

## ДОСТАТОЧНЫЕ УСЛОВИЯ ГАРАНТИРОВАННОГО РЕЗУЛЬТАТА В ДИФФЕРЕНЦИАЛЬНОЙ ИГРЕ С ТЕРМИНАЛЬНОЙ ФУНКЦИЕЙ ПЛАТЫ

### Введение

В настоящей работе, следуя методике [1], введены понятия верхней и нижней разрешающих функций двух типов и получены достаточные условия гарантированного результата в дифференциальной игре с терминальной функцией платы в случае, когда условие Понтрягина не имеет места. Предложены две схемы метода разрешающих функций, построены соответствующие стратегии управления и дано сравнение гарантированных времен.

Работа является развитием идей [2–7], примыкает к исследованиям [8–21] и указывает новые возможности приложения выпуклого анализа к теории конфликтно-управляемых процессов.

### Общая схема метода, разрешающие функции первого типа

Рассмотрим конфликтно-управляемый процесс, эволюция которого описывается равенством

$$z(t) = g(t) + \int_0^t \Omega(t, \tau) \varphi(u(\tau), v(\tau)) d\tau, \quad t \geq 0. \quad (1)$$

Здесь  $z(t) \in R^n$ , функция  $g(t)$ ,  $g: R_+ \rightarrow R^n$ , измерима по Лебегу [22] и ограничена при  $t > 0$ , матричная функция  $\Omega(t, \tau)$ ,  $t \geq \tau \geq 0$ , измерима по  $t$ , а также суммируема по  $\tau$  для каждого  $t \in R_+$ . Блок управления задается функцией  $\varphi(u, v)$ ,  $\varphi: U \times V \rightarrow R^n$ , которая считается непрерывной по совокупности переменных на прямом произведении непустых компактов  $U$  и  $V$ ,  $m, l, n$  — натуральные числа.

Управления игроков  $u(\tau)$ ,  $u: R_+ \rightarrow U$ , и  $v(\tau)$ ,  $v: R_+ \rightarrow V$  — измеримые функции времени. Кроме процесса (1) задана собственная выпуклая замкнутая ограниченная снизу по  $z$  функция  $\sigma(z)$ ,  $\sigma: R^n \rightarrow R^1$ , значения которой на траекториях процесса (1) определяют момент окончания игры. Если  $z(t)$ ,  $t \geq 0$ , — траектория системы (1), то игру будем считать законченной в момент  $t_1 > 0$ , если

$$\sigma(z(t_1)) \leq 0. \quad (2)$$

Цели первого ( $u$ ) и второго ( $v$ ) игроков противоположны. Первый (будем называть его преследователем) пытается добиться выполнения неравенства (2) на соответствующей траектории процесса (1) за кратчайшее время, а другой — максимально оттянуть момент выполнения этого неравенства или вообще избежать его выполнения.

Примем сторону первого игрока и будем ориентироваться на выбор противником в качестве управления произвольной измеримой функции, которая принимает значения из  $V$ . В свою очередь, будем считать, что если игра (1), (2) продолжается на интервале  $[0, T]$ , то управление первого игрока в момент  $t$  будем выбирать на основе информации о  $g(T)$  и  $v_t(\cdot)$ , т.е. в виде измеримой функции

© И.С. РАППОПОРТ, 2018

$$u(t) = u(g(T), v_t(\cdot)), \quad t \in [0, T], \quad u(t) \in U, \quad (3)$$

где  $v_t(\cdot) = \{v(s) : s \in [0, t]\}$  — предыстория управления второго игрока к моменту  $t$ , или в виде контруправления

$$u(t) = u(g(T), v(\cdot)), \quad t \in [0, T], \quad u(t) \in U. \quad (4)$$

Если, в частности,  $g(t) = e^{At} z_0$ ,  $\Omega(t, \tau) = e^{A(t-\tau)}$ ,  $z(0) = z_0$ , а  $e^{At}$  — матричная экспонента, то говорят, что управление  $u(t) = u(z_0, v_t(\cdot))$  реализует квазистратегию [11], а контруправление [8]  $u(t) = u(z_0, v(\cdot))$  является проявлением стробоскопической стратегии Хайека [12].

Согласно определению сопряженной функции и с учетом теоремы Фенхеля–Моро [23] имеем

$$\sigma(z) = \sup_{p \in R^n} [(p, z) - \sigma^*(p)],$$

где

$$\sigma^*(z) = \sup_{z \in R^n} [(p, z) - \sigma(z)]. \quad (5)$$

Функция  $\sigma^*(p)$  собственная замкнутая и выпуклая [1]. Эффективное множество функции  $\sigma^*(p)$  имеет вид  $\text{dom } \sigma^* = \{p \in R^n : \sigma^*(p) < +\infty\}$ . В силу ограниченности снизу собственной функции  $\sigma(z)$  и соотношения (5) получим  $\sigma^*(0) = -\inf_{z \in R^n} \sigma(z)$ , а значит,  $0 \in \text{dom } \sigma^*$ .

Будем считать, что  $L$  — линейная оболочка множества  $\text{dom } \sigma^*$  (пересечение всех линейных подпространств, которые содержат множество  $\text{dom } \sigma^*$ ). Тогда она является линейным подпространством. Обозначим  $\pi$  оператор ортогонального проектирования из  $R^n$  на  $L$ . Справедливо соотношение  $\sigma(z) = \sigma(\pi z)$ ,  $z \in R^n$ .

Пусть  $\gamma(t, \tau)$ ,  $\gamma : \Delta \rightarrow L$ ,  $\Delta = \{(t, \tau) : 0 \leq \tau \leq t < \infty\}$ , — некоторая почти везде ограниченная измеримая по  $t$  и суммируемая по  $\tau$ ,  $\tau \in [0, T]$ , для каждого  $t > 0$  функция, которую, следуя [1], будем называть функцией сдвига.

*Условие 1.* Для некоторой функции сдвига  $\gamma(t, \tau)$ ,  $\gamma : \Delta \rightarrow L$ , на множестве  $\Delta \times V$  имеет место неравенство  $\min_{u \in U} \max_{p \in \text{dom } \sigma^*} [(p, \pi \Omega(t, \tau) \varphi(u, v) - \gamma(t, \tau))] \leq 0$ .

