

Polinomul caracteristic și polinomul minimal al unei matrice

Prezentare de prof. Doru Buzac

Câteva noțiuni teoretice

Definiția 1. Un număr $\lambda \in \mathbb{C}$ se numește **valoare proprie** pentru matricea $A \in M_n(\mathbb{C})$, dacă există un vector nenul $X \in M_{n,1}(\mathbb{C})$, astfel încât $AX = \lambda X$.

Un astfel de vector X se numește **vector propriu** pentru matricea A , corespunzător valorii proprii λ .

Proprietăți. Dacă $\lambda \in \mathbb{C}$ este valoare proprie pentru matricea $A \in M_n(\mathbb{C})$, iar $X \in M_{n,1}(\mathbb{C})$ este vectorul propriu corespunzător atunci:

- Pentru orice $k \in \mathbb{N}$, numărul λ^k este valoare proprie pentru matricea A^k , iar X este vector propriu pentru A^k ;
- Pentru orice polinom $p \in \mathbb{C}[X]$ numărul $p(\lambda)$ este valoare proprie pentru matricea $p(A)$, iar X este vector propriu pentru $p(A)$;
- Dacă A este inversabilă, atunci $\lambda \neq 0$ și numărul $\frac{1}{\lambda}$ este valoare proprie pentru matricea A^{-1} .

Teoremă. Un număr $\lambda \in \mathbb{C}$ este valoare proprie pentru matricea $A \in M_n(\mathbb{C})$, dacă și numai dacă $\det(A - \lambda I_n) = 0$.

Definiția 2. Polinomul $p_A \in \mathbb{C}[X]$, $p_A(X) = \det(XI_n - A)$ se numește polinomul caracteristic al matricei A .

Propoziție. Dacă $A \in M_n(\mathbb{C})$, atunci $p_A(X) = X^n - \sigma_1 X^{n-1} + \sigma_2 X^{n-2} - \dots + (-1)^n \sigma_n$, unde σ_k este suma minorilor diagonali de ordin k din matricea A .

Deci dacă $\lambda_1, \lambda_2, \dots, \lambda_n$ sunt valorile proprii ale lui A , atunci din relațiile lui Viete obținem

$$\sigma_1 = \sum_{i=1}^n \lambda_i = \text{Tr}(A), \quad \sigma_2 = \sum_{1 \leq i < j \leq n} \lambda_i \lambda_j, \quad \dots, \quad \sigma_n = \lambda_1 \cdot \lambda_2 \cdot \dots \cdot \lambda_n = \det(A).$$

În particular pentru o matrice de ordinul doi, $A = \begin{pmatrix} a & b \\ c & d \end{pmatrix}$, avem

$$p_A(X) = X^2 - \text{Tr}(A) \cdot X + \det(A);$$

Iar pentru o matrice de ordinul trei $A \in M_3(\mathbb{C})$, avem

$$p_A(X) = X^3 - \text{Tr}(A)X + \text{Tr}(A^*)X^2 - \det(A).$$

Folosindu-ne acum de relațiile lui Viete avem

$$\text{Tr}(A^*) = \sum_{1 \leq i \leq j \leq n} \lambda_i \lambda_j = \frac{\left(\sum_{i=1}^n \lambda_i \right)^2 - \sum_{i=1}^n \lambda_i^2}{2} = \frac{(\text{Tr}(A))^2 - \text{Tr}(A^2)}{2}.$$

Teoremă (Hamilton-Cayley). Dacă $A \in M_n(\mathbb{C})$, atunci $p_A(A) = O_n$, adică orice matrice pătratică este rădăcină a polinomului său caracteristic.

Definiția 3. Spunem că două matrici $A, B \in M_n(K)$, sunt asemenea dacă există o matrice inversabilă $T \in M_n(K)$ astfel încât $A = T^{-1}BT$.

Propoziție. Dacă A și B sunt două matrici pătratice asemenea atunci au același polinom caracteristic.

Demonstrație:

Deoarece $XI_n - A = XT^{-1}T - T^{-1}BT = T^{-1}(XI_n - A)T$, atunci rezultă că

$$\det(XI_n - A) = \det(XI_n - B)$$

Definiția 4. Dacă $A \in M_n(\mathbb{C})$, polinomul monic $m_A \in \mathbb{C}[X]$, de grad minim care admite pe A ca rădăcină, se numește **polinomul minimal** al matricii A .

Observație. Orice polinom ce admite pe A ca rădăcină este divizibil cu m_A .

