

MILTON MANUEL AGUIRRE VALENCIA

ALGUNS RESULTADOS DA TEORIA DE  $\mathbb{R}^k$ -AÇÕES SOBRE  
VARIEDADES DIFERENCIÁVEIS

Dissertação apresentada à Universidade  
Federal de Viçosa, como parte das exi-  
gências do Programa de Pós-Graduação  
em Matemática, para obtenção do título  
de *Magister Scientiae*.

VIÇOSA  
MINAS GERAIS - BRASIL  
2019

**Ficha catalográfica preparada pela Biblioteca Central da Universidade  
Federal de Viçosa - Câmpus Viçosa**

T

A284a  
2019

Aguirre Valencia, Milton Manuel, 1986-  
Alguns resultados da teoria de  $R^k$ -ações sobre variedades  
diferenciáveis / Milton Manuel Aguirre Valencia. – Viçosa, MG,  
2019.

vii, 50 f. : il. (algumas color.) ; 29 cm.

Orientador: Walter Teófilo Huaraca Vargas.  
Dissertação (mestrado) - Universidade Federal de Viçosa.  
Referências bibliográficas: f. 49-50.

1. Sistemas dinâmicos diferenciais. 2. Folheações  
(Matemática). 3. Anosov, Difeomorfismos de. I. Universidade  
Federal de Viçosa. Departamento de Matemática. Programa de  
Pós-Graduação em Matemática. II. Título.

CDD 22. ed. 515.39

MILTON MANUEL AGUIRRE VALENCIA

ALGUNS RESULTADOS DA TEORIA DE  $\mathbb{R}^k$ -AÇÕES SOBRE  
VARIEDADES DIFERENCIÁVEIS

Dissertação apresentada à Universidade  
Federal de Viçosa, como parte das exi-  
gências do Programa de Pós-Graduação  
em Matemática, para obtenção do título  
de *Magister Scientiae*.

APROVADA: 25 de fevereiro de 2019.



Alexandre Miranda Alves



Andrés Mauricio López Barragán



Bulmer Mejía García  
(Presidente)

*Dedico este trabalho a minha família e  
à memória do meu avô Luis Arturo Valencia.*

“Longo é o caminho de ensinar  
através de teorias, breve e eficaz  
por meio de exemplos”.

---

Sêneca

# Agradecimentos

Agradeço aos meus pais, Mirian e Jose, pelo apoio, carinho e motivação, vocês são os pilares da minha vida, nossa história de lutas e vitórias começa bem antes daqui.

Agradeço ao meu orientador, Professor Dr. Walter Teofilo Huaraca Vargas, pela paciência, as correções e pelos conselhos oportunos que me deu. Enfim pela pessoa maravilhosa que é.

Ao meu incondicional e exclusivo irmão, Edwin, pelo companheirismo, força e credibilidade.

Aos professores e funcionários do DMA-UFV, por colaborarem com a minha formação e pelos eficientes serviços prestados.

Aos meus amigos e colegas de curso pela amizade e pelos momentos de descontração e de estudos. Vocês fizeram parte da minha formação e vão continuar presentes em minha vida com certeza.

Agradeço a todos que de alguma forma contribuíram para a realização deste processo de formação acadêmica.

Finalmente, mas não menos importante, agradeço à CAPES pelo apoio financeiro indispensável para a realização deste trabalho.

# Sumário

<b>Resumo</b>	<b>vi</b>
<b>Abstract</b>	<b>vii</b>
<b>Introdução</b>	<b>1</b>
<b>1 Preliminares</b>	<b>2</b>
1.1 Teoria de conjuntos e espaços topológicos . . . . .	2
1.1.1 Redes . . . . .	4
1.2 Variedades Topológicas e Diferenciáveis . . . . .	5
1.3 Campos de vetores em variedades . . . . .	8
1.3.1 Colchete de Lie . . . . .	15
1.3.2 Teorema do fluxo tubular . . . . .	18
<b>2 Folheações e Ações de Grupos</b>	<b>20</b>
2.1 Folheação . . . . .	20
2.2 Ações de grupos sobre Variedades . . . . .	25
2.3 Algumas propriedades de ações de grupos . . . . .	27
<b>3 Campos comutativos sobre superfícies</b>	<b>38</b>
3.1 Prova do Teorema A e do Teorema B . . . . .	39
3.2 Teorema C . . . . .	43
<b>Referências Bibliográficas</b>	<b>49</b>

# Resumo

VALENCIA, Milton Manuel Aguirre, M.Sc., Universidade Federal de Viçosa, fevereiro de 2019. **Alguns resultados da teoria de  $\mathbb{R}^k$ -ações sobre variedades diferenciáveis.** Orientador: Walter Teofilo Huaraca Vargas.

Na presente dissertação estudamos condições necessárias para garantir a existência de pontos fixos para ações de  $\mathbb{R}^n$  definidas sobre uma superfície compacta  $M$ . Estes resultados foram obtidos por E. L. Lima.



# Abstract

VALENCIA, Milton Manuel Aguirre, M.Sc., Universidade Federal de Viçosa, February, 2019. **Some results of the  $\mathbb{R}^k$ -actions theory on differentiable manifolds.** Adviser: Walter Teofilo Huaraca Vargas.

In the present dissertation we study conditions necessary to guarantee the existence of fixed points for actions of  $\mathbb{R}^n$  defined on a compact manifold  $M$ . These results were obtained by E. L. Lima.

# Introdução

Neste trabalho apresentamos o estudo de resultados que garantam a existência de pontos singulares comuns respeito de dois ou mais campos de vetores definidos sobre superfícies conexas, compactas com ou sem fronteira.

O objetivo principal desta dissertação é estudar os seguintes resultados obtidos por E. L. Lima em [10] e [9].

**Teorema A:** *Qualquer ação contínua de  $\mathbb{R}^2$  sobre a esfera  $S^2$  admite um ponto fixo.*

**Teorema B:** *Qualquer ação contínua de  $\mathbb{R}^2$  sobre o plano projetivo  $\mathbb{R}P^2$  admite um ponto fixo.*

**Teorema C:** *Qualquer ação contínua de  $\mathbb{R}^n$  sobre uma superfície  $M$ , com  $\chi(M) \neq 0$ , tem um ponto fixo.*

Embora o Teorema C implique o Teorema A e o Teorema B, apresentaremos provas independentes para cada um dos teoremas. Acreditamos que as demonstrações deles tem um valor individual pela riqueza das ideias.

O trabalho está dividido como segue: No capítulo 1, apresentaremos resultados preliminares muito conhecidos na teoria de sistemas dinâmicos, teoria de conjuntos e topologia. Todos eles sem prova, pois, as mesmas podem ser encontradas na bibliografia do presente trabalho.

No capítulo 2, apresentaremos fatos conhecidos da Teoria de folheações e ações de grupos sobre variedades e alguns lemas preliminares que usaremos nas provas dos teoremas.

Finalmente, no capítulo 3 apresentaremos as provas dos teoremas mencionados acima.

# Capítulo 1

## Preliminares

É muito importante contextualizar alguns conceitos básicos e resultados essenciais para o estudo dos capítulos seguintes. Dedicaremos este capítulo a fornecer as informações necessárias para os próximos capítulos.

### 1.1 Teoria de conjuntos e espaços topológicos

As definições e resultados apresentados aqui podem ser encontradas em [15], [3] e [13].

**Definição 1.1.** *Lembremos que uma relação  $\preceq$  em um conjunto  $\mathcal{A}$  é chamada uma relação de ordem parcial se as seguintes condições são satisfeitas:*

- (1)  $\alpha \preceq \alpha$  para todo  $\alpha$ .
- (2) Se  $\alpha \preceq \beta$  e  $\beta \preceq \alpha$ , então  $\alpha = \beta$ .
- (3) Se  $\alpha \preceq \beta$  e  $\beta \preceq \gamma$ , então  $\alpha \preceq \gamma$ .

Se  $\mathcal{A}$  é uma família de conjuntos com a relação definida como  $A \preceq B$  se, e somente se,  $B \subset A$  é uma relação de ordem parcial. Dizemos que  $A$  é um elemento maximal de  $\mathcal{A}$  se, e somente se, nenhum membro de  $\mathcal{A}$  contém propriamente  $A$ .

Uma família  $\mathcal{N}$  de conjuntos é dita uma cadeia se, e somente se, sempre que  $A$  e  $B$  são membros da família, então ou  $A \preceq B$  ou  $B \preceq A$ . Isto é equivalente a dizer que  $\mathcal{N}$  é linearmente ordenada.

Agora, podemos enunciar o seguinte princípio que foi formulado pela primeira vez por Hausdorff em 1914.

**Teorema 1.2. (Princípio Maximal de Hausdorff)** *Se  $\mathcal{A}$  é uma família de conjuntos e  $\mathcal{N}$  é uma cadeia em  $\mathcal{A}$ , então existe uma cadeia maximal  $\mathcal{M}$  em  $\mathcal{A}$  tal que  $\mathcal{N} \subset \mathcal{M}$ .*

Lembremos a seguinte definição.

**Definição 1.3.** *Uma topologia sobre um conjunto  $X$  é uma coleção  $\tau$  de subconjuntos de  $X$  satisfazendo as seguintes propriedades:*

- (1)  $\emptyset$  e  $X$  estão em  $\tau$ .
- (2) A união dos elementos de alguma subcoleção de  $\tau$  está em  $\tau$ .
- (3) A intersecção dos elementos de alguma subcoleção finita de  $\tau$  está em  $\tau$ .

Um conjunto  $X$  para o qual uma topologia  $\tau$  foi especificada é chamado um espaço topológico.

Corretamente falando, um espaço topológico é um par ordenado  $(X, \tau)$  consistindo de um conjunto  $X$  e uma topologia  $\tau$  em  $X$ , mas, muitas vezes omitimos menções específicas a  $\tau$  se não houver confusão.

**Definição 1.4.** *Seja  $(X, \tau_X)$  um espaço topológico e  $Z \subset X$  um subconjunto de  $X$  qualquer. Então, o conjunto  $Z \cap \tau_X = \{Z \cap A \mid A \in \tau_X\}$  é uma topologia para  $Z$  denominada topologia induzida por  $\tau_X$  em  $Z$ .*

Se  $X$  é um espaço topológico com topologia  $\tau$ , dizemos que um subconjunto  $U$  de  $X$  é um conjunto aberto de  $X$  se  $U$  pertence à coleção  $\tau$ . Usando esta terminologia, podemos dizer que um espaço topológico é um conjunto  $X$  com uma coleção de subconjuntos de  $X$ , chamada conjuntos abertos, tal que  $\emptyset$  e  $X$  ambos são abertos, e, tal que a união arbitrária e a intersecção finita de conjuntos abertos são abertos.

**Exemplo 1.5.** *Considere o espaço  $X = \mathbb{R}^n$  e  $\tau = \{U \subset \mathbb{R}^n; \forall x \in U, \exists B(a, r) \subset U\}$ , então  $(\mathbb{R}^n, \tau)$  é um espaço topológico satisfazendo as propriedades acima.*

**Exemplo 1.6.** *Seja  $S^{n-1} = \{x \in \mathbb{R}^n; x_1^2 + x_2^2 + \cdots + x_n^2 = a, a > 0\} \subset \mathbb{R}^n$  a esfera  $(n-1)$ -dimensional. Note que  $S^{n-1}$  com a topologia induzida é um espaço topológico.*

O seguinte resultado é conhecido na topologia algébrica, porém, omitiremos a prova pois esta pode ser encontrada em [13].

**Teorema 1.7. (Ponto Fixo de Lefschetz)** *Seja  $f : K \rightarrow K$  uma aplicação contínua, sendo  $K$  uma superfície compacta. Se  $\chi(K) \neq 0$ , então,  $f$  admite pelo menos um ponto fixo.*

Lembremos que um espaço de recobrimento de um espaço topológico  $X$  é um espaço topológico  $\tilde{X}$  com uma aplicação  $p : \tilde{X} \rightarrow X$  satisfazendo a seguinte condição: Existe uma cobertura aberta  $\{U_\alpha\}$  de  $X$  tal que para cada  $\alpha$ ,  $p^{-1}(U_\alpha)$  é união disjunta de conjuntos abertos em  $\tilde{X}$ , cada um dos quais é aplicado por  $p$  homeomorficamente em  $U_\alpha$ . Não exigimos  $p^{-1}(U_\alpha)$  ser não vazio, então  $p$  não precisa ser sobrejetiva.

Os recobrimentos são definidos em termos geométricos, como as aplicações  $p : \tilde{X} \rightarrow X$  que são homeomorfismos locais em um sentido bastante forte. Mas do ponto de vista da topologia algébrica, a característica distintiva dos espaços de recobrimento é o seu comportamento em relação ao levantamento das aplicações. Um levantamento de uma aplicação  $f : Y \rightarrow X$  é uma aplicação  $\tilde{f} : Y \rightarrow \tilde{X}$  tal que  $p \circ \tilde{f} = f$ . Em seguida, apresentamos duas propriedades de elevação, sem provas, uma vez que elas podem ser encontradas em [6]

**Teorema 1.8. (Existência)** *Seja  $(\tilde{X}, p)$  um espaço de recobrimento de  $X$ ,  $\tilde{x}_0 \in \tilde{X}$ , e  $x_0 = p(\tilde{x}_0)$ . Então, para qualquer caminho  $f : I \rightarrow X$  com ponto inicial  $x_0$ , existe um único caminho  $g : I \rightarrow \tilde{X}$  com ponto inicial  $\tilde{x}_0$  tal que  $p \circ g = f$ .*

**Teorema 1.9. (Unicidade)** *Seja  $(\tilde{X}, p)$  um espaço de recobrimento de  $X$  e seja  $Y$  um espaço conexo. Dadas quaisquer duas aplicações  $f_0, f_1 : Y \rightarrow \tilde{X}$  tal que  $p \circ f_0 = p \circ f_1$ , o conjunto  $\{y \in Y : f_0(y) = f_1(y)\}$  ou é vazio ou é todo  $Y$ .*

### 1.1.1 Redes

Sabemos que as sequências são adequadas para detectar pontos limite, funções contínuas e conjuntos compactos em espaços métricos. Existe uma generalização da noção de sequência, chamada rede, que fará o mesmo para um espaço topológico arbitrário. Vamos apresentar uma série de definições e um teorema que será relevante para os próximos capítulos, estes podem ser encontradas em [15] e [18]

**Definição 1.10.** *Um conjunto dirigido  $J$  é um conjunto com uma ordem parcial  $\preceq$  tal que para cada par de elementos  $\alpha, \beta$  de  $J$ , existe um elemento  $\gamma$  de  $J$  tendo a propriedade que  $\alpha \preceq \gamma$  e  $\beta \preceq \gamma$ .*

**Exemplo 1.11.** *Seja  $J = \mathbb{N}$ , note que se  $a, b \in \mathbb{N}$ , existe um elemento  $c = a + b \in \mathbb{N}$  tal que  $a \leq c$  e  $b \leq c$ .*

**Definição 1.12.** *Um subconjunto  $K$  de  $J$  é dito cofinal em  $J$  se para cada  $\alpha \in J$ , existe  $\beta \in K$  tal que  $\alpha \preceq \beta$ .*

**Exemplo 1.13.** *Seja  $K = \{2n : n \in \mathbb{N}\} \subset \mathbb{N}$ , então  $K$  é cofinal em  $\mathbb{N}$ , pois, para todo  $a \in \mathbb{N}$ , existe  $b \in K$  tal que  $a \leq b$ .*

**Definição 1.14.** *Seja  $X$  um espaço topológico e  $J$  um conjunto dirigido. Uma rede em  $X$  é uma função  $f : J \rightarrow X$ . Se  $\alpha \in J$ , usualmente denotamos  $f(\alpha)$  por  $x_\alpha$ . Denotamos a própria rede  $f$  pelo símbolo  $(x_\alpha)_{\alpha \in J}$ , ou simplesmente por  $(x_\alpha)$  se o conjunto de índices for subentendido.*

**Definição 1.15.** *A rede  $(x_\alpha)$  é dita convergente ao ponto  $x$  de  $X$  e escrevemos como  $x_\alpha \rightarrow x$  se, para cada vizinhança  $U$  de  $x$ , existe  $\alpha \in J$  tal que*

$$\alpha \preceq \beta \implies x_\beta \in U.$$

**Definição 1.16.** *Seja  $f : J \rightarrow X$  uma rede em  $X$ , tal que  $f(\alpha) = x_\alpha$ . Se  $K$  é um conjunto dirigido e  $g : K \rightarrow J$  é uma função tal que:*

(i)  $i \preceq j \implies g(i) \preceq g(j)$ ,

(ii)  $g(K)$  é cofinal em  $J$ ,

então, a função composta  $f \circ g : K \rightarrow X$  é chamada uma subrede de  $(x_\alpha)$ .

**Exemplo 1.17.** Note que uma sequência em  $\mathbb{R}$  é um caso particular de uma rede, isto é, para  $J = \mathbb{N}$  e  $X = \mathbb{R}$  temos que  $f : \mathbb{N} \rightarrow \mathbb{R}$  dada por  $f(n) = 1/2^n$  é uma rede e  $1/2^n \rightarrow 0$  é convergente. Além disso, uma subsequência é um caso particular de uma subrede.

O seguinte teorema generaliza um resultado conhecido de análise real.

**Teorema 1.18.**  $X$  é compacto se, e somente se, cada rede em  $X$  tem uma subrede convergente.

Outro resultado de especial interesse neste trabalho é o seguinte.

**Teorema 1.19.** Sejam,  $f : (X, \tau) \rightarrow (Y, \sigma)$  uma função arbitrária e  $x_0 \in X$ . As seguintes afirmações são equivalentes:

- a)  $f$  é contínua em  $x_0$ .
- b) Se  $\varphi : A \rightarrow X$  é uma rede convergente em  $x_0$ , então, a rede  $f \circ \varphi : A \rightarrow Y$  é convergente em  $f(x_0)$ .

## 1.2 Variedades Topológicas e Diferenciáveis

As definições incluídas nesta seção podem ser encontradas em [14] e em [8].

Iniciaremos esta seção com a definição de variedade topológica.

**Definição 1.20.** Suponha que  $M$  seja um espaço topológico. Dizemos que  $M$  é uma variedade topológica de dimensão  $n$  ou uma  $n$ -variedade topológica se tiver as seguintes propriedades:

- $M$  é um espaço Hausdorff: Para cada par de pontos  $p, q \in M$ , existem subconjuntos abertos disjuntos  $U, V \subset M$  tal que  $p \in U$  e  $q \in V$ .
- $M$  é segundo enumerável: Existe uma base enumerável para a topologia de  $M$ . Isto é, todo aberto da topologia pode ser escrito como união enumerável de elementos da base.
- $M$  é localmente euclidiana de dimensão  $n$ : Cada ponto tem uma vizinhança que é homeomorfa a um subconjunto aberto de  $\mathbb{R}^n$ .

Para nossos propósitos, precisaremos de uma classe de variedades topológicas, as chamadas variedades topológicas com fronteira. Para enuciar formalmente a definição das mesmas, consideremos para cada  $n \geq 1$  o espaço topológico  $\mathbb{H}^n = \{(x_1, \dots, x_n) \in \mathbb{R}^n : x_i \geq 0\}$  com a topologia induzida por  $\mathbb{R}^n$ . Um subconjunto  $U$  de  $\mathbb{H}^n$  é dito aberto em  $\mathbb{H}^n$  se  $U = \mathbb{H}^n \cap U'$  para algum subconjunto aberto  $U'$  de  $\mathbb{R}^n$ .

**Definição 1.21.** *Suponha que  $M$  seja um espaço topológico. Dizemos que  $M$  é uma variedade topológica com fronteira de dimensão  $n$  se tiver as seguintes propriedades:*

- (i)  *$M$  é um espaço Hausdorff: Para cada par de pontos  $p, q \in M$ , existem subconjuntos abertos disjuntos  $U, V \subset M$  tal que  $p \in U$  e  $q \in V$ .*
- (ii)  *$M$  é o segundo enumerável: Existe uma base enumerável para a topologia de  $M$ . Isto é, todo aberto da topologia pode ser escrito como união de elementos da base.*
- (iii)  *$M$  é localmente semi-euclidiana de dimensão  $n$ : Cada ponto tem uma vizinhança que é homeomorfa a um subconjunto aberto de  $\mathbb{H}^n$ .*

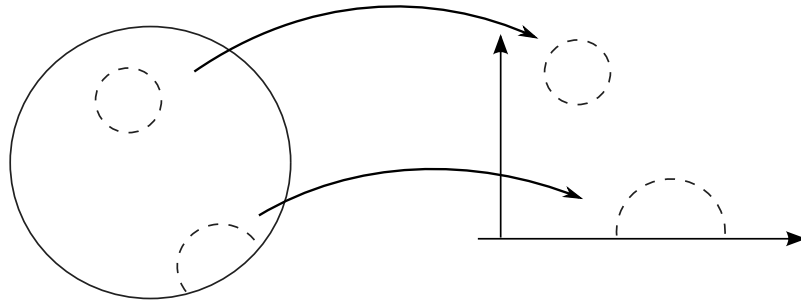


Figura 1.1: Variedade com fronteira.

**Observação 1.22.** 1. *Seja  $(U, \varphi)$  tal que  $U \subset M$  é aberto e  $\varphi : U \rightarrow \varphi(U) \subset \mathbb{R}^n$  como no item (iii) das definições anteriores. O par  $(U, \varphi)$  será chamado de carta coordenada.*

- 2. *O conjunto fronteira,  $\partial\mathbb{H}$ , de  $\mathbb{H}^n$  em  $\mathbb{R}^n$  é o conjunto de pontos onde  $x_n = 0$ . Se  $M$  é uma variedade com fronteira, um ponto que é a imagem inversa de  $\partial\mathbb{H}$  por alguma carta é chamado de ponto fronteira de  $M$  os demais pontos são chamados de pontos interiores de  $M$ .*

**Exemplo 1.23.** Para  $n \geq 1$  e  $M = \mathbb{R}_+^n$ , então,  $M$  é uma  $n$ -variedade com fronteira, com  $\text{int}(M) = \{(x_1, \dots, x_n) \in \mathbb{R}^n : x_n > 0\}$  e  $\partial M = \{(x_1, \dots, x_n) \in \mathbb{R}^n : x_n = 0\}$ .

**Exemplo 1.24.** A  $n$ -bola fechada  $D_n = \{(x_1, \dots, x_n) \in \mathbb{R}^n : (x_1)^2 + \dots + (x_n)^2 \leq 1\}$  é uma  $n$ -variedade com fronteira tal que  $\text{int}(D_n) = \{(x_1, \dots, x_n) \in \mathbb{R}^n : (x_1)^2 + \dots + (x_n)^2 < 1\}$  e  $\partial D_n = \{(x_1, \dots, x_n) \in \mathbb{R}^n : (x_1)^2 + \dots + (x_n)^2 = 1\} = S^{n-1}$ .

**Exemplo 1.25.** O toro sólido  $M = D_2 \times S^1$  é uma 3-variedade com fronteira, com  $\partial M = S^1 \times S^1$  sendo o 2-toro.

Em seguida, apresentaremos a definição de variedade diferenciável ou suave. Seja  $M$  uma  $n$ -variedade topológica. Se  $(U, \varphi), (V, \psi)$  são duas cartas tal que  $U \cap V \neq \emptyset$ , então, o homeomorfismo  $\psi \circ \varphi^{-1} : \varphi(U \cap V) \rightarrow \psi(U \cap V)$  é chamado de *aplicação transição*. Duas cartas  $(U, \varphi), (V, \psi)$  são chamadas compatíveis se, ou  $U \cap V = \emptyset$  ou a aplicação transição  $\psi \circ \varphi^{-1}$  é um difeomorfismo.

**Definição 1.26.** Um atlas de dimensão  $n$  sobre uma variedade topológica  $M$  é uma coleção  $\mathcal{A}$  de cartas coordenadas tal que a união dos domínios cobrem  $M$ . Um atlas  $\mathcal{A}$  é chamado de atlas de classe  $C^r$  se toda aplicação de transição for um difeomorfismo de classe  $C^r$ .

