

ОБ ОДНОВРЕМЕННОЙ ТРИАНГУЛИЗАЦИИ МАТРИЦ НАД ПРОИЗВОЛЬНЫМ ПОЛЕМ

Н. В. Лесниченко, О. К. Тен

Кубанский государственный университет, г. Краснодар

В работе сформулированы и доказаны необходимые и достаточные условия одновременной приводимости нескольких матриц к верхнетреугольному виду над произвольным полем нулевой характеристики. Предложен алгоритм нахождения подобия, приводящего матрицы к верхнетреугольному виду, использующий технику базисов Гребнера.

Работа посвящена вопросу одновременного приведения двух или нескольких матриц к верхнетреугольному виду над произвольным полем K характеристики нуль. Матрицы $A_1, A_2, \dots, A_m \in M_n(K)$, которые можно привести к верхнетреугольному виду одним подобием, с помощью подходящей невырожденной матрицы $C \in M_n(K)$, называются одновременно триангулируемыми (над полем K). Здесь и далее $M_n(K)$ — множество квадратных матриц порядка n . В случае алгебраически замкнутого поля критерий одновременной триангулируемости двух матриц был получен Маккоем в работе [1].

Теорема 1. *Матрицы A и B одновременно триангулируемы тогда и только тогда, когда для всякого многочлена $p(x, y)$ от некоммутирующих переменных x и y матрица $p(A, B)(AB - BA)$ нильпотентна.*

Однако, оригинальное и поздние доказательства теоремы Маккоя были сложны, а сам критерий не предлагал конечной процедуры проверки выполнения условий теоремы (см. [2, 3]). В работе [4] Альпину Ю.А. и Корешкову Н.А. удалось связать вопрос об одновременной триангулируемости матриц с теорией линейных алгебр и на основе классических теорем теории алгебр Ли и ассоциативных алгебр получить новое доказательство критерия Маккоя. По сути они доказали, что критерий Маккоя одновременной триангулируемости матриц A и B эквивалентен условию разрешимости алгебры Ли $L(A, B)$, порожденной матрицами A и B .

Теорема 2. *Матрицы A и B одновременно триангулируемы тогда и только тогда, когда алгебра Ли $L(A, B)$, порожденная матрицами A и B , является разрешимой.*

В рамках своего подхода им удалось дать естественное объяснение для других известных условий триангулируемости матриц. Кроме этого, в [4] были найдены новые критерии, приводящие к эффективным алгоритмам проверки одновременной триангулируемости матриц над алгебраически замкнутым полем нулевой характеристики.

Задача одновременной триангуляции матриц над произвольным полем представляет важный интерес, например, с точки зрения реализации в рамках той или иной системы безопычных вычислений. Непосредственная реализация алгоритмов, приспособленных для алгебраически замкнутого поля на компьютерах, использующих арифметику с плавающей точкой, делает задачу одновременной триангуляции матриц в общем случае неустойчивой. Известно, что уже задача нахождения собственных значений и собственных векторов над полем комплексных чисел, неразрешима в радикалах (см. [2]).

В первой части работы мы формулируем и доказываем критерии одновременной триангулируемости матриц над произвольным полем нулевой характеристики, вторая часть посвящена алгоритму одновременной триангуляции матриц над произвольным эффективно реализуемым в рамках системы компьютерной алгебры полем.

1. Критерий одновременной триангулируемости матриц над произвольным полем. Понятно, что если несколько матриц одновременно триангулируемы над полем K , то они одновременно триангулируемы и над алгебраическим замыканием \bar{K} поля K , а их характеристические корни лежат в K . Оказывается, что эти необходимые условия являются и достаточными.

Теорема 3. *Матрицы $A, B \in M_n(K)$ одновременно триангулируемы над полем K тогда и только тогда, когда они одновременно триангулируемы над алгебраическим замыканием \bar{K} поля K и их характеристические корни лежат в K .*

Матрицы из $M_n(K)$ удобно мыслить как линейные операторы на некотором линейном пространстве V размерности n . Линейные операторы будем называть одновременно триангулируемыми, если существует базис e_1, e_2, \dots, e_n в V , относительно которого матрицы данных линейных операторов являются верхнетреугольными. Это в точности эквивалентно тому, что найдется полный флаг $\{0\} = V_0 \subseteq V_1 \subseteq \dots \subseteq V_n = V$, $\dim V_{i+1}/V_i = 1, i = 0, 1, \dots, n-1$ линейных подпространств, инвариантных относительно данных линейных операторов.