Exemplu. Fie $A \in M_3(\mathbb{R})$, $A = \begin{pmatrix} 0 & -1 & 0 \\ -1 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 1 \end{pmatrix}$. Polinomul caracteristic al lui A este

$$p_A(X) = \begin{vmatrix} X & 1 & 0 \\ 1 & X & 0 \\ 0 & 0 & X-1 \end{vmatrix} = (X-1)^2(X+1),$$

cu divizorii $1, X-1, X+1, (X-1)^2, X^2-1, (X-1)^2(X+1)$. Polinomul m_A fiind de grad minim, va fi din lista de mai sus a divizorilor lui p_A . Cum $A^2 = I_2$, rezultă că X^2-1 admite pe A ca rădăcină, deducem că $m_A(X) = X^2-1$.

Teoremă (Frobenius) Fie K un corp de numere și $A \in M_n(K)$. Polinoamele p_A și m_A admit aceiași divizori ireductibili peste K .

Aplicații

1. Dacă $A, B \in M_n(\mathbb{C})$ sunt două matrici oarecare, atunci polinoamele caracteristice asociate matricelor AB și BA sunt egale.

Demonstrație:

Presupunem mai întâi că $\det(A) \neq 0$. Atunci $BA = A^{-1}(AB)A$, deci matricile AB și BA sunt asemenea, ceea ce, conform unei propoziții de mai sus rezultă că au același polinom caracteristic.

Dacă $\det(A) = 0$, luăm un $x \in \mathbb{C}$ care să nu fie valoare proprie pentru $-A$, deci $\det(xI_n + A) \neq 0$. Prin urmare $xI_n + A$ este o matrice inversabilă, ceea ce implică faptul că $(xI_n + A)B$ și $B(xI_n + A)$ au același polinom caracteristic, deci $P_{(xI_n + A)B} = P_{B(xI_n + A)}$, relație care are loc pentru o infinitate de valori ale lui x , deci are loc pentru $(\forall)x \in \mathbb{C}$. În particular luăm $x = 0$ și obținem concluzia.

2. Pentru orice matrice $A, B \in M_n(\mathbb{C})$ și $\lambda \in \mathbb{C}$ au loc relațiile:

- a) $Tr(AB) = Tr(BA)$;
- b) $\det(\lambda I_n + AB) = \det(\lambda I_n + BA)$.

Demonstrație:

a) Deoarece $p_{AB} = p_{BA}$ iar coeficienții lui X^{n-1} sunt $Tr(AB)$ și $Tr(BA)$, rezultă concluzia.

b) $\det(\lambda I_n + AB) = (-1)^n p_{AB}(-\lambda) = (-1)^n p_{BA}(-\lambda) = \det(\lambda I_n + BA)$.

3. Fie $A \in M_n(\mathbb{C})$. Dacă $Tr(A) = Tr(A^2) = Tr(A^3) = \dots = Tr(A^n) = 0$, atunci $A^n = O_n$.

Demonstrație.

Dacă $\lambda_1, \lambda_2, \dots, \lambda_n$ sunt valorile proprii ale matricei A , atunci $\lambda_1^k, \lambda_2^k, \dots, \lambda_n^k$ sunt valorile proprii ale matricei A^k . Din condițiile inițiale se obține sistemul

$$\begin{cases} \lambda_1 + \lambda_2 + \dots + \lambda_n = 0 \\ \lambda_1^2 + \lambda_2^2 + \dots + \lambda_n^2 = 0 \\ \dots\dots\dots \\ \lambda_1^n + \lambda_2^n + \dots + \lambda_n^n = 0 \end{cases}$$

Arătăm că $\lambda_1 = \lambda_2 = \dots = \lambda_n = 0$, este singura soluție.

Dacă rescriem sistemul sub forma

$$\begin{cases} \lambda_1 \cdot 1 + \lambda_2 \cdot 1 + \dots + \lambda_n \cdot 1 = 0 \\ \lambda_1 \cdot \lambda_1 + \lambda_2 \cdot \lambda_2 + \dots + \lambda_n \cdot \lambda_n = 0 \\ \dots\dots\dots \\ \lambda_1 \cdot \lambda_1^{n-1} + \lambda_2 \cdot \lambda_2^{n-1} + \dots + \lambda_n \cdot \lambda_n^{n-1} = 0 \end{cases}$$

rezultă că $(\lambda_1, \lambda_2, \dots, \lambda_n)$ este soluție a sistemului de ecuații liniare cu determinantul de tip Vandermonde $\Delta = V(\lambda_1, \lambda_2, \dots, \lambda_n)$. Dacă $\Delta \neq 0$ atunci $\lambda_1 = \lambda_2 = \dots = \lambda_n = 0$.

