CÁLCULO DIFERENCIAL E INTEGRAL III

TRANSFORMAÇÃO DE LAPLACE

1 Transformação de Funções Elementares

Para certas funções reais de variável real $f:[0,+\infty[\to\mathbb{R},$ na variável t, definimos a transformada de Laplace $F=\mathcal{L}[f]:\mathbb{C}\to\mathbb{C},$ na variável s,

por

$$F(s) = \int_0^{+\infty} f(t) e^{-st} dt$$

A transformada só está definida para os valores de $s\in\mathbb{C}$ para os quais o integral impróprio é convergente.

(Nota: As funções f para as quais definimos a transformada de Laplace são as seccionalmente contínuas e de tipo exponencial. Esta última condição significa que existem constantes reais α_0 e c tais que, para qualquer $t \in \mathbb{R}$, $|f(t)| \leq c \, e^{\alpha_0 t}$).

A transformação de Laplace é usada por exemplo na Teoria de Sistemas e Sinais, onde permite obter uma descrição mais simples e computável de um sistema: dado um domínio onde um sinal é descrito a partir da variável temporal t, obtém-se um outro domínio, onde aparecem as frequências complexas relacionadas com o sinal, e onde a análise desse sinal se torna mais acessível. Outra aplicação da transformação é a resolução de equações diferenciais, como vamos ver de seguida.

Exemplo:

Se f = 1, temos

$$\mathcal{L}[f](s) = \int_0^{+\infty} e^{-st} dt = \lim_{R \to +\infty} \frac{e^{-st}}{-s} \Big|_{t=0}^{t=R}$$
$$= \lim_{R \to +\infty} -\frac{1}{s} \left[e^{-sR} - 1 \right] = \frac{1}{s}$$

A transformada é válida para $\operatorname{Re} s > 0$.

Exemplo:

Se $f = e^{at}$ (com $a \in \mathbb{R}$), temos

$$\mathcal{L}[f](s) = \int_0^{+\infty} e^{at} e^{-st} dt = \lim_{R \to +\infty} -\frac{1}{s-a} \left[e^{-(s-a)R} - 1 \right]$$
$$= \frac{1}{s-a}$$

A transformada é válida para $\operatorname{Re} s > a$.

Exemplo:

Se f = sen(at) (com $a \in \mathbb{R}$), temos

$$\mathcal{L}[f](s) = \mathcal{L}[\operatorname{sen}(at)](s) = \operatorname{Im} \int_0^{+\infty} e^{iat} e^{-st} dt$$

$$= \operatorname{Im} \lim_{R \to +\infty} \frac{e^{-(s-ia)t}}{-(s-ia)} \Big|_0^R$$

$$= \operatorname{Im} \frac{1}{s-ia} = \operatorname{Im} \frac{s+ia}{s^2+a^2} = \frac{a}{s^2+a^2}$$

A transformada é válida para $\operatorname{Re} s > 0$. O último passo não é directo, porque s pode ter parte imaginária não nula, mas a fórmula está correcta porque, fazendo o integral por partes duas vezes, obtemos:

$$\mathcal{L}[\operatorname{sen}(at)](s) = \int_0^{+\infty} \operatorname{sen}(at) e^{-st} dt = \lim_{R \to +\infty} \int_0^R \operatorname{sen}(at) e^{-st} dt$$

$$= \lim_{R \to +\infty} \left(\operatorname{sen}(at) \frac{e^{-st}}{-s} \Big|_0^R - \int_0^R a \cos(at) \frac{e^{-st}}{-s} dt \right)$$

$$= \lim_{R \to +\infty} \left(\operatorname{sen}(at) \frac{e^{-st}}{-s} \Big|_0^R - a \cos(at) \frac{e^{-st}}{s^2} \Big|_0^R - \int_0^R a^2 \operatorname{sen}(at) \frac{e^{-st}}{s^2} dt \right)$$

$$= \frac{a}{s^2} - \frac{a^2}{s^2} \mathcal{L}[\operatorname{sen}(at)](s)$$

Onde o último passo só é válido para $\operatorname{Re} s>0$ (nos outros casos os limites mostrados não existem).

