

19. Druhý rozklad lineární transformace

Úmluva. Všude $P = \mathbb{C}$.

V přednášce o vlastních vektorech jsme se seznámili s diagonalizovatelnými transformacemi. V bázi složené z vlastních vektorů v_i mají diagonální matici s vlastními čísly λ_i na diagonále.

Obecná lineární transformace nemusí mít bázi složenou z vlastních vektorů. Nicméně, jak ukážeme, lze zkonstruovat jinou významnou bázi — Jordanovu. Matice lineární transformace v Jordanově bázi je tzv. Jordanova matice. Opět má na diagonále vlastní čísla, ale může obsahovat i nenulové prvky v řadě sousedící s diagonálou (všechny ovšem rovny 1).

Východiskem pro nalezení Jordanovy báze bude první rozklad, příslušný rozkladu charakteristického polynomu (nebo libovolného jiného anulujícího polynomu) χ_f na nesoudělné součinitele. Při $P = \mathbb{C}$ ovšem existuje rozklad na kořenové činitele

$$\chi_f = (x - \xi_1)^{k_1} \cdots (x - \xi_s)^{k_s}, \quad \xi_i \neq \xi_j \text{ pro } i \neq j,$$

a pro $i \neq j$ jsou polynomy $(x - \xi_i)^{k_i}$ a $(x - \xi_j)^{k_j}$ nesoudělné. Invariantní podprostory prvního rozkladu pak jsou

$$U_i = \text{Ker}(f - \xi_i \text{id})^{k_i}.$$

Na jednotlivých invariantních podprostorech vznikají restrikce $f|_{U_i} : U_i \rightarrow U_i$. Označíme-li $g_i = f - \xi_i \text{id}$, pak $\text{Ker } g_i^{k_i} = U_i$, a tedy $(g|_{U_i})^{k_i} = 0$.

Má tedy smysl studovat transformace $f : U \rightarrow U$ takové, že pro některé číslo ξ transformace $g = f - \xi \text{id}$ splňuje $g^k = 0$. Výsledky použijeme pro $U = U_i$ a $g = f|_{U_i} - \xi_i \text{id}_{U_i}$, $i = 1, \dots, s$.

1. Cyklické podprostory

Definice. Transformace $g : U \rightarrow U$ (resp. čtvercová matice B) se nazývá *nilpotentní*, jestliže existuje celé číslo $k \geq 1$ takové že $g^k = 0$ (resp. $B^k = 0$).

Cvičení. Transformace g je nilpotentní právě tehdy, když je její matice B (v libovolné bázi) nilpotentní.

Definice. Podprostor $T \subseteq U$ se nazývá *cyklický* vzhledem k transformaci $g : U \rightarrow U$, jestliže má bázi e_1, e_2, \dots, e_n takovou, že

$$g(e_1) = e_2, \quad g(e_2) = e_3, \quad \dots, \quad g(e_{n-1}) = e_n, \quad g(e_n) = 0.$$

Báze e_1, e_2, \dots, e_n se nazývá *Jordanova báze*.

Schematicky,

$$e_1 \xrightarrow{g} e_2 \xrightarrow{g} \cdots e_{n-1} \xrightarrow{g} e_n \xrightarrow{g} 0.$$

Definice. Matice

$$J_1(\xi) = (\xi), \quad J_2(\xi) = \begin{pmatrix} \xi & 0 \\ 1 & \xi \end{pmatrix}, \quad J_3(\xi) = \begin{pmatrix} \xi & 0 & 0 \\ 1 & \xi & 0 \\ 0 & 1 & \xi \end{pmatrix},$$

$$J_4(\xi) = \begin{pmatrix} \xi & 0 & 0 & 0 \\ 1 & \xi & 0 & 0 \\ 0 & 1 & \xi & 0 \\ 0 & 0 & 1 & \xi \end{pmatrix}, \quad \text{atd.}$$

se nazývají *Jordanovy bloky* (též *Jordanovy buňky*).

