

Introdução aos sistemas dinâmicos

Mendeli H. Vainstein¹

¹Instituto de Física, Universidade Federal do Rio Grande do Sul, Brasil

Semestre 2020-1

1 Forma canônica de Jordan

Forma canônica de Jordan

Dado um sistema dinâmico linear

$$\frac{d\vec{z}(t)}{dt} = \overset{\leftrightarrow}{A} \vec{z}(t),$$

se sua matriz $\overset{\leftrightarrow}{A}$, $n \times n$, tem autovalores repetidos, há duas possibilidades:

- Se cada autovalor múltiplo permite autovetores independentes, ela pode ser diagonalizada e a versão desacopada do sistema pode ser escrita como

$$\frac{d\vec{v}(t)}{dt} = \overset{\leftrightarrow}{D} \vec{v}(t),$$

onde $\vec{v}(t) = (\overset{\leftrightarrow}{P})^{-1} \vec{z}(t)$, $\overset{\leftrightarrow}{D} = (\overset{\leftrightarrow}{P})^{-1} \overset{\leftrightarrow}{A} \overset{\leftrightarrow}{P}$ e $\overset{\leftrightarrow}{P}$ é a matriz modal de $\overset{\leftrightarrow}{A}$.

- se não, é possível transformá-la em uma matriz quase diagonal, a **forma canônica de Jordan**.

Sistemas dinâmicos na forma canônica de Jordan

No segundo caso, pode-se escrever a matriz

$$\vec{J} = (\vec{P})^{-1} \vec{A} \vec{P}$$

e fazer uma transformação de coordenadas $\vec{\omega}(t) = (\vec{P})^{-1} \vec{z}(t)$, de modo que

$$\frac{d\vec{z}(t)}{dt} = \vec{A} \vec{z}(t)$$

$$(\vec{P})^{-1} \frac{d\vec{z}(t)}{dt} = (\vec{P})^{-1} \vec{A} \vec{z}(t)$$

$$\frac{d}{dt} [(\vec{P})^{-1} \vec{z}(t)] = (\vec{P})^{-1} \vec{A} \vec{z}(t)$$

$$\frac{d\vec{\omega}(t)}{dt} = [(\vec{P})^{-1} \vec{A} \vec{P}] [(\vec{P})^{-1} \vec{z}(t)]$$

$$\boxed{\frac{d\vec{\omega}(t)}{dt} = \vec{J} \vec{\omega}(t).}$$

Autovetores generalizados

A solução desta equação, como vimos anteriormente é

$$\vec{\omega}(t) = e^{\vec{J}t} \vec{\omega}(0).$$

Como neste caso não há n autovetores linearmente independentes, a base em que \vec{A} é transformada em sua forma canônica de Jordan \vec{J} é formada por **autovetores generalizados**.

Definição

Um **autovetor generalizado** de uma matriz \vec{A} , $n \times n$, é um vetor para o qual

$$(\vec{A} - \lambda \vec{I})^k \vec{v} = \vec{0},$$

para algum $k \in \mathbb{Z}^+$. Aqui \vec{I} é a matriz identidade $n \times n$.

- k define a ordem do autovetor generalizado;
- Se $k = 1$, temos um autovetor usual.

Stover, Christopher. "Generalized Eigenvector." From MathWorld—A Wolfram Web Resource, created by Eric W. Weisstein.
<https://mathworld.wolfram.com/GeneralizedEigenvector.html>

Base de Jordan

- Se \overleftrightarrow{A} é uma matriz $n \times n$, existe uma base para \mathbb{R}^n que consiste dos autovetores generalizados de \overleftrightarrow{A} e que satisfaz:

$$\begin{aligned}\overleftrightarrow{A}\vec{b}_{i,1} &= \lambda_i \vec{b}_{i,1} & \text{e} \\ [\overleftrightarrow{A} - \lambda_i \overleftrightarrow{I}] \vec{b}_{i,j} &= \vec{b}_{i,j-1}.\end{aligned}$$

- Autovetores generalizados assim gerados são linearmente independentes.
- De posse de uma base de Jordan, basta calcular a **matriz modal generalizada** \overleftrightarrow{P} usando os autovetores e autovetores generalizados como colunas de \overleftrightarrow{P} .
- As primeiras colunas são as dos autovetores com autovalores simples, seguidas pelos autovetores generalizados com ordem crescente.

