

УПРАВЛЕНИЕ ДИНАМИЧЕСКИМИ СИСТЕМАМИ

УДК 519.2

М.Ю. Киселева, В.И. Смагин

УПРАВЛЕНИЕ С ПРОГНОЗИРУЮЩЕЙ МОДЕЛЬЮ С УЧЕТОМ ЗАПАЗДЫВАНИЯ ПО УПРАВЛЕНИЮ

Рассматривается задача синтеза прогнозирующего управления, построенного на основе слежения за выходом системы, с учетом запаздывания по управлению. При решении задачи управления с прогнозирующей моделью учитываются ограничения, накладываемые на состояние объекта и на управление. Прогнозирование осуществляется на основе вычисления оценок состояний объекта, построенных с использованием экстраполятора Калмана. Критерием качества является выпуклая квадратичная функция.

Ключевые слова: *прогнозирующее управление, запаздывание, экстраполятор Калмана.*

Одним из современных формализованных подходов к синтезу систем управления, базирующихся на математических методах оптимизации, является теория управления динамическими объектами с использованием прогнозирующих моделей – Model Predictive Control (MPC).

Этот подход начал развиваться в начале 60-х годов XX века для управления процессами и оборудованием в нефтехимическом и энергетическом производстве, для которых применение традиционных методов синтеза было крайне затруднено в связи с исключительной сложностью их математических моделей. В последнее время область применения MPC значительно расширилась, охватывая технологические отрасли [1] и экономику при управлении производством [2, 3], при решении задач управления запасами [4] и портфелем ценных бумаг [5].

Основным достоинством MPC-подхода, определяющим его успешное использование в практике построения и эксплуатации систем управления, служит относительная простота базовой схемы формирования обратной связи, сочетающаяся с высокими адаптивными свойствами. Последнее обстоятельство позволяет управлять многомерными и многосвязными объектами со сложной структурой, оптимизировать процессы в режиме реального времени в рамках ограничений на управляющие и управляемые переменные, учитывать неопределенности в задании объектов и возмущений. Кроме того, возможен учет запаздываний, поскольку зачастую решение об управлении принимается в момент времени $t - h$, а реализация этого решения происходит в момент времени t .

Результаты настоящей статьи обобщают работу [6] на случай запаздываний по управлению.

1. Постановка задачи

Пусть имеется объект, который в пространстве состояний описывается системой линейных разностных уравнений вида

$$x_{t+1} = Ax_t + Bu_{t-h} + w_t, \quad x_0 = \bar{x}_0; \quad (1)$$

$$\psi_t = Hx_t + v_t; \quad (2)$$

$$y_t = Gx_t, \quad (3)$$

где $x_t \in R^n$ – состояние объекта; $u_t \in R^m$ – управление ($u_t = \bar{u}_t$, $t = -h, -h+1, \dots, -1$, \bar{u}_t – заданные значения); $y_t \in R^p$ – выход; $\psi_t \in R^l$ – наблюдение; h – величина запаздывания.

Далее будем полагать, что случайные возмущения w_t и шумы измерения v_t не коррелированы между собой и подчиняются гауссовскому распределению с нулевым средним и с соответствующими ковариациями

$$M\{w_t w_k^T\} = W\delta_{t,k}, \quad M\{v_t v_k^T\} = V\delta_{t,k}$$

где $\delta_{t,k}$ – символ Кронекера.

Ограничения на векторы состояния и управления зададим в виде

$$a_1 \leq S_1 x_t \leq a_2; \quad (4)$$

$$\varphi_1(x_t) \leq S_2 u_{t-h} \leq \varphi_2(x_t), \quad (5)$$

где S_1 и S_2 – структурные матрицы, состоящие из нулей и единиц и определяющие компоненты векторов x_t и u_t , на которые накладываются ограничения; a_1 , a_2 , $\varphi_1(x_t)$ и $\varphi_2(x_t)$ – заданные постоянные векторы и вектор-функции соответствующих размерностей.

Задача состоит в том, чтобы по наблюдениям ψ_t определить стратегию управления, при которой вектор выхода системы y_t будет близок к заданному вектору \bar{y}_t с учетом ограничений (4), (5).