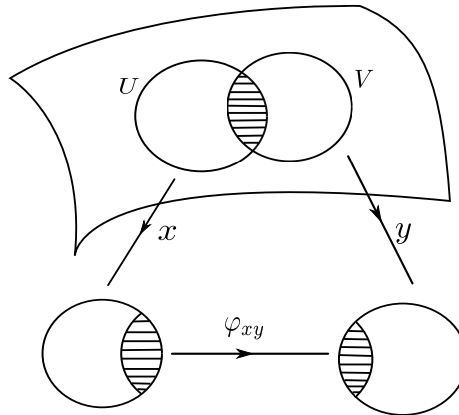


Figura 1.2: Mudanças de coordenadas.

Agora, podemos definir o principal conceito desta seção.

**Definição 1.27.** Uma estrutura diferencial de classe  $C^r$  sobre uma variedade topológica de dimensão  $n$  é um atlas maximal de classe  $C^r$ . Uma  $n$ -variedade diferencial de classe  $C^r$  é um par  $(M, \mathcal{A})$ , onde  $M$  é uma variedade topológica de dimensão  $n$  e  $\mathcal{A}$  é uma estrutura diferencial de classe  $C^r$  sobre  $M$ .

**Exemplo 1.28.** Sejam  $M = \mathbb{R}^m$ ,  $U \subset \mathbb{R}^m$  um aberto e  $x : U \rightarrow \mathbb{R}^m$  a aplicação de inclusão,  $x(p) = p$ . As coordenadas introduzidas em  $U$  pelo sistema  $x$  são denominadas coordenadas cartesianas.

**Exemplo 1.29.** A esfera  $n$ -dimensional  $S^n \subset \mathbb{R}^{n+1}$  definida por:

$$S^n = \{x = (x_1, \dots, x_{n+1}) \in \mathbb{R}^{n+1}; x_1^2 + \dots + x_{n+1}^2 = 1\}$$



com a topologia induzida por  $\mathbb{R}^{n+1}$  possui uma estrutura de variedade de classe  $C^\infty$  de dimensão  $n$ . De fato, se  $U_i^\sigma \subset S^n$ , e se  $\sigma = \pm 1$ , com  $1 \leq i \leq n+1$ , seja  $U_i^\sigma = \{x \in S^n; \sigma x_i > 0\}$ . A carta local  $\varphi_i^\sigma : U_i^\sigma \rightarrow \mathbb{R}^n$  definida por  $\varphi_i^\sigma(x_1, \dots, x_{i-1}, x_i, x_{i+1}, \dots, x_{n+1}) = (x_1, \dots, x_{i-1}, x_{i+1}, \dots, x_{n+1})$  cobre  $S^n$  e as mudanças de coordenadas são  $C^\infty$ .

Diremos que duas variedades topológicas  $M$  e  $N$  são equivalentes se elas são homeomorfas. Daí o problema para classificar variedades topológicas vai consistir em determinar explicitamente um representante em cada classe de equivalência.

As variedades conexas compactas de dimensão 2 podem ser classificadas como se expressa em [4], isto é, demonstra-se que toda superfície compacta conexa é homeomorfa ao quociente de um polígono plano por uma relação de equivalência que identifica as arestas do polígono duas a duas segundo as regras embaixo:

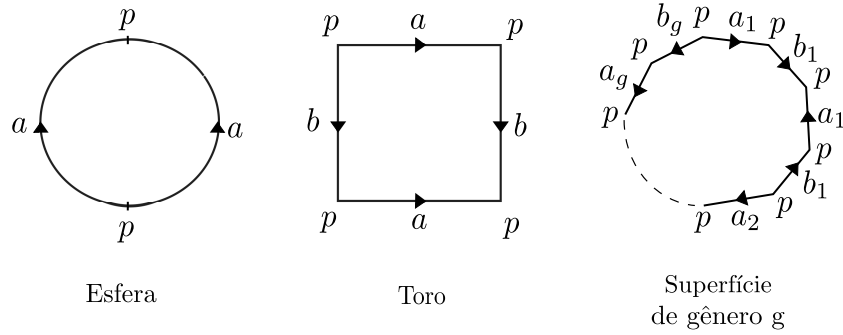


Figura 1.3: Superfícies orientáveis.

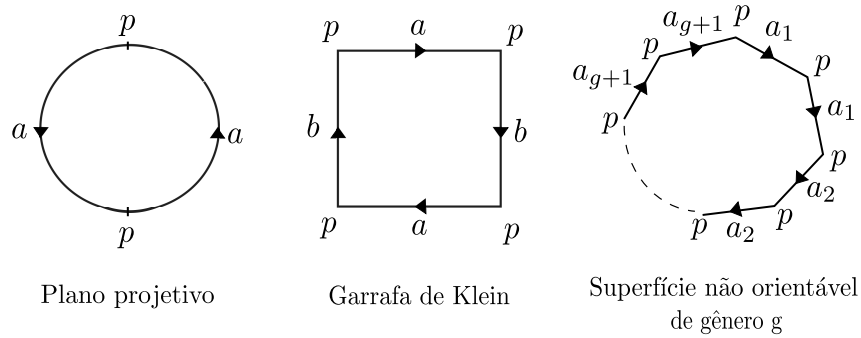


Figura 1.4: Superfícies não orientáveis.

Nas Figuras 1.3 e 1.4 as arestas com a mesma letra são identificadas segundo o sentido das setas. Esta idéia é muito importante para nosso capítulo 3, como veremos no Lema 2.13.

### 1.3 Campos de vetores em variedades

Nesta seção, apresentamos a definição de fluxo e outros conceitos importantes para formalizar o teorema de Poincaré-Bendixson na versão original e,

seguidamente, a versão para a esfera com a qual finalizaremos esta seção, os resultados aqui descritos podem ser encontrados em [16] e [17].

Seja  $M^m \subset \mathbb{R}^k$  uma variedade diferenciável. Um campo de vetores de classe  $C^r$  em  $M$  é uma aplicação de classe  $C^r$ ,  $X : M \rightarrow \mathbb{R}^k$  que a cada ponto  $p \in M$ , associa um vetor  $X(p) \in TM_p \subset \mathbb{R}^k$ . Isso corresponde a uma aplicação  $C^r$ ,  $X : M \rightarrow TM$  tal que  $\pi \circ X$  é a identidade em  $M$ , onde  $\pi$  é a projeção natural de  $TM$  em  $M$ . Denotaremos por  $\mathcal{X}^r(M)$  o conjunto dos campos de vetores de classe  $C^r$  em  $M$ .

Uma curva integrável de  $X \in \mathcal{X}^r(M)$  passando por um ponto  $p \in M$  é uma aplicação de classe  $C^{r+1}$ ,  $\alpha : I \rightarrow M$ , onde  $I$  é um intervalo contendo 0, tal que  $\alpha(0) = p$  e  $\alpha'(t) = X(\alpha(t))$  para todo  $t \in I$ . A imagem de uma curva integral é chamada de órbita ou trajetória.

Se  $f : M \rightarrow N$  é um difeomorfismo de classe  $C^{r+1}$  e  $X \in \mathcal{X}^r(M)$ , então  $Y = f * X$ , definido por  $Y(q) = df_p.X(p)$  com  $q = f(p)$ , é um campo de classe  $C^r$  em  $N$ , pois,  $f * X = df \circ X \circ f^{-1}$ . Se  $\alpha : I \rightarrow M$  é uma curva integrável de  $X$ , então  $f \circ \alpha : I \rightarrow N$  é uma curva integral de  $Y$ . Em particular,  $f$  leva trajetórias de  $X$  em trajetórias de  $Y$ . Assim, se  $x : U \rightarrow U_0 \subset \mathbb{R}^m$  é uma carta local,  $Y = x * X$  é um campo de classe  $C^r$  em  $U_0$ ; dizemos que  $Y$  é a expressão de  $X$  na carta local  $(x, U)$ . Com essas considerações, os teoremas locais sobre existência, unicidade e diferenciabilidade de soluções estende-se a campos em variedades. Isso se traduz na proposição dada a seguir:

**Proposição 1.30.** *Sejam  $E$  um espaço de Banach e  $F : E \times M \rightarrow TM$  uma aplicação  $C^r$  com  $r \geq 1$ , tal que  $\pi \circ F(\lambda, p) = p$ , onde  $\pi : TM \rightarrow M$  é a projeção natural. Para todo  $\lambda_0 \in E$  e  $p_0 \in M$ , existem vizinhanças  $W$  de  $\lambda_0$  em  $E$ ,  $V$  de  $p_0$  em  $M$ , um número real  $\varepsilon > 0$  e uma função de classe  $C^r$ ,  $\varphi : (-\varepsilon, \varepsilon) \times V \times W \rightarrow M$  tais que  $\varphi(0, p, \lambda) = p$  e  $(\partial/\partial t)\varphi(t, p, \lambda) = F(\lambda, \varphi(t, p, \lambda))$  para todo  $t \in (-\varepsilon, \varepsilon)$ ,  $p \in V$  e  $\lambda \in W$ . Além disso, se  $\alpha : (-\varepsilon, \varepsilon) \rightarrow M$  é uma curva integral do campo  $F_\lambda = F(\lambda, \cdot)$  com  $\alpha(0) = p$ , então  $\alpha = \varphi_{p, \lambda} = \varphi(\cdot, p, \lambda)$ .*

**Proposição 1.31.** *Sejam  $I, J$  intervalos abertos e  $\alpha : I \rightarrow M$ ,  $\beta : J \rightarrow M$  curvas integrais de  $X \in \mathcal{X}^r(M)$ ,  $r \geq 1$ . Se  $\alpha(t_0) = \beta(t_0)$ , para algum  $t_0 \in I \cap J$ , então  $\alpha(t) = \beta(t)$  em  $I \cap J$ . Consequentemente existe uma curva integral  $\gamma : I \cup J \rightarrow M$ , que coincide com  $\alpha$ , em  $I$ , e com  $\beta$ , em  $J$ .*

**Definição 1.32.** *Uma aplicação  $\varphi : \mathbb{R} \times M \rightarrow M$  de classe  $C^r$  é dita ser um fluxo se:*

$$(i) \quad \varphi(0, x) = x,$$

$$(ii) \quad \varphi(t + s, x) = \varphi(t, \varphi(s, x)), \text{ para todo } t, s \in \mathbb{R},$$

O fluxo é dito linear se para cada  $t$  fixo,  $\varphi_t(x) = \varphi(t, x)$  é uma aplicação linear em  $\mathbb{R}^n$ .

**Proposição 1.33.** *Seja  $M$  uma variedade compacta e  $X \in \mathcal{X}^r(M)$ . Existe em  $M$  um fluxo global de classe  $C^r$  para  $X$ . Isto é, uma aplicação  $\varphi : \mathbb{R} \times M \rightarrow M$  tal que  $\varphi(0, p) = p$  e  $(\partial/\partial t)(\varphi(t, p)) = X(\varphi(t, p))$ .*

**Corolário 1.34.** *Sejam  $X \in \mathcal{X}^r(M)$  e  $\varphi : \mathbb{R} \times M \rightarrow M$  o fluxo associado a  $X$ . Para cada  $t \in \mathbb{R}$ , a aplicação  $X_t : M \rightarrow M$ , tal que  $X_t(p) = \varphi(t, p)$ , é um difeomorfismo de classe  $C^r$ . Além disso,  $X_0 = \text{identidade}$ ,  $X_{t+s} = X_t \circ X_s$  para todo  $t, s \in \mathbb{R}$ .*

Sejam  $X \in \mathcal{X}^r(M)$  e  $\varphi : \mathbb{R} \times M \rightarrow M$  e  $X_t, t \in \mathbb{R}$  o fluxo associado a  $X$ . A órbita de  $X$  por  $p \in M$  é o conjunto  $\mathcal{O}(p) = \{X_t(p) : t \in \mathbb{R}\}$ . Se  $X(p) = 0$ , a órbita de  $p$  se reduz a  $p$ . Nesse caso, dizemos que  $p$  é uma singularidade de  $X$ . Caso contrário, a aplicação  $\alpha : \mathbb{R} \rightarrow M$ ,  $\alpha(t) = X_t(p)$  é uma imersão. Se  $\alpha$  não é biunívoca, existe um  $w > 0$  tal que  $\alpha(w) = \alpha(0) = p$  e  $\alpha(t) \neq p$  para  $0 < t < w$ . Nesse caso, a órbita de  $p$  é difeomorfa ao círculo  $S^1$  e dizemos que a órbita é fechada de período  $w$ . Caso a órbita não seja singular ou fechada, ela é dita regular. Assim, uma órbita regular é a imagem de uma imersão biunívoca da reta.

O conjunto  $w$ -limite de um ponto  $p \in M$  é  $w(p) = \{q \in M : \text{existe } t_n \rightarrow +\infty \text{ se } n \rightarrow +\infty \text{ com } \lim X_{t_n}(p) = q\}$ . Analogamente, definimos o conjunto  $\alpha$ -limite de  $p$  como  $\alpha(p) = \{q \in M : \text{existe } t_n \rightarrow -\infty \text{ se } n \rightarrow +\infty \text{ com } \lim X_{t_n}(p) = q\}$ . Observamos que o  $\alpha$ -limite de  $p$  é o  $w$ -limite de  $p$  para o campo  $-X$ . Também,  $w(p) = w(\tilde{p})$  se  $\tilde{p}$  pertence à órbita de  $p$ . De fato,  $\tilde{p} = X_{t_0}(p)$  e, portanto, se  $X_{t_n}(p) \rightarrow q$  com  $t_n \rightarrow \infty$ , então,  $X_{t_n - t_0}(\tilde{p}) \rightarrow q$  e  $t_n - t_0 \rightarrow \infty$ . Definimos, então, o  $w$ -limite da órbita de  $p$  como  $w(p)$ .

**Exemplo 1.35.** *Consideremos a esfera unitária  $S^2 \subset \mathbb{R}^3$  com centro na origem e sejam  $(x, y, z)$  as coordenadas canônicas de  $\mathbb{R}^3$ . Chamamos  $p_N = (0, 0, 1)$  de polo norte e  $p_S = (0, 0, -1)$  de polo sul de  $S^2$ .*

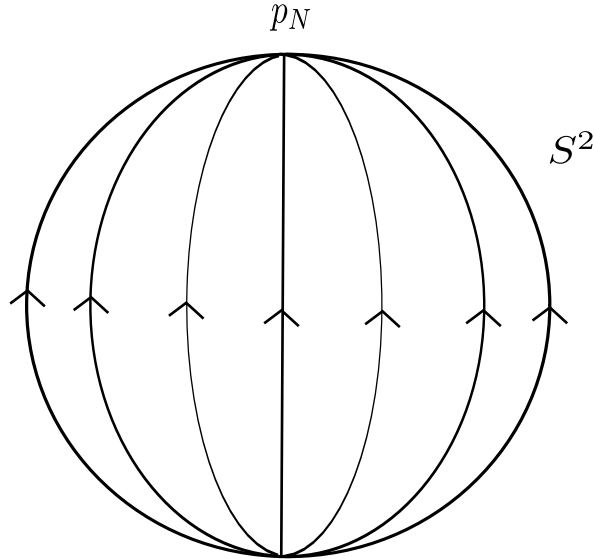


Figura 1.5: Exemplo de um campo de vetores na esfera.

Definimos o campo  $X$  em  $S^2$  por  $X(x, y, z) = (-xz, -yz, x^2 + y^2)$ . É claro que  $X$  é de classe  $C^\infty$  e é fácil verificar que as singularidades de  $X$  são  $p_N, p_S$ . Como  $X$  é tangente aos meridianos de  $S^2$  apontando para cima,  $w(p) = p_N$  e  $\alpha(p) = p_S$ , se  $p \in S^2 - \{p_N, p_S\}$

**Exemplo 1.36.** *Fluxos racionais e irracionais no toro. Seja  $\varphi : \mathbb{R}^2 \rightarrow T^2 \subset \mathbb{R}^3$ ,*

$$\varphi(u, v) = ((2 + \cos 2\pi v)\cos 2\pi u, (2 + \cos 2\pi v)\sin 2\pi u, \sin 2\pi v)$$

*Temos que  $\varphi$  é um difeomorfismo local que leva retas horizontais de  $\mathbb{R}^2$  em paralelos de  $T^2$ , retas verticais em meridianos e o quadrado  $[0, 1] \times [0, 1]$  sobre  $T^2$ . Além disso,  $\varphi(u, v) = \varphi(\tilde{u}, \tilde{v})$  se, e somente se,  $u - \tilde{u} = m$  e  $v - \tilde{v} = n$ , onde  $m, n$  são inteiros.*

*Para cada  $\alpha \in \mathbb{R}$ , consideremos em  $\mathbb{R}^2$  o campo de vetores  $X^\alpha(u, v) = (1, \alpha)$ . É fácil ver que  $Y^\alpha = \varphi_* X^\alpha$  está bem definido e é um campo  $C^\infty$  em  $T^2$ . As órbitas de  $Y^\alpha$  são as imagens por  $\varphi$  das órbitas de  $X^\alpha$ , sendo estas as retas de inclinação  $\alpha$  em  $\mathbb{R}^2$ . Vamos mostrar que, para  $\alpha$  racional, toda órbita de  $Y^\alpha$  é fechada e, para  $\alpha$  irracional, toda órbita  $Y^\alpha$  é densa em  $T^2$ . Para cada  $c \in \mathbb{R}$ , denotamos por  $l_c$  a reta de  $\mathbb{R}^2$  que passa por  $(0, c)$  e tem inclinação  $\alpha$ ;  $l_c = \{(u, c + \alpha u) : u \in \mathbb{R}\}$ . Como já observamos,  $\varphi(l_c)$  é uma órbita de  $Y^\alpha$ . Se  $\alpha$  é racional, essa órbita é fechada qualquer que seja  $c \in \mathbb{R}$ . De fato, se  $\alpha = n/m$ , então,  $[m, c + (n/m)m] \in l_c$  e  $\varphi(m, c + n) = \varphi(0, c)$ . Suponhamos agora,  $\alpha$  irracional e fixemos  $\bar{c} \in \mathbb{R}$ . Afirmamos que  $C = \{c \in \mathbb{R} : \varphi(l_c) = \varphi(l_{\bar{c}})\}$  é denso em  $\mathbb{R}$ . Segue-se que  $\cup_{c \in C} l_c$  é denso em  $\mathbb{R}^2$  e, portanto,  $\varphi(\cup_{c \in C} l_c)$  é denso em  $T^2$ . Para provar que  $C$  é denso em  $\mathbb{R}$ , basta mostrar que  $G = \{m\alpha + n : m, n \in \mathbb{Z}\}$  é denso em  $\mathbb{R}$ , pois,  $c \in C$  se, e somente se,  $c - \bar{c} \in G$ . Como  $G$  é um subgrupo de  $\mathbb{R}, +$ , temos que  $G$  ou é denso ou é discreto. Resta assim, mostrar que  $G$  não é discreto. De fato, para cada  $m \in \mathbb{Z}$ , existe  $n \in \mathbb{Z}$  tal que  $u_m = m\alpha + n$  pertence ao intervalo  $[0, 1]$ . A sequência  $u_m$  tem um ponto de acumulação e, como  $\alpha$  é irracional, seus elementos são distintos. Logo  $G$  é denso.*

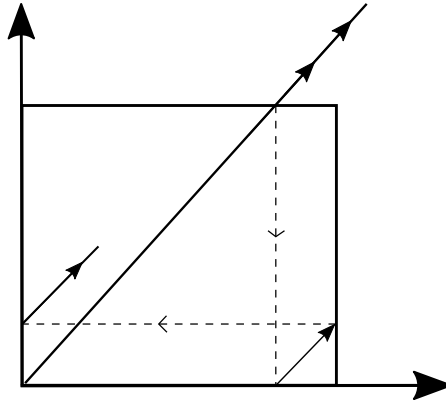


Figura 1.6: Campo irracional no Toró.

O campo  $Y^\alpha$ , como abordado acima, é chamado de campo racional ou irracional em  $T^2$  conforme  $\alpha$  seja racional ou não. Se  $\alpha$  é racional, o  $w$ -limite de qualquer órbita é ela própria. Se  $\alpha$  é irracional, o  $w$ -limite de qualquer órbita é todo o toro  $T^2$ .

A seguir, apresentamos algumas propriedades gerais dos conjuntos  $w$ -limites e podem ser encontradas em [17].

**Proposição 1.37.** *Sejam  $X \in \mathcal{X}^r(M)$ ,  $M$  uma variedade compacta e  $p \in M$ , temos:*

- a)  $w(p) \neq \emptyset$ .
- b)  $w(p)$  é fechado.
- c)  $w(p)$  é invariante pelo fluxo de  $X$ , isto é,  $w(p)$  é uma união de órbitas de  $X$ .
- d)  $w(p)$  é conexo.

**Observação 1.38.** *As propriedades acima também são válidas para o conjunto  $\alpha$ -limite. Por outro lado, se a variedade não é compacta, devemos nos restringir a uma órbita que positivamente (ou negativamente) permaneça em um subconjunto compacto da variedade e ainda obtemos estas propriedades.*

Lembremos que uma curva simples fechada em uma variedade  $M$  é imagem homeomorfa da circunferência  $S^1$  em  $M$  ou, dito de outra forma, a imagem de  $S^1$  por uma injeção contínua  $S^1 \rightarrow M$ .

O seguinte teorema é conhecido na topologia e uma prova dele pode ser encontrada em [7]

**Teorema 1.39. (Curva de Jordan)** *Uma curva simples fechada  $C$  na esfera  $S^2$  separa a esfera em duas componentes conexas, cada uma homeomorfa a um disco, isto é,  $S^2 \setminus C = D_1 \cup D_2$  com  $D_1$  e  $D_2$  homeomorfos a um disco.*

Seja  $U$  um subconjunto aberto de  $\mathbb{R}^2$  e  $X$  um campo vetorial de classe  $C^r$ ,  $r \geq 1$ , em  $U$ . Pode-se definir a semi-órbita positiva por  $p$ , como  $\gamma_p^+ = \{\varphi(t, p), t \geq 0\}$  e a semi-órbita negativa por  $p$  como  $\gamma_p^- = \{\varphi(t, p), t \leq 0\}$ .

**Teorema 1.40. (Poincaré-Bendixson)** *Seja  $\varphi(t) = \varphi(t, p)$  uma curva integral de  $X$ , definida para todo  $t \geq 0$ , tal que  $\gamma_p^+$  esteja contida em um compacto  $K \subset U \subset \mathbb{R}^2$ ,  $U$  aberto. Suponha que o campo  $X$  possua um número finito de singularidades em  $w(p)$ . Então, tem-se as seguintes alternativas:*

- (a) *Se  $w(p)$  contém somente pontos regulares, então  $w(p)$  é uma órbita periódica.*
- (b) *Se  $w(p)$  contém pontos regulares e singulares, então  $w(p)$  consiste de um conjunto de órbitas, cada uma das quais tende a um desses pontos singulares quando  $t \rightarrow \pm\infty$ .*
- (c) *Se  $w(p)$  não contém pontos regulares, então  $w(p)$  é um ponto singular.*

A prova deste teorema pode ser encontrada em [17].

Como já vimos, o  $w$ -limite de uma órbita do fluxo irracional no toro  $T^2$  é todo o toro. Existem exemplos mais complexos de campos em  $T^2$  com um conjunto  $w$ -limite de estrutura bastante complicada. Entretanto, para a esfera  $S^2$  a situação é bem mais simples devido ao Teorema da Curva de Jordan. A estrutura de um conjunto  $w$ -limite de campos em  $S^2$  é descrita pelo Teorema de Poincaré-Bendixson que mostraremos a seguir.

