

Capítulo 7

Diagonalização

7.1 Diagonalização de operadores

Dado um operador linear $T : V \rightarrow V$, nosso objetivo é encontrar, se existir, uma base β de V tal que a matriz de T nessa base, $[T]_{\beta}^{\beta}$, seja diagonal. É a isso que nos referimos por *diagonalizar um operador*, ou ainda, dizer que um operador é *diagonalizável*. É evidente que matrizes diagonais são mais simples de lidar, por exemplo, quando queremos aplicar o operador a um vetor: $[T(v)]_{\beta} = [T]_{\beta}^{\beta} [v]_{\beta}$.

Antes de apresentar a teoria, vamos retomar um exemplo do capítulo anterior.

Considere o operador $T : \mathbb{R}^3 \rightarrow \mathbb{R}^3$ definido por

$$T(x, y, z) = (x, y, -x + 2z).$$

Escolhendo a base

$$\beta = \{(1, 0, 1); (0, 2, 0); (0, 0, 1)\}$$

de \mathbb{R}^3 e fazendo as contas chegamos a

$$[T]_{\beta}^{\beta} = \begin{bmatrix} 1 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 2 \end{bmatrix}.$$

Note que $[T]_{\beta}^{\beta}$ é diagonal, e que cada vetor da base β é autovetor de T . De fato, você pode verificar que

$$T(1, 0, 1) = 1(1, 0, 1), \quad T(0, 2, 0) = 1(0, 2, 0), \quad T(0, 0, 1) = 2(0, 0, 1).$$

Este exemplo indica que a procura pela base β passa por estudar os autovetores de T .

7.1.1 Bases formadas por autovetores

Dado um operador linear $T : V \rightarrow V$ suponha que

$$\beta = \{v_1, \dots, v_n\}$$

seja uma base de V para a qual

$$[T]_{\beta}^{\beta} = \begin{bmatrix} \lambda_1 & 0 & \cdots & 0 \\ 0 & \lambda_2 & \cdots & 0 \\ \vdots & \vdots & \ddots & \vdots \\ 0 & 0 & \cdots & \lambda_n \end{bmatrix}.$$

Sabemos que a cada coluna i dessa matriz é exatamente $[T(v_i)]_\beta$, e assim

$$T(v_i) = 0v_1 + \cdots + \lambda_i v_i + \cdots + 0v_n \Rightarrow T(v_i) = \lambda_i v_i$$

para todo i . Ou seja,

Se $[T]_\beta^\beta$ é diagonal, então a base β é formada por autovetores de T .

Po outro lado, se

$$\beta = \{v_1, \dots, v_n\}$$

é base V formada por autovetores de T , digamos $T(v_i) = \lambda_i v_i$ para todo i (autovetor v_i associado ao autovalor λ_i), então

$$T(v_i) = \lambda_i v_i \Rightarrow T(v_i) = 0v_1 + \cdots + \lambda_i v_i + \cdots + 0v_n$$

para todo i , e logo

$$[T]_\beta^\beta = \begin{bmatrix} | & | & & | \\ [T(v_1)]_\beta & [T(v_2)]_\beta & \cdots & [T(v_n)]_\beta \\ | & | & & | \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} \lambda_1 & 0 & \cdots & 0 \\ 0 & \lambda_2 & \cdots & 0 \\ \vdots & \vdots & \ddots & \vdots \\ 0 & 0 & \cdots & \lambda_n \end{bmatrix}.$$

Ou seja,

Se β é base formada por autovetores de T , então $[T]_\beta^\beta$ é diagonal. Neste caso, **a diagonal de $[T]_\beta^\beta$ será formada pelos autovalores de T na ordem em que a base de autovetores é construída**, como mostra a expressão acima.

Isso nos leva à concluir que T admite uma base β que torna sua matriz diagonal se, e somente se, essa base β é formada por autovetores T . Isso motiva a definição de *operador diagonalizável*:

Definição 7.1. Um operador $T : V \rightarrow V$ é **diagonalizável** se existe uma base de V formada por autovetores de T .

Exemplo 7.1. O operador T sobre \mathbb{R}^3 do início do capítulo,

$$T(x, y, z) = (x, y, -x + 2z).$$

é diagonalizável pois, como vimos, $\beta = \{(1, 0, 1); (0, 2, 0); (0, 0, 1)\}$ é uma base de \mathbb{R}^3 onde todos os elementos são autovetores de T . Neste caso, vimos que $[T]_\beta^\beta$ é diagonal. \square

Exemplo 7.2. Considere o operador $S : \mathbb{R}^2 \rightarrow \mathbb{R}^2$ definido por

$$S(x, y) = (x + y, y).$$

O polinômio característico associado é

$$p(\lambda) = \det([S]_{can}^{can} - \lambda \mathbf{I}_2) = \det \begin{bmatrix} 1 - \lambda & 1 \\ 0 & 1 - \lambda \end{bmatrix} = (1 - \lambda)^2,$$

cujas únicas raízes (autovalores) são $\lambda = 1$. Resolvendo o sistema $([S]_{can}^{can} - \mathbf{I}_2)[v]_{can} = \mathbf{0}$, obtemos

$$[v]_{can} = \begin{bmatrix} x \\ 0 \end{bmatrix}$$

(verifique!). Assim, conseguimos apenas um autovetor LI, por exemplo, $v = (1, 0)$. Logo, **não é possível** construir uma base de \mathbb{R}^2 formada por autovetores de S . Assim, S **não** é diagonalizável. Você pode tentar conseguir uma base para a qual a matriz de S seja diagonal, e não terá sucesso! \square

