

Autovalores e autovetores de operadores lineares

Prof. Alfredo Gay Neto
Prof. Luís Bitencourt Jr.
Prof. Miguel Bucalem



PEFUSP

DEPARTAMENTO DE ENGENHARIA
DE ESTRUTURAS E GEOTÉCNICA

**PEF 3302 – Mecânica das
Estruturas I**

Seja um operador linear $\mathbf{T}: \mathbb{E} \rightarrow \mathbb{E}$,

\mathbb{E} : espaço de vetores da geometria euclidiana

se existirem $\lambda \in \mathbb{R}$ e $\mathbf{x} \in \mathbb{E}$, $\mathbf{x} \neq \mathbf{0}$, tal que:

$$\mathbf{T}\mathbf{x} = \lambda\mathbf{x}$$

Dizemos que λ é um **autovalor** de \mathbf{T} associado ao **autovetor** (ou “vetor próprio”) \mathbf{x} .

Se \mathbf{x} é um autovetor, então $\mathbf{y} = \alpha\mathbf{x}$, $\alpha \in \mathbb{R}$, também é autovetor.

$$\mathbf{T}\mathbf{y} = \mathbf{T}(\alpha\mathbf{x}) = \alpha\mathbf{T}(\mathbf{x}) = \alpha\lambda\mathbf{x} = \lambda(\alpha\mathbf{x}) = \lambda\mathbf{y}$$

O autovetor $\mathbf{y} = \alpha\mathbf{x}$ é associado ao mesmo autovalor λ .

Considerando \mathbf{h} um autovetor de \mathbf{T} ,

$$\mathbf{T}\mathbf{h} = \lambda\mathbf{h}$$

$$\mathbf{T}\mathbf{h} - \lambda\mathbf{h} = (\mathbf{T} - \lambda\mathbf{I})\mathbf{h} = \mathbf{0}$$

Pode ser escrito matricialmente por:

$$([\mathbf{T}] - \lambda[\mathbf{I}])\{h\} = 0$$

$$\begin{bmatrix} T_{11} - \lambda & T_{12} & T_{13} \\ T_{21} & T_{22} - \lambda & T_{23} \\ T_{31} & T_{32} & T_{33} - \lambda \end{bmatrix} \begin{Bmatrix} h_1 \\ h_2 \\ h_3 \end{Bmatrix} = \begin{Bmatrix} 0 \\ 0 \\ 0 \end{Bmatrix}$$

Para existirem soluções diferentes da trivial ($\mathbf{h} = \mathbf{0}$),

$$\det([\mathbf{T}] - \lambda[\mathbf{I}]) = 0$$

Equação característica

ou

$$\lambda^3 - I_1\lambda^2 + I_2\lambda - I_3 = 0$$

onde I_1, I_2, I_3 são os invariantes:

$$I_1 = T_{11} + T_{22} + T_{33} = \text{tr}[\mathbf{T}]$$

$$I_2 = \begin{vmatrix} T_{11} & T_{12} \\ T_{21} & T_{22} \end{vmatrix} + \begin{vmatrix} T_{22} & T_{23} \\ T_{32} & T_{33} \end{vmatrix} + \begin{vmatrix} T_{33} & T_{31} \\ T_{13} & T_{11} \end{vmatrix}$$

$$I_3 = \begin{vmatrix} T_{11} & T_{12} & T_{13} \\ T_{21} & T_{22} & T_{23} \\ T_{31} & T_{32} & T_{33} \end{vmatrix} = \det[\mathbf{T}]$$

Para um operador simétrico, as raízes da equação característica ($\lambda_1, \lambda_2, \lambda_3$) são números reais

Considerando, por exemplo, o autovalor λ_1 , pode-se determinar o autovetor $\mathbf{h}^{(1)}$ associado a λ_1 usando:

$$\begin{bmatrix} T_{11} - \lambda_1 & T_{12} & T_{13} \\ T_{21} & T_{22} - \lambda_1 & T_{23} \\ T_{31} & T_{32} & T_{33} - \lambda_1 \end{bmatrix} \begin{Bmatrix} h_1^{(1)} \\ h_2^{(1)} \\ h_3^{(1)} \end{Bmatrix} = \begin{Bmatrix} 0 \\ 0 \\ 0 \end{Bmatrix}$$

Como a matriz é singular, há infinitas soluções.

