

Optimale Steuerung

Eugenia Fidas

Universität Konstanz

13.Juli 2010

Inhalt

1. Zustandsgleichung
2. Das Optimalsteuerproblem
3. Notwendige Optimalitätsbedingungen erster Ordnung
4. Algorithm 1 (Abstiegsverfahren)
5. Matlab Beispiel

1. Zustandsgleichung

Seien $t_f \geq t_o > 0$, $r > 0$ und $L > 0$. Wir betrachten das dynamische System

$$\dot{x}(t) = \frac{r}{2} (u_1(t) + u_2(t)) \begin{pmatrix} \cos(\psi(t)) \\ \sin(\psi(t)) \end{pmatrix} \quad \text{für } t \in (t_o, t_f], \quad (1a)$$

$$\dot{\psi}(t) = \frac{r}{2L} (u_1(t) - u_2(t)) \quad \text{für } t \in (t_o, t_f] \quad (1b)$$

mit den Anfangsbedingungen

$$x(t_o) = x_o \quad \text{und} \quad \psi(t_o) = \psi_o, \quad (1c)$$

wobei $x_o = (x_{1o}, x_{2o})^T \in \mathbb{R}^2$ gilt.

1. Zustandsgleichung

Seien $y = (x, \psi)^T : [t_0, t_f] \rightarrow \mathbb{R}^2 \times \mathbb{R}$, $y_0 = (x_0, \psi_0)^T$ und

$$f(y, u) = \begin{pmatrix} \frac{r}{2} (u_1 + u_2) \cos \psi \\ \frac{r}{2} (u_1 + u_2) \sin \psi \\ \frac{r}{2L} (u_1 - u_2) \end{pmatrix}$$

für $y = (x_1, x_2, \psi) \in \mathbb{R}^3$, $u = (u_1, u_2) \in \mathbb{R}^2$.

1. Zustandsgleichung

Kompakte Form:

$$\dot{y}(t) = f(y(t), u(t)) \text{ für } t \in (t_0, t_f] \quad \text{und} \quad y(t_0) = y_0 \quad (2)$$

autonomes Anfangswertproblem für eine gegebene Steuerung
 $u : [t_0, t_f] \rightarrow \mathbb{R}^2$

1. Zustandsgleichung

f ist stetig partiell differentierbar.

Jacobimatrix von f :

$$\begin{aligned} f'(y, u) &= \left(\frac{\partial f}{\partial y}(y, u) \mid \frac{\partial f}{\partial u}(y, u) \right) \\ &= \frac{r}{2} \left(\begin{array}{ccc|cc} 0 & 0 & -(u_1 + u_2) \sin \psi & \cos \psi & \cos \psi \\ 0 & 0 & (u_1 + u_2) \cos \psi & \sin \psi & \sin \psi \\ 0 & 0 & 0 & \frac{1}{L} & -\frac{1}{L} \end{array} \right) \end{aligned}$$

für $y = (x, \psi) \in \mathbb{R}^2 \times \mathbb{R}$ und $u = (u_1, u_2) \in \mathbb{R}^2$.

1. Zustandsgleichung

Lösbarkeit?

Picard-Lindelöf?

Globale Stetigkeit?

1. Zustandsgleichung

Nach dem Mittelwertsatz der Differentialrechnung gilt für $y_1 = (x_1, \psi_1)$, $y_2 = (x_2, \psi_2) \in \mathbb{R}^2 \times \mathbb{R}$, $u = (u_1, u_2) \in \mathbb{R}^2$ und für Zwischenstellen $\xi_1, \xi_2 \in \mathbb{R}$

$$\begin{aligned}\|f(y_1, u) - f(y_2, u)\|_2^2 &= \left\| \begin{pmatrix} \frac{r}{2} (u_1 + u_2)(\cos \psi_1 - \cos \psi_2) \\ \frac{r}{2} (u_1 + u_2)(\sin \psi_1 - \sin \psi_2) \\ 0 \end{pmatrix} \right\|_2^2 \\ &= \left\| \begin{pmatrix} -\frac{r}{2} (u_1 + u_2) \sin \xi_1 (\psi_1 - \psi_2) \\ \frac{r}{2} (u_1 + u_2) \cos \xi_2 (\psi_1 - \psi_2) \\ 0 \end{pmatrix} \right\|_2^2 \\ &= \frac{r^2}{4} |u_1 + u_2|^2 (|\cos^2 \xi_1| + |\sin^2 \xi_2|) |\psi_1 - \psi_2|^2 \\ &\leq \frac{r^2}{2} |u_1 + u_2|^2 |\psi_1 - \psi_2|^2\end{aligned}$$

