

Úvodní informace

Matematické modelování

Matematické metody pro ITS (11MAMY)

Jan Příkryl, Bohumil Kovář

1. přednáška 11MAMY

úterý 23. února 2016

verze: 2016-02-28 16:17

Obsah

<i>O předmětu</i>	2
<i>Základní organizační informace</i>	2
<i>Seznam literatury</i>	3
<i>Hodnocení předmětu</i>	4
<i>Domácí příprava</i>	4
<i>Vstupní znalosti</i>	4
<i>Výstupní znalosti</i>	4
<i>Matematické modelování systémů</i>	5
<i>Jaké cíle může modelování dosáhnout?</i>	6
<i>Klasifikace modelů</i>	7
<i>Fáze modelování</i>	8
<i>Model systému</i>	8
<i>Vnější popis systémů</i>	11
<i>Vnitřní popis systémů</i>	12
<i>Iterace</i>	14
<i>Iterace rovnice ceny</i>	14
15	
<i>Základní spojité signály</i>	15
<i>Diracův impuls</i>	15
<i>Jednotkový skok</i>	15
<i>Exponenciála</i>	16
<i>Periodické a harmonické funkce</i>	16

<i>Diskrétní</i>	17
<i>Diskrétní jednotkový impuls a skok</i>	17
<i>Diskrétní sinusová posloupnost</i>	18
<i>Odezva systému</i>	19
<i>Diskrétní systém</i>	19
<i>Lineární a nelineární</i>	19
<i>Časově invariantní, resp. stacionární systém</i>	21
<i>Kauzální, příčinný systém</i>	22
<i>Spojité systém</i>	23
<i>Autonomní a neautonomní systém</i>	24

Tento text je do jisté míry experimentálním pískovištěm na odladění převodu textu prezentace vytvořené v L^AT_EXové třídě beamer do textu vysázeného pomocí tuft^e-handout. Obsah je oproti prezentaci mírně rozšířen o poznámky. Bude se ještě v průběhu semestru měnit, kontrolujte si prosím čas sestavení v záhlaví tohoto souboru.

O předmětu

Cílem předmětu *Modelování systémů a procesů* je seznámit posluchače se základními teoretickými poznatky a postupy, které jsou nezbytné pro matematické modelování jevů v dopravě. Předmět je základním stavebním kamenem navazujících předmětů, které se zabývají teorií řízení, identifikací parametrů systému či modelováním stochastických systémů a procesů.

Problematika modelování systémů a procesů je velmi rozsáhlá. Tento text se proto soustředí zejména na oblast modelování lineárních a časově invariantních (LTI) spojitých a diskretních systémů, pro které lze využít matematické transformace – Laplaceovu transformaci a Z -transformaci. Tyto transformace převádějí diferenciální a diferenční rovnice na rovnice algebraické, s jejichž pomocí lze definovat LTI systém v podobě přenosové funkce. Z tvaru přenosové funkce lze již stanovit základní vlastnosti systému, jako je například *stabilita systému*, jeho *kmitočtové charakteristiky*, impulsní a přechodová odezva a podobně.

Základní organizační informace

Přednášející:

- Dr. Ing. Jan Příkryl (prikryl@fd.cvut.cz) přednášky blokově, po–
čt 9:45–12:00

Cvičící:

- Dr. Ing. Jan Příkryl (prikryl@fd.cvut.cz) cvičení blokově, po–čt
13:00–15:15

Garant předmětu:

- prof. RNDr. Miroslav Vlček, DrSc. (vlcek@fd.cvut.cz)

Domovská stránka předmětu 11MAMY: <http://zolotarev.fd.cvut.cz/mamy>

Cvičení: Pravidla jsou na stránkách předmětu.

Cvičení pro druhý zápis: Zatím nemáme.

Seznam literatury

Není zcela úplný, viz web.

1. VELTEN, Kai. *Mathematical modeling and simulation: introduction for scientists and engineers*. John Wiley & Sons, 2009.
2. OGATA, Katsuhiko. *Modern control engineering*. Prentice Hall PTR, 2001.
3. OPPENHEIM, Alan V., Alan S. WILLSKY a Syed Hamid NAWAB. *Signals and Systems*. 2. vyd. Upper Saddle River: Prentice Hall, 1997, 957 s. ISBN 01-381-4757-4.
4. JAMES, Gareth, et al. *An introduction to statistical learning*. New York: Springer, 2013.
5. DANGELMAYR, Gerhard a KIRBY, Michael. *Mathematical Modeling – A Comprehensive Introduction*. Upper Saddle River: Prentice Hall, 2005.
6. HEATH, Michael T. *Scientific computing – An Introductory Survey*. 2. vyd. New York: McGraw-Hill, 2002.
7. BERTSEKAS, Dimitri P. *Dynamic programming and optimal control*. Belmont, MA: Athena Scientific, 1995.
8. KARBAN, Pavel. *Výpočty a simulace v programech Matlab a Simulink*. Brno: Computer Press, 2006.
9. Informace o prostředí MATLAB <http://zolotarev.fd.cvut.cz/mni/> <http://zolotarev.fd.cvut.cz/msp/> <http://www.fd.cvut.cz/personal/nagyivan/PrpStat/Prp/MatIntro.pdf>
10. Matematika-opakování <http://euler.fd.cvut.cz/predmety/ml1/>

Hodnocení předmětu

Celkový počet bodů, které lze získat, je 30. Počet bodů, které studenti mohou získat ze cvičení, je 15. Zkouška sestává z písemného testu (15 bodů).

Zápočet udělujeme od 7 bodů ze semestru výše.

Body jsou rozděleny následovně:

- 7 bodů za teoretické zpracování odborného textu z oblasti ITS, popisujícího nějaký model,
- 8 bodů za implementaci, prezentaci a výsledky.

Úkoly na cvičeních (semestrální projekt) jsou skupinové – skupiny po dvou, výjimečně po třech studentech)

Domácí příprava

Vstupní znalosti

Toto jsou znalosti, u nichž předpokládáme, že je ovládáte. Jejich neznalost se *neomlouvá*.

1. Znalost základních pojmů a operací s vektory a maticemi
2. Znalost práce s komplexními čísly a základů funkcí komplexní proměnné
3. Znalost vlastností trigonometrických, hyperbolických, exponenciálních funkcí
4. Znalost výpočtu součtů nekonečné řady, derivace a integrálů funkce jedné proměnné
5. Znalost práce se zlomky, algebraickými výrazy a běžné středoškolské matematiky
6. Základní znalosti prostředí SCILAB/MATLAB (v rozsahu předmětů 11PT a 11STS)

Výstupní znalosti

Toto jsou dovednosti, u nichž garantujeme, že je budete v případě úspěšného absolvování předmětu ovládat:

1. Znalost základních principů matematického modelování a matematické teorie řízení
2. Základní znalosti o typech modelů a jejich užití
3. Základní znalosti o měření a předzpracování dat

4. Povědomí o lineární optimalizaci, multikriteriální optimalizaci a dynamickém programování
5. Znalost modelování časových řad
6. Znalost prostředí MATLAB/SIMULINK pro modelování dynamických systémů a řešení soustav nelineárních diferenciálních a diferenčních rovnic

Matematické modelování systémů

Co je to vlastně matematické modelování?

Modely vždy nějakým způsobem popisují naše přesvědčení o tom, jak svět funguje. Modely nás provázejí od nepaměti: například obyčejná mapa je vlastně dvourozměrný model našeho pohledu na krajinu; architekti často studují tvary plánovaných budov na jejich zmenšeninách ze sádry a dřeva, aby zjistili, jak bude objekt působit po zasazení do krajiny. Modely jsou většinou zjednodušením reality, postihují jen to, co nás pro studium daného problému opravdu zajímá. Pro nás nepodstatné detaily model zanedbává (u mapy to například mohou být různé malé detaily, u architektonického modelu potom vnitřní vybavení místností budovy).

