

COMO O MATLAB TRATA SISTEMAS LINEARES

Hamilton Leckar

Doutorado em Matemática - UNICAMP

Professor Adjunto - GMA/UFF

E-mail: GMAHAFL@VM.UFF.BR

Rubens Sampaio

Doutorado em Matemática - Carnegie -

Mellon University - USA

Professor Titular GMA/UFF (Aposentado)

E-mail: rsampaio@mec.puc-rio.br

COMO O MATLAB TRATA SISTEMAS LINEARES

1 Introdução

Estas notas estão divididas em duas partes principais. Na primeira parte, calculamos com o MATLAB uma aproximação da solução de um sistema linear $AX = b$, através de alguns exemplos nos três casos seguintes:

- O sistema tem uma única solução.
- O sistema tem uma infinidade de soluções.
- O sistema não tem solução.

Em cada caso, comparamos a resposta dada usualmente pelo MATLAB com a resposta obtida por um outro programa *solsis*¹ que procura simular uma possível resolução à mão.

Na segunda parte, associamos a qualquer sistema linear, um novo problema (na verdade, uma extensão não linear), que tem uma única solução. Trata-se do seguinte problema de otimização:

PROBLEMA: Achar um vetor coluna X de coordenadas x_1, \dots, x_n com norma² mínima, tal que b_1^*, \dots, b_m^* onde

$b_1^* = a_{11}x_1 + \dots + a_{1n}x_n, \dots, b_m^* = a_{m1}x_1 + \dots + a_{mn}x_n$ compõem o vetor coluna b^* mais próximo³ de b .

Em seguida, usando o MATLAB, aproximamos a solução desse novo problema, a partir da *pseudo-inversa da matriz do sistema correspondente*.

2 Sistemas Lineares

Iniciaremos com um sistema linear geral

$$\begin{cases} a_{11}x_1 + \dots + a_{1n}x_n = b_1 \\ a_{21}x_1 + \dots + a_{2n}x_n = b_2 \\ \vdots \\ a_{m1}x_1 + \dots + a_{mn}x_n = b_m \end{cases} \quad (1)$$

de m equações nas n incógnitas x_1, \dots, x_n .

Classicamente o problema importante que se coloca para esse sistema é o seguinte:

“Dadas as constantes $a_{11}, \dots, a_{1n}, a_{21}, \dots, a_{2n}, \dots, a_{m1}, \dots, a_{mn}$ e as constantes b_1, \dots, b_m , achar números x_1, \dots, x_n para os quais todas as equações em (1) são simultaneamente verdadeiras.”

¹ Os *solsis* são programas simples (Apêndice C de [7]) com objetivo didático, que fizemos usando a decomposição valor singular de A (Apêndice B de [7]).

² a ser definida

³ sentido a ser definido

Um tal conjunto x_1, \dots, x_n satisfazendo (1) é chamado *solução*.

2.1 Exemplos ilustrativos

Consideramos alguns exemplos que servirão como base para ilustrar os conceitos desenvolvidos neste trabalho.

Sistema 1 (Duas equações e duas incógnitas)

$$\begin{cases} 0,97x_1 + 1,72x_2 = 1 \\ 2,28x_1 + 0,96x_2 = 2 \end{cases}$$

A solução desse sistema é $x_1 = \frac{744}{900} = 0,82666\dots$

e $x_2 = 12$.

Sistema 2 (Duas equações e duas incógnitas)

$$\begin{cases} 0,96x_1 + 1,72x_2 + 0,76x_3 = 1 \\ 2,28x_1 + 0,96x_2 - 1,32x_3 = 2 \end{cases}$$

As soluções desse sistema são dadas por $x_1 = \frac{744}{900} + c$, $x_2 = \frac{12}{100} - c$ e $x_3 = c$ com c real arbitrário. Temos então uma família de soluções descritas pelo parâmetro c .

