

ЭКСПОНЕНЦИАЛЬНАЯ УСТОЙЧИВОСТЬ ИНТЕРВАЛЬНОЙ НЕЛИНЕЙНОЙ СИСТЕМЫ

С.П. СОКОЛОВА¹, Р.С. ИВЛЕВ²

¹Санкт-Петербургский институт информатики и автоматизации РАН;

²Институт проблем информатики и управления МОН РК

¹СПИИРАН, 14-я линия ВО, д. 39, Санкт-Петербург, 199178;

²ИПИУ МОН РК, ул. Пушкина, д. 125, Алма-Ата, 480100

<sokolova_sv@mail.ru>

УДК 681.3

Соколова С. П., Ивлев Р. С. Экспоненциальная устойчивость интервальной нелинейной системы // Труды СПИИРАН. Вып. 3, т. 2. — СПб.: Наука, 2006.

Аннотация. В статье предложен подход исследования динамического свойства экспоненциальной устойчивости нелинейной интервальной динамической системы с нелинейностью квадратичного типа на основе прямого метода Ляпунова. Построена внутренняя оценка области притяжения начала координат для рассматриваемого класса интервальных систем. — Библиограф. 10 назв.

UDC 681.3

Sokolova S. P., Ivlev R. S. Exponential Stability of Interval Nonlinear Systems // SPIIRAS Proceedings. Issue 3, vol. 2. — SPb.: Nauka, 2006.

Abstract. This article proposes an approach for investigating the exponential stability of a nonlinear interval dynamical system with nonlinearity of a quadratic type on the base of the Lyapunov's direct method. It also constructs an inner estimate of the attraction domain to the origin for the system under consideration. — Bibl. 10 items.

1. Введение

Проблеме исследования устойчивости динамических систем с интервальной неопределенностью параметров посвящено значительное количество публикаций [1-5]. На первый взгляд кажущаяся простота исследования динамических свойств интервальных систем оказалась обманчивой даже для линейного случая. Об этом свидетельствуют и неудачные попытки обобщить результаты работы [1] на случай интервальных матриц [2-4] и результаты исследований [5], в которых показано, что исследование устойчивости интервальной матрицы является NP-трудной задачей.

В отличие от линейного случая результаты исследования динамических свойств нелинейных интервальных систем, математические модели которых заданы в пространстве состояний, представлены достаточно скупо. Возможная причина этого заключается в сложности применения прямого метода Ляпунова к вышеуказанному классу систем. В статье предложен подход на основе прямого метода Ляпунова и получены условия экспоненциальной устойчивости нелинейной интервальной динамической системы с квадратичной нелинейностью. Построена внутренняя оценка области притяжения начала координат для рассматриваемого класса интервальных систем.

2. Постановка задачи

Ниже будут использованы следующие обозначения:

- точечные числа и векторы — малые латинские буквы;
- интервальные числа и векторы — малые полужирные латинские буквы;

- точечные матрицы — большие латинские буквы;
- интервальные матрицы — большие полужирные латинские буквы.

Пусть математическая модель исследуемой системы в пространстве состояний представляется в виде нелинейного дифференциального уравнения с неточно заданными параметрами

$$\dot{x}(t) = (A_c + \Delta A)x(t) + X(t)(B_c + \Delta B)x(t), \quad x(t_0) = x_0, \quad t \in [t_0, \infty), \quad (1)$$

где t — независимая переменная (время), $x(t) = (x_i(t))$ — вектор состояний, компонентами которого являются непрерывно дифференцируемые на $[t_0, \infty)$ функции $x_i(t)$, т.е. $x_i(t) \in C^1[t_0, \infty)$, $i = 1, 2, \dots, n$; в начальный момент времени t_0 значение вектора состояний предполагается известным x_0 и принадлежит некоторой открытой окрестности начала координат $D \subseteq R^n$. Матрица $X(t)$ является блочно диагональной вида

$$X(t) = \text{Diag} \left\{ \underbrace{x^T(t), x^T(t), \dots, x^T(t)}_n \right\},$$