Tvrzení. *Bud' T cyklický podprostor nilpotentní transformace g , bud' $f = g + \xi \text{id}$. Pak*

- (1) *T je invariantní vzhledem k lineárním transformacím g i f ;*
- (2) *$g|_T$ má v Jordanově bázi e_1, e_2, \dots, e_n matici $J_n(0)$;*
- (3) *$f|_T$ má v Jordanově bázi e_1, e_2, \dots, e_n matici $J_n(\xi)$.*

Důkaz. Cvičení.

Často se setkáváme s odlišnou definicí Jordanových buněk — jedničky stojí v řadě nad diagonálou. To odpovídá opačnému pořadí vektorů Jordanovy báze, tj. e_n, \dots, e_2, e_1 .

2. Nalezení Jordanovy báze

Tvrzení. *Bud' $g : U \rightarrow U$ nilpotentní transformace. Pak existují cyklické podprostory $T_1, \dots, T_r \subseteq U$ takové, že $U = T_1 \dot{+} \dots \dot{+} T_r$.*

V důkazu budeme potřebovat následující lemma.

Lemma. *Bud' $h : U \rightarrow V$ lineární zobrazení. Zvolme libovolně bázi v $\text{Ker } h$ a doplňme ji do báze v U nějakými vektory e_1, \dots, e_m . Pak jsou vektory $h(e_1), \dots, h(e_m)$ nezávislé a tvoří bázi v $\text{Im } h$.*

Důkaz. Cvičení. (Viz důkaz formule $\dim U = \dim \text{Ker } h + \dim \text{Im } h$.)

Tvrzení dokážeme uvedením praktického algoritmu pro nalezení Jordanovy báze. Popis algoritmu tvoří věty psané kurzívou.

Máme $U = \text{Ker } g^k$ pro jisté k (protože g je nilpotentní). Bez újmy na obecnosti je číslo k minimální, to jest, $g^{k-1} \neq 0$, a tudíž $\text{Ker } g^{k-1} \neq U$.

1. *Zvolíme libovolně bázi v $\text{Ker } g^{k-1}$ a doplníme ji do báze v $U = \text{Ker } g^k$ nějakými vektory e_1, \dots, e_{m_1} . Podle lemmatu potom vektory $g^{k-1}(e_1), \dots, g^{k-1}(e_{m_1})$ tvoří bázi v $\text{Im } g^{k-1}$ a jsou tedy nezávislé.*

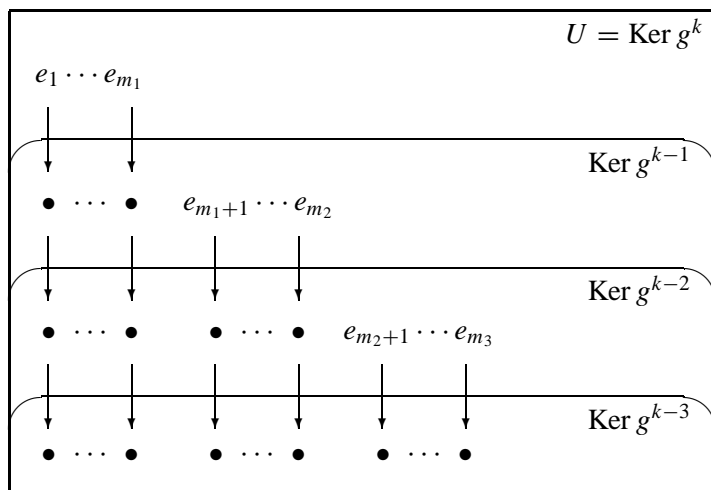
2. *Zvolíme libovolně bázi v $\text{Ker } g^{k-2}$ a přidáme k ní vektory $g(e_1), \dots, g(e_{m_1}) \in \text{Ker } g^{k-1}$ (protože $g^k = 0$). Tato sestava je lineárně nezávislá. [Skutečně, lineární závislost by znamenala, že existují skaláry c_1, \dots, c_{m_1} takové, že $c_1 g(e_1) + \dots + c_{m_1} g(e_{m_1}) \in \text{Ker } g^{k-2}$. Pak ovšem $0 = g^{k-2}(c_1 g(e_1) + \dots + c_{m_1} g(e_{m_1})) = c_1 g^{k-1}(e_1) + \dots + c_{m_1} g^{k-1}(e_{m_1})$, a tedy $c_1 = 0, \dots, c_{m_1} = 0$, protože vektory $g^{k-1}(e_1), \dots, g^{k-1}(e_{m_1})$ jsou nezávislé (viz výše).]*