1. Zustandsgleichung

Also

$$\|f(y_1, u) - f(y_2, u)\|_2 \leq L \|y_1 - y_2\|_2$$

mit $L = r |u_1 + u_2|/\sqrt{2}$.

$\Rightarrow f$ global Lipschitz-stetig

Satz von Picard-Lindelöf \Rightarrow (2) hat für jedes stetige u genau eine Lösung $y \in C^1([t_o, t_f]; \mathbb{R}^3)$

1. Zustandsgleichung

Bemerkung:

Für $u \in L^2(t_o, t_f; \mathbb{R}^2)$ gibt es genau eine schwache Lösung $y \in H^1(t_o, t_f; \mathbb{R}^3)$ von (2), die $y(t_o) = y_o$ und die Variationsgleichung

$$\int_{t_o}^{t_f} (\dot{y}(t) - f(y(t), u(t)))^T p(t) dt = 0 \quad (3)$$

für alle $p \in L^2(t_o, t_f; \mathbb{R}^3)$ erfüllt.

1. Zustandsgleichung

Ein nichtlinearer Lösungsoperator

$$\mathcal{S} : L^2(t_0, t_f; \mathbb{R}^3) \rightarrow H^1(t_0, t_f; \mathbb{R}^3)$$

mit $y = \mathcal{S}u$ ist eindeutige Lösung der Variationsgleichung (3)

mit $y(t_0) = y_0$ für die Steuerung $u \in L^2(t_0, t_f; \mathbb{R}^2)$.

2. Das Optimalsteuerproblem

Gegeben:

vorgegebene Trajektorie $x_d \in L^2(t_o, t_f; \mathbb{R}^2)$

vorgegebener nominaler Winkel $\psi_d \in L^2(t_o, t_f; \mathbb{R})$

nominale Steuerung $u_d \in L^2(t_o, t_f; \mathbb{R}^2)$

Gewichtungparameter $\alpha \geq 0$

Regularisierungsparameter $\beta, \gamma \geq 0$ mit $\beta + \gamma > 0$

2. Das Optimalsteuerproblem

Wir betrachten das Zielfunktional

$$J(y, u) = \frac{1}{2} \int_{t_0}^{t_f} \|x(t) - x_d(t)\|_2^2 + \alpha |\psi(t) - \psi_d(t)|^2 + \\ + \beta \|u(t) - u_d(t)\|_2^2 + \gamma \|\dot{u}(t)\|_2^2 dt$$

für $y \in Y := H^1(t_0, t_f; \mathbb{R}^3)$ und $u \in U$ mit

$$U = \begin{cases} L^2(t_0, t_f; \mathbb{R}^2) & \text{wenn } \gamma = 0 \text{ gilt,} \\ H^1(t_0, t_f; \mathbb{R}^2) & \text{wenn } \gamma > 0 \text{ gilt.} \end{cases}$$

2. Das Optimalsteuerproblem

Definiere Hilbertraum $Z = Y \times U$ mit der üblichen Produkttopologie.

Das nichtlineare (unendlich-dimensionale) Optimierungsproblem lautet

$$\min J(z) \quad \text{u.d.N.} \quad z = (y, u) \in Z \quad \text{und} \quad (\mathbf{P})$$

$$\begin{cases} \dot{y}(t) = f(y(t), u(t)), & t \in (t_0, t_f], \\ y(t_0) = y_0. \end{cases}$$

Da das Anfangswertproblem (2) für eine gegebene Steuerung eindeutig lösbar ist, können wir mit $y(u) = \mathcal{S}(u)$ die zur Steuerung u eindeutig definierte Lösung von (2) bezeichnen.

