

CAPITULO 8 LA FORMA NORMAL DE JORDAN

§ 1 SUMA DIRECTA E INVARIANCIA

Definición 1 Sea V un espacio vectorial sobre el campo F . Sean U y W subespacios de V . Se dice que V es una suma directa de U y W si para todo elemento $v \in V$ existen elementos únicos $u \in U$ y $w \in W$ tales que $v = u + w$. Lo notaremos $V = U \oplus W$.

Observación 1 Si U, W son subespacios del espacio vectorial V tales que $V = U + W$ y además $U \cap W = \{0\}$ entonces $V = U \oplus W$.

Teorema 1 Sea V un espacio vectorial de dimensión finita sobre el campo F . Sea W un subespacio de V . Entonces existe un subespacio U tal que V es la suma directa de U y W .

Teorema 2 Si V es un espacio vectorial de dimensión finita sobre el campo F , tal que $V = U \oplus W$ con U, W subespacios, entonces

$$\dim V = \dim U + \dim W$$

Definición 2 Sea V un espacio vectorial sobre el campo F , y sea $T: V \rightarrow V$ un operador lineal sobre V . Un subespacio W de V se dice invariante por T si T aplica a W en sí mismo. Esto es, si $v \in W$ entonces $T(v) \in W$.

Ejemplo 1 Sea v_1 un vector propio de T , y sea V_1 el espacio generado por v_1 . Entonces V_1 es un subespacio invariante por T .

Ejemplo 2 Sea λ un valor propio de T , y sea V_λ el subespacio de V que consta de todo $v \in V$ tal que $Tv = \lambda v$ (vale decir, el espacio propio de λ). Entonces V_λ es invariante por T .

Ejemplo 3 Sea $T: \mathbb{R}^3 \rightarrow \mathbb{R}^3$ tal que
$$T(x, y, z) = (x \cos \theta - y \sin \theta, x \sin \theta + y \cos \theta, z)$$

Es el operador lineal que rota cada vector sobre el eje z un ángulo θ .

Observemos que cada vector $w = (a, b, 0) \in W$ (el plano xy) permanece en W por la aplicación de T , luego W es invariante por T .

Teorema 3 Sea $T: V \rightarrow V$ lineal y $p(t)$ un polinomio cualquiera. Entonces $\text{Nul}(p(T))$ es invariante por T .

Demostración Sea $v \in \text{Nul}(p(T))$, esto es $p(T)(v) = 0$.
Necesitamos probar que $T(v) \in \text{Nul}(p(T))$.
Vale decir que $p(T)(T(v)) = 0$.
Como $p(t)t = t p(t)$, tenemos $p(T)T = T p(T)$.
Luego

$$p(T)(T(v)) = T p(T)(v) = T(0) = 0$$

Teorema 4 Sea $p(t) \in \mathcal{P}$, el espacio de todas las funciones polinómicas sobre el campo F . Supongamos que $p = p_1 p_2$, donde p_1, p_2 son polinomios de grado ≥ 1 y su máximo común divisor es igual a 1. Sea $T: V \rightarrow V$ un operador lineal. Supongamos que $p(T) = 0$. Sean

$$W_1 = \text{Nul}(p_1(T)) \quad ; \quad W_2 = \text{Nul}(p_2(T))$$

$$\text{Entonces } V = W_1 \oplus W_2$$

Demostración Por suposición, existen polinomios q_1, q_2 tales que

$$q_1(t) p_1(t) + q_2(t) p_2(t) = 1$$

de donde

$$q_1(T) p_1(T) + q_2(T) p_2(T) = I \quad (*)$$

Sea $v \in V$. Entonces

$$v = q_1(T) p_1(T)(v) + q_2(T) p_2(T)(v)$$

El primer término de esta suma pertenece a W_2 , ya que

$$\begin{aligned} p_2(T) q_1(T) p_1(T)(v) &= q_1(T) p_1(T) p_2(T)(v) \\ &= q_1(T) p(T)(v) = 0 \end{aligned}$$

Análogamente, el segundo término está en W_1 .

Así, V es la suma de W_1 y W_2 .

