

第五章 向量空间

本章介绍向量空间以及维数、基和坐标等概念，讨论齐次线性方程组的解空间和非齐次线性方程组解的结构。

第一节 向量空间

一、向量空间及有关概念

定义 1 设 V 为 R^n 的一个非空子集，如果 V 满足：

- (1) V 对加法运算封闭，即 V 中任意两个向量的和向量仍在 V 中；
- (2) V 对数乘运算封闭，即 V 中任意向量与任一实数的乘积仍在 V 中；

则称 V 关于向量的线性运算构成实数域上的一个**向量空间**。

如我们平常接触最多的 R^1 、 R^2 和 R^3 都是向量空间。

例 1 设 $V_1 = \{(x, y, z)^T \mid x + y + z = 0, x, y, z \in R\}$ ，

$V_2 = \{(x, y, z)^T \mid x + y + z = 1, x, y, z \in R\}$ ，问 V_1 和 V_2 是向量空间吗？

解 由于 V_1 同时满足向量空间定义中的加法运算封闭性和数乘运算封闭性，因此 V_1 是向量空间。

而 V_2 不满足加法运算封闭性（数乘运算封闭性也没有满足），因此 V_2 不是向量空间。

例 2 设齐次线性方程组的解集 $V_3 = \{x = (x_1, x_2, \dots, x_n)^T \mid Ax = 0, x_1, \dots, x_n \in R\}$ ，非齐次线性方程组的解集 $V_4 = \{x = (x_1, x_2, \dots, x_n)^T \mid Ax = b, b \neq 0, x_1, \dots, x_n \in R\}$ ，问 V_3 和 V_4 是向量空间吗？

解 对于 V_3 ，设 α_1 和 α_2 是任意两个属于 V_3 的向量， k 是任意一个实数，则由 $A(\alpha_1 + \alpha_2) = A\alpha_1 + A\alpha_2 = 0$ 以及 $A(k\alpha_1) = kA\alpha_1 = 0$ 可知 V_3 满足加法运算封闭性和数乘运算封闭性，因此 V_3 是向量空间。对于 V_4 ，设 β_1 和 β_2 是任意两个属于 V_4 的向量，则由 $A(\beta_1 + \beta_2) = A\beta_1 + A\beta_2 = 2b \neq b$ 可知 V_4 不满足加法运算封闭性，因此 V_4 不是向量空间。

定义 2 设 $\alpha_1, \alpha_2, \dots, \alpha_s \in R^n$ ，则可以验证由该向量组的所有线性组合得到的向量的集

合 $U = \{x \mid x = k_1 a_1 + k_2 a_2 + \cdots + k_s a_s, k_1, k_2, \cdots, k_s \in \mathbf{R}\}$ 是一个向量空间。称 U 是由

a_1, a_2, \cdots, a_s 所生成的子空间 (或称为 a_1, a_2, \cdots, a_s 的生成子空间), 记作

$U = \text{Span}(a_1, a_2, \cdots, a_s)$, 其中 a_1, a_2, \cdots, a_s 称为 U 的生成元。

例如本节例子中的向量空间 V_3 是齐次线性方程组 $Ax = 0$ 的所有解向量所构成的解集, 它可以看成是由方程组的解集的极大无关组 $\xi_1, \xi_2, \cdots, \xi_r$ 作为生成元所生成的, 即 $V_3 = \text{Span}(\xi_1, \xi_2, \cdots, \xi_r)$ 。

定义 3 设 V 是向量空间 U 的一个子集, 如果 V 也是向量空间, 则称 V 是 U 的子空间。如本节例子中的 V_1 是 \mathbf{R}^3 的一个子空间。

二、向量空间的基、维数和坐标

定义 4 设 V 是一个向量空间, a_1, a_2, \cdots, a_r 是 V 中的一组向量, 如果满足:

- (1) a_1, a_2, \cdots, a_r 线性无关;
- (2) V 中的任一向量都可由 a_1, a_2, \cdots, a_r 线性表示,

则称 a_1, a_2, \cdots, a_r 是 V 的一组基, 数 r 称为 V 的维数, 记作 $\dim(V) = r$, 并称 V 是 r 维向量空间。