Modely popisují naše přesvědčení o tom, jak svět funguje.

Provázejí nás od nepaměti:

- obyčejná mapa je dvourozměrný model pohledu na krajinu
- modely plánovaných budov ze sádry a dřeva

Většinou jde o *zjednodušení reality*: postihují jen to, co nás pro studium daného problému opravdu zajímá. Pro nás nepodstatné detaily model zanedbává.

V matematickém modelování tato přesvědčení o fungování světa překládáme do jazyka matematiky. To má řadu výhod:

1. *Matematika je velmi přesný jazyk.* Tato přesnost nám pomáhá formulovat myšlenky a identifikovat základní předpoklady pro vytvářený model.
2. *Matematika je výstižný jazyk s dobře definovanými pravidly* pro manipulaci s výrazy.
3. *Všechny výsledky, které matematici dokázali v průběhu minulých stovek let, jsou nám k dispozici* a můžeme je pro náš model využít.
4. *K provedení numerických výpočtů můžeme dnes použít počítače.*

V matematickém modelování naše přesvědčení o fungování světa překládáme do jazyka matematiky.

Má to řadu výhod:

1. Matematika je *velmi přesný jazyk*.
2. Matematika je *výstižný jazyk s dobře definovanými pravidly* pro manipulaci s výrazy.
3. Všechny dřívější výsledky *jsou nám k dispozici* a můžeme je pro náš model využít.
4. K provedení numerických výpočtů *můžeme dnes použít počítače*.

Hned na úvod je vhodné zdůraznit, že značnou část matematického modelování tvoří kompromisy. Většina systémů, jež na sebe v reálném světě působí, je totiž příliš složitých na to, abychom je mohli modelovat v plném rozsahu a mnohdy to ani není možné, protože potřebné jemné detaily fungování modelovaného systému ani neznáme. Proto je prvním stupněm kompromisu snaha *identifikovat nejdůležitější části systému* – ty budou do modelu zahrnuty, zbytek bude zanedbán.

Druhá úroveň kompromisu se týká množství matematických operací, které má smysl při modelování provádět: I když matematika má potenciál v naprosté obecnosti dokázat různé výsledky, tyto výsledky závisí kriticky na formě použitých rovnic. Malé změny ve struktuře rovnic přitom mohou vyžadovat obrovské změny v matematických metodách. Použijeme-li k manipulaci s rovnicemi vytvářeného modelu počítač, nemusí to sice vést k elegantním výsledkům, ale je to mnohem odolnější vůči změnám. ■ **vůči změnám?**
tenhle konec je nesrozumitelný ■

Značnou část matematického modelování tvoří *kompromisy*.

Většina reálných systémů je příliš složitá.

Kompromis #1: Snaha *identifikovat nejdůležitější části systému* – ty budou do modelu zahrnuty, zbytek bude zanedbán.

Matematicky lze v naprosté obecnosti dokázat mnoho, ale použitelnost výsledků závisí kriticky na formě použitých rovnic. K jejich vyčíslení používáme *počítače*, a ty *nejsou nikdy zcela přesné*.

Kompromis #2: Použijeme-li k manipulaci s rovnicemi vytvářeného modelu počítač, nemusí to sice vést k elegantním výsledkům, ale je to mnohem odolnější vůči změnám.

Jaké cíle může modelování dosáhnout?

Pro použití matematického modelu je v praxi celá řada různých důvodů a model používáme jako prostředek k dosažení různých cílů. Jak dobře je přitom nějakého určitého cíle dosaženo, to závisí

jak na stavu našich znalostí o modelovaném systému, tak i na tom, jak dobře tento systém modelujeme.

Příklady řady cílů jsou:

1. *Rozvoj vědeckého poznání* – prostřednictvím kvantitativního vyjádření současných znalostí o systému (stejně jako znázornit to, co víme, můžeme také ukázat, co nevíme);
2. *Testování* vlivu změn v systému
3. *Získat informace pro podporu rozhodování*, včetně
 - (a) taktických rozhodnutí manažerů
 - (b) strategických rozhodnutí plánovačů

Klasifikace modelů

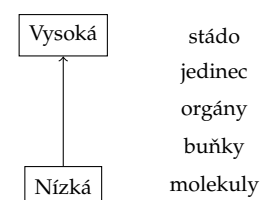
Při studiu modelů je užitečné identifikovat hlavní kategorie modelů. Klasifikace jednotlivých modelů do těchto kategorií nám okamžitě řekne některé základní informace o jejich struktuře. Jedno rozdělení modelů je založeno na typu výsledku, který předpovídají. **Deterministické modely** ignorují náhodné variace a vždy tak predikují stejný výsledek z daného výchozího bodu. Na druhou stranu může mít model více statistickou povahu a může predikovat statistické rozdělení pravděpodobnosti možných výsledků. O takových modelech říkáme, že jsou **stochastické**.

Druhý přístup k rozlišování mezi typy modelů uvažuje míru pochopení reálného světa, na níž je model založen. Nejjednodušší vysvětlení uvažuje hierarchii organizačních struktur v rámci systému, který je modelovaný. Jedna taková hierarchie u zvířat je znázorněna na obrázku 1.

Model, který využívá velké množství teoretických informací, obecně popisuje, co se děje na jedné úrovni hierarchie tím, že uvažuje procesy na nižších úrovních. Jedná se o tzv. **mechanistické modely**, protože berou v úvahu mechanismy, prostřednictvím nichž dochází ke změnám. Naproti tomu u **empirických modelů** se nepřihlíží k mechanismu, jímž dochází ke změnám v systému. Namísto toho se pouze zaznamená, že ke změnám došlo, a model se snaží kvantitativně vysvětlit změny spojené s různými podmínkami.

Obě rozdělení, uvedená výše, tedy deterministický / stochastický a mechanistický / empirický, představují extrémní v rozsahu typů modelů. Mezi nimi leží celá škála typů modelů. Tyto dva přístupy ke klasifikaci se navíc vzájemně doplňují. Deterministický model může být například mechanistický nebo empirický (ale ne stochastický). Příklady čtyř širokých kategorií modelů vyplývajících z výše uvedené metody klasifikace jsou uvedeny v tabulce 1.

Za zmínku stojí ještě jeden další typ modelu, a to **model systému**. Ten je sestaven z řady dílčích modelů, z nichž každý popisuje



Obrázek 1: Hierarchie modelů – analogie se světem zvířat

	Empirický	Mechanistický
Deterministický	Předpověď růstu dobytka z regresní závislosti na konzumaci potravy	Pohyb planet založený na Newtonovské mechanice, popsáné <i>diferenciálními rovnicemi</i>
Stochastický	<i>Analýza rozptylu</i> výnosů odrůd přes lokality a roky	Genetika malých populací založená na Mendelovské dědičnosti popsáné <i>pravděpodobnostními rovnicemi</i>

Tabulka 1: Jedna z možných klasifikací modelů

podstatu nějaké z interagujících složek modelu. Výše uvedený způsob klasifikace pak je v pak vhodnější pro dílčích modely: v jednom modelu systémů mohou být použity různé typy dílčích modelů.

Mnoho publikací o modelování zmiňuje „simulační modely“. Proč tedy jsou nejsou zahrnuty v našem rozdělení? Důvodem tohoto zdánlivého opomenutí je, že *simulace* odkazuje na jeden způsob, jakým se provádějí modelové výpočty – tedy například počítačovou simulací. Vlastní model systému se nemění v závislosti na způsobu, jakým se provádí potřebné matematické výpočty, i když naše interpretace modelu může záviset na numerické přesnosti prováděných aproximací.