Dacă $\Delta = 0$, atunci $\lambda_1, \lambda_2, \dots, \lambda_n$ nu sunt distincte. Să presupunem că $\lambda_1, \lambda_2, \dots, \lambda_p$ sunt distincte cu multiplicitățile k_1, k_2, \dots, k_p ($k_1 + k_2 + \dots + k_p = n$). Reținem din sistem primele p ecuații:

6. Fie $A \in M_2(\mathbb{Z})$ cu proprietatea că $\exists n \in \mathbb{N}^*$, $(n, 6) = 1$, astfel încât $A^n = I_2$, atunci $A = I_2$.

Demonstrație:

Avem $A \in M_2(\mathbb{Z}) \subset M_2(\mathbb{R})$, deci $m_A \in \mathbb{R}[X]$. Din $A^n - I_2 = O_2 \Rightarrow m_A \mid (X^n - 1)$ deci avem iarăși cazurile:

- $\text{grad}(m_A) = 1$ și atunci $m_A = X \pm 1$, dar cum n este impar, polinomul $X^n - 1$ are ca singură rădăcină reală, pe 1 și atunci $m_A = X - 1$, deci $A = I_2$.

- $\text{grad}(m_A) = 2$, atunci la fel ca mai sus $p_A = m_A = X^2 - 2X \cos \frac{2k\pi}{n} + 1$. Dar acum avem în

plus că $m_A = p_A \in \mathbb{Z}[X]$, de unde rezultă că $\cos \frac{2k\pi}{n} \in \left\{0, -1, 1, \frac{1}{2}, -\frac{1}{2}\right\}$. Cum $\Delta < 0$,

rezultă că $\cos \frac{2k\pi}{n} = 0$ sau $\cos \frac{2k\pi}{n} = \pm \frac{1}{2}$. Folosind iarăși că n este impar o să avem că

$\cos \frac{2k\pi}{n} \neq 0$, iar din $(n, 3) = 1$ rezultă că $\cos \frac{2k\pi}{n} \neq \pm \frac{1}{2}$. Deci cazul $\text{grad}(m_A) = 2$ nu

este posibil și atunci $A = I_2$.

7. Să se arate că dacă $A \in M_n(\mathbb{R})$ și $A^3 = A + I_n$, atunci $\det(A) > 0$.

Demonstrație:

Funcția $f: \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$, dată de $f(x) = x^3 - x - 1$, are derivata $f'(x) = 3x^2 - 1$, cu rădăcinile

$x_1 = -\frac{1}{\sqrt{3}}$, $x_2 = \frac{1}{\sqrt{3}}$. Aplicăm șirul lui Rolle și obținem

$f(-\infty) < 0$, $f(x_1) < 0$, $f(x_2) < 0$, $f(\infty) > 0$. Mai mult, din $f(1) \cdot f(2) < 0$, deducem că singura rădăcină reală a este în intervalul $(1, 2)$. Rezultă că

$m_A \mid (X^3 - X - 1) = (X - a)(X^2 + bX + c)$, cu $ac = 1$ și $a > 0$, deci $c > 0$. Astfel

$m_A = (X - a)^s (X^2 + bX + c)^t$ și conform teoremei lui Frobenius o să avem că

$p_A = (X - a)^u (X^2 + bX + c)^v = (-1)^n \det(A - XI_n)$ cu $u + 2v = n$. Deducem că

$p_A(0) = (-a)^u \cdot c^v = (-1)^n \det(A)$, deci $\det(A) = (-1)^{n+u} a^u c^v = (-1)^{2u+2v} a^u c^v = a^u c^v > 0$.

8. Fie matricea $A \in M_n(\mathbb{R})$ cu $A^3 = 4I_n - 3A$. Să se arate că $\det(A + I_n) = 2^n$.

Demonstrație:

$A^3 - 4I_n + 3A = O_n$ și $X^3 + 3X - 4 = (X - 1)(X^2 + X + 4)$ implică

$m_A = (X - 1)^s (X^2 + X + 4)^t$. Aplicăm teorema lui Frobenius și obținem:

$p_A(X) = (X - 1)^u (X^2 + X + 4)^v = (-1)^n \det(A - XI_n)$, $u + 2v = n$.

Deducem $p_A(-1) = (-2)^u 4^v = (-1)^n \det(A + I_n)$, deci

$\det(A + I_n) = (-1)^{n+u} 2^u 4^v = (-1)^{2u+2v} 2^{u+2v} = 2^n$.