2. Das Optimalsteuerproblem

reduziertes Zielfunktional: $\hat{J} : U \rightarrow \mathbb{R}$

$$\hat{J}(u) = J(y(u), u) \quad \text{für } u \in U.$$

reduziertes Problem

$$\min \hat{J}(u) \quad \text{u.d.N.} \quad u \in U. \quad (\hat{\mathbf{P}})$$

2. Das Optimalsteuerproblem

Ist u^* eine (lokale) optimale Lösung von $(\hat{\mathbf{P}})$, so löst offenbar $(y(u^*), u^*)$ das Problem (\mathbf{P}) .

Ist umgekehrt $(y(u^*), u^*)$ eine optimale Lösung von (\mathbf{P}) , so löst u^* das reduzierte Problem $(\hat{\mathbf{P}})$.

Wir bezeichnen eine Lösung u^* von $(\hat{\mathbf{P}})$ als **optimale Steuerung** und die dazugehörige Lösung $y(u^*)$ des Anfangswertproblems (2) den zu u^* gehörende **optimale Zustand**.

3. Notwendige Optimalitätsbedingungen erster Ordnung

Zunächst führen wir die Lagrangefunktion $\mathcal{L} : Z \times Y \times \mathbb{R}^3 \rightarrow \mathbb{R}$ ein:

$$\mathcal{L}(z, p, p_0) = J(z) + \langle \dot{y} - f(y(\cdot), u(\cdot)), p \rangle_{L^2(t_0, t_f; \mathbb{R}^3)} + (y(t_0) - y_0)^T p_0$$

$$= J(z) + \int_{t_0}^{t_f} (\dot{y}(t) - f(y(t), u(t)))^T p(t) dt + (y(t_0) - y_0)^T p_0$$

für $z = (y, u) \in Z$ und $(p, p_0) \in Y \times \mathbb{R}^3$.

3. Notwendige Optimalitätsbedingungen erster Ordnung

Richtungsableitungen von \mathcal{L} :

Die Ableitung nach (p, p_0) ergibt die Zustandsgleichung (1).

Seien $z = (y, u) \in X$ und $(p, p_0) \in Y \times \mathbb{R}^3$.

Richtungsableitung nach der Variablen y :

$$\frac{\partial \mathcal{L}}{\partial y}(z, p, p_0) y_\delta = \int_{t_0}^{t_f} (x(t) - x_d(t)) x_\delta(t) + \alpha (\psi(t) - \psi_d(t)) \psi_\delta(t) dt$$

$$+ \int_{t_0}^{t_f} (\dot{y}_\delta(t) - \frac{\partial f}{\partial y}(y(t), u(t)) y_\delta(t))^T p(t) dt + y_\delta(t_0)^T p_0$$

für eine beliebige Richtung $y_\delta = (x_\delta, \psi_\delta) \in Y$.

3. Notwendige Optimalitätsbedingungen erster Ordnung

Mit $p = (p_x, p_\psi)$, $p_x \in H^1(t_o, t_f; \mathbb{R}^2)$, $p_\psi \in H^1(t_o, t_f; \mathbb{R})$,
und $p_o = (p_{x_o}, p_{\psi_o}) \in \mathbb{R}^2 \times \mathbb{R}$ folgt:

$$\begin{aligned} \frac{\partial \mathcal{L}}{\partial x}(z, p, p_o)x_\delta &= \int_{t_o}^{t_f} (x(t) - x_d(t))x_\delta(t) dt + x_\delta(t_o)^T p_{x_o} \\ &+ \int_{t_o}^{t_f} \left(\dot{x}_\delta(t) - \frac{\partial f}{\partial x}(y(t), u(t))x_\delta(t) \right)^T p_x(t) dt, \end{aligned} \quad (4a)$$

$$\begin{aligned} \frac{\partial \mathcal{L}}{\partial \psi}(z, p, p_o)\psi_\delta &= \int_{t_o}^{t_f} \alpha (\psi(t) - \psi_d(t))\psi_\delta(t) dt \\ &+ \int_{t_o}^{t_f} \left(\dot{\psi}_\delta(t) - \frac{\partial f}{\partial \psi}(y(t), u(t))\psi_\delta(t) \right) p_\psi(t) dt + \psi_\delta(t_o)p_{\psi_o} \end{aligned} \quad (4b)$$