Sistema 3 (Três equações e duas incógnitas)

$$\begin{cases} 0,96x_1 + 1,72x_2 = 1 \\ 2,28x_1 + 0,96x_2 = 2 \\ 1,32x_1 - 0,76x_2 = 3 \end{cases}$$

Este sistema não tem solução. No entanto se a terceira equação for substituída por

$1,32x_1 - 0,76x_2 = 1$ mantidas as demais, teremos o sistema

Sistema 4

$$\begin{cases} 0,96x_1 + 1,72x_2 = 1 \\ 2,28x_1 + 0,96x_2 = 2 \\ 1,32x_1 - 0,76x_2 = 1 \end{cases}$$

o qual tem $x_1 = \frac{744}{900} = 0,82666\dots$ e $x_2 = 12$ como solução.

Sistema 5 (Três equações e três incógnitas)

$$\begin{cases} 0,96x_1 + 1,72x_2 + 0,76x_3 = 1 \\ 2,28x_1 + 0,96x_2 - 1,32x_3 = 2 \\ 1,32x_1 - 0,76x_2 - 2,08x_3 = 1 \end{cases}$$

Este sistema tem como solução geral $x_1 = \frac{744}{900} + c$, $x_2 = \frac{12}{100} - c$ e $x_3 = c$ com c real arbitrário. Por outro lado, o sistema

Sistema 6

$$\begin{cases} 0,96x_1 + 1,72x_2 + 0,76x_3 = 1 \\ 2,28x_1 + 0,96x_2 - 1,32x_3 = 2 \\ 1,32x_1 - 0,76x_2 - 2,08x_3 = 3 \end{cases}$$

não tem solução.

Terminologia: Um sistema linear em geral pode ser **possível (consistente)** ou **impossível (inconsistente)**.

- **Sistema possível** é aquele que tem ao menos uma solução.

Exemplo: Sistemas 1, 2, 4 e 5.

Além disso é

possível determinado, se tem uma única solução.

Exemplo: Sistemas 1 e 5.

possível indeterminado, se tem mais de uma solução.

Exemplo: Sistemas 2 e 5.

- **Sistema impossível** é aquele que não tem solução.

Exemplo: Sistemas 3 e 6.

Observação: Diversos são os métodos que podemos empregar para estudar um dado sistema linear. Dentre eles, existe um teorema clássico de *Rouché-Capelli*, que nos permite decidir quando um dado sistema linear é possível ou impossível e, se possível, saber se é determinado ou não. Ainda mais, no caso de um sistema "quadrado" (quando o número de equações é igual ao número de incógnitas) *possível determinado*, há a bem conhecida *Regra de Cramer* para calcular explicitamente sua única solução.

Hoje em dia, por questões práticas, é preciso resolver sistemas lineares com um grande número de equações e incógnitas. Neste caso, resolução analítica é uma tarefa, no mínimo, desanimadora. Por isso, precisamos escolher um método adequado e usar o Computador⁴.

2.2 Aproximação da Solução com o MATLAB**2.2.1 Sistema Linear na forma Matricial**

O MATLAB opera essencialmente com MATRIZES. Daí, o primeiro passo é transformar nosso sistema linear de m equações e n incógnitas na forma de uma equação matricial equivalente. O sistema é escrito como uma *única equação* onde as operações de adição e multiplicação em cada equação do sistema é traduzida como operações correspondentes com matrizes.

Deste modo, o sistema (1) se escreve na forma matricial como

$$AX = b \quad (2)$$

onde

$$A = \begin{bmatrix} a_{11} & \dots & a_{1n} \\ a_{21} & \dots & a_{2n} \\ \vdots & \ddots & \vdots \\ a_{m1} & \dots & a_{mn} \end{bmatrix}, X = \begin{bmatrix} x_1 \\ x_2 \\ \vdots \\ x_n \end{bmatrix} \text{ e } b = \begin{bmatrix} b_1 \\ b_2 \\ \vdots \\ b_m \end{bmatrix} \quad (3)$$

A é a matriz do sistema, podendo ser quadrada ou retangular.

b é o termo independente do sistema, tem o mesmo número de linhas m que A .

X é a matriz incógnita do sistema, tem tantas linhas quanto número de colunas n de A .

⁴Veja por exemplo a seção 3.2.1 da referência [8].