Para mostrar que esta suma es directa, se debe probar que una expresión

$$v = w_1 + w_2$$

CON $w_1 \in W_1$ Y $w_2 \in W_2$, ESTÁ DETERMINADA EN FORMA ÚNICA POR v . AL APLICAR $q_1(T) p_1(T)$ A ESTA SUMA SE OBTIENE

$$q_1(T) p_1(T)(v) = q_1(T) p_1(T) w_2$$

PUES $p_1(T) w_1 = 0$. APLICANDO LA EXPRESIÓN (*) A w_2 SE OBTIENE

$$w_2 = q_1(T) p_1(T) w_2$$

DEBIDO A QUE $p_2(T) w_2 = 0$. EN CONSECUENCIA

$$w_2 = q_1(T) p_1(T)(v)$$

Y POR LO TANTO w_2 ESTÁ DETERMINADO DE MANERA ÚNICA.

ANÁLOGAMENTE, $w_1 = q_2(T) p_2(T)(v)$ ESTÁ DETERMINADO DE MANERA ÚNICA Y POR CONSECUENCIA LA SUMA ES DIRECTA.

Teorema 5 SEA V UN ESPACIO VECTORIAL SOBRE \mathbb{C} , Y SEA $T: V \rightarrow V$ UN OPERADOR LINEAL. SEA $P(x)$ UN POLINOMIO TAL QUE $P(T) = 0$, Y SEA

$$P(x) = (x - \alpha_1)^{m_1} \cdots (x - \alpha_n)^{m_n}$$

SU FACTORIZACIÓN, DONDE $\alpha_1, \dots, \alpha_n$ SON LAS

RAICES DISTINTAS ENTRE SÍ. SEA $U_i = \text{Nul}(T - \alpha_i I)^{m_i}$

ENTONCES V ES LA SUMA DIRECTA DE LOS SUBESPACIOS

U_1, \dots, U_n .

Demostración EJERCICIO (AYUDA: POR INDUCCIÓN).

§2 EL LEMA DE SCHUR

(3)

Definición 3 Sea V un espacio vectorial sobre F , y sea S un conjunto de operadores de V . Sea W un subespacio de V . Se dice que W es un subespacio S -invariante si BW está en W para todo $B \in S$. Se dice que V es un S -espacio simple si $V \neq \{0\}$ y si los únicos subespacios S -invariantes son V mismo y el subespacio nulo.

Proposición 1 Sea $T: V \rightarrow V$ un operador tal que $TU = UT$ para toda $U \in S$. Entonces $\text{Im } T$ y $\text{Nul } T$ son subespacios S -invariantes de V .

Demostración Sea $w \in \text{Im } T$, por ejemplo $w = Tv$ con $v \in V$. Entonces $Uw = UTv = TUV$. Esto muestra que Uw también está en $\text{Im } T$ y por lo tanto que $\text{Im } T$ es S -invariante.

Sea $u \in \text{Nul } T$. Entonces $TUu = UTu = 0$, de donde Uu también está en $\text{Nul } T$, el cual resulta S -invariante.

Proposición 2 Sea S un conjunto de operadores de V . Sea $T: V \rightarrow V$ un operador. Supongamos que $TU = UT$ para todo $U \in S$. Si p es un polinomio sobre F , entonces $p(T)U = Up(T)$.

Demostración Ejercicio

Teorema 5 LEMA DE SCHUR

Sea V un espacio vectorial sobre F y sea

Sea un conjunto de operadores de V . Supongamos que V es un S -espacio simple. Sea $T: V \rightarrow V$ una transformación lineal tal que $TU = UT$ para todo $U \in S$. Entonces T es invertible o T es la aplicación nula.

Demostración Supongamos $T \neq 0$. Por la Proposición 1 $\text{Nul } T = \{0\}$ e $\text{Im } T = V$. Por lo tanto T es invertible.

