

Monitoria MAT1202 - Álgebra Linear 2

Apostila Notas de Aula

Matheus Nogueira

Resumo

Este documento consiste nas notas de aula da monitoria de MAT1202. Este material foi produzido com base em minhas anotações do curso de Álgebra Linear 2 do semestre 20.2 e do livro *Álgebra Linear e suas aplicações*, de *Gilbert Strang*. Qualquer dúvida, favor entrar em contato *matnogueira@gmail.com*

Sumário

1	Sistemas Lineares e Eliminação Gaussiana	2
1.1	Sistemas Lineares e Notação Matricial	2
1.2	Solução de um Sistema Linear	2
1.2.1	Operações Elementares	3
1.2.2	Matrizes das operações elementares	3
1.3	Exemplo	4
1.4	Conclusão	5
2	Fatoração $A=LU$	6
2.1	Sem permutação de linhas	6
2.1.1	Exemplo	7
2.2	Fatoração $PA=LU$ (com permutação de linhas)	8
2.2.1	Exemplo	8
2.3	Conclusão	9

1 Sistemas Lineares e Eliminação Gaussiana

1.1 Sistemas Lineares e Notação Matricial

Nosso foco é estudar sistemas de equações da forma $Ax = b$, onde A é a matriz com os termos que acompanham as variáveis (incógnitas), x é o vetor coluna com as incógnitas e b é o vetor coluna com os termos independentes.

Exemplo: Seja o seguinte sistema de equações...

$$\begin{aligned}x + 2y + 3 &= 2 \\ -x + y - z &= -3 \\ 2x + y - z &= 0\end{aligned}$$

Escrevê-lo em forma matricial é definir as seguinte matriz e vetores:

$$A = \begin{bmatrix} 1 & 2 & 3 \\ -1 & 1 & -1 \\ 2 & 1 & -1 \end{bmatrix}, x = \begin{bmatrix} x \\ y \\ z \end{bmatrix} \text{ e } b = \begin{bmatrix} 2 \\ -3 \\ 0 \end{bmatrix}$$

Não é difícil perceber que a multiplicação representada por Ax resulta exatamente no sistema linear inicial.

1.2 Solução de um Sistema Linear

Nossa estratégia para calcular a solução de um sistema de equações lineares será a **Eliminação Gaussiana**.

Este método consiste em realizar operações na matriz do sistema $Ax = b$, chamadas *operações elementares*, para chegar a um *sistema triangular*. Ao ser obtido este sistema, basta realizar uma série de substituições retroativas para chegar à solução.

Definição: Matrizes Triangulares

Uma matriz é triangular - superior ou inferior - se todas as entradas abaixo ou acima, respectivamente, da diagonal principal são nulas. A matriz A abaixo é triangular superior, enquanto que B é triangular inferior.

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

São 3 os possíveis tipos de solução de um sistema linear:

1. Exatamente 1 solução
2. Infinitas Soluções
3. Não há solução

Observação: lembrem-se que, para verificar qual das opções acima é a o caso da matriz a ser estudada, podemos olhar para o *determinante* da matriz. Se seu valor for zero, o sistema possui infinitas soluções ou nenhuma solução. Se for diferente de zero, uma solução.

1.2.1 Operações Elementares

Definição: dado um sistema linear $Ax = b$, são 3 as operações elementares que não alteram a solução do sistema.

1. Permutação de linhas ($L_i \leftrightarrow L_j$)
2. Multiplicação de linha por escalar ($L_i \rightarrow L_i \cdot k, k \neq 0$)
3. Somar um múltiplo de uma linha a outra linha ($L_i \rightarrow L_i + k \cdot L_j$)

1.2.2 Matrizes das operações elementares

Veremos que cada uma das 3 operações elementares descritas pode ser representada por meio de matrizes da seguinte forma:

Se queremos realizar a operação elementar e sobre a matriz A , devemos realizar a multiplicação $E \cdot A$, onde E é a matriz que representa a operação elementar e .

Vejamos as como montar as matrizes para as mesmas 3 operações já apresentadas. Por facilidade, usaremos matrizes 3×3 , pois o raciocínio para outras dimensões é o mesmo. Começamos sempre com a matriz identidade e:

1. Permutação de linhas ($L_i \leftrightarrow L_j$):
basta permutar as linhas da matriz identidade de acordo com as linhas a serem permutadas na matriz A
2. Multiplicação de linha por escalar ($L_i \rightarrow L_i \cdot k, k \neq 0$):
multiplicamos a linha correspondente da matriz identidade pelo escalar em questão.
3. Somar um múltiplo de uma linha a outra linha ($L_i \rightarrow L_i + k \cdot L_j$):
colocamos na entrada i, j da matriz identidade o valor de k com o devido sinal.