Para restringir as soluções, considera-se a condição adicional:

$$\|\mathbf{h}\| = 1 \Rightarrow (h_1)^2 + (h_2)^2 + (h_3)^2 = 1$$

Diz-se que \mathbf{h} é um versor neste caso

Quando $\mathbf{T} = \mathbf{T}^T$ para dois autovalores distintos $\lambda_1 \neq \lambda_2$, tem-se que $\mathbf{h}_1 \perp \mathbf{h}_2$

De fato, como $\mathbf{T} = \mathbf{T}^T$:

$$\mathbf{h}_1 \cdot \mathbf{T}\mathbf{h}_2 = \mathbf{h}_2 \cdot \mathbf{T}^T\mathbf{h}_1 = \mathbf{h}_2 \cdot \mathbf{T}\mathbf{h}_1$$

Tem-se:

$$\mathbf{h}_1 \cdot \lambda_2\mathbf{h}_2 = \mathbf{h}_2 \cdot \lambda_1\mathbf{h}_1$$

$$\Rightarrow (\lambda_2 - \lambda_1)(\mathbf{h}_1 \cdot \mathbf{h}_2) = 0 \Rightarrow \boxed{\mathbf{h}_1 \cdot \mathbf{h}_2 = 0}$$

Como $\|\mathbf{h}_1\| = \|\mathbf{h}_2\| = 1$,

$$\boxed{\mathbf{h}_1 \perp \mathbf{h}_2}$$

- ▶ 1ª situação: três autovalores distintos ($\lambda_1 \neq \lambda_2 \neq \lambda_3$)
 - Os três autovetores são **necessariamente ortogonais** entre si!
- ▶ 2ª situação: dois iguais e um distinto ($\lambda_1 = \lambda_2 \neq \lambda_3$)
 - O autovalor distinto λ_3 está associado a um determinado autovetor \mathbf{h}_3 .
 - \mathbf{h}_3 determina a normal a um **plano**. Todos os vetores paralelos a esse plano são autovetores associados ao outro autovalor $\lambda_1 = \lambda_2$.
 - Sempre pode-se escolher um par de autovetores ortogonais paralelos a esse plano!
- ▶ 3ª situação: três autovalores iguais ($\lambda_1 = \lambda_2 = \lambda_3$)
 - Todos os vetores são autovetores!
 - Sempre pode-se escolher um trio de autovetores ortogonais!

Assim, é sempre possível construir uma **base (tri)ortonormal** formada por autovetores de um operador simétrico **T**.

Nesta base, a matriz de **T** é diagonal e tem componentes:

$$[T] = \begin{bmatrix} \lambda_1 & 0 & 0 \\ 0 & \lambda_2 & 0 \\ 0 & 0 & \lambda_3 \end{bmatrix}$$

Geralmente estabelecem-se os autovalores na ordem: $\lambda_1 \geq \lambda_2 \geq \lambda_3$

Pode-se definir uma **forma quadrática** associada a um operador linear simétrico \mathbf{T} como sendo a aplicação $t: \mathbb{E} \rightarrow \mathbb{R}$, de um vetor a um número real, dada por:

$$t(\mathbf{x}) = \mathbf{x} \cdot \mathbf{T}\mathbf{x}$$

Note-se que

$$t(\alpha\mathbf{x}) = (\alpha\mathbf{x}) \cdot \mathbf{T}(\alpha\mathbf{x}) = \alpha^2(\mathbf{x} \cdot \mathbf{T}\mathbf{x}) = \alpha^2 t(\mathbf{x}), \forall \alpha \in \mathbb{R}$$

Considere um vetor genérico \mathbf{x} , escrito na base ortonormal de autovetores de \mathbf{T} :

$$\mathbf{x} = x_1\mathbf{h}_1 + x_2\mathbf{h}_2 + x_3\mathbf{h}_3$$

$$(x_1)^2 + (x_2)^2 + (x_3)^2 = 1$$

Na base de autovetores, o operador simétrico \mathbf{T} que define a forma quadrática tem componentes:

$$[\mathbf{T}] = \begin{bmatrix} \lambda_1 & 0 & 0 \\ 0 & \lambda_2 & 0 \\ 0 & 0 & \lambda_3 \end{bmatrix}$$