Fáze modelování

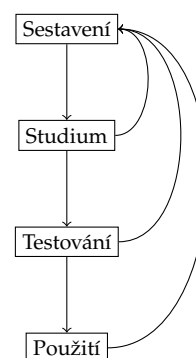
Je užitečné rozdělit proces modelování do čtyř hlavních kategorií činnosti, a to na *tvorbu*, *studium*, *testování* a *používání* modelu. I když by to mohlo být hezké si myslet, že modelovací projekty postupují plynule od fáze tvorby modelu až po jeho použití, téměř vždy to tak není. Obecně platí, že vady zjištěné ve fázích studia a testování jsou korigovány návratem do fáze výstavby. Všimněte si, že pokud dojde ke jakýmkoliv změnám modelu, pak fáze studia a testování se musí opakovat. Schématické znázornění možných cest přes jednotlivé fáze modelování je uvedeno na obrázku 2.

Tento proces opakovaných iterací je pro modelovací projekty typický a je jedním z nejužitečnějších aspektů modelování, pokud jde o lepší pochopení toho, jak systém funguje. Toto rozdělení činnosti v oblasti modelování budeme používat i nadále a bude tvořit strukturu pro zbytek tohoto kurzu.

Model systému

Definice 1 (Systém). Charakteristické vlastnosti, se kterými vystačíme při modelování:

- systém považujeme za část prostředí, kterou lze od jejího okolí oddělit fyzickou nebo myšlenkovou hranicí,
- systém se skládá z podsystémů, vzájemně propojených součástí.



Obrázek 2: Jednotlivé fáze modelování

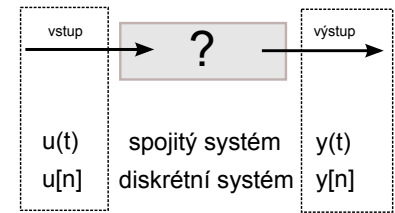
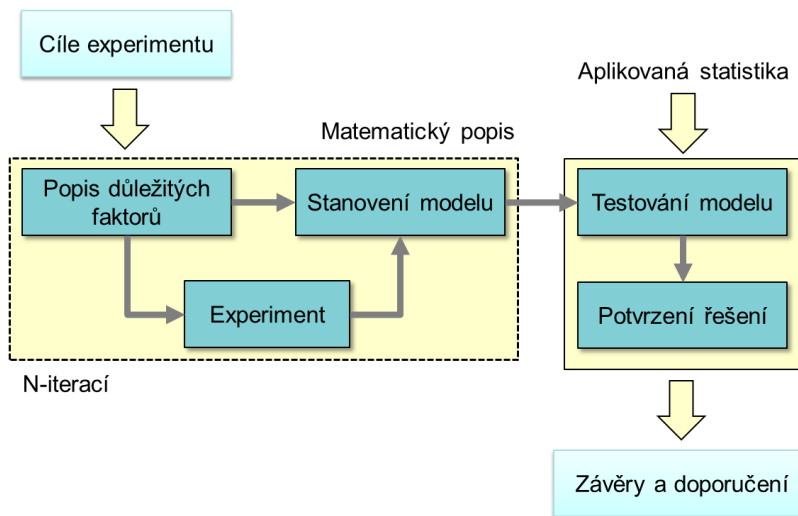
Je to část našeho světa, která se svým okolím nějak interaguje, například prostřednictvím vstupu a výstupu.

Model

Za model můžeme pokládat náhradu nebo zjednodušení **skutečného objektu reálného světa** z hlediska jeho vlastností a funkčnosti.

Modelování je možné pouze pokud zavedeme **určitý stupeň** abstrakce a aproximace.

■ obrázek 3 překreslit do TikZ ■



Obrázek 3: Vstup a výstup systému

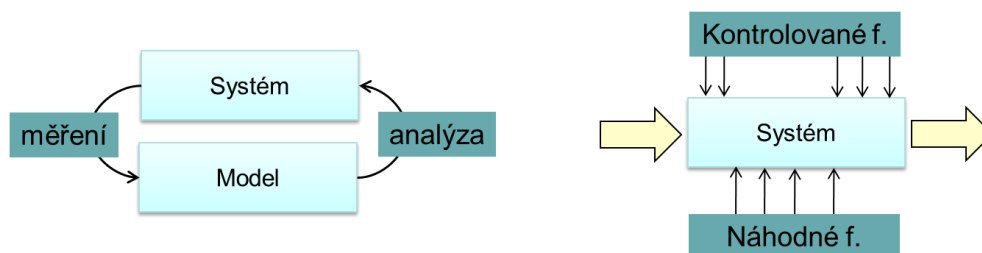
Obrázek 4: Tvorba matematického modelu

■ celá sekce je hodně na vodě ■

Při analýze navrženého modelu chceme učinit co možná nejsilnější rozhodnutí na základě malého množství dat. Správnost našeho návrhu je nutné statisticky vyhodnotit.

Problémy:

1. Významné diference ve sledovaných parametrech mohou být způsobeny špatným návrhem modelu, případně měřením dat
2. Je těžké rozlišit, zda diference v datech jsou skutečné nebo způsobené „náhodným vlivem“.



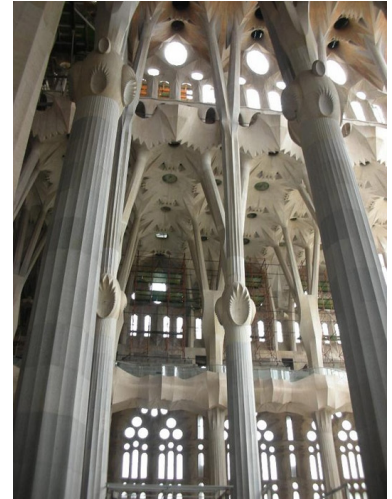
Obrázek 5: Problémy při tvorbě modelu

Otázky:

- Jak ověříme správnost výpočtu rychlosti šíření ptačí chřipky?
- Jak ověříme pevnost nového mostu?
- Jak ověříme bezpečnost softwaru zabezpečovacího zařízení?
- Jak předpovíme dopravní zácpu na dálnici?
- Jak zajistíme spolehlivou funkci navigace při výpadku signálu GPS?

Pokud nemůžeme předem prokázat určité vlastnosti na samotného systému, prokážeme hledané vlastnosti na jeho modelu!