3. Notwendige Optimalitätsbedingungen erster Ordnung

Gleich Null setzen und partielle Integration von (4a) liefert:

$$\int_{t_0}^{t_f} \left(x^*(t) - x_d(t) - \dot{p}_x^*(t) - \frac{\partial f}{\partial x}(y^*(t), u^*(t))^T p_x^*(t) \right)^T x_\delta(t) dt \\ + p_x^*(t_f)^T x_\delta(t_f) - (p_x^*(t_0) - p_{x_0}^*)^T x_\delta(t_0) = 0$$

für eine beliebige Richtung $x_\delta \in H^1(t_0, t_f; \mathbb{R}^2)$.

3. Notwendige Optimalitätsbedingungen erster Ordnung

Für Richtungen $x_\delta \in H^1(t_o, t_f; \mathbb{R}^2)$ mit $x_\delta(t_o) = x_\delta(t_f) = 0$:

$$\int_{t_o}^{t_f} \left(x^*(t) - x_d(t) - \dot{p}_x^*(t) - \frac{\partial f}{\partial x}(y^*(t), u^*(t))^T p_x^*(t) \right)^T x_\delta(t) dt = 0.$$

für alle $x_\delta \in H_0^1(t_o, t_f; \mathbb{R}^2) \subset H^1(t_o, t_f; \mathbb{R}^2)$.

3. Notwendige Optimalitätsbedingungen erster Ordnung

Damit löst die duale Variable p_x^* die Differentialgleichung

$$-\dot{p}_x^*(t) = \frac{\partial f}{\partial x}(y^*(t), u^*(t))^T p_x^*(t) + x_d(t) - x^*(t) \quad \text{für } t \in (t_o, t_f). \quad (5a)$$

Verwende (5a) und wähle $x_\delta \in H^1(t_o, t_f; \mathbb{R}^2)$ mit $x_\delta(t_o) = 0$ und dann mit $x_\delta(t_f) = 0$, so erhalten wir die Bedingungen

$$p_x^*(t_f) = 0 \quad \text{und} \quad p_{x,o}^* = p_x^*(t_o). \quad (5b)$$

Analog für die partielle Ableitung nach ψ und verwende (4b)

3. Notwendige Optimalitätsbedingungen erster Ordnung

Insgesamt mit (5) erhalten wir mit $y_d = (x_d, \psi_d) \in L^2(t_o, t_f; \mathbb{R}^3)$ die **dualen Gleichungen** für $t \in [t_o, t_f]$

$$-\dot{p}^*(t) = \frac{\partial f}{\partial y}(y^*(t), u^*(t))^T p^*(t) + \begin{pmatrix} x_d(t) - x^*(t) \\ \alpha(\psi_d(t) - \psi^*(t)) \end{pmatrix} \quad (6a)$$

$$p^*(t_f) = 0, \quad (6b)$$

$$p_o^* = p^*(t_o). \quad (6c)$$

Hierbei gilt:

$$\frac{\partial f}{\partial y}(y^*(t), u^*(t))^T p^*(t) = \begin{pmatrix} 0 & 0 & \frac{r}{2} (-(u_1^*(t) + u_2^*(t)) \sin(\psi^*(t))) \\ 0 & 0 & \frac{r}{2} (u_1^*(t) + u_2^*(t)) \cos(\psi^*(t)) \\ 0 & 0 & 0 \end{pmatrix}^T \begin{pmatrix} p_x^*(t) \\ p_\psi^*(t) \end{pmatrix}$$

für $t \in [t_o, t_f]$.

3. Notwendige Optimalitätsbedingungen erster Ordnung

Die Lösung des linearen Anfangswertproblems (6a)-(6b) wird zu $z^* = (y^*, u^*)$ gehörender **adjungierter** oder **dualer Zustand** genannt.

