

И. В. Молчанюк, А. В. Плотников (Одес. акад. стр-ва и архитектуры)

НЕОБХОДИМЫЕ И ДОСТАТОЧНЫЕ УСЛОВИЯ ОПТИМАЛЬНОСТИ В ЗАДАЧАХ УПРАВЛЕНИЯ С НЕЧЕТКИМ ПАРАМЕТРОМ

A problem of the high-speed operation is considered for linear control systems with a fuzzy right-hand side. For this problem, a notion of optimal solution is introduced and necessary and sufficient conditions of the optimality are established in the form of the maximum principle.

Розглянуто задачу швидкодії для лінійних систем управління з нечіткою правою частиною. Для цієї задачі введено поняття оптимального розв'язку і встановлено необхідні та достатні умови оптимальності у формі принципу максимуму.

1. Введение. Понятие нечеткого множества было введено в работе [1]. В работе [2] впервые рассматривалось нечеткое дифференциальное уравнение, которое в дальнейшем исследовалось в работах [3 – 11], а в работах [12 – 14] изучались дифференциальные включения с нечеткой правой частью, которые затем рассматривались в [15, 16].

В данной работе продолжены исследования, начатые в [17]. В ней рассматривается одна из задач теории оптимального управления — задача быстродействия, которая сформулирована для управляемых дифференциальных включений с нечеткой правой частью. Получены необходимые и достаточные условия оптимальности в форме принципа максимума, которые обобщают результаты, полученные в [18] для обычных управляемых дифференциальных включений.

2. Основные определения и обозначения. Пусть $\text{Comp}(R^n)$ ($\text{Conv}(R^n)$) — пространство непустых (выпуклых) компактных подмножеств евклидова пространства R^n с метрикой Хаусдорфа

$$h(A, B) = \min\{r \geq 0 \mid A \subset B + S_r(0), B \subset A + S_r(0)\},$$

где $A, B \subset \text{Comp}(R^n)$ (или $\text{Conv}(R^n)$), $S_r(a)$ — шар в R^n радиуса r с центром в точке $a \in R^n$.

Пусть поведение управляемой системы описывается линейным дифференциальным уравнением

$$\dot{x} = A(t)x + B(t)u + C(t)v, \quad x(0) = x_0, \quad (1)$$

где $x \in R^n$ — фазовый вектор; $A(t)$, $B(t)$, $C(t)$ — матрицы соответствующих размерностей $(n \times n)$, $(n \times m)$, $(n \times k)$; $u(t) \in U(t)$ — вектор управления; $U(\cdot): R_+^1 \rightarrow \text{Conv}(R^m)$ — многозначное отображение; $v(t) \in V$ — нечеткое внешнее воздействие (помеха); V — нечеткое множество с характеристической функцией $\mu(x)$, $\mu(\cdot): R^k \rightarrow [0, 1]$, которые удовлетворяют следующим условиям.

Предположение 1. 1. Матрицы $A(t)$, $B(t)$, $C(t)$ измеримы на R_+^1 .

2. Существуют суммируемые функции $a(t) > 0$, $b(t) > 0$, $c(t) > 0$ такие, что $\|A(t)\| \leq a(t)$, $\|B(t)\| \leq b(t)$, $\|C(t)\| \leq c(t)$ для почти всех $t \in R_+^1$.

3. Многозначное отображение $U(t)$ измеримо на R_+^1 .

4. Существует суммируемая функция $g(t) > 0$ такая, что $h(U(t), \{0\}) \leq g(t)$ для почти всех $t \in R_+^1$.

5. Характеристическая функция $\mu(\cdot): R^k \rightarrow [0, 1]$ удовлетворяет условиям:

а) функция $\mu(\cdot)$ модальная, т. е. существует хотя бы одно $y_0 \in R^k$ такое, что $\mu(y_0) = 1$;

- б) функция $\mu(y)$ непрерывна по y на R^k ;
- в) для любого $\varepsilon > 0$ и $y \in \{y \in R^k \mid \mu(y) \in (0, 1)\}$ существуют $y_1, y_2 \in R^k$ такие, что $\|y - y_1\| < \varepsilon$, $\|y - y_2\| < \varepsilon$ и $\mu(y_1) < \mu(y) < \mu(y_2)$;
- г) множество $[V]^0 = \text{cl}\{y \mid \mu(y) > 0\}$ компактно.