Зафиксируем некоторую функцию сдвига  $\gamma(t, \tau)$  и положим

$$\xi(t) = \xi(t, g(t), \gamma(t, \cdot)) = \pi g(t) + \int_0^t \gamma(t, \tau) d\tau.$$

Рассмотрим множество  $P(g(\cdot), \gamma(\cdot, \cdot)) = \{t \geq 0 : \sigma(\xi(t), g(t), \gamma(t, \cdot)) \leq 0\}$ . Если неравенство в фигурных скобках не выполняется ни для каких  $t \geq 0$ , то положим  $P(g(\cdot), \gamma(\cdot, \cdot)) = \emptyset$ .

**Теорема 1.** Пусть для конфликтно-управляемого процесса (1), (2) с терминальным функционалом  $\sigma(z)$ , который является собственной выпуклой замкнутой ограниченной снизу по  $z$  функцией, выполнено условие 1 и для соответствующей функции сдвига  $\gamma(\cdot, \cdot)$  множество  $P(g(\cdot), \gamma(\cdot, \cdot))$  не пусто и  $P \in P(g(\cdot), \gamma(\cdot, \cdot))$ . Тогда игра может быть закончена в момент  $P$  с использованием управления вида (4).

*Доказательство.* Пусть  $v(\tau)$  — произвольный измеримый селектор компакта  $V$ ,  $\tau \in [0, P]$ . Укажем способ выбора управления преследователем.

Рассмотрим многозначное отображение для  $\tau \in [0, P]$ ,  $v \in V$ :

$$U_0(\tau, v) = \{u \in U : \sup_{p \in \text{dom}\sigma^*} [(p, \pi\Omega(P, \tau)\varphi(u, v) - \gamma(P, \tau))] \leq 0\}.$$

В силу свойств параметров процесса (1) и функции  $\sigma(z)$  отображение  $U_0(\tau, v)$   $L \otimes B$ -измеримо [5] при  $v \in V$ ,  $\tau \in [0, P]$ . Поэтому по теореме об измеримом выборе селектора [22] многозначное отображение  $U_0(\tau, v)$  содержит  $L \otimes B$ -измеримый селектор  $u_0(\tau, v)$ , который является суперпозиционно измеримой функцией [5].

Положим управление первого игрока  $u_0(\tau) = u_0(\tau, v(\tau))$ ,  $\tau \in [0, P]$ . Принимая во внимание равенство  $\sigma(z(P)) = \sigma(\pi z(P))$ , формулу (1) и определение сопряженной функции, получим

$$\begin{aligned} \sigma(z(P)) = \max_{p \in \text{dom}\sigma^*} [(p, \xi(P, g(P), \gamma(P, \cdot))) + \\ + \int_0^P (p, \pi\Omega(P, \tau)\varphi(u_0(\tau), v(\tau)) - \gamma(P, \tau)) d\tau - \sigma^*(p)]. \end{aligned} \quad (6)$$

Тогда с учетом закона выбора управления первым игроком соотношение (6) дает  $\sigma(z(P)) \leq \sigma(\xi(P, g(P), \gamma(P, \cdot))) \leq 0$ , откуда следует неравенство (2) в момент  $P$ .

*Замечание 1.* Положив  $\varphi(U, v) = \{\varphi(u, v) : u \in U\}$ , рассмотрим многозначные отображения

$$W(t, \tau, v) = \pi\Omega(t, \tau)\varphi(U, v), \quad W(t, \tau) = \bigcap_{v \in V} W(t, \tau, v), \quad \tau \in [0, t], \quad v \in V,$$

на множествах  $\Delta \times V$  и  $\Delta$  соответственно. Будем предполагать, что многозначное отображение  $W(t, \tau, v)$  имеет замкнутые значения на множестве  $\Delta \times V$ .

*Условие Понтрягина.* Многозначное отображение  $W(t, \tau)$  принимает непустые значения на множестве  $\Delta$ .

Из условия Понтрягина следует, что существует измеримый селектор  $\gamma(t, \tau)$ ,  $\gamma(t, \tau) \in W(t, \tau)$ , для которого выполняется условие 1 и справедлива теорема 1.

Рассмотрим многозначное отображение

$$\begin{aligned} \mathfrak{A}(t, \tau, v) = \{\alpha \geq 0 : \inf_{u \in U} \sup_{p \in \text{dom}\sigma^*} [(p, \pi\Omega(t, \tau)\varphi(u, v) - \gamma(t, \tau)) + \\ + \alpha[(p, \xi(t, g(t), \gamma(t, \cdot))) - \sigma^*(p)]] \leq 0\}. \end{aligned} \quad (7)$$

*Условие 2.* Многозначное отображение  $\mathfrak{A}(t, \tau, v)$  принимает непустые значения на множестве  $\Delta \times V$ .

Если это условие выполнено, то, следуя работе [1], введем верхнюю и нижнюю разрешающие функции первого типа:

$$\alpha^*(t, \tau, v) = \sup\{\alpha : \alpha \in \mathfrak{A}(t, \tau, v)\}, \quad \alpha_*(t, \tau, v) = \inf\{\alpha : \alpha \in \mathfrak{A}(t, \tau, v)\}, \quad \tau \in [0, t], \quad v \in V.$$

Можно показать [5], что многозначное отображение  $\mathfrak{A}(t, \tau, v)$  является замкнутозначным,  $L \otimes B$ -измеримым по совокупности  $(\tau, v)$ ,  $\tau \in [0, t]$ ,  $v \in V$ , а

верхняя и нижняя разрешающие функции  $L \otimes B$ -измеримы по совокупности  $(\tau, v)$ ,  $\tau \in [0, t]$ ,  $v \in V$ . Отметим также, что верхняя разрешающая функция полунепрерывна сверху, а нижняя — полунепрерывна снизу по переменной  $v$ . Поэтому [7] функции  $\inf_{v \in V} \alpha^*(t, \tau, v)$  и  $\sup_{v \in V} \alpha_*(t, \tau, v)$  измеримы по  $\tau$ ,  $\tau \in [0, t]$ . Пусть  $V(\cdot)$  — совокупность измеримых функций  $v(\tau)$ ,  $\tau \in [0, +\infty]$ , со значениями из  $V$ . Поскольку при фиксированном  $t$  функции  $\alpha^*(t, \tau, v)$  и  $\alpha_*(t, \tau, v)$   $L \otimes B$ -измеримы по совокупности  $(\tau, v)$ ,  $\tau \in [0, t]$ ,  $v \in V$ , то они суперпозиционно измеримы [5], т.е.  $\alpha^*(t, \tau, v(\tau))$  и  $\alpha_*(t, \tau, v(\tau))$  измеримы по  $\tau$ ,  $\tau \in [0, t]$ , при любой измеримой функции  $v(\cdot) \in V(\cdot)$ .

