

矩阵的广义Schwarz形和多项式 矩阵的稳定性

刘智敏 李凤翎

(中国科学院系统科学研究所, 北京)

摘要

本文通过线性变换, 对具有一般形式的多项式矩阵, 建立了广义Routh数组和广义 Schwarz 形的概念, 给出了由矩阵块状相伴标准形到广义 Schwarz 形的变换阵, 利用 Liapunoff 第二定理, 得到判别多项式矩阵稳定的充分条件, 并把此结果运用到多变量控制系统中。

一、前言

Routh 早在十九世纪就已把矩阵的相伴标准形与 Schwarz 形联系起来, 给出了多项式稳定的充分必要条件, 1978年, Leang-San 和 Shailendra 将多项式的一些结果推广到多项式矩阵^[1], 定义了矩阵 Routh 数组, 给出了矩阵块状 Schwarz 形和判别多项式矩阵稳定的充分条件, 但[1]中, 限制在多项式矩阵的各列次均相等时的列首一阵。笔者的工作是将 Leang-San 和 Shailendra 的结果进一步推广到具有一般形式的多项式矩阵, 并把此结果运用于多变量控制系统中。

二、多项式矩阵的广义 Schwarz 形

考虑非异多项式方阵

$$P(s) = P_0 s^p + P_1 s^{p-1} + \cdots + P_{p-1} s + P_p.$$

定义 如果非异多项式方阵 $P(s)$ 的行列式是一个稳定多项式, 则称该阵是稳定的。

由于经多项式阵的初等变换后, 稳定性不变, 因此恒可假定 $P(s)$ 已是一个列首一项多项式阵^[1]。

$$P(s) = I \begin{pmatrix} s^{d_1} & & & 0 \\ & s^{d_2} & & \\ & & \ddots & \\ 0 & & & s^{d_m} \end{pmatrix} + A_1 \begin{pmatrix} s^{d_1-1} & & & \\ & s^{d_2-1} & & \\ & & \ddots & \\ & & & s^{d_{n_1}-1} \end{pmatrix}$$

$$+ A_2 \begin{pmatrix} s^{d_1-2} & & & 0 \\ & s^{d_2-2} & & \\ & & \ddots & \\ & & & s^{d_{n_2}-2} \\ 0 & & & & \end{pmatrix} + \dots + A_r (I_r \ 0), \quad (1)$$

其中，恒可假设 $d_m \geq 1$ ； A_i 是 $n_1 \times n_i$ 矩阵，为多项式矩阵的系数阵； d_i 为多项式矩阵 $P(s)$ 的列次，且 $d_1 \geq d_2 \geq \dots \geq d_{n_1}$ ； n_i 为整数集 $\{d_1 - i, d_2 - i, \dots, d_m - i\}$ 中非负数的个数，且满足 $m = n_1 \geq n_2 \geq \dots \geq n_p (\geq 1)$ 。[2]

将 $P(s)$ 作用到 n_1 维向量 $X(t)$ 上的微分方程形式为

$$P(D)X(t) \equiv 0, \quad (2)$$

与 (2) 对应的状态方程为

$$\dot{x} = Ax, \quad (3)$$

其中， x 是 n 维向量， $n = \sum_{i=1}^p n_i$ ； A 是 $n \times n$ 矩阵：

$$A = \begin{pmatrix} 0 & [I_p \ 0] & & & & & 0 \\ & 0 & [I_{p-1} \ 0] & & & & \\ \mathbf{0} & & \ddots & \ddots & \ddots & & \\ & & & 0 & & [I_2 \ 0] & \\ -A_p & -A_{p-1} & \dots & -A_2 & & & -A_1 \end{pmatrix}.$$

设 A_1 为非奇异，令

$$\begin{aligned} C_{1,1} &= I, \quad C_{1,2} = A_2, \dots, C_{1,j} = A_{2(j-1)}, \dots \\ C_{2,1} &= A_1, \quad C_{2,2} = A_3, \dots, C_{2,j} = A_{2j-1}, \dots \\ & j = 1, 2, \dots, l. \end{aligned}$$