Определение 1. Множество всех измеримых селекторов $U(\cdot)$ на $[0, \infty)$ будем называть множеством допустимых управлений и обозначать U .

Введем нечеткое управляемое дифференциальное включение

$$\dot{x} \in A(t)x + B(t)u + C(t)V, \quad x(0) = x_0, \tag{2}$$

которое получается из системы (1) в результате замены параметра $v(t)$ на нечеткое множество V .

Обозначим через $X(u)$ нечеткий пучок траекторий системы (2), соответствующих допустимому управлению $u(\cdot)$, а через $X(t, u)$ сечение пучка $X(u)$ в момент времени $t > 0$, которое является некоторым нечетким множеством с характеристической функцией $\chi(x, t, u)$.

Замечание 1. Из [17] известно, что при выполнении условий предположения 1 нечеткое многозначное отображение $X(\cdot, u)$ имеет вид

$$X(t, u) = \Phi(t)x_0 + \Phi(t) \int_0^t \Phi^{-1}(s) B(s) u(s) ds + \Phi(t) \int_0^t \Phi^{-1}(s) C(s) V ds \tag{3}$$

и является нечетко выпуклым и нечетко компактным в каждый момент времени $t > 0$ и абсолютно непрерывным на R_+^1 , характеристическая функция $\chi(x, t, u)$ удовлетворяет условию 5 предположения 1 по x для всех $t \geq 0$ и всех допустимых управлений $u(\cdot)$, $\Phi(t)$ — матрица Коши дифференциального уравнения $\dot{x} = A(t)x$, а интеграл в последнем слагаемом понимается в смысле [19].

Определение 2. Нечетким множеством достижимости $Y(T)$ системы (2) назовем множество всех нечетких множеств $X(T, u)$, т. е.

$$Y(T) = \{X(T, u) \mid u(\cdot) \in U\}.$$

Замечание 2. Из [17] известно, что при выполнении условий предположения 1 нечеткое множество достижимости $Y(T)$ является выпуклым и компактным множеством нечетких множеств.

3. Задачи быстрогодействия нечеткими пучками траекторий. Рассмотрим следующую задачу оптимального управления: определить минимальную величину $T > 0$ и допустимое управление $u^*(\cdot) \in U$ такие, что для соответствующего сечения пучка $X(T, u^*)$ системы (2) выполняется одно из условий

$$X(T, u^*) \cap S_k \neq \emptyset, \tag{4}$$

$$X(T, u^*) \subset S_k, \tag{5}$$

$$X(T, u^*) \supset S_k, \tag{6}$$

где S_k — нечеткое целевое множество с характеристической функцией $\zeta(x)$, удовлетворяющей условию 5 предположения 1.

Определение 3. Будем говорить, что пара $(u^*(\cdot), X(T, u^*))$ удовлетворяет условию максимума на отрезке $[0, T]$, если существует для всех $t \in [0, T]$ векторная функция $\psi(\cdot)$ — решение сопряженной системы

$$\dot{\psi} = -A^T(t)\psi(t), \quad \psi(0) \in S_1(0), \tag{7}$$

и выполнены условия:

1) условие максимума: для почти всех $t \in [0, T]$

$$(u^*(t), \psi(t)) = C(B(t)U(t), \psi(t)); \quad (8)$$

2) условие трансверсальности на S_k :

а) для случая (4)

$$C([X(T, u^*)]^1, \psi(T)) = -C([S_k]^1, -\psi(T)); \quad (9)$$

б) для случая (5): для любого $\alpha \in [0, 1]$

$$C([X(T, u^*)]^\alpha, \psi(T)) \leq C([S_k]^\alpha, \psi(T))$$

и существует хотя бы одно $\alpha' \in [0, 1]$ такое, что

$$C([X(T, u^*)]^\alpha, \psi(T)) = C([S_k]^\alpha, \psi(T));$$

в) для случая (6): для любого $\alpha \in [0, 1]$

$$C([X(T, u^*)]^\alpha, -\psi(T)) \leq C([S_k]^\alpha, -\psi(T))$$

и существует хотя бы одно $\alpha' \in [0, 1]$ такое, что

$$C([X(T, u^*)]^\alpha, -\psi(T)) = C([S_k]^\alpha, -\psi(T)),$$

где $[G]^\alpha$ — α -срезка нечеткого множества [1], т. е.