т.е. $X(t)$ имеет одинаковые блочно диагональные элементы, равные транспонированному вектору состояний $x^T(t)$. Постоянные матрицы $A_c \in R^{n \times n}$ and $B_c \in R^{n^2 \times n}$ являются известными, матрица B_c имеет следующий блочный вид

$$B_c = \begin{pmatrix} B_{1c} \\ B_{2c} \\ \vdots \\ B_{nc} \end{pmatrix}, \quad (2)$$

где $B_{ic} \in R^{n \times n}$, $i = 1, 2, \dots, n$ являются известными постоянными матрицами. Параметрическая неопределенность в системе (1) представлена двумя неизвестными постоянными матрицами $\Delta A \in R^{n \times n}$ и $\Delta B \in R^{n^2 \times n}$. Предполагается, что эти матрицы могут принимать значения из заданных интервальных матриц с известными границами:

$$\Delta A \in [-\Delta_A, \Delta_A], \quad \Delta B \in [-\Delta_B, \Delta_B],$$

где $\Delta_A = |\Delta_A| \in R^{n \times n}$, $\Delta_B = |\Delta_B| \in R^{n^2 \times n}$ - заданные постоянные матрицы, причем матрицы ΔB и Δ_B имеют блочный вид аналогичный (2)

$$\Delta B = \begin{pmatrix} \Delta B_1 \\ \Delta B_2 \\ \vdots \\ \Delta B_n \end{pmatrix}, \quad \Delta_B = \begin{pmatrix} \Delta B_1 \\ \Delta B_2 \\ \vdots \\ \Delta B_n \end{pmatrix},$$

где $\Delta B_i, \Delta_{B_i} \in R^{n \times n}$, $i = 1, 2, \dots, n$. Операция взятия абсолютного значения $|\cdot|$ соответствующих матриц и векторов понимается в покомпонентном смысле. Так-

же предполагается, что $-A_c \notin [-\Delta_A, \Delta_A]$, это условие означает, что не все элементы интервальной матрицы $[A_c - \Delta_A, A_c + \Delta_A]$ являются одновременно нуль-содержащими.

Для любых сочетаний фиксированных значений матриц $\Delta A \in [-\Delta_A, \Delta_A]$ и $\Delta B \in [-\Delta_B, \Delta_B]$ дифференциальное уравнение (1) удовлетворяет условиям существования и единственности решения, т.е. для любого начального условия $x_0 \in \mathcal{D} \subseteq R^n$ при фиксированных значениях $\Delta A \in [-\Delta_A, \Delta_A]$ и $\Delta B \in [-\Delta_B, \Delta_B]$ через точку x_0 проходит единственная кривая уравнения (1). Для нулевого начального условия $x_0 = 0$ тривиальное решение $x(t, t_0, x_0) = x(t, t_0, 0) \equiv 0$ является положением равновесия системы (1).

Определение 1. Тривиальное решение $x(t, t_0, 0) \equiv 0$ системы (1) называется экспоненциально устойчивым при $t \rightarrow \infty$, если существуют такие положительные постоянные N и α , что для любых значений $\Delta A \in [-\Delta_A, \Delta_A]$ и $\Delta B \in [-\Delta_B, \Delta_B]$ и любого решения $x(t, t_0, x_0)$ при $x_0 \in \mathcal{D}$ справедливо неравенство

$$\|x(t, t_0, x_0)\|_2 \leq N \|x(t_0)\|_2 \exp(-\alpha(t - t_0)),$$

где $\|\cdot\|$ — Евклидова норма.

Система (1) может обладать свойством экспоненциальной устойчивости не для любых начальных условий $x_0 \in \mathcal{D}$, но для некоторого подмножества $\mathcal{D}^* \subseteq \mathcal{D}$, содержащего начало координат. Областью притяжения называется множество всех тех начальных значений x_0 , для которых система (1) обладает свойством экспоненциальной устойчивости.

Задача: определить область притяжения, построить ее внутреннюю оценку и получить условия, при которых положение равновесия $x(t, t_0, 0) \equiv 0$ нелинейной интервальной динамической системы (1) обладает свойством экспоненциальной устойчивости в смысле определения 1.