Tabela 1 - Forma Matricial dos Sistemas

Sistema	$AX=b$
$\begin{cases} 0,97x_1 + 1,72x_2 = 1 \\ 2,28x_1 + 0,96x_2 = 2 \end{cases}$	$\begin{bmatrix} 0,96 & 1,72 \\ 2,28 & 0,96 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} x_1 \\ x_2 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 1 \\ 2 \end{bmatrix}$
$\begin{cases} 0,96x_1 + 1,72x_2 + 0,76x_3 = 1 \\ 2,28x_1 + 0,96x_2 - 1,32x_3 = 2 \end{cases}$	$\begin{bmatrix} 0,96 & 1,72 & 0,76 \\ 2,28 & 0,96 & -1,32 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} x_1 \\ x_2 \\ x_3 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 1 \\ 2 \end{bmatrix}$
$\begin{cases} 0,96x_1 + 1,72x_2 = 1 \\ 2,28x_1 + 0,96x_2 = 2 \\ 1,32x_1 - 0,76x_2 = 3 \end{cases}$	$\begin{bmatrix} 0,96 & 1,72 \\ 2,28 & 0,96 \\ 1,32 & -0,76 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} x_1 \\ x_2 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 1 \\ 2 \\ 3 \end{bmatrix}$
$\begin{cases} 0,96x_1 + 1,72x_2 = 1 \\ 2,28x_1 + 0,96x_2 = 2 \\ 1,32x_1 - 0,76x_2 = 1 \end{cases}$	$\begin{bmatrix} 0,96 & 1,72 \\ 2,28 & 0,96 \\ 1,32 & -0,76 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} x_1 \\ x_2 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 1 \\ 2 \\ 1 \end{bmatrix}$
$\begin{cases} 0,96x_1 + 1,72x_2 + 0,76x_3 = 1 \\ 2,28x_1 + 0,96x_2 - 1,32x_3 = 2 \\ 1,32x_1 - 0,76x_2 - 2,08x_3 = 1 \end{cases}$	$\begin{bmatrix} 0,96 & 1,72 & 0,76 \\ 2,28 & 0,96 & -1,32 \\ 1,32 & -0,76 & -2,08 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} x_1 \\ x_2 \\ x_3 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 1 \\ 2 \\ 1 \end{bmatrix}$
$\begin{cases} 0,96x_1 + 1,72x_2 + 0,76x_3 = 1 \\ 2,28x_1 + 0,96x_2 - 1,32x_3 = 2 \\ 1,32x_1 - 0,76x_2 - 2,08x_3 = 3 \end{cases}$	$\begin{bmatrix} 0,96 & 1,72 & 0,76 \\ 2,28 & 0,96 & -1,32 \\ 1,32 & -0,76 & -2,08 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} x_1 \\ x_2 \\ x_3 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 1 \\ 2 \\ 3 \end{bmatrix}$

2.2.2 Aproximação da Solução

Quando a matriz A do sistema é quadrada e inversível, a solução é dada formalmente por $X = A^{-1} b$. No entanto, inverter diretamente a matriz A não é uma tarefa computacional muito simples.

Achar $X = A^{-1} b$ com o MATLAB corresponde à operação $X = A \setminus b$ a qual usa eliminação Gaussiana e não calcula a matriz A^{-1} diretamente. Quando a matriz A não é quadrada, a operação $A \setminus b$ varia de acordo com propriedades da matriz A . Por exemplo, se as colunas de A são linearmente independentes, $A \setminus b$ usa a decomposição ortogonal de A .

Vemos em seguida, a resposta obtida para cada sistema exemplo, usando primeiramente a função $A \setminus b$ e em seguida a resposta dada pelos **solsis**⁵, os quais são programas simples, com objetivo didático, que fizemos usando a decomposição **valor singular de A** ⁶. Esses resultados são comparados com as soluções de cada sistema na Tabela 2.

⁵Veja no Apêndice C de [7].

⁶Veja no Apêndice B de [7].

