

Identificación de SIStemas

Estructuras de Modelos para Sistemas Lineales Estacionarios en Tiempo Discreto

ISIS

J. C. Gómez

1

- ❑ Como los datos de entrada/salida a usar en la Identificación se obtienen por **muestreo**, es más natural asumir que los datos provienen de **un modelo en Tiempo Discreto (TD)**, aunque las variables del sistema sean inherentemente de naturaleza continua.
- ❑ Un sistema es **estacionario** si la respuesta del sistema a una misma entrada es la misma independientemente del instante en que se aplica la entrada.
- ❑ Un sistema es **lineal** si verifica el **Principio de Superposición**, es decir si su respuesta a una combinación lineal de entradas es la misma combinación lineal de las respuestas a las entradas individuales.
- ❑ Un sistema es **causal** si la salida en un instante depende de las entradas pasadas hasta ese instante (no depende de valores futuros). Para un sistema en TD una **condición necesaria y suficiente** para causalidad es:

ISIS

J. C. Gómez

2

Causalidad $\Leftrightarrow h(n) = 0$ para $n < 0$

donde $\{h(n)\}_{n=-\infty}^{\infty}$ es la **respuesta al impulso** del sistema.

□ Un **Sistema Lineal y Estacionario** puede ser completamente descrito por su **respuesta al impulso**, ya que la respuesta del sistema a una entrada arbitraria puede calcularse como la convolución entre la entrada y la respuesta al impulso del sistema:

- Sistemas en Tiempo Continuo

$$y(t) = \int_{-\infty}^{\infty} h(\tau)u(t - \tau)d\tau \quad (1)$$

- Sistemas en Tiempo Discreto

$$y(n) = \sum_{k=-\infty}^{\infty} h(k)u(n - k) \quad (2)$$

ISIS

3

Modelos Entrada-Salida

□ La relación (2) permite computar la respuesta del SLE a una entrada arbitraria. En la práctica, existen **señales de perturbación** que también afectan la respuesta del sistema. El efecto de estas perturbaciones se suele concentrar en un término $v(n)$ aditivo a la salida, *i.e.*

$$y(n) = \sum_{k=0}^{\infty} h(k)u(n - k) + v(n)$$

Perturbación

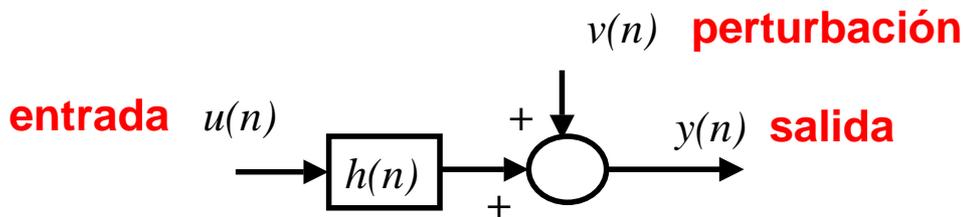
$$y(n) = \underbrace{\sum_{k=0}^{\infty} h(k)q^{-k}}_{G(q)} u(n) + v(n) \quad (3)$$

Función Transferencia

ISIS

J. C. Gómez

4



Sistema LTI Modelo Lineal General

- La perturbación $v(n)$ es la parte de la salida que no puede ser explicada por las entradas pasadas. Puede atribuirse a distintas causas:

Ruido de medición: los sensores que miden las señales están afectados por ruido.

Entradas no controlables: señales que ingresan al sistema pero que no son controlables por el usuario, y generalmente tampoco son medibles.