§ 3 LA FORMA NORMAL DE JORDAN

Definición 4 Sea V un espacio vectorial sobre \mathbb{C} . Sea $T: V \rightarrow V$ una transformación lineal. Sean $\alpha \in \mathbb{C}$ y $v \in V$ con $v \neq 0$. Diremos que v es $(T - \alpha I)$ cíclico si existe un entero $n \geq 1$ tal que $(T - \alpha I)^n v = 0$. El mínimo entero positivo n que tiene esta propiedad recibe el nombre de período de v relativo a $T - \alpha I$. Si n es dicho período, entonces tenemos que $(T - \alpha I)^k v \neq 0$ para cualquier entero k tal que $0 \leq k < n$.

Lema 1 Si $v \neq 0$ es $(T - \alpha I)$ cíclico, con período n , entonces los elementos

$$v, (T - \alpha I)v, \dots, (T - \alpha I)^{n-1}v$$

son l.i.

(4)

Demostración Sea $U = T - \alpha I$, PARA SIMPLIFICAR LA NOTACIÓN. UNA RELACIÓN DE DEPENDENCIA LINEAL ENTRE LOS ELEMENTOS ANTERIORES SE PUEDE EXPRESAR DE LA MANERA SIGUIENTE:

$$p(U)v = 0$$

DONDE p ES UN POLINOMIO $\neq 0$ DE GRADO $\leq n-1$, A SABER

$$c_0 v + c_1 Uv + \dots + c_s U^s v = 0$$

CON $p(t) = c_0 + c_1 t + \dots + c_s t^s$ Y $s \leq n-1$.

TENEMOS TAMBIÉN QUE $U^n v = 0$ POR HIPÓTESIS.

SEA $g(t) = t^n$. SI h ES EL MÁXIMO COMÚN DIVISOR DE p Y g , ENTONCES SE PUEDE ESCRIBIR

$$h = p_1 p + g_1 g$$

DONDE p_1, g_1 SON POLINOMIOS, Y ASÍ

$$h(U) = p_1(U) p(U) + g_1(U) g(U).$$

SE DEDUCE QUE $h(U)v = 0$. PERO $h(t)$

DIVIDE A t^n Y ES DE GRADO $\leq n-1$, ASÍ QUE

$h(t) = t^d$ CON $d < n$. ESTO CONTRADICE LA

HIPÓTESIS QUE n ES UN PERÍODO DE v , Y ASÍ PROBAMOS EL LEMA.

Definición 5 EL ESPACIO VECTORIAL V ^{DE DIM n} SE CONOCE COMO CÍCLICO SI EXISTE ALGÚN NÚMERO α Y UN ELEMENTO $v \in V$ QUE ES $(T - \alpha I)$ CÍCLICO DE ORDEN n .

Observación 2 Si V es cíclico, entonces

$$\{(T - \alpha I)^{n-1}v, \dots, (T - \alpha I)v, v\} \text{ es } (*)$$

ES UNA BASE DE V . CON RESPECTO A ESTA BASE

LA MATRIZ DE T ES PARTICULARMENTE SIMPLE.

PARA CADA k SE TIENE

$$T(T - \alpha I)^k v = (T - \alpha I)^{k+1} v + \alpha (T - \alpha I)^k v$$

POR DEFINICIÓN, SE INFIERE QUE LA MATRIZ ASOCIADA PARA T CON RESPECTO A ESTA BASE ES IGUAL A LA MATRIZ TRIANGULAR

$$\begin{pmatrix} \alpha & 1 & 0 & \dots & 0 & 0 \\ 0 & \alpha & 1 & \dots & 0 & 0 \\ \vdots & \vdots & \vdots & & \vdots & \vdots \\ 0 & 0 & 0 & \dots & \alpha & 1 \\ 0 & 0 & 0 & \dots & 0 & \alpha \end{pmatrix}$$

ESTA MATRIZ TIENE A α EN LA DIAGONAL, A 1 ARRIBA DE LA DIAGONAL Y CERO EN LAS DEMÁS ENTRADAS. SE PUEDE OBSERVAR QUE $(T - \alpha I)^{n-1}v$ ES UN VECTOR PROPIO PARA T , CON VALOR PROPIO α .

LA BASE (*) SE CONOCE COMO BASE DE JORDAN PARA T .

