МИНИСТЕРСТВО ОБРАЗОВАНИЯ И НАУКИ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ

Московский Государственный Университет им. М.В.Ломоносова

Факультет вычислительной математики и кибернетики

Кафедра системного анализа

Магистерская программа по направлению

Математические модели сложных систем: теория, алгоритмы, приложения

Магистерская диссертация на тему

Построение множества достижимости для гибридной системы с одним переключением с неопределенностью

Выполнил:

Селиверстов Д.С.

Научный руководитель:

к.ф-м.н. Точилин П.А.

2010

Файл annotation.tex:

Аннотация

Данная магистерская диссертация посвящена решению одной из классических задач теории управления для нового класса сложных, нелинейных систем. А именно, решается задача построения множества достижимости для гибридной системы с одним переключением, с неопределенностью в дифференциальных уравнениях. В работе рассмотрена модель гибридной динамической системы, состоящая из двух систем линейных обыкновенных дифференциальных уравнений и условия переключения между ними. Задача состоит в построении и аппроксимации множества всех траекторий этой гибридной системы в конечный момент времени, в которые гарантированно можно попасть, выбрав соответствующее управление, вне зависимости от реализации помехи.

В диссертации получено решение поставленной задачи с привлечением аппарата выпуклого анализа, при помощи сопряженных функций и функций цены минимаксного типа. Множество достижимости представлено в виде объединения множеств уровня (множеств Лебега) для специальных функций. Рассмотрено решение задачи методами многозначного анализа. Этот подход позволяет явно построить искомое множество достижимости посредством операций над выпуклыми, компактными множествами. В работе 16 страниц, 2 иллюстраций.

Содержание

Файл intro.tex:

1. Введение.

В данной работе рассматривается математическая модель гибридной системы, состоящей из двух систем обыкновенных дифференциальных уравнений с управляющими параметрами и помехами, а также из условия замены одной системы на другую. Траектория такой системы развивается в каждый момент времени в силу одной из двух систем дифференциальных уравнений. При достижении определенной гиперплоскости в фазовом пространстве происходит обязательная смена активной системы уравнений — так называемое переключение траектории гибридной системы [3]. Рассматриваемые системы обыкновенных дифференциальных уравнений являются линейными по фазовым переменных, а также по управляющим параметрам и помехам. Однако, в целом система нелинейна. Похожие модели гибридных систем активно исследуются в последние годы (см. например, [6], [11], [10]), для них актуальны многие классические задачи управления, такие как задачи достижимости, верификации, синтеза управления в условиях реально доступной информации и др. Особенно важны задачи, в которых учитываются неопределенности, помехи, которые могут быть связаны как с ошибками математического моделирования, так и с заранее неизвестными воздействиями на систему.

В данной работе для гибридной системы решается задача построения множества достижимости "минимаксного типа" в классе программных управлений. То есть необходимо построить множество всех позиций системы, в которые можно попасть за счет применения программных управлений, несмотря на наличие в системе заранее неизвестных помех. Для действующих в системе помех известны лишь по-точечные ограничения. Решение данной задачи можно рассматривать как первый шаг к построению теории достижимости при неопределенности для гибридных систем с кусочно-линейной структурой в классах программных или позиционных управлений.

Поскольку рассматриваемые дифференциальные уравнения линейны по фазовым переменным, управляениям и помехам, то для решения поставленной задачи целесообразно использовать аппарат сопряженных функций и другие методы выпуклого анализа [4], [5]. Кроме того, для аппроксимации множеств достижимости возможно использование методов эллипсоидального исчисления [9], [8]. В данной работе рассматриваеся два подхода к решению задачи достижимости: 1) при помощи функций цены и методов выпуклого анализа, а также 2) при помощи методов многозначного анализа. В первом случае множества достижимости представлены в виде множеств уровней (множеств Лебега) для специальных функций, а во втором методе указанные множества построены в явном виде, за счет применения операций с выпуклыми компактами.

Файл postanovka.tex:

2. Постановка задачи

Рассматриваются две взаимосвязанные системы линейных обыкновенных дифференциальных уравнений, описывающих состояние некоторой модели до переключения (смены системы дифференциальных уравнений) и после:

$$\begin{cases} \left[\begin{array}{l} \begin{cases} \dot{x}^{(1)} = A^{(1)}(t)x^{(1)} + B^{(1)}(t)u^{(1)}(t) + C^{(1)}(t)v^{(1)}(t); \\ x(t_0) \in \mathcal{E}(x_0, X_0) = \mathcal{X}_0; \end{cases} \\ \begin{cases} \dot{x}^{(2)} = A^{(2)}(t)x^{(2)} + B^{(2)}(t)u^{(2)}(t) + C^{(2)}(t)v^{(2)}(t); \\ x(\tau) \in \mathcal{X}^{(1)}(\tau, t_0) \cap H; \end{cases} \end{array} \right. \\ H = \{x \in \mathbb{R}^n \colon \langle x, c\rangle = \gamma\} \text{— гиперплоскость переключения;} \\ A(t) \in \mathbb{R}^{n\times n},\ B(t) \in \mathbb{R}^{n\times m},\ C(t) \in \mathbb{R}^{n\times k};\ A(t), B(t), C(t) \in L_1[t_0, t_1]; \\ \tau :\ \langle x^{(1)}(\tau), c\rangle - \gamma = 0,\ \tau \in [t_0, t_1] \\ u^{(1)}(t) \in \mathcal{E}(p^{(1)}(t), P^{(1)}(t)) = \mathcal{P}^{(1)}[t_0, t_1]; \\ v^{(1)}(t) \in \mathcal{E}(w^{(1)}(t), W^{(1)}(t)) = \mathcal{V}^{(1)}[t_0, t_1]; \\ u^{(2)}(t) \in \mathcal{E}(p^{(2)}(t), P^{(2)}(t)) = \mathcal{P}^{(2)}[t_0, t_1]; \\ v^{(2)}(t) \in \mathcal{E}(w^{(2)}(t), W^{(2)}(t)) = \mathcal{V}^{(2)}[t_0, t_1]; \end{cases} \tag{2.1}$$

