Nelineární systémy

4 / Stabilita a Lyapunovova funkce

Přehled

1. Úvod
2. Příklady
3. Matematické základy
4. Stabilita a Lyapunovova funkce
5. Řízení NS pomocí přibližné linearizace. Gain scheduling
6. Řízení NS pomocí strukturálních metod – základní pojmy
7. Struktura a řízení NS s jedním vstupem a výstupem
8. Struktura a řízení NS s více vstupy a výstupy

Historie

- studium stability dynamických systémů má bohatou historii
- podílelo se na ní mnoho významných matematiků, fyziků a astronomů
- zájem přitahoval „problém stability *n* těles“ (stabilita sluneční soustavy)
- Torricelli (1608-1647): princip nejmenší celkové energie:
  Systém těles je ve stabilním rovnovážném stavu když je ve stavu (lokálně) minimální energie.

konzervativní = zachovává energii (kinetickou+potenciální)
disipativní = energie klesá

- Laplace a Lagrange, 18. stol.:
  konzervativního systému je stav s nulovou kinetickou a minimální potenciální energií stab. rovnovážný
- další: platí i pro disipativní (energie klesá podél trajektorie)
- Ale abstraktní definice stability až
- Lyapunov 1892 :
- definuje funkce vhodné k popisu „energie“
- a definuje co znamená „klesání podél trajektorie“

Opakování

Systém $\dot{x} = f(t,x), x(t_0) = x_0, x \in R^n, t \geq 0$ je

- autonomní: *f* nezávisí explicitně na *t:* $f(x)$
- lineární: $f(x,t) = A(t)x(t),\ t \geq 0$
- lineární autonomní $f(x,t) = Ax(t),\ t \geq 0$
- po částech spojitý v t:
  nejvýše konečně mnoho skokových nespojitostí

Označíme-li kruh (kouli) $B_h = B(0,h)$,
pak řekneme, že nějaká vlastnost platí

- lokálně, když platí $\forall x_0 \in B_h$ pro nějaké *h*
- globálně, když platí $\forall x_0 \in R^n$
- semi-globálně, když platí $\forall x_0 \in B_h$ pro každé *h,* ale s jinými parametry
- stejnoměrně (uniformně), když platí $\forall t \geq 0$

Opakování / 2

- funkce *f* je lokálně Lipschitzovsky spojitá v *x* když pro nějaké $h > 0 \;\; \exists l > 0$ takové, že

$$\|f(x_1,t) - f(x_2,t)\| \le L\|x_1 - x_2\| \;\; \forall x_1, x_2 \in B_h, t \ge 0$$

LIP

- konstanta *L* je Lipschitzova konstanta
- funkce $f(x)$ je lokálně Lipschitzovsky spojitá na oblasti (otevřené a souvislé množině) když každý bod *D* oblasti má okolí D_0, ve kterém L. podmínka platí s nějakou konstantou L_0
- funkce je L. na množině *W* když L. podmínka je splněna ve všech bodech *W* se stejnou konstantou *L*
- lokálně L. na oblasti *D* neznamená L. na *D*, protože tam podmínka nemusí platit stejnoměrně (se stejnou konstantou)
- ale pokud *D* je kompakt, pak to platí.

$$x_1^2 - x_2^2 = (x_1 - x_2)(x_1 + x_2) \le L\|x_1 - x_2\|$$

$$L = \sup(x_1 + x_2)$$

- funkce $f(x)$ je globálně L. pokud je *L* na celém R^n stejná
- pro funkci $f(x,t)$ se L. podmínka se vždy předpokládá stejnoměrná v *t*, tj. *L* nezávisí na *t*.

Opakování / 3

- funkce Lipschitzovsky spojitá v *x* je spojitá v *x* (dokonce stejnoměrně)
- pokud má *f* omezené parciální derivace v *x*, pak je Lipschitzovsky spojitá.
- Označíme-li $D_1 f(x,t) = \left[\frac{\partial f_i}{\partial x_j} \right]$ matici parciálních derivací dle *x*, pak z

$$\boxed{\left\| D_1 f(x,t) \right\| < l}$$

plyne, že *f* je Lipschitzova s Lipschitzovou konstantou *l* (kdekoli nerovnost platí) – <u>viz Věta o střední hodnotě</u>
- x^* je ekvilibrium (rovnovážný bod), když $f(x^*,t) = 0, \forall t \geq 0$
- posunutím počátku do ekvilibria x^* uděláme z počátku e.
- protože to usnadní značení, budeme zde předpokládat, že počátek je ekvilibrium

Definice stability

Rychlost růstu / klesání

Věta

Je-li $f(x,t)$ L. v *x* s konstantou *l* a po částech spojitá v *t*, a má-li e. *x* = 0, pak řešení *x(t)* splňuje $|x_0| e^{l(t-t_0)} \geq |x(t)| \geq |x_0| e^{-l(t-t_0)}$ pokud *x(t)* zůstane v B_h

Z věty plyne

- řešení zůstane v B_h aspoň konečnou dobu
- je-li *f* globálně L., pak nemá „únik v konečném čase“
- řešení nemůže konvergovat k nule rychleji než exponenciálně

Důkaz:

- protože $|x| = x^T x$, platí $\left|\frac{d}{dt}|x|^2\right| = 2|x|\left|\frac{d}{dt}|x|\right| = 2\left|x^T \frac{d}{dt} x\right| \leq 2|x|\left|\frac{d}{dt} x\right|$
- tedy $\left|\frac{d}{dt}|x|\right| \leq \left|\frac{d}{dt} x\right|$. Díky L a $f(x,0)=0$ z toho plyne, že $-l|x| \leq \frac{d}{dt}|x| \leq l|x|$
- důkaz končí dvojnásobnou aplikací BG lemmatu.