2. Построение прогнозирующего управления

Поскольку случайные возмущения w_t и шумы измерения v_t имеют гауссовское распределение, то можно синтезировать алгоритм оптимального прогнозирования поведением объекта и вектором выхода, используя экстраполятор Калмана [7]. Пусть $\hat{x}_{i|j}$ и $\hat{y}_{i|j}$ – оценки состояния и вектора выхода в момент времени i , вычисляющие информацию с j -го момента времени, $j \leq i$. Тогда

$$\hat{x}_{t+1|t} = A\hat{x}_{t|t-1} + Bu_{t-h} + K_t(\psi_t - H\hat{x}_{t|t-1}),$$

$$\hat{y}_{t+1|t} = G\hat{x}_{t+1|t},$$

$$K_t = AP_t H^T (HP_t H^T + V)^{-1},$$

$$P_{t+1} = W + AP_t A^T - AP_t H^T (HP_t H^T + V)^{-1} HP_t A^T, \quad P_0 = P_{x_0}. \quad (6)$$

Указанное выражение для P_t известно как разностное уравнение Риккати с дискретным временем, P_{x_0} – начальное значение дисперсионной матрицы.

3. Синтез прогнозирующего управления

Для решения поставленной задачи в качестве целевой функции используется критерий

$$J(t) = \frac{1}{2} \sum_{k=1}^N \left\{ \|\hat{y}_{t+k|t} - \bar{y}_t\|_C^2 + \|u_{t-h+k|t} - u_{t-h+k-1|t}\|_D^2 \right\}, \quad (13)$$

где матрицы $C > 0$ и $D > 0$ – весовые матрицы.

В случае, когда желаемая отслеживаемая траектория управления \bar{y}_{t+k} не известна для $k \geq 0$, целесообразно считать $\bar{y}_{t+k} = \bar{y}_t$. Это означает, что заданный уровень устанавливается постоянным в течение всего времени прогнозирования.

Преобразуем целевую функцию (13). Введем вектор

$$\bar{Y}_t = \begin{bmatrix} \bar{y}_{t+1} \\ \vdots \\ \bar{y}_{t+N} \end{bmatrix}.$$

Тогда с учетом (12) получим

$$\begin{aligned} \frac{1}{2} \sum_{k=1}^N \|\hat{y}_{t+k|t} - \bar{y}_t\|_C^2 &= \frac{1}{2} \|\hat{Y}_t - \bar{Y}_t\|_C^2 = \\ &= \frac{1}{2} U_{t-h}^T \Phi^T \bar{C} \Phi U_{t-h} + U_{t-h}^T [\Phi^T \bar{C} \Lambda \hat{x}_{t+1|t} - \Phi^T \bar{C} \bar{Y}_t] + c_1. \end{aligned} \quad (14)$$

Здесь c_1 – постоянная составляющая, которая не зависит от U_{t-h} и $\hat{x}_{t+1|t}$, а \bar{C} имеет вид

$$\bar{C} = \begin{bmatrix} C & 0 & \vdots & 0 \\ 0 & C & \vdots & 0 \\ \dots & \dots & \ddots & \dots \\ 0 & 0 & \vdots & C \end{bmatrix}.$$

Аналогично

$$\frac{1}{2} \sum_{k=1}^N \|u_{t-h+k|t} - u_{t-h+k-1|t}\|_D^2 = \frac{1}{2} U_{t-h}^T \bar{D} U_{t-h} - u_{t-h+1|t}^T D u_{t-h} + c_2, \quad (15)$$

где c_2 – постоянная, не зависящая от u_{t-h+k} ($k = \overline{1, N}$), \bar{D} представляется в виде

$$\bar{D} = \begin{bmatrix} 2D & -D & 0 & \vdots & 0 \\ -D & 2D & -D & \vdots & 0 \\ \dots & \ddots & \ddots & \ddots & \dots \\ 0 & \dots & -D & 2D & -D \\ 0 & \dots & 0 & -D & 2D \end{bmatrix}.$$

Таким образом, с учетом (14), (15) целевая функция запишется следующим образом:

$$J(t) = \frac{1}{2} U_{t-h}^T F U_{t-h} + U_{t-h}^T f + c_3, \quad (16)$$

где c_3 есть линейная комбинация c_1 и c_2 , а матрица F и вектор f определяются соотношениями

$$F = \Phi^T \bar{C} \Phi + \bar{D}, \quad f = \Gamma \begin{bmatrix} \hat{x}_{t+1|t} \\ \bar{Y}_t \end{bmatrix} - \begin{bmatrix} Du_{t-h} \\ 0 \\ \vdots \\ 0 \end{bmatrix}, \quad \Gamma = [\Phi^T \bar{C} \Lambda \quad -\Phi^T \bar{C}].$$

Аналитическое решение данной задачи без учета ограничений с использованием формул векторно-матричного дифференцирования [8]

$$y^T A y = \text{tr} A y y^T, \quad \frac{d \text{tr} A X B}{dX} = A^T B^T, \quad \frac{d \text{tr} A X^T B}{dX} = B A$$

