

一类时变非线性控制系统的绝对稳定性

杨 斌 潘德惠

(东北大学信息科学与工程学院·沈阳, 110006)

摘要: 用“二次型加积分项”形式的 Lyapunov 函数研究一类时变非线性控制系统的绝对稳定性, 给出了系统绝对稳定的充分条件以及时变系数导数界限的估计, 明显地优于[1]中的结果.

关键词: 控制系统; Lyapunov 函数; 绝对稳定性

1 引 言

本文研究时变非线性控制系统:

$$\dot{x} = Ax - bg(t, \sigma), \quad \sigma = c^T x - \rho g(t, \sigma), \quad g(t, \sigma) = k(t)f(\sigma) \quad (1.1)$$

的绝对稳定性. 这里 A 是 $n \times n$ 阶稳定矩阵, x, b, c 是 n 维向量, 不失一般性, 我们假设 $c^T = (1, 0, \dots, 0)$, $f(\sigma)$ 是满足条件 $0 \leq \sigma f(\sigma) \leq F\sigma^2 (F < +\infty)$ 的连续函数, $g(t, \sigma)$ 是满足条件 $g(t, \sigma) = k(t)f(\sigma)$ 且 $0 \leq \sigma g(t, \sigma) \leq G\sigma^2 (G < +\infty)$ 的连续函数, 用 A_G 表示这类函数组成的集合. 在研究时变非线性控制系统时, 一般都用二次型的 Lyapunov 函数, 得出圆频率准则. 在[1]中作者采用了形如:

$$V(t, x) = \frac{1}{2}x^T P x + \beta k(t) \int_0^\sigma f(\sigma) d\sigma + \frac{1}{2}\beta \rho g^2(t, \sigma) \quad (1.2)$$

的 Lyapunov 函数来研究系统(1.1)的绝对稳定性. 用 S-手续的方法给出了绝对稳定的频率形式的充分条件. 减弱了圆频率准则的条件, 扩大了稳定性区域((1.2)式中的 $P = P^T$ 是矩阵方程 $A^T P + PA = -2W$ 的唯一解, 而 $W = W^T$ 是某一给定矩阵, $\beta \geq 0, \rho \geq 0, k(t)$ 是 t 的连续可导函数). 但它的结果要求

$$k'(t) \leq (r_0/\beta)\Phi k(t)[1 - k(t)/K]. \quad (1.3)$$

其中: $\varphi(\sigma) = [\sigma f(\sigma) / \int_0^\sigma f(\sigma) d\sigma] \geq \Phi = \min_\sigma \{\varphi(\sigma)\} \geq 0, K = G/F, r_0$ 表示 S-手续中的常数(见引理 4). 一般说来, Φ 是很难确定的. 另外这个结果还要求 $k(t)$ 满足微分不等式(1.3), 这样对 $k(t)$ 的限制也太强. 此结果要求知道的信息太强, 不便于应用. 目前在实际应用中仍采用圆频率准则^[2].

本文用同样形式的 Lyapunov 函数, 运用直接估计的方法来研究系统(1.1)的绝对稳定性, 得到系统绝对稳定的充分条件, 它只要求 $k'(t)$ 小于某个常数, 因而便于应用. 并且如果[1]中所需的信息都能得到, 本文又给出另一个明显优于[1]中的结果.

2 主要结果

将 W 写成:

$$W = \begin{bmatrix} W_{11} & \omega_{12}^T \\ W_{12} & W_{22} \end{bmatrix} \begin{matrix} 1 \\ n-1 \end{matrix}$$

我们有如下结果:

定理 1 若存在形如(1.2)式的函数 $V(t, x)$, 使得

$$1) 1/G > (-n + \sqrt{\Delta})/q,$$

$$2) \sup_{t \geq t_0} k'(t) < \frac{2}{\beta F(\det S)} \min[q, mG^2 + 2nG + q],$$

则系统(1.1)绝对稳定.

$$\text{其中 } U = \frac{1}{2}(Pb - \beta A^T c), U^T = (u_1, U_2^T), a = \beta c^T b + 2\rho u_1 + \rho^2 w_{11},$$

$$d = u_1 + \rho w_{11}, \delta = U_2 + \rho W_{12}, S = W_{22}, \Delta = n^2 - mq,$$

$$R = \begin{bmatrix} a & d & \delta^T \\ d & w_{11} & W_{12}^T \\ \delta & W_{12} & W_{22} \end{bmatrix}, m = \det R \begin{pmatrix} 2 \\ 2 \end{pmatrix}, n = \det R \begin{pmatrix} 1 \\ 2 \end{pmatrix}, q = \det R \begin{pmatrix} 1 \\ 1 \end{pmatrix}.$$

注 用 $T \begin{pmatrix} i \\ j \end{pmatrix}$ 表示从矩阵 T 中去掉第 i 行和第 j 列后得到的子矩阵.