Rowland, Todd. "Jordan Basis." From MathWorld—A Wolfram Web Resource, created by Eric W. Weisstein.

<https://mathworld.wolfram.com/JordanBasis.html>

Moore, S. "Generalized Eigenvectors" (2013).

<https://hans.math.upenn.edu/~moose/240S2013/slides7-31.pdf>.

Exemplo 1

Calcule os autovetores generalizados da matriz

$$\vec{A} = \begin{bmatrix} 1 & 1 \\ 0 & 1 \end{bmatrix}.$$

$$\begin{aligned} p(\lambda) &= \det(\vec{A} - \lambda \vec{I}) \\ &= \begin{vmatrix} (1-\lambda) & 1 \\ 0 & (1-\lambda) \end{vmatrix} = (1-\lambda)^2. \end{aligned}$$

$$\Rightarrow \lambda_1 = \lambda_2 = 1$$

$$* A\vec{v} = \lambda\vec{v}$$

$$(\vec{A} - \lambda\vec{I})\vec{v} = \vec{0}$$

$$\begin{bmatrix} 0 & 1 \\ 0 & 0 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} v_1 \\ v_2 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 0 \\ 0 \end{bmatrix}$$

$$\begin{cases} 0v_1 + v_2 = 0 & \rightarrow v_2 = 0 \\ 0v_1 + 0v_2 = 0 & v_1 \text{ é qualquer} \end{cases}$$

$$\vec{v} = \begin{bmatrix} 1 \\ 0 \end{bmatrix}$$

\Rightarrow vetor $\vec{u} = \begin{bmatrix} 0 \\ 1 \end{bmatrix}$ não é autovetor,

mas forma uma base junto com \vec{v} .

Como calculá-lo?

Exemplo 1 (cont.)

Exemplo 1 (cont.)

$$(\vec{A} - \lambda \vec{I}) \vec{u} = \vec{0}$$

$$\begin{bmatrix} 0 & 1 \\ 0 & 0 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} m_1 \\ m_2 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 1 \\ 0 \end{bmatrix}$$

$$\left. \begin{array}{l} 0m_1 + 1m_2 = 1 \\ 0m_1 + 0m_2 = 0 \end{array} \right\}$$

$$\left. \begin{array}{l} 0m_1 + 0m_2 = 0 \end{array} \right\}$$

$$\Rightarrow \begin{cases} m_2 = 1 \\ m_1 \text{ é qualquer} \end{cases}$$

$$\vec{u} = \begin{bmatrix} 0 \\ 1 \end{bmatrix}$$

Note que

$$\begin{aligned} (\vec{A} - \lambda \vec{I})^2 \vec{u} &= (\vec{A} - \lambda \vec{I}) \underbrace{[(\vec{A} - \lambda \vec{I}) \vec{u}]}_{\vec{0}} \\ &= (\vec{A} - \lambda \vec{I}) \vec{0} \\ &= \vec{0} \end{aligned}$$

\vec{u} é autovetor generalizado de

ordem 2.

$$\vec{P} = \begin{bmatrix} 1 & 0 \\ 0 & 1 \end{bmatrix} = \vec{I}$$

\vec{A} já está na forma canônica de Jordan.