O exemplo anterior mostra que **nem sempre** é possível diagonalizar um operador. **Então, como saber se um operador é diagonalizável?**

Passamos agora a estudar quando conseguimos diagonalizar um operador. Ou seja, **quando conseguimos autovetores LI suficientes para formar uma base.**

Teorema 7.1. *Autovetores associados a autovalores distintos são LI.*

Mais especificamente se $\lambda_1, \dots, \lambda_r$ são autovalores de T , distintos entre si, e v_1, \dots, v_r são autovetores correspondentes então $\{v_1, \dots, v_r\}$ é um conjunto LI.

Imediatamente, se o operador $T : V \rightarrow V$ possui n autovalores distintos ($n = \dim V$) então existem n autovetores LI, e logo formam uma base de V .

Corolário 7.1. *Se V é um espaço vetorial de dimensão n e o operador linear $T : V \rightarrow V$ possui n autovalores distintos, então T é diagonalizável.*

Exemplo 7.3. Seja $T : \mathbb{R}^3 \rightarrow \mathbb{R}^3$ o operador linear definido por

$$T(x, y, z) = (x - y + z, z, 2x + y + 2z).$$

Sua matriz na base canônica do \mathbb{R}^3 é

$$[T]_{can}^{can} = \begin{bmatrix} 1 & 0 & 2 \\ -1 & 0 & 1 \\ 1 & 1 & 2 \end{bmatrix},$$

donde segue que o polinômio característico é

$$p(\lambda) = \det([T]_{can}^{can} - \lambda \mathbf{I}_3) = \det \begin{bmatrix} 1 - \lambda & 0 & 2 \\ -1 & -\lambda & 1 \\ 1 & 1 & 2 - \lambda \end{bmatrix}.$$

Usando desenvolvimento de Laplace sobre a primeira linha, obtemos

$$\begin{aligned} p(\lambda) &= (-1)^{1+1}(1 - \lambda) \det \begin{bmatrix} -\lambda & 1 \\ 1 & 2 - \lambda \end{bmatrix} + (-1)^{1+3} 2 \det \begin{bmatrix} -1 & -\lambda \\ 1 & 1 \end{bmatrix} \\ &= (1 - \lambda)[- \lambda(2 - \lambda) - 1] + 2(-1 + \lambda) \\ &= (1 - \lambda)[\lambda^2 - 2\lambda - 3]. \end{aligned}$$

Assim, os autovalores de T (raízes de p) são

$$\lambda_1 = 1, \quad \lambda_2 = -1, \quad \lambda_3 = 3.$$

Como os três autovalores são distintos entre si, T é diagonalizável. Podemos então calcular uma base de autovetores que diagonaliza T .

Autovetor associado a $\lambda_1 = 1$. Devemos encontrar uma solução não trivial do sistema $([T]_{can}^{can} - \mathbf{I}_3)[v]_{can} = \mathbf{0}$ (onde $[v]_{can} = \begin{bmatrix} x & y & z \end{bmatrix}^t$), ou seja,

$$\begin{cases} 2z = 0 \\ -x - y + z = 0 \\ x + y + z = 0 \end{cases}$$

Uma solução não trivial é

$$[v_1]_{can} = \begin{bmatrix} 1 \\ -1 \\ 0 \end{bmatrix} \Rightarrow v_1 = (1, -1, 0).$$

Autovetor associado a $\lambda_2 = -1$. O sistema associado $([T]_{can}^{can} + \mathbf{I}_3)[v]_{can} = \mathbf{0}$ toma a forma

$$\begin{cases} 2x & +2z & = & 0 \\ -x & +y & +z & = & 0 \\ x & +y & +3z & = & 0 \end{cases}.$$

Uma solução não trivial é (verifique)

$$[v_2]_{can} = \begin{bmatrix} 1 \\ 2 \\ -1 \end{bmatrix} \Rightarrow v_2 = (1, 2, -1).$$

Autovetor associado a $\lambda_3 = 3$. O sistema associado é $([T]_{can}^{can} - 3\mathbf{I}_3)[v]_{can} = \mathbf{0}$, ou seja,

$$\begin{cases} -2x & +2z & = & 0 \\ -x & -3y & +z & = & 0 \\ x & +y & -z & = & 0 \end{cases}.$$

Uma solução não trivial é

$$[v_3]_{can} = \begin{bmatrix} 1 \\ 0 \\ 1 \end{bmatrix} \Rightarrow v_3 = (1, 0, 1).$$

Portanto o conjunto

$$\beta = \{v_1, v_2, v_3\} = \{(1, -1, 0) ; (1, 2, -1) ; (1, 0, 1) \}$$

é uma base de \mathbb{R}^3 formada por autovetores de T .