当 v 为偶数时， $l = \frac{v}{2} + 1$ ，当 v 为奇数时， $l = \frac{v+1}{2}$ ，且当 $2j-1 > v$ 时， $C_{2,j} \equiv 0$ 。可

构造矩阵列 $[I, A_1, A_2, \dots, A_p]$

的广义 Routh 数组：

$$\begin{matrix} C_{1,1} & C_{1,2} & C_{1,3} & C_{1,4} \dots \\ C_{2,1} & C_{2,2} & C_{2,3} & C_{2,4} \dots \\ C_{3,1} & C_{3,2} & C_{3,3} \dots \\ \vdots & \vdots & & \\ C_{v+1,1} & C_{v+1,2} \dots \end{matrix}$$

此处

$$\begin{aligned} C_{i+2,j} &= [I_i \ 0] C_{i+1}^+ C_{i,j+1} - C_{i+1,1}^+ C_{i+1,j+1} [I_{i+2j} \ 0] \\ & i = 1, 2, \dots, v-1; \quad j = 1, 2, \dots, \end{aligned}$$

$$v = q^T P q,$$

这里取 P 为正定阵

$$P = \begin{pmatrix} Y_v & & & & & \\ & Y_{v-1} & & & & 0 \\ & & \ddots & & & \\ & & & \ddots & & \\ 0 & & & & Y_2 & \\ & & & & & Y_1 \end{pmatrix},$$

其中 Y_i 是 $n_i \times n_i$ 阶正定阵, 则

$$\begin{aligned} \dot{v} &= -q^T Q q, \\ Q &= -(PF^T + FP) \end{aligned}$$

$$= - \begin{pmatrix} 0 & Q_v & & & & & \\ Q_v^T & 0 & Q_{v-1} & & & & \\ & & Q_{v-1}^T & 0 & & & \\ & & & \ddots & \ddots & \ddots & \\ & & & & & Q_3 & \\ & & & & & & Q_2 \\ 0 & & & & & Q_3^T & 0 & Q_2 \\ & & & & & Q_2^T & -Q_1 \end{pmatrix}, \quad (6)$$

其中 $Q_1 = X_1 C_{2,1} X_1^{-1} Y_1 + Y_1 (X_1^T)^{-1} C_{2,1}^T X_1^T$,

$$Q_i = X_i \begin{bmatrix} I_i & 0 \end{bmatrix} X_{i-1}^{-1} Y_{i-1} - Y_i (X_i^T)^{-1} C_{i+1,1}^T X_i^T \quad i = 2, 3, \dots, v.$$

若能选择 X_i, Y_i 满足一定条件使 $-(PF^T + FP)$ 是非负定阵, 且 $Q = H^T H$, (F, H) 能检测, 从而由 Liapunoff 第二定理, (4) 是稳定的。

对系统 (4) 或广义 Schwarz 阵 B , 我们有

定理 1 如果

i) 存在非异的 X_i^1 , 使

$$X_i^1 C_{2,1} X_i^{1-1} > 0; \quad (7)$$

ii) $D_{i+2,2}^T (X_i^1 C_{i+2,1}) = 0 \quad \forall i \leq v-1 \quad (8)$

这里

$$G_i \triangleq X_i^1 C_{2,1},$$

$$X_i^2 X_i^1 C_{i+2,1} = \begin{bmatrix} G_{i+1} \\ 0 \end{bmatrix},$$

其中 X_i^2 为 $n_i \times n_i$ 阶正交阵, G_{i+1} 为 $n_{i+1} \times n_{i+1}$ 阶阵, 而

$$G_i = [D_{i+2,1} \quad D_{i+2,2}],$$

其中 $D_{i+2,1}$ 为 n_{i+1} 列的, $D_{i+2,2}$ 为 $(n_i - n_{i+1})$ 列的, 于是

$$D_{i+2,2}^T X_i^2 X_i^T X_i^1 C_{i+2,1} = 0,$$

即

$$X_i^2 D_{i+2,2} = \begin{bmatrix} 0 \\ G_{i,2} \end{bmatrix}.$$

设

$$X_i^2 D_{i+2,1} = \begin{bmatrix} G_{i,1} \\ G_{i,3} \end{bmatrix}.$$

则记

$$X_{i+1}^1 \triangleq G_{i,1};$$

iii)