где $\mathcal{P}^{(1,2)}[t_0, t_1], \mathcal{V}^{(1,2)}[t_0, t_1]$ - кусочно-непрерывные эллипсоидальнозначные отображения. В неизвестный заранее момент времени τ, при пересечении наперед известной гиперплоскости $H = \{x \in \mathbb{R}^n \colon \langle x, c\rangle = \gamma\}$, происходит переключение с первой системы на вторую. $v^{(i)}(t)$ - неизвестная функция, неопределенность, область значений которой в каждый момент t ограничена k-мерной эллипсоидальной областью $\mathcal{V}^{(i)}(t)$, и принадлежащая классу интегрируемых функций $L_1[t_0, t_1]$. Управление $(u^{(1)}(\cdot), u^{(2)}(\cdot))$ – интегрируемые в $L_1[t_0, t_2]$ функции, ограниченные в каждый момент t эллипсоидальными областями $u^{(1)}(t) \in \mathcal{P}^{(1)}(t)$,$u^{(2)}(t) \in \mathcal{P}^{(2)}(t)$. Оно выбирается из класса программных управлений то есть так, что оно определяется к начальному моменту t_0 заранее и уже не изменяется в зависимости от поведения системы в дальнейшем, оно также не зависит от времени переключения τ. Для решения задачи важно, чтобы траектория гибридной системы удовлетворяла условию односторонней проницаемости, то есть чтобы при переходе через плоскость H в момент τ всегда выполнялось

$$\begin{cases} \langle x(\tau), c\rangle - \gamma = 0 \\ \langle x(\tau + \epsilon), c\rangle - \gamma > 0; \end{cases} \tag{2.2}$$

для любого малого $\epsilon > 0$. Это предположение будем считать выполненным как для первой системы $x(t) = x^{(1)}(t)$, так и для второй $x(t) = x^{(2)}(t)$, где $x^{(1)}(t), x^{(t)}(t)$ – фазовые переменные (траектории) системы соответственно до переключения и после. Это означает, что траектория системы может пересекать гиперплоскость переключения только один раз с переходом к другой системе, что также гарантирует связность множеста $\{(x(\tau), \tau) \mid x(\tau) \cap H\}$. Требуется построить множество достижимости $\mathcal{X}[t, t_0]$ в классе допустимых управлений $\mathcal{P}[t_0, t_1]$, в момент времени $t > t_0$, при известном начальном множестве $\mathcal{X}_0$. Таким образом, необходимо найти множество точек $\mathcal{X}[t, t_0, \mathcal{X}_0] = \{x(t)\}$, в которые система может гарантированно прийти из начального множества $\mathcal{X}^0$ за счет выбора соответствующего управления $(u^{(1)}(\cdot), u^{(2)}(\cdot))$ вне зависимости от помехи $(v^{(1)}(\cdot), v^{(2)}(\cdot))$.

Определение 1. *Эллипсоидом* $\mathcal{E}(q,Q)$ *называется множество* $\{x \mid (x-q)^T Q^{-1}(x-q) \le 1\}$, *где* $x, q \in \mathbb{R}^n$,$Q \in \mathbb{R}^{n\times n}$, $Q = Q^T$, Q *– положительно определенная матрица.*

Определение 2. *Множеством достижимости* $\mathcal{X}[t_1, t_0, \mathcal{X}_0]$ *системы линейных дифференциальных уравнений в момент* t_1 *называется*

$$\mathcal{X}[t_1, t_0, \mathcal{X}_0] = \{x_1 \mid \exists u(\cdot) : \ \forall v(\cdot), \exists x_0 \in \mathcal{X}_0 : x(t_1, t_0, x_0) = x_1\},$$

где $x(\cdot, t, x)$ *– траектория системы при фиксированных* $u(\cdot), v(\cdot)$ *и начальном условии* $x(t) = x$. $\mathcal{X}_0$ *– начальное множество в момент времени* t_0.

Определение 3. *Множеством достижимости* $\mathcal{X}[t_1, t_0, \mathcal{X}_0]$ *для гибридной системы* (2.1) *называется*

$$\mathcal{X}[t_1, t_0, \mathcal{X}_0] = \{x_1 \mid \exists u^{(1)}(\cdot) \in \mathcal{P}^{(1)}, u^{(2)}(\cdot) \in \mathcal{P}^{(2)} :$$
$$\forall v^{(1)}(\cdot) \in \mathcal{V}^{(1)}, v^{(2)}(\cdot) \in \mathcal{V}^{(2)} : \exists x_0 \in \mathcal{X}_0 :$$
$$x(t_1, t_0, x_0) = x_1, \exists \tau : x(\tau, t_0, x_0) \cap H \ne \emptyset, t_1 \ge \tau > t_0\},$$

где $x(\tau, t, x_0)$ *– траектория гибридной системы при фиксированном управлении* $u^{(1,2)}$ *и помехе* $v^{(1,2)}$.

Файл teoriya.tex:

3. Теоретическая часть

Поиск множества достижимости непосредственным расчетом каждой траектории ведет к большим вычислительным издержкам. Поэтому разумно прибегнуть к различным методам, которые позволили бы воспользоваться свойствами данной модели, такими как линейность системы уравнений и выпуклость множеств ограничений и начального множества, что позволит сократить количество вычислений с помощью параметризации множеств с помощью вычисления конечномерных функций. Например, можно использовать множества уровней некоторой специальной функции, и по ним однозначно вычислять искомое множество. Другой подход основывается на применении приемов многзначного анализа. Так, если известна опорная функция к выпуклому компактному множеству, то по этой функции можно восстановить все множество. Рассмотрим сначала первый подход.

3.1 Построение множества через функцию цены

Мы будем искать множество достижимости с использованием функции цены, значениями которой будет расстояние выбранной точки $x(t)$ от искомого множества $\mathcal{X}[t, t_0, \mathcal{X}_0]$. Согласно (Опр.3.) нам необходимо найти наиболее подходящее управление, которое позволит сократить до мининмума это расстояние при любой возможной реализации помехи. Для этого используется минимаксный подход, описанный в [2] .