Finalmente, vimos que a diagonal de $[T]_{\beta}^{\beta}$ é formada pelos autovalores na mesma ordem em que os autovetores aparecem na base β , ou seja, **sem a necessidade de fazer contas** temos

$$[T]_{\beta}^{\beta} = \begin{bmatrix} 1 & 0 & 0 \\ 0 & -1 & 0 \\ 0 & 0 & 3 \end{bmatrix}.$$

□

Exemplo 7.4. Considere o operador linear sobre \mathbb{R}^4

$$T(x, y, z, w) = (x + y - z + 2w, 2y + w, -z + 3w, 5w).$$

A matriz de T na base canônica de \mathbb{R}^4 é

$$[T]_{can}^{can} = \begin{bmatrix} 1 & 0 & 0 & 0 \\ 1 & 2 & 0 & 0 \\ -1 & 0 & -1 & 0 \\ 2 & 1 & 3 & 5 \end{bmatrix},$$

cujos autovalores são

$$\lambda_1 = 1, \quad \lambda_2 = 2, \quad \lambda_3 = -1, \quad \lambda_4 = 5,$$

pois trata-se de uma matriz triangular inferior. Como todos os autovalores são distintos, T é diagonalizável. Isto é, é possível construir uma base β de \mathbb{R}^4 formada por autovetores de T , para a qual $[T]_{\beta}^{\beta}$ será diagonal. □

Atividade 7.1. Calcule uma base de \mathbb{R}^4 formada por autovetores de T no exercício anterior, e escreva a matriz de T nessa base.

7.1.2 Matrizes

Operadores lineares podem ser descritos por suas matrizes em determinadas bases; portanto, eles podemos falar em *matrizes diagonalizáveis* também.

Definição 7.2. Uma matriz quadrada \mathbf{A} de ordem n é dita **diagonalizável** se o operador associado $T : \mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R}^n$ definido por $[T]_{can}^{can} = \mathbf{A}$ é diagonalizável.

Isto é, \mathbf{A} ($n \times n$) é diagonalizável se admite n autovetores LI.

Para saber se uma matriz é diagonalizável, procedemos da mesma forma que com operadores:

- Calculamos as raízes do polinômio característico de \mathbf{A} ,

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

- Se as raízes (autovalores de \mathbf{A}) forem todas distintas entre si, então \mathbf{A} é diagonalizável e podemos calcular os autovetores resolvendo os sistemas $\mathbf{A}\mathbf{v} = \lambda_i \mathbf{v}$ (ou $(\mathbf{A} - \lambda_i \mathbf{I}_n)\mathbf{v} = \mathbf{0}$).

Exemplo 7.5. A matriz

$$\mathbf{A} = \begin{bmatrix} 1 & 1 & 8 \\ 0 & 2 & 0 \\ 0 & 0 & -1 \end{bmatrix}$$

é diagonalizável pois seu polinômio característico é

$$p(\lambda) = \det(\mathbf{A} - \lambda \mathbf{I}_3) = \begin{vmatrix} 1-\lambda & 1 & 8 \\ 0 & 2-\lambda & 0 \\ 0 & 0 & -1-\lambda \end{vmatrix} = (1-\lambda)(2-\lambda)(-1-\lambda),$$

cujas raízes são distintas entre si: $\lambda_1 = 1$, $\lambda_2 = 2$ e $\lambda_3 = -1$. □

Atividade 7.2. Calcule 3 autovetores LI da matriz \mathbf{A} do exemplo anterior.

7.1.3 O polinômio minimal

É de interesse saber se um operador/matriz é diagonalizável antes de calcular seus autovetores, pois, caso não seja, evitamos buscar uma base de autovetores em vão. Nas seções anteriores vimos um caso onde isso é possível: quando T (ou \mathbf{A}) possui todos seus autovalores distintos entre si (Corolário 7.1). Mas quando T (ou \mathbf{A}) possui alguns autovalores iguais? Como decidir apenas pelos autovalores se T (ou \mathbf{A}) é diagonalizável?

A resposta passa por eliminar raízes repetidas do polinômio característico (autovalores com multiplicidade algébrica ≥ 1). Isso nos levará a um polinômio com mesmas raízes que o polinômio característico, mas com grau menor. Definiremos um polinômio de grau mínimo possível com essas características, que chamaremos de *polinômio minimal*.

Como de costume, utilizaremos matrizes do operador T em nossas contas. Iniciemos então o estudo em termos de matrizes.

Definição 7.3. Seja

$$q(x) = a_n x^n + \cdots + a_1 x + a_0$$

um polinômio e \mathbf{A} uma matriz quadrada. Então $q(\mathbf{A})$ é matriz

$$q(\mathbf{A}) = a_n \mathbf{A}^n + \cdots + a_1 \mathbf{A} + a_0 \mathbf{I}.$$

Isto é, trocamos x por \mathbf{A} e 1 por \mathbf{I} , e operamos normalmente.