Рассмотрим множество

$$P_*^1(g(\cdot), \gamma(\cdot, \cdot)) = \left\{ t \geq 0 : \sigma(\xi(t, g(t), \gamma(t, \cdot))) \leq 0, \int_0^t \sup_{v \in V} \alpha_*(t, \tau, v) d\tau < 1 \right\}.$$

Если неравенство в фигурных скобках не выполняется ни для каких  $t \geq 0$ , то положим  $P_*^1(g(\cdot), \gamma(\cdot, \cdot)) = \emptyset$ .

**Теорема 2.** Пусть для конфликтно-управляемого процесса (1), (2) с терминальным функционалом  $\sigma(z)$ , который является собственной выпуклой замкнутой ограниченной снизу по  $z$  функцией, выполнено условие 2 и для соответствующей функции сдвига  $\gamma(t, \tau)$  множество  $P_*^1(g(\cdot), \gamma(\cdot, \cdot))$  не пусто и  $P_*^1 \in P_*^1(g(\cdot), \gamma(\cdot, \cdot))$ . Тогда игра может быть закончена в момент  $P_*^1$  с использованием управления вида (4).

*Доказательство.* Пусть  $v(\tau)$  — произвольный измеримый селектор компакта  $V$ ,  $\tau \in [0, P_*^1]$ . Укажем способ выбора управления преследователем.

Рассмотрим компактнозначное многозначное отображение

$$U_*^1(\tau, v) = \{ u \in U : \sup_{p \in \text{dom} \sigma^*} [(p, \pi \Omega(P_*^1, \tau) \varphi(u, v) - \gamma(P_*^1, \tau)) + \alpha_*(P_*^1, \tau, v)[(p, \xi(P_*^1, g(P_*^1, \cdot))) - \sigma^*(p)]] \leq 0 \}.$$

В силу свойств параметров процесса (1), функции  $\sigma(z)$  и нижней разрешающей функции  $\alpha_*(P_*^1, \tau, v)$  компактнозначное отображение  $U_*^1(\tau, v)$   $L \otimes B$ -измеримо [5] при  $v \in V$ ,  $\tau \in [0, P_*^1]$ . Поэтому по теореме об измеримом выборе селектора [22] многозначное отображение  $U_*^1(\tau, v)$  содержит  $L \otimes B$ -измеримый селектор  $u_*^1(\tau, v)$ , который является суперпозиционно измеримой функцией [5].

Положим управление первого игрока  $u_*^1(\tau) = u_*^1(\tau, v(\tau))$ ,  $\tau \in [0, P_*^1]$ . Прибавив и вычтя в квадратных скобках выражения (6) величину  $[(p, \xi(P_*^1)) - \sigma^*(p)] \times \int_0^{P_*^1} \alpha_*(P_*^1, \tau, v(\tau)) d\tau$ , получим

$$\sigma(z(P_*^1)) = \max_{p \in \text{dom} \sigma^*} \left\{ [(p, \xi(P_*^1)) - \sigma^*(p)] \left( 1 - \int_0^{P_*^1} \alpha_*(P_*^1, \tau, v(\tau)) d\tau \right) + \int_0^{P_*^1} [(p, \pi \Omega(P_*^1, \tau) \varphi(u_*^1(\tau), v(\tau)) - \gamma(P_*^1, \tau)) + \alpha_*(P_*^1, \tau, v(\tau))[(p, \xi(P_*^1)) - \sigma^*(p)]] d\tau \right\}.$$

Отсюда следует, что преследователь может гарантировать в момент  $P_*^1$  выполнение неравенства

$$\sigma(z(P_*^1)) \leq \sigma(\xi(P_*^1, g(P_*^1), \gamma(P_*^1, \cdot))) \left( 1 - \int_0^{P_*^1} \alpha_*(P_*^1, \tau, v(\tau)) d\tau \right) \leq 0,$$

поскольку по определению  $P_*^1$  имеем  $\sigma(\xi(P_*^1, g(P_*^1), \gamma(P_*^1, \cdot))) \leq 0$ , а

$$1 - \int_0^{P_*^1} \alpha_*(P_*^1, \tau, v(\tau)) d\tau \geq 1 - \int_0^{P_*^1} \sup_{v \in V} \alpha_*(P_*^1, \tau, v) d\tau > 0,$$

что и завершает доказательство теоремы.

*Замечание 2.* Если для некоторой функции сдвига  $\gamma(t, \tau)$ ,  $\gamma: \Delta \rightarrow L$ , на множестве  $\Delta \times V$  выполнено условие 1, то  $0 \in \mathfrak{A}(t, \tau, v)$ ,  $\tau \in [0, P_*^1]$ ,  $v \in V$ . Поэтому справедливо условие 2 и  $\alpha_*(t, \tau, v) = \inf \{ \alpha : \alpha \in \mathfrak{A}(t, \tau, v) \} = 0$  на множестве  $\Delta \times V$ .

Рассмотрим множество

$$T(g(t), \gamma(\cdot, \cdot)) = \left\{ t \geq 0 : \int_0^t \inf_{v \in V} \alpha^*(t, \tau, v) d\tau \geq 1, \int_0^t \sup_{v \in V} \alpha_*(t, \tau, v) d\tau < 1 \right\}. \quad (8)$$

Если при некотором  $t > 0$   $\alpha^*(t, \tau, v) \equiv +\infty$  для  $\tau \in [0, t]$ ,  $v \in V$ , то в этом случае значение соответствующего интеграла в фигурных скобках соотношения (8) естественно положить равным  $+\infty$  и  $t \in T(g(t), \gamma(\cdot, \cdot))$ , если для этого  $t$  справедливо другое неравенство в фигурных скобках соотношения (8). В случае, когда неравенства в соотношении (8) не выполняются при всех  $t > 0$ , положим  $T(g(t), \gamma(\cdot, \cdot)) = \emptyset$ .