Exemplo 2

Calcule os autovetores generalizados da matriz

$$\vec{A} = \begin{bmatrix} 1 & 2 & 0 \\ 1 & 1 & 2 \\ 0 & -1 & 1 \end{bmatrix}$$

sua matriz modal generalizada e sua forma canônica de Jordan.

$$p(\lambda) = \det(\vec{A} - \lambda \vec{I})$$

$$= \begin{vmatrix} (1-\lambda) & 2 & 0 \\ 1 & (1-\lambda) & 2 \\ 0 & -1 & (1-\lambda) \end{vmatrix}$$

$$= (1-\lambda)^3 + 2(1-\lambda) - 2(1-\lambda)$$

$$= (1-\lambda)^3 \Rightarrow \lambda_1 = \lambda_2 = \lambda_3 = 1$$

* Autovetores:

$$(\vec{A} - \lambda \vec{I}) \vec{v} = \vec{0}$$

$$\begin{bmatrix} 0 & 2 & 0 \\ 1 & 0 & 2 \\ 0 & -1 & 0 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} v_1 \\ v_2 \\ v_3 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 0 \\ 0 \\ 0 \end{bmatrix}$$

$$\begin{cases} 2v_2 = 0 \\ v_1 + 2v_3 = 0 \\ -v_2 = 0 \end{cases} \rightarrow \begin{cases} v_2 = 0 \\ v_1 = -2v_3 \\ v_3 \text{ é qualquer} \end{cases}$$

Exemplo 2 (cont.)

$$\vec{w} = \begin{bmatrix} -2 \\ 0 \\ 1 \end{bmatrix}$$

$$* (\vec{A} - \lambda \vec{I})^2 \vec{w} = \vec{0}$$

$$(\vec{A} - \lambda \vec{I}) \underbrace{(\vec{A} - \lambda \vec{I}) \vec{w}}_{\vec{v}} = \vec{0}$$

$$\begin{bmatrix} 0 & 2 & 0 \\ 1 & 0 & 2 \\ 0 & -1 & 0 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} M_1 \\ M_2 \\ M_3 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} -2 \\ 0 \\ 1 \end{bmatrix}$$

$$\begin{cases} 2M_2 = -2 \\ M_1 + 2M_3 = 0 \\ -M_2 = 1 \end{cases} \rightarrow \begin{cases} M_2 = -1 \\ M_1 = -2M_3 \\ M_3 \text{ é qualquer} \end{cases}$$

escolho $M_3 = 0$ $\vec{u} = \begin{bmatrix} 0 \\ -1 \\ 0 \end{bmatrix}$

$$* (\vec{A} - \lambda \vec{I})^3 \vec{w} = \vec{0}$$

$$(\vec{A} - \lambda \vec{I})^2 \underbrace{(\vec{A} - \lambda \vec{I}) \vec{w}}_{\vec{v}} = \vec{0}$$

$$\begin{bmatrix} 0 & 2 & 0 \\ 1 & 0 & 2 \\ 0 & -1 & 0 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} w_1 \\ w_2 \\ w_3 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 0 \\ -1 \\ 0 \end{bmatrix}$$

$$\begin{cases} 2w_2 = 0 \\ w_1 + 2w_3 = -1 \\ -w_2 = 0 \end{cases} \Rightarrow \begin{cases} w_2 = 0 \\ w_1 = -1 - 2w_3 \\ w_3 \text{ é qualquer} \end{cases}$$

Escolho $w_3 = 0$

Exemplo 2 (cont.)

$$\vec{w} = \begin{bmatrix} -1 \\ 0 \\ 0 \end{bmatrix}$$

\vec{w} \vec{u} \vec{v}

↓ ↓ ↓

$$\Rightarrow \vec{P} = \begin{bmatrix} -2 & 0 & -1 \\ 0 & -1 & 0 \\ 1 & 0 & 0 \end{bmatrix}$$

$$\vec{P}\vec{P}^{-1} = \vec{J}$$

Python ↪
or
Math world

$$\vec{P}^{-1} = \begin{bmatrix} 0 & 0 & 1 \\ 0 & -1 & 0 \\ -1 & 0 & -2 \end{bmatrix}$$

$$\vec{J} = \vec{P}^{-1} \vec{A} \vec{P} = \begin{bmatrix} 1 & 1 & 0 \\ 0 & 1 & 1 \\ 0 & 0 & 1 \end{bmatrix}$$