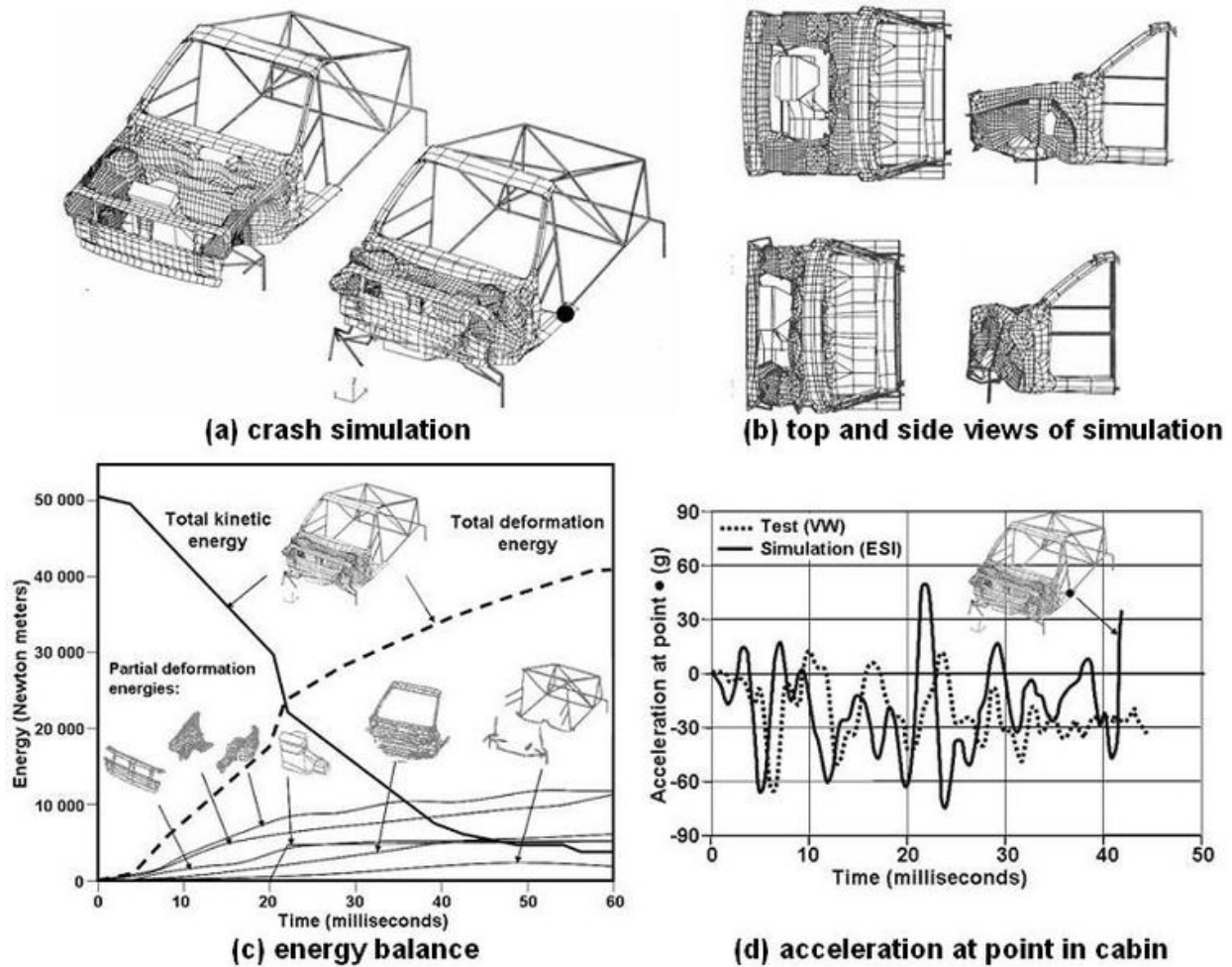
■ pokud nebude víc textu, je třeba změnit marginfigure na figure ■



Obrázek 6: Klenba Gaudího katedrály Sagrada Família v Barceloně



Obrázek 7: Model klenby pro ověření statiky stavby, sestavený z provázků a plátěných pytlíčků s pískem



Obrázek 8: Virtuální crashtest první generace VW Polo

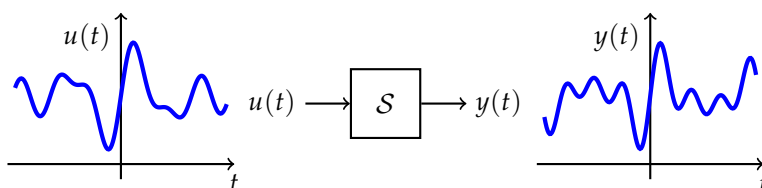
Vnější popis systému

Dynamický systém má v každém okamžiku **stav**, daný množinou reálných čísel. Tento stav lze reprezentovat jako bod ve stavovém prostoru.

Evoluční pravidlo (rovnice vývoje stavu) popisuje přechody mezi jednotlivými stavy dynamického systému.

- většinou deterministické
- může být stochastické

Vnější popis vychází z popisu systému vektorem *vstupu* \mathbf{u} a vektorem *výstupu* \mathbf{y} .



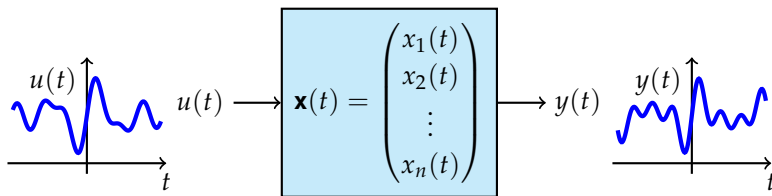
System tak chápeme jako *černou skříňku*, o jejích vlastnostech se dozvíme pouze tehdy, jestliže budeme zkoumat její reakci na vnější události (signály, data).

Vnější model popisujeme diferenciální rovnicí pro systémy se spojitým časem a diferenční rovnicí pro systémy s diskrétním časem. Uvedená rovnice je obecně vyššího řádu, než 1.

Vnitřní popis systémů

Vnitřní, tzv. **stavový popis** systému používá k popisu dynamiky systému vektor **vnitřních stavů** \mathbf{x} .

Vektor vstupů \mathbf{u} a vektor výstupních veličin \mathbf{y} jsou druhotné veličiny vnitřního popisu.



Stavové modely popisujeme

- soustavou diferenciálních rovnic prvního řádu pro systémy se spojitým časem a
- soustavou diferenčních rovnic prvního řádu pro systémy s diskrétním časem.

Modelování není samospasitelné:

- výstupy modelu je vždy třeba ověřovat,
- možné chyby jsou jak v modelu, tak i v jeho výpočtu.

Verifikace: Počítáme správný model.

Validate: Model počítá správně.

Příklad 1 (RC článek): ■ **zde se to kvůli vloženému 'frame' z prezentace rozlomí, text má navazovat** ■

Napětí $u_1(t)$ na RC článku je součet napětí na rezistoru $u_R(t)$ a na kapacitoru $u_C(t)$:

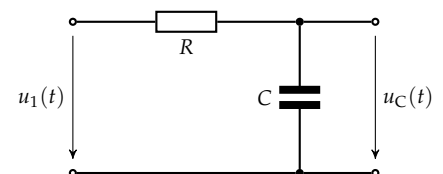
$$u_1(t) = u_R(t) + u_C(t). \quad (1)$$

Proud procházející obvodem $i(t)$ a časový průběh napětí na rezistoru $u_R(t)$ je možno vyjádřit jako

$$i(t) = C \frac{d}{dt} u_C(t)$$

a proto

$$u_R(t) = R \cdot i(t) = RC \frac{d}{dt} u_C(t). \quad (2)$$



Obrázek 9: RC článek

Dosazením $u_R(t)$ do rovnice (1) získáme diferenciální rovnici prvního řádu pro časový průběh napětí na kapacitoru $u_C(t)$:

$$RC \frac{d}{dt} u_C(t) + u_C(t) = u_1(t).$$

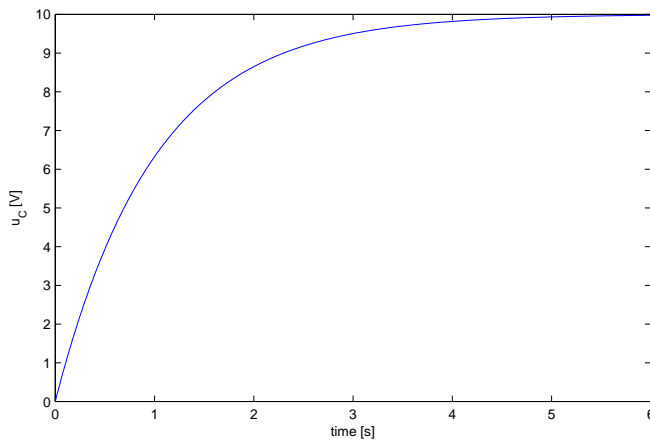
Řešení uvedené rovnice má pro všechna $t \geq 0$,

$$\alpha = \frac{1}{RC},$$

$$u_1(t) = U_0$$

a pro počáteční hodnotu $u_C(0) = 0$ tvar

$$u_C(t) = U_0(1 - e^{-\alpha t}).$$



Obrázek 10: Výstup RC článku

Příklad 2 (Nabídka a poptávka): Základní makroekonomický model rovnovážného trhu, kde nabídka produktu odpovídá poptávce po něm a na trhu se postupně ustálí cena produktu, není lineární. Představíme si jeho linealizovanou variantu, u níž je jako poptávka tak i nabídka lineárně závislá na ceně produktu.