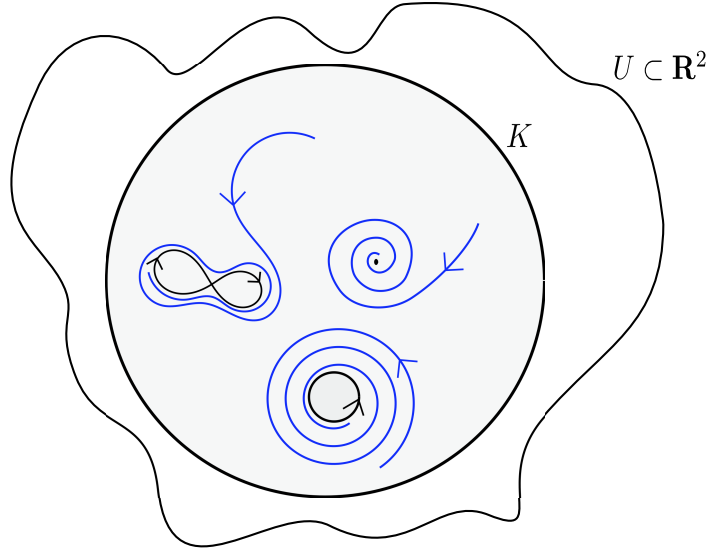


Figura 1.7: Teorema de Poincaré-Bendixson.

**Corolário 1.41. (Poincaré-Bendixson na esfera)** Seja  $X \in \mathcal{X}^r(S^2)$ ,  $r \geq 2$  um campo com um número finito de singularidades. Sejam  $p \in S^2$  e  $w(p)$  o conjunto  $w$ -limite de  $p$ . Então ocorre uma das seguintes alternativas:

- 1)  $w(p)$  é uma singularidade,
- 2)  $w(p)$  é uma órbita fechada,
- 3)  $w(p)$  é constituído por singularidades  $p_1, \dots, p_n$  e órbitas regulares, tais que, se  $\gamma \subset w(p)$ , então,  $\alpha(\gamma) = p_i$  e  $w(\gamma) = p_j$ .

*Demonstração.* Seja  $\psi : S^2 \setminus \{p_N\} \rightarrow \mathbb{R}^2$  o difeomorfismo dado pela projeção estereográfica da esfera furada (no polo norte)  $S^2 \setminus \{p_N\}$  no plano  $\mathbb{R}^2$ , e, seja  $X$  um campo vetorial de classe  $C^r$ ,  $r \geq 1$ , consideremos a curva integral  $\gamma : I \rightarrow S^2$ , tal que, para algum  $t_0$ ,  $\gamma(t_0) = p \in S^2$ .

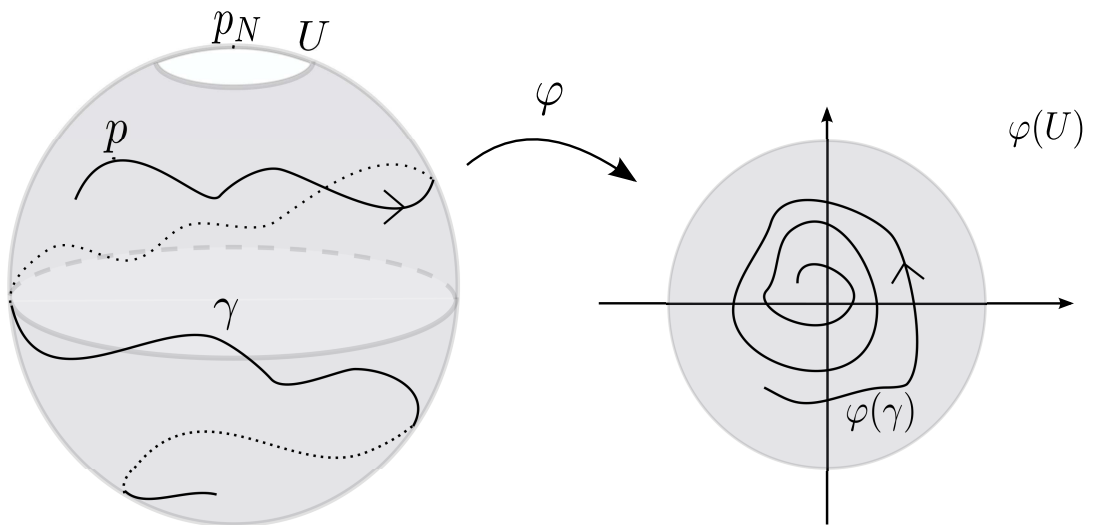


Figura 1.8: Corolário de Poincaré-Bendixson na esfera.

*Caso 1:* Se  $p_N \notin \overline{\gamma\{t\}}$ , então, seja  $U$  um aberto em  $S^2$  tal que  $p_N \in U$  e  $\gamma(t) \cap U = \emptyset$ , logo  $\psi(U)$  é aberto, assim,  $M \setminus \psi(U) = V$  é fechado e compacto. Além disso  $\psi(\gamma) \subset V$ . Considerando  $Y = \psi(X)$  o campo em  $\mathbb{R}^2$  associado a  $\psi$  o qual tem um número finito de singularidades, então, para um  $\tilde{p} = \psi(p) \in \mathbb{R}^2$  temos que  $w(\tilde{p}) = \lim_{t_n \rightarrow \infty} Y_{t_n}(\tilde{p})$  satisfaz as condições do Teorema 1.40, portanto,

$$\begin{aligned} w(p) &= \psi^{-1}(w(\tilde{p})) = \psi^{-1}\left(\lim_{t_n \rightarrow \infty} Y_{t_n}(\tilde{p})\right) = \lim_{t_n \rightarrow \infty} \psi^{-1}(Y_{t_n}(\tilde{p})) \\ &= \lim_{t_n \rightarrow \infty} \psi^{-1}(\psi(X)(\psi(p))) = \lim_{t_n \rightarrow \infty} X_{t_n}(p) \end{aligned}$$

satisfaz as condições na esfera  $S^2 \setminus \{p_N\}$ .

*Caso 2:* Se  $p_N \in \overline{\gamma\{t\}}$ , então, existe um  $p \in S^2$  tal que  $p \notin \overline{\gamma(t)}$ , pela página 3 de [?] não existe uma única trajetória densa cobrindo toda a esfera, isto é,  $\gamma(t) \neq S^2$ , logo, existe um aberto  $U \subset S^2 \setminus \overline{\gamma(t)}$  com  $p \in U$  e  $U \cap \overline{\gamma(t)} = \emptyset$ . Assim, por um raciocínio análogo ao caso 1, para o ponto  $p$  concluímos nossa prova.

■

**Observação 1.42.** Se  $r = 1$ , o gráfico pode ser formado pela união finita de singularidades e até infinitas órbitas regulares como veremos no Exemplo 1.44.

Nos exemplos dados a seguir, ilustramos alguns fatos sobre este Teorema.

**Exemplo 1.43.** Seja  $X$  um campo em  $S^2$ . Os polos norte e sul são singularidades e o equador uma órbita fechada. As outras órbitas nascem nos polos e morrem no equador (como na Figura 1.9). Seja  $\varphi : S^2 \rightarrow \mathbb{R}$  uma função  $C^\infty$  que se anula exatamente no equador da esfera. Consideremos o campo  $Y = \varphi \cdot X$ . Todo ponto do equador é uma singularidade de  $Y$  e o conjunto  $w$ -limite de um ponto  $p$  que não esteja nos polos nem no equador é todo o equador. Este exemplo mostra que o Teorema de Poincaré-Bendixson não é válido sem a hipótese de um número finito de singularidades.

**Exemplo 1.44.** Seja  $X$  um campo em  $S^2$ . O campo  $X$  possui duas singularidades  $p_S$  e  $p_N$ , e uma órbita fechada  $\gamma$ . As órbitas do hemisfério norte da esfera têm como  $\alpha$ -limite a  $p_N$  e como  $w$ -limite a  $\gamma$ . No hemisfério sul, temos a singularidade  $p_S$  que é o centro de uma rosa com uma infinidade de pétalas limitadas por órbitas que nascem em  $p_S$  e morrem em  $p_S$ . As demais órbitas do hemisfério sul têm  $\gamma$  como  $\alpha$ -limite e a fronteira da rosa como  $w$ -limite. Portanto, o  $w$ -limite de uma órbita pode conter uma infinidade de órbitas regulares.

Outro fato conhecido sobre campos de vetores definido em  $S^2$  é o seguinte resultado que pode ser encontrado em [12].

**Teorema 1.45. (Poincaré)** Todo campo contínuo de vetores tangentes à esfera  $S^2$  admite uma singularidade.

A prova deste teorema pode se encontrar em [12], cap. 3, página 62.

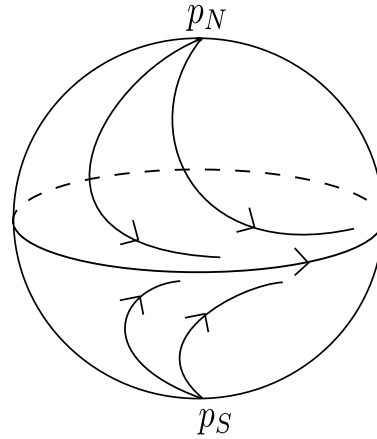


Figura 1.9: Exemplo de infinitas singularidades no Corolário de Poincaré-Bendixson.

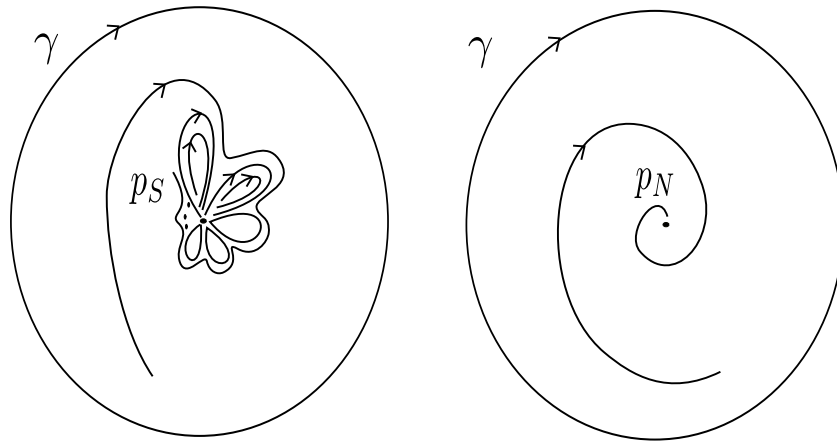


Figura 1.10: Campo com infinitas pétalas em  $S^2$ .

### 1.3.1 Colchete de Lie

Seja  $M$  uma  $n$ -variedade. Lembre-se que se  $X$  e  $Y$  são campos de vetores suaves em  $M$ , então,  $X$  e  $Y$  são operadores diferenciais de primeira ordem em funções suaves  $M \rightarrow \mathbb{R}$ . Assim, para uma função suave  $f : M \rightarrow \mathbb{R}$ ,  $X \circ f$  e  $Y \circ f$  são novamente funções suaves  $M \rightarrow \mathbb{R}$ .

**Definição 1.46.** Agora definimos um operador diferencial  $[X, Y]$ , chamado colchete de Lie ou o comutador de  $X$  e  $Y$  como:

$$[X, Y] := XY - YX.$$

Isto é, para uma função suave  $f : M \rightarrow \mathbb{R}$ ,

$$[X, Y](f) := X(Y \circ f) - Y(X \circ f).$$

Pela sua definição,  $[X, Y]$  é um operador diferencial de segunda ordem. No entanto, verifica-se que  $[X, Y]$  é na verdade um operador diferencial de primeira ordem e, de fato, um campo vetorial:



**Teorema 1.47.** *Para qualquer campo de vetores suaves  $X$  e  $Y$  em uma  $n$ -variedade  $M$ , o colchete de Lie  $[X, Y]$  é novamente um campo de vetores suaves em  $M$ .*

Não daremos uma prova detalhada do teorema anterior mas, em vez disso, apenas verifica-se que o teorema é válido para os campos de vetores básicos.

Seja  $\phi = (x_1, \dots, x_n) : U \rightarrow \mathbb{R}^n$  um caminho de coordenadas em  $M$ . Seja  $X = a(x_1, \dots, x_n) \frac{\partial}{\partial x_i}$  e  $Y = b(x_1, \dots, x_n) \frac{\partial}{\partial x_j}$  para algum  $1 \leq i, j \leq n$  e para alguma função suave  $a = a(x_1, \dots, x_n)$  e  $b = b(x_1, \dots, x_n)$ .

Seja  $f : M \rightarrow \mathbb{R}$  uma função suave. Agora calculamos  $[X, Y](f)$ . Por definição:

$$[X, Y](f) = [a \frac{\partial}{\partial x_i}, b \frac{\partial}{\partial x_j}]f = a \frac{\partial}{\partial x_i} (b \frac{\partial f}{\partial x_j}) - b \frac{\partial}{\partial x_j} (a \frac{\partial f}{\partial x_i}) =$$

usando a regra do produto

$$\begin{aligned} & a \frac{\partial b}{\partial x_i} \frac{\partial f}{\partial x_j} + ab \frac{\partial^2 f}{\partial x_i \partial x_j} - b \frac{\partial a}{\partial x_j} \frac{\partial f}{\partial x_i} - ba \frac{\partial^2 f}{\partial x_j \partial x_i} = \\ & a \frac{\partial b}{\partial x_i} \frac{\partial f}{\partial x_j} - b \frac{\partial a}{\partial x_j} \frac{\partial f}{\partial x_i} = (a \frac{\partial b}{\partial x_i} \frac{\partial}{\partial x_j} - b \frac{\partial a}{\partial x_j} \frac{\partial}{\partial x_i})f \end{aligned}$$

Assim sendo,

$$[X, Y] = [a \frac{\partial}{\partial x_i}, b \frac{\partial}{\partial x_j}] = a \frac{\partial b}{\partial x_i} \frac{\partial}{\partial x_j} - b \frac{\partial a}{\partial x_j} \frac{\partial}{\partial x_i}. \quad (1.1)$$

Note que, se  $a = b = 1$ , então,  $\frac{\partial b}{\partial x_i} = \frac{\partial a}{\partial x_j} = 0$ . Assim sendo,

$$[\frac{\partial}{\partial x_i}, \frac{\partial}{\partial x_j}] = 0.$$

Vejamos agora algumas propriedades gerais do colchete de Lie:

- (1)  $[X, Y] = -[Y, X]$ .
- (2)  $[X_1 + X_2, Y] = [X_1, Y] + [X_2, Y]$  e  $[X, Y_1 + Y_2] = [X, Y_1] + [X, Y_2]$ .
- (3) para quaisquer funções suaves  $a, b : M \rightarrow \mathbb{R}$

$$[aX, bY] = ab[X, Y] + a(Xb)Y - b(Ya)X.$$

- (4) (identidade de Jacobi)

$$[[X, Y], Z] + [[Y, Z], X] + [[Z, X], Y] = 0.$$

Note que, com a propriedade (2) acima e a fórmula (1.1), não é difícil calcular  $[\sum_{i=1}^n a_i(x) \frac{\partial}{\partial x_i}, \sum_{j=1}^n b_j(x) \frac{\partial}{\partial x_j}]$  em um gráfico de coordenadas  $\phi = (x_1, \dots, x_n) : U \rightarrow \mathbb{R}^n$  em  $M$ :

$$\begin{aligned} [\sum_{i=1}^n a_i(x) \frac{\partial}{\partial x_i}, \sum_{j=1}^n b_j(x) \frac{\partial}{\partial x_j}] &= \sum_i \sum_j [a_i(x) \frac{\partial}{\partial x_i}, b_j(x) \frac{\partial}{\partial x_j}] \\ &= \sum_i \sum_j a_i \frac{\partial b_j}{\partial x_i} \frac{\partial}{\partial x_j} - b_j \frac{\partial a_i}{\partial x_j} \frac{\partial}{\partial x_i} \end{aligned} \quad (1.2)$$

Porém, como uma questão prática, é melhor lembrar a fórmula (1.1) juntamente com as propriedades (1), (2), (3) e (4) acima, em vez de tentar memorizar a fórmula (1.2).

**Exemplo 1.48.** Seja  $M = \mathbb{R}^3$  com coordenadas  $(x, y, z)$  e seja  $X = 2xz \frac{\partial}{\partial x} + e^{yz} \frac{\partial}{\partial y}$  e  $Y = (x^2 + y^2 + z^2) \frac{\partial}{\partial x} + 5 \frac{\partial}{\partial z}$ .

Queremos calcular  $[X, Y]$ . Sabemos, pela propriedade (2):

$$\begin{aligned} [X, Y] &= [2xz \frac{\partial}{\partial x}, (x^2 + y^2 + z^2) \frac{\partial}{\partial x}] + [2xz \frac{\partial}{\partial x}, 5 \frac{\partial}{\partial z}] + \\ &\quad + [e^{yz} \frac{\partial}{\partial y}, (x^2 + y^2 + z^2) \frac{\partial}{\partial x}] + [e^{yz} \frac{\partial}{\partial y}, 5 \frac{\partial}{\partial z}]. \end{aligned}$$

Usando (1.2), obtemos:

$$\begin{aligned} [2xz \frac{\partial}{\partial x}, (x^2 + y^2 + z^2) \frac{\partial}{\partial x}] &= 2xz \frac{\partial}{\partial x} (x^2 + y^2 + z^2) \frac{\partial}{\partial x} - (x^2 + y^2 + z^2) 2z \frac{\partial}{\partial x} \\ &= (2x^2z - 2y^2z - 2z^3) \frac{\partial}{\partial x}, \end{aligned}$$

e

$$[2xz \frac{\partial}{\partial x}, 5 \frac{\partial}{\partial z}] = 0 - 10x \frac{\partial}{\partial x} = -10x \frac{\partial}{\partial x},$$

e

$$[e^{yz} \frac{\partial}{\partial y}, (x^2 + y^2 + z^2) \frac{\partial}{\partial x}] = e^{yz} 2y \frac{\partial}{\partial x} - (x^2 + y^2 + z^2) \cdot 0 \frac{\partial}{\partial y} = e^{yz} 2y \frac{\partial}{\partial x},$$

e

$$[e^{yz} \frac{\partial}{\partial y}, 5 \frac{\partial}{\partial z}] = e^{yz} \cdot 0 \frac{\partial}{\partial z} - 5ye^{yz} \frac{\partial}{\partial y} = -5ye^{yz} \frac{\partial}{\partial y}.$$

Assim,

$$[X, Y] = (2x^2z - 2y^2z - 2z^3 - 10x + 2ye^{yz}) \frac{\partial}{\partial x} - 5ye^{yz} \frac{\partial}{\partial y}.$$

**Teorema 1.49.** Sejam  $X^1, \dots, X^k$   $k$  campos de vetores de classe  $C^r$  ( $r \geq 1$ ) definidos em  $M$ . Suponhamos que para todo  $i \in \{1, \dots, k\}$ , o fluxo  $X_t^i$  está definido em  $\mathbb{R} \times M$ . As seguintes afirmações são equivalente:

- a) Os campos  $X^1, \dots, X^k$  são gerados de uma ação de classe  $C^r$ ,  $\varphi : \mathbb{R}^k \times M \rightarrow M$ .
- b) Para quaisquer  $i, j \in \{1, \dots, k\}$  e  $s, t \in \mathbb{R}$ , temos  $X_t^i \circ X_s^j = X_s^j \circ X_t^i$ .
- c) Para quaisquer  $i, j \in \{1, \dots, k\}$ , temos  $[X^i, X^j] = 0$ .

A prova deste resultado pode ser consultada em [4]

### 1.3.2 Teorema do fluxo tubular

Como referência para os resultados não demonstrados aqui, recomendamos ao leitor consultar [16].

**Definição 1.50.** Sejam  $X, Y \in \mathcal{X}^r(M)$  e  $p, q \in M$ . Dizemos que  $X$  e  $Y$  são topologicamente equivalentes em  $p$  e  $q$  respectivamente, se existem vizinhanças  $V_p$  e  $W_q$  e um homeomorfismo  $h : V_p \rightarrow W_q$  que leva órbitas de  $X$  em órbitas  $Y$ , preservando a orientação das órbitas e  $h(p) = q$ .

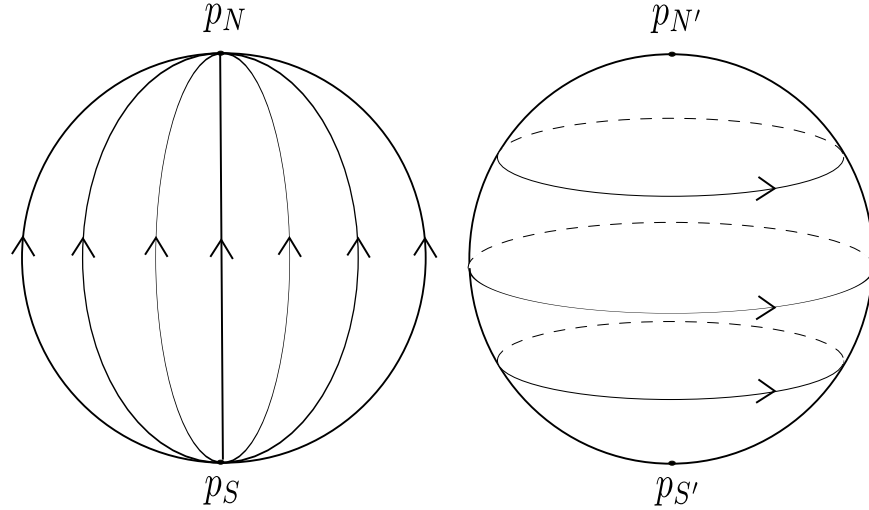


Figura 1.11: Campos não equivalentes.

**Exemplo 1.51.** Consideremos os campos  $X$  e  $Y$  em  $S^2$  (dados na Figura 1.11),  $X$  e  $Y$  não são equivalentes em  $p_N$  e  $p_{N'}$ , pois, qualquer vizinhança de  $p_{N'}$  contém órbitas fechadas de  $Y$ , o que não ocorre em vizinhanças de  $p_N$ .

**Definição 1.52.** Sejam  $X \in \mathcal{X}^r(M)$  e  $p \in M$ . Dizemos que  $X$  é localmente estável em  $p$  se existem vizinhanças  $\mathcal{N}_X$  de  $X$  em  $\mathcal{X}^r(M)$  e  $U(p) \subset M$ , tais que, para cada  $Y \in \mathcal{N}_X$ ,  $X$  em  $p$  é topologicamente equivalente a  $Y$  em  $q$ , para algum  $q \in U$ .

O teorema abaixo descreve o comportamento local das órbitas na vizinhança de um ponto regular.

**Teorema 1.53. (Fluxo Tubular)** *Seja  $X \in \mathcal{X}^r(M)$  e  $p \in M$  um ponto regular de  $X$ . Sejam  $C = \{(x_1, \dots, x_m) \in \mathbb{R}^m; |x_i| < 1\}$  e  $X_C$  um campo em  $C$  definido por  $X_C(x) = (1, 0, \dots, 0)$ . Então, existe um difeomorfismo de classe  $C^r$ ,  $h : V_p \rightarrow C$ , onde  $V_p$  é uma vizinhança de  $p$  em  $M$ , levando trajetórias de  $X$  em trajetórias de  $X_C$  (ver Figura 1.12).*

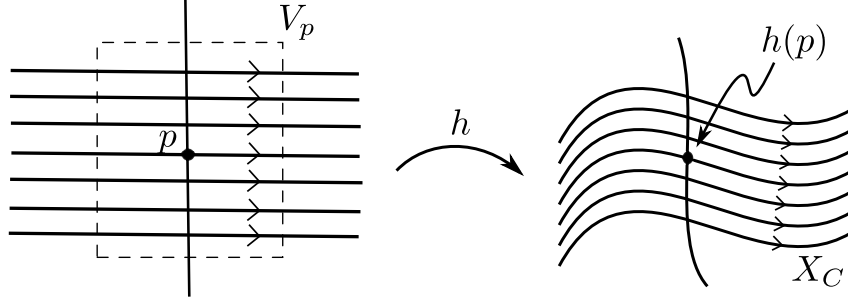


Figura 1.12: Fluxo tubular.

**Observação 1.54.** *O difeomorfismo  $\tilde{h}^{-1} : C_\varepsilon \rightarrow M$  definido por  $\tilde{h}^{-1} = x^{-1} \circ \tilde{\psi}$  leva órbitas do campo unitário paralelo  $X_{C_\varepsilon}$  em órbitas do campo  $X$  preservando o parâmetro  $t$ .*

**Corolário 1.55.** *Se  $X, Y \in \mathcal{X}^r(M)$  e  $p, q \in M$  são pontos regulares de  $X$  e  $Y$  respectivamente, então  $X$  é equivalente a  $Y$  em  $p$  e  $q$ .*

**Corolário 1.56.** *Se  $X \in \mathcal{X}^r(M)$  e  $p \in M$  é um ponto regular de  $X$ , então  $X$  é localmente estável em  $p$ .*

Como consequência do Teorema 1.53, temos o seguinte resultado importante para nosso trabalho.