получится из условия $\frac{\partial J}{\partial U_{t-h}} = 0$:

$$\begin{aligned} \frac{\partial J}{\partial U_{t-h}} &= \frac{\partial}{\partial U_{t-h}} \left[\frac{1}{2} U_{t-h}^T F U_{t-h} + U_{t-h}^T f + c \right] = \\ &= \frac{1}{2} \frac{\partial (\text{tr} F U_{t-h} U_{t-h}^T)}{\partial U_{t-h}} + \frac{\partial (U_{t-h}^T f)}{\partial U_{t-h}} = \frac{1}{2} [F^T U_{t-h} + F U_{t-h}] + f = 0. \end{aligned} \quad (17)$$

В силу симметричности матрицы F уравнение (17) можно представить в виде

$$F U_{t-h} + f = 0.$$

Решение этого уравнения определяется выражением

$$U_{t-h}^* = -(\Phi^T \bar{C} \Phi + \bar{D})^{-1} (\Phi^T \bar{C} \Lambda \hat{x}_{t+1|t} - \Phi^T \bar{C} \bar{Y}_t) - \begin{pmatrix} Du_{t-h} \\ 0 \\ \dots \\ 0 \end{pmatrix},$$

что позволяет найти оптимальное прогнозирующее управление

$$u_{t-h+1|t}^* = (E_n \quad 0 \quad \dots \quad 0) U_{t-h}^*.$$

3. Моделирование управления экономической системы

В качестве примера рассмотрен вариант экономической системы [3, 6], предназначенной для производства, хранения и поставок товаров потребителям:

$$\begin{aligned} q_{t+1} &= \bar{A} q_t + \varphi_{t-h} + \xi_t, \quad q_0 = \bar{q}_0, \\ z_{t+1} &= z_t + \bar{B} \omega_{t-h} - \varphi_{t-h} + \zeta_t, \quad z_0 = \bar{z}_0, \end{aligned} \quad (18)$$

где $q_t \in R^s$, $q_{i,t}$ – количество товаров i -го типа у потребителя в момент времени t ($t = \overline{1, T}$, $i = \overline{1, s}$); $z_{i,t}$ – количество товаров i -го типа на складе производителя; $\omega_{i,t}$ – объем производства товаров i -го типа; $\varphi_{i,t}$ – объем поставок товаров i -го типа; h – величина запаздывания (целое число), ξ_t , ζ_t – векторные гауссовские случайные последовательности с характеристиками $M\{\xi_t\} = 0$, $M\{\zeta_t\} = 0$, $M\{\xi_t \xi_k^T\} = \Sigma \delta_{t,k}$, $M\{\zeta_t \zeta_k^T\} = \Xi \delta_{t,k}$, $M\{\xi_t \zeta_k^T\} = 0$; \bar{A} и \bar{B} – матрицы, определяющие динамику производства и потребления. В модели (18) случайные векторы ξ_t , ζ_t учитывают ошибки, возникающие из-за погрешностей при задании модели.

В каждый момент времени t должны выполняться ограничения

$$z_{\min} \leq z_t \leq z_{\max}, 0 \leq \omega_{t-h} \leq \omega_{\max}, 0 \leq \varphi_{t-h} \leq z_t. \quad (19)$$

Переменные ω_t и φ_t рассматриваются как управляющие воздействия, и их значения при $t = -h, -h+1, \dots, -1$ заданы. Задача состоит в том, чтобы по наблюдениям определить стратегию управления производством, хранением и поставками товаров, обеспечивающую количество товаров у потребителя q_t , близкое к заданному вектору \bar{q} , с учетом ограничений вида (19).

Модель экономической системы (18) сводится к модели (1) при $n = 2s$ с ограничениями (4), (5), если ввести следующие обозначения:

$$x_t = \begin{bmatrix} q_t \\ z_t \end{bmatrix}, u_{t-h} = \begin{bmatrix} \varphi_{t-h} \\ \omega_{t-h} \end{bmatrix}, A = \begin{bmatrix} \bar{A} & 0 \\ 0 & E_s \end{bmatrix}, B = \begin{bmatrix} E_s & 0 \\ -E_s & \bar{B} \end{bmatrix}, w_t = \begin{bmatrix} \xi_t \\ \zeta_t \end{bmatrix}, W = \begin{bmatrix} \Sigma & 0 \\ 0 & \Xi \end{bmatrix},$$

$$a_1 = z_{\min}, a_2 = z_{\max}, S_1 = [0 \quad E_s], \varphi_1(x_t) = 0, S_2 = \begin{bmatrix} E_s & 0 \\ 0 & E_s \end{bmatrix}, \varphi_2(x_t) = \begin{bmatrix} z_t \\ \omega_{\max} \end{bmatrix}.$$

