrisen er ikke p.d. i følge punkt 3. Systemet er da ikke asymptotisk stabilt.

f)(5%) Mange fremgangsmåter, men to mulige er:

1. La $e^{\mathbf{A}t} = \mathbf{M} e^{\bar{\mathbf{A}}t} \mathbf{M}^{-1}$ hvor \mathbf{M} og $\bar{\mathbf{A}}$ er definert som i a)
2. $e^{\mathbf{A}t} = \mathcal{L}^{-1} \{ (s\mathbf{I} - \mathbf{A})^{-1} \}$

Metode 1: Finner først egenverdiene til å bli: $\lambda_1 = -1.4495$ og $\lambda_2 = 3.4495$.

Tilhørende egenvektorer blir:

$$\mathbf{m}_1 = \begin{bmatrix} -0.9757 \\ 0.2193 \end{bmatrix}, \quad \mathbf{m}_2 = \begin{bmatrix} -0.4100 \\ -0.9121 \end{bmatrix} \quad (11)$$

Dette gir oss:

$$e^{\mathbf{A}t} = \begin{bmatrix} 0.91 \cdot e^{-1.4495 \cdot t} + 0.09 \cdot e^{3.4495 \cdot t} & 0.41 \cdot e^{3.4495 \cdot t} - 0.41 \cdot e^{-1.4495 \cdot t} \\ 0.20 \cdot e^{3.4495 \cdot t} - 0.20 \cdot e^{-1.4495 \cdot t} & 0.09 \cdot e^{-1.4495 \cdot t} + 0.91 \cdot e^{3.4495 \cdot t} \end{bmatrix} \quad (12)$$

Metode 2:

$$\begin{aligned} e^{\mathbf{A}t} &= \mathcal{L}^{-1} \left\{ \begin{bmatrix} \frac{s-3}{s^2-2s-5} & \frac{2}{s^2-2s-5} \\ \frac{1}{s^2-2s-5} & \frac{s+1}{s^2-2s-5} \end{bmatrix} \right\} \\ &= \begin{bmatrix} 0.91 \cdot e^{-1.4495 \cdot t} + 0.09 \cdot e^{3.4495 \cdot t} & 0.41 \cdot e^{3.4495 \cdot t} - 0.41 \cdot e^{-1.4495 \cdot t} \\ 0.20 \cdot e^{3.4495 \cdot t} - 0.20 \cdot e^{-1.4495 \cdot t} & 0.09 \cdot e^{-1.4495 \cdot t} + 0.91 \cdot e^{3.4495 \cdot t} \end{bmatrix} \end{aligned} \quad (13)$$

Oppgave 3

a)(4%) En minimal realisasjon på formen

$$\dot{\mathbf{x}} = \mathbf{A}\mathbf{x} + \mathbf{B}\mathbf{u}, \quad \mathbf{y} = \mathbf{C}\mathbf{x} + \mathbf{D}\mathbf{u} \quad (14)$$

har følgende egenskaper:

1. Det er ikke mulig å representere systemet ved bruk av færre tilstandsvariable.
2. (\mathbf{A}, \mathbf{B}) er et styrbart par.
3. (\mathbf{A}, \mathbf{C}) er et observerbart par.
4. Ekvivalent til de to foregående punktene er $\dim(\mathbf{A}) = \deg(\mathbf{G}(s))$

b)(5%) En transferfunksjon $G(s)$ er realiserbar hvis og bare hvis $G(s)$ er en rasjonal proper matrise. I vårt tilfellet er graden i nevneren lik 2 og i telleren lik 1, funksjonen er strengt proper og dermed realiserbar. (Teorem 4.2 i Chen)

c)(6%) Vi må splitte $\mathbf{G}(s)$ slik at $\mathbf{G}(s) = \mathbf{G}_{sp}(s) + \mathbf{G}(\infty)$. Vi ser at element 1 er en strengt proper transferfunksjon. Element 2 derimot, må deles. Det er enkelt å

se at $G_2(\infty) = \frac{1}{2}$. Videre setter vi opp:

$$\begin{aligned} G_2(s) &= G_{2sp} + G_2(\infty) \Rightarrow \\ \frac{1+s}{1+2s} &= \frac{\alpha}{1+2s} + \frac{1}{2} = \frac{s + \frac{1}{2} + \alpha}{1+2s} \Rightarrow \\ 1+s &= \frac{1}{2} + \alpha + s \Rightarrow \\ \alpha &= \frac{1}{2} \end{aligned} \quad (15)$$