19. Druhý rozklad lineární transformace

Sestavu doplníme do báze v $\text{Ker } g^{k-1}$ nějakými vektory $e_{m_1+1}, \dots, e_{m_2}$. Tím se vlastně doplní báze v $\text{Ker } g^{k-2}$ do báze v $\text{Ker } g^{k-1}$ vektory $g(e_1), \dots, g(e_{m_1}), e_{m_1+1}, \dots, e_{m_2}$. Z lemmatu potom vyplývá, že vektory $g^{k-1}(e_1), \dots, g^{k-1}(e_{m_1}), g^{k-2}(e_{m_1+1}), \dots, g^{k-2}(e_{m_2})$ tvoří bázi v obrazu $g^{k-2} \text{Ker } g^{k-1}$ a jsou tedy nezávislé.

3. Zvolíme libovolně bázi v $\text{Ker } g^{k-3}$ a připojíme k ní vektory $g^2(e_1), \dots, g^2(e_{m_1}), g(e_{m_1+1}), \dots, g(e_{m_2}) \in \text{Ker } g^{k-2}$. Tato sestava je lineárně nezávislá. [Skutečně, jinak by existovaly skaláry $c_1, \dots, c_{m_1}, c_{m_1+1}, \dots, c_{m_2}$ takové, že $c_1 g^2(e_1) + \dots + c_{m_1} g^2(e_{m_1}) + c_{m_1+1} g(e_{m_1+1}) + \dots + c_{m_2} g(e_{m_2}) \in \text{Ker } g^{k-3}$. Pak ovšem $0 = g^{k-3}(c_1 g^2(e_1) + \dots + c_{m_1} g^2(e_{m_1}) + c_{m_1+1} g(e_{m_1+1}) + \dots + c_{m_2} g(e_{m_2})) = c_1 g^{k-1}(e_1) + \dots + c_{m_1} g^{k-1}(e_{m_1}) + c_{m_1+1} g^{k-2}(e_{m_1+1}) + \dots + c_{m_2} g^{k-2}(e_{m_2})$, a tedy $c_1 = 0, \dots, c_{m_1} = 0, c_{m_1+1} = 0, \dots, c_{m_2} = 0$, protože vektory $g^{k-1}(e_1), \dots, g^{k-1}(e_{m_1}), g^{k-2}(e_{m_1+1}), \dots, g^{k-2}(e_{m_2})$ jsou nezávislé (viz výše).]

Sestavu doplníme do báze v $\text{Ker } g^{k-2}$ nějakými vektory $e_{m_2+1}, \dots, e_{m_3}$. Tím se doplní báze v $\text{Ker } g^{k-3}$ do báze v $\text{Ker } g^{k-2}$ vektory $g^2(e_1), \dots, g^2(e_{m_1}), g(e_{m_1+1}), \dots, g(e_{m_2}), e_{m_2+1}, \dots, e_{m_3}$.



Podobných kroků provedeme k (v posledním kroku doplňujeme bázi podprostoru $\text{Ker } g^0 = \text{Ker id} = \{0\}$ do báze v podprostoru $\text{Ker } g$). Celkově získáme bázi

$$e_1, \dots, e_{m_1},$$

$$g(e_1), \dots, g(e_{m_1}), e_{m_1+1}, \dots, e_{m_2},$$

$$g^2(e_1), \dots, g^2(e_{m_1}), g(e_{m_1+1}), \dots, g(e_{m_2}), e_{m_2+1}, \dots, e_{m_3},$$

$$\dots$$

v prostoru U . Podprostory

$$\llbracket e_1, g(e_1), g^2(e_1), \dots \rrbracket, \quad \dots, \quad \llbracket e_{m_1}, g(e_{m_1}), g^2(e_{m_1}), \dots \rrbracket,$$

$$\llbracket e_{m_1+1}, g(e_{m_1+1}), g^2(e_{m_1+1}), \dots \rrbracket, \quad \dots, \quad \llbracket e_{m_2}, g(e_{m_2}), g^2(e_{m_2}), \dots \rrbracket,$$

$$\dots$$

jsou pak cyklické podprostory s příslušnými Jordanovými bazemi.