Nota 1 SUPONGAMOS QUE V SE EXPRESA COMO UNA SUMA DIRECTA DE SUBESPACIOS T -INVARIANTES

$$V = V_1 \oplus \dots \oplus V_m$$

Y SUPONGAMOS QUE CADA V_i ES CÍCLICO. SI SE SELECCIONA UNA BASE DE JORDAN PARA CADA V_i , ENTONCES LA SUCESIÓN DE ESTAS BASES FORMA UNA BASE PARA V , CONOCIDA NUEVAMENTE COMO UNA BASE DE JORDAN PARA T . CON RESPECTO A ESTA BASE, LA MATRIZ PARA T SE DIVIDE POR CONSIGUIENTE EN BLOQUES

$$\begin{pmatrix} \boxed{\begin{matrix} \alpha_1 & & & \\ & 1 & \dots & 1 \\ & & \ddots & \\ & & & \alpha_1 \end{matrix}} & & \\ & \boxed{\begin{matrix} \alpha_2 & & & \\ & 1 & \dots & 1 \\ & & \ddots & \\ & & & \alpha_2 \end{matrix}} & & \\ & & \boxed{\begin{matrix} \alpha_3 & & & \\ & 1 & \dots & 1 \\ & & \ddots & \\ & & & \alpha_3 \end{matrix}} & & \\ & & & \ddots & \end{pmatrix}$$

EN CADA UNO DE LOS BLOQUES SE TIENE UN VALOR PROPIO α_i EN LA DIAGONAL. TENEMOS 1 ARRIBA DE LA DIAGONAL Y CEROS EN LAS DEMÁS ENTRADAS. ESTA MATRIZ SE CONOCE COMO FORMA NORMAL DE JORDAN PARA T .

Teorema 6 SEA V UN ESPACIO DE DIMENSIÓN FINITA SOBRE \mathbb{C} , Y SEA $V \neq \{0\}$. SEA $T: V \rightarrow V$ UN OPERADOR. ENTONCES V SE PUEDE EXPRESAR COMO UNA SUMA DIRECTA DE SUBESPACIOS CÍCLICOS T -INVARIANTES.

Demostración SIN PERDER GENERALIDAD, SUPONGAMOS QUE
 EXISTE UN NÚMERO α Y UN ENTERO $n \geq 1$
 TAL QUE $(T - \alpha I)^n = 0$. SEA $U = T - \alpha I$
 ENTONCES $U^n = 0$. SUPONGAMOS QUE n ES
 EL MÍNIMO DE DICHS ENTEROS. ENTONCES
 $U^{n-1} \neq 0$. EL SUBESPACIO UV NO ES IGUAL A V
 DEBIDO A QUE SU DIMENSION ES ESTRICTAMENTE
 MENOR QUE LA DE V . (POR QUÉ? PENSAR)
 POR INDUCCIÓN, SE PUEDE ESCRIBIR UV COMO
 UNA SUMA DIRECTA DE SUBESPACIOS T -INVARIANTES
 (O U -INVARIANTES) QUE SON CÍCLICOS; SEA

$$UV = W_1 \oplus \dots \oplus W_m$$

TAL QUE W_i TIENE UNA BASE QUE CONSTA DE ELEMENTOS
 $U^k w_i$ PARA ALGUN VECTOR CÍCLICO $w_i \in W_i$ DE
 PERIODO n_i . SEA $v_i \in V$ TAL QUE $U v_i = w_i$.

ENTONCES, CADA UNO DE LOS v_i ES UN VECTOR
 CÍCLICO, DEBIDO A QUE

$$\text{SI } B^{n_i} w_i = 0 \text{ ENTONCES } B^{n_i+1} v_i = 0$$

SEA V_i EL SUBESPACIO DE V GENERADO POR LOS
 ELEMENTOS $B^k v_i$ PARA $k = 1, \dots, n_i + 1$.