Vi setter videre opp uttrykket for $\mathbf{G}(s)$ og bruker formelene i vedlegget til å sette opp tilstandsrommet, $\dot{\mathbf{x}} = \mathbf{A}\mathbf{x} + \mathbf{B}\mathbf{u}$, $y = \mathbf{C}\mathbf{x} + \mathbf{D}\mathbf{u}$:

$$\begin{aligned} \mathbf{G}(s) &= \begin{bmatrix} 0 & \frac{1}{2} \end{bmatrix} + \left[-\frac{2}{4s^2+4s+1} \quad \frac{1}{2(1+2s)} \right] \\ &= \begin{bmatrix} 0 & \frac{1}{2} \end{bmatrix} + \frac{1}{4s^2+4s+1} \begin{bmatrix} -2 & 0.5(1+2s) \end{bmatrix} \\ &= \begin{bmatrix} 0 & \frac{1}{2} \end{bmatrix} + \frac{1}{s^2+s+1} \left[[0 \quad 0.25]s + [-0.5 \quad 0.125] \right] \Rightarrow \\ \mathbf{A} &= \begin{bmatrix} -1 & 0 & -0.25 & 0 \\ 0 & -1 & 0 & -0.25 \\ 1 & 0 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & 0 & 0 \end{bmatrix}, \quad \mathbf{B} = \begin{bmatrix} 1 & 0 \\ 0 & 1 \\ 0 & 0 \\ 0 & 0 \end{bmatrix}, \\ \mathbf{C} &= [0 \quad 0.25 \quad -0.5 \quad 0.125], \quad \text{and} \quad \mathbf{D} = [0 \quad 0.5] \end{aligned} \quad (16)$$

En kan også sette opp en 3'de ordens realisasjon:

$$\begin{aligned} \mathbf{A} &= \begin{bmatrix} -1 & -0.25 & 0 \\ 1 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & -0.25 \end{bmatrix}, \quad \mathbf{B} = \begin{bmatrix} 1 & 0 \\ 0 & 0 \\ 0 & 1 \end{bmatrix}, \\ \mathbf{C} &= [0 \quad -0.5 \quad 0.25] \quad \text{and} \quad \mathbf{D} = [0 \quad 0.5] \end{aligned} \quad (17)$$

Oppgave 4

a)(4%) Dette er en åpen søyfe tilstandsestimator. Estimatoren bruker ikke utgangen til å korrigere estimer som er feil for eksempel pga av modellfeil. For å få nogenlunde tilfredstillende estimer fra denne fremgangsmåten må modellen være svært nøyaktig. Legg også merke til at initialtilstandene i den faktiske prosessen og estimatoren må være like.

b)(4%) Her brukes utgangen som et direkte estimat av tilstanden. Vi vil altså la støyen ha udempet effekt på estimatet. Dette kan sees fra transferfunksjonen fra

støy til estimat.

$$\frac{\hat{x}}{w}(s) = 1 \quad (18)$$

c)(6%) Vi skriver systemet som

$$\begin{aligned} \dot{\hat{x}} &= (a - l)\hat{x} + bu + l(x + w) \Rightarrow \\ \hat{x} &= \frac{1}{s - a + l}(bu + lx + lw) \end{aligned} \quad (19)$$

Ved hjelp av superposisjon får vi:

$$\frac{\hat{x}}{w}(s) = \frac{l}{s - a + l} = \frac{8}{s + 10} \quad (20)$$

d)(6%) Vi sammenligner først estimatoren i a) med den i c):

- c) bruker utgangen y til å korrigere estimatet slik at estimatet blir mindre følsomt for modellfeil enn i a).
- I c) vil estimatet svinge seg inn til korrekt verdi selv om initialtilstandene er forskjellige.
- I a) vil den ukjente forstyrrelsen v føre til at estimatet raskt avviker fra virkelige verider.
- En teoretisk fordel med a) til fordel for c) er at hvis modellen er perfekt og initialtilstanden kjent, vil ikke målestøyen ha noen innvirkning på estimatet, men dette er svært sjelden/aldri tilfellet.

