

Esercitazione I: predizione e simulazione.

Si considerino i seguenti modelli di sistema

- $y(t) = -0.2 y(t-1) - 0.3 y(t-2) + u(t-1) + e(k)$
- $$\begin{cases} y_u(t) = -0.2 y_u(t-1) - 0.3 y_u(t-2) + u(t-1) \\ y(t) = y_u(t) + e(t) \end{cases}$$

Dove $e(k) \sim N(0,1)$ ed il tempo di campionamento è pari a 1 minuto.

Si crei uno script matlab che, per ogni modello

1. simuli l'andamento dell'uscita $y(t)$ a fronte di una variabile esogena $u(t)$ costante pari ad dieci lungo un orizzonte temporale di 100 minuti [$N=100$];
2. che, dopo aver determinato da un punto di vista teorico il predittore ad un passo [$\hat{y}(t|t-1) = f(Z^{k-1})$], predica l'andamento della serie storica di uscita a fronte dello stesso ingresso e con lo stesso segnale di errore usato al punto 1.
3. calcoli l'errore di predizione $\varepsilon(t) = y(t) - \hat{y}(t|t-1)$ e verifichi che esso sia pari al segnale di errore [$\varepsilon(t) = e(t)$].
4. Salvi i segnali (ingresso, uscita) in formato matlab [$*.mat$].

Comandi matlab utili

- **clear all:** svuota il work space;
- **close all:** chiude tutte le finestre;
- **clc:** svuota la command window;
- **[...]** : operatore di concatenazione;
- **save:** salva l'intero workspace od un suo sottoinsieme nel
- **figure:** per aprire una figura o crearne di nuove;
- **subplot:** per creare un'area di plot all'interno di una figura;
- **title:** per dare un titolo ad una figura;
- **plot:** per disegnare una o più funzioni;
- **xlabel, ylabel:** imposta le etichette per gli assi (rispettivamente x ed y);
- **legend:** crea una legenda;
- **axis:** definisce gli estremi di visualizzazione del grafico corrente.