

Esercitazione 1 — Aprile 27

Docente: Luca Schenato

Stesore: Luca Schenato

1.1 Il Filtro di Kalman

Esercizio 1: Inseguimento di un veicolo In questo esercizio di andrà ad applicare il filtro di Kalman per la stima di posizione di un veicolo mobile di cui non si conosce il comportamento a priori. A tale scopo consideriamo un veicolo bidimensionale la cui dinamica è data da $\ddot{p}_x = u_x$ e $\ddot{p}_y = u_y$, dove (p_x, p_y) è la sua posizione rispetto ad un sistema di riferimento fisso e (u_x, u_y) sono le forze generate dai suoi motori. Si tratta in pratica della dinamica di un oggetto di massa unitaria senza attrito. Poiché gli ingressi non sono noti a priori, una tecnica molto usata è quella di modellare un comportamento non noto a priori assumendo che gli ingressi (u_x, u_y) siano delle variabili aleatorie gaussiane. Per prima cosa si discretizza la dinamica con tempo di campionamento $T = 0.1$ e si utilizza una rappresentazione in spazio di stato dove lo stato $x = (p_x, v_x, p_y, v_y) \in \mathbb{R}^4$, dove (v_x, v_y) sono le velocità istantanee. La dinamica discretizzata è data da:

$$x_{k+1} = Ax_k + w_k, \quad w_k \sim \mathcal{N}(0, Q), \quad A = \begin{bmatrix} 1 & 0.1 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 1 & 0.1 \\ 0 & 0 & 0 & 1 \end{bmatrix}, \quad Q = q * 0.01 \begin{bmatrix} 0.01 & 0.1 & 0 & 0 \\ 0.1 & 1 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 0.01 & 0.1 \\ 0 & 0 & 0.1 & 1 \end{bmatrix}$$

dove $q \in \mathbb{R}, q \geq 0$ è l'effetto di (u_x, u_y) è stato sostituito dal disturbo di processo w_k . Si assume poi che il processo di misura $y = (y_x, y_y)$ corrisponda alla misura della posizione (p_x, p_y) del veicolo soggetto a rumore gaussiano, cioè:

$$y_k = Cx_k + v_k, \quad v_k \sim \mathcal{N}(0, R), \quad C = \begin{bmatrix} 1 & 0 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 1 & 0 \end{bmatrix}, \quad R = r \begin{bmatrix} 0.01 & 0 \\ 0 & 0.01 \end{bmatrix}$$

dove $r \in \mathbb{R}, r \geq 0$. Si noti come, per costruzione, la dinamica e il processo di misura lungo l'asse x e lungo l'asse y sia disaccoppiata e identica, e quindi si potrebbe scomporre la dinamica del sistema di dimensione $n = 4$ come l'unione di due sistemi uguali di dimensione $n = 2$, semplificando notevolmente le equazioni. Si assuma infine che la posizione iniziale non sia nota ma si possa approssimare come una variabile aleatoria gaussiana:

$$x_0 \sim \mathcal{N}(0, P_0), \quad P_0 = \begin{bmatrix} 1 & 0 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 1 \end{bmatrix}$$

1. Si implementino le equazioni del filtro di Kalman per $q = r = 1$. Si facciano alcune simulazioni per verificare la prestazione dello stimatore con almeno 100 passi. Si inizializzi¹ la posizione del veicolo con

$$x_0 = [1 \ 1 \ 2 \ 1]^T.$$

La varianza di errore $P_{k+1|k}$ converge? E' la matrice a cui converge strettamente definita positiva? E' unica? Quale e' il guadagno del del filtro di Kalman a regime?