Rovnice nabídky

Nabídka *dnes* závisí na *včerejší* ceně a to tak, že nabídka stoupá s rostoucí cenou. Pro $C > 0$ platí

$$n[k] = Cc[k-1] + Au[k]. \quad (3)$$

Rovnice poptávky

Poptávka *dnes* závisí na *dnešní* ceně a to tak, že poptávka klesá s rostoucí cenou. Pro $D > 0$ platí

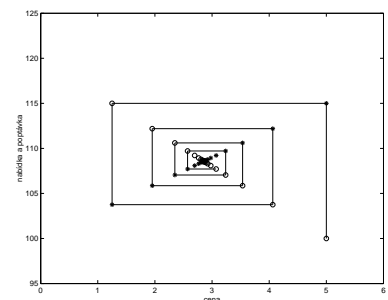
$$p[k] = -Dc[k] + Bu[k]. \quad (4)$$

Rovnost nabídky a poptávky

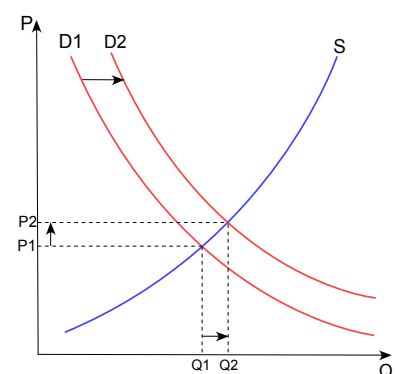
$$n[k] = p[k]$$

pak vede po dosazení z (3) a (4) na diferenciální rovnici prvního řádu

$$c[k] + \frac{C}{D}c[k-1] = \frac{B-A}{D}u[k]. \quad (5)$$



Obrázek 11: Pavučinkový diagram – variace ceny



Obrázek 12: Obecná závislost

Iterace diferenční rovnice

■ doplnit text ■

Iterace rovnice ceny

Diferenční rovnici (5) přepíšeme do kanonického tvaru¹

$$y[k] + \gamma y[k-1] = \beta u[k]$$

a postupnými iteracemi nalezneme pro $u[k] = 1[k]$ a počáteční podmínku $y[-1] = 0$ následující vztahy.

Pro $k = 0$:

$$\begin{aligned} y[0] + \gamma y[-1] &= \beta u[0] \\ y[0] &= \beta - \gamma y[-1] = \beta \end{aligned}$$

Pro $k = 1$:

$$\begin{aligned} y[1] + \gamma y[0] &= \beta u[1] \\ y[1] &= \beta - \gamma y[0] = \beta - \beta\gamma \end{aligned}$$

Pro $k = 2$:

$$\begin{aligned} y[2] + \gamma y[1] &= \beta u[2] \\ y[2] &= \beta - \gamma y[1] = \beta - \beta\gamma + \beta\gamma^2 \end{aligned}$$

Pro obecné n :

$$\begin{aligned} y[n] + \gamma y[n-1] &= \beta u[n] \\ y[n] &= \beta - \gamma y[n-1] = \beta \left(1 - \gamma + \gamma^2 + \dots + (-\gamma)^n \right) \end{aligned}$$

Pokud si uvědomíme, jak vypadá vzorec pro částečný součet členů geometrické posloupnosti, lze z výše uvedeného výčtu odvodit, že řešení rovnice ceny by mělo být ve tvaru

$$y[n] = \beta \sum_{m=0}^n (-\gamma)^m = \beta \frac{1 - (-\gamma)^{n+1}}{1 + \gamma} = \frac{\beta}{1 + \gamma} + \frac{\beta\gamma}{1 + \gamma} (-\gamma)^n.$$

Výsledná cena tedy pro stabilní trh klesá k určité stabilní hodnotě, dané podílem $\beta/(1 + \gamma)$. Výsledný proces stabilizace ceny je znázorněn na obrázku 11.

¹ Kanonický tvar diferenční rovnice označuje ustálenou formu zápisu rovnice, kde výstupy jsou umístěny na levé straně a vstupy na pravé straně rovnice, seřazeny podle posunutí. Zápis v kanonickém tvaru umožňuje čtenáři snadnější orientaci v problematice.

Úvod do teorie signálů

Doporučená literatura pro tuto část je [Oppenheim \(1997\)](#).

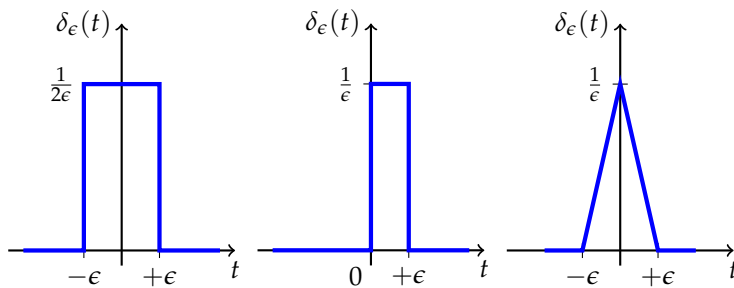
Základní spojité signály

■ doplnit text ■

Diracův impuls

Tato funkce je definována na časovém intervalu pro všechna t a její nenulovou hodnotu předpokládáme pouze v okolí bodu $t = 0$.

Plocha těchto funkcí je rovna 1 pro každé $\epsilon > 0$.



Obrázek 13: Konečná reprezentace $\delta_\epsilon(t)$ pro $\epsilon > 0$

Funkci $\delta(t)$ definujeme jako $\delta(t) = \lim_{\epsilon \rightarrow 0} \delta_\epsilon(t)$.

Funkce $\delta(t)$ se nazývá **Diracův impuls**, Diracova δ -funkce nebo jednotkový impuls. Hodnota $\delta(t)$ pro $t \neq 0$ je $\delta(t) = 0$. Její hodnota v $t = 0$ není definována jako funkce, používá se integrální definice

$$\int_{-\infty}^{\infty} \delta(t) dt = \int_{-\epsilon}^{\epsilon} \delta(t) dt = \int_{0^-}^{0^+} \delta(t) dt = 1$$

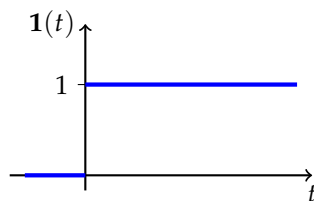
pro každé $\epsilon > 0$.

