

В.Н. ШЕВЧЕНКО, С.В. СИДОРОВ

О ПОДОБИИ МАТРИЦ ВТОРОГО ПОРЯДКА
НАД КОЛЬЦОМ ЦЕЛЫХ ЧИСЕЛ

Из линейной алгебры известно (напр., [1], с. 101), что с линейным преобразованием линейного пространства V над полем \mathbf{F} связан класс $[\varphi]$ подобных между собой матриц. А именно, этот класс состоит из всех матриц преобразования φ в различных базисах пространства V . Если $A, B \in [\varphi]$, то существует невырожденная матрица S с элементами из \mathbf{F} такая, что $AS = SB$. Подобие матриц A и B над полем рациональных чисел будем обозначать $A \approx B$. Для проверки подобия над полем \mathbf{Q} имеется алгоритм (напр., [1], с. 154–157) приведения характеристической матрицы $A - \lambda E$ к нормальной диагональной форме Смита и построения по ней единственной канонической матрицы F (в [1], с. 181, она называется естественной нормальной формой матрицы A).

Перенесем понятие подобия на кольцо \mathbf{Z} целых чисел. Сильно возросшие трудности заставили ограничиться двумерным случаем, в котором будет получен алгоритм проверки подобия двух матриц A и B над \mathbf{Z} и, если их характеристический многочлен приводим над \mathbf{Q} , описаны классы подобных матриц.

Определение 1. Будем говорить, что матрица $B \in \mathbf{Z}^{n \times n}$ подобна матрице $A \in \mathbf{Z}^{n \times n}$ над кольцом \mathbf{Z} , если существует $S \in \mathbf{Z}^{n \times n}$ такая, что $AS = SB$ и $\det S \in \{-1, 1\}$, и обозначать это $A \sim B$. При этом матрицу S будем называть \mathbf{Z} -трансформирующей A в B матрицей.

Очевидно, что введенное отношение есть отношение эквивалентности.

Следовательно, множество $\mathbf{Z}^{n \times n}$ разбивается на классы эквивалентности K_j , $j \in J$. Таким образом, можно записать

$$\mathbf{Z}^{n \times n} = \bigcup_{j \in J} K_j.$$

Целочисленную матрицу A можно рассматривать как матрицу над кольцом вычетов \mathbf{Z}/m , если положить $A = (\text{res}_m a_{ij})$, где m — натуральное число, а $\text{res}_m x$ — остаток от деления x на m . Обозначим через $(\mathbf{Z}/m)^*$ множество делителей единицы в \mathbf{Z}/m .

Определение 2. Будем говорить, что матрица $B \in \mathbf{Z}^{n \times n}$ подобна матрице $A \in \mathbf{Z}^{n \times n}$ над кольцом \mathbf{Z}/m , если существует $S \in \mathbf{Z}^{n \times n}$ такая, что $AS \equiv SB \pmod{m}$ и $\det S \in (\mathbf{Z}/m)^*$, и обозначать это $A \sim_m B$.

Задача заключается в том, чтобы определить, являются ли две данные целочисленные матрицы A и B подобными, и если являются, то найти трансформирующую матрицу.

Над полем \mathbf{Q} критерием подобия матриц является равенство наибольших общих делителей (НОД) миноров k -го порядка их характеристических матриц. Обобщением понятия НОД на кольцо $\mathbf{Z}[\lambda]$ является идеал, порожденный минорами k -го порядка характеристической матрицы. Так как $\mathbf{Q}[\lambda]$ — кольцо главных идеалов, а $\mathbf{Z}[\lambda]$ таковым не является, то это первое усложнение при переходе к \mathbf{Z} .

Работа выполнена при частичной финансовой поддержке Российского фонда фундаментальных исследований (код проекта № 05-01-00552-а).

Обозначим через $I_k(A - \lambda E)$ идеал в кольце $\mathbf{Z}[\lambda]$, порожденный минорами k -го порядка характеристической матрицы $A - \lambda E$, а через $\Delta_k(A)$ — НОД миноров k -го порядка матрицы A .

Теорема 1. Если $A \sim B$, то

- 1) $A \approx B$,
- 2) $A \sim_m B$ над кольцом \mathbf{Z}/m для всех $m \geq 2$,
- 3) $I_k(A - \lambda E) = I_k(B - \lambda E)$ для всех $k = 1, \dots, n$,
- 4) $\Delta_k(A) = \Delta_k(B)$, $k = 1, \dots, n$.

Доказательство. Так как $A \sim B$, то существует матрица $T \in \mathbf{Z}^{n \times n}$ такая, что $\det T \in \{-1, 1\}$ и $AT = TB$.

- 1) Очевидно, что T удовлетворяет условиям подобия над полем \mathbf{Q} .
- 2) Очевидно, что $AT \equiv TB \pmod{m}$ и $\det T \in (\mathbf{Z}/m)^*$, т. е. $A \sim_m B$.
- 3) $(A - \lambda E)T = T(B - \lambda E)$, откуда $A - \lambda E = T(B - \lambda E)T^{-1}$. Из формулы Бине–Коши (напр., [2], с. 19) следует, что любой минор k -го порядка матрицы $A - \lambda E$ принадлежит $I_k(B - \lambda E)$. Следовательно, $I_k(A - \lambda E) \subseteq I_k(B - \lambda E)$. Аналогично доказывается обратное включение.
- 4) Доказательство проводится аналогично предыдущему пункту теоремы. \square

Заметим, что условие 1) является следствием условия 3).

Теорема 2. Пусть $A, B \in \mathbf{Z}^{n \times n}$. Тогда если $A \sim_m B$ и $A \sim_k B$, где m и k — взаимно простые числа, то $A \sim_{mk} B$.

