
Séminaire d'algèbre et géométrie de l'UVSQ

3 mai 2011

Géométrie affine des espaces de matrices

Clément de Seguins Pazzis
Lycée Sainte-Geneviève, Versailles

Introduction.

I. Quelques résultats historiques.

II. Classification des grands espaces vectoriels de matrices de rang majoré.

III. Espaces affines de matrices de rang minoré.

Introduction

\mathbb{K} corps (commutatif).

On considère une propriété $\mathcal{P}(M)$ définie pour M dans $M_n(\mathbb{K})$ (éventuellement $M_{n,p}(\mathbb{K})$).

Exemples :

- (i) “ $\text{rg } M \leq r$ ”
- (ii) “ M inversible ou nulle”
- (iii) “ M nilpotente”
- (iv) “ M diagonalisable”.

Premier type de problème :
Sous-espaces vectoriels de matrices de type
particulier

Étudier les sous-espaces vectoriels
(éventuellement les sous-espaces affines) de
 $M_n(\mathbb{K})$ dont tous les éléments M vérifient $\mathcal{P}(M)$.

→ dimension maximale d'un tel sev ?

→ classification de ces sev, **ou au moins de**
ceux de "grande" dimension ?

Second type de problème :
Questions de préservation linéaire

Déterminer les automorphismes f (éventuellement les endomorphismes) de *l'espace vectoriel* $M_n(\mathbb{K})$ qui conservent la propriété \mathcal{P} :

– ou bien **au sens faible** i.e.

$$\forall M, \mathcal{P}(M) \Rightarrow \mathcal{P}(f(M))$$

– ou bien **au sens fort** i.e.

$$\forall M, \mathcal{P}(M) \Leftrightarrow \mathcal{P}(f(M)).$$

I. Grands résultats historiques

A. SEV de matrices de rang ≤ 1

Théorème 1 (Schur). *Soit V sev de $M_n(\mathbb{K})$ tel que $\forall M \in V, \text{rg } M \leq 1$.*

Alors il existe $X_0 \in M_{n,1}(\mathbb{K})$ et F sev de $M_{n,1}(\mathbb{K})$ tels que

$$V = X_0 {}^t F \quad \text{ou} \quad V = F {}^t X_0.$$

En particulier $\dim V \leq n$, avec égalité ssi V ou ${}^t V$ équivalent à

$$\left\{ \left[C \quad 0 \quad \dots \quad 0 \right] \mid C \in M_{n,1}(\mathbb{K}) \right\}.$$

B. SEV de matrices singulières

Théorème 2 (Dieudonné). *Soit V sous-espace affine de $M_n(\mathbb{K})$ tel que $\forall M \in V, \text{rg } M < n$.*

(a) $\dim V \leq n^2 - n$.

(b) *Si $\dim V = n^2 - n$, alors V ou tV est équivalent à*

$$\left\{ \left[C_1 \quad \cdots \quad C_{n-1} \quad 0 \right] \mid C_1, \dots, C_{n-1} \in M_{n,1}(\mathbb{K}) \right\}$$

(matrices de dernière colonne nulle) ... sauf lorsque $n = 2$, $\text{card}(\mathbb{K}) = 2$ et V équivalent à

$$\left\{ \begin{bmatrix} x & y \\ 0 & x+1 \end{bmatrix} \mid (x, y) \in \mathbb{K}^2 \right\}.$$

J. Dieudonné, Sur une généralisation du groupe orthogonal à quatre variables, *Arch. Math.*, **1** (1949) 282-287.

Remarque 1. Les matrices de $M_3(\mathbb{K})$ de la forme

$$\begin{bmatrix} ? & ? & ? \\ ? & 0 & 0 \\ ? & 0 & 0 \end{bmatrix} \text{ constituent un sev maximal de}$$

matrices singulières de dimension 5 !