Portanto:

$$t(\mathbf{x}) = \mathbf{x} \cdot \mathbf{T}\mathbf{x} = \{x_1 \quad x_2 \quad x_3\} \begin{bmatrix} \lambda_1 & 0 & 0 \\ 0 & \lambda_2 & 0 \\ 0 & 0 & \lambda_3 \end{bmatrix} \begin{Bmatrix} x_1 \\ x_2 \\ x_3 \end{Bmatrix}$$

ou

$$t(\mathbf{x}) = \lambda_1(x_1)^2 + \lambda_2(x_2)^2 + \lambda_3(x_3)^2$$

Substituindo na equação anterior

$$(x_1)^2 = 1 - (x_2)^2 - (x_3)^2$$

$$t(\mathbf{x}) = \lambda_1[1 - (x_2)^2 - (x_3)^2] + \lambda_2(x_2)^2 + \lambda_3(x_3)^2$$

$$t(\mathbf{x}) = \lambda_1 + (\lambda_2 - \lambda_1)(x_2)^2 + (\lambda_3 - \lambda_1)(x_3)^2$$

Como $\lambda_1 \geq \lambda_2 \geq \lambda_3$, pode-se concluir que:

$$\forall \mathbf{x} \in \mathbb{E}, t(\mathbf{x}) \leq \lambda_1 \quad \text{Já que } \lambda_2 - \lambda_1 \leq 0 \text{ e } \lambda_3 - \lambda_1 \leq 0$$

Como $t(\mathbf{h}_1) = \lambda_1$, λ_1 é o valor máximo assumido pela aplicação t

Analogamente, temos:

$$(x_3)^2 = 1 - (x_1)^2 - (x_2)^2$$

$$t(\mathbf{x}) = \lambda_1(x_1)^2 + \lambda_2(x_2)^2 + \lambda_3[1 - (x_1)^2 - (x_2)^2]$$

$$t(\mathbf{x}) = \lambda_3 + (\lambda_1 - \lambda_3)(x_1)^2 + (\lambda_2 - \lambda_3)(x_2)^2$$

Lembrando a ordem $\lambda_1 \geq \lambda_2 \geq \lambda_3$, resulta:

$$\forall \mathbf{x} \in \mathbb{E}, t(\mathbf{x}) \geq \lambda_3 \quad \text{Já que } \lambda_1 - \lambda_3 \geq 0 \text{ e } \lambda_2 - \lambda_3 \geq 0$$

Como $t(\mathbf{h}_3) = \lambda_3$, λ_3 é o valor mínimo assumido pela aplicação t

Ou seja, $\forall \mathbf{x} \in \mathbb{E}, \boxed{\lambda_3 \leq t(\mathbf{x}) \leq \lambda_1}$

O alongamento linear da fibra infinitesimal é dado por:

$$\varepsilon_l(\mathbf{m}^r) = \mathbf{m}^r \cdot \mathbf{E} \mathbf{m}^r$$

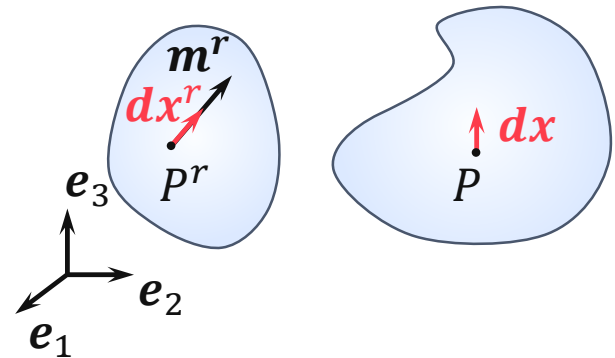
$\varepsilon_l(\mathbf{m}^r)$ é uma forma quadrática associada ao operador linear simétrico \mathbf{E} , o tensor das deformações infinitesimais.