3. Notwendige Optimalitätsbedingungen erster Ordnung

Ableitung von \mathcal{L} nach der Variablen u :

$$\begin{aligned} & \frac{\partial \mathcal{L}}{\partial u}(z, p, p_0) u_\delta \\ &= \int_{t_0}^{t_f} \left(\beta (u(t) - u_d(t)) - \frac{\partial f}{\partial u}(y(t), u(t))^T p(t) \right)^T u_\delta(t) + \gamma \dot{u}(t)^T \dot{u}_\delta(t) dt. \end{aligned}$$

Setze die partielle Ableitung der Lagrangefunktion an einer kritischen Stelle $z^* = (y^*, u^*)$ und (p^*, p_0^*) gleich Null, es folgt:

$$\int_{t_0}^{t_f} \left(\beta (u^*(t) - u_d(t)) - \frac{\partial f}{\partial u}(y^*(t), u^*(t))^T p^*(t) \right)^T u_\delta(t) + \gamma \dot{u}^*(t)^T \dot{u}_\delta(t) dt = 0.$$

3. Notwendige Optimalitätsbedingungen erster Ordnung

Für $\gamma = 0$ erhalten für alle $t \in [t_o, t_f]$:

$$\beta (u^*(t) - u_d(t)) - \frac{\partial f}{\partial u}(y^*(t), u^*(t))^T p^*(t) = 0 \quad (7)$$

3. Notwendige Optimalitätsbedingungen erster Ordnung

Andernfalls löst u^* das nichtlineare (Dirichlet-)Randwertproblem

$$\begin{aligned} -\gamma \ddot{u}^*(t) + \beta u^*(t) &= \frac{\partial f}{\partial u}(y^*(t), u^*(t))^T p^*(t) + \beta u_d(t) \quad \text{für } t \in (t_o, t_f), \\ \dot{u}^*(t_o) &= \dot{u}^*(t_f) = 0. \end{aligned} \tag{8}$$

Hierbei gilt

$$\frac{\partial f}{\partial u}(y^*(t), u^*(t))^T p^*(t) = \frac{r}{2} \begin{pmatrix} \cos(\psi^*(t)) & \sin(\psi^*(t)) & \frac{1}{L} \\ \cos(\psi^*(t)) & \sin(\psi^*(t)) & -\frac{1}{L} \end{pmatrix} p^*(t) \quad \text{für } t \in [t_o, t_f]$$

3. Notwendige Optimalitätsbedingungen erster Ordnung

Das Optimalitätssystem erster Ordnung aus:
der Zustandsgleichung (2):

$$\dot{y}(t) = f(y(t), u(t)) \text{ für } t \in (t_0, t_f] \quad \text{und} \quad y(t_0) = y_0$$

den adjungierten Gleichungen (6):

$$\begin{aligned} \dot{p}^*(t) &= \frac{\partial f}{\partial y}(y^*(t), u^*(t))^T p^*(t) + \begin{pmatrix} x_d(t) - x^*(t) \\ \alpha(\psi_d(t) - \psi^*(t)) \end{pmatrix} \text{ für } t \in [t_0, t_f] \\ p^*(t_f) &= 0, \\ p_0^* &= p^*(t_0) \end{aligned}$$

der Optimalitätsbedingung (7) bzw. (8):

$$\beta(u^*(t) - u_d(t)) - \frac{\partial f}{\partial u}(y^*(t), u^*(t))^T p^*(t) = 0 \quad \text{für alle } t \in [t_0, t_f]$$

3. Notwendige Optimalitätsbedingungen erster Ordnung

Die Ableitung $J'(u)$ des reduzierten Zielfunktional \hat{J} an einer Stelle u für $\gamma = 0$:

$$\hat{J}'(u) = \beta (u - u_d) - \frac{\partial f}{\partial u}(y(\cdot), u(\cdot))^T p \in L^2(t_o, t_f; \mathbb{R}^2), \quad (9)$$

wobei $y = (x, \psi)^T \in Y$ die Zustandsgleichung (2) löst und p die Lösung von

$$-\dot{p}(t) = \frac{\partial f}{\partial y}(y(t), u(t))^T p(t) + y_d(t) - y(t) \quad \text{für } t \in [t_o, t_f), \quad (10a)$$

$$p(t_f) = 0, \quad (10b)$$

$$p_o = p(t_o) \quad (10c)$$

ist.