C. Automorphismes de $M_n(\mathbb{K})$ conservant l'inversibilité

Théorème 3 (Dieudonné). *Soit f automorphisme de l'espace vectoriel $M_n(\mathbb{K})$ t.q. $f(\text{GL}_n(\mathbb{K})) = \text{GL}_n(\mathbb{K})$.*

Alors $\exists(P, Q) \in \text{GL}_n(\mathbb{K})^2$ t.q.

$$\forall M, f(M) = PMQ \quad \text{ou} \quad \forall M, f(M) = P^tMQ.$$

Remarque 2. L'hypothèse $f(\text{GL}_n(\mathbb{K})) \subset \text{GL}_n(\mathbb{K})$ est suffisante. On sait même classifier les endomorphismes f de $M_n(\mathbb{K})$ t.q.

$f(\text{GL}_n(\mathbb{K})) \subset \text{GL}_n(\mathbb{K})$. Voir C. de Seguins Pazzis, The singular linear preservers of non-singular matrices, *Linear Algebra Appl.*, **433** (2010) 483-490.

Idées de preuve :

- on fait agir f sur l'ensemble des sev de matrices singulières de dimension $n^2 - n$;
- ces sev sont les ensembles

$$\mathcal{M}_D = \{M : \forall X \in D, MX = 0\}$$

et

$$\mathcal{M}^D = \{M : \forall X \in D, {}^tXM = 0\},$$

D droite vectorielle quelconque de $E = \mathbb{K}^n$;

→ OPS $\exists D_1, \exists D_2 : f(\mathcal{M}_{D_1}) = \mathcal{M}_{D_2}$;

→ on trouve φ et ψ de $\mathbb{P}(E)$ dans lui-même t.q.

$$\forall D \in \mathbb{P}(E), f(\mathcal{M}_D) = \mathcal{M}_{\varphi(D)} \text{ et } f(\mathcal{M}^D) = \mathcal{M}^{\psi(D)},$$

→ φ et ψ sont des homographies (utilise en particulier le thm fondamental de la géométrie projective) ;

→ OPS $\varphi = \psi = \text{id}$;

→ on montre alors que $f = \lambda \text{id}$ en trouvant de nombreux vecteurs propres de f .

D. SEV de matrices nilpotentes

Théorème 4 (Gerstenhaber). *Soit V sev de $M_n(\mathbb{K})$ dont tous les éléments sont nilpotents.*

Alors :

(a) $\dim V \leq \binom{n}{2}$.

(b) *Si $\dim V = \binom{n}{2}$, alors V est conjugué à $T_n^{++}(\mathbb{K})$, espace des matrices triangulaires supérieures strictes.*

M. Gerstenhaber, On nilalgebras and linear varieties of nilpotent matrices (I), *Amer. J. Math.* **80** (1958) 614-622.

V. N. Serezhkin, On linear transformations preserving nilpotency, *Izv. Akad. Nauk BSSR, Ser. Fiz.-Mat. Nauk.*

6 (1985) 46-50.

Attention, les sev nilpotents maximaux ne sont pas nécessairement de dimension $\binom{n}{2}$.

Exemple : $\left\{ \begin{bmatrix} 0 & 0 & -b \\ 0 & 0 & a \\ a & b & 0 \end{bmatrix} \mid (a, b) \in \mathbb{K}^2 \right\}$.

II. Grands espaces de matrices de rang $\leq r$

A. Le théorème de Flanders

Théorème 5 (Flanders). *Soit $r \in \llbracket 1, n-1 \rrbracket$ et V sev de $M_n(\mathbb{K})$ tel que $\forall M \in V, \text{rg } M \leq r$. Alors :*

(a) $\dim V \leq rn$;

(b) Si $\dim V = rn$, alors V ou tV est équivalent à

$$\left\{ \left[\begin{array}{cccccc} C_1 & \cdots & C_r & 0 & \cdots & 0 \end{array} \right] \mid C_1, \dots, C_r \in M_{n,1}(\mathbb{K}) \right\}.$$

Cas où $\text{card}(\mathbb{K}) > r$:

H. Flanders, On spaces of linear transformations with bounded rank, *J. Lond. Math. Soc.*, **37** (1962) 10-16.

Cas général :

R. Meshulam, On the maximal rank in a subspace of matrices, *Quart. J. Math. Oxford (2)*, **36** (1985) 225-229.

B. Le théorème d'Atkinson et Lloyd

Théorème 6 (Atkinson-Lloyd). *Soit*

$r \in \llbracket 1, n-1 \rrbracket$ *et* V *sev de* $M_n(\mathbb{K})$ *t.q.*

$\forall M \in V, \text{rg } M \leq r$.