Seja

$$\mathbf{E} \mathbf{x} = \lambda \mathbf{x}$$

Denominando-se os autovalores λ de $\varepsilon_1 \geq \varepsilon_2 \geq \varepsilon_3$ e os correspondentes autovetores de $\mathbf{h}_1, \mathbf{h}_2, \mathbf{h}_3$, decorre:

- ε_1 é o máximo alongamento linear e ocorre na direção \mathbf{h}_1
- ε_3 é o mínimo alongamento linear e ocorre na direção \mathbf{h}_3



Na base dos autovetores, tem-se a seguinte representação matricial

$$[E] = \begin{bmatrix} \varepsilon_1 & 0 & 0 \\ 0 & \varepsilon_2 & 0 \\ 0 & 0 & \varepsilon_3 \end{bmatrix}$$

Denomina-se:

$\varepsilon_1 \geq \varepsilon_2 \geq \varepsilon_3$ **deformações principais** e
 h_1, h_2, h_3 direções principais de deformação

O estado de deformação em um ponto de um sólido deformável é caracterizado pelo tensor das deformações \mathbf{E} que, na base ortonormal considerada, é dado por:

$$[\mathbf{E}] = \begin{bmatrix} -2 & 1 & -1 \\ 1 & 3 & 2 \\ -1 & 2 & 4 \end{bmatrix} \times 10^{-3}$$

Determinar as deformações e direções principais de \mathbf{E} .

Determinando a equação característica $\det([E] - \lambda[I]) = 0$

$$\begin{vmatrix} -0,002 - \lambda & 0,001 & -0,001 \\ 0,001 & 0,003 - \lambda & 0,002 \\ -0,001 & 0,002 & 0,004 - \lambda \end{vmatrix} = 0$$

ou

$$\lambda^3 - I_1\lambda^2 + I_2\lambda - I_3 = 0$$

onde:

$$I_1 = E_{11} + E_{22} + E_{33} = 0,005$$

$$I_2 = \begin{vmatrix} E_{11} & E_{12} \\ E_{21} & E_{22} \end{vmatrix} + \begin{vmatrix} E_{22} & E_{23} \\ E_{32} & E_{33} \end{vmatrix} + \begin{vmatrix} E_{33} & E_{31} \\ E_{13} & E_{11} \end{vmatrix} = -8 \times 10^{-6}$$

$$I_3 = \begin{vmatrix} E_{11} & E_{12} & E_{13} \\ E_{21} & E_{22} & E_{23} \\ E_{31} & E_{32} & E_{33} \end{vmatrix} = -2,7 \times 10^{-8}$$

Resolvendo:

$$\begin{aligned}\lambda_1 &= 0,00557 \\ \lambda_2 &= 0,00194 \\ \lambda_3 &= -0,0025\end{aligned}$$

Determinando o autovetor associado a $\lambda_1 = 0,00557$

$$\begin{bmatrix} -0,00757 & 0,001 & -0,001 \\ 0,001 & -0,00257 & 0,002 \\ -0,001 & 0,002 & -0,00157 \end{bmatrix} \begin{Bmatrix} h_1 \\ h_2 \\ h_3 \end{Bmatrix} = \begin{Bmatrix} 0 \\ 0 \\ 0 \end{Bmatrix}$$

Como o sistema é possível e indeterminado, deve-se escolher duas equações linearmente independentes e considerar a equação adicional:

$$(h_1)^2 + (h_2)^2 + (h_3)^2 = 1$$

$$\begin{aligned} -0,00757h_1 + 0,001h_2 - 0,001h_3 &= 0 \\ 0,001h_1 - 0,00257h_2 + 0,002h_3 &= 0 \\ (h_1)^2 + (h_2)^2 + (h_3)^2 &= 1 \end{aligned}$$

Resolvendo o sistema, chega-se a:

$$\begin{aligned} h_1 &= -0,03073h_3 \\ h_2 &= 0,76753h_3 \\ h_3 &= \pm 0,79304 \end{aligned}$$

onde os sinais + e – para h_3 sinalizam a existência de dois autovetores com sentidos opostos. Escolhendo a solução positiva, temos:

$$\begin{aligned} h_1 &= -0,02437 \\ h_2 &= 0,60868 \\ h_3 &= 0,79304 \end{aligned}$$

Ou:

$$\mathbf{h}_1 = -0,02437 \mathbf{e}_1 + 0,60868 \mathbf{e}_2 + 0,79304 \mathbf{e}_3$$

De forma análoga para $\lambda_2 = 0,00194$ e $\lambda_3 = -0,0025$ chega-se a:

$$\begin{aligned}\mathbf{h}_2 &= -0,3351 \mathbf{e}_1 - 0,75236 \mathbf{e}_2 + 0,56715 \mathbf{e}_3 \\ \mathbf{h}_3 &= 0,94187 \mathbf{e}_1 - 0,25192 \mathbf{e}_2 + 0,22230 \mathbf{e}_3\end{aligned}$$