Для поиска множества $\mathcal{X}[t, t_0]$ используется функция цены вида

$$V(t,x) = \min_{u(\cdot)} \max_{v(\cdot)} d^2(x_0 \mid_{x(t)=x}, \mathcal{X}_0)$$

где $d(x_0, \mathcal{X}_0)$ - расстояние между точкой x_0 и множеством $\mathcal{X}_0$, определяемое метрикой $d(x, \mathcal{X}) = \min_{y\in\mathcal{X}} \|x - y\|$. Поясним наш выбор. Мы ищем множество $\mathcal{X}[t, \mathcal{X}_0]$ всех таких точек, что для $\forall x^*(t) \in \mathcal{X}[t, \mathcal{X}_0]$ можно заранее подобрать некоторое управление $u^*(\cdot)$ и некоторое подмножество $\{x^*(t_0)\} \in \mathcal{X}_0$ так, чтобы при любой помехе $v(\cdot)$ гарантировать вхождение $x^*(t) \in \{x(t, u^*(\cdot), \{x^*(t_0)\})\}_{\forall v(\cdot)}$. В рассматриваемой здесь задаче кроме помехи

$v(\cdot)$ появляется другой неизвестный параметр $\tau(u, v)$ – момент переключения, в который меняется динамика системы, что приводит к существенному усложенинию задачи.

Рассмотрим функцию $\phi(x) = d^2(x, \mathcal{X})$,где $\mathcal{X}$ – выпуклый компакт. Тогда $\phi(x))$ – выпуклая, собственная, замкнутая, и тогда операция двойного сопряжения приводит к тождественному результату [4] . Удобно выразить $V(x, t)$ через двойное сопряжение функции расстояния $d^2(x, \mathcal{X}_0)$, что позволит заменить вычисление минимума на множестве в функции расстояния на вычисление максимума функции по n-мерному аргументу.

$$\phi^*(\ell^*) = \sup_x(\langle x, \ell^* \rangle - d^2(x, \mathcal{X}_0)) = \rho(\ell^* \mid \mathcal{X}_0) + \frac{\|\ell^*\|^2}{4},$$
$$\phi^{**}(\ell^{**}) = \sup_{\ell^*} \left(\langle \ell^*, \ell^{**} \rangle - \rho\left(\ell^* \mid \mathcal{X}_0\right) - \frac{\|\ell^*\|^2}{4} \right)$$

Поскольку $\phi(\ell)$ – замкнутая функция, sup достигается и его можно заменить на max , тогда

$$V(t, x) = \min_{u(\cdot)} \max_{v(\cdot)} \max_{\ell} \left(\langle \ell, x_0 \mid_x \rangle - \rho\left(\ell \mid \mathcal{X}_0\right) - \frac{\|\ell^*\|^2}{4} \right). \tag{3.1}$$

Найдем выражения для поиска $x_0 \mid_{x(t_1)=x}$. Пусть траектория точки в момент t_1 известна $x(t_1) = x$. Идя в обратном времени, найдем её значение в момент $\tau \leqslant t \leqslant t_1$ при известных $B(s), C(s), u(s), v(s)$ до переключения:

$$x^{(2)}(t, x, u, v) = G_2(t, t_1)x + \int_{t_1}^{t} G_2(t, s)\left[B_2(s)u_2(s) + C_2(s)v_2(s)\right] ds, \text{при}\, \tau \leqslant t \leqslant t_1,$$

и после для $t_0 \leqslant t \leqslant \tau$:

$$\begin{aligned} x^{(2,1)}(t, \tau, x, u, v) =& G_1(t, \tau)G_2(\tau, t_1)x + G_1(t, \tau) \int_{t_1}^{\tau} G_2(t, s)\left[B_2(s)u_2(s) + C_2(s)v_2(s)\right] ds + \\ &+ \int_{\tau}^{t_0} G_1(t, s)\left[B_1(s)u_1(s) + C_1(s)v_1(s)\right] ds\,,\ \text{при}\, t_0 \leqslant t \leqslant \tau. \end{aligned} \tag{3.2}$$

Нам необходимо, чтобы момент τ в этих выражениях удовлетворял условию на переключение, так чтобы $\langle x(\tau), c \rangle = \gamma$. Поскольку $d^2(x, \mathcal{X}) \geqslant 0$, то $V(x, t) \geqslant 0$. Тогда если $\mathcal{X}[t, t_0] = \{x \mid V(t, x) \leqslant 0\}, \forall t \in [t_0, t_1]$, то достаточно ввести штрафующий член $(\langle x(\tau), c \rangle - \gamma)^2$ в выражение для $V(t, x)$, тем самым обеспечивая для $\mathcal{X}[t, t_0]$ включение только тех траекторий, которые удовлетворяют нашим двум системам и условию на момент переключения.

Так как мы рассматриваем задачу в классе программных управлений, мы не можем строить управление в зависимости от текущего состояния системы, а должны определять его заранее. Поэтому, в формуле для $V(t, x)$ нельзя искать отдельно $\min_{u^{(i)}} \max_{v^{(i)}}$ для каждой из подсистем "до" и "после", так как момент переключения τ не известен заранее. Это означает, что выбираемое управление не может меняться в зависимости от τ. Это описывается выражением

$$V(t, x) = \min_{\substack{u_1 \in \mathcal{P}^1 \\ u_2 \in \mathcal{P}^2}} \max_{\substack{v_1 \in \mathcal{V}^1 \\ v_2 \in \mathcal{V}^2}} \min_{\tau} \left\{ d^2(x_0|_{x(t)=x}, \mathcal{X}_0) + (\langle x(\tau), c \rangle - \gamma)^2 \right\}.$$

Это значит, что искомое множество $\mathcal{X}[t, \mathcal{X}_0]$ в классе программных управлений содержит только те траектории, которые при любой допустимой помехе $v_1(\cdot), v_2(\cdot)$ и при любом τ гарантированно могут попасть на множество $\mathcal{X}[t, \mathcal{X}_0]$ Пока примем $\gamma = 0$. Для линеаризации условия на переключение сделаем подстановку

$$\langle x, c \rangle^2 \equiv \max_{\mu} \left\{ \mu \langle x, c \rangle - \frac{\mu^2}{4} \right\},$$