$$L_2 \leftrightarrow L_3 \implies \begin{bmatrix} 1 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 1 \end{bmatrix} \leftrightarrow \begin{bmatrix} 1 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 1 \\ 0 & 1 & 0 \end{bmatrix} = E \quad (1)$$

$$L_2 \rightarrow L_2 \cdot k \implies \begin{bmatrix} 1 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 1 \end{bmatrix} \leftrightarrow \begin{bmatrix} 1 & 0 & 0 \\ 0 & k \cdot 1 & 0 \\ 0 & 0 & 1 \end{bmatrix} = E \quad (2)$$

$$L_3 \rightarrow L_3 - 2 \cdot L_1 \implies \begin{bmatrix} 1 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 1 \end{bmatrix} \leftrightarrow \begin{bmatrix} 1 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & 0 \\ -2 & 0 & 1 \end{bmatrix} = E \quad (3)$$

Ao final da *Eliminação Gaussiana*, depois de serem realizadas todas as devidas *operações elementares*, a matriz obtida estará na forma **escalonada**, isto é:

1. Se existem linhas nulas elas devem ser as últimas da matriz.
2. Em quaisquer duas linhas sucessivas não nulas, o pivô (primeiro elemento não nulo) da linha inferior deve estar mais à direita que o da linha superior.
3. Abaixo do pivô todas as entradas são nulas.

1.3 Exemplo

Calculemos a solução do seguinte sistema, mostrando as matrizes das operações elementares.

$$\begin{aligned} 2x + y + z &= 5 \\ 4x - 6y &= 2 \\ -2x + 7y + 2z &= 9 \end{aligned}$$

Em forma matricial o sistema é:

$$\begin{bmatrix} 2 & 1 & 1 \\ 4 & -6 & 0 \\ -2 & 7 & 2 \end{bmatrix} \cdot \begin{bmatrix} x \\ y \\ z \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 5 \\ -2 \\ 9 \end{bmatrix}$$

Seja a matriz aumentada a ser escalonada a seguir:

$$\begin{bmatrix} 2 & 1 & 1 & 5 \\ 4 & -6 & 0 & -2 \\ -2 & 7 & 2 & 9 \end{bmatrix}$$

Começemos as operações elementares para chegar à matriz escalonada. A cada operação, indicaremos a matriz E correspondente.

$$L_2 \rightarrow L_2 - 2L_1 \text{ sendo } E_1 = \begin{bmatrix} 1 & 0 & 0 \\ -2 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 1 \end{bmatrix}$$

Nosso sistema fica...

$$\begin{bmatrix} 2 & 1 & 1 & 5 \\ 0 & -8 & -2 & -12 \\ -2 & 7 & 2 & 9 \end{bmatrix}$$

$$L_3 \rightarrow L_3 + L_1 \text{ sendo } E_2 = \begin{bmatrix} 1 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & 0 \\ 1 & 0 & 1 \end{bmatrix}$$

Nosso sistema fica...

$$\begin{bmatrix} 2 & 1 & 1 & 5 \\ 0 & -8 & -2 & -12 \\ 0 & 8 & 3 & 14 \end{bmatrix}$$

$$L_3 \rightarrow L_3 + L_2 \text{ sendo } E_3 = \begin{bmatrix} 1 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & 0 \\ 0 & 1 & 1 \end{bmatrix}$$

Nosso sistema fica...

$$\begin{bmatrix} 2 & 1 & 1 & 5 \\ 0 & -8 & -2 & -12 \\ 0 & 0 & 1 & 2 \end{bmatrix}$$

Chegamos à matriz escalonada. Agora basta realizar algumas substituições retroativas para calcularmos a solução.

Lendo e substituindo o sistema de baixo para cima temos:

$$\begin{aligned} z &= 2 \\ -8y - 2(2) &= -12 \rightarrow y = 1 \\ 2x + 1 + 2 &= 5 \rightarrow x = 1 \end{aligned}$$

Note que chegamos a uma solução única, o que faz sentido pois $\det(A) = -16 \neq 0$

Utilizando as matrizes das operações elementares, chegaríamos na mesma matriz escalonada:

$E_3 \cdot E_2 \cdot E_1 \cdot A$, onde A é a matriz aumentada

$$\begin{bmatrix} 1 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & 0 \\ 0 & 1 & 1 \end{bmatrix} \cdot \begin{bmatrix} 1 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & 0 \\ 1 & 0 & 1 \end{bmatrix} \cdot \begin{bmatrix} 1 & 0 & 0 \\ -2 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 1 \end{bmatrix} \cdot \begin{bmatrix} 2 & 1 & 1 & 5 \\ 4 & -6 & 0 & -2 \\ -2 & 7 & 2 & 9 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 2 & 1 & 1 & 5 \\ 0 & -8 & -2 & -12 \\ 0 & 0 & 1 & 2 \end{bmatrix}$$

1.4 Conclusão

Com este material sabemos como encontrar a solução de um sistema linear utilizando a Eliminação Gaussiana e as operações Elementares, com suas respectivas matrizes. O próximo assunto a ser abordado será **Fatoração LU**.