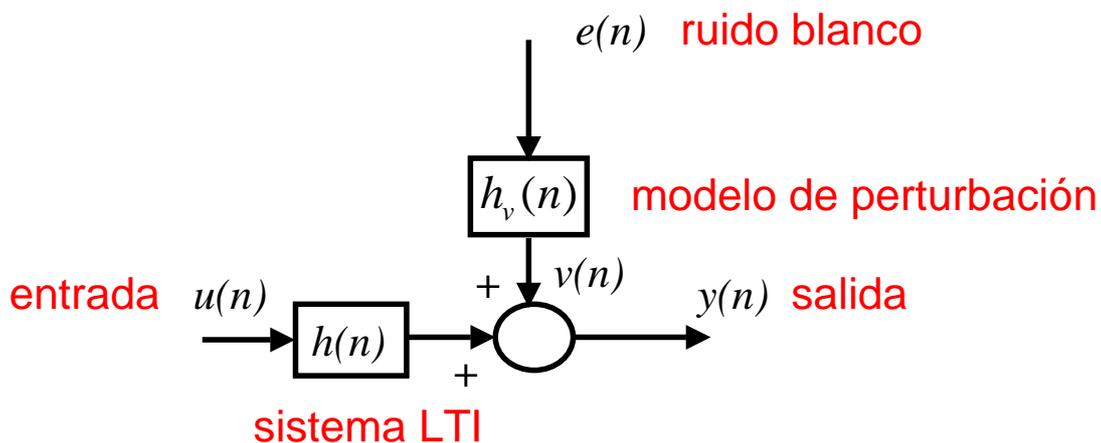
Caracterización de las perturbaciones

- Una característica importante de las perturbaciones es que su valor **no se conoce de antemano**. Existen básicamente dos enfoques respecto a la caracterización de las perturbaciones:
 - **Enfoque Probabilístico:** Se asignan probabilidades a las diferentes secuencias $\{v(n)\}$. Es decir $\{v(n)\}$ es un proceso aleatorio con una distribución de probabilidad conocida (por ejemplo a través de la función de densidad de probabilidad (pdf) $p_v(\bullet, \theta)$). Esta caracterización da lugar a modelos estocásticos y los correspondientes métodos de identificación resultan métodos estocásticos.
 - **Enfoque Determinístico:** Se restringe el conjunto de posibles señales de alguna manera, por ejemplo asumiendo que son desconocidas pero que están acotadas, *i.e.*

$$|v(n)| \leq C \quad \forall n$$

Este enfoque da lugar a los Métodos de Identificación Determinísticos, e.g. Bounded Error Estimation, o Set Membership Identification.

- Enfoque Probabilístico:** Se asume que $\{v(n)\}$ es un proceso aleatorio. Una completa caracterización implicaría conocer la función de densidad de probabilidad condicional conjunta para $\{v(n+l), l \geq 1\}$ dado $\{v(s), s \leq n\}$, lo que no es realístico. Se adopta en general un enfoque más simple asumiendo que $\{v(n)\}$ es la salida de un SLE cuando su entrada es **ruido blanco**, i.e.



$$v(n) = \underbrace{\sum_{k=0}^{\infty} h_v(k) q^{-k}}_{H(q)} e(n) = H(q)e(n) \quad (4) \quad \text{Modelo de perturbación (ruido blanco filtrado)}$$

$$y(n) = G(q)u(n) + H(q)e(n) \quad (5)$$

$\{e(n)\}$ es **ruido blanco**, i.e., es una secuencia de variables aleatorias independientes e idénticamente distribuidas (iid) con una cierta función de densidad de probabilidad. Esta descripción, si bien bastante general, no puede caracterizar completamente todas las perturbaciones aleatorias. Usualmente sólo se especifican las estadísticas de segundo orden de $\{e(n)\}$, es decir la **media** y la **varianza**.

□ Valor Medio y Covarianza de $\{v(n)\}$

Asumiremos que $\{e(k)\}$ es ruido blanco con media cero y varianza λ . A partir de la descripción (5) calcularemos la media y la varianza de $\{v(n)\}$.

La media resulta

$$E\{v(n)\} = \sum_{k=0}^{\infty} h_v(k) E\{e(n-k)\} = 0 \quad (6)$$

La covarianza resulta

$$\begin{aligned} E\{v(n)v(n-\ell)\} &= \sum_{k=0}^{\infty} \sum_{s=0}^{\infty} h_v(k) h_v(s) E\{e(n-k)e(n-\ell-s)\} \\ &= \sum_{k=0}^{\infty} \sum_{s=0}^{\infty} h_v(k) h_v(s) \delta(k-\ell-s) \lambda \\ &= \lambda \sum_{k=0}^{\infty} h_v(k) h_v(k-\ell) \end{aligned} \quad (7)$$

donde $h_v(r) = 0$ para $r < 0$. Podemos notar que la covarianza es independiente de n . La denotaremos

$$R_v(\ell) = E\{v(n)v(n-\ell)\}$$

y la designaremos como **función covarianza** del proceso $\{v(n)\}$.