Lyapunovovská stabilita

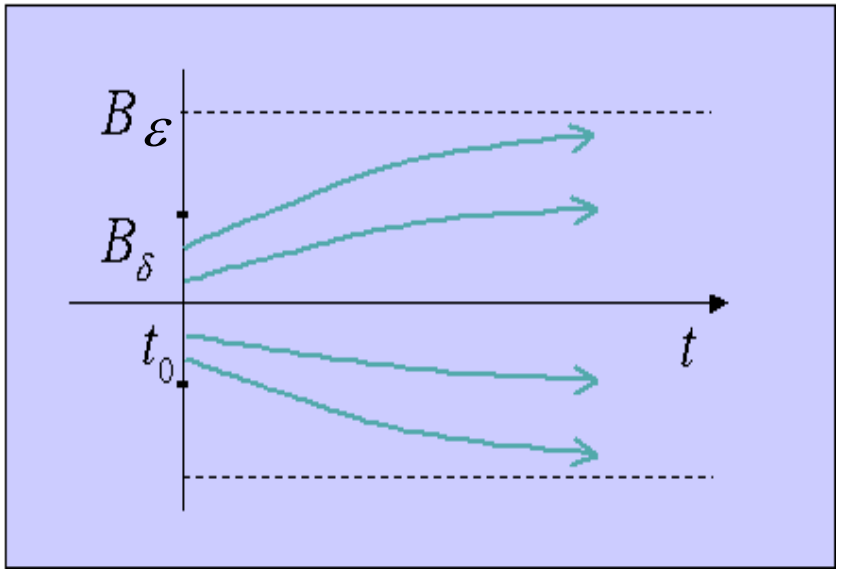
DEFINICE Lyapunovská stabilita

Ekvilibrium $x = 0$ je Lyapunovsky stabilní jestliže

$$\forall t_0 \geq 0 \wedge \forall \varepsilon > 0 \ \exists \delta(t_0, \varepsilon) > 0 : |x_0| \leq \delta(t_0, \varepsilon) \Rightarrow |x(t)| < \varepsilon \quad \forall t \geq t_0$$

kde $x(t)$ je řešení začínající z x_0 v čase t_0 .

- <u>neformálně:</u>
  čím blížeji řešení začne,
  tím blížeji zůstane, přičemž
  se lze přibližovat neomezeně.
- Jedná se vlastně o
  spojitou závislost na
  počátečních podmín.
  v neomezeném čase



Stejnoměrná stabilita

DEFINICE Stejnoměrná stabilita

Ekvilibrium $x = 0$ je stejnoměrně stabilní jestliže v předchozí definici $\delta(\varepsilon)$ nezávisí na t_0 .

- stejnoměrně stabilní e. se s rostoucím časem nestává postupně méně stabilní
- zejména $\delta(t_0, \varepsilon)$ okolí nutné k udržení trajektorií uvnitř ε okolí nejde s rostoucím časem k nule.

Asymptotická stabilita

DEFINICE Asymptotická stabilita

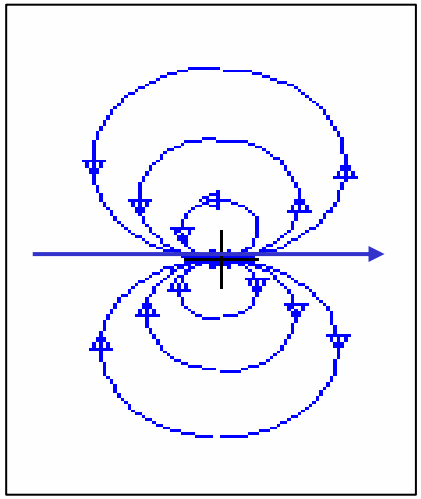
Ekvilibrium $x = 0$ je asymptoticky stabilní jestliže

- je Lyapunovovsky stabilní a
- je atraktor, tj. $\forall t_0 \geq 0 \; \exists \delta(t_0) > 0 : |x_0| \leq \delta \Rightarrow \lim_{t \to 0} |x(t)| = 0$

- Definice dvě různé podmínky.
- To se může zdát přehnané, ale není: konvergující trajektorie nezaručují stabilitu.
- Druhé podmínce se někdy říká kvaziasymptotická stabilita

Příklad: nestabilní atraktor

Uvažme systém $\begin{aligned}\dot{x}_1 &= x_1^2 - x_2^2 \\ \dot{x}_2 &= 2x_1x_2\end{aligned}$ s fázovým portrétem:



- všechny trajektorie jdou do počátku
- vyjma té na ose x_1
- spojíme-li „všechna nekonečna“ do jednoho bodu (tzv. jednobodová kompaktifikace nebo průmět na kouli),
- pak i tato konverguje do počátku
- ale: e. není Lyapunovsky stabilní
- pro sebemenší B_δ tato trajektorie opustí B_ε

- tedy chyba je v tom, že sice všechny trajektorie konvergují k počátku, ale některé z nich před tím jdou „moc daleko“

Stejnoměrná asymptotická stabilita

DEFINICE Stejnoměrná asymptotická stabilita

Ekvilibrium $x = 0$ je stejnoměrně asymptoticky stabilní jestliže

- je Lyapunovsky stabilní a
- trajektorie konvergují k 0 stejnoměrně, tj. existuje $\delta > 0$ a funkce $\gamma(\tau, x_0): R_+ \times R^n \to R_+$ taková, že

$$\forall x_0 \in B_\delta : \lim_{\tau \to \infty} \gamma(\tau, x_0) = 0$$

a

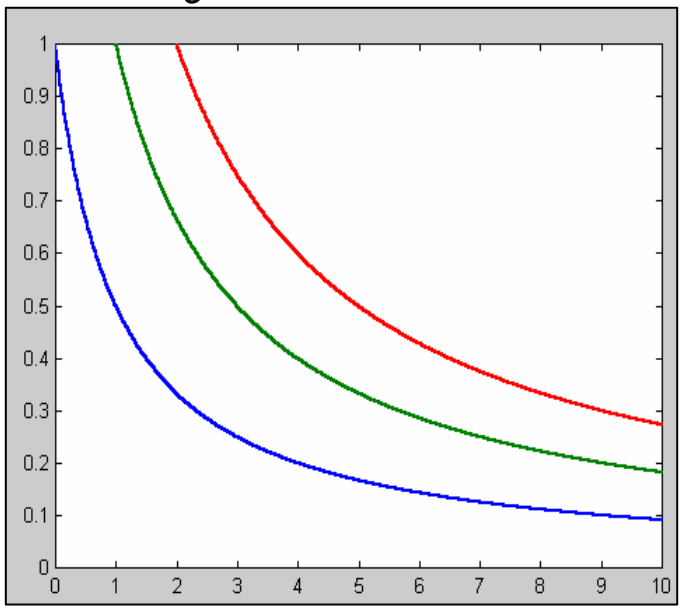
$$|x_0| \le \delta \Rightarrow |x(t)| \le \gamma(t - t_0, x_0) \quad \forall t \ge t_0$$