**Teorema 1.57. (Fluxo Tubular Longo)** *Suponha que  $\varphi_t(p) \neq \varphi_s(p)$  para  $t \neq s$ , com  $t, s \in [a, b]$ . Então pode-se tomar um aberto  $W_l \subset V$  suficientemente pequeno tal que  $\tau : (a, b) \times W_l \rightarrow E$  é um difeomorfismo sobre sua imagem.*

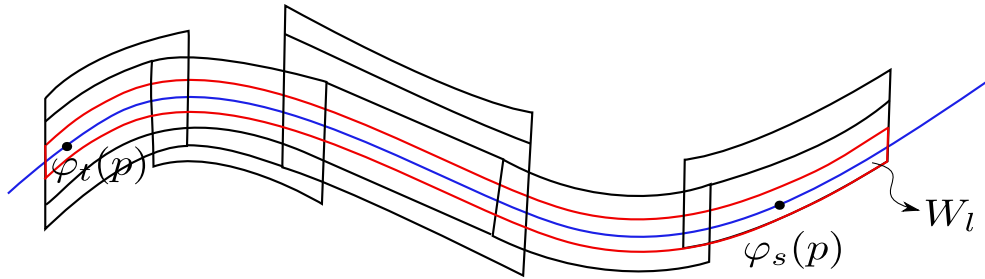


Figura 1.13: Fluxo tubular longo.

## Capítulo 2

# Folheações e Ações de Grupos

Apresentamos neste capítulo a noção de uma folheação e de outras propriedades que serão utilizadas no resto da dissertação. Também apresentamos vários exemplos ilustrando os conceitos. Os resultados inseridos nesta seção podem ser encontrados em [4], [10], [9] e [2].

### 2.1 Folheação

Uma folheação de dimensão  $n$  de uma variedade diferenciável  $M^m$  é, a grosso modo, uma decomposição de  $M$  em subvariedades conexas de dimensão  $n$  chamadas folhas, as quais se aglomeram localmente como os subconjuntos de  $\mathbb{R}^m = \mathbb{R}^n \times \mathbb{R}^{m-n}$  com a segunda coordenada constante.

O exemplo mais elementar de folheação de dimensão  $n$  é a folheação de  $\mathbb{R}^m = \mathbb{R}^n \times \mathbb{R}^{m-n}$  onde as folhas são  $n$ -planos da forma  $\mathbb{R}^n \times \{c\}$  com  $c \in \mathbb{R}^{m-n}$ .

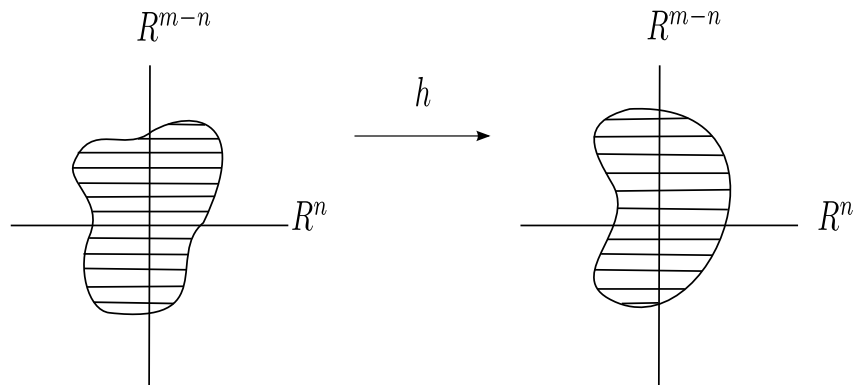


Figura 2.1: Comportamento local de uma folheação.

Os difeomorfismos locais  $h : U \subset \mathbb{R}^m \rightarrow V \subset \mathbb{R}^m$  que preservam as folhas desta folheação são aqueles que, para cada  $c \in \mathbb{R}^{m-n}$  com  $U \cap (\mathbb{R}^n \times \{c\}) \neq \emptyset$ , satisfazem  $h(U \cap (\mathbb{R}^n \times \{c\})) = V \cap (\mathbb{R}^n \times \{c'\})$ ,  $c' \in \mathbb{R}^{m-n}$ . Estes difeomorfismos

têm a seguinte expressão:

$$h(x, y) = (h_1(x, y), h_2(y)), \quad (x, y) \in \mathbb{R}^n \times \mathbb{R}^{m-n} \quad (2.1)$$

Formalmente, temos a seguinte definição.

**Definição 2.1.** *Seja  $M$  uma variedade  $C^\infty$  de dimensão  $m$ . Uma  $C^r$  folheação de dimensão  $n$  de  $M$  é um atlas máximo  $\mathcal{F}$  de classe  $C^r$  em  $M$ , com as seguintes propriedades:*

- (a) *Se  $(U, \varphi) \in \mathcal{F}$ , então,  $\varphi(U) = U_1 \times U_2 \subset \mathbb{R}^n \times \mathbb{R}^{m-n}$  onde  $U_1$  e  $U_2$  são discos abertos em  $\mathbb{R}^n$  e  $\mathbb{R}^{m-n}$  respectivamente.*
- (b) *Se  $(U, \varphi)$  e  $(V, \psi) \in \mathcal{F}$  são tais que  $U \cap V \neq \emptyset$ , então, a aplicação de mudança de coordenadas  $\psi \circ \varphi^{-1} : \varphi(U \cap V) \rightarrow \psi(U \cap V)$  é da forma (2.1), isto é,  $\psi \circ \varphi^{-1}(x, y) = (h_1(x, y), h_2(y))$ . Dizemos também, que  $M$  é folheada por  $\mathcal{F}$ , ou ainda que  $\mathcal{F}$  é uma estrutura folheada de dimensão  $n$  e classe  $C^r$  em  $M$ .*

Na Figura 2.2, ilustramos o aspecto local de uma variedade 2-dimensional folheada por uma folheação 1-dimensional.

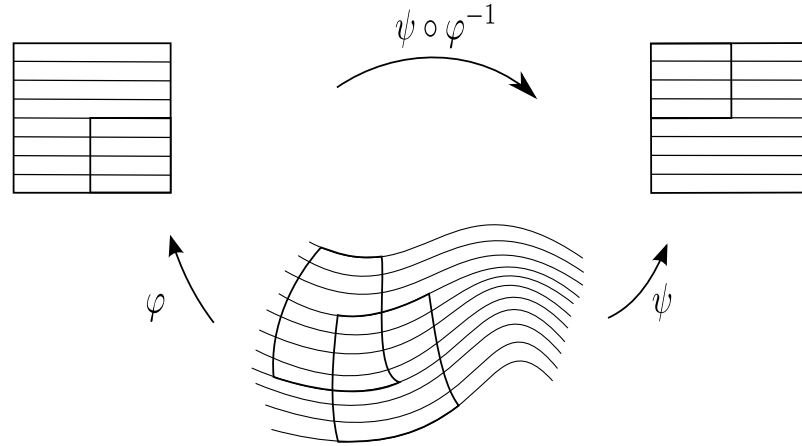


Figura 2.2: Folheação.

**Observação 2.2.** *Quando dizemos que  $M$  é uma variedade  $C^\infty$  que possui um atlas  $\mathcal{F}$  como acima, estamos implicitamente dizendo que  $M$  possui um atlas  $\mathcal{A}$  cujas mudanças de coordenadas são  $C^\infty$ , porém, se  $(U, \varphi) \in \mathcal{A}$  e  $(V, \psi) \in \mathcal{F}$  e  $U \cap V \neq \emptyset$ , então,  $\varphi \circ \psi^{-1}$  e  $\psi \circ \varphi^{-1}$  são  $C^r$ . A única relação entre os atlas  $\mathcal{F}$  e  $\mathcal{A}$  é que as mudanças de variáveis mistas, como acima, são  $C^r$ . Como é claro da definição, o atlas  $\mathcal{F}$  é muito especial (devido à condição (2.1)).*

Observemos também que, se  $A = \{(U_i, \varphi_i) | i \in I\}$  é um atlas, não máximo, cujas cartas locais satisfazem (a) e (b), então, existe um único atlas máximo que contém  $A$  e satisfaz (a) e (b). Este atlas é definido como o conjunto de todas as cartas,  $\varphi : U \rightarrow \mathbb{R}^n$ , tais que, se  $U \cap U_i \neq \emptyset$  para algum  $i \in I$ , então,  $h = \varphi \circ \varphi_i^{-1} : \varphi_i(U \cap U_i) \rightarrow \varphi(U \cap U_i)$ , é um difeomorfismo  $C^r$  da forma

(2.1). Embora a condição do atlas ser máximo seja dispensável na definição, ela é conveniente porque, neste caso, o conjunto de todos os domínios de cartas locais formam uma base para a topologia de  $M$ .

De agora em diante, consideremos apenas folheações de classe  $C^r$ ,  $r \geq 1$ . As cartas  $(U, \varphi) \in \mathcal{F}$  serão chamadas também cartas trivializadoras de  $\mathcal{F}$ .

Seja  $\mathcal{F}$  uma folheação de classe  $C^r$  e dimensão  $n$ ,  $0 < n < m$ , de uma variedade  $M^m$ . Consideremos uma carta local  $(U, \varphi)$  de  $\mathcal{F}$  tal que  $\varphi(U) = U_1 \times U_2 \subset \mathbb{R}^n \times \mathbb{R}^{m-n}$ . Os conjuntos da forma  $\varphi^{-1}(U_1 \times \{c\})$ ,  $c \in U_2$  são chamadas placas de  $U$ , ou ainda placas de  $\mathcal{F}$ . Fixando  $c \in U_2$ , a aplicação  $f = \varphi^{-1}|_{U_1 \times \{c\}} : U_1 \times \{c\} \rightarrow U$  é um mergulho de classe  $C^r$ , portanto, as placas são subvariedades conexas de dimensão  $n$  e classe  $C^r$  de  $M$ . Além disto, se  $\alpha$  e  $\beta$  são placas de  $U$ , então  $\alpha \cap \beta = \emptyset$  ou  $\alpha = \beta$ .

Um caminho de placas de  $\mathcal{F}$  é uma sequência  $\alpha_1, \dots, \alpha_k$  de placas de  $\mathcal{F}$  tal que  $\alpha_j \cap \alpha_{j+1} \neq \emptyset$  para todo  $j \in \{1, \dots, k-1\}$ . Como  $M$  é recoberta pelas placas de  $\mathcal{F}$ , podemos definir em  $M$  a seguinte relação de equivalência: “ $pRq$  se existe um caminho de placas  $\alpha_1, \dots, \alpha_k$  com  $p \in \alpha_1$  e  $q \in \alpha_k$ ”. As classes de equivalência da relação  $R$  são chamadas folhas de  $\mathcal{F}$ .

Da definição, segue que uma folha de  $\mathcal{F}$  é um subconjunto de  $M$  conexo por caminhos. De fato, se  $F$  é uma folha de  $\mathcal{F}$  e  $p, q \in F$ , então, existe um caminho de placas  $\alpha_1, \dots, \alpha_k$  tal que  $p \in \alpha_1$  e  $q \in \alpha_k$ . Como as placas  $\alpha_j$  são conexas por caminhos e  $\alpha_j \cap \alpha_{j+1} \neq \emptyset$ , é imediato que  $\alpha_1 \cup \dots \cup \alpha_k \subset F$  é conexo por caminhos, logo, existe um caminho contínuo em  $F$  ligando  $p$  a  $q$ .

Outro fato importante é que toda folha  $F$  de  $\mathcal{F}$  possui uma estrutura de variedade  $C^r$  de dimensão  $n$  naturalmente induzida pelas cartas de  $\mathcal{F}$ .

**Exemplo 2.3. Folheação definida por submersão.** Seja  $f : M^m \rightarrow N^n$  uma submersão de classe  $C^r$ . Pela forma local das submersões, dados  $p \in M$  e  $q = f(p) \in N$  existem cartas locais  $(U, \varphi)$  em  $M$ ,  $(V, \psi)$  em  $N$ , tais que,  $p \in U$ ,  $q \in V$ ,  $\varphi(U) = U_1 \times U_2 \subset \mathbb{R}^{m-n} \times \mathbb{R}^n$  e  $\psi(V) = V_2 \supset U_2$  e  $\psi \circ f \circ \varphi^{-1} : U_1 \times U_2 \rightarrow U_2$  coincide com a segunda projeção  $(x, y) \mapsto y$ .

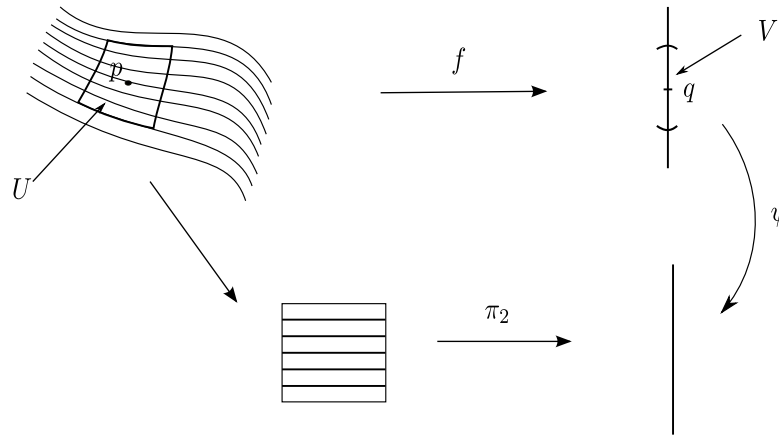


Figura 2.3: Folheação definida por submersão.

Daí é claro que as cartas locais  $(U, \varphi)$  definem uma estrutura de variedade folhada de classe  $C^r$  onde as folhas são as componentes conexas das superfícies

de nível  $f^{-1}(c)$ ,  $c \in \mathbb{R}$ . Vejamos um exemplo específico. Seja  $f : \mathbb{R}^3 \rightarrow \mathbb{R}$  a submersão definida por  $f(x, y, z) = \alpha(r^2)e^z$  onde  $r = \sqrt{x^2 + y^2}$  e  $\alpha : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$  é uma função  $C^\infty$  tal que  $\alpha(1) = 0$  e  $\alpha(0) = 1$  e se  $t > 0$ , então,  $\alpha'(t) < 0$ . Seja  $\mathcal{F}$  a folheação de  $\mathbb{R}^3$  cujas folhas são componentes conexas das subvariedades  $f^{-1}(c)$ ,  $c \in \mathbb{R}$ .

As folhas de  $\mathcal{F}$  no interior do cilindro sólido  $C = \{(x, y, z) | x^2 + y^2 \leq 1\}$  são todas homeomorfas a  $\mathbb{R}^2$  e podem ser parametrizadas por  $(x, y) \in D^2 \mapsto (x, y, \log(c/\alpha(r^2)))$ , onde  $c > 0$ . A fronteira de  $C$ , dada por  $\partial C = \{(x, y, z) | x^2 + y^2 = 1\}$  é também uma folha. Fora de  $C$  as folhas são todas homeomorfas a cilindros.

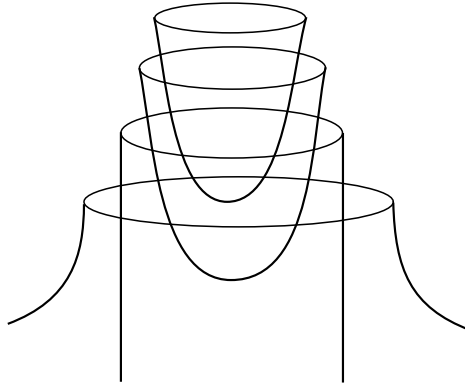


Figura 2.4: Exemplo de folheação.

**Exemplo 2.4. As folheações de  $S^3$  de Reeb.** O seguinte exemplo desempenhou um papel importante no desenvolvimento da teoria de folheações.

Considere a submersão do exemplo 2.3,  $f : D^2 \times \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$  dado por  $f(x, y, z) = \alpha(r) \cdot e^z$ , onde agora  $\alpha(r)$  é a função  $\alpha(r) = \exp(-\exp(1/(1 - r^2)))$ . A folheação definida por  $f$  tem por folhas os gráficos das funções  $z = \exp(1/(1 - r^2)) + b$ ,  $b \in \mathbb{R}$  e se estende a uma folheação  $C^\infty$  de  $\mathbb{R}^3$  cujas folhas no exterior de  $D^2 \times \mathbb{R}$  são os cilindros  $x^2 + y^2 = r^2$ ,  $r > 1$ .

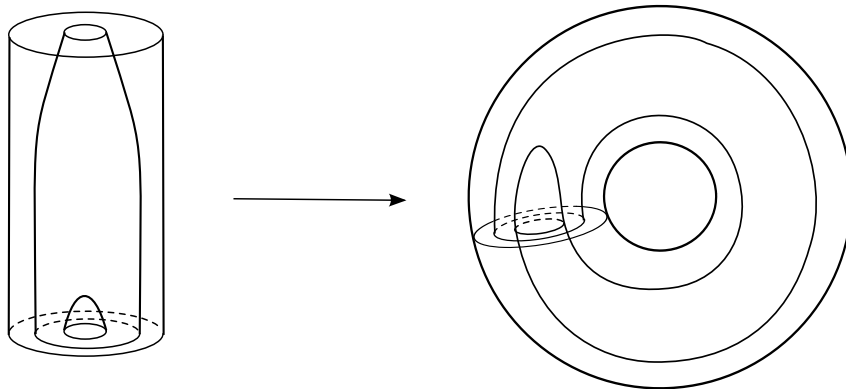


Figura 2.5: Folheação de Reeb.

Em  $D^2 \times [0, 1]$  identificamos os pontos da fronteira da maneira seguinte:  $(x_1, y_1, 0) \equiv (x_2, y_2, 1)$  se e somente se  $(x_1, y_1) = (x_2, y_2)$ . A variedade quociente  $D^2 \times [0, 1] / \equiv$  é difeomorfa a  $D^2 \times S^1$  e como a folheação definida em  $D^2 \times \mathbb{R}$



é invariante por translação ao longo do eixo  $z$  (isto é, uma translações destas, leva folhas sobre folhas), ela induz uma folheação  $\mathcal{R}$  de classe  $C^\infty$  de  $D^2 \times S^1$ . Esta é a chamada folheação de Reeb (orientável) de  $D^2 \times S^1$ . Nesta folheação, a fronteira  $\partial(D^2 \times S^1) = S^1 \times S^1$  é uma folha. Além disso, as outras folhas são homeomorfas a  $\mathbb{R}^2$  e se acumulam somente na fronteira. É fácil ver que esta folheação não é definida por uma submersão. Se no lugar da identificação acima, consideramos em  $D^2 \times [0, 1]$  a relação  $(x_1, y_1, 0) \sim (x_2, y_2, 1)$  se, e somente se,  $(x_1, y_1) = (x_2, -y_2)$ , então, o quociente  $D^2 \times [0, 1] / \sim$  será uma variedade não orientável de dimensão três,  $K^3$ , cuja fronteira é difeomorfa à garrafa de Klein. Como esta identificação preserva a folheação de  $D^2 \times \mathbb{R}$ , esta induz uma folheação  $\mathcal{R}$  de  $K^3$  chamada a folheação Reeb não-orientável de  $K^3$ . As folhas de  $\mathcal{R}$  no interior de  $K^3$  são todas homeomorfas a  $\mathbb{R}^2$  e a fronteira de  $K^3$  é uma folha.

A partir de duas folheações de Reeb de  $D^2 \times S^1$  podemos obter uma folheação  $C^\infty$  de  $S^3$  da maneira seguinte. A esfera  $S^3 = \{(x_1, x_2, x_3, x_4) \in \mathbb{R}^4 \mid \sum_{i=1}^4 x_i^2 = 1\}$  pode ser considerada como a união de dois toros sólidos  $T_i \simeq D^2 \times S^1$ ,  $i = 1, 2$  unidos ao longo da fronteira por um difeomorfismo que leva meridianos de  $\partial T_1$  em paralelos de  $\partial T_2$  e vice-versa. O toro sólido  $T_1$  pode ser definido pelas equações  $\sum_{i=1}^4 x_i^2 = 1$  e  $x_1^2 + x_2^2 \leq 1/2$ , e o toro sólido  $T_2$  pelas equações  $x_1^2 + x_2^2 \geq 1/2$ .

Uma outra maneira de ver essa decomposição de  $S^3$  em dois toros sólidos é a seguinte. Considere a projeção estereográfica  $\pi : S^3 - P \rightarrow \mathbb{R}^3$  onde  $P = (0, 0, 0, 1)$  e  $\pi(x)$  é o ponto de intersecção com o plano  $x_4 = 0$  da reta que contém  $P$  e  $x$ . Como  $\pi$  é um difeomorfismo,  $S^3$  pode ser considerada como a união de  $\mathbb{R}^3$  com o ponto  $P$  no infinito.

Consideremos agora no plano  $x_1 x_3$  as regiões  $S_1$  limitadas pelos círculos de raio 1 centrados em  $p = (2, 0)$ ,  $q = (-2, 0)$  e  $S_2 = \mathbb{R}^2 \setminus S_1$ .

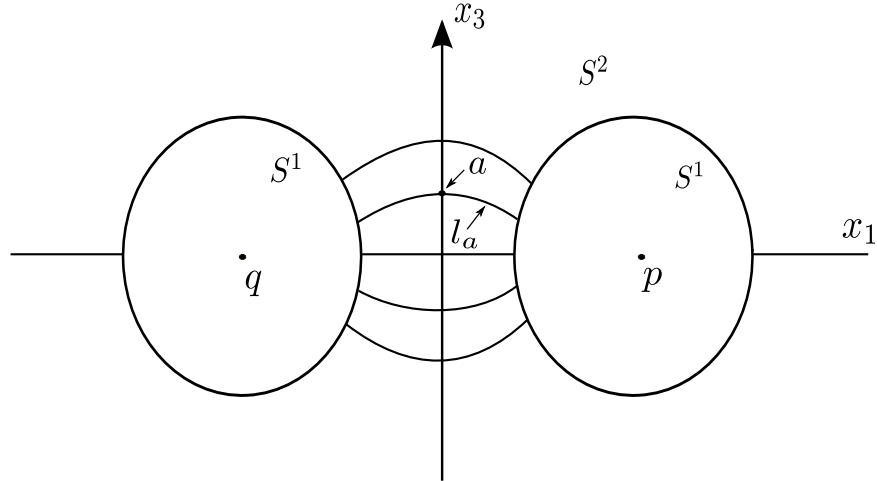


Figura 2.6:  $\mathbb{R}^3$  como soma de dois toros.

Ao girar esta figura em  $\mathbb{R}^3$  em torno do eixo  $x_3$ , a região  $S_1$  gera um toro sólido  $S'_1$ . Seja  $S'_2 = \mathbb{R}^3 \setminus S'_1$  e note que  $\pi^{-1}(S'_2) \cup P$  é também um toro sólido. De fato considere os círculos do plano  $x_1 x_3$  com centro no eixo  $x_3$  e que passam pelos pontos  $p$  e  $q$ . Seja  $l_a$  a componente conexa de um destes círculos em  $S_2$  que intersecta o eixo  $x_3$  no ponto  $a$ . Colocando  $l_\infty = \{(x_1, 0) \mid x_1^2 \geq 9\}$  obtemos uma folheação de  $S_2$  cujas folhas são as curvas  $\{l_a\}$ ,  $a \in \mathbb{R} \cup \{\infty\}$ . Ao girar o

plano  $x_1x_3$  em torno do eixo  $x_3$ , as curvas  $l_a (a \in \mathbb{R})$  geram discos  $D_a$  e  $l_\infty$  gera um cilindro  $D_\infty$ . Cada  $D_a$ ,  $a \in \mathbb{R} \cup \{\infty\}$ , intersecta o toro  $\partial S'_1$  ao longo de um paralelo.