Exercício 4.36

Mostre que, para um sistema linear bidimensional com autovalores iguais, a forma canônica de Jordan é

$$\vec{J} = \begin{bmatrix} \lambda & 1 \\ 0 & \lambda \end{bmatrix}. \quad \frac{d\vec{z}}{dt} = \vec{A}\vec{z}$$

Assuma que a solução tentativa seja da forma (ver aula 6)

$$\vec{z}(t) = e^{\lambda t}(t\vec{\omega}_1 + \vec{\omega}_2).$$

$$a) \quad \frac{d}{dt} [e^{\lambda t}(t\vec{\omega}_1 + \vec{\omega}_2)] = \vec{A} [e^{\lambda t}(t\vec{\omega}_1 + \vec{\omega}_2)] \quad \left| \quad (\vec{A}\vec{\omega}_1 - \lambda\vec{\omega}_1)t + (\vec{A}\vec{\omega}_2 - \lambda\vec{\omega}_2 - \vec{\omega}_1) = \vec{0}$$

$$\frac{d}{dt} [e^{\lambda t}t]\vec{\omega}_1 + \frac{d}{dt} [e^{\lambda t}]\vec{\omega}_2 = e^{\lambda t} [t\vec{A}\vec{\omega}_1 + \vec{A}\vec{\omega}_2]$$

$$\lambda e^{\lambda t}t\vec{\omega}_1 + e^{\lambda t}\vec{\omega}_1 + \lambda e^{\lambda t}\vec{\omega}_2 = e^{\lambda t}(t\vec{A}\vec{\omega}_1) + e^{\lambda t}\vec{A}\vec{\omega}_2$$

$$t(\lambda\vec{\omega}_1) + (\lambda\vec{\omega}_2 + \vec{\omega}_1) = t(\vec{A}\vec{\omega}_1) + \vec{A}\vec{\omega}_2$$

$$\hookrightarrow \begin{cases} \vec{A}\vec{\omega}_1 = \lambda\vec{\omega}_1 \\ \vec{A}\vec{\omega}_2 = \lambda\vec{\omega}_2 + \vec{\omega}_1 \end{cases}$$

Exercício 4.36 (cont.)

$$b) \vec{w}_1 = \begin{bmatrix} w_{1x} \\ w_{1y} \end{bmatrix}, \vec{w}_2 = \begin{bmatrix} w_{2x} \\ w_{2y} \end{bmatrix}$$

$${}^{\infty}P = \begin{bmatrix} w_{1x} & w_{2x} \\ w_{1y} & w_{2y} \end{bmatrix} \quad {}^{\infty}P {}^{\infty}P^{-1} = I$$

↳ MOSTRAR QUE

$${}^{\infty}P^{-1} = \frac{1}{\det {}^{\infty}P} \begin{bmatrix} w_{2y} & -w_{2x} \\ -w_{1y} & w_{1x} \end{bmatrix}$$

$$\det {}^{\infty}P = w_{1x} w_{2y} - w_{2x} w_{1y}$$

$$c) \vec{J} = ({}^{\infty}P^{-1}) {}^{\infty}A {}^{\infty}P$$

$$= ({}^{\infty}P^{-1}) {}^{\infty}A \begin{bmatrix} w_{1x} & w_{2x} \\ w_{1y} & w_{2y} \end{bmatrix}$$

$$= {}^{\infty}P^{-1} \begin{bmatrix} \lambda w_{1x} & (\lambda w_{2x} + w_{1x}) \\ \lambda w_{1y} & (\lambda w_{2y} + w_{1y}) \end{bmatrix}$$

$$= \frac{1}{\det({}^{\infty}P)} \begin{bmatrix} w_{2y} & -w_{2x} \\ -w_{1y} & w_{1x} \end{bmatrix} \begin{bmatrix} \lambda w_{1x} & (\lambda w_{2x} + w_{1x}) \\ \lambda w_{1y} & (\lambda w_{2y} + w_{1y}) \end{bmatrix}$$