Доказательство. Существуют матрицы $T = (t_{ij}) \in (\mathbf{Z}/m)^{n \times n}$, $S = (s_{ij}) \in (\mathbf{Z}/k)^{n \times n}$ такие, что

$$AT \equiv TB \pmod{m}, \quad AS \equiv SB \pmod{k} \quad (1)$$

и $\det T \in (\mathbf{Z}/m)^*$, $\det S \in (\mathbf{Z}/k)^*$. Равенства (1) можно переписать следующим образом:

$$\sum_{j=1}^n a_{ij}t_{jl} \equiv \sum_{j=1}^n t_{ij}a_{jl} \pmod{m}, \quad \sum_{j=1}^n a_{ij}s_{jl} \equiv \sum_{j=1}^n s_{ij}a_{jl} \pmod{k}, \quad i, l = 1, \dots, n. \quad (2)$$

Согласно китайской теореме об остатках

$$\mathbf{Z}/m \times \mathbf{Z}/k \cong \mathbf{Z}/mk. \quad (3)$$

Построим матрицу $Q = (q_{ij})$, элементы которой удовлетворяют условиям

$$\text{res}_m q_{ij} = t_{ij}, \quad \text{res}_k q_{ij} = s_{ij}. \quad (4)$$

Эта матрица строится однозначно в силу изоморфизма (3). Из (1), (2) и (4) вытекает, что $AQ \equiv AT \pmod{m}$, $AQ \equiv AS \pmod{k}$, $QB \equiv TB \pmod{m}$, $QB \equiv SB \pmod{k}$. Следовательно, $AQ \equiv QB \pmod{m}$ и $AQ \equiv QB \pmod{k}$, откуда в силу взаимной простоты m и k получаем, что $AQ \equiv QB \pmod{mk}$.

Осталось доказать, что $\det Q \in (\mathbf{Z}/mk)^*$. Действительно, $\text{res}_m(\det Q) = \text{res}_m(\det T) \in (\mathbf{Z}/m)^*$, $\text{res}_k(\det Q) = \text{res}_k(\det S) \in (\mathbf{Z}/k)^*$. Отсюда видно, что $\det Q \in (\mathbf{Z}/mk)^*$. \square

Следствие 1. Если $A \sim_{m_i} B$, где $i = 1, \dots, s$, $\text{НОД}(m_i, m_j) = 1$ для всех $i \neq j$, то $A \sim_q B$, где $q = m_1 \dots m_s$.

Следствие 2. Если $A \sim_q B$, где $q = p^k$ для любых простых p и натуральных k , то $A \sim_m B$, для любого натурального $m \geq 2$.

Следствие 3. Пусть $A, B \in \mathbf{Z}^{n \times n}$ и существует матрица $S \in \mathbf{Z}^{n \times n}$, у которой $\det S = p_1^{k_1} \dots p_s^{k_s}$ и $AS = SB$. Если $A \sim_q B$ над \mathbf{Z}/q , где $q = p_i^{k_i}$, $i = 1, \dots, s$, для любого натурального k , то $A \sim_m B$ над \mathbf{Z}/m для всех $m \geq 2$.

Доказательство. Логически возможны два варианта:

1) $\text{НОД}(m, \det S) = 1$. Тогда $AS \equiv SB \pmod{m}$. Покажем, что $\det S \in (\mathbf{Z}/m)^*$. Действительно, $\det S = p_1^{k_1} \cdots p_s^{k_s} \equiv r \pmod{m}$, причем $\text{НОД}(m, r) = 1$, т. к. в противном случае имели бы противоречие с взаимной простотой m и $\det S$.

2) $\text{НОД}(m, \det S) = d \neq 1$. Таким образом, $m = db$ и $\text{НОД}(b, \det S) = 1$. Тогда $A \sim_d B$ по следствию 1 и $A \sim_b B$ согласно предыдущему случаю. Следовательно, в силу взаимной простоты d и b и теоремы 2 получаем $A \sim_m B$. \square

Следствие 4. Пусть $A, B \in \mathbf{Z}^{n \times n}$ и существуют матрицы $S_i \in \mathbf{Z}^{n \times n}$ такие, что $AS_i = S_i B$, $\det S_i \neq 0$, $i = 1, \dots, l$. Если $\text{НОД}(\det S_1, \dots, \det S_l) = 1$, то $A \sim_m B$ для всех $m \geq 2$.

Пусть матрицы A и B имеют один и тот же характеристический многочлен $d(\lambda)$, который неприводим над \mathbf{Q} . Введем несколько обозначений: $M_{A,B} = \{S \in \mathbf{Q}^{n \times n} \mid AS = SB\}$ и $\Lambda_{A,B} = M_{A,B} \cap \mathbf{Z}^{n \times n}$. Очевидно, что $M_{A,B}$ — подпространство в $\mathbf{Q}^{n \times n}$, а $\Lambda_{A,B}$ — подмодуль в $\mathbf{Z}^{n \times n}$. В этом случае верно

Утверждение ([2], с. 193) $M_{A,B} = L(S, AS, A^2S, \dots, A^{n-1}S) = L(S, SB, SB^2, \dots, SB^{n-1})$, где $S \in M_{A,B}$, $\det S \neq 0$, а буквой L обозначили множество всех линейных комбинаций матриц, стоящих в скобках.

Не уменьшая общности, можно считать, что S целочисленная. Пусть T_1, \dots, T_n — базис модуля $\Lambda_{A,B}$. Тогда очевидна

Лемма 1. Для того чтобы $A \sim B$ необходимо и достаточно, чтобы уравнение $\det(x_1 T_1 + \dots + x_n T_n) = \pm 1$ имело решение в целых x_1, \dots, x_n .

Если t_j^i — j -й столбец матрицы T_i , то

$$f(x_1, \dots, x_n) = \det \left(\sum_{i=1}^n x_i T_i \right) = \sum_{i_1=1}^n \cdots \sum_{i_n=1}^n x_{i_1} \cdots x_{i_n} \det(t_{i_1}^{i_1}, \dots, t_{i_n}^{i_n}).$$

Нужно выяснить имеет ли уравнение $f(x_1, \dots, x_n) = \pm 1$ решение в целых числах. Как решать это уравнение в общем случае, неизвестно. Но если $n = 2$, то $\det(x_1 T_1 + x_2 T_2) = x_1^2 \det T_1 + x_1 x_2 (\det(t_1^1, t_2^2) + \det(t_2^1, t_1^2)) + x_2^2 \det T_2$ — бинарная квадратичная форма, т. е. в этом случае задача о подобии сводится к классическому вопросу теории чисел — представлению целого числа (здесь ± 1) квадратичной формой (напр., [3], с. 286; [4], с. 310). Поэтому для более детального изучения перейдем к матрицам второго порядка. Из третьего необходимого условия подобия вытекает (при $k = n$), что если $A \sim B$, то характеристические многочлены матриц совпадают. Будем это предполагать, не оговаривая специально. Дальнейшее изучение будет существенно различаться для приводимых и неприводимых характеристических многочленов $d(\lambda)$.