$$[G]^\alpha = \begin{cases} \{y | \beta(y) \geq \alpha\}, & \alpha \in (0, 1], \\ \text{cl}\{y | \beta(y) > 0\}, & \alpha = 0, \end{cases}$$

$\beta(\cdot)$ — характеристическая функция нечеткого множества G , $C(X, \psi) = \max_{x \in X} (x, \psi)$ — опорная функция множества $X \in \text{Comp}(R^n)$ по вектору $\psi \in R^n$ [20].

Обозначим

$$Z(T) = \int_0^T \Phi(T)\Phi^{-1}(s)C(s)V ds = \int_0^T \Phi(T)\Phi^{-1}(s)C(s)ds V.$$

Теорема 1 (необходимое условие оптимальности). Пусть справедливы условия предположения 1, $u^*(\cdot)$ — оптимальное управление, а $X(\cdot, u^*)$ — соответствующий ему пучок системы (2).

Тогда пара $(u^*(\cdot), X(\cdot, u^*))$ удовлетворяет следующим условиям:

1) принципу максимума на $[0, T]$;

2) существует множество $K \in \text{Comp}(R^n)$ такое, что:
для случая (5)

$$K = \{k \in R^n | Z(T) + k \subset S_k\}, \quad (10)$$

для случая (6)

$$K = \{k \in R^n | S_k \subset Z(T) + k\} \quad (11)$$

и управление $u^*(\cdot)$ удовлетворяет условию

$$\Phi(T)x_0 + \int_0^T \Phi(T)\Phi^{-1}(s)B(s)u^*(s)ds \in K.$$

Доказательство. Рассмотрим подробно задачу (2), (4).

Для доказательства применим схему рассуждений, аналогичную используемой при доказательстве принципа максимума для линейных дифференциальных уравнений [20].

Пусть $u^*(\cdot)$ — оптимальное управление, $X(\cdot, u^*)$ — соответствующий ему пучок системы (1), который удовлетворяет граничным условиям:

- 1) $X(T, u^*) \in Y(T)$;
- 2) $X(T, u^*) \cap S_k \neq \emptyset$.

Очевидно, что из предположения 1 условие $[X(T, u^*)]^1 \cap [S_k]^1 \neq \emptyset$ гарантирует выполнение условия 2. Это означает, что для любого $\psi \in S_1(0)$

$$\max_{X \in [Y(T)]^1} C(X, \psi) \geq -C([S_k]^1, -\psi). \quad (12)$$

Следовательно,

$$p \equiv \max_{X \in [Y(T)]^1} \min_{\psi \in S_1(0)} C(X, \psi) + C([S_k]^1, -\psi) \geq 0. \quad (13)$$

Действительно, если $p < 0$, то не существует такого множества $X \in [Y(T)]^1$, чтобы для всех $\psi \in S_1(0)$ выполнялось неравенство

$$C(X, \psi) + C([S_k]^1, -\psi) \geq 0,$$

что противоречит неравенству (12).

Покажем, что существуют $\psi = \bar{\psi} \in S_1(0)$ и $X = [X(T, u^*)]^1$, при которых $p < 0$. Из соотношения $[X(T, u^*)]^1 \cap [S_k]^1 \neq \emptyset$ следует, что для любого $\psi \in S_1(0)$

$$q(T, \psi) = C([X(T, u^*)]^1, \psi) + C([S_k]^1, -\psi) \geq 0. \quad (14)$$

Поскольку $[X(T, u^*)]^1$ непрерывно зависит от времени [17], функция $q(T, \psi)$ непрерывна по ψ и T .

