Resolução de Sistemas Lineares - Parte I

Prof. Jonathan Esteban Arroyo Silva

Departamento de Ciência da Computação Universidade Federal de São João del-Rei silva.jea@ufsj.edu.br

Sumário

Introdução

Métodos Diretos Eliminação Gaussiana Decomposição LU

Introdução

- Uma equação é dita linear se cada termo contém não mais que uma variável e cada variável aparece na primeira potência
- Um sistema de equações lineares é um conjunto finito de equações lineares nas mesmas variáveis



Definição

Um sistema de equações lineares S com m equações e n incógnitas é dado por:

$$\begin{cases} a_{11}x_1 + a_{12}x_2 + \dots + a_{1n}x_n = b_1 \\ a_{21}x_1 + a_{22}x_2 + \dots + a_{2n}x_n = b_2 \\ & \vdots \\ a_{m1}x_1 + a_{m2}x_2 + \dots + a_{mn}x_n = b_m \end{cases}$$

sendo:

- ▶ $a_{ii} \in \mathbb{R}$ os coeficientes
- ▶ $b_i \in \mathbb{R}$ constantes
- $ightharpoonup x_j \in \mathbb{R}$ as variáveis (ou incógnitas) do problema
- i = 1, ..., m e j = 1, ..., n



Definição II

O sistema de equações lineares S também pode ser escrito na forma matricial como $\mathbf{A}\mathbf{x} = \mathbf{b}$ ou:

$$\begin{bmatrix} a_{11} & a_{12} & \cdots & a_{1n} \\ a_{21} & a_{22} & \cdots & a_{2n} \\ \vdots & \vdots & \vdots & \vdots \\ a_{m1} & a_{m2} & \cdots & a_{mn} \end{bmatrix} \begin{bmatrix} x_1 \\ x_2 \\ \vdots \\ x_n \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} b_1 \\ b_2 \\ \vdots \\ b_m \end{bmatrix}$$

Importância

Sistemas de equações lineares aparecem em diferentes problemas das mais diversas áreas da ciência:

- Análise de estruturas
- Modelagem de circuitos elétricos
- Reações químicas (equilibrar equações)
- Programação linear e não-linear
- Aprendizagem de máquina (regressão/classificação)
- Métodos numéricos
 - Interpolação, mínimos quadrados, solução de equações diferenciais



Classificação dos sistemas

Seja um sistema $\mathbf{A}\mathbf{x} = \mathbf{b}$, com uma matriz quadrada $\mathbf{A} \in \mathbb{R}^{n \times n}$, tem-se as seguintes possibilidades quanto ao vetor solução \mathbf{x} :

- Caso 1: Solução única (consistente e determinado)
- Caso 2: Infinitas soluções (consistente e indeterminado)
- Caso 3: Nenhuma solução (inconsistente)



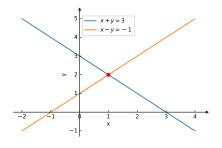
Caso 1 - Exemplo

Seja o sistema $\mathbf{A}\mathbf{x} = \mathbf{b}$, dado por:

$$\begin{bmatrix} 1 & 1 \\ 1 & -1 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} x_1 \\ x_2 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 3 \\ -1 \end{bmatrix}$$

O vetor solução é dado

por:
$$\mathbf{x} = \begin{bmatrix} 1 \\ 2 \end{bmatrix}$$



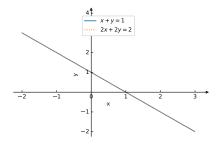


Caso 2 - Exemplo

Seja o sistema $\mathbf{A}\mathbf{x} = \mathbf{b}$, dado por:

$$\left[\begin{array}{cc} 1 & 1 \\ 2 & 2 \end{array}\right] \left[\begin{matrix} x_1 \\ x_2 \end{matrix}\right] = \left[\begin{matrix} 1 \\ 2 \end{matrix}\right]$$

