

Álgebra Linear

1. + sobre Funções de Matriz Quadrada
2. Equação de Sylvester
3. Formas Quadráticas
4. Sinais de Matrizes
5. Normas de Matrizes

Funções de Matriz Quadrada

↪ Função de matriz quadrada definida como série de potência infinita...

Suponha que $f(\lambda)$ possa ser definida como:

$$f(\lambda) = \sum_{i=0}^{\infty} \beta_i \lambda^i$$

com raio de convergência ρ . Se todos os autovalores de A têm magnitude menor do que ρ , então $f(A)$ pode ser definida como:

$$f(A) = \sum_{i=0}^{\infty} \beta_i A^i$$

Funções de Matriz Quadrada

Exemplo Considere uma matriz \hat{A} na forma de Jordan e seja

$$f(\lambda) = f(\lambda_1) + \frac{f'(\lambda_1)}{1!}(\lambda - \lambda_1) + \frac{f''(\lambda_1)}{2!}(\lambda - \lambda_1)^2 + \dots$$

Então

$$f(\hat{A}) = f(\lambda_1)\mathbf{I} + \frac{f'(\lambda_1)}{1!}(\hat{A} - \lambda_1\mathbf{I}) + \dots + \frac{f^{(n-1)}(\lambda_1)}{(n-1)!}(\hat{A} - \lambda_1\mathbf{I})^{n-1} + \dots$$

Note que $(\hat{A} - \lambda_1\mathbf{I})^k = \mathbf{0}$ para $k \geq n$, i.e., a série infinita pode ser truncada! Por exemplo, considere um único bloco de Jordan de ordem 4, então $f(\hat{A})$ reduz-se a:

$$f(\hat{A}) = \begin{bmatrix} f(\lambda_1) & f'(\lambda_1)/1! & f''(\lambda_1)/2! & f^{(3)}(\lambda_1)/3! \\ 0 & f(\lambda_1) & f'(\lambda_1)/1! & f''(\lambda_1)/2! \\ 0 & 0 & f(\lambda_1) & f'(\lambda_1)/1! \\ 0 & 0 & 0 & f(\lambda_1) \end{bmatrix}$$

Funções de Matriz Quadrada

Note que e^{At} pode ser descrita via série de Taylor por:

$$e^{\lambda t} = 1 + \lambda t + \frac{\lambda^2 t^2}{2!} + \dots + \frac{\lambda^n t^n}{n!} + \dots = \sum_{k=0}^{\infty} \frac{1}{k!} t^k \lambda^k$$

que converge para todo λ e t finitos. Então,

$$e^{At} = \mathbf{I} + \mathbf{A}t + \frac{t^2}{2!} \mathbf{A}^2 + \dots + \frac{t^n}{n!} \mathbf{A}^n + \dots = \sum_{k=0}^{\infty} \frac{1}{k!} t^k \mathbf{A}^k$$

► Pode-se usar a descrição por série como um método numérico para computar exponenciais de matrizes

MATLAB – cômputo de exponencial de matriz, aproximação de Padé: `expm` ou `expmdemo1`

Computação Simbólica no MATLAB com `expm`

Remeta-se ao Exemplo da pag. 16 - Aula 8. Obtenha e^{At} para:

$$A = \begin{bmatrix} 0 & 0 & -2 \\ 0 & 1 & 0 \\ 1 & 0 & 3 \end{bmatrix}$$

```
>> A=[0 0 -2;0 1 0;1 0 3];
```

```
>> syms t;
```

```
>> expAt = expm(A*t)
```

expAt =

$$\begin{bmatrix} 2*\exp(t) - \exp(2*t), & 0, & 2*\exp(t) - 2*\exp(2*t) \\ 0, & \exp(t), & 0 \\ \exp(2*t) - \exp(t), & 0, & 2*\exp(2*t) - \exp(t) \end{bmatrix}$$

Funções de Matriz Quadrada

Propriedades de e^{At}

$$e^{At} = I + At + \frac{t^2}{2!}A^2 + \dots + \frac{t^n}{n!}A^n + \dots = \sum_{k=0}^{\infty} \frac{1}{k!}t^k A^k$$

$$e^0 = I$$
$$e^{A(t_1+t_2)} = e^{At_1}e^{At_2}$$

► Veja que para $t_2 = -t_1$:

$$e^{At_1}e^{-At_1} = e^{A \cdot 0} = I \Rightarrow e^{-At_1} = I/e^{At_1}$$



$$[e^{At}]^{-1} = e^{-At}$$

Funções de Matriz Quadrada

$$\begin{aligned}\frac{d}{dt}e^{At} &= \sum_{k=1}^{\infty} \frac{1}{(k-1)!} t^{k-1} A^k \\ &= A \left(\sum_{k=0}^{\infty} \frac{1}{k!} t^k A^k \right) = \left(\sum_{k=0}^{\infty} \frac{1}{k!} t^k A^k \right) A\end{aligned}$$