3. Основной результат

Выберем функцию Ляпунова

$$V(x) = x^T H x, \quad (3)$$

где $H \in R^{n \times n}$, $H = H^T \succ 0$ — симметрическая положительно определенная матрица, являющаяся решением матричного уравнения

$$A_c^T H + H A_c + H H = -Q, \quad (4)$$

где $Q \in R^{n \times n}$, $Q = Q^T \succ 0$ — некоторая симметрическая положительно определенная матрица.

Введем следующие интервальные матрицы $\mathbf{B}_{ic} = [B_{ic} - \Delta B_i, B_{ic} + \Delta B_i]$, $i = 1, 2, \dots, n$. Используя интервальные арифметические операции [6, 7], вычислим

$$l_i = \sum_{j=1}^n \max_{B_i \in \mathbf{B}_i, B_j \in \mathbf{B}_j} \rho \left(\frac{1}{2} (B_i B_j^T + B_j B_i^T) \right), \quad i = 1, 2, \dots, n,$$

где $\rho(\cdot)$ — спектральный радиус вещественной квадратной матрицы. Обозначим, соответственно, минимальное и максимальное собственные значения квадратной вещественной матрицы через $\lambda(\cdot)$ и $\Lambda(\cdot)$.

В пространстве R^n построим замкнутое множество

$$\mathcal{E}(\mu) = \left\{ x \in R^n \mid V(x) \leq \frac{\lambda(H)\mu}{\max_i \{l_i\}} \right\}, \quad (5)$$

где $\mu \in R$, $\mu > 0$. Множество (5) является в R^n гиперэллипсоидом с центром в начале координат.

Выполнение условий теоремы 1 обеспечивает свойство экспоненциальной устойчивости и позволяет построить внутреннюю оценку области притяжения начала координат.

Теорема 1. Пусть для заданных матриц $A_c, \Delta_A \in R^{n \times n}$, $B_c, \Delta_B \in R^{n^2 \times n}$ и некоторой симметрической положительно определенной матрицы $Q \in R^{n \times n}$, $Q = Q^T \succ 0$ выполнены следующие условия:

- матричное уравнение (4) имеет симметрическое положительно определенное решение $H \in R^{n \times n}$, $H = H^T \succ 0$,
- справедливо неравенство

$$\lambda(Q) > \rho(\Delta_A^T |H| + |H| \Delta_A).$$

Тогда тривиальное решение $x(t, t_0, 0) \equiv 0$ системы (1) экспоненциально устойчиво для $x_0 \in \mathcal{E}(\mu)$ и множество (5) при $0 < \mu < \lambda(Q) - \rho(\Delta_A^T |H| + |H| \Delta_A)$ принадлежит области притяжения начала координат.

Доказательство теоремы. Обозначим $A = A_c + \Delta A$ и $B = B_c + \Delta B$ для $\Delta A \in [-\Delta_A, \Delta_A]$ and $\Delta B \in [-\Delta_B, \Delta_B]$. Первая производная функции Ляпунова (3) в силу уравнения движения (1) представляется

$$\begin{aligned} \dot{V}(x) &= \dot{x}^T(t) H x(t) + x^T(t) H \dot{x}(t) = \\ &= x^T(t) (A^T H + H A) x(t) + x^T(t) (B^T X^T(t) H + H X(t) B) x(t) = \\ &= x^T(t) (A^T H + H A + H H) x(t) - x^T(t) (X(t) B - H)^T (X(t) B - H) x(t) + \\ &+ x^T(t) X(t) B B^T X^T(t) x(t) \leq \\ &\leq x^T(t) (A^T H + H A + H H) x(t) + x^T(t) X(t) B B^T X^T(t) x(t) \leq \\ &\leq x^T(t) (A_c^T H + H A_c + H H) x(t) + |x^T(t)| (\Delta_A^T |H| + |H| \Delta_A) |x(t)| + \\ &+ x^T(t) X(t) B B^T X^T(t) x(t). \end{aligned}$$