*Quando $q(\mathbf{A}) = \mathbf{0}$ (matriz nula) dizemos que o polinômio q **anula** a matriz \mathbf{A} .*

Exemplo 7.6. Sejam $q(x) = x^2 - 9$, $t(x) = 2x + 3$ e $\mathbf{A} = \begin{bmatrix} -1 & 4 \\ 2 & 1 \end{bmatrix}$. Temos

$$q(\mathbf{A}) = \mathbf{A}^2 - 9\mathbf{I}_2 = \begin{bmatrix} -1 & 4 \\ 2 & 1 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} -1 & 4 \\ 2 & 1 \end{bmatrix} - 9 \begin{bmatrix} 1 & 0 \\ 0 & 1 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 0 & 0 \\ 0 & 0 \end{bmatrix}$$

e

$$t(\mathbf{A}) = 2\mathbf{A} - 3\mathbf{I}_2 = 2 \begin{bmatrix} -1 & 4 \\ 2 & 1 \end{bmatrix} + 3 \begin{bmatrix} 1 & 0 \\ 0 & 1 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 1 & 8 \\ 4 & 5 \end{bmatrix}.$$

Assim, q anula \mathbf{A} e t não anula \mathbf{A} . □

Definição 7.4. Seja \mathbf{A} uma matriz quadrada. O **polinômio minimal** de \mathbf{A} é o polinômio da forma

$$m(x) = x^r + a_{r-1}x^{r-1} + \cdots + a_1x + a_0$$

(observe que $a_r = 1$) tal que

- $m(\mathbf{A}) = \mathbf{0}$, isto é, m anula \mathbf{A} ;
- m é o polinômio de menor grau que anula \mathbf{A} .

Podemos responder se o operador linear $T : V \rightarrow V$ é diagonalizável ou não olhando para o polinômio minimal da matriz (quadrada) $[T]_\beta^\beta$ em qualquer base β de V .

Teorema 7.2. Sejam $T : V \rightarrow V$ um operador linear e β uma base qualquer de V . Então T é diagonalizável se, e somente se, o polinômio minimal da matriz $[T]_\beta^\beta$ tem a forma

$$m(x) = (x - \lambda_1)(x - \lambda_2) \cdots (x - \lambda_r),$$

onde $\lambda_1, \dots, \lambda_r$ são os autovalores distintos de T .

O teorema acima indica que precisamos apenas calcular os autovalores de T para saber se o operador é diagonalizável ou não. Isso envolve, evidentemente, calcular as raízes do polinômio característico.

O que falta é uma maneira de calcular o polinômio minimal! Veremos como fazer isso a partir do polinômio característico.

Teorema 7.3 (de Cayley-Hamilton). Sejam $T : V \rightarrow V$ um operador linear, β uma base de V , e

$$p(x) = \det([T]_\beta^\beta - \lambda \mathbf{I})$$

o polinômio característico associado a T . Então p anula $[T]_\beta^\beta$, isto é,

$$p([T]_\beta^\beta) = \mathbf{0}.$$

NÃO se pode concluir que $p([T]_\beta^\beta) = \mathbf{0}$ pensando que “ $\det([T]_\beta^\beta - [T]_\beta^\beta \mathbf{I}) = \det \mathbf{0}$ ”... **Esta conta está ERRADA e não faz sentido**, pois $\det \mathbf{0}$ é um número, não uma matriz nula! Deve-se primeiro calcular o polinômio $p(\lambda)$ desenvolvendo o determinante normalmente e **SÓ DEPOIS** substituir λ por $[T]_\beta^\beta$. A prova deste teorema é bem mais complicada...

O Teorema de Cayley-Hamilton diz que o polinômio característico é **candidato** a ser o polinômio minimal, pois anula a matriz de T . Agora, devemos cuidar das possíveis raízes repetidas!

Teorema 7.4. *Os polinômios minimal e característico de $[T]_\beta^\beta$ têm as mesmas raízes, exceto pelas multiplicidades.*

O teorema acima diz que se λ é autovalor de T , então ambos os polinômios característico e minimal possuem o fator (ou mais precisamente, são divisíveis por)

$$x - \lambda.$$

Assim, os Teoremas 7.2, 7.4 e 7.3 fornecem a seguinte maneira de calcular o polinômio minimal e decidir se T é diagonalizável ou não:

Cálculo do polinômio minimal

1. Calcule o polinômio característico $p(\lambda) = \det([T]_\beta^\beta - \lambda \mathbf{I})$;
2. Encontre todas as raízes de p (autovalores); digamos que suas raízes distintas sejam $\lambda_1, \dots, \lambda_r$;
3. Escreva $p(x)$ na forma

$$p(x) = c (x - \lambda_1)^{d_1} (x - \lambda_2)^{d_2} \cdots (x - \lambda_r)^{d_r}$$

(λ foi trocado por x por conveniência). Os expoentes d_1, \dots, d_r são o número de vezes que cada autovalor aparece como raiz de p , ou seja, são as multiplicidades algébricas de cada autovalor;

4. O polinômio minimal será o polinômio **de menor grau**, com $c = 1$, que contém pelo menos um de cada termo $x - \lambda_i$ ($i = 1, \dots, r$), e que **anule a matriz** $[T]_\beta^\beta$.