On suppose que $\text{card}(\mathbb{K}) > r$. *Alors :*

(a) *Si* $\dim V > nr - r + 1$, *alors* V *ou* tV *est équivalent à un sev de*

$$\left\{ \left[C_1 \quad \cdots \quad C_r \quad 0 \quad \cdots \quad 0 \right] \mid C_1, \dots, C_r \in M_{n,1}(\mathbb{K}) \right\}$$

(b) *Si* $\dim V = nr - r + 1$, *alors la seule autre possibilité est que* V *ou* tV *soit équivalent à l'espace des matrices du type*

$$\begin{bmatrix} ? & \cdots & ? & ? & \cdots & ? \\ ? & \cdots & ? & 0 & \cdots & 0 \\ \vdots & & \vdots & \vdots & & \vdots \\ ? & \cdots & ? & 0 & \cdots & 0 \end{bmatrix}$$

(limitation sur les $n - r + 1$ *dernières colonnes).*

M.D. Atkinson, S. Lloyd, Large spaces of matrices of bounded rank, *Quart. J. Math. Oxford (2)*, **31** (1980) 253-262.

Contre-exemple pour $n = 3$, $\mathbb{K} \simeq \mathbb{F}_2$ et $\dim V = 5$:

$$\left\{ \begin{bmatrix} a & b & c \\ 0 & d & e \\ 0 & 0 & a + d \end{bmatrix} \mid a, b, c, d, e \in \mathbb{K} \right\}$$

(espace des matrices triangulaires supérieures de trace nulle).

C. Le théorème d'Atkinson et Lloyd généralisé

Théorème 7 (de Seguin Pazzis (2010)). *Le théorème d'Atkinson et Lloyd reste vrai sans hypothèse sur \mathbb{K} , sauf si $n = 3$, $r = 2$, $\text{card } \mathbb{K} = 2$, et $\dim V = 5$, où le contre-exemple précédent est, à équivalence près, la seule exception à la règle.*

C. de Seguins Pazzis, The classification of large spaces of matrices with bounded rank, prépublication arXiv, <http://arxiv.org/abs/1004.0298>

Une application (non triviale) :

Théorème 8 (de Seguins Pazzis (2010)). *Soit V sev de $M_n(\mathbb{K})$ de codimension $\leq n - 2$, et $f : V \hookrightarrow M_n(\mathbb{K})$ injection linéaire conservant l'inversibilité au sens fort.*

Alors, sauf éventuellement si $n = 3$, $\text{card}(\mathbb{K}) = 2$ et $\text{codim } V = 1$, il existe $(P, Q) \in \text{GL}_n(\mathbb{K})^2$ t.q.

$$\forall M, f(M) = PMQ \quad \text{ou} \quad \forall M, f(M) = P^tMQ$$

La conservation de l'inversibilité au sens faible suffit si \mathbb{K} est infini.

C. de Seguins Pazzis, The linear preservers of non-singularity in a large space of matrices, prépublication arXiv, <http://arxiv.org/abs/1004.2467>

D. Principes de démonstration

Soit V sev de $M_n(\mathbb{K})$ t.q. $\forall M \in V, \text{rg}(M) \leq r$.

(a) Méthode de Flanders

On suppose $\text{card}(\mathbb{K}) > r$.

OPS V contient une matrice de rang r (réc. sur r).

OPS V contient

$$J_r = \begin{bmatrix} I_r & 0 \\ 0 & 0 \end{bmatrix}$$

On découpe toute matrice de V sous le même format :

$$M = \begin{bmatrix} A(M) & C(M) \\ B(M) & D(M) \end{bmatrix}.$$

On fixe $(i, j) \in \llbracket 1, n - p \rrbracket^2$ et on note L_i la i -ème ligne de $A(M)$ et C_j la j -ème col. de $C(M)$.