在证明定理 1 之前, 先证以下的引理.

引理 1 设 φ 是 $r \times r$ 阶非异对称矩阵, θ, ξ 分别是 r 维列向量, $t, \alpha_1, \alpha_2, \alpha_3$ 为实数.

$$H(t) = \begin{bmatrix} \alpha_1 t^2 + 2\alpha_2 t + \alpha_3 & t\xi^T + \theta^T \\ t\xi + \theta & \varphi \end{bmatrix}, I = \begin{bmatrix} \alpha_1 & \alpha_2 & \xi^T \\ \alpha_2 & \dots & \vdots \\ \xi & \dots & H(0) \end{bmatrix}.$$

$$\text{则 } \det H = t^2 \det I \begin{pmatrix} 2 \\ 2 \end{pmatrix} + 2t \det I \begin{pmatrix} 1 \\ 2 \end{pmatrix} + \det I \begin{pmatrix} 1 \\ 1 \end{pmatrix},$$

$$\Delta_0 = [\det I \begin{pmatrix} 1 \\ 2 \end{pmatrix}]^2 - [\det I \begin{pmatrix} 2 \\ 2 \end{pmatrix}] [\det I \begin{pmatrix} 1 \\ 1 \end{pmatrix}] = -(\det H)(\det \varphi).$$

$$\text{证 } \det H = (\det \varphi) [\alpha_1 t^2 + 2\alpha_2 t + \alpha_3 - (t\xi^T + \theta^T) \varphi^{-1} (t\xi + \theta)]$$

$$= t^2 \det I \begin{pmatrix} 2 \\ 2 \end{pmatrix} + 2t \det I \begin{pmatrix} 1 \\ 2 \end{pmatrix} + \det I \begin{pmatrix} 1 \\ 1 \end{pmatrix},$$

$$\Delta_0 = (\det \varphi)^2 [(\alpha_2 - \xi^T \varphi^{-1} \theta)^2 - (\alpha_1 - \xi^T \varphi^{-1} \xi)(\alpha_3 - \theta^T \varphi^{-1} \theta)] \\ = -(\det H)(\det \varphi).$$

引理 2

$$\det \begin{bmatrix} \beta c^T b & U^T \\ U & W \end{bmatrix} \leq 0.$$

证 考虑系数矩阵为零的定常线性系统:

$$\dot{x} = Ax - b\sigma, \quad \dot{\sigma} = c^T Ax - c^T b\sigma$$

以及正定二次型:

$$V(x, \sigma) = \frac{1}{2} x^T P x + \frac{\beta}{2} \sigma^2.$$

因为系统的零解不是渐近稳定的, 所以

$$\dot{V} = -x^T W x - 2x^T U \sigma - \beta c^T b \sigma^2$$

不是负定二次型, 又因为 $W > 0$, 故引理成立.

引理 3 $\det R \leq 0$.

证 由简单的计算, 并注意到引理 2 可得:

$$\det R = \det \begin{bmatrix} \beta c^T b & U^T \\ U & W \end{bmatrix} \leq 0.$$

有了以上的引理,下面我们证明定理 1.