1. Случай приводимого характеристического многочлена

Пусть $\alpha \in \mathbf{Z}$ — корень многочлена $d(\lambda)$ и $x = (x_1, x_2)^T$ — собственный вектор, соответствующий α . Не уменьшая общности, можно считать, что $x \in \mathbf{Z}^2$ и $\text{НОД}(x_1, x_2) = 1$. Тогда существуют целые числа y_1, y_2 такие, что $\det \begin{pmatrix} x_1 & y_1 \\ x_2 & y_2 \end{pmatrix} = \det(x, y) = 1$. Векторы x и y образуют базис в \mathbf{Q}^2 . Разложим Ay по этому базису: $Ay = c_1 x + c_2 y$. В пространстве \mathbf{Q}^2 определим линейное преобразование φ с матрицей A , т. е. $[\varphi]_e = A$ в стандартном базисе e . Тогда в базисе x, y

$$C = [\varphi]_{(x,y)} = \begin{pmatrix} \alpha & c_1 \\ 0 & c_2 \end{pmatrix}. \quad (5)$$

Таким образом, $C = T^{-1}AT$, где $T = (x, y)$. Следовательно, $A \sim C$ и $\text{tr } A = \text{tr } C$, $\det A = \det C$ (где $\text{tr } A$ — след матрицы, т. е. сумма элементов главной диагонали, $\det A$ — определитель матрицы). Возможны два варианта:

1° $d(\lambda)$ имеет один двукратный корень,

2° $d(\lambda)$ имеет два различных корня.

1° В первом случае $d(\lambda) = (\lambda - \alpha)^2 = \lambda^2 - 2\alpha\lambda + \alpha^2$, т.е. $\text{tr } A = 2\alpha$ и $\det A = \alpha^2$. Над полем рациональных чисел \mathbf{Q} имеем два класса $Y_1(\alpha)$ и $Y_2(\alpha)$ подобных матриц с каноническими матрицами $R_0(\alpha) = \begin{pmatrix} \alpha & 0 \\ 0 & \alpha \end{pmatrix}$ и $R_1(\alpha) = \begin{pmatrix} \alpha & 1 \\ 0 & \alpha \end{pmatrix}$ соответственно, т.е. $Y_1(\alpha) = \{A \in \mathbf{Z}^{2 \times 2} \mid A \approx R_0(\alpha)\}$, $Y_2(\alpha) = \{A \in \mathbf{Z}^{2 \times 2} \mid A \approx R_1(\alpha)\}$. Посмотрим, что изменится над \mathbf{Z} . В силу вышесказанного $c_2 = \alpha$. Таким образом, выражение (5) принимает вид $C = [\varphi]_{(x,y)} = \begin{pmatrix} \alpha & c_1 \\ 0 & \alpha \end{pmatrix}$. Теперь заметим, что можно считать $c_1 \geq 0$, т.к. в противном случае, взяв $T = \begin{pmatrix} -1 & 0 \\ 0 & 1 \end{pmatrix}$, получим $T^{-1}CT = \begin{pmatrix} \alpha & -c_1 \\ 0 & \alpha \end{pmatrix}$. Из теоремы 1 следует, что матрицы $R_{k_1}(\alpha) = \begin{pmatrix} \alpha & k_1 \\ 0 & \alpha \end{pmatrix}$ и $R_{k_2}(\alpha) = \begin{pmatrix} \alpha & k_2 \\ 0 & \alpha \end{pmatrix}$, где $k_1, k_2 \geq 0$, не подобны, если $k_1 \neq k_2$, т.к. $I_1(R_1 - \lambda E) \neq I_1(R_2 - \lambda E)$.

Матрицы $R_{k_1}(\alpha)$ и $R_{k_2}(\alpha)$ представляют разные классы эквивалентности и однозначно характеризуют класс, которому принадлежат. Поэтому матрица вида $R_k(\alpha) = \begin{pmatrix} \alpha & k \\ 0 & \alpha \end{pmatrix}$, где $k \geq 0$, является канонической. Таким образом, класс $Y_2(\alpha)$ разбивается на счетное число подклассов $K_j(\alpha) = \{A \in \mathbf{Z}^{2 \times 2} \mid A \sim R_j(\alpha)\}$, каждый из которых характеризуется канонической матрицей $R_j(\alpha) = \begin{pmatrix} \alpha & j \\ 0 & \alpha \end{pmatrix}$, где $j \geq 1$. Тем самым доказана

Теорема 3. Если $d(\lambda) = (\lambda - \alpha)^2$, где $\alpha \in \mathbf{Z}$, то

- 1) $A \sim B$ тогда и только тогда, когда $I_1(A - \lambda E) = I_1(B - \lambda E)$,
- 2) $Y_1(\alpha) = K_0(\alpha)$, $Y_2(\alpha) = \bigcup_{j \geq 1} K_j(\alpha)$, где $K_j(\alpha) = \{A \in \mathbf{Z}^{2 \times 2} \mid A \sim R_j(\alpha)\}$, а $R_j(\alpha) = \begin{pmatrix} \alpha & j \\ 0 & \alpha \end{pmatrix}$, $j \geq 0$ — каноническая матрица.