Оптимизационная задача решается на каждой итерации для прогнозируемых значений вектора состояния. При решении задачи минимизации критерия (16) численно с использованием системы Matlab [9] необходимо преобразовать ограничения к векторно-матричному виду. Тогда ограничение на объем производства $\omega_{t-h+i|t-h} \leq \omega_{\max}$ для расширенной системы определяется неравенством

$$R_1 U_{t-h} \leq \bar{E} \omega_{\max}; \quad (20)$$

ограничение на объем поставки $\varphi_{t-h+i|t-h} \leq \hat{z}_{t-h+i|t-h}$ запишется в виде

$$R_2 U_{t-h} \leq R_1 \Psi \hat{x}_{t-h+1|t-h} + R_1 P U_{t-2h}. \quad (21)$$

Так как $\omega_{t-h+i|t-h} \geq 0$ и $\varphi_{t-h+i|t-h} \geq 0$, то

$$U_{t-h} \geq 0. \quad (22)$$

Ограничения $\hat{z}_{t+i|t} \leq z_{\max}$, $\hat{z}_{t+i|t} \geq z_{\min}$ задаются неравенствами

$$R_1 P U_{t-h} \leq \bar{E} z_{\max} - R_1 \Psi \hat{x}_{t+1|t}; \quad (23)$$

$$-R_1 P U_{t-h} \leq -\bar{E} z_{\min} + R_1 \Psi \hat{x}_{t+1|t}. \quad (24)$$

В (20), (21), (23), (24) матрицы R_1, R_2, \bar{E} выражаются следующим образом:

$$R_1 = \begin{bmatrix} 0 & E_s & 0 & 0 & \dots & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & E_s & \dots & 0 & 0 \\ \dots & \dots & \ddots & \dots & \dots & \dots & \dots \\ 0 & 0 & 0 & \dots & 0 & E_s \end{bmatrix}, R_2 = \begin{bmatrix} E_s & 0 & 0 & 0 & \dots & 0 & 0 \\ 0 & 0 & E_s & 0 & \dots & 0 & 0 \\ \dots & \dots & \ddots & \dots & \dots & \dots & \dots \\ 0 & 0 & 0 & \dots & E_s & 0 \end{bmatrix}, \bar{E} = \begin{bmatrix} E_s \\ E_s \\ \dots \\ E_s \end{bmatrix}.$$

Моделирование проведено для следующих исходных данных:

$$\bar{A} = \begin{bmatrix} 0,75 & 0 \\ -0,25 & 0,9 \end{bmatrix}, \bar{B} = \begin{bmatrix} 0,3 & 0,1 \\ 0,2 & 0,8 \end{bmatrix}, z_{\min} = \begin{bmatrix} 0,1 \\ 0,1 \end{bmatrix}, z_{\max} = \begin{bmatrix} 1 \\ 1 \end{bmatrix},$$

$$\omega_{\max} = \begin{bmatrix} 0,8 \\ 0,7 \end{bmatrix}, z_0 = \begin{bmatrix} 0,2 \\ 0,2 \end{bmatrix}, q_0 = \begin{bmatrix} 0 \\ 0 \end{bmatrix}, \bar{q} = \begin{bmatrix} 1 \\ 2 \end{bmatrix},$$

$$h=1, N=8, H=E_4, W=0, V=\text{diag}\{0,0005; 0,0005; 0,0005; 0,0005\}.$$

Результаты численного моделирования приведены в виде графиков переходных процессов на рис. 1 – 3.