2 Fatoração $A=LU$

2.1 Sem permutação de linhas

No capítulo anterior vimos, ou relembramos, como resolver um sistema linear utilizando o processo da Eliminação Gaussiana por meio, principalmente, de operações elementares e suas matrizes. Neste capítulo continuaremos estudando sistemas lineares do tipo $Ax = b$ e apresentaremos uma maneira de fatorar a matriz A , escrevendo-a como $A = LU$.

Dito isso, já podemos definir a matriz A como a matriz de coeficientes do nosso sistema linear, ou seja, exatamente a mesma matriz A do capítulo anterior. Nosso sistema linear é:

$$\begin{bmatrix} a_{11} & a_{12} & a_{13} \\ a_{21} & a_{22} & a_{23} \\ a_{31} & a_{32} & a_{33} \end{bmatrix} \cdot \begin{bmatrix} x \\ y \\ z \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} b_{11} \\ b_{21} \\ b_{31} \end{bmatrix} \text{ logo, } A = \begin{bmatrix} a_{11} & a_{12} & a_{13} \\ a_{21} & a_{22} & a_{23} \\ a_{31} & a_{32} & a_{33} \end{bmatrix}$$

A matriz U é a matriz triangular superior que aparece ao final do processo de escalonamento da matriz A , obtida por meio das operações elementares. Você deve se lembrar que, em nossa aula 2 de *MATLAB*, aprendemos a função $[U] = lu(A)$, sendo U o nome dado à variável que guarda o output da função $lu()$, isto é, a matriz escalonada resultante da eliminação gaussiana. Com U em mãos, tudo que nos restava fazer era uma substituição retroativa para descobrir a solução do sistema.

A última matriz que falta ser descoberta é L . Para isso, precisamos lembrar das matrizes E_i que representam as operações elementares. Se nos recordarmos, para escalonar A até U fazíamos:

$$U = E_n \cdot E_{n-1} \cdot \dots \cdot E_2 \cdot E_1 \cdot A$$

sendo n o número de operações elementares a serem feitas.

Chamemos de E a matriz resultante de todas as multiplicações de E_i . Podemos reescrever a equação acima como $U = E \cdot A$. Queremos chegar na faturação $A = LU$, logo, não é difícil perceber que basta multiplicar ambos os lados de $U = E \cdot A$ por E^{-1} à esquerda que obteremos algo similar à fatoração desejada.

$$E^{-1}U = E^{-1}E \cdot A \rightarrow E^{-1} \cdot U = A$$

De fato, a matriz L da fatoração $A = LU$ é, justamente, a multiplicação de todas as inversas das matrizes elementares utilizada. Sendo assim, definimos

$$L = E_1^{-1} \cdot E_2^{-1} \cdot \dots \cdot E_n^{-1}$$

Convença-se de que L está corretamente definida!

O único empecilho para esta definição é garantir que todas as matrizes elementares são inversíveis. Para isso, seus determinantes devem ser diferentes de 0. Como estamos estudando, nesta seção, apenas o caso sem trocas de linha, é trivial notar que todas as matrizes E_i possuem 1 em sua diagonal principal e são triangulares inferiores. Sendo

assim, seus determinantes são sempre 1. Convença-se deste fato.

Agora podemos apresentar a versão completa da função do *MATLAB*, $[L, U] = lu(A)$. Esta função retorna, não somente a matriz escalonada U , como a matriz L , o que faz todo o sentido dado o nome da função... A análise da matriz L é importante para ver se houve trocas de linha na execução interna do algoritmo da função.

Com todas estas definições em mãos, podemos partir para um exemplo.

2.1.1 Exemplo

Dada a seguinte matriz A , calculemos cada uma das matrizes envolvidas na fatoração $A = LU$ e mostremos que essa igualdade vale.

$$A = \begin{bmatrix} 1 & 1 & 1 \\ 2 & 3 & 5 \\ 4 & 6 & 8 \end{bmatrix}$$

Realizando seu escalonamento, chegamos às seguintes matrizes elementares:

$$E_1 = \begin{bmatrix} 1 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & 0 \\ -4 & 0 & 1 \end{bmatrix}; E_2 = \begin{bmatrix} 1 & 0 & 0 \\ -2 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 1 \end{bmatrix}; E_3 = \begin{bmatrix} 1 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & 0 \\ 0 & -2 & 1 \end{bmatrix}$$

Podemos verificar (deixo por conta de você, caro aluno) que:

$$E_3 \cdot E_2 \cdot E_1 \cdot A = U \text{ onde, } U = \begin{bmatrix} 1 & 1 & 1 \\ 0 & 1 & 3 \\ 0 & 0 & -2 \end{bmatrix}$$

Note que U é uma matriz triangular superior assim como prevê a teoria! Calculemos agora a matriz L .

$$L = E_1^{-1} \cdot E_2^{-1} \cdot E_3^{-1} = \begin{bmatrix} 1 & 0 & 0 \\ 2 & 1 & 0 \\ 4 & 2 & 1 \end{bmatrix} \quad (4)$$

Como previsto, a matriz L é triangular inferior com todas as entradas da diagonal principal igual a 1.