Příklad

- systém $\dot{x} = -x/(1+t)$ má řešení $$x(t) = \frac{1+t_0}{1+t}\,x(t_0)$$

```
» dsolve('Dx=x/(1+t)','x(t0)=xt0')
ans = xt0*(t0+1)/(t+1)
```

- řešení konverguje k 0 pro všechna t_0 , ale
- s rostoucím t_0 stále pomaleji
- tedy je asymptoticky stabilní
- ale ne stejnoměrně
- uvažte limitu



Globální asymptotická stabilita

DEFINICE Globální asymptotická stabilita

Ekvilibrium $x = 0$ je globálně asymptoticky stabilní jestliže

- je stejnoměrně Lyapunovsky stabilní a
- $\forall x_0 \in R^n : \lim_{t \to 0} | x(t) | = 0$

DEFINICE Globální stejnoměrná asymptotická stabilita

Ekvilibrium $x = 0$ je globálně stejnoměrně asymptoticky stabilní

- když je globálně asymptoticky stabilní a
- konvergence trajektorií do počátku je stejnoměrná v čase, tj. existuje funkce $\gamma(\tau, x_0) : R_+ \times R^n \to R_+$ taková, že

$$|x(t)| \le \gamma(t - t_0, x_0) \quad \forall t \ge t_0$$

- tyto definice stability nepožadují zvláštní rychlost konvergence
- nemusí konv. exponenciálně (jako lin.), ale třeba jako $\frac{1}{t}, \frac{1}{\sqrt{t}}$

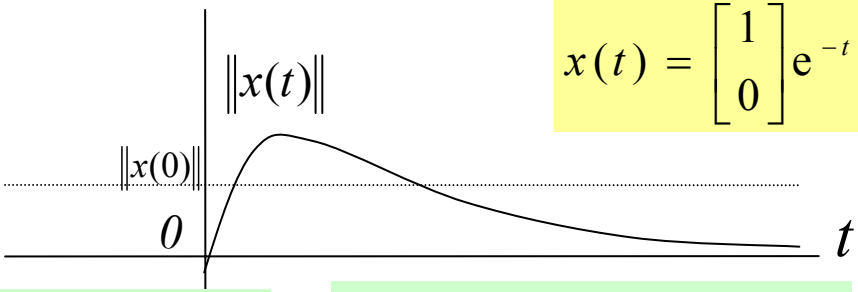
Exponenciální stabilita

DEFINICE Exponenciální stabilita

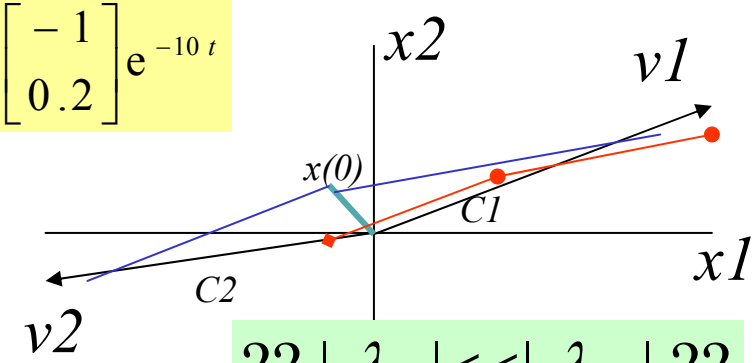
Ekvilibrium $x = 0$ je exponenciálně stabilní jestliže

$$\exists m, \alpha > 0 : |x(t)| \le m e^{-\alpha(t-t_0)} |x_0|, \ \forall \in B_h, t \ge t_0 \ge 0$$

- konstanta α je rychlost konvergence
- globální exponenciální stabilita = nerovnost platí $\forall x_0 \in R^n$
- exponenciální stabilita je obecně silnější než asymptotická stabilita
- *m* charakterizuje „překývnutí“ - i pro lin. syst. s výhradně reálnými póly!!!



$$x(t) = \begin{bmatrix} 1 \\ 0 \end{bmatrix} e^{-t} + \begin{bmatrix} -1 \\ 0.2 \end{bmatrix} e^{-10t}$$



$$\dot{x} = Ax, x \in R^2, \lambda_{1,2} < 0$$
$$Av_1 = \lambda_1 v_1, Av_2 = \lambda_2 v_2$$

$$x(t) = C_1 v_1 e^{\lambda_1 t} + C_2 v_2 e^{\lambda_2 t}$$
$$C_1 v_1 + C_2 v_2 = x(0)$$

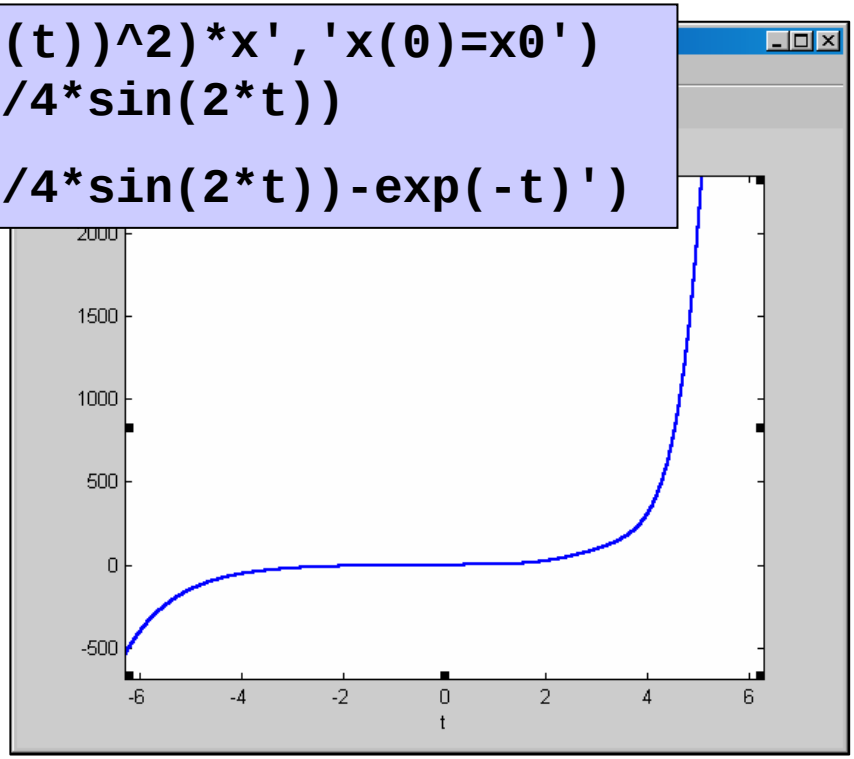
$$?? \ |\lambda_1| << |\lambda_2| \ ??$$