Оценим сверху первые два слагаемых последнего неравенства

$$\begin{aligned} & x^T(t) \left(A_c^T H + H A_c + H H \right) x(t) + \left| x^T(t) \left(\Delta_A^T |H| + |H| \Delta_A \right) \right| x(t) \leq \\ & \leq -\lambda(Q) x^T(t) x(t) + \rho \left(\Delta_A^T |H| + |H| \Delta_A \right) x^T(t) x(t). \end{aligned}$$

При положительных значениях μ и $\Delta\mu$, удовлетворяющих неравенству $0 < \mu < \mu + \Delta\mu < \lambda(Q) - \rho \left(\Delta_A^T |H| + |H| \Delta_A \right)$, будет справедливо следующее выражение

$$\begin{aligned} & -\left(\lambda(Q) - \rho \left(\Delta_A^T |H| + |H| \Delta_A \right) \right) x^T(t) x(t) + x^T(t) X(t) B B^T X^T(t) x(t) < \\ & < -(\mu + \Delta\mu) x^T(t) x(t) + x^T(t) X(t) B B^T X^T(t) x(t). \end{aligned} \quad (6)$$

Определим множество таких x , при которых правая часть выражения (6) будет отрицательной для любой матрицы $B = B_c + \Delta B$, $\Delta B \in [-\Delta_B, \Delta_B]$. Для этого достаточно обеспечить, чтобы следующая симметрическая матрица была неотрицательно определенной

$$\mu I - S, \quad (7)$$

где I — единичная матрица соответствующей размерности, $S = X(t) B B^T X^T(t)$. Известно [8], что матрица (7) будет обладать этим свойством, если выполняется условие $\|S\| \leq \mu$, где $\|\cdot\|$ — любая матричная норма. Используя матричную

норму вида $\|S\|_\infty = \max_i \sum_{j=1}^n |s_{ij}|$ и представление матрицы $S = X(t) B B^T X^T(t)$ в покомпонентном виде

$$S = X(t) B B^T X^T(t) = \begin{pmatrix} x^T(t) B_1 B_1^T x(t) & x^T(t) B_1 B_2^T x(t) & \dots & x^T(t) B_1 B_n^T x(t) \\ x^T(t) B_2 B_1^T x(t) & x^T(t) B_2 B_2^T x(t) & \dots & x^T(t) B_2 B_n^T x(t) \\ \vdots & \vdots & \ddots & \vdots \\ x^T(t) B_n B_1^T x(t) & x^T(t) B_n B_2^T x(t) & \dots & x^T(t) B_n B_n^T x(t) \end{pmatrix},$$

где $B = B_c + \Delta B$, $\Delta B \in [-\Delta_B, \Delta_B]$, $B_i = B_{ic} + \Delta B_i$, $\Delta B_i \in [-\Delta_{B_i}, \Delta_{B_i}]$,

$s_{ij} = x^T(t) B_i B_j^T x(t)$, получим неравенство

$$\mu \geq \sum_{j=1}^n \left| x^T(t) B_i B_j^T x(t) \right|, \quad i = 1, 2, \dots, n. \quad (8)$$

Получим оценку сверху суммы

$$\sum_{j=1}^n \left| x^T(t) B_i B_j^T x(t) \right|, \quad i = 1, 2, \dots, n.$$

Для этого выполним следующие преобразования

$$\sum_{j=1}^n \left| x^T(t) B_i B_j^T x(t) \right| = \sum_{j=1}^n \left| \frac{1}{2} x^T(t) \left(B_i B_j^T + B_j B_i^T \right) x(t) \right| \leq$$

$$\leq \|x(t)\|_2^2 \sum_{j=1}^n \max_{B_i \in \mathbf{B}_i} \max_{B_j \in \mathbf{B}_j} \rho \left(\frac{1}{2} (B_i B_j^T + B_j B_i^T) \right) = l_i \|x(t)\|_2^2, \quad i = 1, 2, \dots, n.$$