例如 $(1, 0)^T, (0, 1)^T$ 是 \mathbf{R}^2 的一组基, 所以 \mathbf{R}^2 是 2 维向量空间;

$(1, 0, 0)^T, (0, 1, 0)^T, (0, 0, 1)^T$ 是 \mathbf{R}^3 的一组基, 所以 \mathbf{R}^3 是 3 维向量空间; 又例如

$(1, 0, -1)^T, (0, 1, -1)^T$ 是向量空间 $V_1 = \{(x, y, z)^T \mid x + y + z = 0, x, y, z \in \mathbf{R}\}$ 的一组基, 因此

V_1 是二维向量空间, 从几何的角度看, V_1 是 \mathbf{R}^3 中过坐标系原点的一个二维平面。

定义 5 设 V 是向量空间, a_1, a_2, \cdots, a_r 是 V 的一组基, 任给 $\alpha \in V$, 若有

$$\alpha = x_1 a_1 + x_2 a_2 + \cdots + x_r a_r = (a_1, a_2, \cdots, a_r) \begin{pmatrix} x_1 \\ x_2 \\ \vdots \\ x_r \end{pmatrix}, \quad (5.1)$$

则称 (x_1, x_2, \cdots, x_r) 为 α 在基 a_1, a_2, \cdots, a_r 下的坐标。

例 3 在向量空间 \mathbf{R}^3 中, 设 $\alpha_1 = \begin{pmatrix} 1 \\ 0 \\ 2 \end{pmatrix}, \alpha_2 = \begin{pmatrix} 2 \\ 1 \\ 0 \end{pmatrix}, \alpha_3 = \begin{pmatrix} 3 \\ 1 \\ 3 \end{pmatrix}, \alpha = \begin{pmatrix} 1 \\ 2 \\ 3 \end{pmatrix}$

(1) 求 α 在由单位坐标向量 $e_1 = (1, 0, 0)^T, e_2 = (0, 1, 0)^T, e_3 = (0, 0, 1)^T$ 构成的基下的坐标;

(2) 证明 $\alpha_1, \alpha_2, \alpha_3$ 也是 \mathbf{R}^3 的一组基, 并求出 α 在基 $\alpha_1, \alpha_2, \alpha_3$ 下的坐标。

解 (1) 由 $\alpha = 1e_1 + 2e_2 + 3e_3$ 知, α 在基 e_1, e_2, e_3 下的坐标是 $(1, 2, 3)$ 。

(2) 设 α 在基 $\alpha_1, \alpha_2, \alpha_3$ 下的坐标是 (x_1, x_2, x_3) , 则 $x_1\alpha_1 + x_2\alpha_2 + x_3\alpha_3 = \alpha$, 从本质来看, 求坐标就是解此线性方程组。增广矩阵

$$(A | \alpha) = (\alpha_1, \alpha_2, \alpha_3 | \alpha) = \begin{pmatrix} 1 & 2 & 3 & \vdots & 1 \\ 0 & 1 & 1 & \vdots & 2 \\ 2 & 0 & 3 & \vdots & 3 \end{pmatrix} \xrightarrow{r} \begin{pmatrix} 1 & 2 & 3 & \vdots & 1 \\ 0 & 1 & 1 & \vdots & 2 \\ 0 & 0 & 1 & \vdots & 9 \end{pmatrix}$$

从行阶梯形可以看出 $R(\alpha_1, \alpha_2, \alpha_3) = 3$, 因此 $\alpha_1, \alpha_2, \alpha_3$ 也是 \mathbf{R}^3 的一组基。为求 α 在基 $\alpha_1, \alpha_2, \alpha_3$ 下的坐标, 进一步把增广矩阵的行阶梯形化为行最简形。

$$\begin{pmatrix} 1 & 2 & 3 & \vdots & 1 \\ 0 & 1 & 1 & \vdots & 2 \\ 0 & 0 & 1 & \vdots & 9 \end{pmatrix} \xrightarrow{r} \begin{pmatrix} 1 & 0 & 0 & \vdots & -12 \\ 0 & 1 & 0 & \vdots & -7 \\ 0 & 0 & 1 & \vdots & 9 \end{pmatrix}$$

