

Álgebra Linear – Teoria de Matrizes

1. Sistemas Lineares
 - 1.1. Coordenadas em espaços lineares: independência linear, base, dimensão, singularidade, combinação linear
 - 1.2. Espaço imagem (colunas) - Espaço linhas. Posto
 - 1.3. Espaço nulo (núcleo). Nulidade
2. Autovalores e autovetores
3. Traço de matriz
4. Forma quadrática e sinais de matrizes
5. Valores singulares
6. Norma vetorial
7. Norma matricial

Sistemas Lineares

▷ Considere o conjunto de equações algébricas lineares

$$\left. \begin{array}{l} y_1 = a_{11}x_1 + a_{12}x_2 + \cdots + a_{1n}x_n \\ \vdots \\ y_m = a_{m1}x_1 + a_{m2}x_2 + \cdots + a_{mn}x_n \end{array} \right\} y = Ax$$

↪ x_1, \dots, x_n denotam **entradas** do sistema linear

↪ y_1, \dots, y_m denotam **saídas** do sistema linear

↪ a_{ij} denotam **parâmetros** que caracterizam o **mapeamento** entrada-saída

↪ $A \in \mathbb{R}^{m \times n}$, $y \in \mathbb{R}^m$ e $x \in \mathbb{R}^n$

Subespaços Fundamentais

Questões fundamentais

↪ Caracterizar os conjuntos de saídas y_1, \dots, y_m que podem ser obtidos dadas as entradas x_1, \dots, x_n (**controlabilidade** da saída)

↪ Dadas as saídas y_1, \dots, y_m identificar, se possível, o conjunto de entradas x_1, \dots, x_n que as geram (**observabilidade** da entrada)

Em outras palavras... Como caracterizar uma solução para $Ax = y$? Veja que tem-se um conjunto com m equações e n incógnitas

▷ Pode-se definir **subespaços fundamentais** de tal forma a obter condições de existência e uma forma geral de soluções para $Ax = y$

Coordenadas em Espaços Lineares

Nota Antes de responder a última questão, introduze-se conceitos sobre coordenadas em espaços lineares...

Dependência Linear Um conjunto de vetores $\{x_1, x_2, \dots, x_k\}$, $x_i \in \mathbb{R}^n$, $i = 1, \dots, k$, é **linearmente dependente** se existem escalares $\alpha_1, \alpha_2, \dots, \alpha_k$, **não todos nulos** tais que

$$\sum_{i=1}^k \alpha_i x_i = \alpha_1 x_1 + \alpha_2 x_2 + \dots + \alpha_k x_k = 0$$

Caso contrário, o conjunto $\{x_1, x_2, \dots, x_k\}$ é **linearmente independente – LI**

Veja que $\sum_{i=1}^k \alpha_i x_i = X\alpha$

sendo $X \triangleq [x_1 \ x_2 \ \dots \ x_k] \in \mathbb{R}^{n \times k}$, $\alpha \triangleq [\alpha_1 \ \alpha_2 \ \dots \ \alpha_k]^T \in \mathbb{R}^k$

Coordenadas em Espaços Lineares

Proposição Qualquer conjunto de n vetores **LI** qualifica uma **base** em um espaço linear n -dimensional (ie um espaço de **dimensão** n)

Lema Considere $Q \in \mathbb{R}^{n \times n}$. O sistema de equações

$$Qx = \mathbf{0}, \quad x \triangleq \begin{bmatrix} x_1 & x_2 & \cdots & x_n \end{bmatrix}^T$$

possui uma solução **não-nula** ($x \neq \mathbf{0}$) se e somente se Q é **singular**

Teorema Considere $Q = \begin{bmatrix} q_1 & q_2 & \cdots & q_n \end{bmatrix}$. Então Q é **não-singular** se e somente se o conjunto de vetores $\{q_1, q_2, \dots, q_n\}$ é **LI** (em outras palavras, $\exists Q^{-1}$)

Coordenadas em Espaços Lineares

Representação de vetores

Considere um conjunto de vetores $\{q_1, q_2, \dots, q_n\}$, base no \mathbb{R}^n . Então todo vetor $y \in \mathbb{R}^n$ pode ser escrito como **combinação linear**:

$$y = \sum_{i=1}^n \alpha_i q_i = Q\alpha$$

Como Q é não-singular:

$$\alpha = Q^{-1}y \quad \text{representação única de } y \text{ na base } \{q_1, q_2, \dots, q_n\}$$

Para outra base qualquer P , $y = P\zeta$, $\zeta = P^{-1}y = P^{-1}Q\alpha$!!!