Сравнивая (7) и (8), запишем

$$\|x(t)\|_2^2 \leq \mu / l_i, \quad i = 1, 2, \dots, n.$$

С другой стороны,

$$V(x) = x^T(t) H x(t) \geq \lambda(H) x^T(t) x(t) = \lambda(H) \|x(t)\|_2^2$$

или

$$V(x) \leq \lambda(H) / \max_i \{l_i\}. \quad (9)$$

Таким образом, для всех x , удовлетворяющих (9), т.е. для $x_0 \in \mathcal{E}(\mu)$, симметрическая матрица (7) будет неотрицательно определенной для любой $B = B_c + \Delta B$, $\Delta B \in [-\Delta_B, \Delta_B]$. Тогда в области $\mathcal{E}(\mu)$ первая производная функции Ляпунова (3) на траекториях движения системы (1) удовлетворяет неравенству

$$\dot{V}(x) < -(\mu + \Delta\mu) x^T(t) x(t) + x^T(t) X(t) B B^T X^T(t) x(t) \leq -\Delta\mu x^T(t) x(t)$$

равномерно по $\Delta A \in [-\Delta_A, \Delta_A]$ и $\Delta B \in [-\Delta_B, \Delta_B]$. Это означает [10, 11], что тривиальное решение $x(t, t_0, 0) \equiv 0$ обладает свойством экспоненциальной устойчивости для $x_0 \in \mathcal{E}(\mu)$, а множество (5) принадлежит области притяжения начала координат. Выражения для вычислений значений α и N в определении 1 представляются как [10]:

$$\alpha = \lambda(Q) / (2\Lambda(H)), \quad N = \sqrt{\Lambda(H) / \lambda(H)}.$$

Теорема доказана.

Замечание. Для построения множества (5), представляющего внутреннюю оценку области притяжения, можно воспользоваться верхней оценкой для величин l_i , $i = 1, 2, \dots, n$, которые представляются либо условиями теоремы Гершгорина [8], либо с помощью вычислительной процедуры, представленной ниже.

Используя действия интервальной арифметики [6, 7], сформируем интервальные матрицы $\mathbf{B}_i \mathbf{B}_j^T$ и $\mathbf{B}_j \mathbf{B}_i^T$, $i, j = 1, 2, \dots, n$, и матрицу

$$\mathbf{G}_{ij} = \left(\mathbf{B}_i \mathbf{B}_j^T + \mathbf{B}_j \mathbf{B}_i^T \right) / 2, \quad i, j = 1, 2, \dots, n.$$

Следующее неравенство выполняется

$$l_i = \sum_{j=1}^n \max_{B_i \in \mathbf{B}_i} \max_{B_j \in \mathbf{B}_j} \rho \left(\frac{1}{2} (B_i B_j^T + B_j B_i^T) \right) \leq \sum_{j=1}^n \max_{G_{ij} = G_{ij}^T \in \mathbf{G}_{ij}} \rho(G_{ij}),$$

так как

$$\left\{ B_i B_j^T + B_j B_i^T \mid B_i \in \mathbf{B}_i, B_j \in \mathbf{B}_j \right\} \subseteq \mathbf{G}_{ij}, \quad i, j = 1, 2, \dots, n,$$

где знак включения понимается в теоретико-множественном смысле. Верхняя оценка для значений l_j , $j = 1, 2, \dots, n$ удовлетворяет неравенствам

$$\max_{G_{ij} = G_{ij}^T \in \mathbf{G}_{ij}} \rho(G_{ij}) \leq \lambda(G_{ijc}) + \rho(\Delta_{G_{ij}}),$$

где $\mathbf{G}_{ij} = [G_{ijc} - \Delta_{G_{ij}}, G_{ijc} + \Delta_{G_{ij}}]$. Эту оценку несложно получить на основе результатов исследований [5].