证 计算得

$$-\dot{V}|_{(1.1)} = x^T W x + 2x^T U g + \beta c^T b g^2 - \beta k'(t) \int_0^\sigma f(\sigma) d\sigma.$$

记

$$x^T = (x_1, \bar{x}^T), \quad \forall g(t, \sigma) \in A_G, \quad \forall x \neq 0,$$

令

$$L(t, \sigma) = \begin{cases} 0, & \sigma = 0, \\ g/\sigma, & \sigma \neq 0, \end{cases}$$

$$-\dot{V}|_{(1.1)} \geq \begin{cases} \lambda_{\min} Q(L)(\sigma^2 + \|\bar{x}\|), & k'(t) \leq 0, \\ \lambda_{\min} \bar{Q}(L)(\sigma^2 + \|\bar{x}\|), & k'(t) > 0. \end{cases}$$

其中

$$Q(L) = \begin{bmatrix} aL^2 + 2dL + w_{11} & L\delta^T + W_{12}^T \\ L\delta + W_{12} & S \end{bmatrix},$$

$$\bar{Q}(L) = Q(L) - \begin{bmatrix} \frac{1}{2}\beta h F & 0 \\ 0 & 0 \end{bmatrix}, \quad h = \sup_{t \geq t_0} k'(t).$$

由引理 1 可得, $\det Q(L) = mL^2 + 2nL + q, \Delta = n^2 - mq = -(\det R)(\det S)$. 由引理 2 可知, $\det R \leq 0$. 又因为 $\det S > 0$, 所以 $\Delta \geq 0$. 当 $L = 0$ 时, $Q(L) = W > 0$, 当 $L \in (0, G]$ 时, 有 $1/L \geq 1/G$, 由定理 1 条件 $1/G > (-n + \sqrt{\Delta})/q$ 成立, 则有 $1/L \geq 1/G > (-n + \sqrt{\Delta})/q$ 成立, 故 $\det Q(L) > 0$. 又因为 $Q(L) \begin{pmatrix} 1 \\ 1 \end{pmatrix} = S > 0$, 所以 $Q(L) > 0, L \in [0, G]$. 则 $\lambda_{\min} Q(L) > 0, \min_{L \in [0, G]} \lambda_{\min} Q(L) \triangleq \delta_1 > 0$. 当 $k'(t) \leq 0$ 时, 就有 $-\dot{V}|_{(1.1)} \geq \delta_1(\sigma^2 + \|\bar{x}\|) > 0$.

由引理 1 可得

$$\det \bar{Q}(L) = mL^2 + 2nL + q - \frac{1}{2}\beta h F(\det S).$$

下证 $\forall L \in [0, G], \det \bar{Q}(L) > 0$. 若不然, 则存在一点 $\alpha \in [0, G]$, 使得 $\det \bar{Q}(\alpha) \leq 0$. 即 $m\alpha^2 + 2n\alpha + q \leq \frac{1}{2}\beta h F(\det S) < \min[q, mG^2 + 2nG + q]$.

由上式可知, 对二次函数 $y(L) = mL^2 + 2nL + q$ 存在 $\alpha \in [0, G]$ 使得 $y(0) > y(\alpha), y(\alpha) < y(G)$, 故 $y(L)$ 在 $[0, G]$ 先下降, 后上升, 因而在 $[0, G]$ 必存在极小值点 e , 根据二次函数性质知此极小值点也是该函数在整个实轴的最小值点. 即有 $mL^2 + 2nL + q \geq me^2 + 2ne + q, \forall L \in \mathbb{R}$. 再有 $L \in [0, G]$ 时, $mL^2 + 2nL + q > 0$, 所以 $me^2 + 2ne + q > 0$. 于是 $mL^2 + 2nL + q > 0, \forall L \in \mathbb{R}$. 即方程 $mL^2 + 2nL + q = 0$ 没有实根, 这与 $\Delta \geq 0$ 矛盾. 故对 $\forall L \in [0, G], \det \bar{Q}(L) > 0$. 又因为 $\bar{Q}(L) \begin{pmatrix} 1 \\ 1 \end{pmatrix} = S > 0$, 则 $\bar{Q}(L) > 0$. 就有 $\lambda_{\min} \bar{Q}(L) > 0, \min_{L \in [0, G]} \lambda_{\min} \bar{Q}(L) \triangleq \delta_2 > 0$. 当 $k'(t) > 0$ 时, 就有 $-\dot{V}|_{(1.1)} \geq \delta_2(\sigma^2 + \|\bar{x}\|) > 0$.

令 $\delta_3 = \min(\delta_1, \delta_2), \|y\| = (\sigma^2 + \|\bar{x}\|)$. 则 $-\dot{V}|_{(1.1)} \geq \delta_3 \|y\| > 0$. 定理得证.