Jednotkový skok

Funkce jednotkového skoku bývá obvykle značena $\mathbf{1}(t)$ a je definována jako

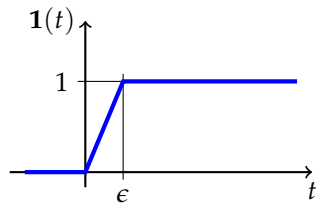
$$\mathbf{1}(t) = \begin{cases} 1 & \text{pro } t \geq 0, \\ 0 & \text{pro } t < 0. \end{cases}$$

Platí



Obrázek 14: Jednotkový skok

$$\delta(t) = \frac{d}{dt} \mathbf{1}(t).$$



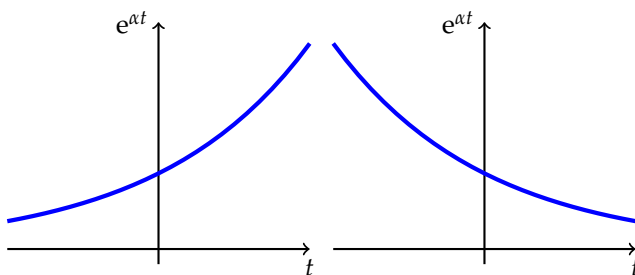
Obrázek 15: Jednotkový skok

Exponenciála

Uvažujme exponenciální funkci

$$f(t) = e^{\alpha t},$$

kde α je reálná konstanta, podle následujícího obrázku.

Obrázek 16: Reálná exponenciála a) pro $\alpha > 0$, b) pro $\alpha < 0$.

Exponenciální funkce

$$f(t) = A e^{\alpha t},$$

kde $\alpha \in \mathbb{C}$, je zajímavá hlavně v případě, kdy $\alpha = i\omega$,

$$f(t) = A e^{i\omega t} = A (\cos \omega t + i \sin \omega t).$$

Periodické a harmonické funkce

O spojitém signálu $f(t)$ říkáme, že je periodický s periodou T , jestliže

$$\forall t : f(t + T) = f(t)$$

a tedy také pro libovolné $k \in \mathbb{Z}$

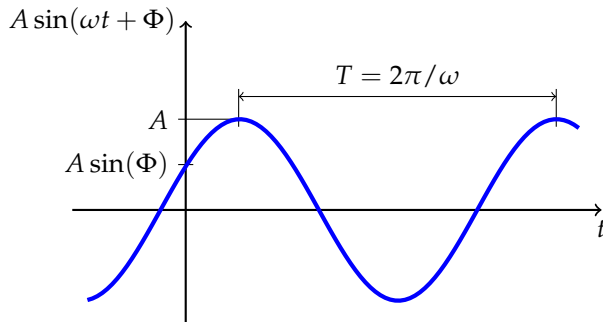
$$f(t) = f(t + T) = f(t + 2T) = \dots = f(t + k \cdot T)$$

Nejmenší možné T nazýváme **fundamentální perioda**, značíme T_0 .

Nejčastěji studovanými signály s periodickým průběhem jsou harmonické funkce, tedy funkce sinus a kosinus. Sinusový signál je obecně zapisován jako

$$f(t) = A \sin(\omega t + \Phi),$$

Konstanty A , ω a Φ se nazývají **amplituda**, **úhlová frekvence** a **fázový posun**. Sinusovka je periodická se základní periodou $T = 2\pi/\omega$.



Obrázek 17: Sinusový signál

Základní diskrétní signály

Jak diskrétní signály vznikají?

- **přirozeně** (průměrné denní teploty, denní kurzy, počty studentů)
- **vzorkováním spojitých signálů** (naměření teploty každou hodinu, měření průtoku každých 15 minut)

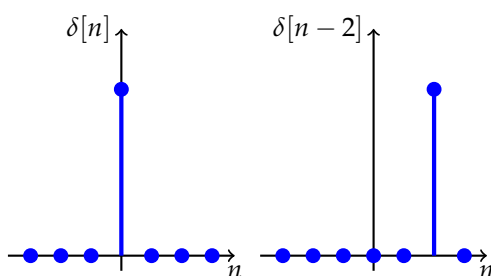
Diskrétní signály, jimiž se budeme v předmětu zabývat, jsou diskrétní v čase, ale *spojité ve funkční hodnotě*.

Digitální signál je totiž často **kvantovaný**, nabývá tedy v každém n pouze diskrétní množiny funkčních hodnot, například $\{0, 1, 2, \dots, 65535\}$.

Diskrétní jednotkový impuls a skok

Diskrétní jednotkový impuls $\delta[n]$ je definován vztahem

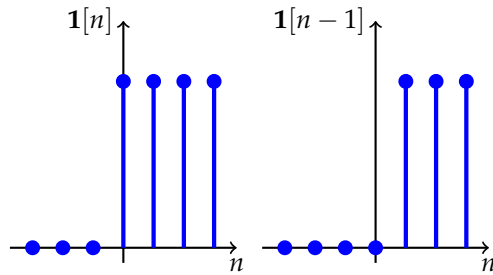
$$\delta[n] = \begin{cases} 1 & \text{pro } n = 0 \\ 0 & \text{pro } n \neq 0. \end{cases}$$



Obrázek 18: Diskrétní jednotkový impuls a posunutý jednotkový impuls.

Diskrétní jednotkový skok $\mathbf{1}[n]$ je definován vztahem

$$\mathbf{1}[n] = \begin{cases} 1 & \text{pro } n \geq 0, \\ 0 & \text{pro } n < 0. \end{cases}$$



Obrázek 19: Diskrétní jednotkový skok a posunutý jednotkový skok.

Z obrázku 19 snadno nahlédneme, že

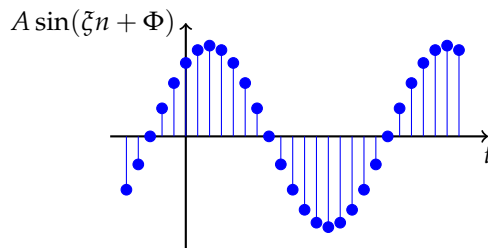
$$\mathbf{1}[n] = \sum_{m=0}^{\infty} \delta[n-m] = \delta[n] + \delta[n-1] + \dots + \delta[1] + \delta[0].$$

Diskrétní sinusová posloupnost

Mějme sinusový signál $f(t) = A \sin(\omega t + \Phi)$ s periodou $T = 2\pi/\omega$. Pokud tento signál vzorkujeme s periodou $T_s > 0$, získáme diskrétní sinusový signál

$$f[n] = f(nT) = A \sin(\omega n T_s + \Phi) = A \sin(\xi n + \Phi),$$

kde $n = 0, \pm 1, \pm 2, \dots$ a $\xi = \omega T_s$.



Obrázek 20: Diskrétní sinusová posloupnost

Diskrétní signál $f[n]$ je periodický, jestliže existuje kladné celé číslo N takové, že platí

$$f[n] = f[n+N] = f[n+2N] = \dots = f[n+k \cdot N] \quad (6)$$

pro všechna $n \in \mathbb{Z}$ (z intervalu $(-\infty, \infty)$) a pro libovolné $k \in \mathbb{Z}$. N se nazývá **perioda diskrétního signálu**.

Nejmenší možné N nazýváme **fundamentální perioda** a značíme N_0 .

Diskrétní sinusový signál *nemusí být nutně periodický*, záleží na volbě vzorkovací periody T_s . Pro periodický diskrétní sinusový signál s periodou N musí platit

$$N = m \cdot \frac{2\pi}{T_s},$$

kde $m \in \mathbb{N}$. Máme i $N \in \mathbb{N}$, proto $2\pi/T_s$ musí být racionální číslo.