Пусть $U \subseteq V$ линейное подпространство, $\text{End}(V)$ — алгебра линейных операторов на V , $\text{End}(V; U) \subseteq \text{End}(V)$ — подалгебра линейных операторов, оставляющих подпространство U инвариантным. Пусть

$$i : \text{End}(V; U) \rightarrow \text{End}(U), \pi : \text{End}(V; U) \rightarrow \text{End}(V/U) —$$

— гомоморфизмы алгебр, определенные следующим образом:

$$i(A) = A|U, \pi(A)(v + U) = A(v) + U,$$

где $A \in \text{End}(V; U)$, $v \in V$, $A|U$ — ограничение линейного оператора A на U .

Предложение 4. *Если линейные операторы $A_1, A_2, \dots, A_m \in \text{End}(V; U)$ одновременно триангулируемы, то линейные операторы $i(A_1), i(A_2), \dots, i(A_m) \in \text{End}(U)$ (соответственно, линейные операторы $\pi(A_1), \pi(A_2), \dots, \pi(A_m) \in \text{End}(V/U)$) одновременно триангулируемы.*

Доказательство. Пусть $\{0\} = V_0 \subseteq V_1 \subseteq \dots \subseteq V_n = V$ — полный флаг подпространств, инвариантных относительно линейных операторов A_1, A_2, \dots, A_m . Тогда

$$\{0\} = V_0 \cap U \subseteq V_1 \cap U \subseteq \dots \subseteq V_n \cap U = U —$$

— флаг подпространств, инвариантных относительно линейных операторов $i(A_1), i(A_2), \dots, i(A_m)$; причем

$$\dim(V_{i+1} \cap U)/(V_i \cap U) \leq 1, i = 0, 1, \dots, n-1.$$

Согласно сделанному выше замечанию, это означает, что линейные операторы $i(A_1), i(A_2), \dots, i(A_m)$ одновременно триангулируемы.

Далее имеем, что

$$\{0\} = (V_0 + U)/U \subseteq (V_1 + U)/U \subseteq \dots \subseteq (V_n + U)/U = V/U —$$

— флаг подпространств, инвариантных относительно линейных операторов $\pi(A_1), \pi(A_2), \dots, \pi(A_m)$; причем

$$\dim((V_{i+1} + U)/U)/((V_i + U)/U) = \dim(V_{i+1} + U)/(V_i + U) \leq 1.$$

Отсюда следует, что линейные операторы $\pi(A_1), \pi(A_2), \dots, \pi(A_m)$ одновременно триангулируемы. \square

Предложение 5. *Линейные операторы $A_1, A_2, \dots, A_m \in \text{End}(V)$ одновременно триангулируемы тогда и только тогда, когда для всякого подпространства $U \subseteq V$, инвариантного относительно операторов A_1, A_2, \dots, A_m , линейные операторы $\pi(A_1), \pi(A_2), \dots, \pi(A_m) \in \text{End}(V/U)$ имеют общий собственный вектор в V/U .*

ДОКАЗАТЕЛЬСТВО. Необходимость следует из одновременной триангулируемости линейных операторов $\pi(A_1), \pi(A_2), \dots, \pi(A_m) \in \text{End}(V/U)$. Обратное утверждение докажем индукцией по размерности линейного пространства V . Пусть $U = \langle v \rangle$, где v — общий собственный вектор линейных операторов A_1, A_2, \dots, A_m . Тогда линейные операторы $\pi(A_1), \pi(A_2), \dots, \pi(A_m)$ удовлетворяют условию предложения, а потому, по предположению индукции, одновременно триангулируемы. Пусть $V_1 = U$ и

$$\{0\} = V_1/V_1 \subseteq V_2/V_1 \subseteq \dots \subseteq V_n/V_1 = V/U —$$

— полный флаг линейных подпространств, инвариантных относительно $\pi(A_1), \pi(A_2), \dots, \pi(A_m)$. Тогда $\{0\} = V_0 \subseteq V_1 \subseteq \dots \subseteq V_n = V$ — полный флаг подпространств, инвариантных относительно A_1, A_2, \dots, A_m ; что и означает одновременную триангулируемость линейных операторов A_1, A_2, \dots, A_m . \square