Alors

$$\forall t \in \mathbb{K}, \begin{vmatrix} tI_r + A(M) & C_j \\ L_i & d_{i,j}(M) \end{vmatrix} = 0$$

i.e., $\forall t \in \mathbb{K}$,

$$d_{i,j}(M)t^r + [d_{i,j}(M) \operatorname{tr} A(M) - L_i C_j] t^{r-1} + \dots = 0.$$

→ l'hypothèse de cardinalité assure :

$$D(M) = 0 \quad \text{et} \quad B(M)C(M) = 0.$$

→ $F := \{(B(M), C(M)) \mid M \in V\}$ est totalement isotrope pour la FQ régulière $q(B, C) := \operatorname{tr}(BC)$, donc $\dim F \leq r(n - r)$.

→ on en déduit l'inégalité :

$$\dim V \leq r^2 + r(n - r) = nr.$$

On suppose maintenant $\dim V > nr - r + 1$.

On introduit

$$V' := \{M \in V : B(M) = 0 \quad \text{et} \quad C(M) = 0\}.$$

Le thm du rang donne

$$\dim V' > r^2 - r + 1.$$

Soit $P \in A(V')$. On reprend la méthode

précédente avec $\begin{bmatrix} P & 0 \\ 0 & 0 \end{bmatrix}$ au lieu de J_r .

On obtient, $\forall M \in V$,

$$B(M) {}^t \text{com}(P) C(M) = 0.$$

Lemme 9. Soit V_1 sev de $M_r(\mathbb{K})$ t.q.

$$\text{codim } V_1 \leq r - 2.$$

Alors, pour tt $x \in \mathbb{K}^r \setminus \{0\}$,

$$\mathbb{K}^r = \text{Vect}\{{}^t \text{com}(P)x \mid P \in V_1\}.$$

Démonstration. Sinon, OPS

$\forall M \in V_1$, $\text{com}(M)_{1,1} = 0$ i.e. pour tout $M \in V$,

la ss-matrice obtenue en retirant 1-ère ligne et

1-ère col. est singulière

→ contradiction avec le thm de Dieudonné. \square

Remarque 3. Le lemme peut être raffiné :

$$\text{Vect}\{M^{-1}x \mid M \in \text{GL}_r(\mathbb{K}) \cap V_1\} = \mathbb{K}^r \text{ pour tout } x \in \mathbb{K}^r \setminus \{0\}.$$

→ on en déduit successivement

$$\forall M \in V, B(M) = 0 \quad \text{ou} \quad C(M) = 0$$

$$\forall M \in V, B(M) = 0 \quad \text{ou} \quad \forall M \in V, C(M) = 0.$$

(b) Méthode raffinée

→ \mathbb{K} corps quelconque.

L'astuce est de limiter les calculs à des polynômes de degré au plus 2 en utilisant + finement le thm du rang

→ on introduit deux sev de V :

W sev des élts de V de la forme $\begin{bmatrix} 0_r & ? \\ ? & ? \end{bmatrix}$;

H sev des élts de W de la forme $\begin{bmatrix} 0_r & ? \\ 0_{n-r,r} & ? \end{bmatrix}$;

→ thm du rang :

$$\dim V = \dim A(V) + \dim B(W) + \dim H.$$

On part de $M_0 \in V$ et $M \in W$.

De

$$\text{rg} \begin{bmatrix} A(M_0) & C(M_0) + C(M) \\ B(M_0) + B(M) & D(M_0) + D(M) \end{bmatrix} \leq r,$$

on tire

$$\begin{aligned} & \det(A(M_0)) [D(M) + D(M_0)] \\ &= [B(M_0) + B(M)]^t \operatorname{com}(A(M_0)) \times [C(M_0) + C(M)]. \end{aligned}$$

d'où

$$\begin{aligned} \det(A(M_0)) D(M) &= B(M)^t \operatorname{com}(A(M_0)) C(M_0) \\ &\quad + B(M_0)^t \operatorname{com}(A(M_0)) C(M) \\ &\quad + B(M)^t \operatorname{com}(A(M_0)) C(M). \end{aligned}$$

En particulier (prendre M_0 t.q. $A(M_0) = I_r$)

$$\forall M \in H, C(M) = 0 \Rightarrow D(M) = 0$$

d'où

$$\dim V = \dim A(V) + \dim B(W) + \dim C(H).$$

Par polarisation :

$$\forall (M, N) \in W \times H, B(M)^t \operatorname{com}(A(M_0)) C(N) = 0.$$

En particulier vrai pour $M_0 = J_r$ d'où la majoration du thm de Flanders.