Observa-se que na base dos versores próprios, escreve-se \mathbf{E} como:

$$[\mathbf{E}] = \begin{bmatrix} 0,00557 & 0 & 0 \\ 0 & 0,00194 & 0 \\ 0 & 0 & -0,0025 \end{bmatrix}$$

Exemplo 2

Considere o cubo de aresta L representado na Figura 1 e sua configuração deformada definida na Figura 2:

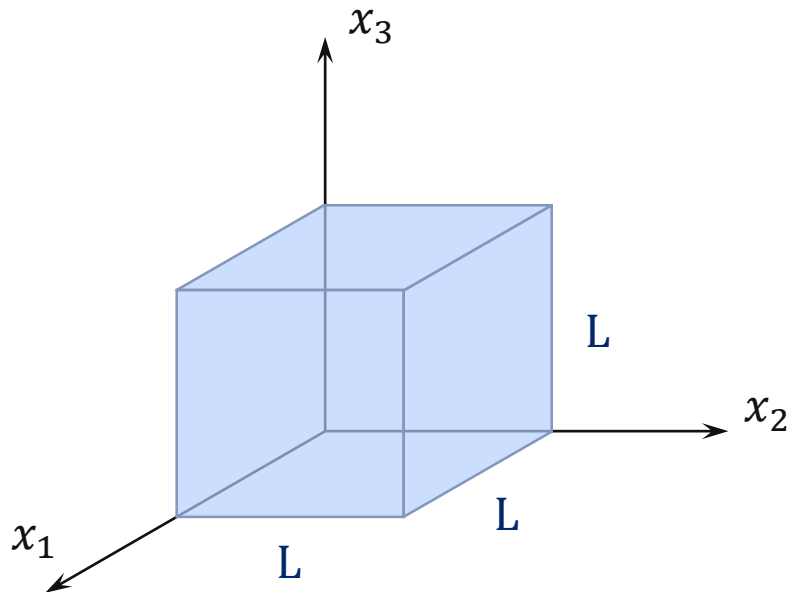


Figura 1

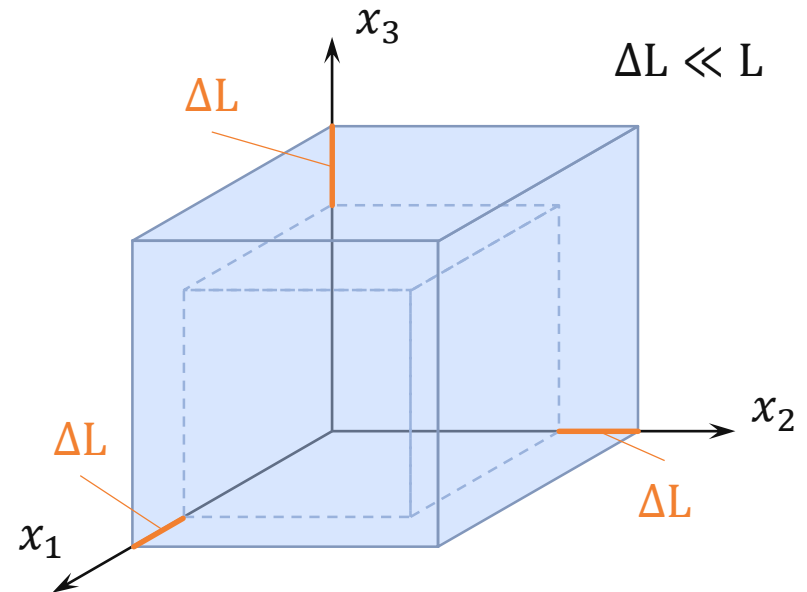


Figura 2

- (i) Calcule por inspeção o tensor das deformações na base $(\mathbf{e}_1, \mathbf{e}_2, \mathbf{e}_3)$;
- (ii) Interprete o resultado.