O vetor solução é dado $\text{por: } \mathbf{x} = \begin{bmatrix} 1-\lambda \\ \lambda \end{bmatrix} \text{, sendo}$ $\lambda \in \mathbb{R}$



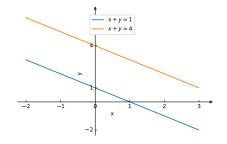


Caso 3 - Exemplo

Seja o sistema $\mathbf{A}\mathbf{x} = \mathbf{b}$, dado por:

$$\left[\begin{array}{cc} 1 & 1 \\ 1 & 1 \end{array}\right] \left[\begin{matrix} x_1 \\ x_2 \end{matrix}\right] = \left[\begin{matrix} 1 \\ 4 \end{matrix}\right]$$

Não existe \mathbf{x} que satisfaça $\mathbf{A}\mathbf{x} = \mathbf{b}$





Existência e Unicidade de solução

Seja uma matriz quadrada $\mathbf{A} \in \mathbb{R}^{n \times n}$, as seguintes afirmações são equivalentes:

- ightharpoonup ightharpoonup ightharpoonup existe
- lacktriangle A única solução para o sistema homogêneo ${f Ay}={f 0}$ é se ${f y}={f 0}$
- ► O posto da matriz **A** é *n*
- ▶ $det(\mathbf{A}) \neq 0$
- ▶ Dado qualquer vetor \mathbf{b} , existe exatamente um vetor \mathbf{x} que satisfaça $\mathbf{A}\mathbf{x} = \mathbf{b}$



Exemplo

Verifique se os exemplos anteriores possuem solução através do cálculo do determinante:



Exemplo

Verifique se os exemplos anteriores possuem solução através do cálculo do determinante:

- Exemplo 1: como o determinante de $\mathbf{A} = \begin{bmatrix} 1 & 1 \\ 1 & -1 \end{bmatrix}$ é igual a $2 \neq 0$, então **existe solução** e é **única**
- Exemplo 2: como o determinante de $\mathbf{A} = \begin{bmatrix} 1 & 1 \\ 2 & 2 \end{bmatrix}$ é igual a 0, então o sistema não tem solução ou a **solução não é única**
- Exemplo 3: como o determinante de $\mathbf{A} = \begin{bmatrix} 1 & 1 \\ 1 & 1 \end{bmatrix}$ é igual a 0, então o sistema **não tem solução** ou a solução não é única



Classificação dos Métodos Numéricos

A partir deste ponto, considera-se que $\bf A$ é uma matriz quadrada e não-singular (tem inversa). Sendo assim, os métodos que serão apresentados podem ser divididos em:

- Métodos diretos: Fornecem a solução exata do problema, a menos de erros de arredondamento, após um número finito de operações
- Métodos iterativos: Geram uma sequência de vetores a partir de uma aproximação inicial e, sob certas condições, essa sequência converge para a solução do problema



Métodos Diretos - Introdução

É chamado de **sistema triangular inferior L** de ordem n o sistema da forma:

$$\begin{bmatrix} I_{11} & 0 & 0 & \cdots & 0 \\ I_{21} & I_{22} & 0 & \cdots & 0 \\ \vdots & \vdots & \vdots & \ddots & \vdots \\ I_{n1} & I_{n2} & I_{n3} & \cdots & I_{nn} \end{bmatrix} \begin{bmatrix} x_1 \\ x_2 \\ \vdots \\ x_n \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} b_1 \\ b_2 \\ \vdots \\ b_n \end{bmatrix}$$



Métodos Diretos - Introdução

É chamado de **sistema triangular inferior L** de ordem n o sistema da forma:

$$\begin{bmatrix} l_{11} & 0 & 0 & \cdots & 0 \\ l_{21} & l_{22} & 0 & \cdots & 0 \\ \vdots & \vdots & \vdots & \ddots & \vdots \\ l_{n1} & l_{n2} & l_{n3} & \cdots & l_{nn} \end{bmatrix} \begin{bmatrix} x_1 \\ x_2 \\ \vdots \\ x_n \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} b_1 \\ b_2 \\ \vdots \\ b_n \end{bmatrix}$$

Um sistema triangular superior U de ordem n é dado de forma análoga.