Subespaços Fundamentais

Definição O **espaço colunas** de A é o espaço gerado pelas colunas de A , e é denominado espaço *imagem* de A — $\mathfrak{S}(A)$. Por outro lado, o **espaço linhas** de A é o espaço gerado pelas linhas de A — $\mathfrak{S}(A^T)$

Exemplo $y = \begin{bmatrix} 1 & -1 \end{bmatrix}^T$ está no espaço imagem de $A = \begin{bmatrix} 1 & -1 & -3 \\ 0 & 10 & 0 \end{bmatrix}$?

Em outras palavras, $y = Ax$, para algum x ? **Sim**, pois as colunas de A geram todo o espaço 2-dimensional

- **posto de colunas** de $A \in \mathbb{R}^{m \times n}$ é a dimensão de $\mathfrak{S}(A)$, ie é equivalente ao número de colunas **LI** de A
- **posto de linhas** de $A \in \mathbb{R}^{m \times n}$ é a dimensão de $\mathfrak{S}(A^T)$
- $\dim \mathfrak{S}(A) = \dim \mathfrak{S}(A^T) = r = \text{posto}(A) \quad \therefore \text{posto}(A) \leq \min \{m, n\}$

Subespaços Fundamentais

Definição O **espaço nulo à direita (ou núcleo)** de A é o espaço gerado por todos os vetores x satisfazendo $Ax = 0$ — $\mathcal{N}(A)$. Por outro lado, o **espaço nulo à esquerda** de A é o espaço gerado por todos os vetores y satisfazendo $y^T A = 0$ — $\mathcal{N}(A^T)$

Exemplo $x = \begin{bmatrix} 1 & 10 & 0 \end{bmatrix}^T$ está no espaço $\mathcal{N}(A)$:

$$A = \begin{bmatrix} 1 & -1 & -3 \\ 0 & 10 & 0 \end{bmatrix} \quad ?$$

Em outras palavras, $Ax = 0$? Como

$$\begin{bmatrix} 1 & -1 & -3 \\ 0 & 10 & 0 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} 1 \\ 10 \\ 0 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} -9 \\ 100 \end{bmatrix} \neq \begin{bmatrix} 0 \\ 0 \end{bmatrix}$$

portanto, a resposta é negativa

Subespaços Fundamentais

- Considere A de ordem $m \times n$

Dimensão dos quatro subespaços fundamentais: $\mathfrak{S}(A)$, $\mathfrak{S}(A^T)$, $\mathcal{N}(A)$ e $\mathcal{N}(A^T)$?

$$r \triangleq \text{posto}(A) = \dim \mathfrak{S}(A)$$

$$n \triangleq \text{colunas de } A$$

$$\therefore r + \dim \mathcal{N}(A) = n \quad \rightarrow \quad \dim \mathcal{N}(A) = n - r \quad (\text{Nulidade})$$

$$r \triangleq \text{posto}(A^T) = \dim \mathfrak{S}(A^T)$$

$$m \triangleq \text{linhas de } A$$

$$\therefore r + \dim \mathcal{N}(A^T) = m \quad \rightarrow \quad \dim \mathcal{N}(A^T) = m - r$$

Subespaços Fundamentais

- O espaço n-dimensional de **entrada** $\mathcal{X} = \mathfrak{S}(A^T) \oplus \mathcal{N}(A)$
- O espaço m-dimensional de **saída** $\mathcal{Y} = \mathfrak{S}(A) \oplus \mathcal{N}(A^T)$