É claro agora que, ao acrescentarmos a  $\mathbb{R}^3$  o ponto  $P$  via a projeção estereográfica, o eixo  $x_3$  junto com  $P$  define o eixo de um toro sólido  $T_2$  o qual esta folheado por discos  $\pi^{-1}(D_a)$ ,  $a \in \mathbb{R}$  mais o disco  $D_P = \pi^{-1}(D_\infty) \cup P$ .

Se denotamos por  $T_1$  o toro sólido  $\pi^{-1}(S'_1)$  obtemos que  $S^3 = T_1 \cup T_2$  e os paralelos de  $\partial T_1$  coincidem com os meridianos de  $\partial T_2$  e vice-versa.

Voltando à construção da folheação de  $S^3$ , considere a folheação que resulta de unir duas folheações de Reeb de  $T_1$  e  $T_2$  onde  $\partial T_1 = \partial T_2$  é uma folha. Obtemos assim uma folheação de  $S^3$  de codimensão 1 chamada folheação de Reeb de  $S^3$ . Esta folheação é  $C^\infty$  e possui uma folha homeomorfa a  $T^2$ . Todas as outras folhas são homeomorfas a  $\mathbb{R}^2$  e acumulam-se na folha compacta.

**Exemplo 2.5. Campos de vetores sem singularidades.** Seja  $M$  uma variedade compacta e  $X \in \mathcal{X}^r(M)$  um campo de vetores sobre  $M$  sem singularidades, então, existe uma decomposição de  $M$  em órbitas associadas a dito campo. Estas órbitas são as folhas de uma folheação definida em  $M$ .

A seguir apresentaremos uma definição que generaliza o conceito de folheação dado acima.

**Definição 2.6.** Uma  $C^r$ -folheação  $\mathcal{F}$ , com  $r \geq 1$ , de uma  $m$ -variedade diferenciável é uma partição de  $M$  em  $C^r$ -subvariedades conexas e imersas, chamadas folhas, tais que o módulo  $\mathcal{X}^r(\mathcal{F})$ , de todos os  $C^r$  campos de vetores tangentes as folhas é transitivo, isto é, dado  $p \in M$  e  $v \in T_p L$ , onde  $L$  é a folha por  $p$ , existe  $X \in \mathcal{X}^r(\mathcal{F})$  tais que  $X(v) = p$

**Observação 2.7.** 1. Esta definição é equivalente à Definição 2.1 sempre que todas as folhas tenham a mesma dimensão.

2. Poderiam existir folhas de diferentes dimensões. A dimensão da folheação  $\mathcal{F}$  é  $d$ , se  $d$  for o máximo possível das dimensões das folhas. Se  $\dim L < d$ , então,  $L$  é chamada de folha singular e se  $\dim L = d$  a folha  $L$  será chamada de folha regular e  $\text{Sing}(\mathcal{F}) = \{p \in L; L \text{ é folha singular} \}$  é chamado de conjunto singular de  $\mathcal{F}$ .

3. Um campo de vetores sobre uma variedade define uma folheação com ou sem singularidade.

## 2.2 Ações de grupos sobre Variedades

Nesta seção,  $M$  denota uma variedade diferenciável de classe  $C^\infty$  e  $G$  um grupo de Lie simplesmente conexo. Como referência para os resultados não demonstrados aqui recomendamos ao leitor se referir ao capítulo VIII de [4], [10] e [9].

Uma ação de classe  $C^k$  de  $G$  em  $M$  é uma aplicação  $C^k$ ,  $\varphi : G \times M \rightarrow M$ , satisfazendo as propriedades abaixo:

- (1)  $\varphi(e, x) = x$  para todo  $x \in M$ , onde  $e$  é a identidade de  $G$ .
- (2)  $\varphi(g_1, \varphi(g_2, x)) = \varphi(g_1 \cdot g_2, x)$  para quaisquer  $g_1, g_2 \in G$  e  $x \in M$ .

Denotaremos por  $\varphi_g : M \rightarrow M$  a aplicação  $\varphi_g(x) = \varphi(g, x)$ . Da definição, segue-se que  $\varphi_{g^{-1}} = (\varphi_g)^{-1}$  para todo  $g \in G$ , o que mostra que  $\varphi_g : M \rightarrow M$  é um difeomorfismo  $C^k$ .

**Definição 2.8.** A órbita de um ponto  $x \in M$  pela ação  $\varphi$  é o subconjunto  $\mathcal{O}_x = \mathcal{O}_x(\varphi) = \{\varphi(g, x) | g \in G\}$ . O grupo de isotropia de  $x \in M$  pela ação  $\varphi$  é o subgrupo de  $G$  definido por  $G_x = G_x(\varphi) = \{g \in G | \varphi(g, x) = x\}$ .

Da definição, é evidente que  $G_x$  é um subgrupo fechado de  $G$ . Consideremos em  $G$  a relação de equivalência  $\sim$  tal que  $g_1 \sim g_2$  se, e somente se,  $g_1^{-1} \cdot g_2 \in G_x$ . Sejam  $G/G_x$  o espaço quociente de  $G$  por  $\sim$  e  $\pi : G \rightarrow G/G_x$  a projeção definida para cada  $g \in G$  como a classe de equivalência  $\pi(g)$ .

Os seguintes dois teoremas descrevem a estrutura das órbitas de uma ação.

**Teorema 2.9.** Em  $G/G_x$  existe uma única estrutura de variedade diferenciável tal que  $\pi : G \rightarrow G/G_x$  define um espaço fibrado com fibra  $G$ . Em particular, se consideramos  $G/G_x$  com esta estrutura,  $\pi$  é uma submersão e se  $G_x$  é discreto, então,  $\pi$  é uma aplicação de recobrimento.

**Teorema 2.10.** Seja  $\varphi : G \times M \rightarrow M$  uma ação de classe  $C^k$ ,  $k \geq 1$  e  $x \in M$ . Existe uma única imersão biunívoca de classe  $C^k$ ,  $\bar{\varphi}_x : G/G_x \rightarrow \mathcal{O}_x$  tal que  $\bar{\varphi}_x \circ \pi = \varphi_x$ . Caso  $G_x$  seja discreto, a aplicação  $\varphi_x : G \rightarrow \mathcal{O}_x$  é uma aplicação de recobrimento.

Quando para todo  $x \in M$ ,  $\dim(\mathcal{O}_x) = \dim(G)$ , dizemos que a ação  $\varphi$  é localmente livre, assim uma ação localmente livre define uma folheação e se a ação não for localmente livre, então, ela define uma folheação singular, isto é, uma folheação  $\mathcal{F}$  onde o conjunto  $Sing(\mathcal{F}) \neq \emptyset$ .

Vejamos como podem ser as órbitas de uma ação de  $\mathbb{R}^n$  numa variedade  $M$ .

**Proposição 2.11.** Seja  $H$  um subgrupo fechado de  $\mathbb{R}^n$ . Então  $H$  é isomorfo a um dos grupos  $\mathbb{R}^k \times \mathbb{Z}^l$  onde  $k, l$  são inteiros com  $0 \leq k + l \leq n$ . Em particular, as órbitas de uma ação de  $\mathbb{R}^2$  são imersões de alguma das seguintes variedades: pontos,  $S^1$ ,  $\mathbb{R}$ ,  $S^1 \times S^1$ ,  $S^1 \times \mathbb{R}$ ,  $\mathbb{R}^2$ .

**Exemplo 2.12.** Vejamos agora um exemplo de uma ação de  $\mathbb{R}^2$  em  $S^3$ . Seja  $D^2 \times S^1 = \{(x, y) \in \mathbb{R}^2 \times \mathbb{R}^2; x_1^2 + x_2^2 \leq 1, y_1^2 + y_2^2 = 1\}$ . Consideremos os campos de vetores

$$X(x_1, x_2, y) = (\rho(r)x_1 - \beta x_2) \frac{\partial}{\partial x_1} + (\beta x_1 + \rho(r)x_2) \frac{\partial}{\partial x_2}$$

$$Y(x_1, x_2, y_1, y_2) = -\alpha x_2 \frac{\partial}{\partial x_1} + \alpha x_1 \frac{\partial}{\partial x_2} - y_2 \frac{\partial}{\partial y_1} + y_1 \frac{\partial}{\partial y_2}.$$

onde  $r = \sqrt{x_1^2 + x_2^2}$  e  $\rho(r)$  é uma função  $C^\infty$  não negativa tal que  $\rho(r) = 0$  se, e somente se,  $r = 1$ ,  $\frac{d^n \rho}{dr^n}(1) = 0$  para todo  $n \geq 1$ , e  $\rho(r) = 1$  para  $r$  em uma vizinhança de zero.

É fácil ver que os fluxos  $X_t$  e  $Y_t$  comutam, isto é,  $X_s \circ Y_t = Y_t \circ X_s$  ( $s, t \in \mathbb{R}$ ) em  $D^2 \times S^1$ , logo, eles definem uma ação  $\varphi$  de classe  $C^\infty$  de  $\mathbb{R}^2$  em  $D^2 \times S^1$ , possuindo duas órbitas compactas que são  $\{0\} \times S^1$  e  $\partial(D^2 \times S^1)$ . No caso em que  $\alpha$  é um número irracional, todas as outras órbitas são planos densos em  $D^2 \times S^1$ . Quando  $\alpha$  é racional elas são cilindros mergulhados.

Tomando duas cópias de  $D^2 \times S^1$  e indentificando-as ao longo da fronteira  $\partial(D^2 \times S^1) = S^1 \times S^1$  por meio de um difeomorfismo que leva paralelos de um em meridianos do outro e vice-versa, obtemos exemplos de ações de  $\mathbb{R}^2$  em  $S^3$  em que as órbitas de dimensão  $< 2$  são dois círculos entrelaçados.

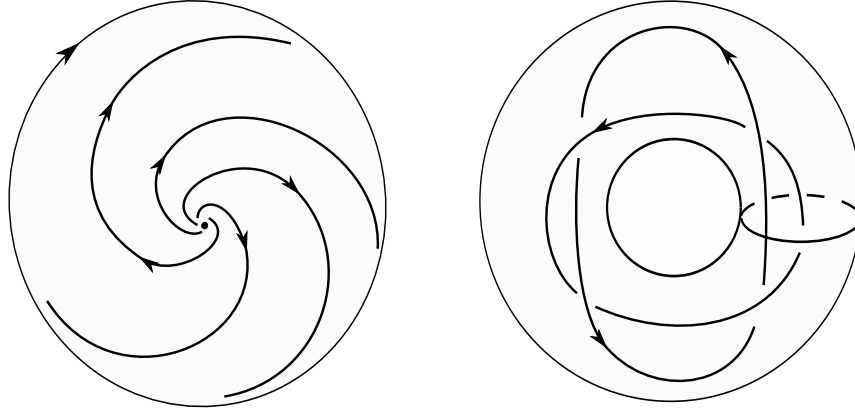


Figura 2.7: Exemplo de ação sobre  $S^3$ .

## 2.3 Algumas propriedades de ações de grupos

Nesta seção apresentaremos fatos gerais que serão usados no seguinte capítulo.

**Lema 2.13.** *Seja  $G$  um grupo topológico simplesmente conexo e  $\varphi : G \times M \rightarrow M$  uma ação do grupo  $G$  sobre o espaço  $M$ . Seja  $p : (\tilde{M}, \tilde{x}_0) \rightarrow (M, x_0)$  um espaço de recobrimento de  $M$ . Então existe uma única ação contínua  $\tilde{\varphi} : G \times \tilde{M} \rightarrow \tilde{M}$  que recobre  $\varphi$ , isto é, o seguinte diagrama comuta.*

$$\begin{array}{ccccc} & & & \tilde{M} & \\ & & \nearrow \tilde{\varphi} & \downarrow p & \\ G \times \tilde{M} & \xrightarrow{id \times p} & G \times M & \xrightarrow{\varphi} & M \end{array}$$

*Demonstração.* Consideremos a aplicação  $\varphi \circ (id \times p) : (G \times \tilde{M}, (e, \tilde{x}_0)) \rightarrow (M, x_0)$ , como  $\varphi$  é uma ação e  $p$  uma aplicação recobrimento, então  $\varphi \circ (id \times p)(e, \tilde{x}_0) = x_0$ .

Consideremos  $f = \varphi \circ (id \times p)$  e  $f_\#$  o homeomorfismo induzido no grupo fundamental.

$$\begin{array}{ccc} & & \tilde{M} \\ & \nearrow^{\alpha, \beta} & \downarrow p \\ \tilde{M} & \longrightarrow & M \end{array}$$

Como  $G$  é simplesmente conexo, então, temos que  $f_\#(G \times \tilde{M}, (e, \tilde{x}_0)) \subset p_\#(\tilde{M}, \tilde{x}_0)$ , assim, pelos Teoremas 1.8 e 1.9, existe uma única aplicação  $\tilde{\varphi} : (G \times \tilde{M}, (e, \tilde{x}_0)) \rightarrow (\tilde{M}, \tilde{x}_0)$  tal que o diagrama acima comuta e  $\tilde{\varphi}(e, \tilde{x}_0) = \tilde{x}_0$ .

Agora verificaremos que  $\tilde{\varphi}$  é uma ação.

- **Para todo  $\tilde{x} \in \tilde{M}$ , temos  $\tilde{\varphi}(e, \tilde{x}) = \tilde{x}$ .** De fato, considere a aplicação  $id \circ p : (\tilde{M}, \tilde{x}_0) \rightarrow (M, x_0)$  e as aplicações  $\alpha, \beta : (\tilde{M}, \tilde{x}_0) \rightarrow (\tilde{M}, \tilde{x}_0)$  definido por  $\alpha(\tilde{x}) = \tilde{\varphi}(e, \tilde{x})$  e  $\beta(\tilde{x}) = \tilde{x}$ .

$$\begin{array}{ccc} & & \tilde{M} \\ & \nearrow^{\lambda, \mu} & \downarrow p \\ G \times G \times \tilde{M} & \longrightarrow & M \end{array}$$

Como

$$p(\alpha(\tilde{x})) = p(\tilde{\varphi}(e, \tilde{x})) = \varphi(e, x) = x = (id \circ p)(\tilde{x})$$

e

$$p(\beta(\tilde{x})) = x = (id \circ p)(\tilde{x})$$

então,  $\alpha$  e  $\beta$  são levantamentos de  $(id \circ p)$  tal que  $\alpha(\tilde{x}_0) = \beta(\tilde{x}_0)$ , logo pelo Teorema 1.9, temos que  $\alpha(\tilde{x}) = \beta(\tilde{x})$  para todo  $\tilde{x} \in \tilde{M}$ , isto é  $\tilde{\varphi}(e, \tilde{x}) = \tilde{x}$ .

- **Para todo  $\tilde{x} \in \tilde{M}$  e para todo  $g, h \in G$ , temos  $\tilde{\varphi}(gh, \tilde{x}) = \tilde{\varphi}(g, \tilde{\varphi}(h, \tilde{x}))$ .** De fato, considere a aplicação  $v : G \times G \times \tilde{M} \rightarrow M$  definida por  $v(g, h, \tilde{x}) = \varphi(g, \varphi(h, p(\tilde{x}))) = \varphi(gh, p(\tilde{x}))$  e as aplicações  $\lambda, \mu : G \times G \times \tilde{M} \rightarrow \tilde{M}$  definidas por  $\lambda(g, h, \tilde{x}) = \tilde{\varphi}(g, \tilde{\varphi}(h, \tilde{x}))$  e  $\mu(g, h, \tilde{x}) = \tilde{\varphi}(gh, \tilde{x})$ .

Como

$$p(\lambda(g, h, \tilde{x})) = p(\tilde{\varphi}(g, \tilde{\varphi}(h, \tilde{x}))) = \varphi(g, \varphi(h, x)) = v(g, h, \tilde{x})$$

e

$$p(\mu(g, h, \tilde{x})) = p(\tilde{\varphi}(gh, \tilde{x})) = \varphi(gh, x) = v(g, h, \tilde{x})$$

então,  $\lambda$  e  $\mu$  são levantamentos de  $v$  tal que  $\lambda(\tilde{x}_0) = \mu(\tilde{x}_0)$ , logo pelo Teorema 1.9, temos que  $\lambda(\tilde{x}) = \mu(\tilde{x})$  para todo  $\tilde{x} \in \tilde{M}$ , isto é  $\tilde{\varphi}(gh, \tilde{x}) = \tilde{\varphi}(g, \tilde{\varphi}(h, \tilde{x}))$ .

■

**Observação 2.14.** Dado  $\tilde{x} \in \tilde{M}$  e  $x = p(\tilde{x})$ , então,  $x$  é um ponto fixo de  $\varphi$  se, e somente se,  $\tilde{x}$  é ponto fixo de  $\tilde{\varphi}$ . De fato, se  $\tilde{\varphi}(g, \tilde{x}) = \tilde{x}$  para todo  $g \in G$ , assim,  $p(\tilde{\varphi}(g, \tilde{x})) = p(\tilde{x}) = x$ , como  $p \circ \tilde{\varphi} = \varphi \circ (\text{id} \times p)$ , então, temos que  $\varphi(g, x) = x$ . Para provarmos a recíproca, consideremos  $\varphi(g, x) = x$ , para todo  $g \in G$  e suponha por contradição que  $\tilde{\varphi}(g, \tilde{x}) = \tilde{y} \neq \tilde{x}$  para algum  $g \in G$ , logo  $p(\tilde{\varphi}(g, \tilde{x})) = \varphi(g, x) = x = p(\tilde{y})$ , mas  $x = p(\tilde{x}) = p(\tilde{y})$  então,  $\tilde{y} = \tilde{x}$ , o que é uma contradição, obtendo assim o desejado.

Uma consequência do lema anterior é que, para nosso proposito, todas as variedades podem ser tomadas como orientáveis. De fato, se  $\varphi : G \times M \rightarrow M$  é uma ação sobre uma variedade não orientável  $M$ , seja  $p : \tilde{M} \rightarrow M$  seu recobrimento duplo orientável [6]. Podemos considerar o levantamento de  $\varphi$  a uma ação de  $G$  sobre  $\tilde{M}$  (Em nosso caso, o grupo  $G$  é um espaço vetorial, por isso é sempre simplesmente conexo).  $\tilde{M}$  é compacto se  $M$  também é, e  $\mathcal{X}(\tilde{M}) = 2 \cdot \mathcal{X}(M)$ , assim,  $\mathcal{X}(\tilde{M}) \neq 0$  se  $\mathcal{X}(M) \neq 0$ . É claro que a redução para  $M$  orientável não é realmente essencial, mas simplifica a consideração dos casos. Esta orientabilidade será assumida na prova do teorema principal, mas não na sua declaração nem em nenhum dos seguintes resultados.

O seguinte resultado é um fato conhecido na teoria de sistemas dinâmicos e aqui será apresentado em nosso contexto.

**Lema 2.15.** Seja  $\varphi : G \times M \rightarrow M$  uma ação contínua de um grupo topológico  $G$  sobre um espaço  $M$ . Qualquer conjunto compacto  $\varphi$ -invariante  $X \subset M$  contém um conjunto minimal.

*Demonstração.* Seja  $\mathcal{J} = \{S \subset M; S \text{ é compacto } \varphi\text{-invariante e } S \subset X\}$ , então:

- 1)  $\mathcal{J} \neq \emptyset$ , de fato,  $X \in \mathcal{J}$ .
- 2) Sobre a família  $\mathcal{J}$  consideremos a relação de ordem  $X \preceq Y$  se  $Y \subset X$ , com isso  $(\mathcal{J}, \preceq)$  é parcialmente ordenado. Seja  $\mathcal{J}' \subset \mathcal{J}$  uma subfamília totalmente ordenada, então,  $\bigcap_{J \in \mathcal{J}'} J \in \mathcal{J}$  é uma cota superior para  $\mathcal{J}'$ , pelo lema de Zorn, existe  $m$  elemento maximal de  $\mathcal{J}$ , isto é, existe um minimal.

■

O seguinte resultado é consequência do Teorema do Fluxo Tubular 1.53 e da observação de que se  $y \in M$  é tal que o grupo de isotropia de  $y$ ,  $G_y$  é discreto, então, pela Proposição 2.11  $\mathcal{O}(y)$  é regular, de fato ela será homeomorfa a um círculo ou à reta.

**Lema 2.16.** Seja  $\xi : \mathbb{R} \times M \rightarrow M$  um fluxo sobre uma 2-variedade  $M$  e seja  $y \in M$  um ponto cujo grupo isotropico é discreto. Existe uma seção transversal de  $\xi$  em  $y$  (assim  $y$  tem uma vizinhança retangular).

De agora em diante se  $\xi : \mathbb{R} \times M \rightarrow M$  é um fluxo sob uma variedade  $M$ , então denotaremos o conjunto de pontos fixos de  $M$  pelo fluxo  $\xi$  como sendo  $\text{Fix}(\xi) = \{x \in M; \xi(t, x) = x, \forall t \in \mathbb{R}\}$ . Dito isto, consideremos o seguinte lema.

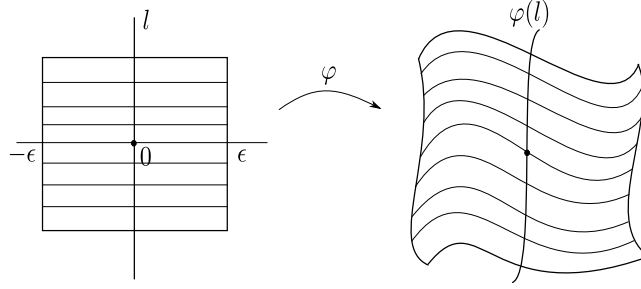


Figura 2.8: Seção transversal.

**Lema 2.17.** *Seja  $\xi : \mathbb{R} \times M \rightarrow M$  um fluxo sobre uma superfície  $M$ , tal que  $\mathcal{X}(M) \neq \emptyset$ , então,  $\text{Fix}(\xi) \neq \emptyset$ .*

*Demonstração.* Isto é uma consequência do Teorema 1.7 (Teorema do ponto fixo de Lefschetz), de acordo com o qual cada aplicação contínua  $f : M \rightarrow M$ , homotópica à identidade, tem um ponto fixo. Dada  $\xi : \mathbb{R} \times M \rightarrow M$ , onde  $M$  é uma superfície, se  $\mathcal{X}(M) \neq \emptyset$ , e para  $n = 1, 2, 3, \dots$  fixo, seja  $f_n : M \rightarrow M$  definida por  $f_n(x) = \xi(1/2^n, x)$ . O conjunto  $F_n = \text{Fix}(f_n) \neq \emptyset$  é compacto e, além disso, temos o seguinte fato:

**Afirmção 1:**  $F_{n+1} \subset F_n$ . De fato, se  $x \in F_{n+1}$ , temos  $f_{n+1}(x) = \xi(1/2^{n+1}, x) = x$ , logo,

$$\xi(1/2^n, x) = \xi(1/2^{n+1} + 1/2^{n+1}, x) = \xi(1/2^{n+1}, \xi(1/2^{n+1}, x)) = \xi(1/2^{n+1}, x) = x,$$

então,  $f_n(x) = x$ , portanto,  $x \in F_n$ . Como  $F_1 \supset F_2 \supset \dots$ , então  $F = \bigcap F_n \neq \emptyset$ .

**Afirmção 2:**  $x \in F$  então  $\xi(t, x) = x$ , para todo  $t \in \mathbb{R}$ . De fato, considere  $t_n \rightarrow t$  tal que  $t_n = t + 1/2^n$ , como  $x \in F_n$  para todo  $n \in \mathbb{N}$ , temos que  $\xi(t_n, x) = x$  por outro lado  $\xi(t_n, x) = \xi(t + \frac{1}{2^n}, x) = \xi(t, \xi(\frac{1}{2^n}, x)) = \xi(t, x)$ , logo  $\xi(t, x) = x$ , assim  $x$  é um ponto fixo do fluxo  $\xi$ . ■

Dizemos que um conjunto minimal de um fluxo é não-trivial, se não for homeomorfo a um ponto, a um círculo ou a um toro. Para fluxos contínuos, M. Peixoto apresenta o seguinte resultado sobre os conjuntos minimais não triviais.