从行最简形即可得 α 在基 $\alpha_1, \alpha_2, \alpha_3$ 下的坐标为 $(-12, -7, 9)$ 。

从该例子可以知道, 一个向量的各个分量只有在单位坐标向量 e_1, e_2, \dots, e_n 这组基 (笛卡尔坐标系) 下才和它的坐标各个分量相等, 而在通常情况下并不相等。

例 4 设向量组 $\alpha_1 = \begin{pmatrix} 1 \\ 3 \\ 1 \\ -1 \end{pmatrix}, \alpha_2 = \begin{pmatrix} 2 \\ -1 \\ -1 \\ 4 \end{pmatrix}, \alpha_3 = \begin{pmatrix} 5 \\ 1 \\ -1 \\ 7 \end{pmatrix}, \alpha_4 = \begin{pmatrix} 2 \\ 6 \\ 2 \\ -3 \end{pmatrix}$, 求向量空间

$U = \text{Span}(\alpha_1, \alpha_2, \alpha_3, \alpha_4)$ 的维数和一组基。

解 显然, 向量组 $\alpha_1, \alpha_2, \alpha_3, \alpha_4$ 的任一个极大无关组都是向量空间

$U = \text{Span}(\alpha_1, \alpha_2, \alpha_3, \alpha_4)$

的一组基, 且 $R(\alpha_1, \alpha_2, \alpha_3, \alpha_4)$ 就是 U 的维数。

$$(\alpha_1, \alpha_2, \alpha_3, \alpha_4) = \begin{pmatrix} 1 & 2 & 5 & 2 \\ 3 & -1 & 1 & 6 \\ 1 & -1 & -1 & 2 \\ -1 & 4 & 7 & -3 \end{pmatrix} \xrightarrow{r} \begin{pmatrix} 1 & 2 & 5 & 2 \\ 0 & 1 & 2 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 1 \\ 0 & 0 & 0 & 0 \end{pmatrix}$$

从行阶梯形可得向量组 $\alpha_1, \alpha_2, \alpha_3, \alpha_4$ 的秩为 3, $\alpha_1, \alpha_2, \alpha_4$ 为一个极大无关组。因此向量空间 $U = \text{Span}(\alpha_1, \alpha_2, \alpha_3, \alpha_4)$ 的维数为 3, $\alpha_1, \alpha_2, \alpha_4$ 即为 $U = \text{Span}(\alpha_1, \alpha_2, \alpha_3, \alpha_4)$ 的一组基。

三、基变换与坐标变换*

定义 6 设 $\alpha_1, \alpha_2, \dots, \alpha_r$ 和 $\beta_1, \beta_2, \dots, \beta_r$ 分别为向量空间 V 的两组基, 且有

$$(\beta_1, \beta_2, \dots, \beta_r) = (\alpha_1, \alpha_2, \dots, \alpha_r) P_{r \times r}, \quad (5.2)$$

称 r 阶方阵 P 是由基 $\alpha_1, \alpha_2, \dots, \alpha_r$ 到基 $\beta_1, \beta_2, \dots, \beta_r$ 的过渡矩阵, (5.2) 式称为基变换公式。

显然 P 可逆。

例 5 已知 R^3 的两个基为 $\alpha_1 = \begin{pmatrix} 1 \\ 1 \\ 1 \end{pmatrix}, \alpha_2 = \begin{pmatrix} 1 \\ 0 \\ -1 \end{pmatrix}, \alpha_3 = \begin{pmatrix} 1 \\ 0 \\ 1 \end{pmatrix}$ 和