Resolvendo a equação obtida em ordem a $\mathcal{L}[\text{sen}(at)](s)$, obtemos a fórmula anterior.

Exemplo:

Se $f = \cos(at)$ (com $a \in \mathbb{R}$), temos

$$\mathcal{L}[f](s) = \operatorname{Re} \int_0^{+\infty} e^{iat} e^{-st} dt = \operatorname{Re} \frac{1}{s - ia} = \frac{s}{s^2 + a^2}$$

A transformada é válida para $\operatorname{Re} s > 0$.

Exemplo:

Se f = t, temos

$$\mathcal{L}[f](s) = \int_0^{+\infty} t e^{-st} dt = \lim_{R \to +\infty} \left[\left. \frac{t e^{-st}}{-s} \right|_0^R - \int_0^R \frac{e^{-st}}{-s} dt \right]$$
$$= \lim_{R \to +\infty} \frac{1}{s} \left. \frac{e^{-st}}{-s} \right|_0^R = \frac{1}{s^2}$$

A transformada é válida para $\operatorname{Re} s > 0$.

Exemplo:

Se $f = t^n$, para n natural superior a 1, temos

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

$$= \lim_{R \to +\infty} \left[\left. \frac{t^n e^{-st}}{-s} \right|_0^R - \int_0^R \frac{n t^{n-1} e^{-st}}{-s} dt \right. \right]$$

$$= \frac{n}{s} \lim_{R \to +\infty} \int_0^R t^{n-1} e^{-st} dt$$

As passagens acima são válidas para $\operatorname{Re} s > 0$.

Obtemos:
$$\mathcal{L}[t^n] = \frac{n}{s} \mathcal{L}[t^{n-1}]$$

e portanto
$$\mathcal{L}[t^n] = \frac{n!}{s^{n+1}}.$$

A transformada é válida para $\operatorname{Re} s > 0$.

2 Propriedades da Transformação de Laplace

- Linearidade:

$$\mathcal{L}[f+g] = \mathcal{L}[f] + \mathcal{L}[g] \text{ para quaisquer f e g}$$

$$\mathcal{L}[\alpha\,f] = \alpha\,\mathcal{L}[f]\,$$
para quaisquer f e $\alpha\,$

Podemos aplicar esta propriedade de modo a obter novamente a transformada de Laplace de $\cos{(at)}$. Note-se que, apesar de só termos definido esta transformação para funções reais, a mesma pode ser extendida a funções complexas: o integral impróprio em causa deve ser convergente.

$$\mathcal{L}[\cos(at)] = \mathcal{L}\left[\frac{e^{iat} + e^{-iat}}{2}\right] = \frac{1}{2}\left[\frac{1}{s - ia} + \frac{1}{s + ia}\right]$$
$$= \frac{1}{2}\left[\frac{s + ia + s - ia}{(s - ia)(s + ia)}\right] = \frac{s}{s^2 + a^2}$$

A transformada é válida para $\operatorname{Re} s > 0$.

Nota:

Em geral, $\mathcal{L}[fg] \neq \mathcal{L}[f] \mathcal{L}[g]$.

Por exemplo,
$$\mathcal{L}[t] = \frac{1}{\varsigma^2} \text{ mas } \mathcal{L}[t^2] = \frac{2}{\varsigma^3} \neq \mathcal{L}[t] \mathcal{L}[t].$$

- Translacção:

$$\mathcal{L}[f(t) e^{at}](s) = \mathcal{L}[f](s-a)$$

porque
$$\mathcal{L}[f(t) e^{at}](s) = \int_0^{+\infty} f(t) e^{at} e^{-st} dt = \int_0^{+\infty} f(t) e^{-(s-a)t} dt$$

Exemplo:

$$\mathcal{L}[e^{at}] = \mathcal{L}[1](s-a) = \frac{1}{s}\Big|_{s-a} = \frac{1}{s-a}$$

- Derivadas da transformação:

$$\mathcal{L}[t \ f(t)] = -(\mathcal{L}(f))'(s)$$

porque:

$$(\mathcal{L}[f])'(s) = \frac{d}{ds} \left[\int_0^{+\infty} f(t) e^{-st} dt \right] = \int_0^{+\infty} -t f(t) e^{-st} dt = -\mathcal{L}[t f(t)]$$