MATLAB

`orth(A)` – base ortonormal para $\mathfrak{S}(A)$

`null(A)` – base ortonormal para $\mathcal{N}(A)$

`rank(A)` – posto de A

Exemplo Posto de $A = \begin{bmatrix} 0 & 1 & 1 & 2 \\ 1 & 2 & 3 & 4 \\ 2 & 0 & 2 & 0 \end{bmatrix} = [a_1 \quad a_2 \quad a_3 \quad a_4] ?$

a_1 e a_2 são **LI**. $a_3 = a_1 + a_2$. $a_4 = 2a_2$. A tem duas colunas **LI** \therefore $\text{posto}(A) = 2$

Subespaços Fundamentais

Teorema Dado $A \in \mathbb{R}^{m \times n}$, existe uma solução x para $Ax = y$, para qualquer y , sse $\text{posto}(A) = m$ (posto completo de linhas)

Teorema Dado $A \in \mathbb{R}^{n \times n}$. Se $\exists A^{-1}$, então $Ax = y$ tem uma única solução para todo y , ie $x = A^{-1}y$. Em particular, a única solução para $Ax = 0$ é $x = 0$

Autovalores e Autovetores

Definição Um escalar λ é denominado um **autovalor** de $A \in \mathbb{R}^{n \times n}$ se $\exists x \in \mathbb{R}^n, x \neq \mathbf{0}$, satisfazendo

$$Ax = \lambda x$$

Tal x é denominado um **autovetor** de A associado ao autovalor λ

Como calcular autovalor? Basta escrever $Ax = \lambda x = \lambda Ix$ da forma

$$(A - \lambda I)x = \mathbf{0}$$

- ▷ Se $(A - \lambda I)$ é **não singular**, então a **única** solução é $x = \mathbf{0}!!$
- ▷ Porém $x \neq \mathbf{0}$, então $(A - \lambda I)$ deve ser necessariamente **singular**, ou de forma equivalente, $\det(A - \lambda I) = 0 \dots$
- ▷ Toda raiz de $p(\lambda) = \det(A - \lambda I)$ é uma autovalor de A

Teoria de Matrizes

Traço Para $A \in \mathbb{R}^{n \times n}$, o traço de A , denotado por $\text{Tr}\{A\}$ ou $\text{Traço}\{A\}$, é definido como sendo:

$$\text{Tr}\{A\} = \sum_{i=1}^n a_{ii}$$

ie, é a soma dos elementos da diagonal principal

Propriedades

1. $\text{Tr}\{A\} = \sum_{i=1}^n \lambda_i$
2. $\text{Tr}\{A + B\} = \text{Tr}\{B + A\} = \text{Tr}\{A\} + \text{Tr}\{B\}$
3. $\text{Tr}\{AB\} = \text{Tr}\{B^T A^T\} = \text{Tr}\{BA\} = \text{Tr}\{A^T B^T\}$ (se existirem multiplicações)
4. $\text{Tr}\{A^T A\} = \sum_{i=1}^n \sum_{j=1}^n a_{ij}^2$

Forma quadrática e Sinais de Matrizes

Simetria $P \in \mathbb{R}^{n \times n}$ é dita ser simétrica se $P = P^T$

Nota Todos os autovalores de uma matriz simétrica são **reais**

Nota Toda matriz simétrica pode ser diagonalizada, mesmo para autovalores repetidos (MATLAB: jordan)

Forma Quadrática É uma classe de **funções escalares** na forma

$$V(x) = x^T P x = \begin{bmatrix} x_1 & \cdots & x_n \end{bmatrix} \begin{bmatrix} P_{11} & \cdots & P_{1n} \\ \vdots & \ddots & \vdots \\ P_{n1} & \cdots & P_{nn} \end{bmatrix} \begin{bmatrix} x_1 \\ \vdots \\ x_n \end{bmatrix}, \quad P = P^T$$

Forma quadrática e Sinais de Matrizes

Função escalar definida positiva Dado $P = P^T$, se a função escalar $x^T P x > 0$, para todo $x \neq 0$, então P é dita ser **definida positiva**, sendo denotado por $P \succ 0$