Portanto,

$$\frac{d}{dt}e^{At} = Ae^{At} = e^{At}A$$

- ▶ Note que $e^{(A+B)t} \neq e^{At}e^{Bt}$ a menos se $AB = BA$
- ▶ Relação de Euler: $e^{Ai} = \cos A + i \operatorname{sen} A$

Funções de Matriz Quadrada

↪ Relembrando a Transformada de Laplace de $f(t)$

$$F(s) = \mathcal{L}[f(t)] \triangleq \int_0^{\infty} f(t)e^{-st} dt$$

Particularmente a Transformada abaixo é de interesse:

$$\mathcal{L}\left[\frac{t^k}{k!}\right] = s^{-(k+1)}$$

Portanto

$$\mathcal{L}[e^{At}] = \sum_{k=0}^{\infty} s^{-(k+1)} A^k = s^{-1} \sum_{k=0}^{\infty} s^{-k} A^k = s^{-1} \sum_{k=0}^{\infty} (s^{-1} A)^k$$

Funções de Matriz Quadrada

► Como a série infinita

$$\sum_{k=0}^{\infty} (s^{-1}\lambda)^k = 1 + s^{-1}\lambda + s^{-2}\lambda^2 + \dots = (1 - s^{-1}\lambda)^{-1}$$

converge para $|s^{-1}\lambda| < 1$, conclui-se que

$$\begin{aligned} s^{-1} \sum_{k=0}^{\infty} (s^{-1}A)^k &= s^{-1}I + s^{-2}A + s^{-3}A^2 + \dots \\ &= s^{-1}(I - s^{-1}A)^{-1} \\ &= [s(I - s^{-1}A)]^{-1} \\ &= (sI - A)^{-1} \end{aligned}$$

$$\therefore \mathcal{L}[e^{At}] = (sI - A)^{-1}$$

Funções de Matriz Quadrada

- ▶ Embora se tenha usado o fato de que os autovalores de $s^{-1}A$ têm que ter módulo menor do que 1, $\mathcal{L} [e^{At}] = (sI - A)^{-1}$ vale para todo 's' exceto 's' igual a um autovalor de A
- ▶ Pode-se obter o mesmo resultado aplicando-se Laplace em $\frac{d}{dt}e^{At} = Ae^{At}$:

$$\begin{aligned}\mathcal{L} \left[\frac{d}{dt} e^{At} \right] &= \mathcal{L} [Ae^{At}] \\ s\mathcal{L} [e^{At}] - e^{\mathbf{0}} &= A\mathcal{L} [e^{At}]\end{aligned}$$

ou

$$(sI - A)\mathcal{L} [e^{At}] = I \Rightarrow \mathcal{L} [e^{At}] = (sI - A)^{-1}$$

Equação de Sylvester

A equação abaixo é denominada Equação de Sylvester:

$$AM + MB = C$$

- ▶ Matrizes dadas: $A \in \mathbb{R}^{n \times n}$, $B \in \mathbb{R}^{m \times m}$, $C \in \mathbb{R}^{n \times m}$
- ▶ Matriz incógnita: $M \in \mathbb{R}^{n \times m}$ (Objetivo: obter uma solução M)
- ▶ Defini-se o mapeamento: $\mathcal{S}(M) \triangleq AM + MB$

Equação de Sylvester

↪ Pode-se reescrever a equação de Sylvester como um conjunto de equações lineares. Lembre-se que M é a matriz incógnita. Por exemplo, considere $n = 3$, $m = 2$ tal que:

$$\begin{bmatrix} a_{11} & a_{12} & a_{13} \\ a_{21} & a_{22} & a_{23} \\ a_{31} & a_{32} & a_{33} \end{bmatrix} \begin{bmatrix} m_{11} & m_{12} \\ m_{21} & m_{22} \\ m_{31} & m_{32} \end{bmatrix} + \begin{bmatrix} m_{11} & m_{12} \\ m_{21} & m_{22} \\ m_{31} & m_{32} \end{bmatrix} \begin{bmatrix} b_{11} & b_{12} \\ b_{21} & b_{22} \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} c_{11} & c_{12} \\ c_{21} & c_{22} \\ c_{31} & c_{32} \end{bmatrix}$$