Nas três direções coordenadas há o mesmo alongamento:

$$E_{11} = E_{22} = E_{33} = \frac{(L + \Delta L) - L}{L} = \frac{\Delta L}{L}$$

Não há distorções entre qualquer par de fibras ortogonais paralelas aos vetores da base. Logo:

$$E_{12} = E_{23} = E_{31} = 0$$

Portanto, na base $(\mathbf{e}_1, \mathbf{e}_2, \mathbf{e}_3)$

$$[\mathbf{E}] = \begin{bmatrix} \Delta L/L & 0 & 0 \\ 0 & \Delta L/L & 0 \\ 0 & 0 & \Delta L/L \end{bmatrix}$$

- ▶ Pela estrutura diagonal do tensor das deformações obtido, conclui-se que as direções e_1 , e_2 , e_3 são direções principais e as deformações principais valem $\Delta L/L$;
- ▶ Esse caso representa a situação em que os três autovalores são iguais. Portanto, todos os vetores são autovetores, ou seja, todas as direções são direções principais;
- ▶ Para qualquer base ortonormal escolhida, não haverá distorção entre quaisquer duas fibras ortogonais escolhidas.

- ▶ O alongamento linear é o mesmo para qualquer direção

Seja $\mathbf{m}^r = m_1 \mathbf{e}_1 + m_2 \mathbf{e}_2 + m_3 \mathbf{e}_3$ um versor, o alongamento linear infinitesimal na direção de \mathbf{m}^r é dado por:

$$\varepsilon_l(\mathbf{m}^r) = \mathbf{m}^r \cdot \mathbf{E} \mathbf{m}^r$$

Como $\mathbf{E} = (\Delta L/L)\mathbf{I}$,

$$\varepsilon_l(\mathbf{m}^r) = \mathbf{m}^r \cdot (\Delta L/L)\mathbf{I} \mathbf{m}^r = (\Delta L/L) \underbrace{(\mathbf{m}^r \cdot \mathbf{m}^r)}_1$$

$$\varepsilon_l(\mathbf{m}^r) = \frac{\Delta L}{L}$$

Estado de dilatação uniforme

Considere o cubo de aresta L representado na Figura 1 e sua configuração deformada definida na Figura 2:

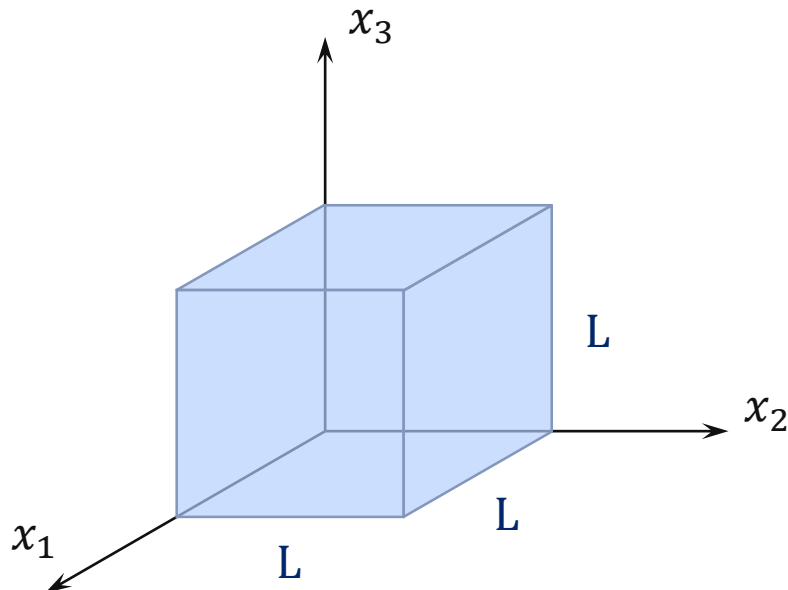


Figura 1

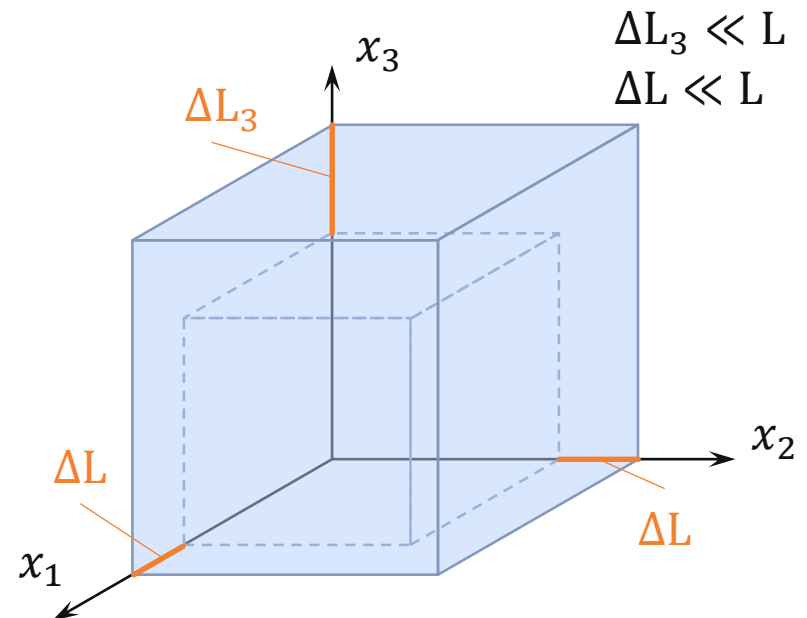


Figura 2

- (i) Calcule por inspeção o tensor das deformações na base $(\mathbf{e}_1, \mathbf{e}_2, \mathbf{e}_3)$;
- (ii) Interprete o resultado.

A diferença deste exemplo para o anterior é que o alongamento na direção e_3 é diferente dos demais. Por inspeção, obtém-se:

$$\begin{aligned}E_{11} &= E_{22} = \frac{\Delta L}{L} \\E_{33} &= \frac{\Delta L_3}{L} \\E_{12} &= E_{23} = E_{31} = 0\end{aligned}$$

Portanto, na base (e_1, e_2, e_3)

$$[E] = \begin{bmatrix} \Delta L/L & 0 & 0 \\ 0 & \Delta L/L & 0 \\ 0 & 0 & \Delta L_3/L \end{bmatrix}$$

- ▶ Pela estrutura diagonal do tensor das deformações obtido, conclui-se que as direções e_1 , e_2 , e_3 formam uma base de autovetores;
- ▶ Os autovalores são $\Delta L/L$ e $\Delta L_3/L$;
- ▶ Esse caso representa a situação com dois autovalores iguais e um distinto ($\lambda_1 = \lambda_2 \neq \lambda_3$);
- ▶ O versor e_3 é um autovetor correspondente ao autovalor $\Delta L_3/L$;
- ▶ Qualquer vetor ortogonal a e_3 , como é o caso de qualquer versor no plano x_1x_2 , é um autovetor correspondente ao autovalor $\Delta L/L$.

De fato, seja um versor $\mathbf{m}^r = m_1 \mathbf{e}_1 + m_2 \mathbf{e}_2$:

$$[\mathbf{E}]\{m^r\} = \begin{bmatrix} \Delta L/L & 0 & 0 \\ 0 & \Delta L/L & 0 \\ 0 & 0 & \Delta L_3/L \end{bmatrix} \begin{Bmatrix} m_1 \\ m_2 \\ 0 \end{Bmatrix} = \frac{\Delta L}{L} \begin{Bmatrix} m_1 \\ m_2 \\ 0 \end{Bmatrix} = \frac{\Delta L}{L} \{m^r\}$$

ou

$$\mathbf{E} \mathbf{m}^r = (\Delta L/L) \mathbf{m}^r$$

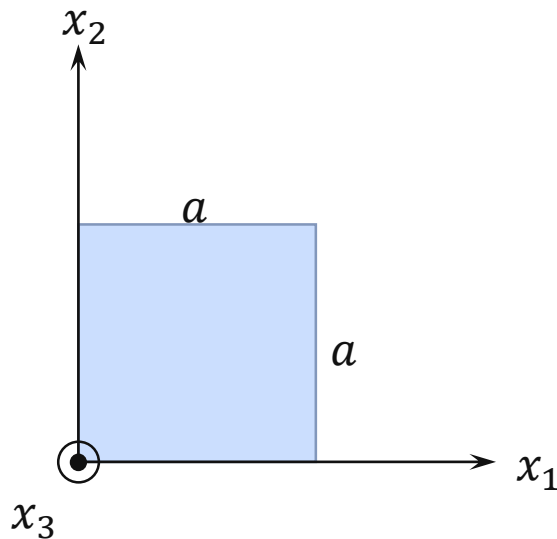
E o alongamento linear:

$$\varepsilon_l(\mathbf{m}^r) = \mathbf{m}^r \cdot \mathbf{E} \mathbf{m}^r = \mathbf{m}^r \cdot (\Delta L/L) \mathbf{m}^r = (\Delta L/L) \underbrace{(\mathbf{m}^r \cdot \mathbf{m}^r)}_1$$