3. Invarianty lineární transformace

Nalezli jsme cyklické podprostory a v každém z nich Jordanovu bázi. Situaci můžeme znázornit diagramem, jehož vrcholy jsou vektory Jordanovy báze a šipky znamenají zobrazení g :



Sloupce znamenají jednotlivé cyklické podprostory. Vektory spodní řady se zobrazují na nulový vektor. Tvoří vlastně bázi v $\text{Ker } g = \text{Ker}(f - \xi \text{id}) = V_\xi$, což je prostor vlastních vektorů s vlastním číslem ξ . Tudíž, počet sloupců = počet cyklických podprostorů = $\dim V_\xi$.

Vektory dolních j řádků tvoří bázi v $\text{Ker } g^j$. V j -tém řádku zdola je proto právě

$$m_{k-j} = \dim \text{Ker } g^j - \dim \text{Ker } g^{j-1} \quad (**)$$

bodů. Čísla $m_1 \leq m_2 \leq \dots \leq m_k$ jednoznačně určují délku sloupců diagramu, a tím i dimenze cyklických podprostorů.

Formule (***) ukazuje, že čísla $m_1 \leq m_2 \leq \dots \leq m_k$ závisí jen a jen na nilpotentní transformaci g a nikoliv na konkrétním postupu, kterým byla získána Jordanova báze. Jsou to *invarianty lineární transformace g* .

Důsledek. *Bud' $g : U \rightarrow U$ nilpotentní transformace. Pak existuje báze prostoru U taková, že*

- transformace g má blokově diagonální matici, která je přímým součtem Jordanových bloků $J_s(0)$;*
- transformace $f = g + \xi \text{id}$ má blokově diagonální matici, která je přímým součtem Jordanových bloků $J_s(\xi)$.*

Příklad. Uvažujme o lineárním zobrazení $\mathbf{C}^5 \rightarrow \mathbf{C}^5$ s maticí

$$A = \begin{pmatrix} 0 & 1 & 1 & -2 & 0 \\ -3 & -4 & -4 & 3 & 0 \\ 3 & 1 & 0 & -3 & 3 \\ 4 & 1 & 1 & -6 & 4 \\ 1 & 0 & 0 & -1 & 0 \end{pmatrix}$$

Anulující polynom nejmenšího stupně je $x^3 + 6x^2 + 12x + 8 = (x + 2)^3$, s jediným kořenem -2 , což je současně jediná vlastní hodnota matice A . První rozklad má proto jediného sčítance $U = \mathbf{C}^5$ a

$$B = A + 2E = \begin{pmatrix} 2 & 1 & 1 & -2 & 0 \\ -3 & -2 & -4 & 3 & 0 \\ 3 & 1 & 2 & -3 & 3 \\ 4 & 1 & 1 & -4 & 4 \\ 1 & 0 & 0 & -1 & 2 \end{pmatrix}$$

je nilpotentní matice, $B^3 = 0$. Spočítáme

$$B^2 = \begin{pmatrix} -4 & -1 & -2 & 4 & -5 \\ 0 & 0 & 0 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 0 & 0 \\ -4 & -1 & -2 & 4 & -5 \\ 0 & 0 & 0 & 0 & 0 \end{pmatrix},$$

19. Druhý rozklad lineární transformace

načež

$$\text{Ker } B^2 = \llbracket (5, 0, 0, 0, -4), (0, 5, 0, 0, -1), (0, 0, 5, 0, -2), (0, 0, 0, 5, 4) \rrbracket.$$