и, используя (3.1), имеем

$$V(t, x) = \min_{u_1, u_2} \max_{v_1, v_2} \min_{\tau} \left\{ \max_{\ell} \max_{\mu} \left\{ \left\langle \ell, x_0 \mid_{x(t)=x} \right\rangle + \mu \langle x(\tau), c \rangle - \frac{\mu^2}{4} - \rho(\ell \mid \mathcal{X}_0) - \frac{\|\ell\|^2}{4} \right\} \right\}.$$

Раскрывая (3.2), получим

$$V(t, x) = \min_{u_1, u_2} \max_{v_1, v_2} \min_{\tau \in [t_0, t]} \max_{\ell} \max_{\mu} \{$$

$$\langle \ell, G_1(t_0, \tau) G_2(\tau, t) x \rangle + \int\limits_t^{\tau} \langle \ell, G_1(t_0, \tau) G_2(\tau, s) \left[B_2(s) u_2(s) + C_2(s) v_2(s) \right] \rangle \, ds +$$

$$+ \int\limits_{\tau}^{t_0} \langle \ell, G_1(t_0, s) \left[B_1(s) u_1(s) + C_1(s) v_1(s) \right] \rangle \, ds + \mu \langle c, G_2(\tau, t) x \rangle +$$

$$+ \mu \int\limits_t^{\tau} \langle c, G_2(\tau, s) \left[B_2(s) u_2(s) + C_2(s) v_2(s) \right] \rangle \, ds -$$

$$- \frac{\mu^2}{4} - \rho(\ell \mid \mathcal{X}_0) - \frac{\|\ell\|^2}{4} \}$$

Сгруппируем слагаемые

$$\tilde{S}(\tau, t) = G_2^T(\tau, t) G_1^T(t_0, \tau) \ell + \mu G_2^T(\tau, t) c,$$
$$\tilde{S}_1(t_0, \tau) = G_1^T(t_0, \tau) \ell,$$

имеем

$$\begin{gathered} V(t, x) = \min_{u_1, u_2} \max_{v_1, v_2} \min_{\tau \in [t_0, t]} \max_{\ell} \max_{\mu} \{ \\ \tilde{S}^T(\tau, t) x + \int\limits_t^{\tau} \tilde{S}^T(\tau, s) \left[B_2(s) u_2(s) + C_2(s) v_2(s) \right] \, ds + \\ + \int\limits_{\tau}^{t_0} \tilde{S}_1^T(t_0, s) \left[B_1(s) u_1(s) + C_1(s) v_1(s) \right] \, ds - \\ - \frac{\mu^2}{4} - \rho(\ell \mid \mathcal{X}_0) - \frac{\|\ell\|^2}{4} \} \end{gathered} \tag{3.3}$$

Чтобы эффективно вычислять множества достижимости используется прием, который позволяет заменить поиск множества допустимых траекторий вычислением опорной функции к этому множетсву. Для перехода к опорным функциям требуется менять местами порядок минимумов и максимумов в (3.3), а для этого необходимо выполнение условий теоремы минимакса. Поэтому дальнейшие преобразования выполняются с целью обеспечения этих условий. Одним из достаточных условий перестановки является линейность по минимизирующему или максимизирующему параметру. Наша цель состоим в том, чтобы перенести операции минимума по u_1, u_2 и максимума по v_1, v_2 внутрь выражения функции цены, тем самым сводя минимизацию/максимизацию на функциональном пространстве $\mathcal{P}, \mathcal{V}$ к поиску минимумов(максимумов) для выпуклых(вогнутых) функций. Первыми меняются местами $\max_{v_1,v_2}\min_\tau(\cdot) = \min_\tau \max_{v_1,v_2}(\cdot)$. Для примера, сначала рассмотрим функционал

$$T(\tau, v(s)) = \int\limits_t^\tau v(s)ds$$

Легко видеть, что $T(\tau, v(s))$, являясь линейным по v, не является таковым по τ. Тогда вместо τ возьмем функцию ограниченной вариации $\tau(w) = \phi(w)$ и преобразуем

$$T(\phi(w), v(s)) = \int\limits_{t_0}^t d\phi(w) \int\limits_t^w v(s)ds.$$

Мы заменили множество τ более широким множеством функций $\phi(w)$. Условием нормировки для этих функций служит следующее выражение

$$\int\limits_{t_0}^t d\phi(w) = 1.$$

Теперь функционал $T(\phi, v)$ является линейным по всем аргументам.

Аналогично поступим с $V(t, x)$:

$$V(t,x) = \min_{u_1,u_2}\max_{v_1,v_2}\min_{\phi(w)}\max_{\ell(w)}\max_{\mu(w)} \int\limits_{t_0}^t d\phi(w)\Bigg\{$$

$$\tilde{S}^T(w,t)x + \int\limits_t^w \tilde{S}^T(w,s)\left[B_2(s)u_2(s) + C_2(s)v_2(s)\right] ds +$$

$$+ \int\limits_w^{t_0} \tilde{S}_1^T(t_0,s)\left[B_1(s)u_1(s) + C_1(s)v_1(s)\right] ds -$$

$$-\frac{\mu^2}{4} - \rho(\ell \mid \mathcal{X}_0) - \frac{\|\ell\|^2}{4}\Bigg\},$$

Мы здесь воспользовались перестановкой

$$\int \max_{\ell,\mu} f(w,\ell,\mu)d\phi(w) = \max_{\ell(w),\mu(w)} \int f(w,\ell(w),\mu(w))d\phi(w),$$

и теперь ℓ, μ есть функции от w.