Příklad 1

- systém $\dot{x} = -(1+\sin^2 t)x$ má v 0 exponenciálně stabilní e
- rychlost konvergence je 1

```
» dsolve('Dx=-(1+(sin(t))^2)*x','x(0)=x0')
ans = x0*exp(-3/2*t+1/4*sin(2*t))

» ezplot('exp(3/2*t-1/4*sin(2*t))-exp(-t)')
```



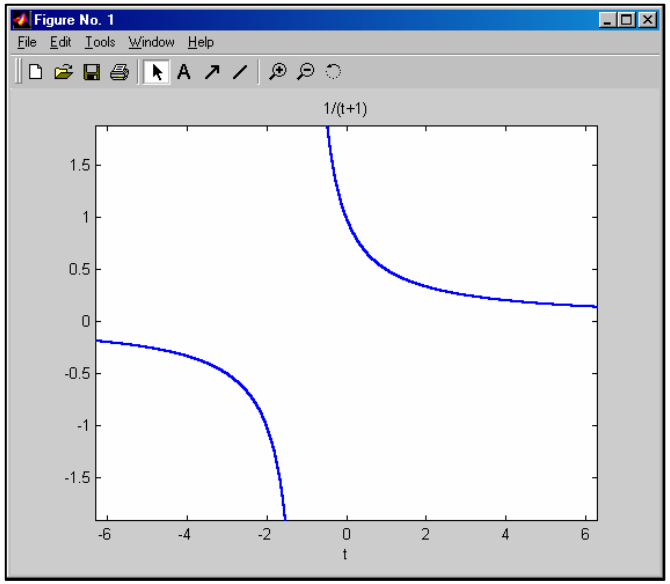
Příklad 2

- řešení systému $\dot{x} = -x^2,\ x(0) \neq 0$ konverguje k 0,
- ale pomaleji než exponenciálně a jen pro *x(0)>0*

```
» sol=dsolve('Dx=-x^2','x(0)=x0')
sol =  1/(t+1/x0)

» sol1=dsolve('Dx=-x^2','x(0)=1')
sol1 =  1/(t+1)

» ezplot(sol1)
```



- e. je stabilní asymptoticky,

  ale ne exponenciálně
- <u>Jiný příklad:</u>

$$\dot{x} = -x^3, x(t_0) = x_0$$

$$\frac{dx}{dt} = -x^3 \Rightarrow \frac{dx}{-x^3} = dt \Rightarrow \frac{1}{2x^2} - \frac{1}{2x_0^2} = t - t_0 \Rightarrow x(t) = \sqrt{\frac{x_0^2}{2(t-t_0)x_0^2 + x_0^2}}$$

Metoda separace proměnných

Lineární autonomní systémy – analýza řešení

Lineární autonomní systém $\dot{x} = Ax,\ x(0) = x_0$

- e. v počátku
- izolované e. $(\det A \neq 0)$ nebo podprostor e. $(\text{null } A)$
- nemůže mít vícenásobná izolovaná e. (z principu superpozice plyne, že lineární kombinace e. je e.)
- má řešení $x(t) = e^{At} x_0$
- *A* má (komplexní) Jordanův tvar $J = P^{-1}AP = \text{block diag}[J_1, \ldots, J_r]$

- Jordanův blok řádu *m* příslušný vlastnímu č. λ_i
- když λ_i přísluší *m* lineárně nezávislých vlastních vektorů

$$J_i = \begin{bmatrix} \lambda_i & 1 & 0 & \ldots & \ldots & 0 \\ 0 & \lambda_i & 1 & 0 & \ldots & 0 \\ \vdots & & \ddots & & & \vdots \\ \vdots & & & \ddots & & 0 \\ \vdots & & & & \ddots & 1 \\ 0 & \ldots & \ldots & \ldots & 0 & \lambda_i \end{bmatrix}_{m \times m}$$

Lineární autonomní systémy – pokračování

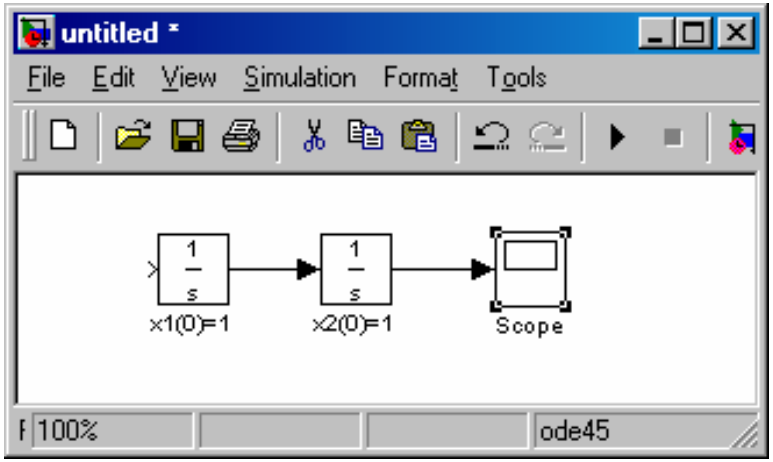
- Pak $$e^{At} = Pe^{Jt}P^{-1} = \sum_{i=1}^{r}\sum_{k=1}^{m_i} t^{k-1}e^{\lambda_i t}R_{ik}$$
- e. je globálně asymptoticky stabilní právě když