$\beta_1 = \begin{pmatrix} 1 \\ 2 \\ 1 \end{pmatrix}, \beta_2 = \begin{pmatrix} 2 \\ 3 \\ 4 \end{pmatrix}, \beta_3 = \begin{pmatrix} 3 \\ 4 \\ 3 \end{pmatrix}$, 求由基 $\alpha_1, \alpha_2, \alpha_3$ 到基 $\beta_1, \beta_2, \beta_3$ 的过渡矩阵。

解 由 $(\beta_1, \beta_2, \beta_3) = (\alpha_1, \alpha_2, \alpha_3) P$, 得 $P = (\alpha_1, \alpha_2, \alpha_3)^{-1} (\beta_1, \beta_2, \beta_3)$, 下用初等行变换法求过渡矩阵 P 。

$$(\alpha_1, \alpha_2, \alpha_3 | \beta_1, \beta_2, \beta_3) = \begin{pmatrix} 1 & 1 & 1 & : & 1 & 2 & 3 \\ 1 & 0 & 0 & : & 2 & 3 & 4 \\ 1 & -1 & 1 & : & 1 & 4 & 3 \end{pmatrix} \xrightarrow{r} \begin{pmatrix} 1 & 0 & 0 & : & 2 & 3 & 4 \\ 0 & 1 & 0 & : & 0 & -1 & 0 \\ 0 & 0 & 1 & : & -1 & 0 & -1 \end{pmatrix}.$$

$$\text{得过渡矩阵 } P = \begin{pmatrix} 2 & 3 & 4 \\ 0 & -1 & 0 \\ -1 & 0 & -1 \end{pmatrix}.$$

定理 1 设 V 是向量空间, $\alpha_1, \alpha_2, \dots, \alpha_r$ 和 $\beta_1, \beta_2, \dots, \beta_r$ 分别为 V 的两组基, 且

$X = (x_1, x_2, \dots, x_r)$ 和 $Y = (y_1, y_2, \dots, y_r)$ 分别是向量 α 在基 $\alpha_1, \alpha_2, \dots, \alpha_r$ 和 $\beta_1, \beta_2, \dots, \beta_r$

下的坐标, 则有

$$X = YP^T \text{ 和 } Y = X(P^T)^{-1} \quad (5.3)$$

其中 P 是由基 $\alpha_1, \alpha_2, \dots, \alpha_r$ 到基 $\beta_1, \beta_2, \dots, \beta_r$ 的过渡矩阵. 式 (5.3) 称为坐标变换公式.

证明 因为 $\alpha = (\alpha_1, \alpha_2, \dots, \alpha_r)X^T$, $\alpha = (\beta_1, \beta_2, \dots, \beta_r)Y^T$,

$$\text{所以 } (\alpha_1, \alpha_2, \dots, \alpha_r)X^T = (\beta_1, \beta_2, \dots, \beta_r)Y^T$$

$$\text{又因为 } (\beta_1, \beta_2, \dots, \beta_r) = (\alpha_1, \alpha_2, \dots, \alpha_r)P,$$

$$\text{所以 } (\alpha_1, \alpha_2, \dots, \alpha_r)X^T = (\alpha_1, \alpha_2, \dots, \alpha_r)PY^T,$$

由 $\alpha_1, \alpha_2, \dots, \alpha_r$ 线性无关, 得 $X^T = PY^T$, 即 $X = YP^T$ 或 $Y = X(P^T)^{-1}$.

例 6 $\alpha_1, \alpha_2, \alpha_3$ 和 $\beta_1, \beta_2, \beta_3$ 分别是向量空间 V 的两个基, 且 $\alpha_1 = 4\beta_1 - \beta_2$,
 $\alpha_2 = -\beta_1 + \beta_2 + \beta_3$, $\alpha_3 = \beta_2 - 2\beta_3$.

(1) 求由基 $\alpha_1, \alpha_2, \alpha_3$ 到基 $\beta_1, \beta_2, \beta_3$ 的过渡矩阵 P ;

(2) 对 $\alpha = 3\alpha_1 + 4\alpha_2 + \alpha_3$, 求 α 在基 $\beta_1, \beta_2, \beta_3$ 下的坐标.