Tabela 2 - Aproximação da Solução com o MATLAB

Sistema	Solução	$A \setminus b$	Solsis
1	0,82666... 0,12000...	0,8267 0,1200	0,8267 0,1200
2	0,82666...+c 0,12000...-c 0...+c	0,8267 0,1200 0	0,5911 + c0,5774 0,3556 - c0,5774 -0,2356 + c0,5774
3	não tem solução	1,4222 -0,6000	Sistema impossível
4	0,82666... 0,12000...	0,8267 0,1200	0,8267 0,1200
5	0,82666...+c 0,12000...-c 0...+c	Cuidado: Res. impreciso	0,5911 + c0,5774 0,3556 - c0,5774 -0,2356 + c0,5774
6	não tem solução	Cuidado: Res. impreciso	Sistema impossível

Algumas Conclusões da Tabela 2:

- Se A é matriz quadrada inversível então $A \setminus b$ dá uma aproximação da solução
- Se A é matriz quadrada não inversível então $A \setminus b$ é passível de erro.
- Se A é matriz não quadrada com mais linhas do que colunas e o sistema é possível determinado então $A \setminus b$ dá uma aproximação da solução.

3 Extensão. Solução no sentido de Mínimos Quadrados

Objetivo: Dar sentido analítico e computacional ao seguinte problema de otimização:

Seja A uma matriz qualquer e b um vetor coluna cujo número de linhas é igual ao número de linhas de A .

Achar um vetor coluna X de norma (a ser escolhida) mínima, tal que $b^* = AX$ é o vetor mais próximo de b (num sentido a ser estabelecido).

3.1 Interpretação Geométrica do Conjunto de Soluções de $AX = b$

Vamos escrever AX da seguinte forma:

$$x_1 A_1 + x_2 A_2 + \dots + x_n A_n,$$

onde A_1, A_2, \dots, A_n são as colunas da matriz A , ou seja, na forma de uma combinação linear das colunas de A , tendo como coeficientes as coordenadas x_1, \dots, x_n do vetor X . O conjunto de todas essas combinações lineares é chamado de *conjunto imagem* de A . Deste modo, um sistema $AX = b$ terá solução se a coluna dada b pertencer ao conjunto imagem de A , caso contrário, não tem solução. Na primeira hipótese, o sistema terá solução única se as colunas de A forem linearmente independentes, caso contrário, isto é, se as colunas de A forem linearmente dependentes, terá uma infinidade de soluções.

O problema geral enunciado na introdução, que vamos associar a um sistema linear qualquer $AX = b$, terá a seguinte característica:

solução única e sua aproximação numérica pode ser dada por uma operação simples com o MATLAB.

Em particular:

- Se o sistema $AX = b$ é possível determinado, a solução do problema geral será a própria solução do sistema.
- Se o sistema $AX = b$ é possível indeterminado, a

solução do problema geral será aquela de norma mínima, dentre todas as soluções do sistema $AX = b$.

• Se o sistema dado é impossível, a solução do problema geral dependerá da solução do sistema $AX = b^*$ onde b^* é o elemento do conjunto imagem de A tal que a norma de $b - b^*$ é mínima. Neste caso, $AX = b^*$ é sempre possível.

- Se o sistema $AX = b^*$ é determinado, sua única solução é a solução do problema geral.

- Se o sistema $AX = b^*$ é indeterminado, a solução do problema geral é aquela de norma mínima, dentre todas as soluções de $AX = b^*$.

Tomemos dois sistemas particulares para analisar a situação:

Sistema 7 (De três equações e duas incógnitas)

$$\begin{cases} a_{11}x_1 + a_{12}x_2 = b_1 \\ a_{21}x_1 + a_{22}x_2 = b_2 \\ a_{31}x_1 + a_{32}x_2 = b_3 \end{cases}$$

ou de outro modo equivalente

$$x_1 \begin{bmatrix} a_{11} \\ a_{21} \\ a_{31} \end{bmatrix} + x_2 \begin{bmatrix} a_{12} \\ a_{22} \\ a_{32} \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} b_1 \\ b_2 \\ b_3 \end{bmatrix}.$$

Com os vetores

$$A_1 = \begin{bmatrix} a_{11} \\ a_{21} \\ a_{31} \end{bmatrix}, A_2 = \begin{bmatrix} a_{12} \\ a_{22} \\ a_{32} \end{bmatrix} \text{ e } Y = \begin{bmatrix} y_1 \\ y_2 \\ y_3 \end{bmatrix}$$

do espaço tridimensional (espaço IR^3), a fórmula $Y = x_1 A_1 + x_2 A_2$ com as variáveis x_1 e x_2 arbitrárias, define um dos seguintes subconjuntos $\{Y\}$ do espaço:

- $\{Y\} = \{0\}$, é a origem do espaço.
- $\{Y\}$ é uma reta passando pela origem.
- $\{Y\}$ é um plano passando pela origem.