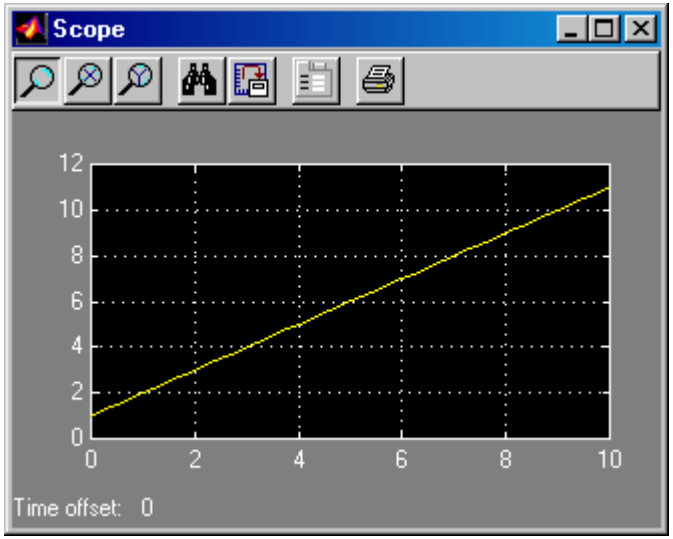
$$\forall \lambda_i : \mathrm{Re}\,\lambda_i < 0$$

- e. Lyapunovovsky stabilní právě když
  - $$\forall \lambda_i : \mathrm{Re}\,\lambda_i \le 0$$
  - každému λ_i přísluší Jordanův blok řádu 1, tj. každému *k* násobnému vlastnímu číslu přísluší právě *k* bloků řádu jedna a tedy *k* lineárně nezávislých vlastních vektorů

Příklad: Je spojení dvou integrátorů stabilní?

Sériové spojení



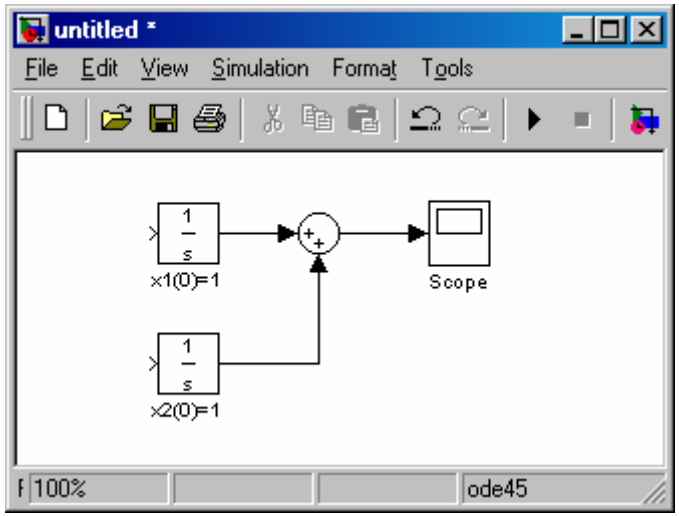


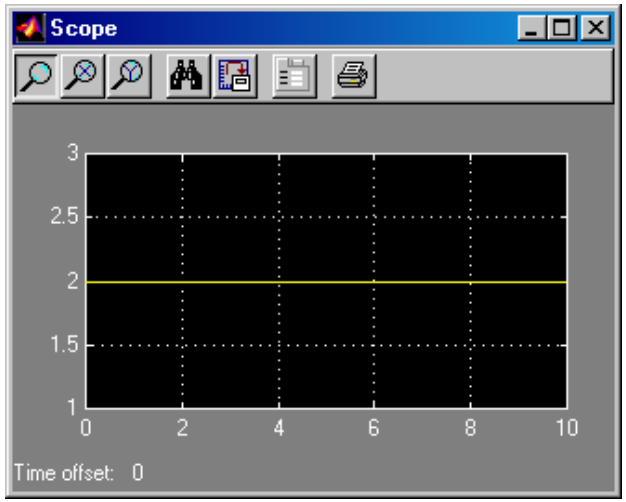
$$A = \begin{bmatrix} 0 & 1 \\ 0 & 0 \end{bmatrix} \qquad \lambda_1 = \lambda_2 = 0 \qquad y(t) = tx_{10} + x_{20}$$

- Není ani asymptoticky ani Laypunovsky stabilní.

Příklad / 2

Paralelní spojení





$$A = \begin{bmatrix} 0 & 0 \\ 0 & 0 \end{bmatrix} \qquad \lambda_1 = \lambda_2 = 0 \qquad y(t) = x_{10} + x_{20}$$

- Je Lyapunovovsky stabilní! Kde je rozdíl?

První Lyapunovova metoda

- Určuje lokální stabilitu e.
- pomocí linearizace v tomto e.
- Pro autonomní systém $\dot{x} = f(x)$ s e. $\bar{x}$, kde *f* je v tomto bodu spojitě diferencovatelná
- zavedeme odchylku $y = x - \bar{x}$
- a systém nahradíme lineární rovnicí $\dot{y} = Ay$
- kde

$$A = \left[\frac{\partial f}{\partial x}\right]_{\bar{x}} = \begin{bmatrix} \frac{\partial f_1}{\partial x_1} & \frac{\partial f_2}{\partial x_2} & \cdots & \frac{\partial f_1}{\partial x_n} \\ \vdots & \vdots & & \vdots \\ \frac{\partial f_n}{\partial x_1} & \frac{\partial f_n}{\partial x_2} & \cdots & \frac{\partial f_n}{\partial x_n} \end{bmatrix}_{\bar{x}}$$

je Jacobiho matice v bodě. Značíme ji také *J* nebo *Df* .

Lokální stabilita z linearizace

Lokální stabilita

- Jestliže mají všechna v.č. matice *A* záporné reálné části, pak je e. lokálně asymptoticky stabilní.
- Jestliže aspoň jedno v.č. matice *A* má kladnou reálnou část, pak e. není Lyapunovsky stabilní.
- Jestliže jedno nebo více v.č. má nulovou reálnou část, a všechna ostatní v.č. mají zápornou r.č., stabilitu nelze z linearizace určit.

Příklad 2 - Systémy 1. řádu

Pro systém prvního řádu $\dot{x} = f(x)$
je vyšetření lokální stability jednoduché:

- Protože jakobián je jednoduše derivace $f'(\bar{x})$, platí:
- Pokud $f'(\bar{x}) < 0$, e. je asymptoticky stabilní.
- Pokud $f'(\bar{x}) > 0$, e. je nestabilní
- Konečně jestliže $f'(\bar{x}) = 0$, pak z lineární aproximace stabilitu neurčíme.