解 (1) 由已知条件可得 $\beta_1 = 0.3\alpha_1 + 0.2\alpha_2 + 0.1\alpha_3$, $\beta_2 = 0.2\alpha_1 + 0.8\alpha_2 + 0.4\alpha_3$,

$$\beta_3 = 0.1\alpha_1 + 0.4\alpha_2 - 0.3\alpha_3. \text{ 从而得 } (\beta_1, \beta_2, \beta_3) = (\alpha_1, \alpha_2, \alpha_3) \begin{pmatrix} 0.3 & 0.2 & 0.1 \\ 0.2 & 0.8 & 0.4 \\ 0.1 & 0.4 & -0.3 \end{pmatrix}, \text{ 即}$$

$$\text{由基 } \alpha_1, \alpha_2, \alpha_3 \text{ 到基 } \beta_1, \beta_2, \beta_3 \text{ 的过渡矩阵 } P = \begin{pmatrix} 0.3 & 0.2 & 0.1 \\ 0.2 & 0.8 & 0.4 \\ 0.1 & 0.4 & -0.3 \end{pmatrix}.$$

(2) 由 $\alpha = 3\alpha_1 + 4\alpha_2 + \alpha_3$ 知向量 α 在基 $\alpha_1, \alpha_2, \alpha_3$ 下的坐标 $X = (3, 4, 1)$, 则由坐标变换公式得 α 在基 $\beta_1, \beta_2, \beta_3$ 下的坐标

$$Y = X(P^T)^{-1} = (3, 4, 1) \begin{pmatrix} 0.3 & 0.2 & 0.1 \\ 0.2 & 0.8 & 0.4 \\ 0.1 & 0.4 & -0.3 \end{pmatrix}^{-1} = (8, 2, 2).$$

思考题一

1. 一个向量空间包含的向量个数总数可以是 1 个? 2 个? 3 个? 或是无穷多个吗?

2. $\alpha_1 = \begin{pmatrix} 1 \\ 0 \\ 2 \end{pmatrix}, \alpha_2 = \begin{pmatrix} 2 \\ 1 \\ 0 \end{pmatrix}, \alpha_3 = \begin{pmatrix} 3 \\ 1 \\ 3 \end{pmatrix}$ 是向量空间 \mathbf{R}^3 的一组基, 设 $\beta_1 = \begin{pmatrix} 1 \\ 2 \\ 3 \end{pmatrix}, \beta_2 = \begin{pmatrix} 4 \\ 5 \\ 6 \end{pmatrix},$

$\beta_3 = \begin{pmatrix} 7 \\ 8 \\ 9 \end{pmatrix}$, 问: 有何办法可同时求出向量 $\beta_1, \beta_2, \beta_3$ 在基 $\alpha_1, \alpha_2, \alpha_3$ 下的坐标呢?

提示: 考虑矩阵 $(\alpha_1, \alpha_2, \alpha_3 | \beta_1, \beta_2, \beta_3)$

3. 设 $\alpha_1, \alpha_2, \alpha_3, \alpha_4 \in \mathbf{R}^n$, 它们生成向量空间 V , 则 V 的维数 ().

(A) 等于 4 (B) 等于 n (C) 小于或等于 4 (D) 大于或等于 4

4. 想一想并去图书馆、新华书店、网上和同专业的师兄学姐及老师那里调研坐标变换在你的本专业领域里有哪些应用? 如何应用?

第三节 向量内积与正交化

1. 向量的内积

定义 7 设有 n 维向量

$$\alpha = \begin{pmatrix} a_1 \\ a_2 \\ \vdots \\ a_n \end{pmatrix}, \quad \beta = \begin{pmatrix} b_1 \\ b_2 \\ \vdots \\ b_n \end{pmatrix},$$

定义它们的内积为

$$\langle \alpha, \beta \rangle = a_1 b_1 + a_2 b_2 + \cdots + a_n b_n = \sum_{i=1}^n a_i b_i. \quad (5.4)$$

由矩阵乘法, 有 $\langle \alpha, \beta \rangle = \alpha^T \beta = \beta^T \alpha$.