3. Notwendige Optimalitätsbedingungen erster Ordnung

Für $\gamma > 0$ an der Stelle von (9):

$$\hat{J}'(u) = -\gamma \ddot{u} + \beta(u - u_d) - \frac{\partial f}{\partial u}(y(\cdot), u(\cdot))^T p \in H^{-1}(t_0, t_f; \mathbb{R}^3) = U', \quad (11)$$

wobei U' den Dualraum von U bezeichnet.

Dann die Richtungsableitung von \hat{J} and u in Richtung $u_\delta \in U$:

$$\langle \hat{J}'(u), u_\delta \rangle_{U', U} = \int_{t_0}^{t_f} \gamma \dot{u}(t)^T \dot{u}_\delta(t) + \left(\beta(u(t) - u_d(t)) - \frac{\partial f}{\partial u}(y(t), u(t))^T p(t) \right)^T u_\delta(t) dt.$$

3. Notwendige Optimalitätsbedingungen erster Ordnung

Beachte, dass wir den Dualraum von $L^2(t_0, t_f; \mathbb{R}^2)$ mit $L^2(t_0, t_f; \mathbb{R}^2)$ identifizieren können, das heißt, im Fall $\gamma = 0$ verwenden wir $U' = U$.

Als numerisches Verfahren können wir z.B. das in Algorithmus 1 verwenden.

4. Algorithm 1 (Abstiegsverfahren)

- 1: Wähle die Eingabedaten für (2): $t_o \geq 0$, $t_f > t_o$, $y_o = (x_o, \psi_o) \in \mathbb{R}^3$.
- 2: Wähle Daten für (**P**): $\alpha \geq 0$, $\beta > 0$, $\gamma = 0$ ($\beta + \gamma > 0$),
 $y_d = (x_d, \psi_d) \in L^2(t_o, t_f; \mathbb{R}^3)$, $u_d \in L^2(t_o, t_f; \mathbb{R}^2)$.
- 3: Wähle Parameter für das Verfahren: $k_{\max} \in \mathbb{N}$, $\varepsilon_{\text{abs}} \geq \varepsilon_{\text{rel}} > 0$,
 $c \in [10^{-4}, 10^{-3}]$, $u^0 \in U$.
- 4: Berechne die Lösung y^0 von (2) für $u = u^0$.
- 5: Werte $\hat{J}(u^0) = J(y^0, u^0)$ aus.
- 6: Bestimme p^0 aus (10) mit $y = y^0$ und $u = u^0$.
- 7: Berechne $\hat{J}'(u^0)$ gemäß (9).

4. Algorithm 1 (Fortsetzung 1)

8: Setze $k = 0$.

9: **while** ($\|\hat{J}'(u^k)\|_{U'} \leq \varepsilon_{\text{abs}} + \varepsilon_{\text{rel}} \|\hat{J}'(u^0)\|_{U'}$ **or** $k \geq k_{\text{max}}$)

10: Wähle die Richtung $d^k = -J'(u^k) / \langle J'(u^k), J'(u^k) \rangle$ mit $\langle \hat{J}'(u^k), d^k \rangle_{U', U} < 0$.

11: Bestimme Schrittweitenparameter $s_k > 0$, so dass die Armijo-Regel

$$\hat{J}'(u^k + s_k d^k) \leq \hat{J}'(u^k) + cs_k \langle \hat{J}'(u^k), d^k \rangle_{U', U}$$

erfüllt ist.

12: Setze $u^{k+1} = u^k + s_k d^k$ und $k = k + 1$;

4. Algorithm 1 (Fortsetzung 2)

13: **if**($\|\hat{J}'(u^k)\|_{U'} > \varepsilon_{\text{abs}} + \varepsilon_{\text{rel}} \|\hat{J}'(u^0)\|_{U'}$ **or** $k < k_{\text{max}}$)

14: Berechne die Lösung y^k von (2) für $u = u^0$.

15: Werte $\hat{J}(u^k) = J(y^k, u^k)$ aus.

16: Bestimme p^k aus (10) mit $y = y^k$ und $u = u^k$.

17: **end if**

18: **end while**