Note que $\{Y\}$ não poderá ser o espaço IR^3 inteiro (só temos dois vetores!).

Tabela 3

{Y}	vetor b	Sistema 7
{0}	= 0 ≠ 0	possível indeterminado impossível
reta π	∈ π ∉ π	possível indeterminado impossível
plano α	∈ α ∉ α	possível determinado impossível

Sistema 8 (De duas equações e três incógnitas)

$$\begin{cases} a_{11}x_1 + a_{12}x_2 + a_{13}x_3 = b_1 \\ a_{21}x_1 + a_{22}x_2 + a_{23}x_3 = b_2 \end{cases}$$

ou, equivalentemente

$$x_1 \begin{bmatrix} a_{11} \\ a_{21} \end{bmatrix} + x_2 \begin{bmatrix} a_{12} \\ a_{22} \end{bmatrix} + x_3 \begin{bmatrix} a_{13} \\ a_{23} \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} b_1 \\ b_2 \end{bmatrix}$$

Com os vetores

$$A_1 = \begin{bmatrix} a_{11} \\ a_{21} \end{bmatrix}, A_2 = \begin{bmatrix} a_{12} \\ a_{22} \end{bmatrix}, A_3 = \begin{bmatrix} a_{13} \\ a_{23} \end{bmatrix} \text{ e } Y = \begin{bmatrix} y_1 \\ y_2 \end{bmatrix}$$

do espaço bi-dimensional (plano \mathbb{R}^2), a fórmula $Y = x_1A_1 + x_2A_2 + x_3A_3$ com as variáveis x_1, x_2 e x_3 arbitrárias, define um dos seguintes subconjuntos do plano:

- $\{Y\} = \{0\}$, é a origem do espaço.
- $\{Y\}$ é uma reta passando pela origem.
- $\{Y\}$ é o plano inteiro.

Note que poderá ser o plano \mathbb{R}^2 inteiro, pois temos três vetores!

Tabela 4

{Y}	vetor b	Sistema 8
{0}	= 0 ≠ 0	possível indeterminado impossível
reta π	∈ π ∉ π	possível indeterminado impossível
plano \mathbb{R}^2	∈ \mathbb{R}^2	possível indeterminado

⁷ dentre várias outras

⁸ Veja a fórmula (5) do Apêndice A de [7].

Passos da Extensão

Passo 1:

Escolher o vetor b^* de $\{Y\}$ mais próximo de b , ou seja, que torna mínima a distância $\|b^* - b\|$.

Passo 2:

Escolher o vetor X de norma mínima que satisfaz o sistema $AX = b^*$.

Assim, combinando estes procedimentos, chegamos a um problema bem determinado:

PROBLEMA: Achar o vetor coluna X de norma mínima que minimiza o erro $e(Z) = \|AZ - b\|$, dentre todos os vetores Z .

Observação: Pode acontecer na prática que a norma ou noção de distância mais adequada ao problema em questão, seja diferente da norma euclidiana usual. Portanto, temos neste caso um problema mais geral.

3.2 Decomposição Valor Singular e Pseudo-inversa com o MATLAB

É bastante interessante observar que existe uma noção de inversa generalizada⁷ de uma matriz A de qualquer tipo, que resolve prontamente o problema acima descrito.

Trata-se da inversa generalizada de Moore-Penrose ou pseudo-inversa da matriz A .