$$= \frac{1}{\det({}^{\infty}P)} \begin{bmatrix} \lambda w_{1x} w_{2y} - \lambda w_{2x} w_{1y} & \lambda w_{2x} w_{2y} + w_{1x} w_{2y} - \lambda w_{1y} w_{2x} - w_{2x} w_{1y} \\ -\lambda w_{1y} w_{1x} + \lambda w_{1x} w_{1y} & \lambda w_{1y} w_{2y} + w_{1x} w_{1y} - \lambda w_{1x} w_{2x} - w_{1y} w_{1x} \end{bmatrix}$$

$$\rightarrow w_{1y} w_{2x} = w_{1x} w_{1y} + \lambda w_{1x} w_{2y} - \lambda w_{1y} w_{2x}$$

Elemento de

• multiplicação matricial:

$$\vec{C} = \vec{A} \vec{B}$$

$$c_{ij} = \sum_k a_{ik} b_{kj}$$

• matriz por vetor:

$$\vec{v} = \vec{A} \vec{u}$$

$$v_j = \sum_k a_{jk} u_k$$

Exercício 4.36 (cont.)

$$= \frac{1}{\det \tilde{P}} \begin{bmatrix} \lambda \det(\tilde{P}) & \det(\tilde{P}) \\ 0 & \lambda \det(\tilde{P}) \end{bmatrix}$$

$$\tilde{J} = \begin{bmatrix} \lambda & 1 \\ 0 & \lambda \end{bmatrix}$$

d) Calcule $e^{\tilde{J}t}$; Autovalores de \tilde{J}
seja $\lambda_1 = \lambda_2 = \lambda t$

Buscamos um polinômio de grau no máximo 1.

$$R(x) = ax + b, \quad f(x) = e^x$$

$$\begin{cases} R(\lambda t) = f(\lambda t) \\ R'(\lambda t) = f'(\lambda t) \end{cases}$$

$$\begin{cases} a \lambda t + b = e^{\lambda t} \\ a = e^{\lambda t} \end{cases}$$

$$\lambda t e^{\lambda t} + b = e^{\lambda t}$$

$$b = e^{\lambda t} (1 - \lambda t)$$

$$\begin{aligned} \Rightarrow R(x) &= x e^{\lambda t} + e^{\lambda t} (1 - \lambda t) \\ &= e^{\lambda t} [x + 1 - \lambda t] \end{aligned}$$

$$e^{\tilde{J}t} = R(\tilde{J}t) = e^{\lambda t} [\tilde{J}t + (1 - \lambda t)I]$$

Exercício 4.36 (cont.)

$$e^{\tilde{A}t} = \left[\begin{array}{cc} \lambda t & t \\ 0 & \lambda t \end{array} \right] + \left[\begin{array}{cc} (1-\lambda t) & 0 \\ 0 & (1-\lambda t) \end{array} \right] e^{\lambda t}$$

$$e^{\tilde{A}t} = \begin{bmatrix} 1 & t \\ 0 & 1 \end{bmatrix} e^{\lambda t}$$

$$e) \begin{cases} \frac{dx}{dt} = 3x - y \\ \frac{dy}{dt} = x + y \end{cases} \Rightarrow \tilde{A} = \begin{bmatrix} 3 & -1 \\ 1 & 1 \end{bmatrix}$$

$$p(\lambda) = \det(\tilde{A} - \lambda \tilde{I}) = \begin{vmatrix} 3-\lambda & -1 \\ 1 & 1-\lambda \end{vmatrix} = (3-\lambda)(1-\lambda) + 1$$

$$p(\lambda) = 3 - 4\lambda + \lambda^2 + 1 = \lambda^2 - 4\lambda + 4 = (\lambda - 2)^2$$