Exemplo:

$$\mathcal{L}[t] = -(\mathcal{L}[1])' = -\left(\frac{1}{s}\right)' = \frac{1}{s^2}$$

Em geral:

$$\mathcal{L}[t^n f(t)] = (-1)^n \left(\mathcal{L}[f] \right)^{(n)} (s)$$

- Transformação de derivadas:

Se $\lim_{t \to +\infty} f(t)$ for finito e Re s > 0,

$$\mathcal{L}[f'] = s \mathcal{L}[f] - f(0)$$

porque:

$$\mathcal{L}[f'(t)] = \lim_{R \to +\infty} \int_0^R f'(t) e^{-st} dt = \lim_{R \to +\infty} \left[f(t) e^{-st} \Big|_0^R - \int_0^R -s f(t) e^{-st} dt \right]$$
$$= -f(0) + s \mathcal{L}[f]$$

Se $\lim_{t\to +\infty} f(t)$ e $\lim_{t\to +\infty} f'(t)$ forem ambos finitos e Re s>0,

$$\mathcal{L}[f''] = s^2 \mathcal{L}[f] - s f(0) - f'(0)$$

porque:

$$\mathcal{L}[f''(t)] = \lim_{R \to +\infty} \int_0^R f''(t) e^{-st} dt = \lim_{R \to +\infty} \left[f'(t) e^{-st} \Big|_0^R - \int_0^R -s f'(t) e^{-st} dt \right]$$
$$= -f'(0) + s \mathcal{L}[f'] = -f'(0) + s (s \mathcal{L}[f] - f(0)) = s^2 \mathcal{L}[f] - s f(0) - f'(0)$$

(Alternativamente, também se pode aplicar a propriedade anterior à função f').

Em geral:

$$\mathcal{L}[f^{(n)}] = s^n \mathcal{L}[f] - s^{n-1} f(0) - \dots - s f^{(n-2)}(0) - f^{(n-1)}(0)$$

(com condições adequadas nos limites de f e das suas derivadas no infinito.)

3 Aplicação da Transformação de Laplace à Resolução de Equações Diferenciais

Exemplo:

$$\begin{cases} y'' - 3y' + 2y = e^{-t} \\ y(0) = 0 \\ y'(0) = 1 \end{cases}$$

Aplicamos a transformação de Laplace aos dois membros da equação, incluindo as condições iniciais apresentadas:

$$\mathcal{L}[y'' - 3y' + 2y] = \mathcal{L}[e^{-t}]$$

$$\Rightarrow (s^2 \mathcal{L}[y] - sy(0) - y'(0)) - 3(s\mathcal{L}[y] - y(0)) + 2\mathcal{L}[y] = \frac{1}{s+1}$$

$$\Rightarrow (s^2 - 3s + 2) \mathcal{L}[y] = 1 + \frac{1}{s+1}$$

$$\Rightarrow \mathcal{L}[y] = \frac{1}{s^2 - 3s + 2} + \frac{1}{(s+1)(s^2 - 3s + 2)}$$

$$\Rightarrow y = \mathcal{L}^{-1} \left[\frac{1}{s^2 - 3s + 2} + \frac{1}{(s+1)(s^2 - 3s + 2)} \right]$$

$$\Rightarrow y = \mathcal{L}^{-1} \left[\frac{-3/2}{s-1} + \frac{4/3}{s-2} + \frac{1/6}{s+1} \right]$$

$$\Rightarrow y = -\frac{3}{2} e^t + \frac{4}{3} e^{2t} + \frac{1}{6} e^{-t}$$

3.1 Inversas de Transformações de Laplace

Exemplo:

$$\mathcal{L}^{-1}\left[\frac{4+s}{s^2+2s}\right] = \mathcal{L}^{-1}\left[\frac{4+s}{s(s+2)}\right] = \mathcal{L}^{-1}\left[\frac{2}{s} - \frac{1}{s+2}\right] = \mathcal{L}^{-1}\left[\frac{2}{s}\right] - \mathcal{L}^{-1}\left[\frac{1}{s+2}\right] = 2 - e^{-2t}$$