2. Si implementi le equazioni di un filtro statico con guadagno del filtro ottenuto dal filtro di Kalman a regime. Si confrontino le prestazioni di questo stimatore con lo stimatore di Kalman utilizzando le stesse condizioni iniziali e la stessa realizzazione delle variabili aleatorie, cioè w_k, v_k devono essere gli stessi².
3. Si visualizzi nel piano x - y la dinamica del veicolo reale e di un veicolo virtuale che utilizza la stimatore per la posizione e velocità. Si usino la funzione `plot_car`(p_k^x, p_k^y, θ_k) calcolando l'angolo di orientamento tramite la funzione $\theta_k = \text{atan2}(v_k^y, v_k^x)$. Si sovrapponga al veicolo virtuale il grafico dell'ellisse di confidenza di probabilità 99% solitamente detto 3σ che si ottiene con `plot_ellipse`($p_k^x, p_k^y, 9 * P_{k|k}^{pos}$), cioè con probabilità del 99% la posizione reale del veicolo e' all'interno dell'ellisse, dove

$$P_{k|k}^{pos} = \begin{bmatrix} P_{k|k}(1, 1) & P_{k|k}(1, 3) \\ P_{k|k}(3, 1) & P_{k|k}(3, 3) \end{bmatrix}.$$

4. Si verifichi che la varianza di errore empirico P_k^{emp} converge verso l'aspettazione d'errore $P_\infty = \lim_{k \rightarrow \infty} P_{k|k}$, dove

$$P_k^{emp} = \frac{1}{M} \sum_{m=1}^M (x_k(m) - \hat{x}_{k|k}(m))(x_k(m) - \hat{x}_{k|k}(m))^T.$$

dove M sono il numero di simulazioni, cioè e' necessario calcolare $x_k(m), \hat{x}_{k|k}(m)$ per diverse realizzazioni dei rumori v_k, w_k e poi mediare.

5. Si ripetano i punti precedenti con $r = 0, q = 1$. Cosa cambia? Posso ancora usare il filtro statico con guadagno del filtro di Kalman a regime?
6. Si ripetano i punti precedenti con $r = 1, q = 0$. Cosa cambia? Posso ancora usare il filtro statico con guadagno del filtro di Kalman a regime? Perché? Si riesce a dare una spiegazione pratica?

¹Ovviamente lo stimatore va inizializzato con $\hat{x}_0 = 0$.

²In MATLAB le variabili aleatorie (v_k, w_k) si possono generare facilmente tramite i comandi $w_k = \text{sqrtm}(Q) * \text{randn}(4, 1), v_k = \text{sqrtm}(R) * \text{randn}(2, 1)$.

Esercizio 2: Stima di parametri costanti Sebbene il filtro di Kalman sia espressamente ottenuto per processi dinamici, puo' essere utilizzato anche per ottenere la stima di parametri costanti non noti. Per esempio si supponga di voler stimare la resistenza di un resistore, che indichiamo con x_0 . In genere si conoscono il valore nominale \bar{x}_0 ed eventualmente l'intervallo di confidenza $\bar{x}_0 \pm p_0$. Si puo' quindi supporre che $x_0 \sim \mathcal{N}(\bar{x}_0, p_0)$. Abbiamo la possibilita' di fare delle misure direttamente sul resistore. Queste misure sono affette da rumore con media nulla e varianza r . Quindi il modello di misura puo' essere scritto come:

$$\begin{aligned}x_{k+1} &= x_k, & x_0 &\sim \mathcal{N}(\bar{x}_0, p_0) \\y_k &= x_k + v_k, & v_k &\sim \mathcal{N}(0, r)\end{aligned}$$

E' chiaro che non essendoci dinamica $x_k = x_0 \forall k$.

1. Si calcoli il filtro di Kalman in maniera esplicita. A cosa converge p_k ? e il guadagno di Kalman k_k ?
2. Se $p_0 = \infty$ cosa e' p_1 ? e p_k ? Si noti che in questo caso $\hat{x}_{k|k} = \frac{1}{k} \sum_{i=1}^k y_i$, cioe' il filtro di Kalman corrisponde al calcolo della media in maniera iterativa. Quale e' il significato di p_0 quindi? Cosa succede se per qualche motivo uso un p_0 diverso?
3. Si facciano alcune simulazioni con $x_0 = 1.9, \bar{x}_0 = 1.5, p_0 = 0.5, r = 0.4$. In particolare si faccia il grafico di $\hat{x}_{k|k}$ e vedere che converge a x_0 . Qual'e' la velocita' di convergenza di $\hat{x}_{k|k}$ a x_0 ? Cioe' con che velocita' converge a zero $p_{k|k}$?