$$\underbrace{\begin{bmatrix} a_{11} + b_{11} & a_{12} & a_{13} & b_{21} & 0 & 0 \\ a_{21} & a_{22} + b_{11} & a_{23} & 0 & b_{21} & 0 \\ a_{31} & a_{32} & a_{33} + b_{11} & 0 & 0 & b_{21} \\ b_{12} & 0 & 0 & a_{11} + b_{22} & a_{12} & a_{13} \\ 0 & b_{12} & 0 & a_{21} & a_{22} + b_{22} & a_{23} \\ 0 & 0 & b_{12} & a_{31} & a_{32} & a_{33} + b_{22} \end{bmatrix}}_{\text{É uma matriz quadrada de dimensão } nm \times nm!!} \begin{bmatrix} m_{11} \\ m_{21} \\ m_{31} \\ m_{12} \\ m_{22} \\ m_{32} \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} c_{11} \\ c_{21} \\ c_{31} \\ c_{12} \\ c_{22} \\ c_{32} \end{bmatrix}$$

► De maneira genérica, a equação de Sylvester pode ser escrita como $\mathcal{S}(M) = C$, mapeamento $\mathbb{R}^{n \times m} \mapsto \mathbb{R}^{n \times m}$

Equação de Sylvester

↪ Um autovalor de \mathcal{S} pode ser definido como um escalar η se $\exists M \neq 0$ tal que

$$\mathcal{S}(M) = \eta M$$

Considerando \mathcal{S} como uma matriz quadrada de ordem nm , há nm autovalores η_k , $k = 1, 2, \dots, nm$, que são descritos da forma:

$$\eta_k = \lambda_i + \mu_j \quad , i = 1, 2, \dots, n \quad ; \quad j = 1, 2, \dots, m$$

sendo λ_i , $i = 1, 2, \dots, n$ autovalores de A e μ_j , $j = 1, 2, \dots, m$ autovalores de B

► De fato, considerando $u \in \mathbb{R}^{n \times 1}$ um autovetor à direita de A associado a λ_i , e $v \in \mathbb{R}^{1 \times m}$ um autovetor à esquerda de B associado a μ_j , tem-se:

$$Au = \lambda_i u \quad ; \quad vB = v\mu_j$$

Aplicando a transformação \mathcal{S} na matriz $uv \in \mathbb{R}^{n \times m}$ tem-se

$$\mathcal{S}(uv) = Auv + uvB = \lambda_i uv + uv\mu_j = (\lambda_i + \mu_j)uv$$

Equação de Sylvester

- ▶ Como o determinante de uma matriz é igual ao produto de todos os seus autovalores; uma matriz é não singular se e somente se nenhum autovalor é nulo
 - ▶ Se não existe nenhum i e j tais que $\lambda_i + \mu_j = 0$, então a matriz quadrada de ordem nm definida por \mathcal{S} é não singular e, para cada C , a solução M da equação de Sylvester é única
 - ▶ Se $\lambda_i + \mu_j = 0$ para algum i e j , dado C , a solução pode existir ou não. Se C pertence ao range de \mathcal{S} , existem múltiplas soluções
- ↪ Se $B = A'$, então $AM + MA' = C$ é denominada **Equação de Lyapunov** com $C, M \in \mathbb{R}^{n \times n}$. Se $C = C'$ então $M = M'$

MATLAB $M = \text{lyap}(A, B, -C)$

Formas Quadráticas

Uma forma quadrática é definida como:

$$x^* M x$$

sendo que $x^* M x \in \mathbb{R}$ e $x \in \mathbb{C}^n$

► Já que $x^* M x \in \mathbb{R}$, então $(x^* M x)^* = (x^* M^* x) = (x^* M x)$. Ou:

$$x^* M x - x^* M^* x = 0, \quad x^* (M - M^*) x = 0 \quad \Rightarrow \quad M = M^*$$

► Toda forma Hermitiana pode ser escrita como $x^* M x$, com $M = M^*$

Exemplos

Exemplo $M = \begin{bmatrix} 2 & 3j \\ 3j & 4 \end{bmatrix}$, considerando $x = \begin{bmatrix} 1 - j \\ 2 + 2j \end{bmatrix}$

$$x^* M x = \begin{bmatrix} 1 + j & 2 - 2j \end{bmatrix} \begin{bmatrix} 2 & 3j \\ 3j & 4 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} 1 - j \\ 2 + 2j \end{bmatrix} = 36$$

de fato, para todo $0 \neq x \in \mathbb{C}^2$ obtém-se:

$$x^* M x = 2x_1^* x_1 + \underbrace{3x_1^* x_2 + 3x_2^* x_1}_{\text{(têm sinal contrário!)}} + 4x_2^* x_2 = 2\|x_1\|^2 + 4\|x_2\|^2 \in \mathbb{R}$$