**Lema 2.18.** *Seja  $\xi : \mathbb{R} \times M \rightarrow M$  um fluxo sobre uma variedade  $M$  de gênero finito  $g$ , então, o número de conjuntos minimais não triviais distintos é no máximo  $2g - 1$ .*

*Demonstração.* Primeiramente, note que, se  $\mu, \nu$  são conjuntos minimais, então,  $\mu \cap \nu \neq \emptyset$  se, e somente se,  $\mu = \nu$ . De fato, observe que existe  $p \in \mu \cap \nu$ , isto é,  $p \in \mu$  e  $p \in \nu$ , logo,  $\mathcal{O}(p) \subset \mu$  e  $\mathcal{O}(p) \subset \nu$ , então,  $\mu \subseteq \nu$  e  $\nu \subseteq \mu$ , portanto,  $\mu = \nu$ , reciprocamente, se  $\mu = \nu$ , é claro que  $\mu \cap \nu \neq \emptyset$ .

Pelo Lema 2.13 podemos supor que  $M$  é orientável porque seu recobrimento duplo  $\tilde{M}$  teria o mesmo gênero, e  $\tilde{\xi}$  em  $\tilde{M}$  admitiria pelo menos tantos conjuntos minimais não triviais quanto  $\xi$ .

Também observe que as curvas na fronteira de  $M$  são subvariedades com a topologia induzida e são órbitas de  $\xi$ , exceto quando  $\xi$  tem um ponto fixo nelas, então, todo conjunto minimal não trivial  $\mu$  está no interior de  $M$ .

A prova vai ser por indução no gênero  $g$ .

**Caso I: Consideremos  $g = 0$ .** Neste caso, temos que  $M = S^2$  ou  $M \subset \mathbb{R}^2$  homeomorfo a um disco. Como consequência do Teorema de Poincaré-Bendixon nas suas duas versões Teorema 1.40 e Corolário 1.41, temos que não existem minimais não triviais, o que prova o resultado.

**Caso II: Suponha agora  $g > 0$  e que o lema foi provado para todas as superfícies do gênero  $< g$ .** Dado um fluxo  $\xi : \mathbb{R} \times M \rightarrow M$  em uma superfície  $M$  de gênero  $g$ , suponha, por contradição, que  $\mu_1, \dots, \mu_{2g}$  são  $2g$  conjuntos minimais não triviais distintos de  $\xi$  em  $M$ .

Seja  $x \in \mu_{2g}$  e seja  $Q =$  uma vizinhança tubular do ponto  $x$  (consulte a Figura 2.9). Escolha  $Q$  para que não faça intersecção com os conjuntos minimais restantes  $\mu_i$ , isto é,  $Q \cap \mu_i = \emptyset$ ,  $1 \leq i < 2g$  e, além,  $Q \cap \partial M = \emptyset$ .

O fato de que  $Q$  não intersecta a fronteira de  $M$  segue da segunda observação acima. Provamos que  $Q$  não intersecta os outros conjuntos minimais.

Suponha que para cada caixa de fluxo  $C_n$  de  $x$ , com  $\text{diam}(C_n) < 1/n$ , existe um minimal  $\mu_{i_n}$  tal que  $\mu_{i_n} \cap C_n \neq \emptyset$  onde  $i_n \in \{1, 2, \dots, 2g - 1\}$ , tomemos  $x_{i_n} \in \mu_{i_n} \cap C_n$ , observe, além disso, que  $x_{i_n} \rightarrow x$ , isso implica que  $x \in \mu_{i_n} \cap \mu_{2g}$ , o que é uma contradição.

A órbita de  $x$  (Observe o Teorema 3,7 pag 87 de [1]) intersecta  $Q$ , e tomemos os pontos  $a, a', b, b'$  como na Figura 2.9 a seguir, considere o seguinte homeomorfismo  $h : Q \rightarrow Q$ . Dado pela identidade nos lados superior, inferior e na lateral esquerda de  $Q$ , e  $h$  é um homeomorfismo sobre o lado direito tal que  $h(a') = b'$ . No interior de  $Q$ ,  $h$  é definido tal que cada segmento horizontal  $yy'$  é levado no segmento  $yh(y')$ .

Definimos um novo fluxo  $\tilde{\xi} : \mathbb{R} \times M \rightarrow M$  tal que:

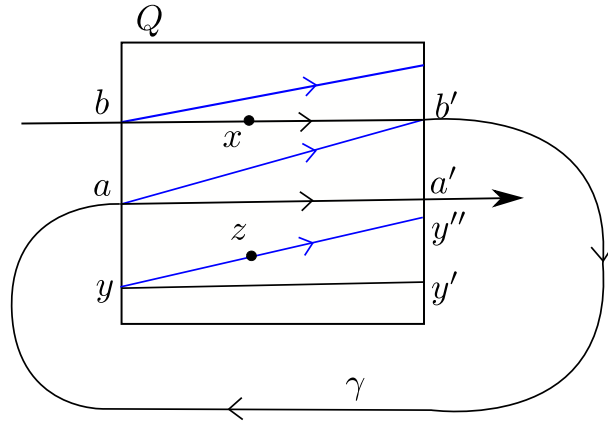
- Se  $z \notin Q$ , então,  $\tilde{\xi}(t, z) = \xi(t, z)$  na mesma direção.
- Se  $z \in Q$ , observe que existem únicos  $y', y''$  em  $Q$  tais que  $h(y') = y''$ , de onde existe  $y \in Q$  tal que  $y, z \in \mathcal{O}(y'')$ , a órbita de  $z$  pelo fluxo  $\tilde{\xi}$  será definida como  $\mathcal{O}^-(y) \cup \mathcal{O}^+(y'') \cup [y, y'']$ , onde  $[y, y'']h([y, y'])$ .

Sob o novo fluxo  $\tilde{\xi}$ , o ponto  $a$  tem uma órbita fechada  $\gamma = \mathcal{O}_{\tilde{\xi}}(a)$ . Observe também que  $\mu_1, \dots, \mu_{2g-1}$  ainda são conjuntos minimais de  $\tilde{\xi}$ .

Note que a curva  $\gamma$  não pode separar  $M$ , pois, se isso acontecesse, então, a curva fechada  $\alpha$  da Figura 2.9, também separaria  $M$ , assim  $M = M_1 \cup \{\alpha\} \cup M_2$ , podemos supor que  $x \in M_1$ , e  $M_1$  é homeomorfa a um disco, então,  $\omega(x)$  seria um minimal não trivial no disco, o que é uma contradição.

Portanto, ao cortar  $M$  ao longo de  $\gamma$ , obtemos uma variedade  $M_\gamma$  de gênero  $g - 1$ , na qual o fluxo  $\tilde{\xi}$  está definido e admite pelo menos os conjuntos minimais não triviais  $\mu_1, \dots, \mu_{2g-1}$ , e pela hipótese indutiva  $2g - 1 \leq 2(g - 1) - 1 = 2g - 3$  o que é uma contradição. Isso conclui a prova do lema. ■



Figura 2.9: Vizinhança tubular de  $x$ .

**Observação 2.19.** O lema acima afirma que, em uma variedade do gênero  $g$ , há no máximo  $2g - 1$  órbitas recorrentes com fechos disjuntos dois a dois. Em particular, não há órbitas recorrentes em uma superfície do gênero zero. Observe que esse resultado fornece informações também no caso diferenciável, uma vez que existem órbitas recorrentes mesmo para ações  $C^\infty$ .

**Lema 2.20.** Seja  $\xi : \mathbb{R} \times M \rightarrow M$  um fluxo sobre uma 2-variedade  $M$ . Suponha que  $x \in M$  é tal que  $x = \lim x_n$  onde cada  $x_n$  tem uma órbita fechada  $\mu_n$ , de período  $t_n$ . Então:

- (a) Se o gênero de  $M$  é finito, a órbita de  $x$  não pode ser recorrente.
- (b) Se  $x$  tem uma órbita fechada  $\mu$ , de período  $t_0$ , é preciso ter  $\lim t_n = a \cdot t_0$  ( $a = 1$  ou  $a = 2$  de acordo com  $\mu$  se é de dois lados ou um lado em  $M$ ), e  $\mu = \{y \in M; y = \lim y_n, y_n \in \mu_n, n = 1, 2, 3, \dots\}$ .

*Demonstração.* (a) Seja  $Q$  uma vizinhança retangular de  $x$ . Claramente, nenhum ponto fronteira de  $M$  pode ter uma órbita recorrente, então, podemos assumir que  $Q \cap \partial M = \emptyset$ .

**Caso I:** Considere que para infinitos valores de  $n$ ,  $\mu_n$  separa  $M$ . Então, como  $\mu$  é uma órbita fechada, podemos assumir que  $Q \setminus \mu$  tem duas componentes, fixemos uma delas e denotemos por  $A_n$ , assim, existe um conjunto aberto  $A_n \subset M$  cujo conjunto de pontos fronteira  $\partial A_n$  satisfaz a condição  $\partial A_n \cap Q \subset \mu_n \cap Q$ .

Suponha, então, que a condição acima é verdadeira e que, por contradição, a órbita de  $x$  seja recorrente. Existe um valor  $t_0$  suficientemente grande para que a órbita de  $x$  cruze  $Q$  pelo menos 3 vezes para  $0 \leq t \leq t_0$ . As órbitas de todos os pontos suficientemente próximos de  $x$  terão exatamente a mesma propriedade. Assim, podemos escolher  $\mu_n$  e o correspondente conjunto aberto  $A_n$ , com  $\partial A_n \cap Q \subset \mu_n \cap Q$ , tal que  $\mu_n$  cruza  $Q$  pelo menos 3 vezes. Os segmentos de  $\mu_n \cap Q$  são precisamente as intersecções de  $Q$  com  $\partial A_n$ . Observe a Figura 2.10.

Como há pelo menos três segmentos como estes, deve haver dois consecutivos, de modo que  $Q$  entre em um deles e deixe  $A_n$  no outro.

*Tal coisa, no entanto, não pode acontecer porque esses segmentos são igualmente orientados em  $Q$  e  $\mu_n$ , por outro lado, têm sua própria orientação (ver Figura 2.11).*

**Caso II:** *Suponha que apenas uma quantidade finita dos  $\mu_n$  satisfaçam a condição com respeito a  $Q$ . Ignorando-os, podemos assumir que nenhum  $\mu_n$  satisfaz essa condição, então  $\mu_n$  não separa  $M$ .*

*A prova agora será feita por indução. Suponhamos que para uma superfície de gênero  $g$  a afirmação seja válida, isto é, não é recorrente. Seja  $\tilde{M}$  uma superfície de gênero  $g+1$  e  $x \in M$  como no enunciado do lema, então, existe  $n \in \mathbb{N}$  suficientemente grande tal que  $\nu_n \in Q$  e  $\mu_n$  separa  $\tilde{M}$ , cortando ao longo de  $\mu_n$  obtemos uma superfície de gênero  $g$  onde  $x$  é recorrente. O que contradiz a nossa hipótese indutiva.*

(b) *Seja  $\epsilon > 0$  dado. Como a órbita de  $x$  é periódica, existe  $t_0 > 0$  tal que  $\xi(t_0, x) = x$ . Provaremos que  $t_n \rightarrow t_0$ , onde  $t_n$  é período da órbita  $\mu_n$ .*

*De fato, considere  $Q$  uma caixa de fluxo contendo  $x$ , tal que  $\mu \cap Q$  é um segmento e tal que  $\mu$  leva um tempo  $< \epsilon$  ir de uma extremidade de  $Q$  para a outra pelo fluxo  $\xi$ . Tome também uma vizinhança tubular  $V$  da órbita fechada  $\mu$ , contida em  $Q$ . escolha  $n_0$  tão grande que, para  $n > n_0$ ,  $x_n$  está perto o suficiente de  $x$ , de modo que  $\xi(t, x_n) \in V$  para  $0 \leq t \leq 2t_0$ , e tal que a órbita de  $x_n$  atinge  $Q$  para o primeiro tempo em  $t = t'$ , onde  $|t' - t_0| < \epsilon/2$ , e pela segunda vez em  $t = t''$ , com  $|t'' - t_0| < \epsilon/2$  também, isso pode ser feito por compacidade da órbita de  $x$  e pela continuidade do fluxo.*

**Caso I:  $\mu$  é 2-lados.** *Então,  $V$  é um cilindro. Claramente  $\xi(t', x_n)$  deve estar no mesmo segmento horizontal de  $Q$  como  $x_n$ , já que uma das semi-órbitas de  $x_n$  pertence a  $V$  e  $\mu_n$  não seria uma órbita fechada. Portanto,*

$$t' < t_n < t' + \epsilon/2 \quad (2.2)$$

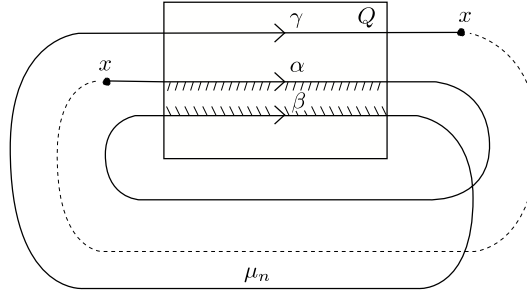
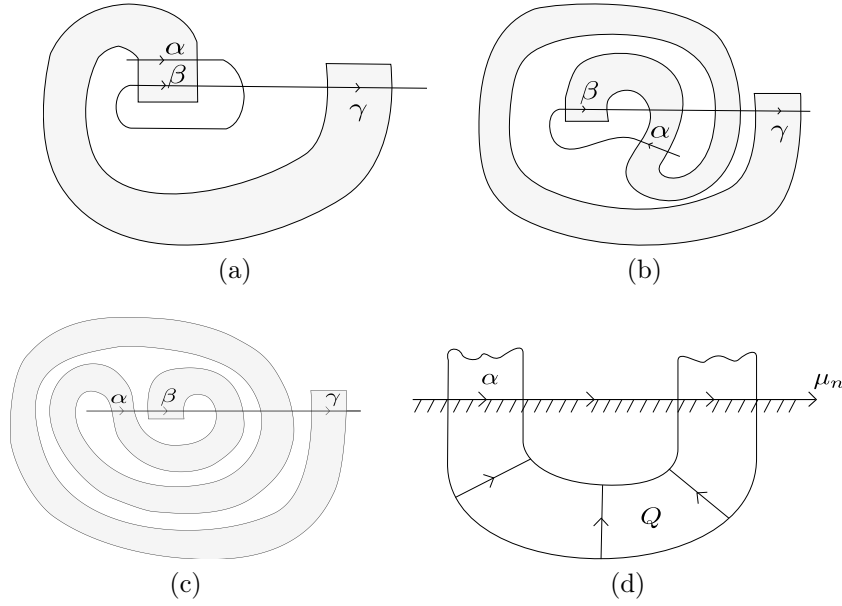
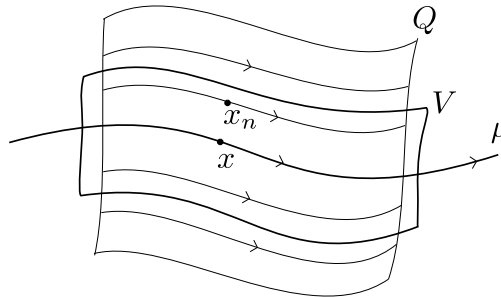
*e pela hipótese sabemos que  $|t' - t_0| < \epsilon/2$ , isto é,  $-\epsilon/2 < t' - t_0 < \epsilon/2$ , daí,*

$$t' - \epsilon/2 < -t_0 < -t' + \epsilon/2 \quad (2.3)$$

*somando as desigualdades 2.2 e 2.3 temos  $-\epsilon < -\epsilon/2 < t_n - t_0 < \epsilon$ , e portanto,  $|t_n - t_0| < \epsilon$ .*

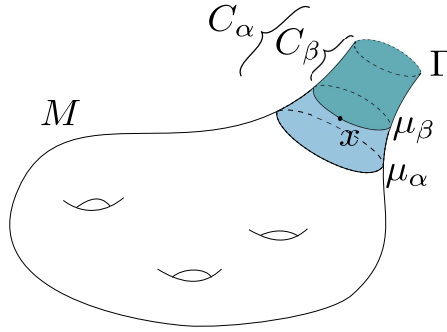
**Caso II:  $\mu$  é um-lado.** *Então,  $V$  é uma faixa de Möbius cujo equador é  $\mu$ . Então  $\xi(t, x_n)$  retorna a  $Q$  para o primeiro tempo em um ponto do outro lado de  $\mu$  (relativamente a  $x_n$  em  $Q$ ), mas, no segundo retorno, ele deve fechar, caso contrário, permanece sempre aberto. Portanto,  $\lim t_n = 2t_0$  neste caso.*

*Para concluir a prova, primeiro observamos que a inclusão  $\mu \subset \{y \in M; y = \lim y_n, y_n \in \mu_n, n = 1, 2, \dots\}$  é óbvia. Por outro lado, seja  $y = \lim y_n, y_n \in \mu_n$ . Então  $y_n = \xi(s_n, x_n)$ , onde  $0 \leq s_n \leq t_n$ , então, a sequência  $\{s_n\}$  é limitada. Passando para uma subsequência convergente, podemos escrever  $s_n \rightarrow s$ . E temos que  $y = \lim \xi(s_n, x_n) = \xi(s, x) \in \mu$ . ■*

Figura 2.10: Vizinhança tubular da órbita do ponto  $x$ .Figura 2.11: Esticamento de  $\mu_n$ .Figura 2.12: Vizinhança tubular de  $\mu$  contida em  $Q$ .

Para o próximo lema, consideramos o seguinte:  $M$  é uma 2-variedade e  $\Gamma$  é um círculo fronteira de  $M$ ;  $\{\mu_\alpha\}$  é uma família de curvas fechadas simples disjuntas em  $M$ , nenhuma delas intersectando a fronteira de  $M$ . Assumimos que para cada  $\alpha$  existe um cilindro compacto  $\bar{C}_\alpha \subset M$ , cujos círculos fronteira são  $\Gamma$  e  $\mu_\alpha$ . Por conveniência, deixamos  $\Gamma \subset C_\alpha$ , mas  $C_\alpha \cap \mu_\alpha = \emptyset$ , de modo que cada  $C_\alpha$  esteja aberto em  $M$ . O conjunto de pontos fronteira de  $C_\alpha$  em  $M$  é  $\mu_\alpha$  e escrevemos  $\partial C_\alpha = \mu_\alpha$  para denotar isso. Finalmente,  $\bar{C}_\alpha = C_\alpha \cup \mu_\alpha$  é o fecho de  $C_\alpha$  em  $M$  (Observe a Figura 2.13).

**Lema 2.21.** *Seguindo a notação acima:*

Figura 2.13: Cilindros abertos na fronteira de  $M$ .

- (a) A família  $\{C_\alpha\}$  é linearmente ordenada pela inclusão, a menos que  $M$  seja um disco com fronteira  $\Gamma$ ;
- (b) A união de qualquer subfamília dada linearmente ordenada de  $\{C_\alpha\}$  é um cilindro  $C$  aberto em  $M$ , contendo  $\Gamma$ , que pode ser escrito como  $C = \bigcup C_n$ ,  $C_1 \subset C_2 \subset \dots$  onde, para cada  $n = 1, 2, \dots$ , temos  $C_n = C_\alpha$  para algum  $\alpha$ ;
- (c) Se o conjunto de pontos fronteira de  $C$  em  $M$  é uma curva fechada simples  $\mu$ , então, ou o fecho  $\bar{C}$  é um cilindro compacto com círculos limite  $\Gamma$  e  $\mu$ , ou  $\bar{C} = M = \text{Faixa de Möbius}$ .

*Demonstração.* (a) Consideremos  $C_\alpha \neq C_\beta$  escolhidos arbitrariamente e suponhamos que  $M$  não é um disco. Denote por  $h : S^1 \times [0, 1] \rightarrow \bar{C}_\alpha$  um homeomorfismo tal que  $h(S^1 \times 0) = \Gamma$ . Seja  $h(z, t) = x \in \bar{C}_\alpha \cap \bar{C}_\beta$  com  $t \in [0, 1]$  maior possível. Já que  $C_\alpha \cap C_\beta$  é aberto  $x$  deve pertencer a  $\mu_\alpha$ , ou a  $\mu_\beta$ , mas não a ambos. De fato, como  $C_\alpha \cap C_\beta$  é aberto, existe  $\varepsilon > 0$  tal que  $h((z - \varepsilon, z + \varepsilon) \times (t - \varepsilon, t + \varepsilon)) \subset C_\alpha \cap C_\beta$  o que implicaria que existe  $t_0 > t$  com  $h(z, t_0) \in C_\alpha \cap C_\beta$ , o que contradiz a maximalidade de  $t$ .

Suponhamos que  $x \in \mu_\beta$  mas  $x \notin \mu_\alpha$ , logo  $x \in \mu_\beta \cap C_\alpha$ . Então, o conjunto conexo  $\mu_\beta$  é tal que  $\mu_\beta \cap C_\alpha$ , mas é disjunto a  $\mu_\alpha = \partial C_\alpha$ , assim,  $\mu_\beta \subset C_\alpha$ .

Observe que  $\mu_\beta$  não pode limitar um disco  $D$  em  $C_\alpha$  pois isto implicaria  $C_\beta \cup D$  seja um disco em  $M$ , com fronteira igual ao círculo  $\Gamma$ . O disco  $C_\beta \cup D$  seria então aberto e fechado em  $M$ , então  $M$  seria um disco, ao contrário da suposição.

Logo  $\bar{C}_\alpha \setminus \mu_\beta = X \cup Y$ , é a união disjunta de duas componentes conexas, com  $\Gamma \subset X$ ,  $\mu_\alpha \subset Y$  e  $\partial X = \partial Y = \mu_\beta$ . Então, o conjunto conexo  $C_\beta$  intersecta  $X$  ao longo de  $\Gamma$ , mas não intersecta  $\partial X = \mu_\beta$ , logo,  $C_\beta \subset X \subset C_\alpha$ . Se tivéssemos assumido  $x \in \mu_\alpha$ , a conclusão seria que  $C_\alpha \subset C_\beta$ .

- (b) Sem perda de generalidade, escrevamos a subfamília dada ainda como  $\{C_\alpha\}$ . Pelo teorema de Lindelöf (pagina 48 de [11]), existe uma sequência enumerável  $C_{\alpha_1}, \dots, C_{\alpha_n}, \dots$  tal que  $\bigcup C_{\alpha_n} = \bigcup C_\alpha$ . Seja  $C_n = C_{\alpha_1} \cup \dots \cup C_{\alpha_n}$ . Já que os  $C_\alpha$  são ordenados linearmente pela inclusão, cada  $C_n = C_\alpha$  para algum  $\alpha$ . Claramente,  $C_1 \subset C_2 \subset \dots$  e  $\bigcup C_n = \bigcup C_\alpha = C$ . Se  $C = C_n$  para algum  $n$ , então,  $C$  é um cilindro, aberto em  $M$ .

De outro lado,  $\bar{C}_n \subset C_{n+1}$  para infinitos valores de  $n$ , então podemos também supor que isso acontece para cada  $n$ . Observe que cada  $\bar{C}_{n+1} \setminus C_n$  é um cilindro fechado.

Considere o cilindro canônico  $K = \{(x, y, z) \in \mathbb{R}^3; x^2 + y^2 = 1, z \geq 0\}$ . Seja  $K_n = \{(x, y, z) \in K; 0 \leq z < n\}$ , com  $n \in \mathbb{N}$ , assim  $K = \bigcup K_n$ ,  $\bar{K}_n \subset K_{n+1}$ . Para cada  $n$ , seja  $k_n : \bar{K}_n \setminus K_{n-1} \rightarrow \bar{C}_n \setminus C_{n-1}$  um homeomorfismo tal que  $k_n(\bar{K}_{n-1} \setminus K_{n-1}) = \bar{C}_{n-1} \setminus C_{n-1}$ .

Por conveniência, seja  $K_0 = C_0 = \emptyset$ . Agora definamos um homeomorfismo  $h : K \rightarrow C$ , mostrando assim que  $C$  é um cilindro. Começamos definindo  $h|_{K_1} = k_1$  e continuando por indução. Supondo  $h : \bar{K}_n \approx \bar{C}_n$  está definido, estendê-lo para  $\bar{K}_{n+1} \setminus K_n$ . Seja  $(x, y, z) \in K_{n+1} \setminus K_n$  definamos,

$$h(x, y, z) = k_{n+1}[k_n^{-1}(h(x, y, z - 1)) + (0, 0, 1)]$$

Esta definição é, claramente, um homeomorfismo e, assim, temos que  $h : K \rightarrow C$  é um homeomorfismo.