2° Если корни простые, то $d(\lambda) = (\lambda - \alpha)(\lambda - \beta) = \lambda^2 - (\alpha + \beta)\lambda + \alpha\beta$, т.е. $\text{tr } A = \alpha + \beta$ и $\det A = \alpha\beta$. Не уменьшая общности, можно считать, что $\beta > \alpha$. Над полем \mathbf{Q} имеем один класс $Y_3(\alpha, \beta) = \{A \in \mathbf{Z}^{2 \times 2} \mid A \approx R_0(\alpha, \beta)\}$ подобных матриц с канонической матрицей $R_0(\alpha, \beta) = \begin{pmatrix} \alpha & 0 \\ 0 & \beta \end{pmatrix}$. Найдется собственный вектор $x = (x_1, x_2)^T \in \mathbf{Z}^2$ с НОД(x_1, x_2) = 1, соответствующий α , т.е. $Ax = \alpha x$. Найдём $y = (y_1, y_2)^T \in \mathbf{Z}^2$ такой, что $\det(x, y) = 1$. В данном случае $c_2 = \beta$. Тогда (5) примет вид $C = [\varphi]_{(x,y)} = \begin{pmatrix} \alpha & c_1 \\ 0 & \beta \end{pmatrix}$. Во-первых, можно считать, что $0 \leq c_1 < \beta - \alpha$. Действительно, $c_1 = q(\beta - \alpha) + r$, где $0 \leq r < \beta - \alpha$. Тогда $T^{-1}CT = \begin{pmatrix} \alpha & r \\ 0 & \beta \end{pmatrix} = R_r(\alpha, \beta)$, если $T = \begin{pmatrix} 1 & q \\ 0 & 1 \end{pmatrix}$. Во-вторых, можно считать, что $0 \leq c_1 \leq \lfloor \frac{\beta - \alpha}{2} \rfloor$, т.к. $S^{-1}R_r(\alpha, \beta)S = \begin{pmatrix} \alpha & (\beta - \alpha) - r \\ 0 & \beta \end{pmatrix}$, где $S = \begin{pmatrix} 1 & -1 \\ 0 & -1 \end{pmatrix}$. Теперь убедимся в том, что матрицы $R_{k_1}(\alpha, \beta) = \begin{pmatrix} \alpha & k_1 \\ 0 & \beta \end{pmatrix}$ и $R_{k_2}(\alpha, \beta) = \begin{pmatrix} \alpha & k_2 \\ 0 & \beta \end{pmatrix}$ не подобны, если $k_1 \neq k_2$ и $0 \leq k_1, k_2 \leq \lfloor \frac{\beta - \alpha}{2} \rfloor$. Предположим, что найдется унимодулярная матрица $T = \begin{pmatrix} t_{11} & t_{12} \\ t_{21} & t_{22} \end{pmatrix}$ такая, что $R_{k_1}(\alpha, \beta)T = TR_{k_2}(\alpha, \beta)$. Тогда $R_{k_1}(\alpha, \beta)T = \begin{pmatrix} \alpha t_{11} + k_1 t_{21} & \alpha t_{12} + k_1 t_{22} \\ \beta t_{21} & \beta t_{22} \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} \alpha t_{11} & k_2 t_{11} + \beta t_{12} \\ \alpha t_{21} & k_2 t_{21} + \beta t_{22} \end{pmatrix} = TR_{k_2}(\alpha, \beta)$. Отсюда видим, что $t_{21} = 0$ и $(\beta - \alpha)t_{12} = k_1 t_{22} - k_2 t_{11}$, значит, $t_{11} t_{22} = \pm 1$ и $(\beta - \alpha)t_{12} = \pm k_1 \pm k_2$. Но тогда t_{12} не может быть целым в силу ограничений на k_1, k_2 . Таким образом, над кольцом \mathbf{Z} класс $Y_3(\alpha, \beta)$ разделился на конечное число подклассов $K_j(\alpha, \beta) = \{A \in \mathbf{Z}^{2 \times 2} \mid A \sim R_j(\alpha, \beta)\}$, и матрица вида $R_j(\alpha, \beta) = \begin{pmatrix} \alpha & j \\ 0 & \beta \end{pmatrix}$, где $0 \leq j \leq \lfloor \frac{\beta - \alpha}{2} \rfloor$, является канонической. Из вышеизложенного следует

Теорема 4. Если $d(\lambda) = (\lambda - \alpha)(\lambda - \beta)$, $\alpha, \beta \in \mathbf{Z}$, $\beta > \alpha$, то $Y_3(\alpha, \beta) = \bigcup_{j=0}^{\lfloor \frac{\beta - \alpha}{2} \rfloor} K_j(\alpha, \beta)$, где $K_j(\alpha, \beta) = \{A \in \mathbf{Z}^{2 \times 2} \mid A \sim R_j(\alpha, \beta)\}$, а $R_j(\alpha, \beta) = \begin{pmatrix} \alpha & j \\ 0 & \beta \end{pmatrix}$, $0 \leq j \leq \lfloor \frac{\beta - \alpha}{2} \rfloor$, — каноническая матрица.

Теорема 4 позволяет строить примеры, показывающие, что условия, сформулированные в Теореме 1, не являются достаточными для подобия двух матриц.

Пример 1. Рассмотрим $A = \begin{pmatrix} 1 & 1 \\ 0 & 6 \end{pmatrix}$ и $B = \begin{pmatrix} 1 & 2 \\ 0 & 6 \end{pmatrix}$. Выполнение первого, третьего и четвертого условий очевидно, причем $AT = TB$, где $T = \begin{pmatrix} 1 & 0 \\ 0 & 2 \end{pmatrix}$. Для проверки второго условия по следствию 3 достаточно показать, что $A \sim_m B$, где $m = 2^k$, k — натуральное число. Для этого в качестве трансформирующей матрицы можно взять $S = \begin{pmatrix} 1 & 1 \\ 0 & 1 \end{pmatrix}$. Но по теореме 4 A и B — канонические матрицы из разных классов эквивалентности, т.е. они не подобны.

Пусть $A = \begin{pmatrix} a_{11} & a_{12} \\ a_{21} & a_{22} \end{pmatrix}$, $B = \begin{pmatrix} b_{11} & b_{12} \\ b_{21} & b_{22} \end{pmatrix}$. Следовательно, $t = a_{11} + a_{22} = b_{11} + b_{22}$, $s = \det A = \det B$, а характеристический многочлен имеет вид $d(\lambda) = \lambda^2 - t\lambda + s$. Очевидно, что если $\alpha \in \mathbf{Z}$, то A и B подобны над \mathbf{Z} тогда и только тогда, когда $A - \alpha E$ и $B - \alpha E$ подобны над \mathbf{Z} . Если в качестве α взять $\lfloor \frac{t}{2} \rfloor$, то возможны два случая.

1) t — четное число. Тогда след матриц $A - \alpha E$ и $B - \alpha E$ будет равен 0, а характеристический многочлен запишется в виде

$$d(\lambda) = \lambda^2 - d, \quad (6)$$

где $d = \alpha^2 - \det A$. В этом случае

$$A - \alpha E = \begin{pmatrix} a & a_1 \\ a_2 & -a \end{pmatrix}, \quad B - \alpha E = \begin{pmatrix} b & b_1 \\ b_2 & -b \end{pmatrix}. \quad (7)$$

2) t — нечетное число. Тогда след матриц $A - \alpha E$ и $B - \alpha E$ будет равен 1, а характеристический многочлен

$$d(\lambda) = \lambda^2 - \lambda - d, \quad (8)$$

где $d = \alpha^2 + \alpha - \det A$. В этом случае

$$A - \alpha E = \begin{pmatrix} a + 1 & a_1 \\ a_2 & -a \end{pmatrix}, \quad B - \alpha E = \begin{pmatrix} b + 1 & b_1 \\ b_2 & -b \end{pmatrix}. \quad (9)$$

Итак, свели исходную задачу к задаче о подобии матриц вида (7) или (9).