Exemplo:

$$\mathcal{L}^{-1} \left[\frac{2s+1}{(s^2+1)(s-2)} \right] = \mathcal{L}^{-1} \left[\frac{1}{s-2} + \frac{-s}{s^2+1} \right] = e^{2t} - \cos t$$

A propriedade de translacção que vimos acima pode também ser vista em termos da inversa da transformação de Laplace:

$$\mathcal{L}^{-1}[F(s-a)] = \mathcal{L}^{-1}[F(s)] e^{at}$$

Exemplo:

$$\mathcal{L}^{-1}\left[\frac{s}{(s-1)^2}\right] = \mathcal{L}^{-1}\left[\frac{s-1}{(s-1)^2} + \frac{1}{(s-1)^2}\right] = \mathcal{L}^{-1}\left[\frac{1}{s-1} + \frac{1}{(s-1)^2}\right] = *$$

Temos
$$F(s-1) = \frac{1}{s-1} + \frac{1}{(s-1)^2}$$
, donde

$$F(s) = \frac{1}{s} + \frac{1}{s^2}$$

$$\Rightarrow \mathcal{L}^{-1}[F(s)] = 1 + t$$

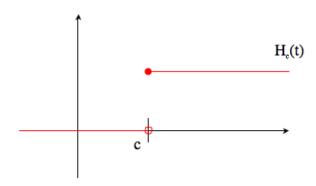
$$\Rightarrow * = (1+t)e^t$$

4 Funções por Troços

A aplicação da transformação de Laplace à resolução de equações diferenciais é útil sobretudo quando o lado direito dessas equações for dado por uma função com um número finito de descontinuidades.

A função de Heaviside $H_c: \mathbb{R} \to \mathbb{R}$ é definida por

$$H_c(t) = \begin{cases} 0, & t < c \\ 1, & t \ge c \end{cases}$$



Nota: H_0 costuma denotar-se simplesmente por H.

A transformada de Laplace de H_c é, para c > 0,

$$\mathcal{L}[H_c(t)] = \int_0^{+\infty} H_c(t) e^{-st} dt = \int_c^{+\infty} e^{-st} dt = \lim_{R \to +\infty} \left[\frac{e^{-st}}{-s} \right]_c^R = \frac{e^{-sc}}{s}$$

$$\mathcal{L}[H_c(t)] = \frac{e^{-sc}}{s}$$

(válido para $\operatorname{Re} s > 0$)

Para uma função geral:

$$\mathcal{L}[H_c(t) f(t-c)] = \int_0^{+\infty} H_c(t) f(t-c) e^{-st} dt = \int_c^{+\infty} f(t-c) e^{-st} dt$$
$$= \int_0^{+\infty} f(u) e^{-s(u+c)} du = *$$

(Usou-se aqui a transformação u = t - c.)

$$* = e^{-sc} \int_0^{+\infty} f(u) e^{-su} du = e^{-sc} \mathcal{L}[f]$$

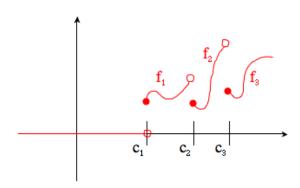
Ou seja:

$$\mathcal{L}[H_c(t) f(t-c)] = e^{-sc} \mathcal{L}[f]$$

Em termos de transformação inversa, a propriedade anterior fica:

$$\mathcal{L}^{-1}[e^{-sc} F(s)] = H_c(t) \mathcal{L}^{-1}[F](t-c)$$

Podemos representar funções por troços (que são as que têm um número finito de descontinuidades) com a ajuda da função de Heaviside (em pontos adequados.) Por exemplo, a função por troços da figura seguinte



é dada por
$$f = f_1 \cdot (H_{c_1} - H_{c_2}) + f_2 \cdot (H_{c_2} - H_{c_3}) + f_3 \cdot H_{c_3}$$
.