Decidindo se T é diagonalizável ou não

5. Com o polinômio minimal $m(x)$ em mãos, T será diagonalizável se, e somente se, se **cada termo** $x - \lambda_i$ aparece uma **única** vez em $m(x)$ (Teorema 7.2).

Exemplo 7.7. Considere o operador linear sobre \mathbb{R}^3 dado por

$$T(x, y, z) = (x, y, -x + 2z).$$

Temos

$$[T]_{can}^{can} = \begin{bmatrix} 1 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & 0 \\ -1 & 0 & 2 \end{bmatrix},$$

e o polinômio característico é

$$p(\lambda) = \det([T]_{can}^{can} - \lambda \mathbf{I}_3) = \begin{vmatrix} 1 - \lambda & 0 & 0 \\ 0 & 1 - \lambda & 0 \\ -1 & 0 & 2 - \lambda \end{vmatrix} = (1 - \lambda)^2(2 - \lambda).$$

Como o polinômio minimal tem as mesmas raízes de p , ele deve ser um dos seguintes polinômios:

- $p_1(x) = (1 - x)(2 - x)$
- $p_2(x) = (1 - x)^2(2 - x)$ (o próprio polinômio característico p).

Por definição, o polinômio minimal $m(x)$ é aquele de **menor grau** que **anula** $[T]_{can}^{can}$. Então, testamos se cada candidato $p_1(x)$ e $p_2(x)$ anula $[T]_{can}^{can}$, em ordem crescente de grau. Ao encontrarmos o primeiro polinômio que anula esta matriz, paramos a busca!

Primeiro, verificamos se $p_1(x)$ anula $[T]_{can}^{can}$: expandindo $p_1(x)$, temos

$$p_1(x) = x^2 - 3x + 2.$$

Assim,

$$\begin{aligned} p_1([T]_{can}^{can}) &= ([T]_{can}^{can})^2 - 3[T]_{can}^{can} + 2\mathbf{I}_3 \\ &= \begin{bmatrix} 1 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & 0 \\ -1 & 0 & 2 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} 1 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & 0 \\ -1 & 0 & 2 \end{bmatrix} - 3 \begin{bmatrix} 1 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & 0 \\ -1 & 0 & 2 \end{bmatrix} + 2 \begin{bmatrix} 1 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 1 \end{bmatrix} \\ &= \begin{bmatrix} 1 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & 0 \\ -3 & 0 & 4 \end{bmatrix} + \begin{bmatrix} -1 & 0 & 0 \\ 0 & -1 & 0 \\ 3 & 0 & -4 \end{bmatrix} = \mathbf{0} \end{aligned}$$

(você pode também calcular $(\mathbf{I}_3 - [T]_{can}^{can})(2\mathbf{I}_3 - [T]_{can}^{can})$ e chegar ao mesmo resultado). Ou seja, $p_1([T]_{can}^{can}) = \mathbf{0}$, e portanto p_1 anula $[T]_{can}^{can}$. Assim, o polinômio minimal é

$$m(x) = (1 - x)(2 - x).$$

Como cada um dos termos do tipo $(a - x)$ aparecem uma única vez $m(x)$, concluímos que T é diagonalizável. \square

Exemplo 7.8. Considere o operador linear sobre \mathbb{R}^4 definido por

$$T(x, y, z, w) = (3x - 4z, 3y + 5z, -z, -w).$$

Temos

$$[T]_{can}^{can} = \begin{bmatrix} 3 & 0 & -4 & 0 \\ 0 & 3 & 5 & 0 \\ 0 & 0 & -1 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & -1 \end{bmatrix}$$

e, como esta matriz é triangular,

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

Os candidatos à polinômio minimal são

- $p_1(x) = (3 - x)(-1 - x)$ (polinômio de grau 2)
- $p_2(x) = (3 - x)^2(-1 - x)$ (polinômio de grau 3)
- $p_3(x) = (3 - x)(-1 - x)^2$ (polinômio de grau 3)
- $p_4(x) = p(x) = (3 - x)^2(-1 - x)^2$ (polinômio de grau 4).

O operador T será diagonalizável somente se $p_1(x)$ for seu polinômio minimal, dado que em todos os outros candidatos há termos de grau 1 aparecendo mais de uma vez. Temos

$$\begin{aligned} p_1([T]_{can}^{can}) &= (3\mathbf{I}_4 - [T]_{can}^{can})(-\mathbf{I}_4 - [T]_{can}^{can}) \\ &= \begin{bmatrix} 0 & 0 & 4 & 0 \\ 0 & 0 & -5 & 0 \\ 0 & 0 & 4 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 4 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} -4 & 0 & 4 & 0 \\ 0 & -4 & -5 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 0 \end{bmatrix} = \mathbf{0}. \end{aligned}$$

Ou seja, $p_1(x)$ anula $[T]_{can}^{can}$. Sendo o candidato de menor grau, $p_1(x)$ é o polinômio minimal. Logo, T é diagonalizável. \square