2. Случай неприводимого характеристического многочлена

Итак, предполагаем, что характеристический многочлен (имеющий вид (6) или (8)) неприводим над полем \mathbf{Q} (отсюда, в частности, следует, что A и B невырождены).

Рассмотрим сначала случай, когда $d(\lambda) = \lambda^2 - \lambda - d$. В этом случае $A = \begin{pmatrix} a+1 & b \\ c & -a \end{pmatrix}$ подобна над полем рациональных чисел матрице Фробениуса $F = \begin{pmatrix} 1 & 1 \\ d & 0 \end{pmatrix}$, где $d = a^2 + a + bc$, $b \neq 0$ и $c \neq 0$. Это следует из того, что НОД миноров любого порядка их характеристических матриц одинаковы (действительно, НОД миноров первого порядка равен 1, а второго — $d(\lambda)$). Выясним, останется ли этот факт верным над \mathbf{Z} . Базисом модуля $\Lambda_{A,F}$ являются матрицы $\begin{pmatrix} a+1 & 1 \\ c & 0 \end{pmatrix}$ и $\begin{pmatrix} b & 0 \\ -a & 1 \end{pmatrix}$. Таким образом, $\Lambda_{A,F}$ состоит из матриц вида $S = \begin{pmatrix} x(a+1)+yb & x \\ cx-ay & y \end{pmatrix}$, $x, y \in \mathbf{Z}$, а $\det S = -cx^2 + (2a+1)xy + by^2$. Получили бинарную квадратичную форму. Заметим, что ее дискриминант совпадает с дискриминантом исходного характеристического многочлена. Нас интересует, разрешимо ли в целых числах уравнение

$$-cx^2 + (2a+1)xy + by^2 = \pm 1. \quad (10)$$

Домножив (10) на $4b$, получим равносильное (10) уравнение

$$(2by + (2a+1)x)^2 - Dy^2 = \pm 4b, \quad (11)$$

где $D = 1 + 4d$. Для того чтобы уравнение (11) имело решение в целых x и y (а, соответственно, и для подобия матриц A и F), необходимо, чтобы для любого простого p , являющегося делителем D , хотя бы одно из чисел $\pm 4b$ было полным квадратом в поле вычетов \mathbf{Z}/p . Тем самым получили пятое необходимое условие подобия при $p \equiv 1 \pmod{4}$, т. к. в противном случае (если $p \equiv -1 \pmod{4}$) либо $4b$, либо $-4b$ является полным квадратом в \mathbf{Z}/p . Заметим, что в силу равноправия b и c аналогичное необходимое условие формулируется и для c .

Теперь перейдем к случаю, когда $d(\lambda) = \lambda^2 - d$. При этом $A = \begin{pmatrix} a & b \\ c & -a \end{pmatrix}$ подобна над полем \mathbf{Q} матрице Фробениуса $F = \begin{pmatrix} 0 & 1 \\ d & 0 \end{pmatrix}$, где $d = a^2 + bc$, $b \neq 0$ и $c \neq 0$. Здесь базисом модуля $\Lambda_{A,F}$ являются матрицы $\begin{pmatrix} a & 1 \\ c & 0 \end{pmatrix}$ и $\begin{pmatrix} b & 0 \\ -a & 1 \end{pmatrix}$, т. е. любая матрица из $\Lambda_{A,F}$ имеет вид $S = \begin{pmatrix} ax+by & x \\ cx-ay & y \end{pmatrix}$, $x, y \in \mathbf{Z}$, а

$\det S = -cx^2 + 2axy + by^2$. Аналогично предыдущему случаю имеем уравнение $-cx^2 + 2axy + by^2 = \pm 1$, эквивалентное

$$(by + ax)^2 - dy^2 = \pm b. \quad (12)$$

Чтобы (12) имело решение в целых числах, получаем аналогичное предыдущему случаю необходимое условие (хотя бы одно из чисел $\pm b$ и хотя бы одно из чисел $\pm c$ должны быть полными квадратами в поле вычетов \mathbf{Z}/p для любого простого p , являющегося делителем d).

Пятое необходимое условие не следует из первых четырех, что показывает следующий пример.

Пример 2. $A = \begin{pmatrix} 0 & 2 \\ 5 & 0 \end{pmatrix}$, $F = \begin{pmatrix} 0 & 1 \\ 10 & 0 \end{pmatrix}$, $d = 10$; $A \approx F$, т.к. $AS = SF$, где $S = \begin{pmatrix} 2 & 0 \\ 0 & 1 \end{pmatrix}$. Для проверки второго необходимого условия по следствию 3 достаточно убедиться, что $A \sim_m F$ для $m = 2^k$. Здесь в качестве трансформирующей можно взять матрицу $T = \begin{pmatrix} 0 & 1 \\ 5 & 0 \end{pmatrix}$. Но пятое необходимое условие нарушается, т.к. ни одно из чисел ± 2 не является квадратом в поле вычетов $\mathbf{Z}/5$. Следовательно, A и F не подобны над \mathbf{Z} .

Это еще один пример, показывающий, что необходимые условия подобия, сформулированные в теореме 1, не являются достаточными. Но и все пять необходимых условий в совокупности не являются достаточными. Это мы продемонстрируем на следующем примере (который получен на основе примера из ([4], с. 314)).

Пример 3. Рассмотрим $A = \begin{pmatrix} 0 & 2 \\ 41 & 0 \end{pmatrix}$, $F = \begin{pmatrix} 0 & 1 \\ 82 & 0 \end{pmatrix}$, $d = 82$. Нетрудно проверить выполнение необходимых условий из теоремы 1. Справедливость пятого условия следует из того, что оба числа ± 2 являются квадратами в поле вычетов $\mathbf{Z}/41$, а именно, $11^2 \equiv -2 \pmod{41}$ и $17^2 \equiv 2 \pmod{41}$. Но, несмотря на это, квадратичная форма $2y^2 - 41x^2$ не представляет ни одно из чисел ± 1 , т.е. A и F не подобны над \mathbf{Z} .