Substituição - I

A resolução de um sistema desta forma é dado pelo procedimento chamado de **substituição** ou substituições sucessivas:

$$l_{11}x_1 = b_1 \Rightarrow x_1 = b_1/l_{11}$$

$$l_{21}x_1 + l_{22}x_2 = b_2 \Rightarrow x_2 = (b_2 - l_{21}x_1)/l_{22}$$

$$\vdots$$

$$l_{n1}x_1 + l_{n2}x_2 + \dots + l_{nn}x_n = b_n \Rightarrow$$

$$x_n = (b_n - l_{n1}x_1 - l_{n2}x_2 - \dots - l_{n,n-1}x_{n-1})/l_{nn}$$

Sendo os valores em vermelho ou dados ou calculados ao longo do processo.



Substituição - II

Outra forma de apresentar a resolução por substituição é a seguinte:

$$x_i = \left(b_i - \sum_{j=1}^{i-1} l_{ij} x_j\right) / l_{ii}, \quad i = 1, \dots, n$$

sendo o lado direito composto com valores dados ou calculados ao longo do processo.



Substituição - Exemplo

Resolva o seguinte sistema triangular inferior:

$$\begin{bmatrix} 2 & 0 & 0 & 0 \\ 3 & 5 & 0 & 0 \\ 1 & -6 & 8 & 0 \\ -1 & 4 & -3 & 9 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} x_1 \\ x_2 \\ x_3 \\ x_4 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 4 \\ 1 \\ 48 \\ 0 \end{bmatrix}$$

Substituição - Exemplo

Resolva o seguinte sistema triangular inferior:

$$\begin{bmatrix} 2 & 0 & 0 & 0 \\ 3 & 5 & 0 & 0 \\ 1 & -6 & 8 & 0 \\ -1 & 4 & -3 & 9 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} x_1 \\ x_2 \\ x_3 \\ x_4 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 4 \\ 1 \\ 48 \\ 0 \end{bmatrix}$$

Solução:

$$2x_1 = 4 \Rightarrow x_1 = 4/2 = 2$$

$$3x_1 + 5x_2 = 1 \Rightarrow x_2 = (1 - 3 \cdot 2)/5 = -1$$

$$x_1 - 6x_2 + 8x_3 = 48 \Rightarrow x_3 = (48 - 2 - (-6) \cdot (-1))/8 = 5$$

$$-x_1 + 4x_2 - 3x_3 + 9x_4 = 0 \Rightarrow$$

$$x_4 = (-(-1) \cdot 2 - 4 \cdot (-1) - (-3) \cdot 5)/9 = 21/9 = 7/3$$



Substituição - III

Assim, dada a matriz \mathbf{L} e o vetor \mathbf{b} , o algoritmo do procedimento de substituição pode ser descrito como:

Algoritmo

```
\begin{array}{l} x_1 \leftarrow b_1/L_{11} \\ \text{soma} \leftarrow 0 \\ \text{Para i = 2,...,n, faça:} \\ \text{soma} \leftarrow b_i \\ \text{Para j = 1,...,i-1, faça:} \\ \text{soma} \leftarrow \text{soma} - L_{ij} * x_j \\ x_i \leftarrow \text{soma}/L_{ii} \end{array}
```



Retro-substituição

De forma análoga, dado um sistema triangular superior com uma matriz \mathbf{U} e vetor \mathbf{b} , o algoritmo do procedimento de retro-substituição pode ser descrito como:

Algoritmo

```
\begin{array}{l} x_n \;\leftarrow\; b_n/L_{nn} \\[2mm] \text{soma} \;\leftarrow\; 0 \\[2mm] \text{Para i = n-1,...,1, faça:} \\[2mm] \text{soma} \;\leftarrow\; b_i \\[2mm] \text{Para j = i+1,...,n, faça:} \\[2mm] \text{soma} \;\leftarrow\; \text{soma} \;-\; L_{ij} \;*\; x_j \\[2mm] x_i \;\leftarrow\; \text{soma}/U_{ii} \end{array}
```



Método de Eliminação Gaussiana

A ideia fundamental do método é transformar a matriz **A** numa matriz triangular superior utilizando **operações elementares** sobre as linhas da matriz original, para em seguida usar a retro-substituição

- Mais precisamente, utilizaremos a operação que consiste em substituir uma equação (linha da matriz) pela diferença entre essa mesma equação e uma outra equação multiplicada por uma constante diferente de zero
- Tal operação não altera a solução do sistema, isto é, obtêm-se com ela outro sistema equivalente ao original (desde que aplicado a todo o sistema)
- Para isso utilizaremos o conceito de matriz estendida (ou aumentada)



Seja o sistema

$$\begin{bmatrix} 2 & 1 & 1 \\ 4 & -6 & 0 \\ -2 & 7 & 2 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} x_1 \\ x_2 \\ x_3 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 26 \\ 7 \\ 91 \end{bmatrix}$$

aplique o método de Eliminação Gaussiana.



Passo 1: Montar a matriz estendida

$$\left[\begin{array}{ccc|c}
2 & 1 & 1 & 26 \\
4 & -6 & 0 & 7 \\
-2 & 7 & 2 & 91
\end{array}\right]$$

Passo 2: Calcular as constantes para aplicar as operações elementares

$$m_{21} = \frac{a_{21}}{a_{11}} = 4/2 = 2$$

 $m_{31} = \frac{a_{31}}{a_{11}} = -2/2 = -1$



Passo 3: Aplicar as operações elementares nas respectivas linhas

$$L_2 \leftarrow L_2 - m_{21} \cdot L_1 = L_2 - 2 \cdot L_1$$

 $L_3 \leftarrow L_3 - m_{31} \cdot L_1 = L_3 + 1 \cdot L_1$

Resultando no seguinte sistema:

$$\left[\begin{array}{ccc|ccc}
2 & 1 & 1 & 26 \\
0 & -8 & -2 & -45 \\
0 & 8 & 3 & 117
\end{array}\right]$$



Passo 4: Repetir o Passo 2 na próxima coluna

$$m_{32} = \frac{a_{32}}{a_{22}} = 8/(-8) = -1$$

Passo 5: Repetir o Passo 3 nas respectivas linhas

$$L_3 \leftarrow L_3 - m_{32} \cdot L_2 = L_3 + 1 \cdot L_2$$

Resultando no seguinte sistema:

$$\left[\begin{array}{ccc|c}
2 & 1 & 1 & 26 \\
0 & -8 & -2 & -45 \\
0 & 0 & 1 & 72
\end{array}\right]$$



Método de Eliminação Gaussiana

Ao utilizar apenas **operações elementares** foi possível chegar a um sistema equivalente ao original, que é possível de resolver facilmente por retro-substituição, como comentado anteriormente.



Decomposição LU

A ideia fundamental do método é que uma matriz quadrada pode ser escrita como o produto de duas matrizes \mathbf{L} e \mathbf{U} , respectivamente, uma matriz triangular inferior e superior. Ou seja, a matriz original \mathbf{A} pode ser escrita como:

$$A = LU$$

Assim, podemos reescrever o sistema da seguinte forma:

$$Ax = b \to LUx = b \tag{1}$$



Decomposição LU

Supondo que $\mathbf{U}\mathbf{x} = \mathbf{y}$, um vetor \mathbf{y} que neste momento não conheço (vetor de incógnitas), da equação 1 podemos escrever:

$$Ly = b$$

e resolver o sistema para encontrar ${\bf y}$.