Função escalar definida negativa Dado $P = P^T$, se a função escalar $x^T P x < 0$, para todo $x \neq 0$, então P é dita ser **definida negativa**, sendo denotado por $P \prec 0$

Função escalar semidefinida positiva (negativa) Dado $P = P^T$, se a função escalar $x^T P x \geq 0$ ($x^T P x \leq 0$), para todo $x \neq 0$, então P é dita ser **semidefinida positiva (semidefinida negativa)**, sendo denotado por $P \succeq 0$ ($P \preceq 0$)

Nota Se P é semidefinida, então $\exists x \neq 0$ tal que $x^T P x = 0$

Forma quadrática e Sinais de Matrizes

Teorema $P = P^T \in \mathbb{R}^{n \times n}$ é **definida positiva** (semidefinida positiva) sse $\lambda(P) > 0$ ($\lambda(P) \geq 0$)

Teorema $P = P^T \in \mathbb{R}^{n \times n}$ é **definida negativa** (semidefinida negativa) sse $\lambda(P) < 0$ ($\lambda(P) \leq 0$)

Exercício Mostre que $V(x)$ é definida positiva

$$V(x) = x^T P x = 10x_1^2 + 4x_2^2 + x_3^2 + 2x_1x_2 - 2x_2x_3 - 4x_1x_3$$

Fato Dado $H \in \mathbb{R}^{m \times n}$ então

1. $H^T H$ ou $H H^T$ é simétrica
2. $H^T H \succeq 0$ ou $H H^T \succeq 0$
3. $H^T H \succ 0$ se $\text{posto}(H) = n$ (posto completo de colunas)
4. $H H^T \succ 0$ se $\text{posto}(H) = m$ (posto completo de linhas)

Valores Singulares

- ▷ Dado $H \in \mathbb{R}^{m \times n}$
 - ▷ Define-se $M \triangleq H^T H \quad \therefore M = M^T \succeq \mathbf{0}, M \in \mathbb{R}^{n \times n}$
 - ▷ Portanto todos os autovalores de M são reais e não negativos
 - ▷ r indica o número de autovalores positivos de M
- ↪ Então os autovalores de $M = H^T H$ podem ser ordenados da forma

$$\lambda_1^2 \geq \lambda_2^2 \geq \dots \geq \lambda_r > \mathbf{0} = \lambda_{r+1} = \dots = \lambda_n$$

Denote por $\bar{n} = \min(m, n)$. Então o conjunto

$$\lambda_1 \geq \lambda_2 \geq \dots \lambda_r > \mathbf{0} = \lambda_{r+1} \geq \lambda_{\bar{n}}$$

é denominado de **valores singulares** de H . Em outras palavras, os valores singulares de H (denotado por σ) são obtidos de:

$$\sigma = \sqrt{\lambda(H^T H)}, \quad \text{MATLAB: sigma}$$

Produto Interno

A função $\langle x, y \rangle : \mathbb{R} \times \mathbb{R} \mapsto \mathbb{R}$ é um **produto interno** se satisfaz os seguintes axiomas

1. $\langle x, y \rangle = \langle y, x \rangle$, $\langle x, y \rangle = \langle y, x \rangle^*$
2. $\langle \alpha(x + y), z \rangle = \alpha \langle x, z \rangle + \alpha \langle y, z \rangle$
3. $\langle x, x \rangle \geq 0$ e $\langle x, x \rangle = 0 \Leftrightarrow x = 0$

Representação usual para vetores do \mathbb{R}^n

$$\langle x, y \rangle = \sum_{i=1}^n x_i y_i$$

Vetores ortogonais – $x \perp y$

$$\langle x, y \rangle = x^T y = 0$$

Norma Vetorial

A função $\|x\| : \mathbb{R} \mapsto \mathbb{R}$ é uma **norma** se satisfaz os seguintes axiomas

1. $\|x + y\| \leq \|x\| + \|y\|$
2. $\|\alpha x\| = |\alpha| \|x\|$
3. $\|x\| \geq 0$ e $\|x\| = 0 \Leftrightarrow x = 0$