**Теорема 3.** Пусть для конфликтно-управляемого процесса (1), (2) с терминальным функционалом  $\sigma(z)$ , который является собственной выпуклой замкнутой ограниченной снизу по  $z$  функцией, выполнено условие 2 и для соответствующей функции сдвига  $\gamma(\cdot, \cdot)$  множество  $T(g(\cdot), \gamma(\cdot, \cdot))$  не пусто, а  $T \in T(g(\cdot), \gamma(\cdot, \cdot))$ . Тогда игра может быть закончена в момент  $T$  с использованием управления вида (3).

*Доказательство.* Пусть  $v(\tau)$  — произвольный измеримый селектор компакта  $V$ ,  $\tau \in [0, T]$ .

Рассмотрим сначала случай  $\sigma(\xi(T, g(T), \gamma(T, \cdot))) > 0$  и введем контрольную функцию

$$h(t) = 1 - \int_0^t \alpha^*(T, \tau, v(\tau)) d\tau - \int_t^T \alpha_*(T, \tau, v(\tau)) d\tau, \quad t \in [0, T].$$

Функции  $\alpha^*(T, \tau, v)$  и  $\alpha_*(T, \tau, v)$   $L \otimes B$ -измеримы по совокупности  $(\tau, v)$ ,  $\tau \in [0, T]$ ,  $v \in V$ , и поэтому они суперпозиционно измеримы, т.е. функции  $\alpha^*(T, \tau, v(\tau))$  и  $\alpha_*(T, \tau, v(\tau))$  измеримы по  $\tau$ ,  $\tau \in [0, T]$ . По определению  $T$  имеем

$$h(0) = 1 - \int_0^T \alpha_*(T, \tau, v(\tau)) d\tau \geq 1 - \int_0^T \sup_{v \in V} \alpha_*(T, \tau, v) d\tau > 0,$$

$$h(T) = 1 - \int_0^T \alpha^*(T, \tau, v(\tau)) d\tau \leq 1 - \int_0^T \inf_{v \in V} \alpha^*(t, \tau, v) d\tau \leq 0.$$

Поэтому в силу непрерывности функции  $h(t)$  существует такой момент времени  $t_*$ ,  $t_* \in (0, T]$ , что  $h(t_*) = 0$ . Отметим, что момент переключения  $t_*$  зависит от предыстории управления второго игрока  $v_{t_*}(\cdot) = \{v(s) : s \in [0, t_*]\}$ .

Рассмотрим компактнозначное многозначное отображение

$$U^1(\tau, v) = \left\{ u \in U : \sup_{p \in \text{dom} \sigma^*} [(p, \pi \Omega(T, \tau) \varphi(u, v) - \gamma(T, \tau)) + \alpha(T, \tau, v)[(p, \xi(T, g(T), \gamma(T, \cdot))) - \sigma^*(p)]] \leq 0 \right\}, \quad (9)$$

где

$$\alpha(T, \tau, v) = \begin{cases} \alpha^*(T, \tau, v), & 0 \leq \tau \leq t_*, \\ \alpha_*(T, \tau, v), & t_* < \tau \leq T. \end{cases}$$

В силу свойств параметров процесса (1), функции  $\sigma(z)$  и верхней  $\alpha^*(T, \tau, v)$  и нижней  $\alpha_*(T, \tau, v)$  разрешающих функций компактнозначное отображение  $U^1(\tau, v)$   $L \otimes B$ -измеримо [5] при  $v \in V$ ,  $\tau \in [0, T]$ . Поэтому по теореме об измеримом выборе селектора [22] многозначное отображение  $U^1(\tau, v)$  содержит  $L \otimes B$ -измеримый селектор  $u^1(\tau, v)$ , который является суперпозиционно измеримой функцией [5].

Положим управление первого игрока  $u^1(\tau) = u^1(\tau, v(\tau))$ ,  $\tau \in [0, T]$ .

Принимая во внимание равенство  $\sigma(z(T)) = \sigma(\pi z(T))$ , формулу (1) и определение сопряженной функции, получим

$$\sigma(z(T)) = \max_{p \in \text{dom} \sigma^*} \left[ (p, \xi(T, g(T), \gamma(T, \cdot))) + \int_0^T (p, \pi \Omega(T, \tau) \varphi(u^1(\tau), v(\tau)) - \gamma(T, \tau)) d\tau - \sigma^*(p) \right]. \quad (10)$$

Прибавим и вычтем в квадратных скобках выражения (10) величину

$$[(p, \xi(T)) - \sigma^*(p)] \left[ \int_0^{t_*} \alpha^*(T, \tau, v(\tau)) d\tau + \int_{t_*}^T \alpha_*(T, \tau, v(\tau)) d\tau \right].$$

Тогда получим

$$\sigma(z(T)) = \max_{p \in \text{dom} \sigma^*} \left\{ [(p, \xi(T)) - \sigma^*(p)] h(t_*) + \int_0^{t_*} [(p, \pi \Omega(T, \tau) \varphi(u^1(\tau), v(\tau)) - \gamma(T, \tau)) + \alpha^*(T, \tau, v(\tau))[(p, \xi(T)) - \sigma^*(p)]] d\tau + \int_{t_*}^T [(p, \pi \Omega(T, \tau) \varphi(u^1(\tau), v(\tau)) - \gamma(T, \tau)) + \alpha_*(T, \tau, v(\tau))[(p, \xi(T)) - \sigma^*(p)]] d\tau \right\}.$$

С учетом соотношения (9) отсюда следует, что преследователь может гарантировать в момент  $T$  выполнение неравенства

$$\sigma(z(T)) \leq \sigma(\xi(T, g(T), \gamma(T, \cdot))) h(t_*) = 0.$$

Для случая  $\sigma(\xi(T, g(T), \gamma(T, \cdot))) \leq 0$  управление первого игрока на всем промежутке  $[0, T]$  выберем в виде измеримой функции  $u_*^1(\tau) = u_*^1(\tau, v(\tau))$ ,  $\tau \in [0, T]$ , где  $u_*^1(\tau, v)$  —  $L \otimes B$ -измеримый селектор отображения  $U^1(\tau, v)$  соотношения (9) с разрешающей функцией  $\alpha(T, \tau, v) = \alpha_*(T, \tau, v)$  на всем промежутке  $[0, T]$ .