→ puis avec le lemme 9 :

$$C(H) = \{0\} \quad \text{ou} \quad B(W) = \{0\}.$$

Quitte à considérer tV , OPS $C(H) = \{0\}$ d'où $H = \{0\}$.

Bilan provisoire : V est de la forme

$$\left\{ \left[\begin{array}{c|c} N & \varphi(N) \end{array} \right] \mid N \in W_1 \right\}$$

où W_1 sev de $M_{n,r}(\mathbb{K})$ de $\text{codim} < r - 1$, et φ lin.
On montre ensuite :

$$\exists C \in M_{r,n-r}(\mathbb{K}) : \forall N \in W_1, \varphi(N) = NC$$

et alors tt $M \in V$ est nul sur l'image de $\begin{bmatrix} C \\ -I_{n-r} \end{bmatrix}$
(de dim. $n - r$).

2 étapes pour ce dernier point :

Lemme 10. Soit W_1 sev de $M_{n,r}(\mathbb{K})$ de codim $\leq r - 1$. et $\varphi : M_{n,r}(\mathbb{K}) \rightarrow M_{n,n-r}(\mathbb{K})$ lin.

On supp. $\forall M \in W_1, \text{rg} \begin{bmatrix} N & \varphi(N) \end{bmatrix} \leq r$.

Alors $\forall N \in V, \text{Im} \varphi(N) \subset \text{Im}(N)$ (sauf si $r = 2$ et $\text{card}(\mathbb{K}) = 2$).

Lemme 11. Avec les \hat{m} hypothèses,

$\exists C \in M_{r,n-r}(\mathbb{K})$ t.q. $\forall N \in W_1, \varphi(N) = NC$.

Preuve du lemme 10 :

pour $N \in W_1$, on écrit $\varphi(N) = \begin{bmatrix} ? \\ \alpha(M) \end{bmatrix}$, avec

$\alpha \in M_{n-r}(\mathbb{K})$. On introduit G sev des $P \in M_r(\mathbb{K})$

t.q. V contienne $\begin{bmatrix} P \\ 0 \end{bmatrix}$. Alors $\text{codim} G \leq r - 1$.

Pour tout $P \in G$ inversible, $\alpha(P) = 0$.

Or $G \cap GL_r(\mathbb{K})$ engendre G (thm de Dieudonné!).

Donc $\alpha = 0$.

→ en généralisant, on conclut.

III. Espaces affines de matrices de rang $\geq r$

A. Énoncé du problème

Ici, $\mathcal{P}(M)$ est “rg $M \geq r$ ”.

Motivation : soit V sev de $M_n(\mathbb{K})$. Est-il engendré par ses matrices de rang $\leq s$? Il ne l'est pas ssi V admet un *hyperplan affine* de matrices de rg $> s$.

On se contentera ici de décrire le cas $n = r$
(espaces affines de matrices inversibles).

Lien avec le thm de Gerstenhaber :

Soit \mathcal{V} espace affine de direction V . OS $I_n \in \mathcal{V}$.

Conditions équivalentes :

- (i) $\mathcal{V} \subset \text{GL}_n(\mathbb{K})$;
- (ii) $\forall M \in V, I_n + M \in \text{GL}_n(\mathbb{K})$;
- (iii) $\forall M \in V, \forall t \in \mathbb{K}, I_n + tM \in \text{GL}_n(\mathbb{K})$;
- (iv) $\forall M \in V, \text{Sp}_{\mathbb{K}}(M) \subset \{0\}$.

Si \mathbb{K} alg. clos, ces conditions sont équivalentes à
 V nilpotent !!

Définition 1. V est dit à spectre trivial lorsque $\forall M \in V, \text{Sp}_{\mathbb{K}}(M) \subset \{0\}$.