Tento čtyřrozměrný podprostor můžeme doplnit do báze v \mathbf{C}^5 libovolným vektorem, který v něm neleží, zvolme například

$$e_1 = (0, 0, 0, 0, 1).$$

Tím je ukončen první krok. Ve druhém kroku spočítáme

$$\text{Ker } B = \llbracket (1, 0, 0, 1, 0), (0, -5, 1, -2, -1) \rrbracket,$$

a přidáme vektor $Be_1 = (0, 0, 3, 4, 2)$. Získanou sestavu tří nezávislých vektorů je třeba doplnit do báze ve čtyřrozměrném $\text{Ker } B^2$ jedním vektorem; zvolme například

$$e_2 = (0, 0, 0, 5, 4)$$

(ve skutečnosti bylo možné vzít kterýkoliv ze shora uvedených generátorů podprostoru $\text{Ker } B^2$). Tím je ukončen druhý krok. Ve třetím kroku je $\text{Ker } B^0 = \text{Ker } E = 0$ a doplňujeme dva vektory $g^2(e_1) = (-5, 0, 0, -5, 0)$ a $g(e_2) = (-10, 15, -3, -4, 3)$ do báze v dvourozměrném $\text{Ker } B$, což ovšem nevyžaduje žádný doplňující vektor a jsme hotovi.

Hledaná Jordanova báze je proto tvořena vektory $e_1, g(e_1), g^2(e_1), e_2, g(e_2)$. Příslušný diagram je



a jeho dva sloupce odpovídají dvěma Jordanovým blokům rozměru 3 a 2. Dostáváme Jordanův tvar matice B resp. A jako

$$\begin{pmatrix} 0 & 0 & 0 & 0 & 0 \\ 1 & 0 & 0 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & 0 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 1 & 0 \end{pmatrix} \quad \text{resp.} \quad \begin{pmatrix} -2 & 0 & 0 & 0 & 0 \\ 1 & -2 & 0 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & -2 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & -2 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 1 & -2 \end{pmatrix}$$

(při obráceném pořadí vektorů Jordanovy báze by jedničky stály nad diagonálou; odlišné může být i pořadí Jordanových bloků).

Cvičení. Spočtete Jordanův tvar transponované matice A^\top . (Výsledek: je týž.)

Vraťme se nyní k obecné transformaci $f : V \rightarrow V$ a prvnímu rozkladu $V = U_1 \dot{+} \dots \dot{+} U_s$ podle některého anulujícího polynomu. Pro každý z prostorů U_l , $l = 1, \dots, s$ dostáváme rozklad na cyklické podprostory $T_{l,i}$, kde $i = 1, \dots, k_l$, celkem tedy

$$V = T_{1,1} \dot{+} \dots \dot{+} T_{1,k_1} \dot{+} \dots \dot{+} T_{s,1} \dot{+} \dots \dot{+} T_{s,k_s}.$$

Tento rozklad se nazývá *druhý rozklad* prostoru lineární transformace.

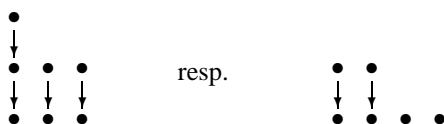
Připomeňme, že cyklické podprostory $T_{i,j}$ jsou invariantní a zobrazení $f|_{T_{i,j}}$ mají v Jordanově bázi matici tvaru $J_r(\xi)$, $r = \dim T_{i,j}$.

Definice. Matice, která je přímým součtem matic $J_r(\xi)$, se nazývá *matice v Jordanově tvaru*.

Příklad. Matice

$$A = \left(\begin{array}{ccc|cc|cc|cc|cc|cc} 2 & 1 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 \\ 0 & 2 & 1 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 2 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 \\ \hline 0 & 0 & 0 & 2 & 1 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 0 & 2 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 \\ \hline 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 2 & 1 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 2 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 \\ \hline 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 3 & 1 & 0 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 3 & 0 & 0 & 0 \\ \hline 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 3 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 3 & 0 \\ \hline 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 3 \\ 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 3 \end{array} \right)$$

je v Jordanově tvaru. Bloky prvního rozkladu jsou vyznačeny dvojitou čarou. Blokům druhého rozkladu odpovídají diagramy



Šipky zde znamenají zobrazení $f - 2 \text{id}$ resp. $f - 3 \text{id}$. Délky spodních řádků jsou dimenze prostorů vlastních vektorů s vlastními hodnotami 2 resp. 3.