$$G_i X_i^1{}^{-1} > 0, \quad i = 2, 3, \dots, \nu.$$

则

$$B = \begin{bmatrix} 0 & [I_\nu \ 0] & & & & & & & \\ -C_{\nu+1,1} & 0 & [I_{\nu-1}, 0] & & & & & & 0 \\ & \ddots & \ddots & \ddots & \ddots & \ddots & & & \\ & & \ddots & \ddots & \ddots & \ddots & \ddots & & \\ & & & \ddots & \ddots & \ddots & \ddots & & \\ & & & & 0 & & & & [I_2 \ 0] \\ & & & & & & & & & & \\ 0 & & & & & & & & & & -C_{3,1} \quad -C_{2,1} \end{bmatrix}$$

是稳定阵。

证 由(9)式知, G_i 为非异方阵, 因此 $C_{i,1}$ 必是列满秩阵. 在 K_2 中, 我们选

$$X_\nu = X_\nu^1,$$

$$X_{\nu-1} = X_{\nu-1}^2 X_{\nu-1}^1,$$

$$X_{\nu-2} = \begin{pmatrix} X_{\nu-2}^2 & 0 \\ 0 & I \end{pmatrix} X_{\nu-2}^2 X_{\nu-2}^1,$$

⋮

$$X_2 = \begin{pmatrix} X_{v-1}^2 & 0 \\ 0 & I \end{pmatrix} \begin{pmatrix} X_{v-2}^2 & 0 \\ 0 & I \end{pmatrix} \dots \begin{pmatrix} X_3^2 & 0 \\ 0 & I \end{pmatrix} X_2^2 X_2^1,$$

(10)

$$X_1 = \begin{pmatrix} X_{v-1}^2 & 0 \\ 0 & I \end{pmatrix} \begin{pmatrix} X_{v-2}^2 & 0 \\ 0 & I \end{pmatrix} \cdots \begin{pmatrix} X_3^2 & 0 \\ 0 & I \end{pmatrix} \begin{pmatrix} X_2^2 & 0 \\ 0 & I \end{pmatrix} X_1^2 X_1^1,$$

及在 P 中取

$$Y_1 = (X_1 C_{2,1} X_1^{-1})^{-1},$$

$$Y_i = (G'_i X_i^{-1})^{-1}, \quad i = 2, 3, \dots, v. \quad (11)$$

其中

$$X_i C_{i+2,1} = \begin{bmatrix} G'_{i+1} \\ 0 \end{bmatrix}.$$

这时

$$\begin{aligned} Y_i (X_i^T)^{-1} C_{i+1,1} X_{i-1}^T &= X_i G'_i{}^{-1} X_i^{T-1} C_{i+1,1} X_{i-1}^T \\ &= X_i G'_i{}^{-1} (X_{i-1} C_{i+1,1} X_{i-1}^T)^T \\ &= X_i G'_i{}^{-1} \begin{bmatrix} G'_i X_i^{-1} \\ 0 \end{bmatrix}^T \\ &= X_i G'_i{}^{-1} [G'_i X_i^{-1} \ 0] \\ &= [I_i \ 0]. \\ X_i [I_i \ 0] X_{i-1}^{-1} Y_{i-1} &= X_i [I_i \ 0] G'_{i-1}{}^{-1} \\ &= X_i [I_i \ 0] \left([I_{i-1} \ 0] \begin{bmatrix} G'_{i-1} \\ 0 \end{bmatrix} \right)^{-1} \\ &= X_i [I_i \ 0] \left([I_{i-1} \ 0] X_{i-2} C_{i,1} \right)^{-1} \\ &= X_i [I_i \ 0] \left([I_{i-1} \ 0] \begin{pmatrix} X_{v-1}^2 & 0 \\ 0 & I \end{pmatrix} \cdots \begin{pmatrix} X_{i-1}^2 & 0 \\ 0 & I \end{pmatrix} \begin{pmatrix} G_{i-1} \\ 0 \end{pmatrix} \right)^{-1} \\ &= X_i [I_i \ 0] \left(\begin{pmatrix} X_{v-1}^2 & 0 \\ 0 & I \end{pmatrix} \cdots \begin{pmatrix} X_i^2 & 0 \\ 0 & I \end{pmatrix} (X_{i-1}^2 \ 0) \begin{pmatrix} G_{i-1} \\ 0 \end{pmatrix} \right)^{-1} \\ &= X_i [I_i \ 0] \left(\begin{pmatrix} X_{v-1}^2 & 0 \\ 0 & I \end{pmatrix} \cdots \begin{pmatrix} X_i^2 & 0 \\ 0 & I \end{pmatrix} X_{i-1}^2 \ G_{i-1} \right)^{-1} \\ &= X_i [I_i \ 0] \left(\begin{pmatrix} X_{v-1}^2 & 0 \\ 0 & I \end{pmatrix} \cdots \begin{pmatrix} X_i^2 & 0 \\ 0 & I \end{pmatrix} \begin{pmatrix} G_{i-1,1} & 0 \\ G_{i-1,3} & G_{i-1,2} \end{pmatrix} \right)^{-1} \\ &= X_i [I_i \ 0] \begin{bmatrix} X_i & 0 \\ G_{i-1,3} & G_{i-1,2} \end{bmatrix}^{-1} \\ &= [I_i \ 0]. \end{aligned}$$