Ao saber os valores de **y**, será possível resolver o sistema:

$$Ux = y$$

e encontrar os valores para x.



Decomposição LU - Detalhes

- Como L é triangular inferior podemos resolver Ly = b facilmente usando o algoritmo de substituição
- Como U é uma matriz triangular superior, podemos resolver este sistema usando o algoritmo da retro-substituição



Decomposição LU - Condição de existência

Seja **A** uma matriz quadrada de ordem $n \in \mathbf{A}_k$ o menor principal, composto das k primeiras linhas e k primeiras colunas de **A**. Se $\det(\mathbf{A}_k) \neq 0$ para $k = 1, 2, \dots, n-1$. Então existe:

- uma **única** matriz triangular inferior $\mathbf{L} = (l_{ij})$ com $l_{ii} = 1$, para i = 1, ..., n
- ightharpoonup uma **única** matriz triangular superior $\mathbf{U} = (u_{ij})$

De forma que $\mathbf{A} = \mathbf{L}\mathbf{U}$, além disso, $\det(\mathbf{A}) = u_{11}u_{22} \dots u_{nn}$



Como visto em Álgebra linear, as **operações elementares** podem ser vistas como matrizes. Tendo isso em mente, faremos o exemplo anterior novamente.

Seja o sistema:

$$\begin{bmatrix} 2 & 1 & 1 \\ 4 & -6 & 0 \\ -2 & 7 & 2 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} x_1 \\ x_2 \\ x_3 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 26 \\ 7 \\ 91 \end{bmatrix}$$

aplique o método de Eliminação Gaussiana.



Como trabalharemos com matrizes não é necessário montar a matriz estendida, assim, podemos pular o **Passo 1** do método anterior.

Passo 1: Calcular as constantes para aplicar as operações elementares

$$m_{21} = 2$$

 $m_{31} = -1$

Passo 2: Montar a matriz de operações elementares utilizando as constantes calculadas no passo anterior

$$\mathbf{M}_1 = \left[\begin{array}{rrr} 1 & 0 & 0 \\ -m_{21} & 1 & 0 \\ -m_{31} & 0 & 1 \end{array} \right] = \left[\begin{array}{rrr} 1 & 0 & 0 \\ -2 & 1 & 0 \\ 1 & 0 & 1 \end{array} \right]$$



Passo 3: Multiplicar a matriz de operações elementares nos dois lados da igualdade pelo lado esquerdo

$$\mathbf{M}_{1}\mathbf{A}\mathbf{x} = \mathbf{M}_{1}\mathbf{b}$$

$$\begin{bmatrix} 1 & 0 & 0 \\ -2 & 1 & 0 \\ 1 & 0 & 1 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} 2 & 1 & 1 \\ 4 & -6 & 0 \\ -2 & 7 & 2 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} x_{1} \\ x_{2} \\ x_{3} \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 1 & 0 & 0 \\ -2 & 1 & 0 \\ 1 & 0 & 1 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} 26 \\ 7 \\ 91 \end{bmatrix}$$

$$\begin{bmatrix} 2 & 1 & 1 \\ 0 & -8 & -2 \\ 0 & 8 & 3 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} x_{1} \\ x_{2} \\ x_{3} \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 26 \\ -45 \\ 117 \end{bmatrix}$$



Repare na semelhança entre os resultados parciais de ambas as abordagens.

Passo 4: Repetir o Passo 1 para a próxima coluna

$$m_{32} = -1$$

Passo 5: Repetir o Passo 2 utilizando as novas constantes

$$\mathbf{M}_2 = \begin{bmatrix} 1 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & 0 \\ 0 & -m_{32} & 1 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 1 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & 0 \\ 0 & 1 & 1 \end{bmatrix}$$