ДОКАЗАТЕЛЬСТВО теоремы 3. Необходимость очевидна. Докажем достаточность. Пусть матрицы линейных операторов $A, B \in \text{End}(V)$ одновременно триангулируемы над \bar{K} и их характеристические корни лежат в K . Согласно предложению требуется доказать, что для всякого подпространства $U \subseteq V$, инвариантного относительно A и B , линейные операторы $\pi(A), \pi(B)$ имеют общий собственный вектор. Наличие общего собственного вектора означает, что система линейных уравнений $\pi(A)(x) = \lambda x, \pi(B)(x) = \mu x$ имеет ненулевое решение $x \in V/U$ для некоторых $\lambda, \mu \in K$. Из условия имеем, что эта система имеет ненулевое решение над полем \bar{K} . Тогда из теории систем линейных уравнений получаем, что эта система имеет ненулевое решение и над полем K . \square

Из доказанной теоремы следует, что критерии, полученные в работе [4], могут быть очевидным образом перенесены на случай произвольного поля нулевой характеристики.

Теорема 6. Матрицы $A, B \in M_n(K)$ одновременно триангулируемы над полем K тогда и только тогда, когда их характеристические корни лежат в K и след ассоциативного произведения любых двух мономов вида $[X_1, [X_2, \dots [X_k, X_{k+1}] \dots]]$, где $X_i \in \{A, B\}, k \leq n^2 - 1$, равен нулю.

Теорема 7. Матрицы $A, B \in M_n(K)$ одновременно триангулируемы над полем K тогда и только тогда, когда их характеристические корни лежат в K и след любой матрицы вида $X_1 \cdots X_k (AB - BA)$, где $X_i \in \{A, B\}, i = 1, \dots, k, 0 \leq k \leq n^2 - 1$, равен нулю.

ДОКАЗАТЕЛЬСТВО этих теорем следует из теоремы 3 и теорем 5 и 6 [4]. \square

2. Алгоритм одновременной триангулизации матриц. Мы будем исходить из предположения, что собственные значения матриц лежат в основном поле, и их можно найти. Достаточно просто, например, это сделать над полем рациональных чисел.

Пусть линейные операторы $A_1, A_2, \dots, A_m \in \text{End}(V)$ одновременно триангулируемы. Базис e_1, e_2, \dots, e_n линейного пространства V будем называть T -базисом относительно линейных операторов A_1, A_2, \dots, A_m , если их матрицы относительно этого базиса имеют верхнетреугольный вид. Это в точности означает, что, возможно после некоторой перенумерации базисных векторов, подпространства $V_0 = \{0\}$ и $V_i = \langle e_1, e_2, \dots, e_i \rangle, i = 1, 2, \dots, n$ инвариантны относительно A_1, A_2, \dots, A_m . Это, в свою очередь, эквивалентно тому, что для каждого $i = 0, 1, \dots, n-1$ вектор $e_{i+1} + V_i$ является общим собственным вектором линейных операторов $\pi_i(A_1), \pi_i(A_2), \dots, \pi_i(A_m)$, где $\pi_i : \text{End}(V; V_i) \rightarrow \text{End}(V/V_i), i = 0, 1, \dots, n-1$ — гомоморфизмы алгебр, определенные следующим образом: $\pi_i(A)(v + V_i) = A(v) + V_i, A \in \text{End}(V; V_i), v \in V$.

Будем говорить, что векторы e_1, e_2, \dots, e_k образуют T -систему относительно линейных операторов A_1, A_2, \dots, A_m , если линейные подпространства $V_0 = \{0\}$ и $V_i = \langle e_1, e_2, \dots, e_i \rangle, i = 1, 2, \dots, k-1$ инвариантны относительно линейных операторов A_1, A_2, \dots, A_m ; и вектор $e_{i+1} + V_i$ является общим собственным вектором линейных операторов $\pi_i(A_1), \pi_i(A_2), \dots, \pi_i(A_m)$ для каждого $i = 0, 1, \dots, k-1$. Понятно, что векторы T -системы линейно независимы.