Exemplo 7.9. Considere o operador linear sobre \mathbb{R}^5 definido por

$$[T]_{can}^{can} = \begin{bmatrix} 2 & 0 & 1 & 0 & 0 \\ 0 & 2 & 0 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 2 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 0 & 1 \end{bmatrix}.$$

O polinômio característico é

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

e os candidatos à polinômio minimal são

- $p_1(x) = (2 - x)(1 - x)$ (grau 2)
- $p_2(x) = (2 - x)^2(1 - x)$ (grau 3)
- $p_3(x) = (2 - x)(1 - x)^2$ (grau 3)
- $p_4(x) = (2 - x)^3(1 - x)$ (grau 4)
- $p_5(x) = (2 - x)^2(1 - x)^2$ (grau 4)
- $p_6(x) = p(x) = (2 - x)^3(1 - x)^2$ (grau 5).

Você pode verificar que

$$p_1([T]_{can}^{can}) = \begin{bmatrix} 0 & 0 & 1 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 0 & 0 \end{bmatrix} \neq \mathbf{0},$$

e logo T **não** é diagonalizável. Se calcularmos $p_2([T]_{can}^{can}), \dots, p_5([T]_{can}^{can})$ em sequência, veremos que o primeiro polinômio que anula $[T]_{can}^{can}$ é $p_3(x)$. Ou seja, $p_3(x)$ é o polinômio minimal $m(x)$.

□

Exemplo 7.10. Considere o operador definido pela *matriz simétrica*

$$[T]_{can}^{can} = \begin{bmatrix} 2 & 0 & 1 & 0 & 0 \\ 0 & 2 & 0 & 0 & 0 \\ 1 & 0 & 2 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 0 & 1 \end{bmatrix},$$

que é uma pequena modificação do exemplo anterior. Calculando o polinômio característico,

temos

$$\begin{aligned}
p(\lambda) &= \det([T]_{can}^{can} - \lambda \mathbf{I}_3) = \det \begin{bmatrix} 2-\lambda & 0 & 1 & 0 & 0 \\ 0 & 2-\lambda & 0 & 0 & 0 \\ 1 & 0 & 2-\lambda & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 1-\lambda & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 0 & 1-\lambda \end{bmatrix} \\
&= (2-\lambda)(-1)^{1+1} \det \begin{bmatrix} 2-\lambda & 0 & 0 & 0 \\ 0 & 2-\lambda & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 1-\lambda & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 1-\lambda \end{bmatrix} \\
&\quad + (-1)^{1+3} \det \begin{bmatrix} 0 & 2-\lambda & 0 & 0 \\ 1 & 0 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 1-\lambda & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 1-\lambda \end{bmatrix} \\
&= (2-\lambda)^3(1-\lambda)^2 - (2-\lambda)(1-\lambda)^2 \\
&= (2-\lambda)(1-\lambda)^2[(2-\lambda)^2 - 1] \\
&= (2-\lambda)(1-\lambda)^2(\lambda^2 - 4\lambda + 3)
\end{aligned}$$

. As raízes da equação do segundo grau $\lambda^2 - 4\lambda + 3 = 0$ são 1 e 3. Portanto podemos escrever

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

O candidato à polinômio minimal que não possui raízes repetidas é

$$p_1(x) = (2-x)(1-x)(3-x),$$

e, fazendo as contas, podemos verificar que

$$p_1([T]_{can}^{can}) = \mathbf{0}.$$

Ou seja, $m(x) = p_1(x)$ é o polinômio minimal. Logo T é diagonalizável. \square

Os dois exemplos anteriores se parecem. Porém, o operador do primeiro exemplo não é diagonalizável, enquanto o operador do segundo exemplo sim. Isso não ocorre à toa: veremos adiante que toda matriz simétrica é diagonalizável!

Finalmente, a mesma estratégia feita para operadores pode ser aplicada à matrizes. Veja que em todos os exemplos anteriores olhamos para as matrizes dos operadores.

Exemplo 7.11. Pergunta-se se a matriz

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

é diagonalizável. Seu polinômio característico é

$$p(\lambda) = \det(\mathbf{A} - \lambda \mathbf{I}_2) = \det \begin{bmatrix} 1-\lambda & 1 \\ 0 & 1-\lambda \end{bmatrix} = (1-\lambda)^2.$$

Os candidatos à polinômio minimal são

- $p_1(x) = (1 - x)$
- $p_2(x) = p(x) = (1 - x)^2$.