Příklad 3 (Neperiodický sinusový signál): Signál

$$y[n] = \sin n$$

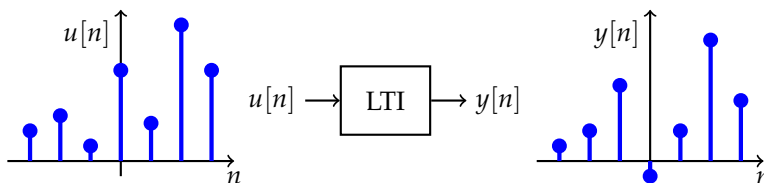
není pro $T_s = 0.1$ s periodický, protože $2\pi/T_s$ není racionální číslo.

Odezva systému

■ doplnit ■

Diskrétní systém

■ doplnit ■



Obrázek 21: Diskrétní LTI systém, jeho vstupní a výstupní posloupnost

Definice 2 (Impulsní odezva). Odezvu systému na jednotkový impuls $\delta[n]$ budeme nazývat **impulsní odezva** a značit $h[n]$,

$$\begin{aligned} h[n] &= \mathcal{S}\{\delta[n]\} \\ h[n, m] &= \mathcal{S}\{\delta[n - m]\}. \end{aligned} \quad (7)$$

Definice 3 (Přechodová odezva). Odezvu systému na jednotkový skok $\mathbf{1}[n]$ budeme nazývat **přechodová odezva** a značit $s[n]$,

$$s[n] = \mathcal{S}\{\mathbf{1}[n]\} = \mathcal{S}\left\{\sum_{m=0}^n \delta[n - m]\right\}.$$

Lineární a nelineární

Řekli jsme si, že systém není nic jiného, než černá skříňka, *black box*, kterou se pokoušíme nejprve identifikovat a poté reprodukovat. Při identifikaci se nejprve ptáme, zda se jedná o lineární systém. ■ **tohle taky nedává moc smysl** ■

Definice 4 (Linearita). V matematice označujeme funkci $f(x)$ jako lineární v případě, že je

1. aditivní $f(x_1 + x_2) = f(x_1) + f(x_2)$ a
2. homogenní, $f(\alpha x) = \alpha f(x)$.

Obdobně to platí i pro lineární systémy.

Definice 5 (Lineární systém). Systém je lineární, pokud pro dva různé vstupní signály $u_1[n]$ a $u_2[n]$ platí

$$\begin{aligned} \mathcal{S}\{u_1[n] + u_2[n]\} &= \mathcal{S}\{u_1[n]\} + \mathcal{S}\{u_2[n]\}, \\ \mathcal{S}\{\alpha u[n]\} &= \alpha \mathcal{S}\{u[n]\}. \end{aligned}$$

Definice 5 nám trochu zakukleně popisuje jednu základní vlastnost všech lineárních systémů, ať už popisují svět v diskretním či

spojitém čase: Je-li vstupem systému vážený součet několika signálů, výstupem systému je opět stejně vážený součet neboli *superpozice* dílčích odezev na tyto vstupy. Jinak řečeno, odezva lineárního systému na lineární kombinaci elementárních vstupních signálů je lineární kombinace odezev na tyto vstupy.

Definice 6 (Princip superpozice). Pro dva různé vstupní signály $u_1[n]$ a $u_2[n]$ platí

$$\begin{aligned}y_1[n] &= \mathcal{S}\{u_1[n]\} \\y_2[n] &= \mathcal{S}\{u_2[n]\}\end{aligned}$$

a pro $u[n] = \alpha u_1[n] + \beta u_2[n]$ také

$$\alpha y_1[n] + \beta y_2[n] = y[n] = \mathcal{S}\{u[n]\} = \mathcal{S}\{\alpha u_1[n] + \beta u_2[n]\}$$

Obecně platí

$$u[n] = \sum_i a_i u_i[n] \quad \rightarrow \quad y[n] = \sum_i a_i y_i[n] = \sum_i a_i \mathcal{S}\{u_i[n]\}$$

Příklad 4 (Lineární systém): Uvažujme systém

$$y[n] + a y[n-1] = u[n].$$

Je-li na vstupu lineární kombinace dvou různých signálů

$$u[n] = b_1 u_1[n] + b_2 u_2[n]$$

je na výstupu

$$y[n] = b_1 (y_1[n] + a y_1[n-1]) + b_2 (y_2[n] + a y_2[n-1])$$

kde

$$\begin{aligned}y_1[n] + a y_1[n-1] &= u_1[n] \\y_2[n] + a y_2[n-1] &= u_2[n]\end{aligned}$$

Příklad 5 (Nelineární systém): Numerický výpočet druhé odmocniny lze zapsat rekurentním vztahem

$$y[n+1] = \frac{1}{2} \left(y[n] + \frac{u[n]}{y[n]} \right).$$

Odmocnina z čísla 10 je s přesností na 10 desetinných míst rovna $\sqrt{10} = 3,16227766017$. Pro $u[n] = u[0] = 10$ dostáváme postupně

n	$y[n]$	$y^2[n]$
1	3	9
2	3,165	10,017225
3	3,162278	10,00000214928
4	3,162277660	9,999999999568
\vdots	\vdots	\vdots

Pro obecný vstupní signál $u[n]$ je pak odezva lineárního systému

$$\begin{aligned} y[n] &= \mathcal{S}\{u[n]\} = \mathcal{S}\left\{\sum_{m=-\infty}^{\infty} u[m] \delta[n-m]\right\} \\ &= \sum_{m=-\infty}^{\infty} u[m] \mathcal{S}\{\delta[n-m]\} = \sum_{m=-\infty}^{\infty} u[m] h[n,m]. \end{aligned} \quad (8)$$

Vidíme, že chování systému je zcela určeno jeho odezvami na různě posunuté jednotkové pulsy $h[n, m]$.

Přechodová odezva diskrétního lineárního systému $s[n]$ je dána prostým součtem impulsních odezev pro $0 \leq m \leq n$

$$\begin{aligned} s[n] &= \mathcal{S}\{\mathbf{1}[n]\} = \mathcal{S}\left\{\sum_{m=0}^n \delta[n-m]\right\} \\ &= \sum_{m=0}^n \mathcal{S}\{\delta[n-m]\} = \sum_{m=0}^n h[n, m]. \end{aligned}$$

Lze za nějakých podmínek zjednodušit $h[n, m]$?

Časově invariantní, resp. stacionární systém

Systém se nazývá **časově invariantní**, jestliže jsou všechny události závislé pouze na časovém intervalu (rozdílu časových událostí) $n - m$ a nikoliv na každém časovém okamžiku n a m samostatně.

$$\begin{array}{ll} \text{dnes} & \dots & y[n] = \mathcal{S}[u[n]] \\ \text{včera} & \dots & y[n-1] = \mathcal{S}[u[n-1]] \\ & & \vdots \end{array}$$

Potom také rovnice (7) pro impulsní odezvu přejde z maticového tvaru na prostý vektorový zápis

$$h[n, m] \rightarrow h[n - m] = \mathcal{S}\{\delta[n - m]\}.$$

V důsledku časové invariance dostáváme z rovnice (8) **konvoluční sumu**

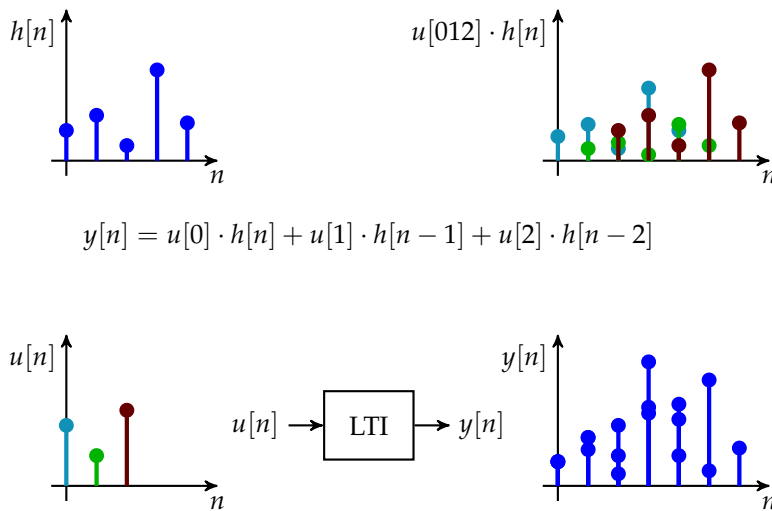
$$y[n] = \sum_{m=-\infty}^{\infty} h[n - m] \cdot u[m] = \sum_{k=-\infty}^{\infty} h[k] \cdot u[n - k], \quad (9)$$

kterou pro úsporu místa značíme

$$y[n] = h[n] * u[n].$$

Pozor: nejde o násobení!