所以(6)式中

$$Q_i = 0; \quad Q_1 = 2I.$$

即 Q 是个非负定阵, 并且容易验证 (F, H) 为能控对, 其中 $H = \begin{bmatrix} 0 & 0 \\ 0 & \sqrt{2}I \end{bmatrix}$, H^T

$= Q$, 由 Liapunoff 第二定理知, 系统(4)是稳定的, 即阵 B 是稳定阵.

对由(1)式表示的多项式矩阵 $P(s)$ 或系统(3), 我们有

定理 2 由 $P(s)$ 的系数阵决定的广义矩阵 Routh 数组 $C_{i,j}$ 满足 $C_{i,j}$ 的列 $\in \text{Span}\{C_{i,1}$ 的列)时, 则当条件

$$X_i^T C_{2,i} X_i^{-1} > 0,$$

$$D_{i+2}^T (X_i^T C_{i+2,i}) = 0,$$

$$G_i X_i^{-1} > 0$$

成立时(式中各元素含义见定理1), $P(s)$ (或 A) 为稳定的.

例 设多项式阵

$$P(s) = \begin{bmatrix} s^3 + 2s^2 + 3s + 2 & 0 & -1 \\ 0 & s^2 + 2s + 1 & 0 \\ -s^2 - s - 1 & 0 & s + 1 \end{bmatrix}$$

$$= I \begin{bmatrix} s^3 & 0 \\ s^2 & \\ 0 & s \end{bmatrix} + A_1 \begin{bmatrix} s^2 & 0 \\ s & \\ 0 & 1 \end{bmatrix} + A_2 \begin{bmatrix} s & 0 & 0 \\ 0 & 1 & 0 \end{bmatrix} + A_3 [1 \ 0 \ 0],$$

其中 $A_1 = \begin{bmatrix} 2 & 0 & -1 \\ 0 & 2 & 0 \\ -1 & 0 & 1 \end{bmatrix}$, $A_2 = \begin{bmatrix} 3 & 0 \\ 0 & 1 \\ -1 & 0 \end{bmatrix}$, $A_3 = \begin{bmatrix} 2 \\ 0 \\ -1 \end{bmatrix}$.

与

$$P(D)X(i) = 0$$

(12)

等价的状态方程为

$$\dot{x} = Ax,$$

(13)

其中 $A = \begin{bmatrix} 0 & [I_3 \ 0] & 0 \\ 0 & 0 & [I_2 \ 0] \\ -A_3 & -A_2 & -A_1 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 0 & 1 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 1 & 0 \\ -2 & -3 & 0 & -2 \\ 0 & 0 & -1 & 0 \\ 1 & 1 & 0 & 1 \end{bmatrix}$.