Veja que

$$p_1(\mathbf{A}) = \mathbf{I}_2 - \mathbf{A} = \begin{bmatrix} 0 & 1 \\ 0 & 0 \end{bmatrix} \neq \mathbf{0}.$$

Daí, $p_1(x)$ não é o polinômio minimal de \mathbf{A} . Ou seja, o termo de grau 1 em $m(x)$ não aparece uma única vez, e logo \mathbf{A} **não** é diagonalizável. \square

7.1.4 COMENTÁRIO EXTRA E NÃO OBRIGATÓRIO – Diagonalização e multiplicidade geométrica – uma visão geométrica

Existe uma relação entre diagonalização e as multiplicidades geométricas dos autovalores. Retomando, a multiplicidade geométrica de um autovalor λ do operador (ou matriz) $T : V \rightarrow V$ é a dimensão do autoespaço

$$V_\lambda = \{v \in V \mid T(v) = \lambda v\}.$$

Ora, dizer que T é diagonalizável é o mesmo que dizer que existe uma base de V formada por autovetores de T . É claro que tal base deve pertencer à união dos autoespaços; isto é, se $\lambda_1, \dots, \lambda_r$ são os autovalores **distintos** de T , então uma base $\beta = \{v_1, \dots, v_n\}$ de V formada por autovetores é tal que

$$\{v_1, \dots, v_n\} \subset V_{\lambda_1} \cup V_{\lambda_2} \cup \dots \cup V_{\lambda_r}.$$

Mas como a união $V_{\lambda_1} \cup V_{\lambda_2} \cup \dots \cup V_{\lambda_r}$ está contida em V , devemos ter

$$V = V_{\lambda_1} + V_{\lambda_2} + \dots + V_{\lambda_r}.$$

Do Teorema 7.1, esta soma é direta, isto é,

$$V = V_{\lambda_1} \oplus V_{\lambda_2} \oplus \dots \oplus V_{\lambda_r}.$$

Então podemos dizer que

“o operador $T : V \rightarrow V$ é diagonalizável se, e somente se, podemos decompor V como soma direta dos autoespaços associados aos autovalores de T ”

ou ainda,

“o operador $T : V \rightarrow V$ é diagonalizável se, e somente se, a soma das multiplicidades geométricas dos autovalores distintos de T é igual à dimensão do espaço V ”.

7.2 Diagonalização de matrizes simétricas

.....

7.3 Demonstrações

Demonstração do Teorema 7.1. Sejam v_1, \dots, v_r autovetores de T associados aos autovalores $\lambda_1, \dots, \lambda_r$, distintos entre si. Considere a combinação linear

$$a_1 v_1 + a_2 v_2 + \dots + a_r v_r = \mathbf{0}. \quad (7.1)$$

Devemos mostrar que $a_i = 0$ para todo $i = 1, \dots, r$. Para cada i , definimos a função $T - \lambda_i Id : V \rightarrow V$ por

$$(T - \lambda_i Id)(u) = T(u) - \lambda_i u.$$

É fácil mostrar que $T - \lambda_i Id$ é um operador linear sobre V . Veja que

$$(T - \lambda_i Id)(v_i) = T(v_i) - \lambda_i v_i = \mathbf{0}, \quad \forall i,$$

e que

$$(T - \lambda_i Id)(v_j) = T(v_j) - \lambda_i v_j = (\lambda_j - \lambda_i) v_j, \quad \forall i \neq j.$$

Assim, aplicando $T - \lambda_1 Id$ sobre (7.1) e usando sua linearidade, obtemos

$$\begin{aligned} a_1 \underbrace{(T - \lambda_1 Id)(v_1)}_{=0} + a_2(T - \lambda_1 Id)(v_2) + \dots + a_r(T - \lambda_1 Id)(v_r) &= \mathbf{0} \\ \Rightarrow a_2(T - \lambda_1 Id)(v_2) + \dots + a_r(T - \lambda_1 Id)(v_r) &= \mathbf{0} \\ \Rightarrow a_2(\lambda_2 - \lambda_1)(v_2) + \dots + a_r(\lambda_r - \lambda_1)(v_r) &= \mathbf{0} \end{aligned}$$

Da mesma forma, aplicando $T - \lambda_2 Id$ sobre a última equação acima obteremos

$$a_3(\lambda_3 - \lambda_2)(\lambda_3 - \lambda_1)(v_3) + \dots + a_r(\lambda_r - \lambda_2)(\lambda_r - \lambda_1)(v_r) = \mathbf{0}.$$

Aplicando $T - \lambda_3 Id, \dots, T - \lambda_r Id$ sucessivamente obteremos

$$a_r [(\lambda_r - \lambda_{r-1}) \dots (\lambda_r - \lambda_1)] = \mathbf{0}.$$

Como todos os autovalores são distintos entre si, concluímos que $a_r = 0$. Substituindo $a_r = 0$ na equação imediatamente anterior, obtida pela aplicação sucessiva dos operadores $T - \lambda_i Id$, concluímos também que $a_{r-1} = 0$. Continuando a substituir esses coeficientes nulos nas equações anteriores, concluiremos que $a_1 = a_2 = \dots = a_r = 0$, e logo os vetores v_1, \dots, v_r são LI, como queríamos demonstrar. \square

Demonstração do Corolário 7.1. Consequência direta do Teorema 7.1 com $r = n$. \square

Demonstração do Teorema 7.2. A prova é demasiadamente sofisticada para este texto. Veja, por exemplo, o livro de Álgebra Linear de Hoffman e Kunze. \square

Demonstração do Teorema 7.3. Consulte [2] para uma demonstração no caso 2×2 . Uma demonstração geral requer conceitos sofisticados, e pode ser encontrada no livro de Álgebra Linear de Hoffman e Kunze. \square

Demonstração do Teorema 7.4. Sejam $p(x)$ e $m(x)$ os polinômios característico e minimal de $[T]_\beta^\beta$, respectivamente. Devemos mostrar que $p(\lambda) = 0$ se, e somente se, $m(\lambda) = 0$.