Exemplos

Exemplo $M = \begin{bmatrix} 1 & -1 \\ -1 & 2 \end{bmatrix}, x \in \mathbb{R}^2$

$$x' M x = x_1^2 - 2x_1 x_2 + 2x_2^2 > 0 \quad \forall x_1, x_2 \neq 0$$

Exemplos $\|Bx\|^2 = x' B' B x; \sum_{i=2}^n (x_{i+1} - x_i)^2; \|Fx\|^2 - \|Gx\|^2$

Unicidade da forma quadrática Se $x' A x = x' B x$ para todo $x \in \mathbb{R}^n$ e as matrizes A e B são simétricas, então $A = B$

Formas Quadráticas

Suponha que uma matriz simétrica M é decomposta na forma $M = QDQ'$, sendo D uma matriz diagonal contendo os autovalores reais de M ordenados:

$$\lambda_{\max} = \lambda_1 \geq \lambda_2 \geq \cdots \geq \lambda_{n-1} \geq \lambda_n = \lambda_{\min}$$

e $Q' = Q^{-1}$ uma matriz ortogonal. Então a forma quadrática:

$$x'Mx = x'QDQ'x = (Q'x)'D(Q'x) = \sum_{i=1}^n \lambda_i (q'_i x)^2$$

$$\leq \lambda_{\max} \sum_{i=1}^n (q'_i x)^2 = \lambda_{\max} \|x\|^2$$

De forma similar pode-se obter: $x'Mx \geq \lambda_{\min} \|x\|^2$. Portanto

$$\lambda_{\min} x'x = \lambda_{\min} \|x\|^2 \leq x'Mx \leq \lambda_{\max} \|x\|^2 = \lambda_{\max} x'x, \quad \forall x \neq 0, x \in \mathbb{C}^n$$

Formas Quadráticas

Propriedades de Matrizes Hermitianas: $M = M^*$ ou $M = M'$ se $M \in \mathbb{R}^{n \times n}$

- ▶ Autovalores reais
- ▶ Forma de Jordan diagonal
- ▶ Autovetores correspondentes a autovalores distintos são ortogonais
- ▶ Toda matriz Hermitiana M pode ser transformada por uma matriz unitária P (isto é, $P^{-1} = P^*$) em uma matriz diagonal com elementos reais:

$$\hat{M} = PMP^*$$

Sinais de Matrizes

↪ Uma matriz M é **definida positiva** sse $x^* M x > 0, \forall x \neq 0, x \in \mathbb{C}^n$.

Simbologia: $M > 0$ (lê-se: a matriz M é definida positiva)

↪ Uma matriz M é **semidefinida positiva** sse $x^* M x \geq 0, \forall x \in \mathbb{C}^n$. Simbologia:

$M \geq 0$ (lê-se: a matriz M é semidefinida positiva)

↪ Uma matriz M é **definida negativa** se $-M$ é (semi)definida positiva. Simbologia:

$M < 0$ (lê-se: a matriz M é definida negativa)

Teorema Uma matriz Hermitiana $M, n \times n$, é **definida positiva** (**semidefinida positiva**) se, e somente se, qualquer uma das condições abaixo é satisfeita:

▶ Todos os autovalores de M são positivos (**não negativos**)

▶ Existe uma matriz não singular $N, n \times n$ (**uma matriz singular $N, n \times n$, ou uma matriz $m \times n$ com $m < n$**) tal que $M = N^* N$

Sinais de Matrizes

Demonstração da segunda condição

▷ Suponha que $\exists N$ não singular tal que $M = N^*N$. Então

$$x^* M x = x^* N^* N x = (N x)^* (N x) = \|N x\|_2^2 \geq 0, \quad \forall x$$

Se N é não-singular, então $Nx = 0$ se, e somente se, $x = 0$ e, portanto, M é definida positiva. Se N é singular, existe $x \neq 0$ tal que $Nx = 0$ e M é semidefinida positiva

▶ N pode ser obtida por fatoração de Cholesky (de fato, Cholesky é aplicável a matrizes definidas positivas...)