$$h[n] \neq \frac{y[n]}{u[n]}$$



Obrázek 22: Superpozice odezvy $y[n]$ jako $\sum_{k=0}^n u[k]h[n-k]$

$$y[n] = u[0] \cdot h[n] + u[1] \cdot h[n-1] + u[2] \cdot h[n-2]$$

Příklad 6 (Časově invariantní systém): Uvažujme mikroekonomický systém variace ceny popsany diferencí rovnicí

$$y[n] + a y[n-1] = u[n].$$

Protože její koeficienty nezávisí na čase, tj. a je konstantní a není funkcí n , zachovává tato rovnice tvar při záměně $n \rightarrow n-m$. Impulsní odezva je potom

$$h[n] = (-a)^n \mathbf{1}[n].$$

Příklad 7 (Časově proměnný systém): Uvažujme nyní obměněnou diferencí rovnicí

$$y[n] + n \cdot y[n-1] = u[n].$$

Koeficient u $y[n-1]$ závisí na čase a tato rovnice nezachovává tvar při záměně $n \rightarrow n-m$. ■ ukázat, proč ■ Impulsní odezvu lze psát ve tvaru

$$h[n] = (-1)^n n! \mathbf{1}[n].$$

Kauzální, příčinný systém

Systém je **kauzální**, pokud jeho výstup závisí pouze na současných a minulých hodnotách vstupů.

Výstupní signál $y[n]$ kauzálního systému tedy závisí pouze na $\{u[n], u[n-1], u[n-2], \dots\}$. V konvoluční sumě (9) proto

$$\begin{aligned} y[n] &= \sum_{k=-\infty}^{\infty} h[k] u[n-k] \\ &= \underbrace{\sum_{k=-\infty}^{-1} h[k] u[n-k]}_0 + \sum_{k=0}^{\infty} h[k] u[n-k] \end{aligned}$$

musíme položit všechny členy impulsní odezvy $h[n] = 0$ pro $n < 0$.

Pro kauzální systémy tedy platí, že jejich impulsní odezva musí být nulová před okamžikem vstupního impulsu, což odpovídá našemu intuitivnímu vnímání kauzality: napřed musí existovat příčina, až po ní můžeme pozorovat důsledky.

Pro lineární kauzální systémy přitom také platí, že pokud je jejich vstup až do nějakého okamžiku roven 0, i výstup bude až do toho okamžiku nulový.

Konvoluční suma pro lineární, časově invariantní a kauzální systém má tvar

$$y[n] = \sum_{k=0}^{\infty} h[k] \cdot u[n-k] = \sum_{k=0}^{\infty} u[k] \cdot h[n-k].$$

Jestliže navíc budeme požadovat, aby vstupní a výstupní signály měly dobře definovaný počátek, tj. aby $\forall n < 0 : u[n] = 0, y[n] = 0$ (oba signály mohou mít nenulové členy pouze pro $n \geq 0$), potom platí

$$y[n] = \sum_{k=0}^n h[k] \cdot u[n-k] = \sum_{k=0}^n h[n-k] \cdot u[k].$$

Spojitéj systém

Definice 7 (Impulsní odezva). Odezvu systému na Diracův impuls $\delta(t)$ budeme nazývat **impulsní odezva** a značit $h(t)$,

$$\begin{aligned} h(t) &= \mathcal{S}\{\delta(t)\} \\ h(t, \tau) &= \mathcal{S}\{\delta(t - \tau)\}. \end{aligned}$$

Definice 8 (Přechodová odezva). Odezvu systému na jednotkový skok $\mathbf{1}(t)$ budeme nazývat **přechodová odezva** a značit $s(t)$,

$$s(t) = \mathcal{S}\{\mathbf{1}(t)\} = \mathcal{S}\left\{\int_0^t \delta(t - \tau) dt\right\}.$$

V případě spojitého času postupujeme podobně a odvodíme pro lineární časově invariantní systém konvoluční integrál

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

Operaci často zapisujeme ve zjednodušené formě jako

$$y(t) = h(t) * u(t).$$

Opět připomínáme, že se v tomto zápisu nejedná o násobení!

Pro $u(t) = \delta(t)$ platí pro lineární a časově invariantní systém samozřejmě

$$y(t) = \mathcal{S}\{u(t)\} = \int_{-\infty}^{\infty} h(\tau) \cdot \delta(t - \tau) d\tau = h(t). \quad (10)$$

Obrázek 23: Animovaný obrázek výpočtu konvoluce dvou signálů. Funguje pouze v prostředí Adobe Reader, jinde uvidíte prázdno

Výstupní signál $y(t)$ spojitého kauzálního systému závisí pouze na hodnotách vstupů pro předešlé časové okamžiky. Z důvodu, které klademe na kauzální chování systému, přejde konvoluční integrál (10) na tvar

$$\begin{aligned} y(t) &= \int_{-\infty}^{\infty} h(\tau) u(t - \tau) \, d\tau \\ &= \underbrace{\int_{-\infty}^0 h(\tau) u(t - \tau) \, d\tau}_0 + \int_0^{\infty} h(\tau) u(t - \tau) \, d\tau \end{aligned}$$

a hodnoty impulsní odezvy pro $t < 0$ uvažujeme opět $h(t) = 0$.

Konvoluční integrál pro lineární, časově invariantní a kauzální systém má tvar

$$y(t) = \int_0^{\infty} h(\tau) \cdot u(t - \tau) \, d\tau = \int_0^{\infty} u(\tau) \cdot h(t - \tau) \, d\tau.$$

Jestliže navíc budeme požadovat, aby vstupní a výstupní signály měly dobře definovaný počátek, tj. aby $\forall t < 0 : u(t) = 0, y(t) = 0$ (oba signály mohou být nenulové členy pouze pro $t \geq 0$), potom platí

$$y(t) = \int_0^t h(\tau) \cdot u(t - \tau) \, d\tau = \int_0^t u(\tau) \cdot h(t - \tau) \, d\tau.$$

Autonomní a neautonomní systém

Definice 9 (Autonomní systém). Za autonomní systém považujeme takový, který **nemá vstup**. Diskrétní autonomní systém je popisuje tedy například diferenční rovnice vnějšího popisu

$$y[n + 1] + a y[n] = 0.$$

Výstup autonomního systému je odezvou na počáteční podmínky.

V případě, že systém má vstup $u[n]$, tedy

$$y[n] + a y[n - 1] = u[n],$$

systém pokládáme za neautonomní.

Reference

OPPENHEIM, Alan V., Alan S. WILLSKY a Syed Hamid NAWAB.
Signals and Systems. 2. vyd. Upper Saddle River: Prentice Hall,
1997, 957 s. ISBN 01-381-4757-4.