9. Considerăm $A \in M_n(\mathbb{R})$ cu $A^3 = 3A - 2I_n$. Să se calculeze $\det(A^2 + A + I_n)$.

Soluție:

$A^3 - 3A + 2I_n = O_n \Rightarrow m_A \mid (X^3 - 3X + 2)$ și $X^3 - 3X + 2 = (X - 1)^2 (X + 2)$, deci $m_A = (X - 1)^s (X + 2)^t$ și atunci $p_A = (X - 1)^u (X + 2)^v = (-1)^n \det(A - XI_n)$, $u + v = n$. Avem $\det(A^2 + A + I_n) = \det(A - \varepsilon I_n) \det(A - \varepsilon^2 I_n)$, unde ε este rădăcina cubică a unității.

Obținem succesiv $p_A(\varepsilon) = (\varepsilon - 1)^u (\varepsilon + 2)^v = (-1)^n \det(A - \varepsilon I_n)$ și

$$p_A(\varepsilon^2) = (\varepsilon^2 - 1)^u (\varepsilon^2 + 2)^v = (-1)^n \det(A - \varepsilon^2 I_n).$$

$$p_A(\varepsilon) p_A(\varepsilon^2) = (\varepsilon - 1)^u (\varepsilon + 2)^v (\varepsilon^2 - 1)^u (\varepsilon^2 + 2)^v = \det(A^2 + A + I_n), \text{ deci}$$

$$\det(A^2 + A + I_n) = (\varepsilon^3 - \varepsilon - \varepsilon^2 + 1)^u (\varepsilon^3 + 2\varepsilon + 2\varepsilon^2 + 4)^v = 3^u 3^v = 3^n.$$

10. Fie $A, B \in M_2(\mathbb{C})$ astfel încât $AB = BA$ și există numerele naturale nenule m și n astfel încât $A^m = O_2$ și $B^n = O_2$. Să se arate că $AB = O_2$.

Demonstrație:

Este cunoscut faptul că din $A^m = O_2$ rezultă $A^2 = O_2$ și analog $B^2 = O_2$.

Rezultă că $(A + B)^4 = A^4 + 4A^3B + 6A^2B^2 + 4AB^3 + B^4 = O_2$, deci $m_{A+B} \mid X^4$.

Dacă $\text{grad}(m_{A+B}) = 1 \Rightarrow m_{A+B} = X, \Rightarrow A + B = O_2, A = -B$, deci $AB = -A^2 = O_2$. Dacă $\text{grad}(m_{A+B}) = 2$, atunci $m_{A+B} = p_{A+B} = X^2$, deci $(A + B)^2 = O_2$ ceea ce implică $A^2 + 2AB + B^2 = 2AB = O_2$, deci $AB = O_2$.

11. Arătați că, dacă matricea $A \in M_2(\mathbb{Z})$ satisface $A^4 = I_2$, atunci $A^2 = I_2$ sau $A^2 = -I_2$.

Demonstrație: Din $A^4 - I_2 = O_2 \Rightarrow m_A \mid (X - 1)(X + 1)(X^2 + 1)$. Dacă $\text{grad}(m_A) = 1$, atunci $m_A = X - 1, A = I_2$, sau $m_A = X + 1, A = -I_2$, în ambele cazuri $A^2 = I_2$.

Dacă $\text{grad}(m_A) = 2$, atunci $m_A = X^2 - 1 = p_A$, deci $A^2 = I_2$, sau $m_A = X^2 + 1 = p_A$, deci $A^2 = -I_2$.

12. Fie $A, B \in M_n(\mathbb{C})$ și $\varepsilon = \cos \frac{2\pi}{n} + i \sin \frac{2\pi}{n}$, $n \in \mathbb{N}^*$. Arătați că

$$\det(A + B) + \det(A + \varepsilon B) + \dots + \det(A + \varepsilon^{n-1} B) = n(\det A + \det B).$$

Demonstrație:

Considerăm polinomul $P = \det(A + XB) = \det(B)X^n + a_1X^{n-1} + \dots + a_{n-1}X + \det(A)$.

Atunci $P(\varepsilon^k) = \det(B)(\varepsilon^k)^n + a_1(\varepsilon^k)^{n-1} + \dots + a_{n-1}\varepsilon^k + \det(A)$, $(\forall) k = \overline{0, n-1}$.