Druhá (přímá) Lyapunovova metoda

- Umožňuje určit stabilitu bez integrace rovnice
- Inspirována disipativním systémem (kde e. je stabilní pokud při pohybu po trajektorii se akumulovaná energie snižuje a v e. je minimální)
- pro obecnější systémy se používají zobecnělé energie, tzv. Lyapunovovy funkce
- umožňuje určit i globální stabilitu

Lyapunovova metoda pro autonomní sys.

PŘEDPOKLADY

- Uvažme nejprve autonomní systém $\dot{x} = f(x)$
- kde funkce $f : D \to R^n$ je lokálně Lipschitzovské zobrazení oblasti $D \subset R^n$ na R^n

DEFINICE

Reálná funkce $V(x) : R^n \to R$ spojitá na *D* je na *D*

- pozitivně definitní když: $V(0) = 0$ a $V(x) > 0 \;\; \forall x \in D - \{0\}$
- pozitivně semidefinitní když -"- a $V(x) \geq 0 \;\; \forall x \in D - \{0\}$
- negativně definitní když $-V(x)$ je tam pozitivně definitní
- negativně semidefinitní když $-V(x)$ je tam pozitivně semidefinitní

Kvadratická forma

Kvadratická forma

- příklad skalární funkce u které
- snadno zjistíme znaménko definitnosti
- definice

$$V(x) = x^T P x = \sum_{i=1}^{n} \sum_{j=1}^{n} p_{ij} x_i x_j$$

- *P* je symetrická matice
- forma je pozitivně (semi)definitní
- $\Leftrightarrow$ v.č. matice *P* jsou kladná (nezáporná)
- $\Leftrightarrow$ hlavní minory *P* jsou kladné (nezáporné)
- negativitu zjistíme zkoumáním $-V(x)$

Příklad

Uvažme

$$V(x) = ax_1^2 + 2x_1x_3 + ax_2^2 + 4x_2x_3 + ax_3^2$$

$$= \begin{bmatrix} x_1 & x_2 & x_3 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} a & 0 & 1 \\ 0 & a & 2 \\ 1 & 2 & a \end{bmatrix} \begin{bmatrix} x_1 \\ x_2 \\ x_3 \end{bmatrix} = x^T P x$$

- hlavní minory *P* jsou $a, a^2, a(a^2-5)$
- forma je pozitivně definitní pro $a > \sqrt{5}$
- pozitivně semidefinitní pro $a \geq \sqrt{5}$
- forma je negativně definitní pro $a < \sqrt{5}$
- negativně semidefinitní pro $a \leq \sqrt{5}$
- je indefinitní pro $a \in (-\sqrt{5}, \sqrt{5})$

Lyapunovova funkce

DEFINICE

Reálná spojitě diferencovatelná funkce $V(x): D \to R$ je Lyapunovova jestliže

- je pozitivně definitní na *D* obsahující počátek
- její derivace podél trajektorií systému $\dot{V}(x)$ je na *D* negativně semidefinitní

Derivace podél trajektorií systému

- tzv. Lieova derivace *V* podél *f*
- $$\dot{V}(x) = \sum_{i=1}^{n} \frac{\partial V}{\partial x_i} \dot{x}_i = \sum_{i=1}^{n} \frac{\partial V}{\partial x_i} f_i(x)$$

$$\dot{x}_i = f_i(x) \leftarrow \dot{x} = f(x)$$

$$= \left[\frac{\partial V}{\partial x_1}, \frac{\partial V}{\partial x_2}, \cdots, \frac{\partial V}{\partial x_n} \right] \begin{bmatrix} f_1(x) \\ f_2(x) \\ \vdots \\ f_n(x) \end{bmatrix} = \frac{\partial V}{\partial x} f(x)$$

- tato derivace závisí na rovnicích systému
- platí

$$\dot{V}(x_0) = \frac{d}{dt} V\left(\Phi(t, t_0, x_0)\right)\Big|_{t=0}$$

- též směrová derivace podél vektorového pole *f(x)*

Lyapunovova věta

VĚTA - Lyapunov

Nechť $x = 0$ je e. systému a $D \subset R^n$ je oblast obsahující $x = 0$.

Nechť $V : D \to R$ je spojitě diferencovatelná funkce, taková že

- $V(0) = 0$ a $V(x) > 0 \;\; \forall x \in D - \{0\}$
- $\dot{V}(x) \leq 0 \;\; \forall x \in D$

Pak $x = 0$ je Lyapunovsky stabilní.

Pokud navíc

- $\dot{V}(x) < 0 \;\; \forall x \in D - \{0\}$

pak $x = 0$ je asymptoticky stabilní.

Slovy:

Počátek je (asymptoticky) stabilní jestliže existuje spojitě diferencovatelná pozitivně definitní funkce (Lyapunovova) $V(x)$ taková, že $\dot{V}(x)$ je negativně semidefinitní (definitní).

Jak najít Lyapunovu funkci

- Lyapunova metoda poskytuje postačující podmínku stability
- Pokud máme vhodnou funkci, ověření je snadné, ale
- není známa žádní systematická metoda jak L. funkci najít.
- Někdy můžeme na základě fyzikální analogie najít funkci energie,
- jindy musíme postupovat metodou „pokusu a omylu“
- Pro inspiraci následuje pár příkladů

Oblast atrakce - povodí

- Jak daleko můžeme začít aby trajektorie ještě konvergovala k (asymptoticky) počátku?
- Oblast atrakce, oblast asymptotické stability, povodí je množina všech bodů *x* takových, že z nich řešení konverguje
- najít jí analyticky může být obtížně nebo i nemožné
- pomocí L. funkce můžeme najít její podmnožiny
- ale může to být dost konzervativní.
- Zajímavá otázka: kdy je oblastí atrakce celý prostor R^n, tj.
- kdy je počátek globálně asymptoticky stabilní ?

Jednoduchý postřeh:

- Pokud je e. globálně asymptoticky stabilní, pak už systém nemůže mít další e. (sporem).
- Takže pro systémy s více různými e. nemá smysl globální asymptotickou stabilitu zkoumat. (Např. u normálního kyvadla).