- (c) Note que, sendo  $C$  aberto em  $M$ ,  $C \cap \partial C = C \cap \mu = \emptyset$ , além disso  $\Gamma \subset C$ , então,  $\Gamma \cap \mu \subset C \cap \mu$ , assim,  $\mu$  não tem pontos em comum com  $\Gamma$ .

**Caso I:**  $\mu$  é de dois lados, existe um anel  $\bar{A} = S^1 \times [0, 1]$  em  $M$ , com  $\mu = S^1 \times \{0\}$ . Seja  $A = S^1 \times (0, 1)$ . Este anel existe quando  $\mu$  intersecta a fronteira de  $M$  ou quando  $\mu$  é interior em  $M$ . No primeiro caso, qualquer anel intersecta  $C$ , e no segundo caso, existem anéis em ambos lados de  $\mu$ , porém, sempre escolheremos  $\bar{A}$  tal que  $A \cap C \neq \emptyset$ . Claramente, podemos escolher  $\bar{A}$  tão estreito que  $A_1 = S^1 \times (0, 1] \subset C$ , tal que  $v = S^1 \times \{1\}$  é uma curva fechada em  $C$ , disjunta de  $\Gamma$ .

- (i) Observe que  $v$  não é homotópico a uma constante em  $C$ . De fato, consideremos a compactação de um ponto de  $C$ . Isto é, um disco  $\hat{C} = C \cup \{\infty\}$ , contendo o disco  $\hat{A}_1 = A_1 \cup \{\infty\}$  que é, também, a compactação de um ponto de  $A_1$ .

Como  $\hat{C}$  é homeomorfa a um cone e o disco definido por  $v$  em  $\hat{C}$  contém  $\{\infty\}$ , isso implica que o disco definido por  $v$  em  $C$  é ilimitado, o que é uma contradição com o fato de que  $v$  é homotopicamente nulo.

- (ii) Se  $\mu \cap \partial M \neq \emptyset$ . Como  $A$  é conexo,  $A \cap C \neq \emptyset$  e  $A \cap \mu = \emptyset$ , então,  $A \subset C$ .
- (iii) Se  $\mu \cap \partial M = \emptyset$ . Como  $A$  é conexo,  $A \cap C \neq \emptyset$  e  $A \cap \mu = \emptyset$ , então,  $A \subset C$ .

Então  $v$  e  $\Gamma$ , juntos, limitam um cilindro compacto  $\bar{B}$ , tal que  $\bar{A} \cap \bar{B} = v$ . Qualquer sequência de pontos de  $C$ , tendendo para um ponto em  $\mu = \bar{C} - C$  deve, eventualmente, ficar dentro de  $A$ , assim,  $\bar{C} = \bar{A} \cup \bar{B}$  e, portanto,  $\bar{C}$  é um cilindro compacto limitado por  $\mu$  e  $\Gamma$ .

**Caso II:**  $\mu$  é de um lado, então,  $\mu \cap \partial M = \emptyset$ . Considere a vizinhança tubular  $V$  de  $\mu$ , tal que  $\bar{V} \cap \partial M = \emptyset$ . Logo,  $\bar{V}$  é uma Faixa de Möbius. Denotemos por  $\nu$  a fronteira de  $\bar{V}$ . Observe que,  $V \setminus \mu$  é conexo, intersecta  $C$ , porém, não  $\mu = \partial C$  o que implica que  $V \subset C$ .

Observe que  $\bar{C} = C \cup \mu$  é fechado e como  $V \subset C$ , então, ele também é aberto, logo  $\bar{C} = M$  é uma variedade com fronteira  $\Gamma$ , observe que  $\nu$  é homotópico a  $\Gamma$ , logo  $M$  é homeomorfo a  $V \cup \{\nu \times [0, 1]\}$ , isto é  $M$  uma Faixa de Möbius.

■

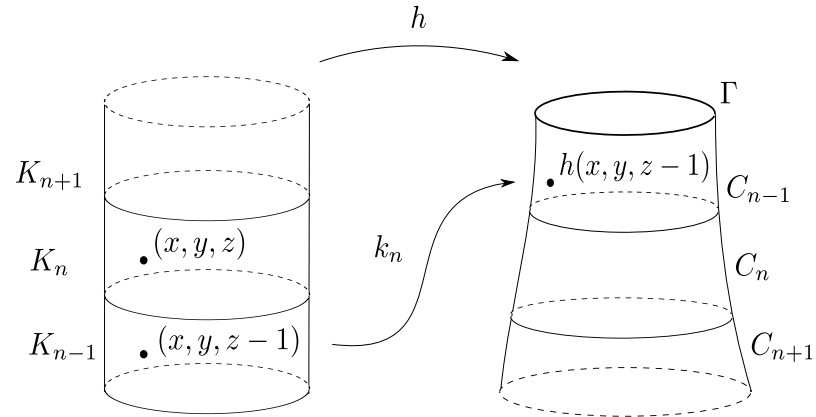


Figura 2.14: Homeomorfismo com o cilindro canônico.

## Capítulo 3

# Campos comutativos sobre superfícies

Neste capítulo, apresentaremos as provas dos resultados principais da dissertação.

**Teorema A:** *Qualquer ação contínua de  $\mathbb{R}^2$  sobre a esfera  $S^2$  admite um ponto fixo.*

**Teorema B:** *Qualquer ação contínua de  $\mathbb{R}^2$  sobre o plano projetivo  $\mathbb{R}P^2$  admite um ponto fixo.*

**Teorema C:** *Qualquer ação contínua de  $\mathbb{R}^k$  sobre uma superfície  $M$ , com  $\chi(M) \neq 0$ , tem um ponto fixo.*

Consideremos a ação  $\varphi : \mathbb{R}^k \times M \rightarrow M$  sobre uma variedade  $M$  e  $\{e_1, e_2, \dots, e_k\}$  a base canônica de  $\mathbb{R}^k$ , então podemos definir para cada  $i \in \{1, 2, \dots, k\}$  a função  $\xi_i : \mathbb{R} \times M \rightarrow M$  como

$$\xi_i(t, p) = \varphi(te_i, p)$$

**Proposição 3.1.** *A função  $\xi_i : \mathbb{R} \times M \rightarrow M$  definida como*

$$\xi_i(t, p) = \varphi(te_i, p)$$

*é um fluxo sobre  $M$ .*

*Demonstração.* Dado uma ação  $\varphi$ , é imediato que:

$$(i) \quad \xi_i(1, p) = \varphi(1e_i, p) = p.$$

$$(ii) \quad \xi_i(t, \xi_j(t, p)) = \varphi(te_i, \varphi(te_j, p)) = \varphi(t(e_i + e_j), p) = \xi_{i+j}(t, p).$$

■

Observe que, se  $X_i$  é o campo de vetores definido sobre  $M$  correspondente ao fluxo  $\xi_i$ . Se  $x \in \text{Sing}(X_i) \subset M$ , isto é,  $X_i(x) = 0$ , se, e somente se,  $\xi_i(t, x) = x$  para todo  $t \in \mathbb{R}$ , isto é,  $x$  é um ponto fixo do fluxo  $\xi_i$ .

Dados  $\xi_i, \xi_j$  fluxos como acima, então,  $\varphi(r_{ij}, x) = \varphi(se_i + te_j, x) = \varphi(se_i, \varphi(te_j, x)) = \xi_i(s, \xi_j(t, x))$  de outro lado  $\varphi(se_i + te_j, x) = \varphi(te_j, \varphi(se_i, x)) = \xi_j(t, \xi_i(s, x))$ , assim,  $\xi_i(s, \xi_j(t, x)) = \xi_j(t, \xi_i(s, x))$  onde  $r_{ij} \in \mathbb{R}^k$  é o único vetor tal que  $r_{ij} \cdot e_i = s$ ,  $r_{ij} \cdot e_j = t$  e  $r_{ij} \cdot e_l = 0$  para  $l \neq i, j$ .

Então, pelo Teorema (1.49), os campos  $X_i$  e  $X_j$  são campos comutativos.

**Definição 3.2.** Um ponto  $x \in M$  é chamado de ponto fixo da ação  $\varphi$  se  $X_i(x) = 0$  para todo  $i = 1, 2, \dots, k$ .

### 3.1 Prova do Teorema A e do Teorema B

Nesta seção usaremos a notação do início do capítulo quando  $k = 2$  e  $M = S^2$  ou  $\mathbb{R}P^2$ . Com base nos preliminares descritos nos capítulos 1 e 2 apresentamos a continuação a prova do Teorema A.

**Teorema 3.3.** Se  $\varphi : \mathbb{R}^2 \times S^2 \rightarrow S^2$  é uma ação contínua, então, existe  $p \in S^2$  tal que  $\varphi(u, p) = p$  para todo  $u \in \mathbb{R}^2$ .

*Demonstração.* Dada a ação  $\varphi : \mathbb{R}^2 \times S^2 \rightarrow S^2$ , consideremos os fluxos por  $\xi_1, \xi_2 : \mathbb{R} \times S^2 \rightarrow S^2$  definidos acima.

Pelo Teorema 1.45, temos que existe  $p \in S^2$  tal que

$$\xi_2^t(p) = \xi_2(t, p) = p \text{ para todo } t \in \mathbb{R}$$

Considere a órbita  $\mathcal{O}_1(p) = \{\xi_1(t, p); t \in \mathbb{R}\}$ . Temos os seguintes fatos:

- (A)  $\mathcal{O}_1(p) \subset \text{Sing}(X_2)$  : De fato, seja  $q \in \mathcal{O}_1(p)$ , então,  $q = \xi_1^s(p)$  para algum  $s \in \mathbb{R}$ , assim  $\xi_2^t(q) = \xi_2^t(\xi_1^s(p)) = \xi_1^s(\xi_2^t(p)) = \xi_1^s(p) = q$ .
- (B)  $\omega_1(p) \cup \alpha_1(p) \subset \text{Sing}(X_2)$  : De fato, seja  $q \in \omega(p)$ , então, existe  $t_n \in \mathbb{R}$  tal que  $t_n \rightarrow +\infty$  e  $q = \lim_{n \rightarrow \infty} \xi_1^{t_n}(p)$ . Por outro lado, seja  $t \in \mathbb{R}$ , então  $\xi_2^t(q) = \xi_2^t(\lim_{n \rightarrow \infty} \xi_1^{t_n}(p)) = \lim_{n \rightarrow \infty} (\xi_2^t(\xi_1^{t_n}(p))) = \lim_{n \rightarrow \infty} (\xi_1^{t_n}(\xi_2^t(p))) = \lim_{n \rightarrow \infty} (\xi_1^{t_n}(p)) = q$ . Se  $q \in \alpha_1(p)$  a prova é análoga.

A prova do resultado será apresentada estudando os dois casos seguintes:

**Caso I:**  $\text{Sing}(X_1) \cap \overline{\mathcal{O}_1(p)} \neq \emptyset$ . Consideremos  $q \in \text{Sing}(X_1) \cap \overline{\mathcal{O}_1(p)}$ , então,  $\xi_1^t(q) = q$  e como  $q \in \overline{\mathcal{O}_1(p)} = \mathcal{O}_1(p) \cup \text{Lim}(\mathcal{O}_1(p))$  e, pelos itens (A) e (B) acima, temos que  $\xi_2^t(q) = q$ . Logo, se  $u \in \mathbb{R}$ , então, temos que existem  $t, s \in \mathbb{R}$  com  $\varphi(u, q) = \varphi(t(1, 0) + s(0, 1), q) = \xi_1^t(\xi_2^s(q)) = q$ , assim, o Teorema ficaria provado.

**Caso II:**  $\text{Sing}(X_1) \cap \overline{\mathcal{O}_1(p)} = \emptyset$ . Seja  $q \in \text{Sing}(X_1)$ , o qual é não vazio pelo Teorema 1.45, então,  $q \notin \overline{\mathcal{O}_1(p)}$ , assim, pelo Teorema de Poincaré-Bendixson (Teorema 1.41) existe uma órbita fechada  $C_1$  para o fluxo  $\xi_1^t$  tal



que  $\omega_1(p) = C_1$  (ou  $\alpha_1(p) = C_1$ ), pelo item (B), temos que  $C_1 \subset \text{Sing}(\xi_2^t)$  ver Figura 3.1.

Pelo Teorema da curva de Jordan 1.39, a curva  $C_1$  é fronteira de um disco  $D_1 \subset S^2$ .

Como  $C_1$  é uma órbita fechada de  $\xi_1^t$  e, pelo item (B) acima, ela está contida em  $\text{Sing}(\xi_1^t)$ , então,  $D_1$  é  $\varphi$ -invariante.

Agora usaremos indução transfinita para mostrar que existe um ponto fixo da ação  $\varphi$  no disco  $D_1$ .

Pelo princípio maximal de Hausdorff 1.2, associado à cadeia não vazia  $\{D_1\}$ , existe uma cadeia maximal  $\mathcal{D}$  como sendo o conjunto de todos os discos fechados  $D$  em  $S^2$ , tal que a fronteira  $C = \partial D$  é uma órbita fechada de  $\xi_1^t$  e com seus pontos todos fixados por  $\xi_2^t$  com a relação de ordem parcial:

$$D_\mu \preceq D_\lambda \text{ se, e somente se } D_\lambda \subset D_\mu$$

**Afirmção:** Se  $D_\lambda \neq D_\mu$  em  $\mathcal{D}$ ,  $D_\lambda \subset D_\mu$  se, e somente se,  $D_\lambda \subset \text{int}(D_\mu)$ .

De fato, Se  $D_\lambda \not\subset \text{int}(D_\mu)$ , então, existe  $y \in D_\lambda$  tal que  $y \in C_\mu$ , assim,  $C_\lambda$  e  $C_\mu$  são órbitas fechadas do fluxo  $\xi_1^t$  com um ponto em comum, logo  $C_\lambda = C_\mu$ , de onde  $D_\lambda = D_\mu$ ; portanto nossa afirmação é verdadeira.

Escrevamos  $C_\lambda = \partial D_\lambda$ . Escolhamos  $x_\lambda \in C_\lambda$  e definamos a rede  $\{x_\lambda\}_{\lambda \in \Lambda} \subset D_1$ , como  $D_1$  é compacto, pelo Teorema 1.18, existe uma subrede convergente  $\{x_\delta\}$  tal que  $x = \lim(x_\delta)$ , como  $\{\delta\}$  é cofinal em  $\{\lambda\}$ , então,  $x \in \cap D_\lambda$ .

Novamente, temos os seguintes fatos:

(A')  $\mathbf{x} \in \text{Sing}(\mathbf{X}_2)$ : De fato, como  $x_\lambda \in C_\lambda$ , então,  $\xi_2^t(x_\lambda) = x_\lambda$  para todo  $t \in \mathbb{R}$ , como  $x_\lambda \rightarrow x$ , então,  $\xi_2^t(x_\lambda) \rightarrow \xi_2^t(x)$ , pelo Teorema 1.19, de onde obtemos o resultado desejado.

(B')  $\overline{\mathcal{O}_1(\mathbf{x})} \subset \text{Sing}(\mathbf{X}_2)$ : Seja  $y \in \overline{\mathcal{O}_1(\mathbf{x})}$ , então, existe  $t_n \in \mathbb{R}$  tal que  $y = \lim_{n \rightarrow \infty} \xi_1^{t_n}(x)$ , assim  $\xi_2^s(y) = \xi_2^s(\lim_{n \rightarrow \infty} \xi_1^{t_n}(x)) = \lim_{n \rightarrow \infty} (\xi_2^s(\xi_1^{t_n}(x))) = \lim_{n \rightarrow \infty} (\xi_1^{t_n}(\xi_2^s(x))) = \lim_{n \rightarrow \infty} (\xi_1^{t_n}(x)) = y$

(C') Como  $\overline{\mathcal{O}_1(\mathbf{x})} \subset D_\lambda$ . **Podemos assumir que  $\overline{\mathcal{O}_1(\mathbf{x})} \cap \text{Sing}(\mathbf{X}_1) = \emptyset$ .** Caso contrário, pelo item (B') acima, existiria um ponto singular comum aos campos  $X_1$  e  $X_2$ , o que provaria o teorema.

Pelo item (C') acima e pelo Teorema de Poincaré-Bendixon 1.40, podemos assumir que,  $\lim \mathcal{O}_1(x) = C_1 \cup C_2$  (ver Figura 3.2), onde cada  $C_i$  é uma órbita fechada de  $\xi_1^t$ , e são tais que seus pontos são todos fixos para  $\xi_2^t$ . Observemos ainda que, ambos círculos topológicos  $C_1, C_2$  estão contidos em todos os discos  $D_\lambda$  com  $\lambda \in \Lambda$  (ver Figura 3.3).

Observe que, para algum  $\lambda_0$ , ou  $C_i = C_{\lambda_0}$  ou  $C_i \subset \text{int}(D_\lambda)$  para todo  $\lambda$ , como na Figura 3.4, com isso temos dois casos novamente:

**Caso I:** Ou  $x \in \text{int}(D_\lambda)$  para todo  $\lambda$ , neste caso, existe um disco tal que  $\partial D = \alpha_1(x)$  ou  $\partial D = \omega_1(x)$ , com  $D \subset \text{int}(D_\lambda)$  e  $D \subset \text{Sing}(X_2)$ , isto é,  $D \in \mathcal{D}$  o que contradiz a maximalidade de  $\mathcal{D}$ .

**Caso II:** Ou  $x \in \partial D_{\lambda_0}$ . Neste caso, temos que  $\overline{\mathcal{O}_1(x)} = \partial D_{\lambda_0}$  e  $\overline{\mathcal{O}_2(x)} = \{x\}$ , então, pelo Corolário 1.41, existe  $y_0 \in \text{int}(D_{\lambda_0})$  tal que  $\xi_1^t(y_0) = y_0$  para todo  $t \in \mathbb{R}$ .

**Afirmção:**  $\xi_2^t(y_0) = y_0$  para todo  $t \in \mathbb{R}$ .

Se  $\xi_2^t(y_0) \neq y_0$  para algum  $t \in \mathbb{R}$  e  $\overline{\mathcal{O}_2(y_0)} \cap \text{Sing}(X_2) \neq \emptyset$ , então, tomando  $w \in \overline{\mathcal{O}_2(y_0)} \cap \text{Sing}(X_2)$ , e pelos mesmos argumentos dos itens (A') e (B'), temos que  $\varphi(u, w) = w$ .

Se  $\xi_2^t(y_0) \neq y_0$  para algum  $t \in \mathbb{R}$  e  $\overline{\mathcal{O}_2(y_0)} \cap \text{Sing}(X_2) = \emptyset$ , pelo Teorema de Poncaré-Bendixson, existe um disco  $D_1 \subset \partial(D_{\lambda_0})$  tal que  $\partial D_1$  é órbita fechada do campo  $X_2$  e  $\partial D_1 \subset \text{Sing}(X_1)$ . Novamente, pelo Teorema de Poncaré-Bendixson, existe  $z_0 \in D_1$  tal que  $\xi_2^t(z_0) = z_0$  e podemos supor que  $\xi_1^t(z_0) \neq z_0$ , usando o mesmo argumento existe  $D \subset \partial(D_{\lambda_0})$  tal que  $\partial D$  é órbita fechada do campo  $X_1$  e  $\partial D \subset \text{Sing}(X_2)$ , isto é,  $D \in \mathcal{D}$  o que, novamente, contradiz a maximalidade de  $\mathcal{D}$ .

Assim, temos que  $\varphi(u, y_0) = y_0$  para todo  $u \in \mathbb{R}^2$ , o que prova o nosso teorema. ■

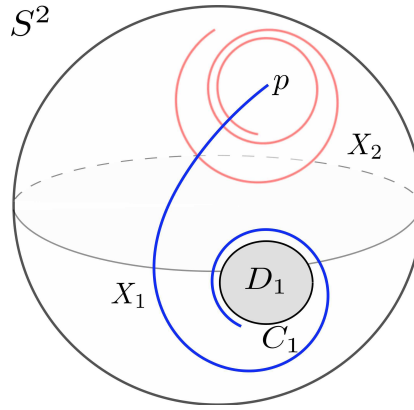


Figura 3.1: Existência da órbita círculo.

A seguir, apresentaremos o mesmo resultado do Teorema A para o plano projetivo real, de fato provaremos:

**Corolário 3.4.** Cada ação contínua do grupo aditivo  $\mathbb{R}^2$  sobre o plano projetivo  $\mathbb{R}P^2$  admite um ponto fixo.

*Demonstração.* Sejam  $\pi : S^2 \rightarrow \mathbb{R}P^2$  um recobrimento (garantido por [7], página 154) e  $\varphi : \mathbb{R}^2 \times \mathbb{R}P^2 \rightarrow \mathbb{R}P^2$  uma ação contínua, então, pelo Lema 2.13 temos que existe uma única ação  $\tilde{\varphi} : \mathbb{R}^2 \times S^2 \rightarrow S^2$

$$\begin{array}{ccccc} & & & S^2 & \\ & & \nearrow \tilde{\varphi} & \downarrow \pi & \\ \mathbb{R}^2 \times S^2 & \xrightarrow{id \times \pi} & \mathbb{R}^2 \times \mathbb{R}P^2 & \xrightarrow{\varphi} & \mathbb{R}P^2 \end{array}$$

que faz o diagrama comutar e pela observação do Lema 2.13, sabemos que se existe um ponto fixo  $p \in S^2$  (o qual existe pelo teorema anterior), então, existe  $\tilde{p} \in S^2$  tal que  $\varphi(u, p) = p$  para todo  $u \in \mathbb{R}^2$  de onde temos que existe  $\tilde{p} = \pi(p) \in \mathbb{R}P^2$  tal que  $\varphi(u, \tilde{p}) = \tilde{p}$  para todo  $u \in \mathbb{R}^2$ , o que prova o resultado. ■

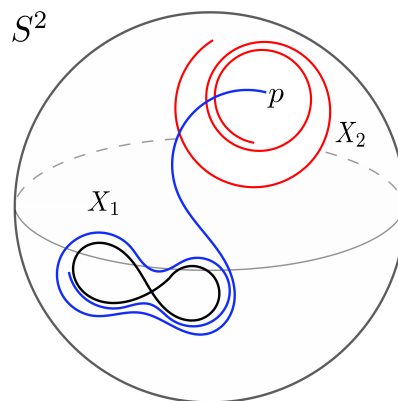


Figura 3.2: Órbita de  $x$ .

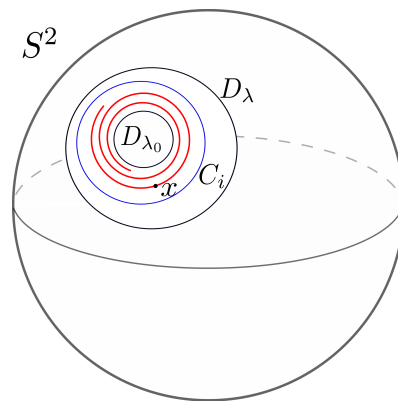
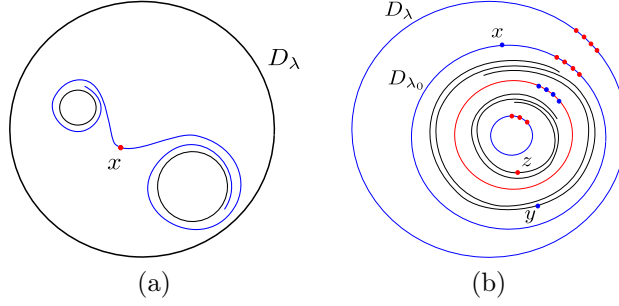


Figura 3.3: Sequência de discos  $D_\lambda$  contendo os  $C_i$ .