Passo 6: Multiplicar a matriz de operações elementares nos dois lados da igualdade pelo lado esquerdo

$$\mathbf{M}_{2}\mathbf{M}_{1}\mathbf{A}\mathbf{x} = \mathbf{M}_{2}\mathbf{M}_{1}\mathbf{b}$$

$$\begin{bmatrix} 1 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & 0 \\ 0 & 1 & 1 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} 2 & 1 & 1 \\ 0 & -8 & -2 \\ 0 & 8 & 3 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} x_{1} \\ x_{2} \\ x_{3} \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 1 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & 0 \\ 0 & 1 & 1 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} 26 \\ -45 \\ 117 \end{bmatrix}$$

$$\begin{bmatrix} 2 & 1 & 1 \\ 0 & -8 & -2 \\ 0 & 0 & 1 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} x_{1} \\ x_{2} \\ x_{3} \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 26 \\ -45 \\ 72 \end{bmatrix}$$



Após o último passo chegamos na matriz triangular superior desejada, ou seja:

$$M_2M_1A = U$$

Chamando $\mathbf{M}_2\mathbf{M}_1 = \mathbf{M}$, teremos:

$$\mathsf{MA} = \mathsf{U} o \mathsf{A} = \mathsf{M}^{-1}\mathsf{U}$$

pela **condição de existência** das matrizes ${\bf L}$ e ${\bf U}$, elas são únicas, logo, chamando ${\bf M}^{-1}={\bf L}$, teremos:

$$A = LU$$

Para maiores detalhes ler *Michael T. Heath. Scientific Computing. An Introductory Survey (2018). pags. 65-68.*



Tudo isso para mostrar que:

$$\mathbf{A} = \mathbf{L}\mathbf{U}$$

$$\begin{bmatrix} 2 & 1 & 1 \\ 4 & -6 & 0 \\ -2 & 7 & 2 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 1 & 0 & 0 \\ m_{21} & 1 & 0 \\ m_{31} & m_{32} & 1 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} 2 & 1 & 1 \\ 0 & -8 & -2 \\ 0 & 0 & 1 \end{bmatrix}$$

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

Assim, é possível montar as matrizes da **Decomposição LU** através do **Método de eliminação gaussiana** (sem utilizar o conceito de matriz estendida).



Decomposição LU - Mais detalhes

A decomposição LU entretanto é importante do ponto de vista computacional, uma vez que é normal acontecerem problemas matemáticos onde apenas o vetor **b** muda de valores e a matriz **A** se mantém fixa. Logo, tendo realizado previamente a decomposição de **A** em **L** e **U**, precisaríamos apenas resolver:

$$Ly = b$$

e em seguida:

$$Ux = y$$

para encontrar \mathbf{x} , ao invés de ter que transformar a matriz \mathbf{A} em triangular toda vez que mudamos o vetor \mathbf{b} .



Decomposição LU - Eliminação gaussiana

Inicializando as matrizes L e U como matrizes identidade e copia da matriz A, respectivamente, teremos:

Algoritmo

```
Para k = 1, ..., n-1, faça:

Se U_{kk} == 0 faça:

BREAK

Para i = k+1, ..., n, faça:

L_{ik} \leftarrow U_{ik} / U_{kk}

Para j = k, ..., n, faça:

Para i = k+1, ..., n, faça:

U_{ij} \leftarrow U_{ij} - L_{ik} * U_{kj}
```



Exemplo - Implementação

Link para exemplo interative



Conclusão I

Foram abordados os seguintes assuntos:

- Definição de sistema linear e a sua importância na ciência
- Classificação dos sistemas lineares: solução única, infinitas soluções, nenhuma solução
- Existência e unicidade da solução



Conclusão II

- Classificação dos métodos numéricos para resolver este tipo de problema: métodos diretos e métodos iterativos
- Introdução aos métodos diretos
- Sistemas triangulares, inferior e superior, assim como a sua resolução por substituição e retro-substituição respectivamente



Conclusão III

- Método de eliminação gaussiana utilizando matriz estendida
- Conceito de decomposição LU, condição de existência
- Montagem das matrizes L e U através do método de eliminação gaussiana