Утверждение 1.

$$\max_{x(\cdot)} \int\limits_{t_0}^t f(x(s))ds = \int\limits_{t_0}^t \max_{x(s)} f(x(s))ds$$

Пусть

$$x^*(\cdot) = \arg\max_{x(\cdot)} \int\limits_{t_0}^t f(x(s))ds$$

$$x^\circ(\cdot) : \int\limits_{t_0}^{t} f(x^\circ(s)) = \int\limits_{t_0}^{t} \max_{x(s)} f(x(s))ds.$$

Предположим, что $x^*(\cdot) \neq x^\circ(\cdot)$ и $\int\limits_{t_0}^{t} f(x^*(s))ds \neq \int\limits_{t_0}^{t} f(x^\circ(s))ds.$

Тогда для выражения $m(s) = f(x^*(s)) - f(x^\circ(s))$ можно указать непересекающиеся отрезки $T_<, T_>, T_=$, на которых выполняются неравенства

$$\forall s \in T_< : \; m(s) < 0, \; \forall s \in T_> : \; m(s) > 0, \; \forall s \in T_= : \; m(s) = 0.$$

Для $T_>$ получаем, что

$$\forall s \in T_> : f(x^*(s)) > f(x^\circ(s)) = \max_{x(s)} f(x(s)$$

– противоречие.

Для $T_<$ получаем, что

$$\max_{x(\cdot)} \int\limits_{T_<} f(x(s))ds = \int\limits_{T_<} f(x^*(s))ds < \int\limits_{T_<} f(x^\circ(s))ds$$

– противоречие.

Остается единственный вариант, который и доказывает утверждение. □

Можно заметить, что от w зависят только переменные $\tilde{S}, \tilde{S}_1$ и пределы интегрирования. Поменяем порядок интегрирования, чтобы собрать вместе члены, зависящие от w. Применяя правила замены

$$\int\limits_{t_0}^{t} d\phi(w) \int\limits_{t}^{w} ds(\cdot) = \int\limits_{t}^{t_0} ds \int\limits_{t_0}^{s} d\phi(w)(\cdot),$$

$$\int\limits_{t_0}^{t} d\phi(w) \int\limits_{w}^{t_0} ds(\cdot) = \int\limits_{t}^{t_0} ds \int\limits_{s}^{t} d\phi(w)(\cdot),$$

и делая замену переменных

$$S(t_0, t_1) = \int\limits_{t_0}^{t_1} \tilde{S}(w, t_1)\, d\phi(w) = \int\limits_{t_0}^{t_1} \left\{ G_2^T(w,t) G_1^T(t_0,w)\ell(w) + \mu(w) G_2^T(w,t)c \right\} \, d\phi(w),$$

$$S_1(t_0, t_1) = \int\limits_{t_0}^{t_1} \tilde{S}_1(t_0, w)\, d\phi(w), = \int\limits_{t_0}^{t_1} \left\{ G_1^T(t_0,w)\ell(w) \right\} \, d\phi(w),$$

$$K(\ell, \mu, \mathcal{X}_0) = \int\limits_{t_0}^{t} \left[\frac{\mu(w)^2}{4} + \rho(\ell(w) \mid \mathcal{X}_0) + \frac{\|\ell(w)\|^2}{4} \right] \, d\phi(w)$$

придем к

$$
\begin{gathered}
V(t,x) = \min_{u_1,u_2}\max_{v_1,v_2}\min_{\phi(w)}\max_{\ell(w)}\max_{\mu(w)}\Bigg\{ \\
S^T(t_0,t)x + \int\limits_t^{t_0} S^T(t_0,s)\left[B_2(s)u_2(s) + C_2(s)v_2(s)\right]\,ds + \\
+\int\limits_t^{t_0} S_1^T(s,t)\left[B_1(s)u_1(s) + C_1(s)v_1(s)\right]\,ds - \\
-K(\ell,\mu,\mathcal{X}_0)\Bigg\},
\end{gathered}
\tag{3.4}
$$

где $K(\ell,\mu,\mathcal{X}_0)$ – выпуклая функция.

Будем искать опорную функцию к множеству достижимости $\mathcal{X}[t,\mathcal{X}_0]$, определяемому по найденному выше выражению (3.4) для $V(t,x)$. Пользуясь линейностью по ϕ, теперь можно переставить

$$
\max_{v_1,v_2}\min_{\phi}\max_{\ell}\max_{\mu}(\cdot) = \min_{\phi}\max_{\ell}\max_{\mu}\max_{v_1,v_2}(\cdot),
$$

и

$$
\max_{v(\cdot)}\int\limits_t^{t_0} f(v(s))ds = \max_{v(\cdot)}\int\limits_{t_0}^{t} -f(v(s))ds = \int\limits_{t_0}^{t}\max_{v(s)}[-f(v(s))]ds
$$

тогда

$$
\begin{gathered}
V(t,x) = \min_{u_1,u_2}\min_{\phi}\max_{\ell}\max_{\mu}\Bigg\{ \\
S^T(t_0,t)x + \int\limits_t^{t_0} S^T(t_0,s)B_2(s)u_2(s)\,ds + \int\limits_{t_0}^{t}\rho(-S^T(t_0,s)\mid C_2(s)\mathcal{V}_2(s))\,ds \\
+\int\limits_t^{t_0} S_1^T(s,t)B_1(s)u_1(s) + \int\limits_{t_0}^{t}\rho(-S_1^T(s,t)\mid C_1(s)\mathcal{V}_1)\,ds - \\
-K(\ell,\mu,\mathcal{X}_0)\Bigg\}.
\end{gathered}
$$

Далее, мы хотим поменять $\min_{u_1,u_2}(\cdot)$ на опорную функцию, но полученное выше выражение уже не является вогнутым по ℓ,μ. Поэтому, мы прибегаем к овыпуклению нужных членов и приходим к

$$
\begin{gathered}
V(t,x) = \min_{\phi}\max_{\ell}\max_{\mu}\Bigg\{ \\
S^T(t_0,t)x - \int\limits_{t_0}^{t}\rho(S_1(s,t)\mid B_1(s)\mathcal{P}_1(s))\,ds - \int\limits_{t_0}^{t}\rho(S(t_0,s)\mid B_2(s)\mathcal{P}_2(s))\,ds - \\
-\mathrm{conv}\left\{-\int\limits_{t_0}^{t}\rho(-S_1(s,t)\mid C_1(s)\mathcal{V}_1(s))\,ds - \int\limits_{t_0}^{t}\rho(-S(t_0,s)\mid C_2(s)\mathcal{V}_2(s))\,ds + K(\ell,\mu,\mathcal{X}_0)\right\}\Bigg\}.
\end{gathered}
$$

Искомое множество достижимости через функцию цены можно найти как множество уровня

$$
\mathcal{X}[t,t_0,\mathcal{X}_0] = \{x \mid V(t,x) \le 0\}
$$

Поскольку значения фунции ищутся через вычисление $\min, \max$ по пространству функций, то построить в явном виде эту фунцию представляется затруднительным.