B. Majoration de la dimension

Théorème 12 (de Seguin Pazzis, 2007). *Si V sev de $M_n(\mathbb{K})$ est à spectre trivial, $\dim V \leq \binom{n}{2}$.*

Corollaire 13. *Si \mathcal{V} sea de $M_n(\mathbb{K})$ inclus dans $GL_n(\mathbb{K})$, alors $\dim \mathcal{V} \leq \binom{n}{2}$.*

C. de Seguin Pazzis, On the matrices of given rank in a large subspace, *Linear Algebra Appl.*, **435** (2011) 147-151.

C. Sous-espaces de dimension maximale

A priori, structure bien plus compliquée, pour les sev à spectre trivial de dim maximale, que ds le cas nilpotent.

Exemple : $A_n(\mathbb{R})$, espace des matrices antisymétriques réelles, non conjugué à $T_n^{++}(\mathbb{R})$ si $n > 2$.

Principe de réduction : Soit V sev de $M_n(\mathbb{K})$ à spectre trivial de dimension $\binom{n}{2}$.

Si V réductible, OPS $\exists r \in \llbracket 1, n-1 \rrbracket$ t.q. tt élt de V est de la forme

$$M = \begin{bmatrix} A(M) & ? \\ 0 & B(M) \end{bmatrix}$$

où $A(M) \in M_r(\mathbb{K})$ et $B(M) \in M_{n-r}(\mathbb{K})$. $A(V)$ et $B(V)$ à spectre trivial!

Majoration de la dim. + théorème du rang donnent :

$$\dim A(V) = \binom{r}{2} \text{ et } \dim B(V) = \binom{n-r}{2}.$$

Avec le thm du rang, on obtient que V est l'ensemble $A(V) \vee B(V)$ des matrices de la forme

$$\begin{bmatrix} A_1 & C_1 \\ 0 & B_1 \end{bmatrix}$$

où $A_1 \in A(V)$, $B_1 \in B(V)$, C_1 quelconque.

Bilan : il suffit de classifier les sev *irréductibles* à spectre trivial de dim max.

On suppose maintenant $\text{card}(\mathbb{K}) > 2$.

Théorème 14 (de Seguin Pazzis, 2011).

Les sev irréductibles à spectre trivial de dim max de $M_n(\mathbb{K})$ sont les $PA_n(\mathbb{K})$, où $P \in GL_n(\mathbb{K})$ est anisotrope.

Théorème 15 (de Seguin Pazzis, 2011).

Soit V sev à spectre trivial de dim max de $M_n(\mathbb{K})$. Alors $\exists P_1, \dots, P_r$ anisotropes t.q.

$$V \simeq P_1 A_{q_1}(\mathbb{K}) \vee \dots \vee P_r A_{q_r}(\mathbb{K}).$$

Chacun des P_i est déterminé par V à simili-congruence près (i.e. $P \sim Q \Leftrightarrow \exists R$ inversible et $\exists \lambda \in \mathbb{K}^$ t.q. $P = \lambda RQ^t R$).*

Théorème 16 (de Seguin Pazzis, 2011).

Soit \mathcal{V} sea de $M_n(\mathbb{K})$ dans $GL_n(\mathbb{K})$ et de dim max. Alors $\exists P_1, \dots, P_r$ anisotropes t.q.

$$\mathcal{V} \sim I_n + \left[P_1 A_{q_1}(\mathbb{K}) \vee \dots \vee P_r A_{q_r}(\mathbb{K}) \right].$$

Chacune des FQ anisotropes $X \mapsto {}^t X P_i X$ est déterminé par V à similitude près.

Interprétation : la classification des formes
quadratiques anisotropes sur \mathbb{K} à similitude près
est lisible dans la géométrie affine des groupes
linéaires $GL_n(\mathbb{K})$!!

C. de Seguins Pazzis, Large affine spaces of non-singular
matrices, prépublication arXiv,
<http://arxiv.org/abs/1102.2493>

Extension aux sous-espaces affines de rang $\geq r$:
C. de Seguins Pazzis, Large affine spaces of matrices with
rank bounded below, prépublication arXiv,
<http://arxiv.org/abs/1102.4027>