Definição: Dada uma matriz A , retangular de tipo $m \times n$, chamamos inversa generalizada de Moore-Penrose ou pseudo-inversa de A a qualquer matriz B de tipo $n \times m$ tendo as quatro propriedades seguintes:

- (i) $ABA = A$
- (ii) $BAB = B$
- (iii) $(BA)^T = BA$
- (iv) $(AB)^T = AB$.

Pode ser provado que existe uma única matriz B com estas propriedades⁸ a qual denotaremos por $\text{pinv}(A)$. A pseudo-inversa A pode ser calculada com a função interna pinv do MATLAB.

3.2.1 Aproximação da Solução do Problema com o MATLAB, usando a Pseudo-inversa:

Dada uma matriz A e um vetor coluna b com o mesmo número de linhas que a , X de norma mínima que minimiza o erro $e(Z) = \|AZ - b\|$ é dado por

$$X = \text{pinv}(A) b.$$

Mais explicitamente, $X = \text{pinv}(A) b$ é o único vetor coluna com as seguintes propriedades:

1. $(AX - b)^T Y = 0$, para todo $Y \in \{Y\}$

2. Se $(AZ - b)^T Y = 0$, para todo $Y \in \{Y\}$,

então $X^T X \leq Z^T Z$.

A primeira condição equivale ao fato de que AX é o único vetor do conjunto imagem $\{Y\}$ de A , tal que $AX - b$ é perpendicular a $\{Y\}$, enquanto que a segunda condição é equivalente ao fato de que, dentre todas as soluções Z de $AZ = b$, o vetor solução X tem a menor norma.

Tabela 5**Solução dos Sistemas Exemplos com o MATLAB, usando pinv.**

A resposta do MATLAB aos problemas associados aos sistemas exemplos é resumida na tabela seguinte, onde podemos comparar os resultados anteriores.

Sistema	Solução	A/b	Solsis	pinv
1	0,82666... 0,12000...	0,8267 0,1200	0,8267 0,1200	0,8267 0,1200
2	0,82666...+ c 0,12000...- c 0... + c	0,8267 0,1200 0	0,5911 + c0,5774 0,3556 - c0,5774 -0,2356 + c0,5774	0,5911 0,3556 -0,2356
3	não tem solução	1,4222 -0,6000	Sistema impossível	1,4222 -0,6000
4	0,82666... 0,12000...	0,8267 0,1200	0,8267 0,1200	0,8267 0,1200
5	0,82666...+ c 0,12000...- c 0... + c	Atenção: Res. impreciso	0,5911 + c0,5774 0,3556 - c0,5774 -0,2356 + c0,5774	0,5911 0,3556 -0,2356
6	não tem solução	Atenção: Res. impreciso	Sistema impossível	0,7481 0,0741 -0,6741

Referências Bibliográficas

- [1] G.H. Golub, C.F. Van Loan, *Matrix Computations*, Johns Hopkins Series in the Mathematical Sciences 3 (1985).
 [2] W. Greub, *Linear Algebra*, Springer-Verlag, Graduate Texts in Math., 23 (1975).
 [3] K. Hoffmann, R. Kunze, *Álgebra Linear*, LTC, Rio de Janeiro (1979).
 [4] R. A. Horn, C. R. Johnson, *Matrix Analysis*, Cambridge Univ. Press (1985).
 [5] R. A. Horn, C. R. Johnson, *Topics in Matrix Analysis*, Cambridge Univ. Press (1991).
 [6] H. F. Leckar, R. Sampaio, *Problemas de Auto-valores Generalizados. Fatoração de Matrizes*, Relatório Técnico, ILTC-Pós-Grad. Matemática -UFF (1982).
 [7] H. F. Leckar, R. Sampaio, *Aproximando Soluções de $AX = b$ com o MATLAB*, Relatório Técnico, PUC-Rio / UFF (1997).
 [8] M. A. G. Ruggiero, V. L. da R. Lopes, *Cálculo Numérico, Aspectos Teóricos e Computacionais*, McGraw-Hill, S.Paulo (1988).
 [9] R. Sampaio, E. Cataldo, R. Riquelme, *Introdução ao MATLAB*, Laboratório de Vibrações, PUC-Rio (1997).
 [10] MATLAB User's Guide, The MathWorks, Inc. (1994).