- Podmínka navíc: radiální neohraničenost Ljap. Fce., tj. Ljap. fce. roste do nekonečna ve všech směrech

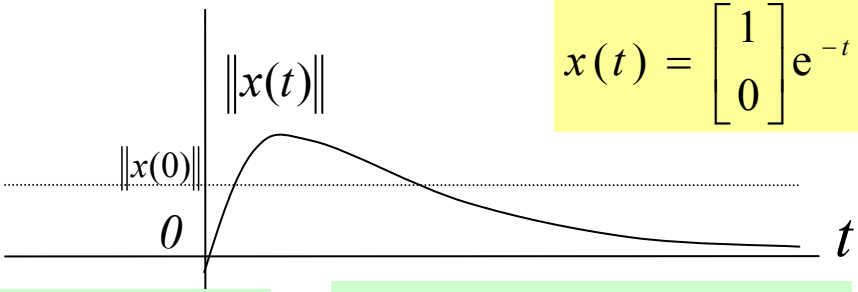
Exponenciální stabilita - opakování

DEFINICE Exponenciální stabilita

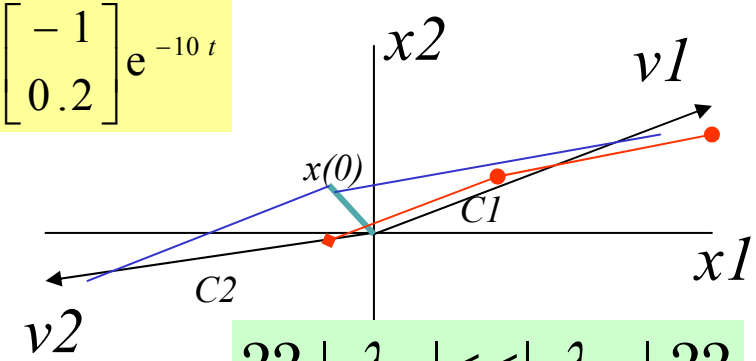
Ekvilibrium $x = 0$ je exponenciálně stabilní jestliže

$$\exists m, \alpha > 0 : |x(t)| \le m e^{-\alpha(t-t_0)} |x_0|, \ \forall \in B_h, t \ge t_0 \ge 0$$

- konstanta α je rychlost konvergence
- globální exponenciální stabilita = nerovnost platí $\forall x_0 \in R^n$
- exponenciální stabilita je obecně silnější než asymptotická stabilita
- *m* charakterizuje „překývnutí“ - i pro lin. syst. s výhradně reálnými póly!!!



$$x(t) = \begin{bmatrix} 1 \\ 0 \end{bmatrix} e^{-t} + \begin{bmatrix} -1 \\ 0.2 \end{bmatrix} e^{-10t}$$



$$\dot{x} = Ax, x \in R^2, \lambda_{1,2} < 0$$
$$Av_1 = \lambda_1 v_1, Av_2 = \lambda_2 v_2$$

$$x(t) = C_1 v_1 e^{\lambda_1 t} + C_2 v_2 e^{\lambda_2 t}$$
$$C_1 v_1 + C_2 v_2 = x(0)$$

$$?? \ |\lambda_1| << |\lambda_2| \ ??$$

Věta o exponenciální stabilitě – Ljap. fce

Věta. *Systém* $\dot{x} = f(t,x), f(t,0) \equiv 0,$ *je exponenciálně stabilní na oblasti* $D = \{x \in R^n \mid \|x\| < r\}$ *tehdy a jen tehdy jestliže existují Ljapunovská fce V(t,x) a kladné konstanty c1, c2, c3, c4 takové, že platí (m je z definice exp. stab. - „překývnutí“):* $\forall (t,x) \in [0,\infty) \times D_0, D_0 = \{x \in R^n \mid \|x\| < r/m\}$

$$c_1\|x\|^2 \le V(t,x) \le c_2\|x\|^2, \quad \frac{\partial V}{\partial t} + \frac{\partial V}{\partial x} f(t,x) \le -c_3\|x\|^2, \quad \left\|\frac{\partial V}{\partial x}\right\| \le c_4\|x\|$$

Důkaz: „Jen tehdy“, viz Khalil, str. 162. „Tehdy“: stačí jen první dvě nerovnice, z nichž plyne, že: $\dot{V} \le \frac{c_3}{c_2} V$ a tedy:

$$V(t,x(t)) \le V(t_0,x_0) - \frac{c_3}{c_2}\int_{t_0}^{t} V(\tau)d\tau$$

na což lze použít Bellman-Gronwall Lemma (BHL), které dává

$$V(t,x(t)) \le V(t_0,x_0)\exp\left(-\frac{c_3}{c_2}(t-t_0)\right)$$

a tedy $c_1\|x\|^2 \le c_2\|x(t_0)\|^2 \exp\left(-\frac{c_3}{c_2}(t-t_0)\right)$

Lineární autonomní systém

- Pro lineární autonomní systém $\dot{x} = Ax$
- Najdeme vždy Lyapunovovu funkci ve tvaru kvadratické formy
- Uvažme $V = x^T P x, \quad P$ reálná symetrická matice
- Derivace podle trajektorie

$$\dot{V} = \dot{x}^T P x + x^T P \dot{x} = x^T A^T P x + x^T P A x = x^T \left(A^T P + PA \right) \dot{x}$$

- Položíme $\boxed{A^T P + PA = -Q}$ Lyapunovova maticová rovnice

  a dostaneme $\boxed{\dot{V} = -x^T Q x}$

Věta. Mají-li všechna vlastní čísla matice *A* záporné reálné části, potom pro každou symetrickou p.d. matici *Q* má L.m.r. právě jedno řešení, které je p.d.

- Prakticky: Volíme p.d. *Q* a vypočteme *P* a určíme definitnost
- Je-li *P* p.d.: asymptotická stabilita. Není-li: nestabilita
- Možno využít nejrůznější software

Exponenciální stabilita a přibližná linearnizace

Věta. *Systém* $\dot{x} = f(t,x), f(t,0) \equiv 0,$ *je exponenciálně stabilní na oblasti* $D = \{x \in R^n \mid \|x\| < r\}$ *pro některé r>0 tehdy a jen tehdy jestliže jeho přibližná linearizace* $\dot{x} = A(t)x,\ A(t) = \frac{\partial f}{\partial x}(t,0)$ *je exponenciálně stabilní.*

Důkaz: Později, na základě Věty o zanikající poruše. ■

Věta. *Systém* $\dot{x} = f(x), f(0) = 0,$ *je exponenciálně stabilní na oblasti* $D = \{x \in R^n \mid \|x\| < r\}$ *pro některé r>0 jestliže jeho přibližná linearizace je exponenciálně stabilní, tj. má všechna vlastní č. v levé koml. polor.*