AFIRMAMOS QUE EL SUBESPACIO V' IGUAL A LA SUMA

$$V' = V_1 + \dots + V_m$$

ES UNA SUMA DIRECTA. HAY QUE PROBAR QUE
 CUALQUIER ELEMENTO u DE ESTA SUMA SE PUEDE
 EXPRESAR DE MANERA ÚNICA EN LA FORMA

$$\mu = \mu_1 + \dots + \mu_m$$

(6)

Cualquier elemento de V_i es del tipo $p_i(U)v_i$ donde p_i es un polinomio de grado $\leq n_i + 1$. Supongamos que

$$p_1(U)v_1 + \dots + p_m(U)v_m = 0 \quad (1)$$

Aplicando U y observando que $U p_i(U) = p_i(U)U$, se obtiene

$$p_1(U)w_1 + \dots + p_m(U)w_m = 0$$

Sin embargo $w_1 + \dots + w_m$ es una descomposición en suma directa de UV , de donde

$$p_i(U)w_i = 0 \quad \forall i = 1, \dots, m$$

Por consiguiente, t^{n_i} divide a $p_i(t)$ y, en particular, t divide a $p_i(t)$. Así se puede escribir

$$p_i(t) = g_i(t)t$$

Para algún polinomio g_i y por lo tanto $p_i(U) = g_i(U)U$.

Se deduce de (1) que

$$g_1(U)w_1 + \dots + g_m(U)w_m = 0$$

Nuevamente, t^{n_i} divide a $g_i(t)$, de donde t^{n_i+1} divide a $p_i(t)$ y por consiguiente $p_i(U)v_i = 0$. Esto prueba

lo que se quería: V' es una suma directa de V_1, \dots, V_m .

A partir de la construcción de V' se observa que

$UV' = UV$, debido a que cualquier elemento en UV es

de la forma $p_1(U)w_1 + \dots + p_m(U)w_m$

CON ALGUNOS POLINOMIOS p_i Y POR CONSIGUIENTE ES LA IMAGEN BAJO U DEL ELEMENTO

$$p_1(U)v_1 + \dots + p_m(U)v_m$$

QUE ESTÁ EN V' . DE ESTO SE CONCLUYE QUE

$$V = V' + \text{Nul } U.$$

CIERTAMENTE, SEA $v \in V$. ENTONCES $Uv = Uv'$ PARA ALGÚN $v' \in V'$ Y POR LO TANTO $U(v - v') = 0$. ASÍ

$$v = v' + (v - v'),$$

Y SE PRUEBA ASÍ QUE $V = V' + \text{Nul } U$. POR SUPUESTO, ESTA SUMA NO ES DIRECTA. SIN EMBARGO, SEA \mathcal{B}' UNA BASE DE JORDAN DE V' . SE PUEDE EXTENDER \mathcal{B}' A UNA BASE DE V USANDO ELEMENTOS DE $\text{Nul } U$. A SABER, SI $\{u_1, \dots, u_s\}$ ES UNA BASE DE $\text{Nul } U$, ENTONCES

$$\{\mathcal{B}', u_{j_1}, \dots, u_{j_\ell}\}$$

ES UNA BASE DE V PARA ÍNDICES CONVENIENTES j_1, \dots, j_ℓ . CADA UNO DE LOS u_j SATISFACE $Uu_j = 0$, DE DONDE u_j ES UN VECTOR PROPIO PARA T Y EL ESPACIO DE UNA DIMENSIÓN GENERADO POR u_j ES T -INVARIANTE Y CÍCLICO. SE DENOTARÁ ESTE ESPACIO POR U_j . ENTONCES SE TIENE

$$\begin{aligned} V &= V' \oplus U_{j_1} \oplus \dots \oplus U_{j_\ell} \\ &= V_1 \oplus \dots \oplus V_m \oplus U_{j_1} \oplus \dots \oplus U_{j_\ell} \end{aligned}$$

DANDO ASÍ LA EXPRESIÓN DESEADA DE V COMO UNA SUMA DIRECTA DE SUBESPACIOS CÍCLICOS. ESTO PRUEBA EL TEOREMA.

Nota 2 ¿CÓMO HALLAR LA FORMA NORMAL DE JORDAN

7

PARA UNA MATRIZ T ?