Если предположить, что $q(T, \psi) > 0$ для любого $\psi \in S_1(0)$, а следовательно, и $p > 0$, то получим

$$q^0(T) = \min_{\psi \in S_1(0)} q(T, \psi) \geq \gamma > 0,$$

где функция $q^0(T)$ непрерывна. Следовательно, найдется $\tau < T$ такое, что $q^0(\tau) \geq 0$. Это означает, что для любого $\psi \in S_1(0)$

$$C([X(\tau, u^*)]^1, \psi) + C([S_k]^1, -\psi) \geq 0,$$

т. е. $[X(T, u^*)]^1 \cap [S_k]^1 \neq \emptyset$. Это противоречит оптимальности времени T .

Если предположить, что $p > 0$ и максимум в (13) достигается при $X \neq [X(T, u^*)]^1$, то аналогично предыдущему приходим к противоречию.

Таким образом, существует вектор $\psi \in S_1(0)$ такой, что

$$C([X(T, u^*)]^1, \bar{\psi}) = \max_{X \in [Y(T)]^1} C(X, \bar{\psi}), \quad (15)$$

$$C\left([X(T, u^*)]^1, \bar{\psi}\right) = -C\left([S_k]^1, -\bar{\psi}\right). \quad (16)$$

Из соотношений (3) и (15) получаем

$$\left(\int_0^T \Phi(T)\Phi^{-1}(s)B(s)u^*(s)ds, \bar{\psi}\right) = \max_{u(\cdot) \in U} \left(\int_0^T \Phi(T)\Phi^{-1}(s)B(s)u(s)ds, \bar{\psi}\right). \quad (17)$$

Из (17), используя свойства интеграла и скалярной функции, получаем

$$\left(\Phi(T)\Phi^{-1}(t)B(t)u^*(t), \bar{\psi}\right) = \max_{u(\cdot) \in U} \left(\Phi(T)\Phi^{-1}(t)B(t)u(t), \bar{\psi}\right) \quad (18)$$

для почти всех $t \in [0, T]$.

Учитывая, что $\psi(t) = \left(\Phi(T)\Phi^{-1}(t)\right)^T \bar{\psi} / \left\| \left(\Phi(T)\Phi^{-1}(t)\right)^T \bar{\psi} \right\|$ является решением сопряженной системы $\dot{\psi} = -A^T(t)\psi(t)$ с начальным условием $\psi(0) \in S_1(0)$ для почти всех $t \in [0, T]$, соотношения (16) и (18) можно записать в форме соответствующих соотношений принципа максимума.

Случаи (5) и (6) доказываются аналогично с небольшими изменениями условия (12):

для случая (5): для любого $\alpha \in [0, 1]$

$$\max_{X \in [Y(T)]^\alpha} -C(X, -\psi) + C\left([S_k]^\alpha, -\psi\right) \geq 0$$

и существует $\alpha' \in [0, 1]$ такое, что

$$\max_{X \in [Y(T)]^{\alpha'}} -C(X, -\psi) + C\left([S_k]^{\alpha'}, -\psi\right) = 0;$$

для случая (6): для любого $\alpha \in [0, 1]$

$$\max_{X \in [Y(T)]^\alpha} C(X, \psi) + C\left([S_k]^\alpha, \psi\right) \geq 0$$

и существует $\alpha' \in [0, 1]$ такое, что

$$\max_{X \in [Y(T)]^{\alpha'}} C(X, \psi) + C\left([S_k]^{\alpha'}, \psi\right) = 0.$$

Тем самым условие 1 доказано. Нетрудно видеть, что условие 2 — гарантия того, что $X(T, u^*) \subset S_k$ или $X(T, u^*) \supset S_k$.

Теорема доказана.

Теорема 2 (достаточное условие оптимальности). Пусть справедливы условия предположения 1, $u^*(\cdot)$ — допустимое управление и пара $(u^*(\cdot), X(T, u^*))$ удовлетворяет условиям теоремы 1 на $[0, T]$. Кроме того, пусть $X(t, u^*)$ удовлетворяет усиленному условию трансверсальности на множестве S_k с функцией $\psi(\cdot)$, т. е. для всех $t \in [0, T)$ выполняются неравенства:

а) для случая (4)

$$C\left([X(t, u^*)]^1, \psi(t)\right) < -C\left([S_k]^1, -\psi(t)\right); \quad (19)$$

б) для случая (5)

$$C\left([X(t, u^*)]^\alpha, \psi(t)\right) > C\left([S_k]^\alpha, \psi(t)\right) \quad (20)$$

для любого $\alpha \in [0, 1]$;

в) для случая (6)

$$C\left([X(t, u^*)]^\alpha, \psi(t)\right) < C\left([S_k]^\alpha, \psi(t)\right) \tag{21}$$

для любого $\alpha \in [0, 1]$.