Предложение 9. Пусть U — подпространство линейного подпространства V , $A \in \text{End}(V; U)$, x_1, x_2, \dots, x_n — базис пространства V , x_1, x_2, \dots, x_l — векторы базиса, нормальные относительно подпространства U . Тогда всякий вектор пространства V/U однозначно представляется в виде $\alpha_1 x_1 + \alpha_2 x_2 + \dots + \alpha_l x_l + U$, $\alpha_1, \alpha_2, \dots, \alpha_l \in K$, и равенство

$$\pi(A)(\alpha_1 x_1 + \alpha_2 x_2 + \dots + \alpha_l x_l + U) = U$$

равносильно

$$\alpha_1 \text{н.ф.}(A(x_1)) + \alpha_2 \text{н.ф.}(A(x_2)) + \dots + \alpha_l \text{н.ф.}(A(x_l)) = 0.$$

ДОКАЗАТЕЛЬСТВО. Докажем, что $x_1 + U, x_2 + U, \dots, x_l + U$ образуют базис факторпространства V/U . Имеем, что $v + U = \text{н.ф.}(v) + U$ и $\text{н.ф.}(v)$ линейно выражается через нормальные переменные x_1, x_2, \dots, x_l . Поэтому $v + U$ линейно выражается через $x_1 + U, x_2 + U, \dots, x_l + U$. Осталось показать, что $x_1 + U, x_2 + U, \dots, x_l + U$ линейно независимы. Пусть $\alpha_1 x_1 + \alpha_2 x_2 + \dots + \alpha_l x_l + U = U$, тогда $\alpha_1 x_1 + \alpha_2 x_2 + \dots + \alpha_l x_l \in U$ и, в силу нормальности, $\alpha_1 x_1 + \alpha_2 x_2 + \dots + \alpha_l x_l = 0$. Так как x_1, x_2, \dots, x_l линейно независимы, то отсюда получаем: $\alpha_1 = \dots = \alpha_l = 0$, что и требовалось.

Далее, равенство $\pi(A)(\alpha_1 x_1 + \alpha_2 x_2 + \dots + \alpha_l x_l + U) = U$ означает, что $\alpha_1 A(x_1) + \alpha_2 A(x_2) + \dots + \alpha_l A(x_l) \in U$, что эквивалентно $\alpha_1 \text{н.ф.}(A(x_1)) + \alpha_2 \text{н.ф.}(A(x_2)) + \dots + \alpha_l \text{н.ф.}(A(x_l)) = \text{н.ф.}(\alpha_1 A(x_1) + \alpha_2 A(x_2) + \dots + \alpha_l A(x_l)) = 0$. \square

Пример реализации предложенного алгоритма нахождения T -базиса и приведения матриц к верхнетреугольному виду рассмотрим в следующем пункте.

3. Пример реализации алгоритма одновременной триангулизации матриц. Пусть

$$C = \begin{pmatrix} 2 & 3 & 0 & 0 \\ 1 & 2 & 0 & 0 \\ 2 & 1 & 1 & 2 \\ 1 & -1 & 2 & 3 \end{pmatrix},$$

тогда матрицы

$$A = C^{-1} \begin{pmatrix} 1 & 0 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 3 \end{pmatrix} C = \begin{pmatrix} -5 & -3 & -3 & -6 \\ 4 & 3 & 2 & 4 \\ 0 & -6 & 7 & 8 \\ 4 & 5 & -1 & 1 \end{pmatrix},$$

$$B = C^{-1} \begin{pmatrix} 2 & 0 & 1 & 0 \\ 0 & 2 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 2 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & -2 \end{pmatrix} C = \begin{pmatrix} 6 & 2 & 2 & 4 \\ -2 & 1 & -1 & -2 \\ -2 & 11 & -11 & -18 \\ -2 & -7 & 5 & 8 \end{pmatrix}$$

одновременно триангулируемы. Покажем на примере матриц A и B , как найти подобие, приводящее эти матрицы к верхнетреугольному виду.

Шаг 1. Находим общие собственные векторы линейных операторов A и B . Их характеристические многочлены имеют соответственно вид: $(t-1)^3(t-3)$ и $(t-2)^3(t+2)$. Для нахождения общих собственных векторов решаем систему линейных уравнений

$$\begin{cases} A(x) = \lambda x, \\ B(x) = \mu x, \end{cases}$$

где $\lambda \in \{1, 3\}$, $\mu \in \{2, -2\}$. При $\lambda = 1$, $\mu = 2$ система имеет двумерное пространство решений. Стандартный базис пространства решений состоит из векторов $(1, -1, -1, 0)$, $(0, 1, 5, -3)$.