Normas usuais para vetores no \mathbb{R}^n

- **Norma-r** $\|x\|_r \triangleq \left(\sum_{i=1}^n |x_i|^r \right)^{\frac{1}{r}}, \quad 1 \leq r < \infty$
- **Norma- ∞** $\|x\|_\infty \triangleq \max_{1 \leq i \leq n} |x_i|$

Norma Vetorial

- **Norma-2 ou Norma Euclidiana** $\|x\|_2 \triangleq \sqrt{x^T x} = \sqrt{\langle x, x \rangle} = \left(\sum_{i=1}^n |x_i|^2 \right)^{\frac{1}{2}}$

Nota Interpretação gráfica? A norma-2 é o comprimento do vetor a partir da origem

MATLAB

`norm(x,1)` – norma-1

`norm(x,2)` ou `norm(x)` – norma-2

`norm(x,inf)` – norma- ∞

Norma Matricial

▷ O conceito de norma vetorial pode ser “estendido” para matrizes, no sentido de se poder “mensurar” matrizes. Considere \mathcal{X} o espaço de entradas \mathbb{R}^n e \mathcal{Y} o espaço de saídas \mathbb{R}^m

Definição Considere $A : \mathcal{X} \mapsto \mathcal{Y}$. O operador é **limitado** se

$$\exists c < \infty, c \in \mathbb{R} \quad : \quad \|Ax\| < c\|x\|, \forall x \in \mathcal{X}$$

Definição Considere $A : \mathcal{X} \mapsto \mathcal{Y}$. A **norma de A é a menor constante c**

Portanto a **norma de um operador linear** pode ser caracterizada por

$$\|A\|_r \triangleq \sup_{x \neq 0} \frac{\|Ax\|_r}{\|x\|_r} = \sup_{\|x\|_r=1} \|Ax\|_r$$

↪ $\|A\|_r$ é denominada norma matricial induzida por uma norma vetorial r

Norma Matricial

Para diferentes $\|x\|$, tem-se diferentes $\|A\|$

1. $\|A\|_1 = \max_j \left(\sum_{i=1}^m |a_{ij}| \right) \Leftrightarrow$ A maior soma absoluta das colunas

2. $\|A\|_2 = (\lambda_{max}(A^T A))^{\frac{1}{2}} \Leftrightarrow$ Valor singular máximo de A

3. $\|A\|_\infty = \max_i \left(\sum_{j=1}^m |a_{ij}| \right) \Leftrightarrow$ A maior soma absoluta das linhas

Norma Matricial

Exemplo Normas 1, 2 e ∞ de $A = \begin{bmatrix} 3 & 2 \\ -1 & 0 \end{bmatrix}$?

$$\|A\|_1 = \max \{3 + |-1|; 2 + 0\} = 4$$

$$\|A\|_2 = 3.7$$

$$\|A\|_\infty = \max \{3 + 2; |-1| + 0\} = 5$$

Norma Matricial

↪ Interpretação gráfica? Considere por exemplo a norma $\|A\|_1$. Note que $y = Ax$ e