Тогда $u^*(\cdot)$ — оптимальное управление.

Доказательство проведем для случаев (2) и (4) (в случаях (5) и (6) доказательство проводится аналогично с небольшими изменениями). Выполнимость необходимых условий оптимальности очевидна. Докажем дополнительное условие оптимальности.

Заметим, что если условие (19) выполняется для некоторого $\bar{t} \in [0, T)$, то условие $X(\bar{t}, u^*) \cap S_k \neq \emptyset$ не имеет места.

Возьмем произвольное допустимое управление $u^*(\cdot) \in U$ на отрезке $[0, t_1]$, $t_1 < T$, и пусть $X(\cdot, u)$ — соответствующая ему многозначная траектория. Учитывая выполнение условия максимума, получаем неравенство

$$C\left([X(t, u)]^1, \psi(t)\right) \leq C\left([X(t, u^*)]^1, \psi(t)\right), \tag{22}$$

которое справедливо для всех $t \in [0, t_1]$.

Пусть теперь задан некоторый момент времени $\tau \leq t_1 < T$. Тогда из (19) и (22) следует, что

$$C\left([X(\tau, u)]^1, \psi(\tau)\right) < -C\left([S_k]^1, -\psi(\tau)\right),$$

т. е. условие $X(\tau, u) \cap S_k \neq \emptyset$ не выполняется.

В силу произвольности выбора допустимого управления $u(\cdot) \in U$ можно утверждать, что не существует ни одной многозначности траектории, удовлетворяющей при $\tau < T$ условию $X(\tau, u) \cap S_k \neq \emptyset$. Тем самым управление $u^*(\cdot)$ оптимально.

Теорема 2 доказана.

Пример. Пусть поведение объекта описывается системой

$$\begin{aligned} \dot{x}_1 &= x_2 + u_1 + v_1, & x_1(0) &= 0, \\ \dot{x}_2 &= -x_1 + u_2 + v_2, & x_2(0) &= 0, \end{aligned}$$

где (x_1, x_2) — фазовое пространство; $u \in U = S_1(0)$ — вектор управления; $v \in R^2$ — вектор помехи, который принадлежит нечеткому множеству V с характеристической функцией

$$v(v) = \begin{cases} \sqrt{1 - 4v_1^2 - 9v_2^2}, & 4v_1^2 + 9v_2^2 \leq 1, \\ 0, & 4v_1^2 + 9v_2^2 > 1. \end{cases}$$

Рассмотрим задачу быстродействия типа (4), т. е. необходимо найти такие T^* и $u^*(\cdot)$, что $T^* = \min T(u)$, $X(T^*, u^*) \cap S_k \neq \emptyset$, где S_k — нечеткое множество с характеристической функцией

$$\zeta(x) = \begin{cases} \sqrt{1 - (x_1 - 2\pi)^2 - (x_2 - 1)^2}, & x \in Q, \quad x_2 \geq 1, \\ \sqrt{1 - (x_1 - 2\pi)^2}, & x \in Q, \quad -1 < x_2 < 1, \\ \sqrt{1 - (x_1 - 2\pi)^2 - (x_2 + 1)^2}, & x \in Q, \quad x_2 \leq -1, \\ 0, & x \notin Q, \end{cases}$$

$$Q = \left\{ (x_1, x_2) \in R^2 \left| \begin{array}{l} 2\pi - 1 \leq x_1 \leq 2\pi + 1, \\ \sqrt{1 - (x_1 - 2\pi)^2} - 1 \leq x_2 \leq \sqrt{1 - (x_1 - 2\pi)^2} + 1 \end{array} \right. \right\}.$$