Файл byconv.tex:

3.2 Построение множества методами многозначного анализа

Перейдем к поиску решения задачи (2.1) с помощью оценивания множеств методами многозначного анализа.

В отличие от первого подхода, где мы нашли функцию, полностью характеризующую наше решение сразу для двух систем уравнений и условия на переключение, сейчас мы будем рассматривать каждый этап по отдельности.

3.2.1 Множество достижимости до переключения

Для системы дифференциальных уравнений

$$\begin{cases} \dot{x}^{(1)} = A^{(1)}(t)x^{(1)} + B^{(1)}(t)u^{(1)}(t) + C^{(1)}(t)v^{(1)}(t); \\ x(t_0) \in \mathcal{E}(x_0, X_0) = \mathcal{X}_0; \\ u^{(1)}(t) \in \mathcal{E}(p^{(1)}(t), P^{(1)}(t)) = \mathcal{P}^{(1)}[t_0, t_1]; \\ v^{(1)}(t) \in \mathcal{E}(w^{(1)}(t), W^{(1)}(t)) = \mathcal{V}^{(1)}[t_0, t_1]; \end{cases} \tag{3.5}$$

требуется найти множество достижимости по (Опр.2.).

Это эквивалентно следующей задаче. Пусть нам даны множества $\mathcal{X}_0[t]$–исходное множество,$\mathcal{P}(t)$–множество управлений, $\mathcal{C}(t)$– множество помех, X_0,$\mathcal{P}(t)$,$\mathcal{C}(t)$ - выпуклые. Гарантированное множество достижимости находится как

$$\mathcal{X}[t] = \big(\mathcal{X}_0[t] \dot{-} \mathcal{C}(t)\big) + \mathcal{P}(t).$$

Здесь операция $\dot{-}$ понимается в смысле

Определение 4. *Геометрической разностью выражения $C = A \dot{-} B$ называется множество $C = \{c \mid c + B \subseteq A$*

Решение задачи Коши для системы (3.5)

$$x(t) = G(t_0, t_1)x_0 + \int\limits_{t_0}^{t_1} G(t_1, s)B(s)u(s)ds + \int\limits_{t_0}^{t_1} C(s)v(s)ds$$

где $x(t)$ – траектория системы, определяется выбранным управлением $u(\cdot)$ и неизвестной реализацией помехи $v(\cdot)$. Тогда гарантированная оценка множества достижимости имеет решение в виде

$$\mathcal{X}[t] = \left(G(t_0, t_1)\mathcal{X}_0 \dot{-} \int\limits_{t_0}^{t_1} G(t_1, s)\mathcal{V}(s)ds \right) + \int\limits_{t_0}^{t_1} G(t_1, s)B(s)\mathcal{P}(s)ds$$

Поскольку напрямую решать данные интегралы от множеств затруднительно, прибегнем к аппарату эллипсоидальных оценивания [2, 8, 9] . Мы можем оценить искомое множество через внешние и внутренние эллипсодальные оценки. Так что

$$\mathcal{X}[t] \subseteq \bigcap_{\ell} \mathcal{E}(q_+^{\ell}(t), Q_+^{\ell}(t));$$

$$\mathcal{X}[t] \supseteq \bigcup_{\ell} \mathcal{E}(q_-^\ell(t), Q_-^\ell(t)),$$

где ℓ – вектор, в направлении которого оценивающий эллипсоид касается искомого множества, $\mathcal{E}(q^ell_+(t), Q_+^\ell(t))$ – внешняя эллипсоидальная оценка, $\mathcal{E}(q_-^\ell(t), Q_-^\ell(t)$ – внутренняя эллипсоидальная оценка. Поскольку ограничения на начальные условия, управление, помеху в задаче (3.5) выражены эллипсоидами, выпуклыми компактами, то само $\mathcal{X}[t]$ – также будет выпуклым [9] и справедливо

$$\bigcup_{\forall\ell} \mathcal{E}(q_-^\ell(t), Q_-^\ell(t)) = \mathcal{X}[t] = \bigcap_{\forall\ell} \mathcal{E}(q_+^\ell(t), Q_+^\ell(t)),$$

где пересечение и объединение берутся по всем возможным направлениям $\ell \in \mathbb{R}^n$.

Параметры внутренней эллипсоидальной оценки $\mathcal{E}(q_-(t), Q_-(t))$ берутся из уравнения

$$\begin{gathered}\dot{Q}_-(t) = A(t)Q_-(t) + Q_-(t)A^T(t) + Q_-^{-\frac{1}{2}}(t)S(t)P^{\frac{1}{2}}(t)B(t) + B(t)P^{\frac{1}{2}}(t)B^T(t)S^T(t)Q_-^{\frac{1}{2}}(t)- \\ -\pi(t)Q_-(t) - \pi^{-1}(t)C(t)W(t)C^t(t), \\ \dot{q}_-(t) = A(t)q(t) + B(t)p(t) + C(t)w(t),\end{gathered} \tag{3.6}$$

где $S(t)$,$\pi(t)$ удовлетворяют соотношениям

$$S(t)P^{\frac{1}{2}}(t)B^T(t)\ell(t) = Q_-^{\frac{1}{2}}(t)\ell(t)\lambda(t), \quad \ell(t) = G^(t, t_0)\ell_0,\ \ell_0 \in \mathbb{R}^n,$$

$$\pi(t) = \frac{\left\langle \ell(t), C(t)W(t)C^T(t)\ell(t)\right\rangle^{\frac{1}{2}}}{\langle \ell(t), Q_-(t)\ell(t)\rangle^{\frac{1}{2}}},$$

$$\lambda(t) = \frac{\left\langle \ell(t), B(t)P(t)B^T(t)\ell(t)\right\rangle^{\frac{1}{2}}}{\langle \ell(t), Q_-(t)\ell(t)\rangle^{\frac{1}{2}}}$$