Sinais de Matrizes

Exemplo $M = \begin{bmatrix} 1 & -1 \\ -1 & 2 \end{bmatrix}$ é definida positiva, pois

Autovalores de M : $\lambda_1 = 0.3820$; $\lambda_2 = 2.6180$

$$M = N'N \quad ; \quad N = \text{chol}(M) = \begin{bmatrix} 1 & -1 \\ 0 & 1 \end{bmatrix} \quad ; \quad \det(N) = 1 \neq 0$$

Propriedades – Sinais de Matrizes

Nota Dada uma matriz H , sabemos que $H'H$ ou HH' é simétrica. Então:

- ▶ A matriz simétrica $H'H$ é sempre semidefinida positiva; será definida positiva se $H'H$ for não singular (invertível). O mesmo vale para HH'
- ▶ Como $H'H$ e HH' são matrizes simétricas semidefinidas positivas, seus autovalores são reais e não negativos
- ▶ Se $H \in \mathbb{R}^{m \times n}$, então $H'H$ tem n autovalores e HH' tem m autovalores
- ▶ Se $H \in \mathbb{R}^{m \times n}$ tem posto completo de colunas n , então $H'H$ é definida positiva
- ▶ Se $H \in \mathbb{R}^{m \times n}$ tem posto completo de linhas m , então HH' é definida positiva

Decomposição em Valores Singulares

Seja $H \in \mathbb{R}^{m \times n}$ e defina $M = H'H$ (simétrica, $n \times n$ e semidefinida positiva). Então todos os autovalores de M são reais e não negativos (zero ou positivos). **Seja r o número de autovalores positivos** ($\because M$ tem posto r)

Os n autovalores de $M = H'H$ podem ser arranjados na forma

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

▷ λ_i^2 , $i = 1, 2, \dots, n$: autovalores de $H'H$

▷ λ_i , $i = 1, 2, \dots, \bar{n}$: valores singulares de H (denotado por σ_i)

sendo $\bar{n} \triangleq \min\{n, m\}$

Decomposição em Valores Singulares

Exemplo $H = \begin{bmatrix} -1 & 1 & 0 \\ 1 & -1 & 1 \end{bmatrix}$ e $M = H'H = \begin{bmatrix} 2 & -2 & 1 \\ -2 & 2 & -1 \\ 1 & -1 & 1 \end{bmatrix}$

▷ $\bar{n} \triangleq \min\{n,m\} = 2$

▷ Autovalores de M : 4.5616; 0.4384; 0

▷ Valores singulares de H : $2.1358 = \sqrt{4.5616}$; $0.6622 = \sqrt{0.4384}$

▷ Autovalores de HH' : 4.5616; 0.4384

▷ Valores singulares de H' : $2.1358 = \sqrt{4.5616}$; $0.6622 = \sqrt{0.4384}$

↪ Note que os autovalores de $H'H$ diferem dos de HH' apenas no número de zeros, e H e H' têm os mesmos valores singulares

Decomposição em Valores Singulares

Teorema – Decomposição em Valores Singulares – Toda matriz H $m \times n$ pode ser escrita na forma

$$H = RSQ'$$

com $R'R = RR' = I_m$, $Q'Q = QQ' = I_n$ e S uma matriz $m \times n$ com os valores singulares de H na diagonal

As colunas de Q (R) são autovetores ortonormais de $H'H$ (HH'). O posto de H é igual ao número de valores singulares diferentes de zero. Se o posto de H é r , as r primeiras colunas de R formam uma base ortonormal para o range de H , e as últimas $(n - r)$ colunas de Q formam uma base para o espaço nulo de H

MATLAB `[R,S,Q]=svd(H)`

Norma de Matrizes

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

sendo \sup o supremo ou o menor limitante superior

\rightsquigarrow $\|A\|_r$ é denominada norma matricial induzida por uma norma vetorial r .
Para diferentes $\|x\|$, tem-se diferentes $\|A\|$

1. $\|A\|_1 = \max_j \sum_{i=1}^m |a_{ij}| \quad \Leftrightarrow \quad$ A maior soma absoluta das colunas
2. $\|A\|_2 = \sqrt{(\lambda_{\max}(A'A))} \quad \Leftrightarrow \quad$ Valor singular máximo de A
3. $\|A\|_\infty = \max_i \sum_{j=1}^m |a_{ij}| \quad \Leftrightarrow \quad$ A maior soma absoluta das linhas

Norma de Matrizes

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

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

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

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

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

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