Прибавив и вычтя в квадратных скобках выражения (10) величину  $[(p, \xi(T)) - \sigma^*(p)] \int_0^T \alpha_*(T, \tau, v(\tau)) d\tau$ , получим

$$\sigma(z(T)) = \max_{p \in \text{dom} \sigma^*} \left\{ [(p, \xi(T)) - \sigma^*(p)] \left( 1 - \int_0^T \alpha_*(T, \tau, v(\tau)) d\tau \right) + \int_0^T [(p, \pi\Omega(T, \tau) \varphi(u_*^1(\tau), v(\tau)) - \gamma(T, \tau)) + \alpha_*(T, \tau, v(\tau)) [(p, \xi(T)) - \sigma^*(p)]] d\tau \right\}.$$

Отсюда следует, что преследователь может гарантировать в момент  $T$  выполнение неравенства

$$\sigma(z(T)) \leq \sigma(\xi(T, g(T), \gamma(T, \cdot))) \left( 1 - \int_0^T \alpha_*(T, \tau, v(\tau)) d\tau \right) \leq 0,$$

поскольку по предположению  $\sigma(\xi(T, g(T), \gamma(T, \cdot))) \leq 0$ , а

$$1 - \int_0^T \alpha_*(T, \tau, v(\tau)) d\tau \geq 1 - \int_0^T \sup_{v \in V} \alpha_*(T, \tau, v) d\tau > 0,$$

что и завершает доказательство теоремы.

### Модификация метода, разрешающие функции второго типа

Рассмотрим многозначное отображение

$$\mathfrak{A}(t, \tau) = \bigcap_{v \in V} \mathfrak{A}(t, \tau, v), \quad (t, \tau) \in \Delta.$$

*Условие 3.* Многозначное отображение  $\mathfrak{A}(t, \tau)$  принимает непустые значения на множестве  $\Delta$ .

Если это условие выполнено, то, следуя работе [1], введем верхнюю и нижнюю разрешающие функции второго типа:

$$\alpha^*(t, \tau) = \sup \{ \alpha : \alpha \in \mathfrak{A}(t, \tau) \}, \quad \alpha_*(t, \tau) = \inf \{ \alpha : \alpha \in \mathfrak{A}(t, \tau) \}, \quad \tau \in [0, T], \quad v \in V.$$

Можно показать [5], что многозначное отображение  $\mathfrak{A}(t, \tau)$  замкнутозначное, измеримо по  $\tau$ , а верхняя и нижняя разрешающие функции измеримы по переменной  $\tau$  при фиксированном  $t$ .

Рассмотрим множество

$$P_*^2(g(\cdot), \gamma(\cdot, \cdot)) = \left\{ t \geq 0 : \sigma(\xi(t, g(t), \gamma(t, \cdot))) \leq 0, \int_0^t \alpha_*(t, \tau) d\tau < 1 \right\}.$$

Если неравенства в фигурных скобках не выполняются ни для каких  $t \geq 0$ , то положим  $P_*^2(g(\cdot), \gamma(\cdot, \cdot)) = \emptyset$ .

**Теорема 4.** Пусть для конфликтно-управляемого процесса (1), (2) с терминальным функционалом  $\sigma(z)$ , который является собственной выпуклой замкнутой ограниченной снизу по  $z$  функцией, выполнено условие 3 и для соответствующей функции сдвига  $\gamma(t, \tau)$  множество  $P_*^2(g(\cdot), \gamma(\cdot, \cdot))$  не пусто и  $P_*^2 \in P_*^2(g(\cdot), \gamma(\cdot, \cdot))$ . Тогда игра может быть закончена в момент  $P_*^2$  с использованием управления вида (4).

*Доказательство.* Пусть  $\nu(\tau)$  — произвольный измеримый селектор компакта  $V$ ,  $\tau \in [0, P_*^2]$ . Укажем способ выбора управления преследователем.

Рассмотрим компактнозначное многозначное отображение

$$U_*^2(\tau, \nu) = \left\{ u \in U : \sup_{p \in \text{dom} \sigma^*} [(p, \pi \Omega(P_*^2, \tau)) \varphi(u, \nu) - \gamma(P_*^2, \tau)] + \alpha_*(P_*^2, \tau)[(p, \xi(P_*^2, g(P_*^2, \cdot))) - \sigma^*(p)] \leq 0 \right\}.$$

В силу свойств параметров процесса (1), функции  $\sigma(z)$  и нижней разрешающей функции  $\alpha_*(P_*^2, \tau)$  компактнозначное отображение  $U_*^2(\tau, \nu) \in L \otimes B$ -измеримо [5] при  $\nu \in V$ ,  $\tau \in [0, P_*^2]$ . Поэтому по теореме об измеримом выборе селектора [22] многозначное отображение  $U_*^2(\tau, \nu)$  содержит  $L \otimes B$ -измеримый селектор  $u_*^2(\tau, \nu)$ , который является суперпозиционно измеримой функцией [5].

Положим управление первого игрока  $u_*^2(\tau) = u_*^2(\tau, \nu(\tau))$ ,  $\tau \in [0, P_*^2]$ . Прибавив и вычтя в квадратных скобках выражения (6) величину  $[(p, \xi(P_*^2)) - \sigma^*(p)] \int_0^{P_*^2} \alpha_*(P_*^2, \tau) d\tau$ , получим

$$\sigma(z(P_*^2)) = \max_{p \in \text{dom} \sigma^*} \left\{ [(p, \xi(P_*^2)) - \sigma^*(p)] \left( 1 - \int_0^{P_*^2} \alpha_*(P_*^2, \tau) d\tau \right) + \int_0^{P_*^2} [(p, \pi \Omega(P_*^2, \tau)) \varphi(u_*^2(\tau), \nu(\tau)) - \gamma(P_*^2, \tau)] + \alpha_*(P_*^2, \tau)[(p, \xi(P_*^2)) - \sigma^*(p)] d\tau \right\}.$$

Отсюда следует, что преследователь может гарантировать в момент  $P_*^2$  выполнение неравенства

$$\sigma(z(P_*^2)) \leq \sigma(\xi(P_*^2, g(P_*^2), \gamma(P_*^2, \cdot))) \left( 1 - \int_0^{P_*^2} \alpha_*(P_*^2, \tau) d\tau \right) \leq 0,$$

поскольку по определению момента  $P_*^2$  имеем  $\sigma(\xi(P_*^2, g(P_*^2), \gamma(P_*^2, \cdot))) \leq 0$ , а  $1 - \int_0^{P_*^2} \alpha_*(P_*^2, \tau) d\tau > 0$ , что и завершает доказательство теоремы.