Exemplo: Aplicação à resolução de equações diferenciais

$$\begin{cases} y'' - 3y' + 2y = H_1(t) \\ y(0) = 0 \\ y'(0) = 1 \end{cases}$$

Obtemos:

$$\mathcal{L}[y'' - 3y' + 2y] = \mathcal{L}[H_1(t)]$$

$$\Rightarrow (s^2 - 3s + 2) \mathcal{L}[y] - 1 = \mathcal{L}[H_1(t)] = \frac{e^{-s}}{s}$$

$$\Rightarrow \mathcal{L}[y] = \frac{1}{s^2 - 3s + 2} + \frac{1}{s(s^2 - 3s + 2)} e^{-s}$$

$$\Rightarrow y = \mathcal{L}^{-1} \left[\frac{1}{s^2 - 3s + 2} \right] + \mathcal{L}^{-1} \left[\frac{1}{s(s^2 - 3s + 2)} e^{-s} \right]$$

Para o primeiro termo, temos:

$$\mathcal{L}^{-1} \left[\frac{1}{s^2 - 3s + 2} \right] = \mathcal{L}^{-1} \left[\frac{A}{s - 1} + \frac{B}{s - 2} \right] = \mathcal{L}^{-1} \left[\frac{-1}{s - 1} + \frac{1}{s - 2} \right] = -e^t + e^{2t}$$

Para o segundo termo, usamos a propriedade anterior (para inversas) com c = 1:

$$\mathcal{L}^{-1} \left[\frac{1}{s (s^2 - 3s + 2)} e^{-s} \right] = H_1(t) \mathcal{L}^{-1} \left[\frac{1}{s (s^2 - 3s + 2)} \right] \Big|_{t-1} = H_1(t) \mathcal{L}^{-1} \left[\frac{A}{s} + \frac{B}{s - 1} + \frac{C}{s - 2} \right] \Big|_{t-1}$$

$$= H_1(t) \mathcal{L}^{-1} \left[\frac{1/2}{s} + \frac{-1}{s - 1} + \frac{1/2}{s - 2} \right] \Big|_{t-1} = H_1(t) \left[\frac{1}{2} - e^t + \frac{1}{2} e^{2t} \right] \Big|_{t-1}$$

$$= H_1(t) \left[\frac{1}{2} - e^{t-1} + \frac{1}{2} e^{2(t-1)} \right]$$

5 Produto de Convolução e Delta de Dirac

5.1 Produto de Convolução

Vimos que, em geral, $\mathcal{L}[fg] \neq \mathcal{L}[f] \mathcal{L}[g]$.

Com o produto de convolução já temos uma relação destas.

Dadas $f \in g$, definimos

$$(f * g)(t) = \int_0^t f(t - u) g(u) du$$
 (para $t > 0$.)

Vê-se facilmente que $(f_1 + f_2) * g = f_1 * g + f_2 * g$ e que $f * (g_1 + g_2) = f * g_1 + f * g_2$ e que (cf) * g = c(f * g), e portanto o produto de convolução é bilinear.

É também comutativo, porque

$$(g * f)(t) = \int_0^t g(t - u) f(u) du = \int_t^0 g(v) f(t - v) (-1) dv = (f * g)(t)$$

(Usou-se a mudança de variável v = t - u.)

Em relação à transformação de Laplace, obtemos:

$$\begin{split} \mathcal{L}[f*g] &= \int_0^{+\infty} \left(f*g\right)(t) \, e^{-st} \, \mathrm{d}t = \int_0^{+\infty} \int_0^t \, f(t-u) \, g(u) \, \mathrm{d}u \, e^{-st} \, \mathrm{d}t \\ &= \int_0^{+\infty} \int_u^{+\infty} \, f(t-u) \, g(u) \, e^{-st} \, \mathrm{d}t \, \mathrm{d}u = \int_0^{+\infty} \, g(u) \, \int_u^{+\infty} \, f(t-u) \, e^{-st} \, \mathrm{d}t \, \mathrm{d}u \\ &= \int_0^{+\infty} \, g(u) \, \int_0^{+\infty} \, f(v) \, e^{-s(v+u)} \, \mathrm{d}v \, \mathrm{d}u = \int_0^{+\infty} \, g(u) \, e^{-su} \, \int_0^{+\infty} \, f(v) \, e^{-sv} \, \mathrm{d}v \, \mathrm{d}u \\ &= \mathcal{L}[f] \, \mathcal{L}[g] \end{split}$$

(Usou-se a mudança de variável v = t - u.)