Параметры внешней эллипсоидальной оценки $\mathcal{E}(q_+(t), Q_+(t))$ находятся из

$$\begin{gathered}\dot{Q}_+ = A(t)Q_-(t) + Q_-(t)A^T(t) + \pi(t)Q_+(t) + \pi^{-1}(t)B(t)P(t)B^T(t)- \\ -Q_+^{\frac{1}{2}}(t)S(t)W^{\frac{1}{2}}(t)C^T(t) - C(t)W^{\frac{1}{2}}(t)S^T(t)Q_+^{\frac{1}{2}}(t),\end{gathered} \tag{3.7}$$

где

$$S(t)W^{\frac{1}{2}}(t)C^T(t)\ell(t) = \lambda(t)Q^{\frac{1}{2}}(t)\ell(t),$$

$$\pi = \frac{\left\langle \ell(t), B(t)P(t)B^T(t)\ell(t)\right\rangle^{\frac{1}{2}}}{\langle \ell(t), Q_+(t)\ell(t)\rangle^{\frac{1}{2}}},$$

$$\lambda(t) = \frac{\left\langle \ell(t), C(t)W(t)C^T(t)\ell(t)\right\rangle^{\frac{1}{2}}}{\langle \ell(t), Q_+(t)\ell(t)\rangle^{\frac{1}{2}}}$$

Итак, с помощью эллипсоидальных оценок мы можем вычислить сколь угодно точную оценку множества достижимости $\mathcal{X}^{(1)}[t, t_0, \mathcal{X}_0]$ (по (Опр.2.)) для любого момента времени t и начального условия $\mathcal{X}_0$.

Необходимо отметить, что $\mathcal{X}[t, t_0]$ образовано двумя множествами: $\left(G(t_0, t_1)\mathcal{X}_0 \dot{-} \int\limits_{t_0}^{t_1} G(t_1, s)\mathcal{V}(s)\right)$ – обеспечивает множество гарантированного попадания, а другое, $\int\limits_{t_0}^{t_1} G(t_1, s)B(s)\mathcal{P}(s)$ – желаемое смещение первого множества. Кроме того, может оказаться, что начиная с некоторого $\tau > t$, $\mathcal{X}[t, t_0]$ окажется пустым, если $\left(\mathcal{X}_0[t] \dot{-} \mathcal{C}(t)\right)$ выродится. Соответственно, расчет для второй системы необходимо выполнять не с начальным множеством $\mathcal{X}^{(1)}[t,t_0,\mathcal{X}_0] \cap H(c,\gamma)$, а $\left(G(t_0,t_1)\mathcal{X}_0 \dot{-} \int\limits_{t_0}^{t_1} G(t_1,s)\mathcal{V}(s)ds + \phi^\alpha \right) \cap H(c,\gamma)$, где $\phi^\alpha = \int\limits_{t_0}^{t_1} G(t_1,s)B(s)p^\alpha(s)ds, \quad p^\alpha(\cdot) \in \mathcal{P}(\cdot)$. Поэтому, в дальнейшем, мы будем искать множество достижимости второй системы для фиксированного $p^\alpha(\cdot)$.

3.2.2 Пересечение с гиперплоскостью

Рассмотрим теперь вычисление множеств, образованных пересечением множества достижимости первой системы с гиперплоскостью $H(c,\gamma) = \{x \mid \langle x, c\rangle = \gamma\}$. Пусть

$$(s) \overset{def}{=} \left(G(t_0,t_1)\mathcal{X}_0 \dot{-} \int\limits_{t_0}^{t_1} G(t_1,s)\mathcal{V}(s)ds \right),$$

$$\phi^\alpha(t) \overset{def}{=} \int\limits_{t_0}^{t} G(t_1,s)B(s)p^\alpha(s)ds,$$

$$C_H^\alpha(s) \overset{def}{=} (C(s) + \phi^\alpha(s)) \cap H$$

$$\mathcal{T}^\alpha \overset{def}{=} \{\tau \mid C_H^\alpha(\tau) \neq \emptyset\}$$

Мы предполагаем условие односторонней трансверсальности выполненным, поэтому можем утверждать, что множество $C_H^\alpha(\mathcal{T}^\alpha)$ – односвязное. Вслучае невыполнения условий трансверсальности (рис.1), множество $C_H^\alpha(\mathcal{T}^\alpha)$ может быть несвязным, в этом случае дальнейший анализ существенно затруднится.

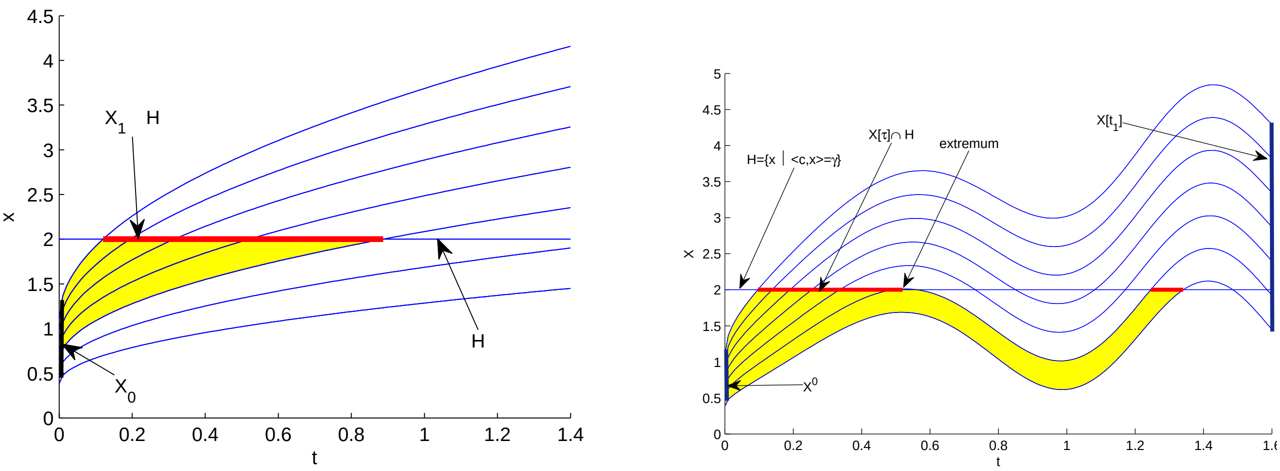

Рис. 1. Выполнение и невыполнение условий трансверсальности

В пункте 3.2.1 мы нашли оценку множества достижимости с помощью эллипсоидальных оценок. Вычислим теперь $C_H^\alpha(\tau)$