下面我们通过一个例子来比较一下这两个结果, 考虑二阶时变非线性控制系统:

$$\begin{aligned} \dot{x}_1 &= -2x_1 + g(t, \sigma), & \dot{x}_2 &= x_1 - x_2 + 2g(t, \sigma), \\ \sigma &= x_1 - g(t, \sigma), & g(t, \sigma) &= k(t)f(\sigma). \end{aligned}$$

取定的 Lyapunov 函数为

$$V(t, x) = x_1^2 + x_2^2 + k(t) \int_0^\sigma f(\sigma) d\sigma + \frac{1}{2} g^2(t, \sigma),$$

计算得: $R = \begin{bmatrix} 3 & 4 & -3 \\ 4 & 4 & -1 \\ -3 & -1 & 2 \end{bmatrix}$, $m = -3$, $n = 5$, $q = 7$, $\Delta_0 = 46$.

由定理 1 可知, 存在形如 (2.2) 式的函数 $V(t, x)$, 使得

$$\begin{aligned} 1) & 1/G > (-5 + \sqrt{46})/7, \\ 2) & \sup_{t \geq t_0} k'(t) < \frac{1}{F} \min[7, -3G^2 + 10G + 7] \end{aligned}$$

成立, 则系统 (2.1) 绝对稳定, 特别当 $G = 2$ 时, $\sup_{t \geq t_0} k'(t) < 7/F$, 则系统 (2.1) 的绝对稳定. 采用文献 [1] 中的方法, 当 $G = 2$ 时, 所得的结果为: $k'(t) \leq r_0 \Phi k(t) [1 - Fk(t)/2]$, 其 $\sqrt{105}/2 < r_0 < (17 + \sqrt{105})/2$ (它是由引理 4 的条件求出的). 由此可见, 本文的结果 $k'(t)$ 的上界小于 $7/F$, 很容易应用. 而 [1] 的结果对 $k(t)$ 所需的信息太多, 很难应用. 如果 [1] 的结果所需的信息量都能得到, 我们用以下方法, 给出另一个优于 [1] 中的结果. 由 S-手续在有限扇形角内的无亏损性, 我们可得如下引理.

引理 4 若存在形如 (1.2) 式的函数 $V(t, x)$ 使得 $1/G > (-n + \sqrt{\Delta})/q$ 成立, 在 $r_0 > 0$, 使得 $x^T W x + 2x^T U g + \beta c^T b g^2 - r_0 g(\sigma - g/G) > 0, \forall (|x| + |g|) \neq 0$. 证 当 $g(\sigma - g/G) \geq 0$ 成立时, 有 $0 \leq \sigma g \leq G\sigma^2$, 即 $g \in A_G$. 此时, 仿定理 1 的

$$x^T W x + 2x^T U g + \beta c^T b g^2 = \begin{bmatrix} \sigma \\ \bar{x} \end{bmatrix}^T Q(L) \begin{bmatrix} \sigma \\ \bar{x} \end{bmatrix} > 0.$$

于是由 [8] 的定理 1.7.3 (关于 S-手续无亏损性定理) 可得引理之结论.

有了这个引理, 我们有以下结果.

定理 2 若存在形如 (1.2) 式的函数 $V(t, x)$, 使得

$$\begin{aligned} 1) & 1/G > (-n + \sqrt{\Delta})/q, \\ 2) & \sup_{t \geq t_0} [k'(t) - h(t)] < \bar{h}, \end{aligned}$$

成立, 则系统 (1.1) 绝对稳定.

其中, G, n, Δ, q 同定理 1, r_0 为引理 4 中满足条件的 r_0 .

$$h(t) = (r_0/\beta) \Phi k(t) [1 - k(t)/K], \bar{U} = \frac{1}{2} (Pb - \beta A^T c - r_0 c), \bar{U}^T = (\bar{u}_1, \bar{U}_2^T)$$

$$\bar{a} = \beta c^T b + r_0 \rho + r_0/G + 2\rho \bar{u}_1 + \rho^2 w_{11}, \bar{d} = \bar{u}_1 + \rho w_{11}, \bar{\delta} = \bar{U}_2 + \rho W_{12}, S =$$