*Замечание 3.* Если для некоторой функции сдвига  $\gamma(t, \tau)$ ,  $\gamma: \Delta \rightarrow L$ , на множестве  $\Delta \times V$  выполнено условие 1, то  $0 \in \mathfrak{Q}(t, \tau)$ ,  $\tau \in [0, t]$ . Поэтому спра-



ведливы условия 2 и 3, причем в силу леммы имеем  $0 \leq \sup_{v \in V} \alpha_*(t, \tau, v) \leq \alpha_*(t, \tau) = 0$ ,  $\tau \in [0, t]$ . С учетом замечаний 1 и 2 можно заключить,

что если выполнено условие Понтрягина, то справедливо равенство

$$\sup_{v \in V} \alpha_*(t, \tau, v) = \alpha_*(t, \tau) = 0, \quad \tau \in [0, t].$$

Рассмотрим множество

$$\Theta(g(t), \gamma(\cdot, \cdot)) = \left\{ t \geq 0 : \int_0^t \alpha^*(t, \tau) d\tau \geq 1, \int_0^t \alpha_*(t, \tau) d\tau < 1 \right\}. \quad (11)$$

Если при некотором  $t > 0$   $\alpha^*(t, \tau) \equiv +\infty$  для  $\tau \in [0, t]$ ,  $v \in V$ , то в этом случае значение соответствующего интеграла в фигурных скобках соотношения (11) естественно положить равным  $+\infty$  и  $t \in T(g(t), \gamma(\cdot, \cdot))$ , если для этого  $t$  справедливо другое неравенство в фигурных скобках соотношения (11). В случае, когда неравенства в соотношении (11) не выполняются при всех  $t > 0$ , положим  $\Theta(g(t), \gamma(\cdot, \cdot)) = \emptyset$ .

**Теорема 5.** Пусть для конфликтно-управляемого процесса (1), (2) с терминальным функционалом  $\sigma(z)$ , который является собственной выпуклой замкнутой ограниченной снизу по  $z$  функцией, выполнено условие 3 и для соответствующей функции сдвига  $\gamma(\cdot, \cdot)$  множество  $\Theta(g(\cdot), \gamma(\cdot, \cdot))$  не пусто, а  $\Theta \in \Theta(g(\cdot), \gamma(\cdot, \cdot))$ . Тогда игра может быть закончена в момент  $\Theta$  с использованием управления вида (4).

*Доказательство.* Пусть  $v(\tau)$  — произвольный измеримый селектор компакта  $V$ ,  $\tau \in [0, \Theta]$ .

Рассмотрим сначала случай  $\sigma(\xi(\Theta, g(\Theta), \gamma(\Theta, \cdot))) > 0$  и введем контрольную функцию

$$h(t) = 1 - \int_0^t \alpha^*(\Theta, \tau) d\tau - \int_t^\Theta \alpha_*(\Theta, \tau) d\tau, \quad t \in [0, \Theta].$$

Функции  $\alpha^*(\Theta, \tau)$  и  $\alpha_*(\Theta, \tau)$ ,  $\tau \in [0, \Theta]$ , измеримы по  $\tau$ ,  $\tau \in [0, \Theta]$ . По определению момента  $\Theta$  имеем

$$h(0) = 1 - \int_0^\Theta \alpha_*(\Theta, \tau) d\tau > 0, \quad h(\Theta) = 1 - \int_0^\Theta \alpha^*(\Theta, \tau) d\tau \leq 0.$$

Поэтому в силу непрерывности функции  $h(t)$  существует такой момент времени  $t_*$ ,  $t_* \in (0, \Theta]$ , что  $h(t_*) = 0$ . Отметим, что момент переключения  $t_*$  не зависит от предыстории управления второго игрока  $v_{t_*}(\cdot) = \{v(s) : s \in [0, t_*]\}$ .

Рассмотрим компактнозначное многозначное отображение

$$U^2(\tau, v) = \left\{ u \in U : \sup_{p \in \text{dom} \sigma^*} [(p, \pi \Omega(\Theta, \tau) \varphi(u, v) - \gamma(\Theta, \tau)) + \alpha(\Theta, \tau)[(p, \xi(\Theta, g(\Theta), \gamma(\Theta, \cdot))) - \sigma^*(p)] \leq 0 \right\}, \quad (12)$$

где

$$\alpha(\Theta, \tau) = \begin{cases} \alpha^*(\Theta, \tau), & 0 \leq \tau \leq t_*, \\ \alpha_*(\Theta, \tau), & t_* < \tau \leq \Theta. \end{cases}$$

В силу свойств параметров процесса (1), функции  $\sigma(z)$ , а также верхней  $\alpha^*(\Theta, \tau)$  и нижней  $\alpha_*(\Theta, \tau)$  разрешающих функций компактнозначное отображение  $U^2(\tau, v) : L \otimes B$ -измеримо [5] при  $v \in V$ ,  $\tau \in [0, \Theta]$ . Поэтому по теореме об измеримом выборе селектора [22] многозначное отображение  $U^2(\tau, v)$  содержит  $L \otimes B$ -измеримый селектор  $u^2(\tau, v)$ , который является суперпозиционно измеримой функцией [5].

Положим управление первого игрока  $u^2(\tau) = u^2(\tau, v(\tau))$ ,  $\tau \in [0, \Theta]$ .