Como la media en (6) y la covarianza en (7) no dependen de n , se dice que el proceso es **estacionario** (hasta momentos de segundo orden).

Parametrización de Modelos Entrada/Salida Estocásticos

$$y(n) = G(q, \theta)u(n) + H(q, \theta)e(n) \quad (8)$$

$\{e(n)\}$ ruido blanco con media cero y varianza λ
 f_{ε} : función de densidad de probabilidad de $\{e(n)\}$

θ vector de parámetros
 $v(n) = H(q, \theta)e(n)$ modelo de la perturbación

□ Modelos Polinomiales Generalizados

$$A(q, \theta)y(n) = \frac{B(q, \theta)}{F(q, \theta)}u(n - n_k) + \frac{C(q, \theta)}{D(q, \theta)}e(n) \quad (9)$$

$A(q, \theta), B(q, \theta), C(q, \theta), D(q, \theta), F(q, \theta)$ polinomios en q^{-1}
 parametrizados por θ

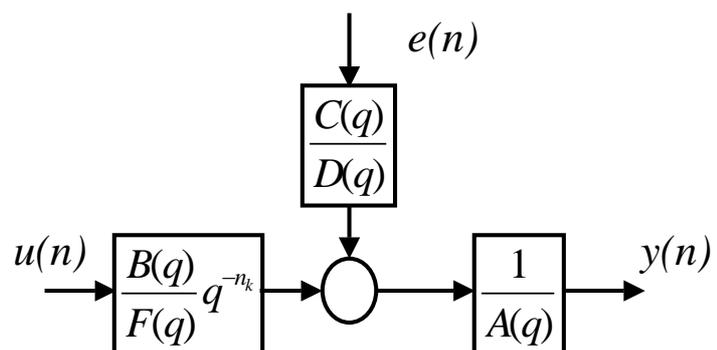
$$A(q) = 1 + a_1q^{-1} + \dots + a_{n_a}q^{-n_a}$$

$$B(q) = b_0 + b_1q^{-1} + \dots + b_{n_b}q^{-n_b}$$

$$C(q) = 1 + c_1q^{-1} + \dots + c_{n_c}q^{-n_c}$$

$$D(q) = 1 + d_1q^{-1} + \dots + d_{n_d}q^{-n_d}$$

$$F(q) = 1 + f_1q^{-1} + \dots + f_{n_f}q^{-n_f}$$



- **Modelo ARX (AutoRegressive with eXogeneous input)**

$$F(q, \theta) = C(q, \theta) = D(q, \theta) = 1$$

- **Modelo ARMAX (AutoRegressive Moving Average with eXogeneous input)**

$$F(q, \theta) = D(q, \theta) = 1$$

- **Modelo ARMA (AutoRegressive Moving Average)**

$$D(q, \theta) = F(q, \theta) = 1$$

$$B(q, \theta) = 0$$

- **Modelo BJ (Box-Jenkins)**

$$A(q, \theta) = 1$$

- **Modelo OE (Output Error)**

$$A(q, \theta) = C(q, \theta) = D(q, \theta) = 1$$

□ Modelos en Espacio de Estados

$$x(n+1) = Ax(n) + Bu(n) + \omega(n)$$

Ecuación de Estado

$$y(n) = Cx(n) + Du(n) + \nu(n)$$

Ecuación de Salida

$x(n)$: vector de estados

$\omega(n)$: ruido de proceso o de planta

$u(n)$: vector de entradas

$\nu(n)$: ruido de medición o de salida

$y(n)$: vector de salidas

C : matriz de salida

A : matriz de evolución

D : matriz de transmisión directa

B : matriz de entrada

$$x(n+1) = Ax(n) + Bu(n) + Ke(n)$$

Forma de Innovación

$$y(n) = Cx(n) + Du(n) + e(n)$$

K : matriz de Kalman

$e(n)$: ruido blanco