VEAMOSLO CON UN EJEMPLO: CONSIDEREMOS LA SIGUIENTE MATRIZ

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

EL POLINOMIO CARACTERÍSTICO DE T ES

$$\det(T - \lambda I) = -\lambda^3 - 2\lambda^2 + 4\lambda + 8$$

ENTONCES LOS AUTOVALORES SON $\lambda_1 = 2$ CON MULTIPLICIDAD $m(\lambda_1) = 1$ Y $\lambda_2 = -2$ CON MULTIPLICIDAD $m(\lambda_2) = 2$

EL ESPACIO PROPIO DE $\lambda_1 = 2$ ES $V(\lambda_1) = \text{Nul}(T - 2I)$

$$\begin{aligned} V_1(2) &= \{(x, y, z) \in \mathbb{R}^3 : (T - 2I)x = 0\} = \\ &= \{(x, y, z) \in \mathbb{R}^3 : -2x + 3y + z = 0 \wedge 2x + y + 3z = 0\} \end{aligned}$$

COMO $\dim V_1(2) = 1 = m(\lambda_1)$, BASTA ENCONTRAR UN VECTOR EN $V_1(2)$ PARA TENER UNA BASE. POR EJEMPLO $u_1 = (1, 1, -1)$, Y ASI $V_1(2) = \text{Gen}\{(1, 1, -1)\}$

EL ESPACIO PROPIO DE $\lambda_2 = -2$ ES $V(\lambda_2) = \text{Nul}(T + 2I)$

$$\begin{aligned} V(-2) &= \{(x, y, z) \in \mathbb{R}^3 : (T + 2I)x = 0\} = \\ &= \{(x, y, z) \in \mathbb{R}^3 : 2x + 3y + z = 0 \wedge 2x + y - z = 0\} \end{aligned}$$

ENTONCES $\dim V(-2) = 1 \neq m(\lambda_2)$. LUEGO T NO ES DIAGONALIZABLE. LLAMEMOS $V_1(-2) = V(-2)$

ARMAMOS EL SEGUNDO ESPACIO PROPIO ASOCIADO A λ_2 :

$$V_2(-2) = \text{Nul}(T + 2I)^2$$

$$V_2(-2) = \{(x, y, z) \in \mathbb{R}^3 : (T + 2I)^2 x = 0\} =$$

$$= \{ (x, y, z) \in \mathbb{R}^3 : x + y = 0 \}$$

OBSERVAMOS QUE $\text{Nul}(T+2I) \subseteq \text{Nul}(T+2I)^2$ Y

$\dim V_2(-2) = 2 = m(-2)$. ENTONCES VAMOS A BUSCAR UNA BASE DE $V_2(-2)$ QUE CONTENGA UN VECTOR DE $V_1(-2)$ COMO SIGUE:

i) ELEGIMOS UN VECTOR CUALQUIERA $u_3 \in V_2(-2) - V_1(-2)$,
POR EJEMPLO $u_3 = (0, 0, 1)$

ii) SEA AHORA $u_2 = (T+2I)u_3$, LUEGO $u_2 = (1, -1, 1)$

ENTONCES $\{u_2, u_3\}$ ES UNA BASE DE $V_2(-2)$ Y ADemás $u_2 \in V_1(-2)$

PIENSANDO A T COMO UNA TRANSFORMACIÓN LINEAL,

POR T COMO LA TRANSFORMACIÓN LINEAL ASOCIADA A $\{u_1, u_2, u_3\}$

TENEMOS QUE $Tu_1 = 2u_1$, $Tu_2 = -2u_2$, $Tu_3 = u_2 - 2u_3$

LUEGO LA MATRIZ ASOCIADA A T EN LA BASE $\beta = \{u_1, u_2, u_3\}$

$$\text{ES } \begin{pmatrix} 2 & 0 & 0 \\ 0 & -2 & 1 \\ 0 & 0 & -2 \end{pmatrix} = J$$

PODEMOS COMPROBAR QUE T Y J SON SIMILARES VIA

$$P = \begin{pmatrix} 1 & 1 & 0 \\ 1 & -1 & 0 \\ -1 & 1 & 1 \end{pmatrix}, \text{ LA MATRIZ DE CAMBIO DE BASE.}$$