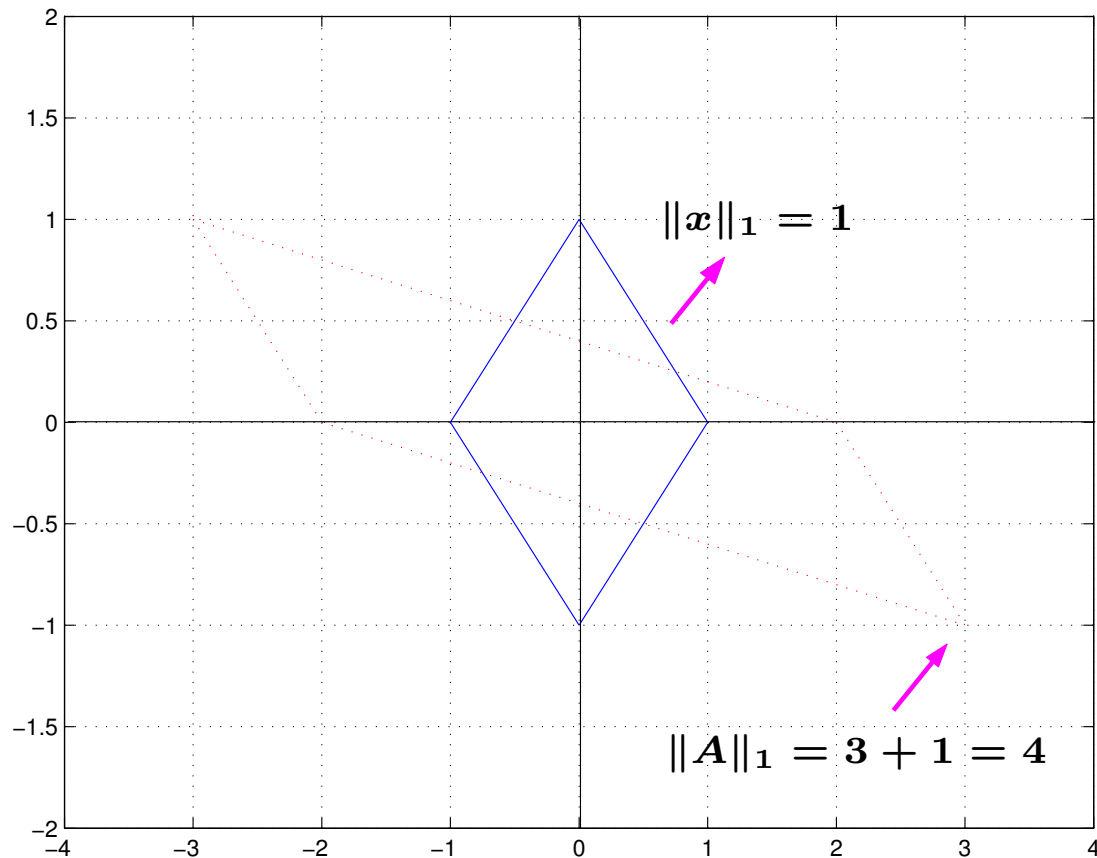
$$\|x\|_1 = 1 \Rightarrow \|x\|_1 = \sum_{i=1}^n |x_i|$$

portanto

$$y_1 = Ax = \begin{bmatrix} 3 & 2 \\ -1 & 0 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} 1 \\ 0 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 3 \\ -1 \end{bmatrix}, \quad y_2 = Ax = \begin{bmatrix} 3 & 2 \\ -1 & 0 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} 0 \\ 1 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 2 \\ 0 \end{bmatrix}$$

$$y_3 = Ax = \begin{bmatrix} 3 & 2 \\ -1 & 0 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} -1 \\ 0 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} -3 \\ 1 \end{bmatrix}, \quad y_4 = Ax = \begin{bmatrix} 3 & 2 \\ -1 & 0 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} 0 \\ -1 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} -2 \\ 0 \end{bmatrix}$$

Norma Matricial



MATLAB `norm(A,r)`, $r = 1, 2$ ou $r = \text{inf}$

Exercícios

1. Calcule o posto de $A = \begin{bmatrix} 0 & 1 & 1 & 2 & -1 \\ 1 & 2 & 3 & 4 & -1 \\ 2 & 0 & 2 & 0 & 2 \end{bmatrix}$

2. Calcule as normas induzidas 1,2 e ∞ para $A = \begin{bmatrix} 1 & -0.5 & 2 \\ 0 & 0.7 & 0.3 \\ -0.9 & 0 & 0.1 \end{bmatrix}$

3. Encontre os valores singulares de $A = \begin{bmatrix} -4 & -1 & 2 \\ 2 & 0.5 & -1 \end{bmatrix}$

4. Encontre uma forma diagonal para $A = \begin{bmatrix} 0 & 1 & 1 & 1 & 1 \\ 0 & 0 & 1 & 1 & 1 \\ 0 & 0 & 0 & 1 & 1 \\ 0 & 0 & 0 & 0 & 1 \\ 0 & 0 & 0 & 0 & 0 \end{bmatrix}$