Dica: para inverter uma matriz elementar basta trocar o sinal da entrada não nula fora da diagonal principal.

Podemos, por fim, verificar que:

$$L \cdot U = \begin{bmatrix} 1 & 0 & 0 \\ 2 & 1 & 0 \\ 4 & 2 & 1 \end{bmatrix} \cdot \begin{bmatrix} 1 & 1 & 1 \\ 0 & 1 & 3 \\ 0 & 0 & -2 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 1 & 1 & 1 \\ 2 & 3 & 5 \\ 4 & 6 & 8 \end{bmatrix} = A$$

2.2 Fatoração PA=LU (com permutação de linhas)

Caso seja necessário realizar alguma permutação de linhas a fim de garantir que U será uma matriz escalonada, precisamos corrigir a matriz A , introduzindo as permutações necessárias para, então, realizar a fatoração LU . Uma vez detectadas as permutações realizadas, podemos carregar essa informação em uma matriz P e multiplicá-la por A de modo que

$$PA = LU$$

Vejamos um exemplo.

2.2.1 Exemplo

Dada a seguinte matriz A , calculemos cada uma das matrizes envolvidas na fatoração $A = LU$, mostremos que serão necessárias permutações, montemos a matriz P e verifiquemos a validade da igualdade $PA = LU$.

$$A = \begin{bmatrix} 1 & 2 & 3 \\ 2 & 4 & 5 \\ 1 & 3 & 4 \end{bmatrix}$$

Para simplificar as contas, usemos a função do *MATLAB* $[L, U] = lu(A)$. O retorno desta função é:

$$L = \begin{bmatrix} 0.5 & 0 & 1 \\ 1 & 0 & 0 \\ 0.5 & 1 & 0 \end{bmatrix}; U = \begin{bmatrix} 2 & 4 & 5 \\ 0 & 1 & 1.5 \\ 0 & 0 & 0.5 \end{bmatrix}$$

A matriz L , neste caso, não é triangular inferior, o que indica que o algoritmo interno da função realizou permutações na matriz A . Precisamos, então, montar a matriz P de permutações. Podemos começar trocando as linhas 2 e 3. Para isso, chamemos de P_1 a seguinte matriz de modo que...

$$P_1 = \begin{bmatrix} 1 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 1 \\ 0 & 1 & 0 \end{bmatrix} \text{ de modo que } P_1 \cdot L = \begin{bmatrix} 0.5 & 0 & 1 \\ 0.5 & 1 & 0 \\ 1 & 0 & 0 \end{bmatrix}$$

Agora definimos P_2 a partir da troca das linhas 1 e 3.

$$P_2 = \begin{bmatrix} 0 & 0 & 1 \\ 0 & 1 & 0 \\ 1 & 0 & 0 \end{bmatrix} \text{ de modo que } P_2 \cdot P_1 \cdot L = \begin{bmatrix} 1 & 0 & 0 \\ 0.5 & 1 & 0 \\ 0.5 & 0 & 1 \end{bmatrix}$$

Definimos, então, $P = P_2 \cdot P_1$. O valor da matriz P está exibido logo abaixo.

Agora a matriz L possui as características necessárias segundo a teoria, isto é, ser triangular inferior e possuir todas as entradas da diagonal principal igual a 1.

Podemos, finalmente, verificar que:

$$PA = LU \leftrightarrow \begin{bmatrix} 0 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 1 \\ 1 & 0 & 0 \end{bmatrix} \cdot \begin{bmatrix} 1 & 2 & 3 \\ 2 & 4 & 5 \\ 1 & 3 & 4 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 0.5 & 0 & 1 \\ 1 & 0 & 0 \\ 0.5 & 1 & 0 \end{bmatrix} \cdot \begin{bmatrix} 2 & 4 & 5 \\ 0 & 1 & 1.5 \\ 0 & 0 & 0.5 \end{bmatrix}$$

2.3 Conclusão

Neste capítulo foram apresentados os conceitos de fatoração $A = LU$ em seu caso sem permutação de linhas e $PA = LU$ quando são necessárias essas permutações. Este é um algoritmo importante para a compreensão dos métodos de resolução de sistemas lineares e seu entendimento desmistifica o funcionamento da função $lu()$ utilizada no *MATLAB*.