Adunând aceste relații obținem:

$$\sum_{k=0}^{n-1} P(\varepsilon^k) = \sum_{k=0}^{n-1} \det(A + \varepsilon^k B) = n(\det A + \det B) + a_1 \left[1 + \varepsilon^{n-1} + (\varepsilon^{n-1})^2 + \dots + (\varepsilon^{n-1})^{n-1} \right] +$$

$$a_2 \left[1 + \varepsilon^{n-2} + (\varepsilon^{n-2})^2 + \dots + (\varepsilon^{n-2})^{n-1} \right] + \dots + a_{n-1} \left[1 + \varepsilon + \varepsilon^2 + \dots + \varepsilon^{n-1} \right] =$$

$$n(\det A + \det B) + a_1 \frac{\varepsilon^{n(n-1)} - 1}{\varepsilon^{n-1} - 1} + a_2 \frac{\varepsilon^{n(n-2)} - 1}{\varepsilon^{n-2} - 1} + \dots + a_{n-1} \frac{\varepsilon^n - 1}{\varepsilon - 1} = n(\det A + \det B), \text{ deoarece}$$

$$\varepsilon^n = 1 \text{ și } \varepsilon^k \neq 1, (\forall) k = \overline{1, n-1}.$$

Ca un caz particular la relația de mai sus avem binecunoscuta relație $\det(A+B) + \det(A-B) = 2(\det A + \det B)$, pentru $A, B \in M_2(\mathbb{C})$.

13. Fie matricea $A \in M_2(\mathbb{C})$. Să se arate că pentru orice $p \in \mathbb{N}^*$, avem

$$\det(A^p + I_2) = \det^p(A) + \text{tr}(A^p) + 1.$$

Demonstrație:

Demonstrația acestei probleme cat și pentru următoarele se bazează pe următoarea teoremă.

Teoremă. Fie $\lambda_1, \lambda_2, \dots, \lambda_n$ valorile proprii ale matricei $A \in M_n(\mathbb{C})$ și polinomul

$f \in \mathbb{C}[X]$, $f = a_0 X^k + a_1 X^{k-1} + \dots + a_{k-1} X + a_k$. Atunci valorile proprii ale lui $f(A)$ sunt $f(\lambda_1), f(\lambda_2), \dots, f(\lambda_n)$ și $\det f(A) = f(\lambda_1) f(\lambda_2) \dots f(\lambda_n)$.

Revenind la problemă, pentru $\lambda_1, \lambda_2 \in \mathbb{C}$, valorile proprii ale matricei A și pentru

$f = X^p + 1$, avem

$$\det(A^p + I_2) = f(\lambda_1) f(\lambda_2) = (\lambda_1^p + 1)(\lambda_2^p + 1) = (\lambda_1 \lambda_2)^p + (\lambda_1^p + \lambda_2^p) + 1 = \det^p(A) + \text{Tr}(A^p) + 1$$

14. Fie $A \in M_2(\mathbb{R})$ cu $\det A = d \neq 0$, astfel încât $\det(A + dA^*) = 0$. Să se arate că $\det(A - dA^*) = 4$.

Demonstrație: Dacă $\lambda_1, \lambda_2 \in \mathbb{C}$ sunt valorile proprii ale lui A , ipoteza $\det(A + dA^*) = 0$

implică $0 = \det(A + d^2 A^{-1}) = \det A^{-1} \det(A^2 + d^2 I_2) = \det A^{-1} \cdot (\lambda_1^2 + d^2)(\lambda_2^2 + d^2)$, de unde

iese că $\lambda_1 = id$ și $\lambda_2 = -id$. Pe de altă parte din $d = \lambda_1 \lambda_2$ reiese că

$d = \lambda_1 \lambda_2 = id \cdot (-id) = d^2$, deci $d = 1$, $\lambda_1 = i$, $\lambda_2 = -i$. Astfel avem că

$$\begin{aligned} \det(A - dA^*) &= \det(A - d^2 A^{-1}) = \det A^{-1} \det(A^2 - d^2 I_2) = \\ &= \frac{1}{d} (\lambda_1^2 - d^2)(\lambda_2^2 - d^2) = (-1-1)(-1-1) = 4 \end{aligned}$$

Bibliografie.

- [1] Vasile Pop, Dana Heuberger, *Matematică de excelență*, Ed. Paralela 45, 2014
- [2] Crăița Doniga, Sorin Țiplea, *Polinomul caracteristic asociat unei matrice*, Ed. Pim
- [3] Colecția *Gazeta Matematică*, (Gm 1/2014, Gm 11/2014 etc.)