**Teorema 3.5.** *Sejam  $X, Y$  campos de vetores de classe  $C^k$ ,  $k \geq 1$  sobre a esfera  $S^2$ , com  $[X, Y] \equiv 0$ . Então, existe um ponto  $p \in S^2$  tal que  $X(p) = Y(p) = 0$ .*

**Corolário 3.6.** *O teorema acima também é válido para o plano projetivo real  $\mathbb{R}P^2$ .*

**Observação 3.7.** *O mesmo tipo de argumento usado para provar o Teorema 3.3, juntamente com um procedimento simples de indução, mostrará que cada ação contínua do grupo aditivo  $\mathbb{R}^m$  ( $m \geq 1$ ) sobre  $S^2$  e, conseqüentemente, sobre  $\mathbb{R}P^2$  tem um ponto fixo. Assim, qualquer conjunto finito  $X_1, \dots, X_m$  de campos*

Figura 3.4: Os possíveis casos dos  $C_i$ .

vetoriais comutáveis emparelhados sobre  $S^2$  (ou  $\mathbb{R}P^2$ ) têm uma singularidade comum.

A prova consiste em fazer indução sob  $n$ , considerando a ação contínua  $\varphi : \mathbb{R}^n \times S^2 \rightarrow S^2$  e sejam  $X_1, \dots, X_n$ ,  $n$  campos comutativos sobre  $S^2$ , então, baseados na prova do Teorema A e pela hipótese indutiva, vamos supor que existe um ponto fixo  $p$  para os  $n - 1$  campos comutativos  $X_2, \dots, X_n$ , isto é,  $\xi_2^t(p) = \xi_3^t(p) = \dots = \xi_n^t(p) = p$ . Pela comutatividade dos fluxos, pode-se provar  $\overline{\mathcal{O}_1(p)} \subset \bigcap_{i=2}^n \text{Sing}(X_i)$ , logo, considerando os dois casos  $\text{Sing}(X_1) \cap \overline{\mathcal{O}_1(p)} \neq \emptyset$  e  $\text{Sing}(X_1) \cap \overline{\mathcal{O}_1(p)} = \emptyset$  os quais são provados com os mesmos argumentos usados para o caso de dois campos comutativos do Teorema A.

## 3.2 Teorema C

Nesta seção apresentaremos a prova do seguinte Teorema.

**Teorema C:** Qualquer ação contínua de  $\mathbb{R}^k$  sobre uma superfície  $M$ , com  $\chi(M) \neq 0$ , tem um ponto fixo.

Inicialmente, apresentaremos alguns lemas auxiliares. Considere uma ação contínua  $\varphi : \mathbb{R}^n \times M \rightarrow M$  com  $M$  superfície compacta.

**Lema 3.8.** Seja  $\varphi : \mathbb{R}^n \times M \rightarrow M$  uma ação contínua e suponhamos que toda ação sobre  $M$  de  $\mathbb{R}^{n-1}$  tem ponto fixo. Se  $\mathcal{M}$  é a coleção de todos os conjuntos  $\varphi$ -minimais em  $M$  e  $\chi(M) \neq 0$ , então, ou  $\varphi$  tem um ponto fixo, ou,  $\mathcal{M}$  é não enumerável, e todos, exceto um número finito de seus elementos, são círculos.

*Demonstração.* Suponhamos que  $\text{Fix}(\varphi) = \emptyset$ . Para cada hiperplano que contém a origem de coordenadas  $H \subset \mathbb{R}^n$ , seja  $\varphi_H$  a ação de  $H$  em  $M$  induzida pela restrição de  $\varphi$ . Pela hipótese indutiva,  $\varphi_H$  tem pelo menos um ponto fixo  $z$  em  $M$ .

Para cada ponto fixo  $z \in M$  da ação  $\varphi_H$ , denotemos  $K(z)$  como sendo o fecho de sua  $\varphi$ -órbita, isto é:

$$K(z) = \overline{\{\varphi(u, z); u \in \mathbb{R}^n \text{ e } z \in \text{Fix}(\varphi_H)\}}$$

- (A) Todos os pontos em  $K(z)$  são pontos fixos da ação  $\varphi_H$ . De fato, seja  $p \in K(z)$ , então, existem  $u_n \in \mathbb{R}^n$  tal que:

$$\varphi(u_n, z) \rightarrow p \quad (3.1)$$

Por outro lado, seja  $h \in H$ , então,  $\varphi(h, \varphi(u_n, z)) \rightarrow \varphi(h, p)$ . Como  $\varphi(u_n, \varphi(h, z)) = \varphi(u_n, z)$ , e pela equação 3.1, temos que  $\varphi(h, p) = p$ .

- (B) Sejam  $L_1, L_2 \subset \mathbb{R}^n$  retas tal que  $\vec{0} \in L_i$  e  $L_i \not\subset H$  para  $i = 1, 2$ , logo,  $\mathcal{O}_{L_1}(x) = \mathcal{O}_{L_2}(x)$  para todo  $x \in K(z)$ . De fato, Seja  $y \in \mathcal{O}_{L_1}(x)$ , então,  $y = \varphi(l_1, x)$  com  $l_1 \in L_1$ , como  $L_2 \not\subset H$ , então, temos que  $\langle H, L_2 \rangle = \mathbb{R}^n$ , assim, existe  $l_2 \in L_2$  e  $h \in H$  tal que  $l_1 = l_2 + h$ , logo, pelo item anterior, temos:

$$y = \varphi(l_1, x) = \varphi(l_2 + h, x) = \varphi(l_2, \varphi(h, x)) = \varphi(l_2, x) \in \mathcal{O}_{L_2}(x)$$

De forma completamente análoga provamos a outra inclusão.

- (C)  $K(z)$  é fechado e  $\varphi$ -invariante e contém pelo menos um conjunto  $\varphi$ -minimal. Por definição, ele é fechado. Agora, tomando  $x \in K(z)$ , seja a reta  $L_1 \not\subset H$ , observe que para provar que ela é  $\varphi$ -invariante, basta provarmos que  $\varphi(l_1, x) \in K(z)$  para todo  $l_1 \in L_1$ , de fato, como  $x \in K(z)$ , então, existe  $\{u_n\} \subset \mathbb{R}^n$  tal que  $\varphi(u_n, z) \rightarrow x$ , logo  $\varphi(l_1 + u_n, z) \rightarrow \varphi(l_1, x)$ , tomando  $v_n = u_n + l_1$ , temos que  $\varphi(l_1, x) \in K(z)$ . Observe que ele contém um conjunto minimal.

Seja

$$\mathcal{M}(H) = \{\mu \subset M; \mu \text{ é } \varphi\text{-minimal e } \varphi(h, w) = w \text{ para todo } w \in \mu \text{ e } h \in H\}$$

Pelo item anterior,  $\mathcal{M}(H) \neq \emptyset$ .

- (D) Dado a reta  $\vec{0} \in L \not\subset H$ , todo  $\mu \in \mathcal{M}(H)$  é um conjunto minimal do fluxo  $\varphi_L$ . De fato, devemos provar as seguintes afirmações:

- $\mu$  é  $\varphi_L$ -invariante. Seja  $y \in \mu$  e  $l \in L$ , consideremos  $h \in H$  arbitrário, então como  $\mu$  é  $\varphi$ -invariante, temos

$$\varphi(l, y) = \varphi(l, \varphi(h, y)) = \varphi(l + h, y) \in \mu$$

Isso prova este item.

- Se  $\nu \subset \mu$  é  $\varphi_L$ -invariante, então,  $\nu = \mu$ . Suponhamos que  $\nu \subsetneq \mu$ . Seja  $y \in \nu$ , como  $\nu$  é  $\varphi_L$ -invariante, temos que  $\varphi(l, y) \in \nu$  para todo  $l \in L$ . Seja  $u \in \mathbb{R}^n$ , então,  $u = l + h$  onde  $l \in L$  e  $h \in H$  assim temos que:

$$\varphi(u, y) = \varphi(l, \varphi(h, y)) = \varphi(l, y) \in \nu$$

Isso prova que  $\nu$  é  $\varphi$ -invariante, assim, deve conter um minimal  $\omega \subsetneq \mu$  o que é uma contradição.

(E) Se  $H_1, H_2$  são hiperplanos distintos contendo a origem, então,  $\mathcal{M}(H_1) \cap \mathcal{M}(H_2) = \emptyset$ . Caso contrário, existiria  $\mu \in \mathcal{M}(H_1) \cap \mathcal{M}(H_2)$ , logo, para cada ponto  $x \in \mu$  teríamos  $x \in \text{Fix}(\varphi_{H_1}) \cap \text{Fix}(\varphi_{H_2})$ . Como  $\langle H_1, H_2 \rangle = \mathbb{R}^n$ , então, para cada  $u \in \mathbb{R}^n$  existe  $h_1 \in H_1$  e  $h_2 \in H_2$  tal que  $u = h_1 + h_2$  de onde temos que  $\varphi(u, x) = \varphi(h_1 + h_2, x) = \varphi(h_1, \varphi(h_2, x)) = \varphi(h_1, x) = x$ , logo,  $x \in \text{Fix}(\varphi)$ , o que é uma contradição com nossa suposição inicial.

Portanto,  $\mathcal{M} = \cup \mathcal{M}(H)$ , onde  $H$  descreve todos os hiperplanos homogêneos de  $\mathbb{R}^n$  é uma coleção não enumerável.

(F) Além disso,  $\mathcal{M}$  contém todos os conjuntos  $\varphi$ -minimais. De fato,

- Dado um conjunto  $\varphi$ -minimal  $\mu$ , a órbita de nenhum ponto  $x \in \mu$  pode conter um ponto interior. Como as órbitas são homeomorfas a  $\mathbb{R}^k \times \mathbb{T}^l$  com  $0 \leq k + l \leq n$ , como  $M$  é superfície, então, estas órbitas podem ser homeomorfas a um ponto, uma reta, o toro  $T^1$ , o cilindro  $T^1 \times \mathbb{R}$ , o plano  $\mathbb{R}^2$  ou o toro  $T^2$ . Observe que este último caso não pode acontecer, pois, em particular, esta órbita é uma subvariedade aberta e fechada de  $M$ , o que implica que  $M = T^2$  e isso contradiz a nossa suposição.

Se existissem órbitas cilindro ou plano, então, a fronteira dos mesmos seriam subconjuntos invariantes e minimais o que contradiz a minimalidade de  $\mu$ .

- Assim, o grupo de isotropia de  $x$  será homeomorfa a  $\mathbb{R}^n$ ,  $\mathbb{Z} \times \mathbb{R}^{n-1}$  ou  $\mathbb{R}^{n-1}$  se a órbita de  $x$  for um ponto, homeomorfa ao círculo ou homeomorfa a uma reta respectivamente. Logo, o grupo de isotropia de  $x$  contém um hiperplano  $H$ .
- Finalmente, sejam  $x, y \in \mu$ , como  $\overline{\mathcal{O}_x} = \overline{\mathcal{O}_y} = \mu$ , então,  $G_x = G_y$ , assim,  $H \subset G_x$  para todo  $x \in \mu$ .

Sejam  $l_1, \dots, l_n$  os eixos de  $\mathbb{R}^n$  e escreva  $\mathcal{M}_i = \cup \{\mathcal{M}(H); H \cap l_i = 0\}$ . Pelo item (D) acima, cada conjunto  $\mu \in \mathcal{M}_i$  é minimal em  $l_i$ . Assim, pelo Lema 2.18, os conjuntos  $\mu \in \mathcal{M}_i$  são todos círculos, exceto, um número finito deles. Mas, claramente,  $\mathcal{M} = \mathcal{M}_1 \cup \dots \cup \mathcal{M}_n$ , porque um determinado hiperplano não pode conter todos os eixos de  $\mathbb{R}^n$ . Portanto, todos os conjuntos em  $\mathcal{M}$  são círculos, com um número finito de exceções. (Observe que, se o gênero de  $M$  é zero, não há exceções). Isso prova o resultado. ■

**Lema 3.9.** Seja  $\varphi : \mathbb{R}^n \times M \rightarrow M$  uma ação contínua e suponhamos que toda ação sobre  $M$  de  $\mathbb{R}^{n-1}$  tem ponto fixo e  $\chi(M) \neq 0$ . Então, ou  $\varphi$  tem um ponto fixo em  $M$  ou podemos encontrar uma órbita unidimensional fechada de  $\varphi$  que é disjunta dos círculos da fronteira de  $M$  e não limita um cilindro junto com nenhum deles.

*Demonstração.* Suponhamos que a ação  $\varphi$  não possua pontos fixos. Seja  $\Gamma$  um círculo fronteira de  $M$ . Considere a coleção  $\{C_\alpha\}$  de todos os cilindros que são abertos em  $M$ , contendo  $\Gamma$  como uma de suas fronteiras e tal que o conjunto de pontos fronteira em relação a  $M$  seja  $\partial C_\alpha = \mu_\alpha$ , uma órbita unidimensional fechada de  $\varphi$ .

(A) A coleção  $\{C_\alpha\}$  é linearmente ordenada por inclusão. Se  $M$  não é um disco, o resultado segue do Lema 2.21; se  $M$  for um disco, então, aplicacando o princípio maximal de Hausdorff e mudando de notação,  $\{C_\alpha\}$  representará uma subfamília maximal ordenada linearmente.

Se  $C = \cup C_n$  é tal que  $C_n = C_\alpha$  para alguns  $\alpha$  e  $C_1 \subset C_2 \subset \dots$ . Além disso, podemos concluir que  $\bar{C}$  é um cilindro compacto com elementos da fronteira  $\Gamma$  e  $\mu$ , pois,  $\mu = \partial C$  é uma curva fechada.

(B)  $x \in \mu$  se, e somente se, existe  $x_n \in \partial C_n$  tais que  $x_n \in C_n$  converge para  $x$ . De fato, existe  $x_n \in C$  tal que  $x_n \rightarrow x$ , como  $C_n$  linearmente ordenado, para  $n$  suficientemente grande, podemos tomar  $x_n \in C_n$ , o recíproco é evidente.

(C)  $\mu$  é minimal. Observe que  $\mu$  é fechado. Seja  $x \in \mu$  e tal que  $\mathcal{O}(x) \not\subset \mu$ , então, existe  $u \in \mathbb{R}^n$  tal que  $\varphi(u, x) \in C_n$  para  $n$  suficientemente grande, isto implica que existe  $z \in \mu_n \cap \mathcal{O}(x) \not\subset \mu$ , o que, claramente, é uma contradição. Assim  $\mu$  é fechado, invariante e não tem singularidades de onde temos que  $\mu$  é minimal.

(D)  $\mathcal{O}_x$  é um círculo. De fato, como  $\mu$  é unidimensional, o grupo de isotropia de  $x$ ,  $G_x$  contém um hiperplano  $H$ , então,  $G_x \cong \mathbb{Z} \times \mathbb{R}^{n-1}$  ou  $G_x \cong \mathbb{R}^{n-1}$ , porém,  $\mathcal{O}_x \subset \mathcal{O}_{x_n}$  de onde temos que  $G_{x_n} \subset G_x$  e, como  $G_{x_n} \cong \mathbb{Z} \times \mathbb{R}^{n-1}$ , temos que  $G_x \cong \mathbb{Z} \times \mathbb{R}^{n-1}$  de onde obtemos o resultado.

O cilindro compacto  $\bar{C}$  é tal que seu conjunto limite em relação a  $M$ ,  $\mu$ , é disjunto das outras curvas da fronteira de  $M$  (pois  $M$  não é um cilindro) e  $M \setminus C$  é uma 2-variedade compacta, homeomorfa com  $M$ . Com  $\mu$  substituindo  $\Gamma$  como um círculo fronteira,  $M \setminus C$  é invariante sob  $\varphi$ , e nenhuma órbita fechada unidimensional de  $\varphi$  em  $M \setminus C$  pode intersectar um cilindro com  $\Gamma$ .

Fazendo a mesma construção com todos os outros círculos de fronteira de  $M$ , obtemos uma variedade  $M' \subset M$  a qual é homeomorfa com  $M$ , invariante sob  $\varphi$  e nenhuma  $\varphi$ -órbita unidimensional fechada em  $M'$  pode intersectar um cilindro com qualquer círculo fronteira de  $M$ . Mas  $\mathcal{X}(M') \neq 0$ , pelo Lema 3.8, existe uma órbita  $\nu$  de  $\varphi$  unidimensional fechada em  $M$ . Como  $\mathcal{M}$  é infinito,  $\nu$  pode ser escolhido disjunto dos círculos fronteira de  $M'$ , assim,  $\nu$  prova o Lema 3.9.

■

### Prova do Teorema C

*Demonstração.* Apresentaremos uma prova usando indução em  $n$ . Para  $n = 1$ , o Teorema é o Lema 2.17. Seja  $n > 1$  e suponha que o teorema tenha sido provado para ações de  $\mathbb{R}^{n-1}$ . Observe que temos que o Lema 3.8 e Lema 3.9 são verdadeiros.

A prova será dada por indução, agora, no gênero  $g$  da variedade  $M$ .

(A) Se  $g = 0$ , consideraremos ainda as seguintes situações:

(A.1)  $M = D^2$ . Se  $\varphi : \mathbb{R}^n \times D^2 \rightarrow D^2$  não tem ponto fixo, então, pelo Lema 3.9, existe uma órbita fechada de  $\varphi$  no interior de  $D^2$ , porém, qualquer órbita destas define um cilindro com  $\partial D^2$ , o que é uma contradição com o Lema 3.9.

(A.2) Se  $M = S^2$ . Dada  $\varphi : \mathbb{R}^n \times S^2 \rightarrow S^2$ , pelo Lema 3.9, existe uma órbita fechada unidimensional  $\mu \subset S^2$ .

Pelo Teorema da Curva de Jordan 1.39,  $\mu$  delimita um disco  $D^2$ . Como  $\mu$  é uma  $\varphi$ -órbita, então,  $D^2$  é invariante e o resultado segue do Item (A.1).

(A.3) Para completarmos o caso de gênero 0, faremos uma terceira indução, desta vez, sobre o número de componentes  $b$  da fronteira de  $M$ .

(A.3.1) Observe que se  $b = 0$ , ou  $b = 1$ , então,  $M = S^2$  ou  $M = D^2$ , respectivamente. E, neste caso, o resultado é verdadeiro pelos itens (A.1) e (A.2) acima.

(A.3.2) Se  $b = 2$ , então,  $M$  é homeomorfo ao cilindro o que implica que  $\chi(M) = 0$ . Observe que este caso não é estudado no Teorema.

(A.3.3) Para iniciarmos a hipótese indutiva sobre  $b$ , consideremos  $b = 3$  e a ação  $\varphi : \mathbb{R}^n \times M \rightarrow M$  sem ponto fixo, então,  $M$  ou é o disco menos dois discos interiores ou  $M$  é a esfera  $S^2$  menos 3 discos.

No primeiro caso, qualquer órbita interior a  $M$  define um cilindro com algum elemento da fronteira o que, claramente, contradiz o Lema 3.9.

Se  $M$  for a esfera  $S^2$  menos 3 discos, usando projeção estereográfica, podemos achar um disco  $D^2$  menos 2 discos interiores e  $\varphi$ -invariante. Assim, esse caso reduz-se ao anterior e temos provado o Teorema para o caso  $b = 3$ .

(A.3.4) Agora, suponha que  $b > 3$  e considere  $\nu$  uma órbita fechada de  $\varphi$  fornecida pelo Lema 3.9. Pelo Lema 3.8, não pode ser fronteira de um cilindro de forma tal que a outra fronteira do mesmo seja uma destas componentes da fronteira, então, podemos assumir que  $\nu$  é uma curva fechada simples contendo  $b'$  círculos da fronteira no seu interior e  $b''$  círculos da fronteira no complementar do interior com  $b' \geq 2$ ,  $b'' \geq 2$  e  $b = b' + b''$ .

Fazendo uma cirurgia em  $M$  a longo de  $\nu$  obtemos duas superfícies  $M'$  e  $M''$  com número de componentes da fronteira menor que  $b$ . Observe que estas superfícies ainda tem gênero zero, daí obteríamos o resultado aplicando à hipótese de indução.



- (B) *Para finalizarmos, suponhamos que  $M$  tem gênero  $g > 0$  e que  $\varphi : \mathbb{R}^n \times M \rightarrow M$  não tem ponto fixo. Suponha que a afirmação é válida para variedades de gênero menor que  $g$ .*

*Escolhamos uma órbita de  $\varphi$ ,  $v$ , fechada e unidimensional fornecida pelo Lema 3.9. Fazendo uma cirurgia em  $M$  ao longo de  $v$ . Obtemos:*

*Ou uma variedade de gênero inferior e a mesma característica de Euler de  $M$ ; ou um par de variedades, ambas com gênero menor que  $g$  e caractetrística de Euler diferente de zero, cuja soma coincide com a característica de Euler de  $M$ .*

*Em ambos casos o Teorema fica provado.*

■

# Referências Bibliográficas

- [1] Aranson, S. Kh.; Belitsky, G. R.; Zhuzhoma, E. V. **Introduction to the qualitative theory of dynamical systems on surfaces.** (English summary) Translated from the Russian manuscript by H. H. McFaden. Translations of Mathematical Monographs, 153. American Mathematical Society, Providence, RI, 1996. xiv+325 pp.
- [2] Arraut, José L. (BR-SPL3-DM); Martins, Luciana F. (BR-PAUL2-MI); Schütz, Dirk (4-DRHM) **On singular foliations on the solid torus.** (English summary) Topology Appl. 160 (2013), no. 13, 1659?1674.
- [3] Bredon, Glen E. **Topology and geometry.** Corrected third printing of the 1993 original. Graduate Texts in Mathematics, 139. Springer-Verlag, New York, 1997. xiv+557 pp.
- [4] Camacho, César; Lins Neto, Alcides. **Geometric theory of foliations.** Translated from the Portuguese by Sue E. Goodman. Birkhäuser Boston, Inc., Boston, MA, 1985. vi+205 pp.
- [5] Godbillon, Claude. **Dynamical systems on surfaces.** Translated from the French by H. G. Helfenstein. Universitext. [University Textbook] Springer-Verlag, Berlin-New York, 1983. ii+201 pp.
- [6] Hatcher, Allen(1-CRNL). **Algebraic topology.** (English summary) Cambridge University Press, Cambridge, 2002. xii+544 pp.
- [7] Kosniowski, Czes. **A first course in algebraic topology.** Cambridge University Press, Cambridge-New York, 1980. viii+269 pp.
- [8] Lee, John M. **Introduction to smooth manifolds.** Graduate Texts in Mathematics, 218. Springer-Verlag, New York, 2003. xviii+628 pp.
- [9] Lima, Elon L. **Common singularities of commuting vector fields on 2-manifolds.** Comment. Math. Helv. 39 1964 97?110.
- [10] Lima, Elon L. **Commuting vector fields on 2-manifolds.** Bull. Amer. Math. Soc. 69 1963 366?368. (Reviewer: T. Ura) 57.48
- [11] Lima, Elon L. **Curso de análise.** Vol. 2. (Portuguese) [Course in analysis. Vol. 2] Projeto Euclides [Euclid Project], 13. Instituto de Matemática Pura e Aplicada, Rio de Janeiro, 1981. ix+547 pp. 26-01

- [12] Lima, Elon L. **Grupo fundamental e espaços de recobrimento**, IMPA, Rio de Janeiro, Brazil (2006).
- [13] Lima, Elon L. **Homologia básica**, IMPA, Rio de Janeiro, Brazil (2012).
- [14] Lima, Elon L. **Variedades diferenciáveis**. (Portuguese) [Differentiable manifolds] Monografias de Matemática [Mathematical Monographs], 15. Instituto de Matemática Pura e Aplicada, Rio de Janeiro, 1977. ii+369 pp.
- [15] Munkres, James R. **Topology**. Second edition of [MR0464128]. Prentice Hall, Inc., Upper Saddle River, NJ, 2000. xvi+537 pp.
- [16] Palis, J. e De Melo W., **Introdução aos sistemas dinâmicos**, Rio de Janeiro, Brazil (1975).
- [17] Sotomayor, Jorge. **Lições de equações diferenciais ordinárias**. (Portuguese) [Lessons on ordinary differential equations] Projeto Euclides [Euclid Project], 11. Instituto de Matemática Pura e Aplicada, Rio de Janeiro, 1979. xvi+327 pp.
- [18] Vazquez, García R., **Lecciones de topología**, UNAM, D.F., México (1995).