Теорема 5. Если $d(\lambda)$ неприводим над \mathbf{Q} , то множество матриц с характеристическим многочленом $d(\lambda)$ распадается на конечное число классов эквивалентности.

Доказательство. 1) Пусть $d > 0$. Рассмотрим случай, когда $d(\lambda) = \lambda^2 - d$. Тогда $A = \begin{pmatrix} a & b \\ c & -a \end{pmatrix}$, $a \geq 0$, $a^2 + bc = d > 0$. Докажем, что существует такое $r \geq 0$, что $A \sim \begin{pmatrix} r & b_1 \\ c_1 & -r \end{pmatrix}$, где

$$b_1 \geq r + 1, \quad c_1 \geq r + 1. \quad (13)$$

Не уменьшая общности, можно считать, что $b > 0$ или $c > 0$. Действительно, если $b < 0$, то $A \sim B$, где $B = \begin{pmatrix} a & -b \\ -c & -a \end{pmatrix}$, т.к. $AE_1 = E_1B$, а $E_1 = \begin{pmatrix} 1 & 0 \\ 0 & -1 \end{pmatrix}$ (аналогично, если $c < 0$).

Заметим, что если $|b| \geq a + 1$ и $|c| \geq a + 1$, то $bc > 0$, т.к. в противном случае имели бы $a^2 > -bc \geq (a + 1)^2$, что неверно. С учетом предыдущего замечания в этом случае можно считать, что $b > 0$ и $c > 0$.

Возможны три варианта.

1) Если $0 < b \leq a$, то, разделив a на b с остатком, получим $a = q_1b + r_1$, где $0 \leq r_1 < b$. Тогда $AT = TB_1$, где $T = \begin{pmatrix} 1 & 0 \\ -q_1 & 1 \end{pmatrix}$, а $B_1 = \begin{pmatrix} r_1 & b \\ c_1 & -r_1 \end{pmatrix}$.

2) Если $0 < c \leq a$, то, разделив a на c с остатком, получим $a = q_2c + r_2$, где $0 \leq r_2 < c$. Тогда $AS = SB_2$, где $S = \begin{pmatrix} 1 & q_2 \\ 0 & 1 \end{pmatrix}$, а $B_2 = \begin{pmatrix} r_2 & b_2 \\ c & -r_2 \end{pmatrix}$.

3) Если $b \geq a + 1$ и $c \geq a + 1$, то условия (13) выполнены, что и требовалось.

После выполнения действий в первом или во втором вариантах для новой матрицы (B_1 или B_2) снова будет справедлив один из трех вариантов. Но с каждым шагом элемент a на главной диагонали будет уменьшаться и в силу его неотрицательности в конце концов придем к третьему варианту. Тогда $d = a^2 + bc \geq a^2 + (a + 1)^2$, откуда следует, что $a \leq \lfloor \frac{\sqrt{2d-1}-1}{2} \rfloor$.

Аналогично рассматривается случай, когда $d(\lambda) = \lambda^2 - \lambda - d$. При этом ограничение на a имеет вид $a \leq \lfloor \frac{\sqrt{8d+1}-3}{4} \rfloor$.

2) Пусть $d < 0$. Здесь можно применить те же действия, которые проводились в предыдущем случае, и добиться того, чтобы для матрицы $A = \begin{pmatrix} a & b \\ c & -a \end{pmatrix}$, $a \geq 0$, $a^2 + bc = d < 0$, имели место неравенства $b \geq a + 1$, $c \geq a + 1$. В этом случае $-d = |d| = -bc - a^2 \geq (a + 1)^2 - a^2 = 2a + 1$, откуда $a \leq \lfloor \frac{|d|-1}{2} \rfloor$. Если же $d(\lambda) = \lambda^2 - \lambda - d$, то $|d| = -bc - a^2 - a \geq (a + 1)^2 - a^2 - a = a + 1$, откуда $a \leq \lfloor |d| - 1 \rfloor$. \square

Пусть S_1 и S_2 — базис $\Lambda_{A,B}$, тогда произвольную матрицу из $\Lambda_{A,B}$ можно представить в виде $xS_1 + yS_2$ для некоторых x и y из \mathbf{Z} . Наша задача состоит в том, чтобы определить, существует ли в $\Lambda_{A,B}$ матрица с определителем 1 или -1 . Пусть $S \in \Lambda_{A,B}$, тогда $\det S = f(x, y) = \det(xS_1 + yS_2) = x^2 \det S_1 + xy(\det(s_1^1, s_2^2) + \det(s_1^2, s_2^1)) + y^2 \det S_2$, где s_1^1, s_2^1 — столбцы матрицы S_1 , а s_1^2, s_2^2 — столбцы матрицы S_2 .

Теорема 6. Пусть $A = \begin{pmatrix} a_{11} & a_{12} \\ a_{21} & a_{22} \end{pmatrix}$, $B = \begin{pmatrix} b_{11} & b_{12} \\ b_{21} & b_{22} \end{pmatrix}$ и их характеристический многочлен $d(\lambda)$ неприводим над \mathbf{Q} . Тогда базис модуля $\Lambda_{A,B}$ образуют матрицы $T_1 = \frac{1}{\delta_1} \begin{pmatrix} a_{12} & 0 \\ b_{11}-a_{11} & b_{12} \end{pmatrix}$ и $T_2 = \frac{1}{\Delta} \begin{pmatrix} \frac{a_{12}}{\delta_1} \gamma & \frac{a_{12}}{\delta_2} \\ \frac{b_{21} + \frac{b_{11}-a_{11}}{\delta_1} \gamma}{\delta_2} & \frac{b_{22}-a_{11} + \frac{b_{12}}{\delta_1} \gamma}{\delta_2} \end{pmatrix}$, где $\delta_1 = \text{НОД}(a_{12}, b_{12}, b_{11} - a_{11})$, $\delta_2 = \text{НОД}(a_{12}, b_{21}, b_{22} - a_{11})$, $\Delta = \text{НОД}(\frac{a_{12}}{\delta_1}, \frac{a_{12}}{\delta_2})$, а γ удовлетворяет сравнению $\frac{b_{12}}{\delta_1} \gamma \equiv \frac{a_{11}-b_{22}}{\delta_2} \pmod{\Delta}$.