Vi ser så på estimatoren i b) sammenlignet med den i c):

- Vi ser av transferfunksjonen fra støyen til estimatet at støyen blir lavpass filtret i c). Dette er en fordel siden støy som regel er høyfrekvent.
- Lavfrekvent støy vil dempes i c) ($\frac{\hat{x}}{w}(0) = \frac{8}{10}$) mot enhetsforsterkning i b).
- En teoretisk fordel med b) fremfor c) er at hvis støyen er neglisjerbar, vil vi ikke ha noen dynamikk mellom mellom virkelig og estimert verdi, og derfor ha et bedre estimat.
- (Kreves ikke) Utfall av målinger i b) vil ikke gi oss noe estimat av tilstanden, men i c) kan l settes lik null og estimatoren kan kjøre en bergrenset periode som åpen sløyfe estimator.

Oppgave 5

a) (4%) Ligningene for kontinuerlig Kalman-filter er gitt i formelsamlingen. Vi må da definere matrisene som inngår i filteret: $\mathbf{F} = -0.4$, $\mathbf{B} = 0.1$, $\mathbf{H} = 1$, \mathbf{Q} er gitt, og $\mathbf{R}' = 0.01\mathbf{R}$, $\mathbf{G} = 1$ Ekstra informasjon som trengs er $\mathbf{x}(0)$ og $\mathbf{P}(0)$.

b) (3%) Når \mathbf{Q} økes øker forsterkningen.

c) (3%) Ingenting skjer med forsterkningen.

d) (5%) Faktorisering av spektraltettheten gir:

$$G(s) = \frac{1}{s+1}$$

Hvitstøy gjennom dette filteret gir derfor den ønskede spektraltettheten. Vi vil nå augmentere ligningene for å ta hensyn til modelleringen av den fargede støyprosessen. Ligningene blir nå:

$$\begin{aligned} \begin{bmatrix} \dot{x}_1 \\ \dot{x}_2 \end{bmatrix} &= \underbrace{\begin{bmatrix} 1 & 0 \\ 0 & -1 \end{bmatrix}}_{\mathbf{F}} \begin{bmatrix} x_1 \\ x_2 \end{bmatrix} + \underbrace{\begin{bmatrix} 0.1 \\ 0 \end{bmatrix}}_{\mathbf{B}} u_d + \underbrace{\begin{bmatrix} 1 & 0 \\ 0 & 1 \end{bmatrix}}_{\mathbf{G}} \begin{bmatrix} u \\ w \end{bmatrix} \\ y &= \underbrace{\begin{bmatrix} 1 & 0.1 \end{bmatrix}}_{\mathbf{H}} \begin{bmatrix} x_1 \\ x_2 \end{bmatrix}, \quad R = 0, \quad \mathbf{Q} = \begin{bmatrix} Q & 0 \\ 0 & 1 \end{bmatrix} \end{aligned}$$

Har man kommet hit vil man få hele oppgaven riktig. Legg likevel merke til at $R = 0$. En må da enten legge til en kunstig målestøy slik at R ikke er singulær eller kjøre en lineær transformasjon på systemet slik at utgangen vil inneholde w .