Утверждение 2. ([1]) *Пусть эллипсоид $\mathcal{E}(q,Q)$ и гиперплоскость $\mathcal{H} = \{x \in \mathbb{R}^n : \langle x, c\rangle = \gamma\}$ таковы, что $\mathcal{E} \cap \mathcal{H} \neq \emptyset$. Тогда $\mathcal{E}(q,Q) \cap \mathcal{H} = \mathcal{E}(\tilde{q},\tilde{Q})$ - вырожденный эллипсоид (т.е. $\tilde{Q} = \tilde{Q}^T \geqslant 0$, $det(\tilde{Q}) = 0$).*

Доказательство. Пусть $T \in \mathbb{R}^{n\times n}$ - такая невырожденная матрица, что $Tc = e_1$, где $e_1 = (1, 0, \ldots, 0)$. Используя замену переменных $x = T'y$ и $q = T'p$, преобразуем множество $\mathcal{E}(q, Q) \cap \mathcal{H}$:

$$\mathcal{E}(q,Q) \cap \mathcal{H} = \{x \in \mathbb{R}^n : \langle x-q, Q^{-1}(x-q)\rangle \leqslant 1, \langle x, c\rangle = \gamma\} =$$
$$T'\{y = (\gamma, z)', z \in \mathbb{R}^{n-1} : \langle z-\tilde{q}, \tilde{Q}(z-\tilde{q})\rangle \leqslant 1\}$$

$$TQ^{-1}T' = \left(\begin{array}{cc} a & c' \\ c & D \end{array}\right), \; D \in \mathbb{R}^{(n-1)\times(n-1)}, p = \left(\begin{array}{c} p_1 \\ \tilde{p} \end{array}\right), \tilde{p} \in \mathbb{R}^{n-1}$$

$$\tilde{q} = \tilde{p} - D^{-1}(\gamma - p_1)c \;, \; A = \frac{D}{1-(\gamma-p_1)^2(a - \langle c, \; D^{-1}c\rangle)}$$

И проверкой подстановки

$$\tilde{q} = T'\left(\begin{array}{c} \gamma \\ \tilde{q} \end{array}\right), \tilde{Q} = T'\left(\begin{array}{cc} 0 & 0 \\ 0 & A^{-1} \end{array}\right) T$$

завершаем доказательство утверждения. Нам важно найти не столько вырожденный эллипсоид $\mathcal{E}(\tilde{q}, \tilde{Q})$, сколько его пересечение с гиперплоскостью. Легко видеть, что это будет эллипсоид с размерностью на единицу меньше, его параметры находятся как $q_H = \gamma D^{-1}c$, $Q_H = A^{-1}$. Вектор q_H указывает смещение эллипсоида относительно опущенного на плоскость перпендикуляра, выпущенного из центра пересекаемого эллипсоида (рис.2).

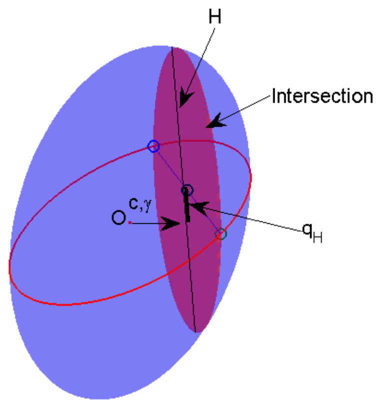

Рис. 2. Пересечение эллипсоида с плоскостью

Таким образом, для момента времени $\tau \in \mathcal{T}^\alpha$ мы получили семейство эллипсоидов размерности на единицу меньше, расположенные на плоскости H, которые, в свою очередь оценивают искомое сечение множества пересечения, которое остается выпуклым. Это семейство внутренних и внешних оценок также можно оценивать новыми оценками, с целью уменьшить количество дальнейших вычислений.

Файл bibl.tex:

Список литературы

[1] *Куржанский А.Б., Варайя П.* Задачи динамики и управления в гибридных системах // Труды международного семинара “Теория управления и теория обобщенных решений уравнений Гамильтона-Якоби”. Екатеринбург: Изд-во Уральского университета, 2005. с.26–33.

[2] *Куржанский А.Б.* Управление и наблюдение в условиях неопределенности. М.: Наука, 1977.

[3] *Куржанский А.Б., Точилин П.А.* Слабо инвариантные множества гибридных систем // Дифференциальные уравнения. 2008. т. 44, N11.

[4] *Пшеничный Б.Н.* Выпуклый анализ и экстремальные задачи. М.: Наука, 1980.

[5] *Рокафеллар Р.* Выпуклый анализ. М.: Мир, 1973.

[6] *Branicky M.S., Borkar V.S., Mitter S.M.* A unified framework for hybrid control: model and optimal control theory. // IEEE transactions on automatic control, 43/1 p.31–45, 1998.

[7] *Kurzhanski A.B., Varaiya P.* Ellipsoidal techniques for reachability under state constraints.// SIAM Journal on Control. 2003. V.45. N.4. p.1369–1394.

[8] *Kurzhanski A.B., Varaiya P.* Ellipsoidal techniques for reachability analysis. Internal approximation // System and Control Letters. 2000. V.41. p.201–211.

[9] *Kurzhanski A.B., Varaiya P.* Ellipsoidal techniques for reachability analysis. Part I: External approximations. Part II: Internal approximations. Box-valued constraints // Optimization methods and software. 2002. V.17. p.177–237.

[10] *Liberzon D.* Switching in systems and control. Boston: Birkhäuser, 2003.

[11] *Van der Schaft A., Schumacher H.* An introduction to hybrid dynamical systems. Lecture Notes in Control and Information Sciences. N251. Springer, 2000.