Доказательство. Так как $d(\lambda)$ неприводим, то $a_{12} \neq 0$. Ранее ввели обозначения $M_{A,B}$ и $\Lambda_{A,B}$. Теперь $M_{A,B} = \{S \in \mathbf{Q}^{2 \times 2} \mid AS = SB\}$ и $\Lambda_{A,B} = M_{A,B} \cap \mathbf{Z}^{2 \times 2}$. В качестве базиса $M_{A,B}$ можно взять матрицы $S_1 = \begin{pmatrix} a_{12} & 0 \\ b_{11}-a_{11} & b_{12} \end{pmatrix}$, $S_2 = \begin{pmatrix} 0 & a_{12} \\ b_{21} & b_{22}-a_{11} \end{pmatrix}$.

Обозначим $\delta_1 = \text{НОД}(a_{12}, b_{12}, b_{11} - a_{11})$, $\delta_2 = \text{НОД}(a_{12}, b_{21}, b_{22} - a_{11})$. Следовательно, S_1 и S_2 можно сократить на δ_1 и δ_2 соответственно. Получим матрицы S'_1, S'_2 . Их можно представить в виде четырехмерных векторов $s_1 = (\frac{a_{12}}{\delta_1} \ 0 \ \frac{b_{11}-a_{11}}{\delta_1} \ \frac{b_{12}}{\delta_1})^T$, $s_2 = (0 \ \frac{a_{12}}{\delta_2} \ \frac{b_{21}}{\delta_2} \ \frac{b_{22}-a_{11}}{\delta_2})^T$, образующих матрицу $G = \begin{pmatrix} \frac{a_{12}}{\delta_1} & 0 & \frac{b_{11}-a_{11}}{\delta_1} & \frac{b_{12}}{\delta_1} \\ 0 & \frac{a_{12}}{\delta_2} & \frac{b_{21}}{\delta_2} & \frac{b_{22}-a_{11}}{\delta_2} \end{pmatrix}^T$. Очевидно, что подпространство L в \mathbf{Q}^4 , базис которого образуют s_1, s_2 , изоморфно $M_{A,B}$. Нам нужно найти базис модуля $L \cap \mathbf{Z}^4$. НОД элементов матрицы G равен 1, а НОД миноров второго порядка равен

$$\begin{aligned} \Delta &= \text{НОД}\left(\frac{a_{12}a_{12}}{\delta_1\delta_2}, \frac{a_{12}b_{21}}{\delta_1\delta_2}, \frac{a_{12}(b_{22}-a_{11})}{\delta_1\delta_2}, \frac{a_{12}b_{12}}{\delta_1\delta_2}, \frac{a_{12}(b_{11}-a_{11})}{\delta_1\delta_2}, \frac{a_{12}a_{21}}{\delta_1\delta_2}\right) = \\ &= \text{НОД}\left(\frac{a_{12}}{\delta_1} \text{НОД}\left(\frac{a_{12}}{\delta_2}, \frac{b_{21}}{\delta_2}, \frac{b_{22}-a_{11}}{\delta_2}\right), \frac{a_{12}}{\delta_2} \text{НОД}\left(\frac{b_{12}}{\delta_1}, \frac{b_{11}-a_{11}}{\delta_1}, \frac{a_{21}}{\delta_1}\right)\right) = \text{НОД}\left(\frac{a_{12}}{\delta_1}, \frac{a_{12}}{\delta_2}\right). \end{aligned}$$

Рассмотрим систему сравнений $G \begin{pmatrix} x \\ y \end{pmatrix} \equiv 0 \pmod{\Delta}$, которая эквивалентна одному сравнению

$$\frac{b_{12}}{\delta_1}x + \frac{b_{22}-a_{11}}{\delta_2}y \equiv 0 \pmod{\Delta}$$

Множество решений данного сравнения является аддитивной циклической группой. Пусть (α, β) — ее порождающий элемент, тогда $\alpha s_1 + \beta s_2 \equiv 0 \pmod{\Delta}$, причем $\text{НОД}(\beta, \Delta) = \text{НОД}(\alpha, \Delta) = 1$, т. к. в противном случае хотя бы один из векторов s_1, s_2 можно было бы сократить на некоторый множитель. Следовательно, в качестве порождающего можно взять вектор $(\gamma, 1)$, где γ удовлетворяет сравнению $\frac{b_{12}}{\delta_1} \gamma \equiv \frac{a_{11}-b_{22}}{\delta_2} \pmod{\Delta}$. Таким образом, базис модуля $L \cap \mathbf{Z}^4$ образуют векторы s_1 и $s_3 = \frac{1}{\Delta}(\gamma s_1 + s_2) = \frac{1}{\Delta} \left(\frac{a_{12}}{\delta_1} \gamma \ \frac{a_{12}}{\delta_2} \ \frac{b_{21}}{\delta_2} + \frac{b_{11}-a_{11}}{\delta_1} \gamma \ \frac{b_{22}-a_{11} + \frac{b_{12}}{\delta_1} \gamma}{\delta_2} \right)^T$. Значит, базис модуля $\Lambda_{A,B}$ образуют матрицы $T_1 = S'_1 = \frac{1}{\delta_1} \begin{pmatrix} a_{12} & 0 \\ b_{11}-a_{11} & b_{12} \end{pmatrix}$ и $T_2 = \frac{1}{\Delta}(\gamma S'_1 + S'_2) = \frac{1}{\Delta} \begin{pmatrix} \frac{a_{12}}{\delta_1} \gamma & \frac{a_{12}}{\delta_2} \\ \frac{b_{21} + \frac{b_{11}-a_{11}}{\delta_1} \gamma}{\delta_2} & \frac{b_{22}-a_{11} + \frac{b_{12}}{\delta_1} \gamma}{\delta_2} \end{pmatrix}$. \square

Следствие 5. Пусть верны условия предыдущей теоремы. Тогда квадратичная форма $f(x, y)$ имеет вид $f(x, y) = x^2 \frac{a_{12}b_{12}}{\delta_1^2} + xy \left(2 \frac{a_{12}b_{12}}{\delta_1^2} \gamma + \frac{a_{12}(b_{22}-b_{11})}{\delta_1\delta_2\Delta} \right) + y^2 \left(\frac{a_{12}b_{12}}{\delta_1^2\Delta^2} \gamma^2 + \frac{a_{12}(b_{22}-b_{11})}{\delta_1\delta_2\Delta^2} - \frac{a_{12}b_{21}}{\delta_2^2\Delta^2} \right)$ и $\frac{d}{D} = (\delta_1, \delta_2)^2$, где d — дискриминант $d(\lambda)$, D — дискриминант $f(x, y)$, (δ_1, δ_2) — наибольший общий делитель δ_1 и δ_2 .