3. Числовой пример

Пусть размерность системы (1) $n = 3$ и соответствующие матрицы равны

$$A_c = \begin{pmatrix} -1.1 & 1 & 0 \\ -0.95 & -1 & -0.05 \\ 0 & 0.05 & -1 \end{pmatrix}, \quad \Delta A = \begin{pmatrix} 0.1 & 0 & 0 \\ 0.05 & 0 & 0.05 \\ 0 & 0.05 & 0 \end{pmatrix},$$

$$B_{1c} = \begin{pmatrix} 0.15 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 0 \end{pmatrix}, \quad \Delta B_1 = \begin{pmatrix} 0.05 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 0 \end{pmatrix},$$

$$B_{ic} = \Delta B_i = 0 \text{ для } i = 2, 3.$$

При выбранной матрице

$$Q = I = \begin{pmatrix} 1 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 1 \end{pmatrix}$$

решение матричного уравнения (4) представляется в виде:

$$H = \begin{pmatrix} 0.707151 & -0.028814 & -0.009662 \\ -0.028814 & 0.762911 & 0.005555 \\ -0.009662 & 0.005555 & 0.979233 \end{pmatrix}.$$

Матрица H — симметрическая положительно определенная, собственные значения которой равны $\lambda_1(H) = 0.6948$, $\lambda_2(H) = 0.7747$, $\lambda_3(H) = 0.9798$. Для проверки второго условия теоремы сформируем матрицу

$$\Delta_A^T |H| + |H| \Delta_A = \begin{pmatrix} 0.144312 & 0.041510 & 0.002685 \\ 0.041510 & 0.000555 & 0.087107 \\ 0.002685 & 0.087107 & 0.000555 \end{pmatrix}.$$

Последовательно вычисляя значения переменных во втором условии теоремы, получим

$$\lambda(Q) = 1, \quad \rho(\Delta_A^T |H| + |H| \Delta_A) = 0.1607, \quad \lambda(Q) - \rho(\Delta_A^T |H| + |H| \Delta_A) = 0.8393 > 0.$$

Так как условия теоремы выполняются, то исследуемая система обладает свойством экспоненциальной устойчивости. Параметры α и N соответственно равны

$$\alpha = \frac{1}{(2 \cdot 0.9798)} = 0.5103, \quad N = \sqrt{\frac{0.9798}{0.6948}} = 1.1875.$$

Для построения множества (5) требуется определить матрицы \mathbf{G}_{ij} , $i, j = 1, 2, 3$. Легко проверить, что все матрицы \mathbf{G}_{ij} , $i, j = 1, 2, 3$ являются нулевыми, за исключением матрицы

$$\mathbf{G}_{11} = \begin{pmatrix} [0.01, 0.04] & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 0 \end{pmatrix}.$$

Для рассматриваемого случая. Множество (5) при вычисленных значениях $\max_i \{l_i\} = 0.04$, $\lambda(H) = 0.6948$ и $0 < \mu < \lambda(Q) - \rho(\Delta_A^T |H| + |H| \Delta_A) = 0.8393$ принадлежит области притяжения начала координат рассматриваемой системы.

Следует отметить, что предложенный подход применим для исследования устойчивости нелинейных интервальных динамических систем с нелинейностями других типов.

Литература

1. Харитонов В. Л. Об асимптотической устойчивости положения равновесия семейства систем линейных дифференциальных уравнений // Дифференциальные уравнения. 1978. Т. 14, № 11. С. 2086–2088.
2. Bialas S. A necessary and sufficient condition for stability of interval matrices // Int. J. Contr. 1983. Vol. 37, No. 4. P. 717–722.
3. Karl W. C., Greschak J. P., Verghese G. C. Comments on “A necessary and sufficient condition for stability of interval matrices” // Int. J. Contr. 1984. Vol. 39, No. 4. P. 849–851.
4. Barmish B. R., Hollot C. V. Counter-example to a recent on the stability of interval matrices by Bialas // Int. J. Contr. 1984. Vol. 39, No. 5. P. 1103–1104.
5. Kreinovich V., Lakeyev A., Rohn J., Kahl P. Computational complexity and feasibility of data processing and interval computations. Dordrecht: Kluwer, 1997.
6. Алефельд Г., Херцбергер Ю. Введение в интервальные вычисления. М.: Мир, 1987.
7. Neumaier A. Interval methods for systems of equations. Cambridge University Press, 1990.
8. Гантмахер Ф. Р. Теория матриц. М.: Наука, 1988.
9. Барбашин Е. А., Табуева В. А. Динамические системы с цилиндрическим фазовым пространством. М.: Наука, 1969.
10. Демидович Б. П. Лекции по математической теории устойчивости. М.: Наука, 1967.