Oppgave 6

a) (4%) Et normalfordelt hvitstøy signal med middelferdi 0 og varians 1 har følgende autokorrelasjonsfunksjon og effektspekter.

$$\begin{aligned} R_w(\tau) &= \delta(\tau) \\ S_w(s) &= 1 \end{aligned} \tag{21}$$

b) (6%) For å finne effektspekteret gjør vi som på side 130 i H&B:

$$\begin{aligned}
 S_v(s) &= G(s)G(-s)S_w(s) = \frac{K}{1+Ts} \cdot \frac{K}{1+T(-s)} \cdot 1 \\
 &= \frac{K^2}{1-T^2s^2} = \frac{\left(\frac{K}{T}\right)^2}{-s^2 + \left(\frac{1}{T}\right)^2} \Rightarrow \\
 S_v(j\omega) &= \frac{\left(\frac{K}{T}\right)^2}{\omega^2 + \left(\frac{1}{T}\right)^2}
 \end{aligned} \tag{22}$$

Vi finner den inverse laplace transformen til transferfunksjonen

$$g(t) = \frac{K}{T}e^{-\frac{t}{T}} \tag{23}$$

Autokorrelasjonsfunksjonen er gitt ved følgende uttrykk der vi har antatt $t_2 > t_1$ og brukt at $z = y + t_2 - t_1 = y + \tau$ (for at diracen skal bli lik 1) :

$$\begin{aligned}
 R_v(t_1, t_2) &= \int_0^{t_1} \int_0^{t_2} g(y)g(z)R_w(y-z+t_2-t_1)dydz \\
 &= \frac{K^2}{T^2} \int_0^{t_1} \int_0^{t_2} e^{-\frac{y}{T}} e^{-\frac{z}{T}} \delta(y-z+t_2-t_1)dydz \\
 &= \frac{K^2}{T^2} \int_0^{t_1} e^{-\frac{y}{T}} e^{-\frac{y-\tau}{T}} dy \\
 &= \frac{K^2}{T^2} e^{-\frac{\tau}{T}} \int_0^{t_1} e^{-\frac{2y}{T}} dy = -\frac{K^2}{2T} e^{-\frac{\tau}{T}} \left(e^{-\frac{2t_1}{T}} - 1 \right)
 \end{aligned} \tag{24}$$

Vi får tilsvarende svar for $t_1 > t_2$ og uttrykket for autokorrelasjonen dersom vi ikke har antatt at V er stasjonær er gitt ved:

$$R_v(t_1, t_2) = \begin{cases} -\frac{K^2}{2T} e^{-\frac{\tau}{T}} \left(e^{-\frac{2t_1}{T}} - 1 \right) & t_2 \geq t_1 \\ -\frac{K^2}{2T} e^{-\frac{\tau}{T}} \left(e^{-\frac{2t_2}{T}} - 1 \right) & t_2 < t_1 \end{cases} \tag{25}$$

Siden vi vet at V er stasjonær kan vi la $t_1, t_2 \rightarrow \infty$ og få følgende uttrykk for autokorrelasjonen:

$$R_v(\tau) = \frac{K^2}{2T} e^{-\frac{\tau}{T}} \tag{26}$$

Dette er i overenstemmelse med at mean square verdien til V er:

$$E[v(t)v(t)] = \frac{K^2}{2T} \tag{27}$$

c) (5%) Grafen knekker ved ca $8Hz = 50.3 \text{ rad/s}$. Fra uttrykket kan vi da regne ut T

$$T = \frac{1}{\sqrt{\omega^2}} = \frac{1}{50.3} \approx 0.02 \quad (28)$$

K kan finnes fra uttrykket ved å sette $\omega = 0$ slik at $K \approx \sqrt{10}$.

Oppgave 5 og 6 for SIE3015-vesjonen

Oppgave 5

a) Transfer funksjonen i s-planet blir:

$$H(s) = K_p \frac{1 - e^{-Ts}}{s} \cdot \frac{1 + T_i s}{T_i s} \quad (29)$$

$H(z)$ er gitt av \mathcal{Z} -transformen:

$$\begin{aligned} H(z) &= \mathcal{Z} \left\{ K_p (1 - e^{-Ts}) \frac{1 + T_i s}{T_i s^2} \right\} \\ &= K_p (1 - z^{-1}) \mathcal{Z} \left\{ \frac{1}{T_i s^2} + \frac{1}{s} \right\} \\ &= K_p (1 - z^{-1}) \left(\frac{1}{T_i} \cdot \frac{T z^{-1}}{(1 - z^{-1})^2} + \frac{1}{1 - z^{-1}} \right) \\ &= K_p + \frac{K_p}{T_i} \cdot \frac{T z^{-1}}{(1 - z^{-1})} = \frac{K_p (T_i - T_i z^{-1}) + T z^{-1}}{T_i (1 - z^{-1})} \\ &= K_p \frac{T_i + (T - T_i) z^{-1}}{T_i (1 - z^{-1})} \end{aligned} \quad (30)$$

b) Algoritmen blir:

$$u(k) = u(k-1) + K_p e(k) + K_p \left(\frac{T}{T_i} - 1 \right) e(k-1) \quad (31)$$

Oppgave 6

a) Frekvensresponsen $H(j\omega)$ er gitt ved:

$$H(j\omega) = \frac{1}{4} + \frac{1}{2} e^{-j\omega h} + \frac{1}{4} e^{-2j\omega h} \quad (32)$$

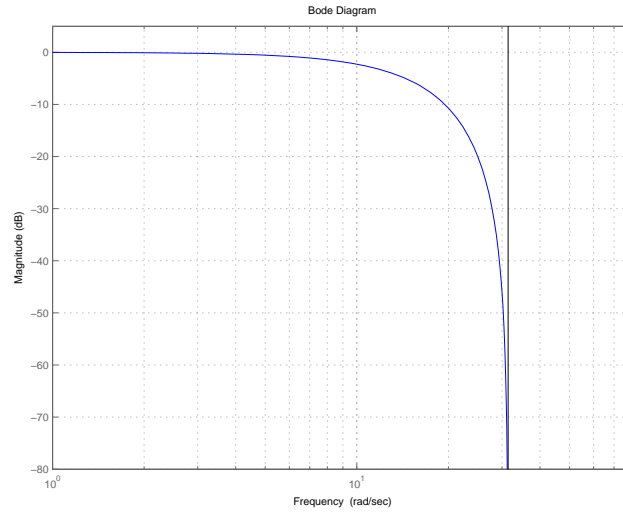


Figure 1: Frekvensrespons

b) Impulseresponsen er gitt av den inverse z-transformen:

$$h(k) = \frac{1}{4} \mathcal{Z}^{-1} \{1 + 2z^{-1} + z^{-2}\} = \frac{1}{4} (\delta(k) + 2\delta(k-1) + \delta(k-2)) \quad (33)$$

$h(0)=0.25$, $h(1)=0.5$, $h(2)=0.25$, $h(k>2)=0$.

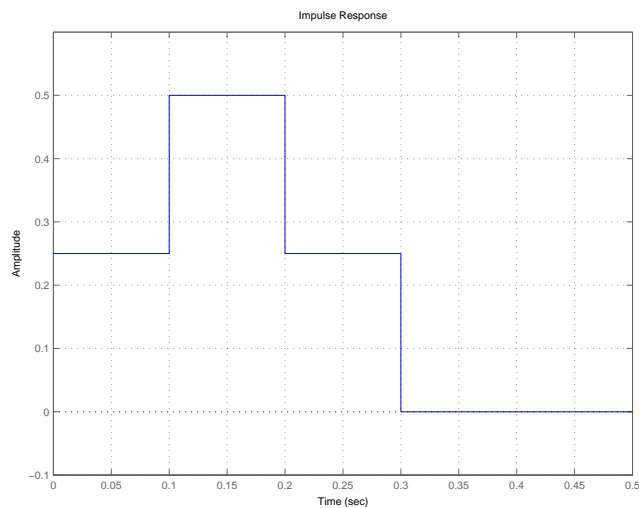


Figure 2: Impulsrespons

c) Transferfunksjonen er gitt ved:

$$H(z) = \frac{1}{4} \left(\frac{z^2 + 2z + 1}{z^2} \right) \quad (34)$$

Proper transferfunksjon og dobbel pol i origo gir stabilitet.

Dobbelt nullpunkt i -1