Шаг 2. Полагаем, что $U = \langle (1, -1, -1, 0), (0, 1, 5, -3) \rangle$. Находим общие собственные векторы линейных операторов $\pi(A)$ и $\pi(B)$. Для этого решаем системы линейных уравнений

$$\begin{cases} A(x) \equiv \lambda x \pmod{U}, \\ B(x) \equiv \mu x \pmod{U}, \end{cases} \quad (2)$$

где $\lambda \in \{1, 3\}$, $\mu \in \{2, -2\}$. Рассмотрим систему (2) при $\lambda = 3$, $\mu = 2$. Векторы $u = (0, 0, 1, 0)$, $v = (0, 0, 0, 1)$ базиса пространства V , нормальные относительно подпространства U , образуют базис факторпространства V/U . Тогда по предложению 9 рассматриваемая система равносильна системе

$$\begin{cases} \alpha u_1 + \beta v_1 = 0, \\ \alpha u_2 + \beta v_2 = 0, \end{cases} \quad (3)$$

где $u_1 = \text{н.ф.}(A(u)) = (0, 0, 6, -4)$, $v_1 = \text{н.ф.}(A(v)) = (0, 0, 12, -8)$, $u_2 = \text{н.ф.}(B(u)) = (0, 0, -12, 8)$, $v_2 = \text{н.ф.}(B(v)) = (0, 0, -24, 16)$. Решая уравнения системы (3), которые оказываются пропорциональными одному уравнению $\alpha + 2\beta = 0$, получаем, что вектор $(0, 0, 2, -1)$ является собственным вектором линейных операторов $\pi(A)$ и $\pi(B)$.

Шаг 3. Полагаем, что $U = \langle (1, -1, -1, 0), (0, 1, 5, -3), (0, 0, 2, -1) \rangle$. Тогда вектор $(0, 0, 0, 1)$, нормальный относительно подпространства U , является собственным вектором линейных операторов $\pi(A)$ и $\pi(B)$.

Таким образом получаем, что векторы $e_1 = (1, -1, -1, 0)$, $e_2 = (0, 1, 5, -3)$, $e_3 = (0, 0, 2, -1)$, $e_4 = (0, 0, 0, 1)$ образуют T -базис. Действительно, полагая, что

$$D = \begin{pmatrix} 1 & 0 & 0 & 0 \\ -1 & 1 & 0 & 0 \\ -1 & 5 & 2 & 0 \\ 0 & -3 & -1 & 1 \end{pmatrix},$$

получаем:

$$D^{-1}AD = \begin{pmatrix} 1 & 0 & 0 & -6 \\ 0 & 1 & 0 & -2 \\ 0 & 0 & 3 & 6 \\ 0 & 0 & 0 & 1 \end{pmatrix},$$

$$D^{-1}BD = \begin{pmatrix} 2 & 0 & 0 & 4 \\ 0 & 2 & 0 & 2 \\ 0 & 0 & -2 & -12 \\ 0 & 0 & 0 & 2 \end{pmatrix}.$$

Список литературы

1. McCoу N. H. On the characteristic roots of matrix polynomials // Bull. Amer. Math. Soc. – 1936. – V. 42. – P. 592–600.
2. Икрамов X. Д., Савельева Н. В., Чугунов В. Н. О рациональных критериях существования общих собственных векторов или инвариантных подпространств // Программирование. – 1997. – № 3. – С. 43–57.
3. Хорн Р., Джонсон Ч. Матричный анализ. – М., Мир. – 1989.
4. Альпин Ю. А., Корешков Н. А. Об одновременной триангулируемости матриц // Мат. заметки. – Т. 68. – Вып. 5. – 2000. – С. 648–652.
5. Латышев В. Н. Комбинаторная теория колец, Стандартные базисы. – М., МГУ. – 1988.

On simultaneous triangularization of matrices over arbitrary field

N. V. Lesnichenko, O. K. Ten

The necessary and sufficient conditions of simultaneous triangularizability of matrices over arbitrary field of characteristic 0 are obtained. The algorithm of simultaneous triangularization of matrices based on Groebner bases technique is suggested.