$$\bar{R} = \begin{bmatrix} \bar{a} & \bar{d} & \bar{\delta}^T \\ \bar{d} & w_{11} & W_{12}^T \\ \bar{\delta} & W_{12} & W_{22} \end{bmatrix}, \bar{m} = \det \bar{R} \begin{pmatrix} 2 \\ 2 \end{pmatrix}, \bar{n} = \det \bar{R} \begin{pmatrix} 1 \\ 2 \end{pmatrix}, \bar{q} = \det \bar{R} \begin{pmatrix} 1 \\ 1 \end{pmatrix},$$

$$\Delta_1 = \bar{n}^2 - \bar{m} \bar{q}, \bar{h}_0 = \frac{2}{\beta F (\det S)},$$

$$\bar{h} = \begin{cases} \bar{h}_0 \bar{q}, & \bar{n} \geq 0, \\ (-\bar{h}_0 \Delta_1) / \bar{m}, & \bar{n} < 0, G > -\bar{n} / \bar{m}, \\ \bar{h}_0 (\bar{m} G^2 + 2\bar{n}G + \bar{q}), & \bar{n} < 0, G \leq -\bar{n} / \bar{m}. \end{cases}$$

注 这里 $\bar{h} > 0$, 故定理 2 的结果优于 [1] 中的结果.

在证明定理 2 之前, 先证以下引理.

引理 5 当 $1/G > (-n + \sqrt{\Delta})/q$ 时, $\det \bar{R} > 0$.

证 由简单的计算, 并注意到引理 4 可得:

$$\det \bar{R} = \det \begin{bmatrix} \beta c^T b + r_0 \rho + r_0/G & \bar{U}^T \\ \bar{U} & W \end{bmatrix} > 0.$$

引理 6 $r_0 g(\sigma - g/G) - \beta h(t) \int_0^\sigma f(\sigma) d\sigma \geq 0$.

证 当 $\sigma = 0$ 时, 结论显然成立. 当 $\sigma \neq 0$ 时,

$$\begin{aligned} & r_0 g(\sigma - g/G) - \beta h(t) \int_0^\sigma f(\sigma) d\sigma \\ & \geq r_0 \Phi \int_0^\sigma f(\sigma) d\sigma [k(t) - Fk^2(t)/G] - r_0 \Phi k(t) [1 - k(t)/K] \int_0^\sigma f(\sigma) d\sigma \geq 0. \end{aligned}$$

下面我们证明定理 2.

令 $k'_1(t) = k'(t) - h(t)$, 由引理 6 可知 $r_0 g(\sigma - g/G) - \beta h(t) \int_0^\sigma f(\sigma) d\sigma \geq 0$.

可得

$$-\dot{V}|_{(A.1)} \geq \begin{bmatrix} g \\ x \end{bmatrix}^T \begin{bmatrix} \beta c^T b + r_0 \rho + r_0/G & \bar{U}^T \\ \bar{U} & W \end{bmatrix} \begin{bmatrix} g \\ x \end{bmatrix} - \beta k'_1(t) \int_0^\sigma f(\sigma) d\sigma.$$

同定理 1 的证明, 可得

$$-\dot{V}|_{(A.1)} \geq \begin{cases} \lambda_{\min} Q_1(L) (\sigma^2 + \|\bar{x}\|), & k'(t) \leq 0, \\ \lambda_{\min} \bar{Q}_1(L) (\sigma^2 + \|\bar{x}\|), & k'(t) > 0. \end{cases}$$

其中

$$Q_1(L) = \begin{bmatrix} \bar{a}L^2 + 2\bar{d}L + w_{11} & L\bar{\delta}^T + W_{12}^T \\ L\bar{\delta} + W_{12} & S \end{bmatrix},$$

$$\bar{Q}_1(L) = Q_1(L) - \begin{bmatrix} \frac{1}{2}\beta h_1 F & 0 \\ 0 & 0 \end{bmatrix}, \quad h_1 = \sup_{t \geq t_0} k'_1(t).$$