Důsledek. 1. *Bud' $f : V \rightarrow V$ lineární transformace. Pak existuje báze prostoru V taková, že f má matici v Jordanově tvaru.*

2. *Bud' A čtvercová komplexní matice. Pak je podobná matici v Jordanově tvaru.*

Odpovídající báze se nazývá Jordanova báze a získáme ji sjednocením Jordanových bazí v jednotlivých cyklických podprostorech $T_{i,j}$.

Při praktickém převodu na Jordanův tvar nejdříve nalezneme invariantní podprostory $U = \text{Ker } g^k = \text{Ker}(f - \xi \text{id})^k$ prvního rozkladu, pro každou vlastní hodnotu ξ zvlášť. V každém z nich pak hledáme Jordanovu bázi známým postupem.

Zbývá rozhodnout, nakolik je Jordanův tvar matice lineárního zobrazení určen jednoznačně. Postup k nalezení Jordanovy báze, který jsme popsali, udává jednoznačně všechny Jordanovy buňky $J_s(\xi)$. Čísla ξ probíhají všechny vlastní hodnoty a rozměr s je určen prostřednictvím diagramů (*), tj. prostřednictvím čísel $m_1 \leq m_2 \leq \dots \leq m_k$, která jsou zase jednoznačně určena formulí (**), kde $g = f - \xi \text{id}$. Neurčeno pak zůstává pouze pořadí Jordanových buněk.

4. Minimální polynom

Minimální polynom můžeme jednoduše stanovit z Jordanova tvaru jako polynom

$$(x - \lambda_1)^{\mu_1} \dots (x - \lambda_s)^{\mu_s},$$

kde $\lambda_1, \dots, \lambda_s$ jsou vlastní hodnoty matice A a μ_1, \dots, μ_s jsou výšky (maximální délky sloupců) diagramů (*) pro jednotlivé vlastní hodnoty ξ_1, \dots, ξ_s . (Dokažte jako cvičení.)

Příklad. Matice z posledního příkladu má minimální polynom $(x - 2)^3(x - 3)^2$.

5. Kriterium podobnosti matic

Připomeňme, že dvě čtvercové matice A, B jsou podobné, jestliže existuje invertibilní matice Q taková, že $B = Q^{-1}AQ$. Zapisujeme $A \approx B$. Dále připomeňme, že matice jedné a téže lineární transformace v různých bazích jsou si podobné (maticí Q je v tomto případě matice přechodu mezi bázemi).

Tvrzení. Každá komplexní matice A je podobná některé matici B v Jordanově tvaru.

Důkaz. Matice A typu n/n je maticí lineárního zobrazení $f : \mathbb{C}^n \rightarrow \mathbb{C}^n, u \mapsto Au$. V Jordanově bázi má zobrazení f matici B v Jordanově tvaru. Pak $B \approx A$.

Matice B z předchozího tvrzení se nazývá *Jordanův tvar* matice A . Jordanův tvar je určen jednoznačně až na pořadí bloků a rozhoduje o podobnosti matic:

Tvrzení. Matice A', A'' jsou si podobné právě tehdy, když mají stejný Jordanův tvar až na pořadí Jordanových bloků.

Důkaz. Jsou-li si matice A', A'' podobné, pak mají zobrazení $u \mapsto A'u, u \mapsto A''u$ stejné vlastní hodnoty a stejné jsou i dimenze m'_j a m''_j určené formulí (**) (cvičení). Proto jsou stejné i Jordanovy tvary.

Naopak, buďte $B' \approx A'$ a $B'' \approx A''$ Jordanovy tvary matic A' a A'' . Jestliže se B' a B'' liší jen pořadím Jordanových bloků, pak jsou si podobné (cvičení), načež $A' \approx B' \approx B'' \approx A''$.

Cvičení. Dokažte, že pro libovolnou čtvercovou matici platí $A \approx A^T$.

Návod: Dokažte postupně

- $J \approx J^T$ pro libovolnou Jordanovu matici J (stačí zpřeházet vektory v Jordanově bázi);
- je-li $A \approx J$, pak $A^T \approx J^T$.