Рассмотрим выражение (10) для момента  $\Theta$  и управления первого игрока  $u^2(\tau)$ ,  $\tau \in [0, \Theta]$ . Прибавим и вычтем в квадратных скобках выражения (10) величину

$$[(p, \xi(\Theta)) - \sigma^*(p)] \left[ \int_0^{t_*} \alpha^*(\Theta, \tau) d\tau + \int_{t_*}^{\Theta} \alpha_*(\Theta, \tau) d\tau \right].$$

Тогда получим

$$\begin{aligned} \sigma(z(\Theta)) = \max_{p \in \text{dom} \sigma^*} & \left\{ [(p, \xi(\Theta)) - \sigma^*(p)] h(t_*) + \right. \\ & + \int_0^{t_*} [(p, \pi \Omega(\Theta, \tau) \varphi(u^2(\tau), v(\tau)) - \gamma(\Theta, \tau) + \alpha^*(\Theta, \tau) [(p, \xi(\Theta)) - \sigma^*(p)])] d\tau + \\ & \left. + \int_{t_*}^{\Theta} [(p, \pi \Omega(\Theta, \tau) \varphi(u^2(\tau), v(\tau)) - \gamma(\Theta, \tau) + \alpha_*(\Theta, \tau) [(p, \xi(\Theta)) - \sigma^*(p)])] d\tau \right\}. \end{aligned}$$

С учетом соотношения (12) отсюда следует, что преследователь может гарантировать в момент  $\Theta$  выполнение неравенства

$$\sigma(z(\Theta)) \leq \sigma(\xi(\Theta, g(\Theta), \gamma(\Theta, \cdot))) h(t_*) = 0.$$

Для случая  $\sigma(\xi(\Theta, g(\Theta), \gamma(\Theta, \cdot))) \leq 0$  управление первого игрока на всем промежутке  $[0, \Theta]$  выберем в виде измеримой функции  $u_*^2(\tau) = u_*^2(\tau, v(\tau))$ ,  $\tau \in [0, \Theta]$ , где  $u_*^2(\tau, v)$  —  $L \otimes B$ -измеримый селектор отображения  $U^2(\tau, v)$  соотношения (12) с разрешающей функцией  $\alpha(\Theta, \tau) = \alpha_*(\Theta, \tau)$  на всем промежутке  $[0, \Theta]$ .

Опять рассмотрим выражение (10) для момента  $\Theta$  и управления первого игрока  $u_*^2(\tau)$ ,  $\tau \in [0, \Theta]$ . Прибавив и вычтя в квадратных скобках выражения (10) величину  $[(p, \xi(\Theta)) - \sigma^*(p)] \int_0^{\Theta} \alpha_*(\Theta, \tau) d\tau$ , получим

$$\sigma(z(\Theta)) = \max_{p \in \text{dom} \sigma^*} \left\{ [(p, \xi(\Theta)) - \sigma^*(p)] \left( 1 - \int_0^{\Theta} \alpha_*(\Theta, \tau) d\tau \right) + \right.$$

$$+ \left. \int_0^{\Theta} [(p, \pi\Omega(\Theta, \tau) \varphi(u_*^2(\tau), v(\tau)) - \gamma(\Theta, \tau)) + \alpha_*(\Theta, \tau)[(p, \xi(\Theta)) - \sigma^*(p)]] d\tau \right\}.$$

Отсюда следует, что преследователь может гарантировать в момент  $\Theta$  выполнение неравенства

$$\sigma(z(\Theta)) \leq \sigma(\xi(\Theta, g(\Theta), \gamma(\Theta, \cdot))) \left( 1 - \int_0^{\Theta} \alpha_*(\Theta, \tau) d\tau \right) \leq 0,$$

поскольку по предположению  $\sigma(\xi(\Theta, g(\Theta), \gamma(\Theta, \cdot))) \leq 0$ , а по определению момента  $\Theta$   $1 - \int_0^{\Theta} \alpha_*(\Theta, \tau) d\tau > 0$ , что и завершает доказательство теоремы.

### Сравнение гарантированных времен

**Лемма [1].** Пусть для конфликтно-управляемого процесса (1), (2) с терминальным функционалом  $\sigma(z)$ , который является собственной выпуклой замкнутой ограниченной снизу по  $z$  функцией, выполнено условие 3. Тогда имеет место неравенство

$$\sup_{v \in V} \alpha_*(t, \tau, v) \leq \alpha_*(t, \tau), \quad (t, \tau) \in \Delta. \quad (13)$$

Если к тому же  $\sigma(\xi(t, g(t), \gamma(t, \cdot))) > 0$ , то справедливо неравенство

$$\inf_{v \in V} \alpha^*(t, \tau, v) \geq \alpha^*(t, \tau), \quad (t, \tau) \in \Delta. \quad (14)$$

При этом, если многозначное отображение  $\mathfrak{A}(t, \tau, v)$  принимает выпуклые значения на множестве  $\Delta \times V$ , то в соотношениях (13) и (14) имеет место равенство.

**Теорема 6.** Пусть для конфликтно-управляемого процесса (1), (2) с терминальным функционалом  $\sigma(z)$ , который является собственной выпуклой замкнутой ограниченной снизу по  $z$  функцией, при некоторой функции сдвига  $\gamma(\cdot, \cdot)$  выполнено условие 3. Тогда имеют место включения

$$T(g(\cdot), \gamma(\cdot, \cdot)) \supset \Theta(g(\cdot), \gamma(\cdot, \cdot)) \supset P_*^2(g(\cdot), \gamma(\cdot, \cdot)) \supset P_*^1(g(\cdot), \gamma(\cdot, \cdot)) \supset P(g(\cdot), \gamma(\cdot, \cdot)).$$

При этом, если многозначное отображение  $\mathfrak{A}(T, \tau, v)$  принимает выпуклые значения на множестве  $\Delta \times V$ , то справедливы равенства

$$T(g(\cdot), \gamma(\cdot, \cdot)) = \Theta(g(\cdot), \gamma(\cdot, \cdot)), \quad P_*^2(g(\cdot), \gamma(\cdot, \cdot)) = P_*^1(g(\cdot), \gamma(\cdot, \cdot)).$$

Если выполнено условие 1, то имеем

$$P_*^2(g(\cdot), \gamma(\cdot, \cdot)) = P_*^1(g(\cdot), \gamma(\cdot, \cdot)) = P(g(\cdot), \gamma(\cdot, \cdot)),$$

причем, если выполнено условие Понтрягина, то в качестве  $\gamma(\cdot, \cdot)$  можно взять некоторый селектор Понтрягина [1].

Доказательство непосредственно следует из леммы и конструкций соответствующих определений и теорем.

**Теорема 7.** Пусть для конфликтно-управляемого процесса (1), (2) с терминальным функционалом  $\sigma(z)$ , который является собственной выпуклой замкнутой

той ограниченной снизу по  $z$  функцией, выполнено условие 2 и для соответствующей функции сдвига  $\gamma(\cdot, \cdot)$  множество  $T(g(\cdot), \gamma(\cdot, \cdot))$  не пусто,  $T \in T(g(\cdot), \gamma(\cdot, \cdot))$  и многозначное отображение  $\mathfrak{A}(T, \tau, \nu)$  принимает выпуклые значения для всех  $(\tau, \nu)$ ,  $\tau \in [0, T]$ ,  $\nu \in V$ . Тогда игра может быть закончена в момент  $T$  с использованием управления вида (4).