Důkaz: Díky negativitě reálných částí v.č. existuje řešení Ljap. rce a tím i kvadratická Ljap. fce, takže lze použít přísl. větu charakterizující exp. stab. přes kvadratickou Ljap. fci. ■

Stabilita perturbovaných systémů

- Uvažujme systém $\dot{x} = f(t,x) + g(t,x)$
  kde $f, g : [0,\infty) \times D \to R^n$ jsou po částech spojité v *t* a lokálně Lipsch. v *x* na $[0,\infty) \times D$, kde *D* je oblast obsahující počátek *x=0.*

- nominální systém $\dot{x} = f(t,x)$

  plus perturbace $g(t,x)$

- neurčitý systém $\dot{x} = \tilde{f}(t,x)$ tam spadá s

  $$g(t,x) \equiv \tilde{f}(t,x) - f(t,x)$$

f je <u>známá nominální</u> pravá strana systému s *f(t,0)=0*

Stabilita perturbovaných systémů 2

Věta. *Nechť je nominální systém* $\dot{x} = f(t,x), f(t,0) \equiv 0,$ *exponenciálně stabilní, tj. existují Ljapunovská fce V(t,x) a kladné konstanty c1, c2, c3, c4 takové, že platí* $\forall\ (t, x) \in [0, \infty) \times D$

$$c_1\|x\|^2 \le V(t,x) \le c_2\|x\|^2, \quad \frac{\partial V}{\partial t} + \frac{\partial V}{\partial x} f(t,x) \le -c_3\|x\|^2, \quad \left\|\frac{\partial V}{\partial x}\right\| \le c_4\|x\|$$

Nechť $\|g(t,x)\| \le \gamma\|x\|$ *, kde* $\gamma < \frac{c_3}{c_4}$ *, potom je počátek x=0 exponenciálně stabilním ekv. perturbovaného systému* $\dot{x} = f(t,x) + g(t,x)$ *Navíc, pokud předpoklady platí globálně, pak je počátek globálně exponenciálně stab. ekvilibriem téhož systému.*

Tzv. zanikající porucha: lokálně platí např. vždy, když *g(t,0)=0* pro každé *t* a *g* je stejnoměrně lok. Lipsch. a tedy $\|g(t,x) - g(t,0)\| \le L\|x - 0\|$, tj. $\gamma = L$ nebo má stejnoměrně omezený Jakobián:

$$\|g(t,x)\| = \|g(t,x) - g(t,0)\| = \left\|\frac{\partial g}{\partial t}(t,x^*)[x-0]\right\| \le \max_{t,x^*}\left\|\frac{\partial g}{\partial t}(t,x^*)\right\|\|x\|$$

Stabilita perturbovaných systémů 3

Důkaz Věty o zanikající poruše. *Nechť je nominální systém* $\dot{x} = f(t,x), f(t,0) \equiv 0,$ *exponenciálně stabilní, tj. existují Ljapunovská fce V(t,x) a kladné konstanty c1, c2, c3, c4 takové, že platí*

$$c_1\|x\|^2 \le V(t,x) \le c_2\|x\|^2, \quad \frac{\partial V}{\partial t} + \frac{\partial V}{\partial x} f(t,x) \le -c_3\|x\|^2, \quad \left\|\frac{\partial V}{\partial x}\right\| \le c_4\|x\|$$

Pro systém $\dot{x} = f(t,x) + g(t,x)$ *tedy platí, s využitím* $\|g(t,x)\| \le \gamma\|x\|$

$$\frac{\partial V}{\partial t} + \frac{\partial V}{\partial x}[f(t,x) + g(t,x)] \le -c_3\|x\|^2 + \left\|\frac{\partial V}{\partial x}\right\|\|g(t,x)\| \le$$

$$-c_3\|x\|^2 + c_4\|x\|\gamma\|x\| = (-c_3 + \gamma c_4)\|x\|^2$$

a jelikož $\gamma < \frac{c_3}{c_4}$ *máme dle věty o exp. stabilitě dokázano.* ■

Exponenciální stabilita a přibližná linearizace

Věta. *Systém* $\dot{x} = f(t,x), f(t,0) \equiv 0,$ *je exponenciálně stabilní na oblasti* $D = \{x \in R^n \mid \|x\| < r\}$ *pro některé r>0 tehdy a jen tehdy jestliže jeho přibližná linearizace* $\dot{x} = A(t)x,\ A(t) = \frac{\partial f}{\partial x}(t,0)$ *je exponenciálně stabilní.*

Důkaz: „Jen tehdy“ plyne y předcházející Věty o zanikající poruše:

$$\dot{x} = A(t)x = f(t,x) + g(t,x) \quad \text{kde} \quad g(t,x) = A(t)x - f(t,x)$$

g(t,x) splňuje všechny potřebné podmínky, neboť

$$g(t,x) = A(t)x - f(t,x) = o(t, \|x\|^2)$$

takže v dostatečně malém okolí ekv. vše potřebné platí.

„Tehdy“ plyne analogickým způsobem (v opačném směru)!!!

Perturbované systémy – nezanikající porucha

Věta. *Nechť je nominální systém* $\dot{x} = f(t,x), f(t,0) \equiv 0,$ *exponenciálně stabilní, tj. existují Ljapunovská fce V(t,x) a kladné konstanty c1, c2, c3, c4 takové, že platí* $\forall\ (t, x) \in [0, \infty) \times D$

$$c_1\|x\|^2 \le V(t,x) \le c_2\|x\|^2, \quad \frac{\partial V}{\partial t} + \frac{\partial V}{\partial x} f(t,x) \le -c_3\|x\|^2, \quad \left\|\frac{\partial V}{\partial x}\right\| \le c_4\|x\|$$

Nechť $\|g(t,x)\| \le \delta$ *, kde* $\delta > 0$ *je vhodné číslo, potom pro systém*

$$\dot{x} = f(t,x) + g(t,x)$$

platí, že existuje určité konečné T>0 , takové že

$$\|x(t)\| \le b, \forall t \ge t_0 + T$$

Kromě toho, $\forall t : t \ge t_0, t < t_0 + T$ *x(t) ubývá exponenciálně.*

Detailní formulace a důkaz viz skriptum.