$$\lambda_1 = \lambda_2 = 2 //$$

Autovetores → WOLFRAM ALPHA

$$\vec{w}_1 = \begin{bmatrix} 1 \\ 1 \end{bmatrix}$$

$$(\tilde{A} - \lambda \tilde{I}) \vec{w}_2 = \vec{w}_1$$

$$\begin{bmatrix} 1 & -1 \\ 1 & -1 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} w_{2x} \\ w_{2y} \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 1 \\ 1 \end{bmatrix}$$

$$\begin{cases} w_{2x} - w_{2y} = 1 \\ w_{2x} - w_{2y} = 1 \end{cases} \rightarrow w_{2x} = 1 + w_{2y}$$

w_{2y} é qualquer

$$\vec{w}_2 = \begin{bmatrix} 1 \\ 0 \end{bmatrix}$$

Exercício 4.36 (cont.)

(livro Monteiro)

$$\vec{\omega}_i = \begin{bmatrix} 2 \\ 1 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 1 \\ 0 \end{bmatrix} + \begin{bmatrix} 1 \\ 1 \end{bmatrix} \quad \vec{\omega}_i$$

$$\vec{P} = \begin{bmatrix} 1 & 1 \\ 1 & 0 \end{bmatrix} \quad \det \vec{P} = -1$$

$$\vec{P}^{-1} = \frac{1}{(-1)} \begin{bmatrix} 0 & -1 \\ -1 & 1 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 0 & 1 \\ 1 & -1 \end{bmatrix}$$

$$\begin{aligned} \vec{J} &= \vec{P}^{-1} \vec{A} \vec{P} = \vec{P}^{-1} \begin{bmatrix} 3 & -1 \\ 1 & 1 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} 1 & 1 \\ 1 & 0 \end{bmatrix} \\ &= \vec{P}^{-1} \begin{bmatrix} 2 & 3 \\ 2 & 1 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 0 & 1 \\ 1 & -1 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} 2 & 3 \\ 2 & 1 \end{bmatrix} \end{aligned}$$

$$\vec{J} = \begin{bmatrix} 2 & 1 \\ 0 & 2 \end{bmatrix} \quad //_{OK}$$

$$\vec{v} = \vec{P}^{-1} \vec{z}$$

$$\hookrightarrow \frac{d\vec{v}}{dt} = \vec{J} \vec{v} \Rightarrow \vec{v}(t) = e^{\vec{J}t} \vec{v}(0)$$

(d)

$$e^{\vec{J}t} = \begin{bmatrix} 1 & t \\ 0 & 1 \end{bmatrix} e^{2t}$$

$$\begin{aligned} \vec{v}(t) &= \begin{bmatrix} 1 & t \\ 0 & 1 \end{bmatrix} e^{2t} \begin{bmatrix} v_1(0) \\ v_2(0) \end{bmatrix} \\ &= \begin{bmatrix} (v_1(0) + v_1(0)t) e^{2t} \\ v_2(0) e^{2t} \end{bmatrix} \end{aligned}$$

Exercícios

Monteiro cap 4:

4.25, 4.27, 4.33, 4.34, 4.35, 4.36, 4.37, 4.38



Fazem

Referências

- 1 Luiz H. A. Monteiro, *Sistemas dinâmicos*, 3ª ed., Editora Livraria da Física, São Paulo (2011)
- 2 Stover, Christopher. “Generalized Eigenvector.” From MathWorld—A Wolfram Web Resource, created by Eric W. Weisstein.
<https://mathworld.wolfram.com/GeneralizedEigenvector.htm> (acessado em 29/07/2020)
- 3 Rowland, Todd. “Jordan Basis.” From MathWorld—A Wolfram Web Resource, created by Eric W. Weisstein. <https://mathworld.wolfram.com/JordanBasis.html> (acessado em 29/07/2020)
- 4 Moore, S. “Generalized Eigenvectors” (2013).
<https://hans.math.upenn.edu/~moose/240S2013/slides7-31.pdf> (acessado em 29/07/2020)