Доказательство автоматически вытекает из теорем 5 и 6.

### Заключение

В настоящей работе рассматриваются квазилинейные конфликтно-управляемые процессы общего вида с терминальной функцией платы. Сформулированы достаточные условия окончания игры за конечное гарантированное время в случае, когда условие Понтрягина не выполняется. Предложены две схемы метода разрешающих функций, обеспечивающих завершение конфликтно-управляемого процесса с терминальной функцией платы в классе квазистратегий и контруправлений и дано сравнение гарантированных времен.

*Й.С. Ратнопорт*

### ДОСТАТНІ УМОВИ ГАРАНТОВАНОГО РЕЗУЛЬТАТУ В ДИФЕРЕНЦІЙНІЙ ГРІ З ТЕРМІНАЛЬНОЮ ФУНКЦІЄЮ ПЛАТИ

Досліджено метод розв'язувальних функцій стосовно теорії конфліктно-керованих процесів з термінальною функцією плати. Запропоновано модифіковану схему методу, що забезпечує закінчення гри за певний гарантований час в класі стробоскопічних стратегій без додаткових умов. Показано результати порівняння гарантованих часів схем методу розв'язувальних функцій з першим прямим методом Понтрягіна.

*J.S. Rappoport*

### SUFFICIENT CONDITIONS OF THE GUARANTEED RESULT IN DIFFERENTIAL GAME WITH A TERMINAL PAY OFF FUNCTION

Advanced research of the resolving-functions method concerning the theory of conflict-controlled processes with terminal payoff function is considered. A modified scheme of the method is proposed. This scheme ensures the end of a game within a definite guaranteed time period in the class of stroboscopic strategies without any subsidiary conditions. The guaranteed times for this schemes of the resolving-functions method are compared with that of the first Pontryagin method.

1. Чикрий А.А., Чикрий В.К. Структура образов многозначных отображений в игровых задачах управления движением // Международный научно-технический журнал «Проблемы управления и информатики». — 2016. — № 3. — С. 65–78.
2. Ратнопорт И.С., Чикрий А.А. О гарантированном результате в дифференциальной игре с терминальной функцией платы // Прикл. математика и механика. — 1995. — **59**, № 5. — С. 714–720.
3. Chikrii A.A., Rappoport J.S. Guarantee result in differential games with terminal payoff // Ann. Dynamic Games. — Berlin : Birkhauser, 1995. — **3**. — P. 323–330.
4. Ратнопорт И.С., Чикрий А.А. Гарантированный результат в дифференциальной игре группового преследования с терминальной функцией платы // Прикл. математика и механика. — 1997. — **61**, № 4. — С. 584–594.

5. *Чикрий А.А., Ратнопорт И.С.* Метод разрешающих функций в теории конфликтно-управляемых процессов // Кибернетика и системный анализ. — 2012. — **48**, № 5. — С. 40–64.
6. *Ратнопорт И.С.* Метод разрешающих функций в теории конфликтно-управляемых процессов с терминальной функцией платы // Международный научно-технический журнал «Проблемы управления и информатики». — 2016. — № 2. — С. 1–10.
7. *Ратнопорт И.С.* О стробоскопической стратегии в методе разрешающих функций для игровых задач управления с терминальной функцией платы // Кибернетика и системный анализ. — 2016. — **52**, № 4. — С. 90–102.
8. *Красовский Н.Н., Субботин А.И.* Позиционные дифференциальные игры. — М. : Наука, 1974. — 455 с.
9. *Понтрягин Л.С.* Избранные научные труды. — М. : Наука, 1988. — **2**. — 576 с.
10. *Никольский М.С.* Первый прямой метод Л.С. Понтрягина в дифференциальных играх. — М. : Изд-во МГУ, 1984. — 65 с.
11. *Субботин А.И., Ченцов А.Г.* Оптимизация гарантии в задачах управления. — М. : Наука, 1981. — 288 с.
12. *Hajek O.* Pursuit games. — New York : Academic Press, 1975. — **12**. — 266 p.
13. *Pittsyk M.V., Chikrii A.A.* On a group pursuit problem // Journal of Applied Mathematics and Mechanics. — 1982. — **46**, N 5. — P. 584–589.
14. *Chikrii A.A.* Multivalued mappings and their selections in game control problems // Journal of Automation and Information Sciences. — 1995. — **27**, N 1. — P. 27–38.
15. *Chikrii A.A.* Quasilinear controlled processes under conflict // Journal of Mathematical sciences. — 1996. — **80**, N 3. — P. 1489–1518.
16. *Chikrii A.A.* The problem of avoidance for controlled dynamic objects // J. Math., Game Theory and Algebra, Nova Science Publ. — 1997. — N 3. — P. 7–20.
17. *Чикрий А.А., Эйдельман С.Д.* Игровые задачи управления для квазилинейных систем с дробными производными Римана–Лиувилля // Кибернетика и системный анализ. — 2001. — № 6. — С. 66–99.
18. *Chikrii A.A.* Optimization of game interaction of fractional-order controlled systems // Optimization Methods and Software. — 2008. — **23**, N 1. — P. 39–72.
19. *Chikrii A.A.* Game dynamic problems for systems with fractional derivatives // Springer Optimization and its Applications. — 2008. — **17**. — P. 349–387.
20. *Чикрий А.А., Белоусов А.А.* О линейных дифференциальных играх с интегральными ограничениями сближения // Труды ИММ УрО РАН. — 2009. — **15**, № 4. — С. 290–301.
21. *Чикрий А.А.* Об одном аналитическом методе в динамических играх сближения // Труды МИ РАН им. В.А.Стеклова. — 2010. — **271**. — С. 76–92.
22. *Aubin J.-P., Frankowska H.* Set-valued analysis. — Boston; Basel; Berlin : Birkhauser, 1990. — 461 p.
23. *Рокафеллар Р.* Выпуклый анализ. — М. : Мир, 1973. — 470 с.

Получено 25.10.2017