取

$$K_1 = \begin{pmatrix} 1 & \mathbf{0} & & \\ \mathbf{0} & 1 & 0 & \mathbf{0} \\ & 0 & 1 & \\ 1 & & 1 & 0 & 0 \\ 0 & \mathbf{0} & 0 & 1 & 0 \\ 0 & & 0 & 0 & 1 \end{pmatrix},$$

$$K_2 = \begin{pmatrix} X_3 & \mathbf{0} \\ & X_2 \\ \mathbf{0} & X_1 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 1 & & \mathbf{0} \\ & 1 & 0 \\ & 0 & 2 \\ & & 1 & 0 & 1 \\ \mathbf{0} & & 0 & 1 & 0 \\ & & 1 & 0 & 2 \end{pmatrix},$$

经过两次坐标变换

$$y = K_1 x, \quad z = K_2 y,$$

系统 (13) 等价于

$$\dot{z} = (K_2 K_1 A K_1^{-1} K_2^{-1}) z = Fz, \quad (14)$$

其中

$$F = \begin{pmatrix} \mathbf{0} & X_3 [I_3 \ 0] X_2^{-1} & \mathbf{0} \\ -X_2 C_{4,1} X_3^{-1} & \mathbf{0} & X_2 [I_2 \ 0] X_1^{-1} \\ \mathbf{0} & -X_1 C_{3,1} X_2^{-1} & -X_1 C_{2,1} X_1^{-1} \end{pmatrix}$$

$$= \begin{pmatrix} 0 & 1 & 0 & \mathbf{0} \\ -1 & \mathbf{0} & 2 & 0 & -1 \\ 0 & & 0 & 2 & 0 \\ & -1 & 0 & -2 & 0 & 1 \\ \mathbf{0} & 0 & -\frac{1}{2} & 0 & -2 & 0 \\ & 0 & 0 & 1 & 0 & -1 \end{pmatrix}.$$

选 P , 使

$$P = \begin{pmatrix} Y_3 & \mathbf{0} \\ & Y_2 \\ \mathbf{0} & Y_1 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 1 & & \mathbf{0} \\ & 1 & 0 \\ & 0 & 2 \\ & & 1 & 0 & 1 \\ \mathbf{0} & & 0 & \frac{1}{2} & 0 \\ & & 1 & 0 & 2 \end{pmatrix} > 0,$$

则

$$PF^T + FP = \begin{bmatrix} 0 & 0 \\ 0 & -2I_1 \end{bmatrix} \leq 0,$$

所以系统(14)是稳定的,可以验证 X_i, Y_i 均满足定理条件,所以 $P(s)$ 是稳定阵.

四、结 论

本文对于一般形式的多项式矩阵,建立了广义矩阵 Routh 数组及广义 Schwarz 的概念;给出了判别列次不相等的列首一多项式阵稳定的一个充分条件,而当多项式阵的列次

$$d_1 = d_2 = \dots = d_m,$$

即如[1]中讨论的情况,这时,文[1]中 H_i 正定时,本文定理 2 的所有条件全部成立,因此,即使在 $d_1 = d_2 = \dots = d_m$ 的特殊情形下,本文也给出了比文[1]中较弱的条件. 该指出,对于系统渐近稳定的必要条件的讨论还比较复杂,本文也没有进一步探讨,而,本文的定理对于一般线性系统稳定性的判别提供了方便.

参 考 文 献

- [1] Leang-San Shieh and Shailendra Sacheti, A Matrix in the Block Schwarz Form and the Stability of Matrix Polynomials, Int. J. Control, 27, 2, (1978), 245-249.
- [2] 韩京清, 线性系统的结构与反馈系统计算, 全国控制理论及其应用学术交流会议论文集, 科学出版社, 北京, (1981).

THE GENERALIZED SCHWARZ FORM OF MATRIX AND THE STABILITY OF MATRIX POLYNOMIALS

Liu Zhemin, Li Fengling

(Institute of Systems Science, Academia Sinica, Beijing)

Abstract

This paper introduces the concepts of the generalized Routh array and schwarz form for the matrix polynomials by linear transformation. We extend Leang-San's and Shailendra's results and give the transformation matrix from the block companion canonical form of matrix to the generalized Schwarz form. A sufficient condition is derived for determining the stability of matrix polynomials. This result is applied to multivariable control systems.