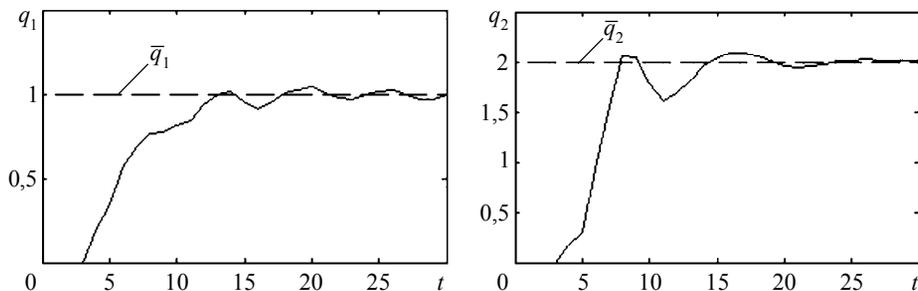


Рис. 1. Динамика изменения количества товаров у потребителя

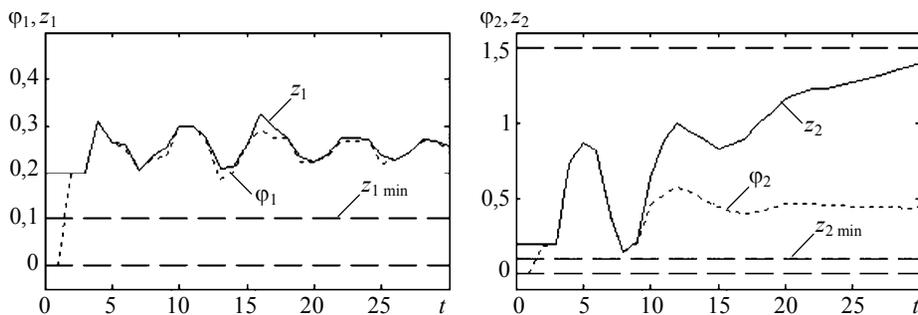


Рис. 2. Динамика изменения количества товаров на складе и объемов поставок

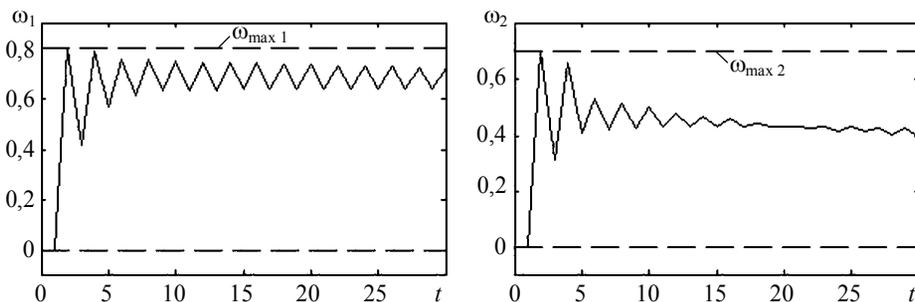


Рис. 3. Процессы изменения объемов производства товаров

Моделирование экономического объекта подтвердило работоспособность алгоритма. Показано, что цель достигается, ограничения на переменные управления и состояния в условиях запаздывания в контуре управления выполняются.

Заключение

Получено решение задачи синтеза прогнозирующего управления выходом дискретного объекта, с запаздыванием по управлению с учетом ограничений в форме неравенств. Для вычисления прогнозируемых значений используется экстраполятор Калмана.

ЛИТЕРАТУРА

1. *Camacho E.F., Bordons C.* Model predictive control. London: Springer-Verlag, 2004. 405 p.
2. *Параев Ю.И.* Решение задач об оптимальном производстве, хранении и сбыте товара // Изв. РАН. Теория и системы управления. 2000. № 2. С. 103 – 107.
3. *Перепелкин Е.А.* Прогнозирующее управление экономической системой производства, хранения и поставок товаров потребителям // Экономика и математические методы. 2004. Т. 40. № 1. С. 125 – 128.
4. *Aggelogiannaki E., Doganis Ph., Sarimveis H.* An Adaptive Model Predictive Control configuration for Production-Inventory Systems // International Journal of Production Economics. 2008. V.114. P. 165 – 178.
5. *Домбровский В.В., Домбровский Д.В., Лященко Е.А.* Управление с прогнозирующей моделью системами со случайными зависимыми параметрами при ограничениях и применение к оптимизации инвестиционного портфеля // Автоматика и телемеханика. 2006. № 12. С. 71 – 85.
6. *Киселева М.Ю., Смагин В.И.* Управление производством, хранением и поставками товаров на основе прогнозирующей модели выхода системы // Вестник ТГУ. Управление, вычислительная техника и информатика. 2009. № 2(7). С. 24 – 30
7. *Браммер К., Зиффлинг Г.* Фильтр Калмана – Бьюси. М.: Наука. 1972. 200 с.
8. *Амосов А.А., Колпаков В.В.* Скалярно-матричное дифференцирование и его применение к конструктивным задачам теории связи // Проблемы передачи информации. 1972. № 1. С. 3 – 15.
9. *Смагин В.И.* Пакет прикладных программ Matlab 5.3: учеб. пособие. Томск: Изд-во Том. ун-та, 2006. 123 с.

Киселева Марина Юрьевна

Смагин Валерий Иванович

Томский государственный университет

E-mail: kiselevamy@gmail.com; vsm@mail.tsu.ru

Поступила в редакцию 19 декабря 2009 г.