由引理 1 可得 $\det \bar{Q}_1(L) = \bar{m}L^2 + 2\bar{n}L + \bar{q}$, $\Delta_1 = \bar{n}^2 - \bar{m}\bar{q} = -(\det \bar{R})(\det S)$. 因为 $\det \bar{R} > 0$, $\det S > 0$, 所以 $\Delta_1 < 0$, 而 $\Delta_1 = \bar{n}^2 - \bar{m}\bar{q}$, 又因为 $\bar{q} = \det W > 0$, 故 $\bar{m} > 0$. 因此 $\det Q_1(L) > 0$, $L \in [0, G]$. 又因为 $Q_1(L) \begin{pmatrix} 1 \\ 1 \end{pmatrix} = S > 0$, 所以 $Q_1(L) > 0$, $L \in [0, G]$. 则 $\lambda_{\min} Q_1(L) > 0$,

$\min_{L \in [0, G]} \lambda_{\min} Q_1(L) \triangleq \tau_1 > 0$. 当 $k'_1(t) \leq 0$ 时, 就有 $-\dot{V}|_{(A.1)} \geq \tau_1 (\sigma^2 + \|\bar{x}\|) > 0$.

由引理 1 可得 $\det \bar{Q}_1(L) = \bar{m}L^2 + 2\bar{n}L + \bar{q} - \frac{1}{2}\beta h_1 F(\det S)$.

下证 $\forall L \in [0, G], \det \bar{Q}_1(L) > 0$.

事实上由定理 2 的条件 2) 成立, 可得 $\det \bar{Q}_1(L) \geq \bar{m}L^2 + 2\bar{n}L + \bar{q} - \frac{1}{2}\beta \bar{h} F(\det S) > 0$.

因为 $\bar{Q}_1(L) \begin{pmatrix} 1 \\ 1 \end{pmatrix} = S > 0$, 则 $\bar{Q}_1(L) > 0$, 就有 $\lambda_{\min} \bar{Q}(L) > 0$, $\min_{L \in [0, G]} \lambda_{\min} \bar{Q}_1(L) \triangleq \tau_2 > 0$. 当

> 0 时, 就有 $-\dot{V}|_{(1.1)} \geq \tau_2(\sigma^2 + \|\bar{x}\|) > 0$.

令 $\tau_3 = \min(\tau_1, \tau_2)$, $\|y\| = (\sigma^2 + \|\bar{x}\|)$. 则 $-\dot{V}|_{(1.1)} \geq \tau_3 \|y\| > 0$. 定理得证.

参 考 文 献

- 1 Narendra, K. S. and Taylor, J. H. . Frequency Domain Criteria for Absolute Stability. New York: Academic, 1973
- 2 Kerbelev, A. M. . Circle criterion of robust stability and instability of nonstationary nonlinear systems. Automat mekh, 1993, (12): 111-115
- 3 赵素霞. 多个执行机构的控制系统的绝对稳定性. 中国科学 A 辑, 1987, (8): 785-792
- 4 谢惠民. 绝对稳定性理论与应用. 北京: 科学出版社, 1986
- 5 秦元勋, 王联, 王慕秋. 运动稳定性理论及其应用. 北京: 科学出版社, 1980
- 6 列托夫. 非线性调节系统的稳定性. 北京: 科学出版社, 1959
- 7 MacFarlane, A. G. T. (ed.). Frequency-Response Methods in Control Systems. New York: IEEE Press, Inc. , 19
- 8 Гелиг, А. Х. , Леонов, Г. А. , Якубович, В. А. . Устойчивость Нелинейных Систем С Неединственным Состоянием Ра НАУКА, Г. Главная Редакция, МОСКВА, Физико-Математич Ескон Литературы, 1978

Absolute Stability of a Class of Nonlinear Time-Varying Control System

YANG Bin and PAN Dehui

(The School of Information Science and Engineering, Northeastern University • Shenyang, 110006, PRC)

Abstract: In this paper, some sufficient conditions for absolute stability of nonlinear time-varying systems based on the quadratic Lyapunov function with integral terms have been given. The results are prior to that of [1].

Key words: control systems; Lyapunov function; absolute stability

本文作者简介

杨 斌 博士研究生. 1992年毕业于辽宁师范大学数学系, 1995年在辽宁师范大学数学系获得硕士学位, 同北大学信息科学与工程学院, 主要研究方向为控制系统的稳定性, 鲁棒控制.

潘德惠 1928年生. 1949年毕业于东北大学理学院, 现为东北大学工商管理学院教授, 自动控制系控制理论业博士生导师. 中国数学会理事, 曾多年从事应用数学的研究, 现在的研究领域是分布参数系统的模型辨识最优控