3. Алгоритм определения подобия

Даны две матрицы $A, B \in \mathbf{Z}^{2 \times 2}$

1. Находим $\text{tr } A$ и $\text{tr } B$. Если $\text{tr } A \neq \text{tr } B$, то A и B не подобны. Если $\text{tr } A = \text{tr } B$, то переходим к п. 2.

2. Находим $\det A$ и $\det B$. Если $\det A \neq \det B$, то A и B не подобны. Если $\det A = \det B$, то переходим к п. 3.

3. Пусть $d(\lambda) = \lambda^2 - a\lambda + b$ — характеристический многочлен матриц A и B , где $a = \text{tr } A = \text{tr } B$, $b = \det A = \det B$. Если $d(\lambda)$ приводим над \mathbf{Z} , т. е. имеет вид $d(\lambda) = (\lambda - \alpha)(\lambda - \beta)$, $\alpha, \beta \in \mathbf{Z}$, то переходим к п. 4, в противном случае к п. 5.

4. Находим векторы $x^A, x^B \in \mathbf{Z}^2$ — собственные векторы матриц A и B , соответствующие α , такие, что $\text{НОД}(x_1^A, x_2^A) = 1$, $\text{НОД}(x_1^B, x_2^B) = 1$. Находим такие векторы $y^A, y^B \in \mathbf{Z}^2$, что $\det(x^A, y^A) = 1$, $\det(x^B, y^B) = 1$. Далее раскладываем вектор Ay^A по базису x^A, y^A , а вектор Bx^B по базису x^B, y^B . Получаем $Ay^A = c_1x^A + \beta y^A$, $Bx^B = c_2x^B + \beta y^B$. Обозначим $S_1 = (x^A, y^A)$, $S_2 = (x^B, y^B)$. Если $\alpha = \beta$, то переходим к п. 4.1, иначе к п. 4.2.

4.1. Если $c_1 = c_2$, то $A \sim B$ и $AS = SB$, где $S = S_1S_2^{-1}$. Если $c_1 = -c_2$, то $A \sim B$ и $AS = SB$, где $S = S_1T^{-1}S_2^{-1}$, $T = \begin{pmatrix} -1 & 0 \\ 0 & 1 \end{pmatrix}$. Если $|c_1| \neq |c_2|$, то A и B не подобны.

4.2. Считаем, что $\beta > \alpha$. Делим с остатком c_1 и c_2 на $\beta - \alpha$. Получаем $c_1 = q_1(\beta - \alpha) + r_1$, $c_2 = q_2(\beta - \alpha) + r_2$. Если $r_1 = r_2$, то $A \sim B$ и $AS = SB$, где $S = S_1T_1T_2^{-1}S_2^{-1}$, $T_1 = \begin{pmatrix} 1 & q_1 \\ 0 & 1 \end{pmatrix}$, $T_2 = \begin{pmatrix} 1 & q_2 \\ 0 & 1 \end{pmatrix}$. Если $r_1 = \beta - \alpha - r_2$, то $A \sim B$ и $AS = SB$, где $S = S_1T_1QT_2^{-1}S_2^{-1}$, $Q = \begin{pmatrix} 1 & -1 \\ 0 & -1 \end{pmatrix}$. В противном случае A и B не подобны.

5. Находим квадратичную форму $f(x, y)$, фигурирующую в следствии 5 и ее дискриминант D . Если $D < 0$, то переходим к п. 5.1, если $D > 0$, то к п. 5.2.

5.1. $f(x, y)$ — положительно определенная форма. Для выяснения вопроса о представимости целого числа этой формой применяется алгоритм приведения Гаусса (напр., [3], с. 293–294).

5.2. $f(x, y)$ — неопределенная форма. В этом случае можно применить алгоритм из [5].

Трудоёмкость алгоритма. На вход алгоритма подаются две целочисленные матрицы A и B . Будем считать, что элементы этих матриц ограничены по модулю константой C . Пусть $n = \log C$ — длина представления числа C . Очевидно, что алгоритм, приведенный выше, является полиномиальным относительно n , если $d(\lambda)$ приводим. Алгоритм приведения Гаусса также является полиномиальным. Алгоритм из [5] не полиномиален, т. к. он использует разложение квадратичной иррациональности $\frac{P_0 + \sqrt{D}}{Q_0}$ в цепную дробь, которая является периодической с длиной периода $l = O(\sqrt{D} \log D)$. Вопрос о существовании полиномиального решающего алгоритма в случае, если $f(x, y)$ — неопределенная форма, остается открытым.

Часть результатов, представленная в данной статье, была анонсирована в ([6], с. 112).

Литература

1. Мальцев А.И. *Основы линейной алгебры*. — М.—Л.: Гостехизтад, 1948. — 424 с.
2. Гантмахер Ф.Р. *Теория матриц*. — М.: Наука, 1988. — 552 с.
3. Бухштаб А.А. *Теория чисел*. — М.: Просвещение, 1966. — 384 с.
4. Касселс Дж. *Рациональные квадратичные формы*. — М.: Мир, 1982. — 440 с.
5. Matthews К. *The diophantine equation $ax^2 + bxy + cy^2 = N$, $D = b^2 - 4ac > 0$* // J. Theor. Nombres Bordeaux. — 2002. — V. 14. — P. 257–270.
6. Шевченко В.Н., Сидоров С.В. *О подобии матриц второго порядка над кольцом целых чисел* // Материалы XIV Международн. школы-семинара “Синтез и сложность управляющих систем” (Нижний Новгород, 27 октября–1 ноября 2003 г.) / Под ред. О.Б. Лупанова. — Н. Новгород: Изд-во. Нижегородск. гос. пед. ун-та, 2003. — 131 с.

Нижегородский государственный
университет им. Н.И. Лобачевского

Поступила
30.09.2004