Ou seja:

$$\mathcal{L}[f * g] = \mathcal{L}[f] \mathcal{L}[g]$$

e

$$\mathcal{L}^{-1}[FG] = \mathcal{L}^{-1}[F] * \mathcal{L}^{-1}[G]$$

Exemplo:

$$\mathcal{L}^{-1}\left[\frac{1}{s^2}\right] = \mathcal{L}^{-1}\left[\frac{1}{s}\right] * \mathcal{L}^{-1}\left[\frac{1}{s}\right] = 1 * 1 = \int_0^t 1 \cdot 1 \, \mathrm{d}\mathbf{u} = t$$

5.2 Delta de Dirac

Definimos $\delta(t) = \lim_{a \to 0} \delta_a(t)$,

onde
$$\delta_a(t) = \frac{1}{2a} \left[H_{-a}(t) - H_a(t) \right].$$

Quando $a \to 0$, temos que $\delta_a(t) \to 0$ se $t \neq 0$, mas $\delta_a(0) \to +\infty$.

Não se pode pois dizer que δ é uma função (é o que se chama uma distribuição).

Podemos ainda assim definir a sua transformação de Laplace de um modo natural. Para isso, começamos por calcular o valor de $\int_{-\infty}^{+\infty} \delta(t) f(t) dt$ para qualquer função contínua $f: \mathbb{R} \to \mathbb{R}$. Obtemos:

$$\begin{split} \int_{-\infty}^{+\infty} \, \delta(t) f(t) \, \mathrm{d} t &= \lim_{a \to 0^+} \frac{1}{2a} \Big[\int_{-\infty}^{+\infty} \, H_{-a}(t) f(t) \, \mathrm{d} t - \int_{-\infty}^{+\infty} \, H_a(t) f(t) \, \mathrm{d} t \Big] \\ &= \lim_{a \to 0^+} \frac{1}{2a} \Big[\int_{-a}^{+\infty} \, f(t) \, \mathrm{d} t - \int_{a}^{+\infty} \, f(t) \, \mathrm{d} t \Big] \\ &= \lim_{a \to 0^+} \frac{1}{2a} \Big[\int_{-a}^{+a} \, f(t) \, \mathrm{d} t \Big] \\ &= \lim_{a \to 0^+} \frac{f(a) + f(-a)}{2} = f(0) \end{split}$$

Podemos então calcular
$$\mathcal{L}[\delta(t)] = \int_0^{+\infty} \delta(t) e^{-st} dt = \int_{-\infty}^{+\infty} \delta(t) e^{-st} dt = 1$$

Ou seja:

$$\mathcal{L}[\delta(t)] = 1$$

Temos também:

$$\mathcal{L}[\delta(t - t_0)] = \int_0^{+\infty} \delta(t - t_0) e^{-st} dt = \int_{-t_0}^{+\infty} \delta(u) e^{-s(u + t_0)} du$$
$$= \int_{-\infty}^{+\infty} \delta(u) e^{-s(u + t_0)} du = e^{-st_0}.$$

Portanto,

$$\mathcal{L}[\delta(t-t_0)] = e^{-st_0}$$

E ainda, para qualquer função contínua $f: \mathbb{R} \to \mathbb{R}$,

$$\mathcal{L}[\delta(t - t_0) f(t)] = \int_0^{+\infty} \delta(t - t_0) f(t) e^{-st} dt = \int_{-t_0}^{+\infty} \delta(u) f(u + t_0) e^{-s(u + t_0)} du$$
$$= \int_{-\infty}^{+\infty} \delta(u) f(u + t_0) e^{-s(u + t_0)} du = e^{-st_0} f(t_0).$$

Ou seja,

$$\mathcal{L}[\delta(t-t_0) f(t)] = e^{-st_0} f(t_0)$$

Em relação à transformação inversa, temos:

$$\mathcal{L}^{-1}[1] = \delta(t)$$

e
$$\mathcal{L}^{-1}[F] = \mathcal{L}^{-1}[F \cdot 1] = \mathcal{L}^{-1}[F] * \mathcal{L}^{-1}[1] = \mathcal{L}^{-1}[F] * \delta$$

Isto implica que $\delta(t)$ é a unidade para o produto de convolução:

$$\boxed{f * \delta = \delta * f = f}$$