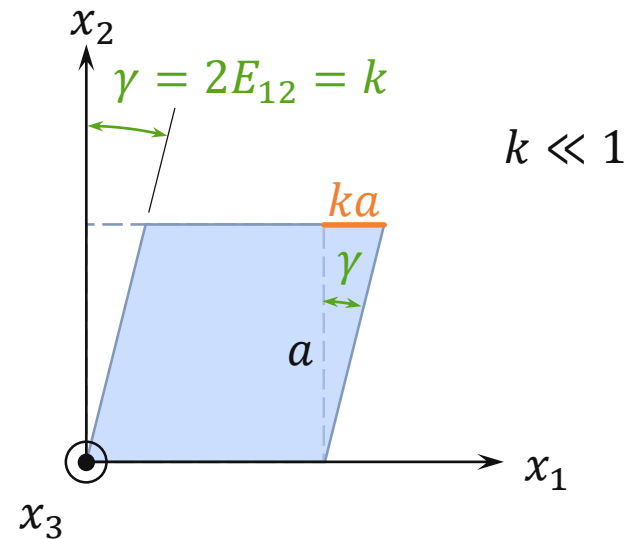
$$\varepsilon_l(\mathbf{m}^r) = \frac{\Delta L}{L}$$

Exemplo 4

Considere a deformação ilustrada abaixo. Calcule as direções principais



Bloco na configuração indeformada



Bloco na configuração deformada

Tensor das deformações: $[E] = \begin{bmatrix} 0 & k/2 & 0 \\ k/2 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 0 \end{bmatrix}$

Exemplo 4

Determinando a equação característica $\det([E] - \lambda[I]) = 0$

$$\begin{vmatrix} -\lambda & k/2 & 0 \\ k/2 & -\lambda & 0 \\ 0 & 0 & -\lambda \end{vmatrix} = 0$$

ou

$$\lambda^3 - I_1\lambda^2 + I_2\lambda - I_3 = 0$$

onde:

$$I_1 = E_{11} + E_{22} + E_{33} = 0$$

$$I_2 = \begin{vmatrix} E_{11} & E_{12} \\ E_{21} & E_{22} \end{vmatrix} + \begin{vmatrix} E_{22} & E_{23} \\ E_{32} & E_{33} \end{vmatrix} + \begin{vmatrix} E_{33} & E_{31} \\ E_{13} & E_{11} \end{vmatrix} = -\frac{k^2}{4}$$

$$I_3 = \begin{vmatrix} E_{11} & E_{12} & E_{13} \\ E_{21} & E_{22} & E_{23} \\ E_{31} & E_{32} & E_{33} \end{vmatrix} = 0$$

Exemplo 4

Equação característica: $\lambda^3 - \frac{k^2}{4}\lambda = 0$

Resolvendo: $\lambda_1 = \frac{k}{2}$ $\lambda_2 = 0$ $\lambda_3 = -\frac{k}{2}$

Determinando o autovetor associado a $\lambda_1 = k/2$

$$\begin{bmatrix} -k/2 & k/2 & 0 \\ k/2 & -k/2 & 0 \\ 0 & 0 & -k/2 \end{bmatrix} \begin{Bmatrix} h_1 \\ h_2 \\ h_3 \end{Bmatrix} = \begin{Bmatrix} 0 \\ 0 \\ 0 \end{Bmatrix}$$

Como o sistema é indeterminado, deve-se escolher duas equações linearmente independentes e considerar a equação adicional:

$$(h_1)^2 + (h_2)^2 + (h_3)^2 = 1$$

Exemplo 4

$$\begin{aligned}k/2 h_1 - k/2 h_2 &= 0 \\ -k/2 h_3 &= 0 \\ (h_1)^2 + (h_2)^2 + (h_3)^2 &= 1\end{aligned}$$

Resolvendo o sistema, chega-se a: $h_1 = h_2 = \sqrt{2}/2$ $h_3 = 0$

Para $\lambda_2 = 0$, chega-se a: $h_1 = h_2 = 0$ $h_3 = 1$

Para $\lambda_3 = -k/2$, chega-se a: $h_1 = -h_2 = -\sqrt{2}/2$ $h_3 = 0$

As direções principais não triviais $\mathbf{h}^{(1)}$ e $\mathbf{h}^{(3)}$ pertencem ao plano x_1x_2 (onde a deformação efetivamente ocorre)