Легко проверить, что оптимальная пара $T^* = 2\pi$ и $u^*(t) = (\cos t, -\sin t)$ удовлетворяет условиям теоремы 1:

- 1) $(u^*(t), \psi(t)) = C(U, \psi(t))$ для почти всех $t \in [0, 2\pi]$;
- 2) $C([X(T^*, u^*)]^1, \psi(T^*)) = -C([S_k]^1, -\psi(T^*))$,

где $\psi(t) = (\cos t, -\sin t)$ для почти всех $t \in [0, 2\pi]$, $[X(T^*, u^*)]^1 = (T^* \cos T^*, -T^* \sin T^*) = (2\pi, 0)$, $[S_k]^1 = \{(x_1, x_2) \mid x_1 = 2\pi, -1 \leq x_2 \leq 1\}$.

1. Zadeh L. A. Fuzzy sets // Inf. Control. – 1965. – 8. – P. 338 – 353.
2. Kaleva O. Fuzzy differential equations // Fuzzy Sets and Systems. – 1987. – 24, № 3. – P. 301 – 317.
3. Комлева Т. А., Плотников А. В., Плотникова Л. И. Усреднение нечетких дифференциальных уравнений // Тр. Одес. политехн. ун-та. – 2007. – Вып. 1 (27). – С. 185 – 190.
4. Комлева Т. А., Плотников А. В., Скрипник Н. В. Ω -пространство и его связь с теорией нечетких множеств // Там же. – 2007. – Вып. 2 (28). – С. 182 – 191.
5. Kaleva O. The Cauchy problem for fuzzy differential equations // Fuzzy Sets and Systems. – 1990. – 35. – P. 389 – 396.
6. Kaleva O. The Peano theorem for fuzzy differential equations revisited // Ibid. – 1998. – № 98. – P. 147 – 148.
7. Kaleva O. O notes on fuzzy differential equations // Nonlinear Anal. – 2006. – № 64. – P. 895 – 900.
8. Lakshmikantham V., Granna Bhaskar T., Vasundhara Devi J. Theory of set differential equations in metric spaces. – Cambridge Sci. Publ., 2006. – 204 p.
9. Park J. Y., Han H. K. Existence and uniqueness theorem for a solution of fuzzy differential equations // Int. J. Math. and Math. Sci. – 1999. – 22, № 2. – P. 271 – 279.
10. Park J. Y., Han H. K. Fuzzy differential equations // Fuzzy Sets and Systems. – 2000. – № 110. – P. 69 – 77.
11. Vorobiev D., Seikkala S. Towards the theory of fuzzy differential equations // Ibid. – 2002. – № 125. – P. 231 – 237.
12. Aubin J. P. Fuzzy differential inclusions // Probl. Control and Inform. Theory. – 1990. – 19, № 1. – P. 55 – 67.
13. Baidosov V. A. Differential inclusions with fuzzy right-hand side // Sov. Math. – 1990. – 40, № 3. – P. 567 – 569.
14. Baidosov V. A. Fuzzy differential inclusions // J. Appl. Math. and Mech. – 1990. – 54, № 1. – P. 8 – 13.
15. Hullermeier E. An approach to modeling and simulation of uncertain dynamical systems // Int. J. Uncertainty Fuzziness Knowledge Based Systems. – 1997. – № 5. – P. 117 – 137.
16. Lakshmikantham V., Mohapatra R. Theory of fuzzy differential equations and inclusions // Ser. Math. Anal. and Appl. – London: Taylor and Francis, Ltd., 2003. – 143 p.
17. Плотников А. В., Молчанюк И. В. Линейные системы управления с нечетким параметром // Нелінійні коливання. – 2006. – 9, № 1. – С. 63 – 73.
18. Плотников А. В. Линейные системы управления с многозначными траекториями // Кибернетика. – 1987. – № 4. – С. 130 – 131.
19. Puri M. L., Ralescu D. A. Differential of fuzzy functions // J. Math. Anal. and Appl. – 1983. – № 91. – P. 552 – 558.
20. Благодатских В. И. Линейная теория оптимального управления. – М.: Изд-во Моск. ун-та, 1978. – 95 с.

Получено 17.09.07,
после доработки — 28.05.08