Primeiro, suponha que $m(\lambda) = 0$. Então podemos colocar o termo $x - \lambda$, referente à raiz λ , em evidência, obtendo

$$m(x) = (x - \lambda)q(x),$$

onde $q(x)$ é um polinômio de grau menor do que o grau de $m(x)$. Note ainda que

$$m([T]_\beta^\beta) = ([T]_\beta^\beta - \lambda \mathbf{I}) q([T]_\beta^\beta).$$

Pela definição de polinômio minimal, $m(x)$ é o polinômio de menor grau que anula $[T]_\beta^\beta$, e logo $q(x)$ não pode anular esta matriz, isto é,

$$q([T]_\beta^\beta) \neq \mathbf{0}.$$

Assim, podemos escolher uma matriz coluna \mathbf{w} tal que $\mathbf{v} = q([T]_\beta^\beta) \mathbf{w} \neq \mathbf{0}$. Como $m([T]_\beta^\beta) = \mathbf{0}$, temos

$$([T]_\beta^\beta - \lambda \mathbf{I}) \mathbf{v} = ([T]_\beta^\beta - \lambda \mathbf{I}) q([T]_\beta^\beta) \mathbf{w} = \mathbf{0} = m([T]_\beta^\beta) \mathbf{w} = \mathbf{0},$$

ou seja, \mathbf{v} é autovetor da matriz $[T]_\beta^\beta$ associado à λ . Portanto, λ é autovalor de $[T]_\beta^\beta$, e logo $p(\lambda) = 0$.

Reciprocamente, suponha que $p(\lambda) = 0$. Vamos mostrar que $m(\lambda) = 0$. Sendo λ autovalor de $[T]_\beta^\beta$, temos

$$[T]_\beta^\beta \mathbf{v} = \lambda \mathbf{v} \tag{7.2}$$

para alguma matriz coluna $\mathbf{v} \neq \mathbf{0}$. Escrevamos o polinômio minimal m na forma

$$m(x) = x^r + a_{r-1}x^{r-1} + \cdots + a_1x + a_0.$$

Por simplicidade, chamemos $\mathbf{A} = [T]_\beta^\beta$. Multiplicando a equação (7.2) por $\mathbf{A} = [T]_\beta^\beta$ à esquerda sucessivas vezes, obtemos

$$\begin{aligned} \mathbf{A} \mathbf{v} &= \lambda \mathbf{v} \\ \Rightarrow \mathbf{A}^2 \mathbf{v} &= \lambda \mathbf{A} \mathbf{v} = \lambda^2 \mathbf{v} \\ \Rightarrow \mathbf{A}^3 \mathbf{v} &= \lambda \mathbf{A}^2 \mathbf{v} = \lambda^3 \mathbf{v} \\ &\vdots \\ \Rightarrow \mathbf{A}^r \mathbf{v} &= \lambda^r \mathbf{v}. \end{aligned}$$

Assim,

$$\begin{aligned} m(\mathbf{A}) \mathbf{v} &= [\mathbf{A}^r + a_{r-1} \mathbf{A}^{r-1} + \cdots + a_1 \mathbf{A} + a_0 \mathbf{I}] \mathbf{v} \\ &= \mathbf{A}^r \mathbf{v} + a_{r-1} \mathbf{A}^{r-1} \mathbf{v} + \cdots + a_1 \mathbf{A} \mathbf{v} + a_0 \mathbf{I} \mathbf{v} \\ &= \lambda^r \mathbf{v} + a_{r-1} \lambda^{r-1} \mathbf{v} + \cdots + a_1 \lambda \mathbf{v} + a_0 \mathbf{v} \\ &= [\lambda^r + a_{r-1} \lambda^{r-1} + \cdots + a_1 \lambda + a_0] \mathbf{v} = m(\lambda) \mathbf{v}. \end{aligned}$$

Isto é, $m([T]_\beta^\beta) \mathbf{v} = m(\lambda) \mathbf{v}$. Agora, como $m([T]_\beta^\beta) = \mathbf{0}$ e $\mathbf{v} \neq \mathbf{0}$, concluímos que $m(\lambda) = 0$, isto é, λ é raiz do polinômio minimal. Isso finaliza a demonstração. \square

7.4 Exercícios

Veja a lista de exercícios 8.

Referências Bibliográficas

- [1] Howard Anton e Chris Rorres. *Álgebra Linear com aplicações*. Bookman, 10 edition, 2010.
- [2] José Luiz Boldrini e outros. *Álgebra Linear*. Harper & Row do Brasil, São Paulo, 3 edition, 1980.
- [3] Alfredo Steinbruch e Paulo Winterle. *Álgebra Linear*. Pearson, São Paulo, 2 edition, 1987.
- [4] David Lay. *Álgebra Linear*. LTC, Rio de Janeiro, 2 edition, 1999.
- [5] David Poole. *Álgebra linear*. Thonsom Learning, São Paulo, 2006.