向量的内积运算满足以下运算律:

(1) 交换律 $\langle \alpha, \beta \rangle = \langle \beta, \alpha \rangle$;

(2) 对加法的分配律 $\langle \alpha, \beta + \gamma \rangle = \langle \alpha, \beta \rangle + \langle \alpha, \gamma \rangle$;

(3) 对数乘的结合律 $\langle k\alpha, \beta \rangle = \langle \alpha, k\beta \rangle = k \langle \alpha, \beta \rangle$;

(4) 非负性 $\langle \alpha, \alpha \rangle \geq 0$, 当且仅当 $\alpha = 0$ 时等号成立.

这四条运算律被称为**内积公理**, 由定义可以直接证明, 留给读者作为练习.

定义 8 对于 n 维向量 $\alpha = (a_1, a_2, \cdots, a_n)^T$, 定义

$$\|\alpha\| = \sqrt{\langle \alpha, \alpha \rangle} = \sqrt{a_1^2 + a_2^2 + \cdots + a_n^2} \quad (5.5)$$

为向量 α 的范数(即长度或模).

定理 2 向量的范数具有下述性质:

- (1) 非负性 $\|\alpha\| \geq 0$;
- (2) 齐次性 $\|k\alpha\| = |k|\|\alpha\|$ (k 为任意实数);
- (3) 柯西-施瓦兹 (Cauchy-Schwartz) 不等式 $|\langle \alpha, \beta \rangle| \leq \|\alpha\| \cdot \|\beta\|$;
- (4) 三角不等式: $\|\alpha + \beta\| \leq \|\alpha\| + \|\beta\|$.

证明 (1) 由内积公理第 (4) 条立得, 且 $\|\alpha\| = 0$ 当且仅当 $\alpha = 0$.

$$(2) \|k\alpha\| = \sqrt{\langle k\alpha, k\alpha \rangle} = \sqrt{k^2 \langle \alpha, \alpha \rangle} = |k|\|\alpha\|.$$

(3) 当 $\beta = 0$ 时显然成立, 当 $\beta \neq 0$ 时, 对任意 $k \in R$, 有

$$\begin{aligned} 0 &\leq \langle \alpha - k\beta, \alpha - k\beta \rangle = \langle \alpha - k\beta, \alpha \rangle - k \langle \alpha - k\beta, \beta \rangle \\ &= \|\alpha\|^2 - 2k \langle \alpha, \beta \rangle + k^2 \|\beta\|^2. \end{aligned}$$

令 $k = \frac{\langle \alpha, \beta \rangle}{\|\beta\|^2}$ 代入上式得 $0 \leq \|\alpha\|^2 - \frac{\langle \alpha, \beta \rangle^2}{\|\beta\|^2}$, 移项即获证. 等号成立当且仅当 $\beta = 0$ 或

$\alpha = k\beta$, 即向量 α, β 线性相关.

(4) 由于

$$\begin{aligned} \|\alpha + \beta\|^2 - (\|\alpha\| + \|\beta\|)^2 &= (\|\alpha\|^2 + \|\beta\|^2 + 2\langle \alpha, \beta \rangle) - (\|\alpha\|^2 + \|\beta\|^2 + 2\|\alpha\| \cdot \|\beta\|) \\ &= 2(\langle \alpha, \beta \rangle - \|\alpha\| \cdot \|\beta\|) \leq 0, \end{aligned}$$

上式移项后开方即可得证. 等号成立当且仅当向量 α, β 线性相关.

三角不等式在几何上表示一个三角形任一边不大于另外两边之和.

长度为 1 的向量称为**单位向量**. 对任一非零向量 α , 向量 $\frac{\alpha}{\|\alpha\|}$ 为单位向量, 这一过程叫

作把向量 α 单位化 (也称**标准化**、**规范化**).

由柯西-施瓦兹不等式, 当 α, β 均为非零向量时, 有

$$-1 \leq \frac{\langle \alpha, \beta \rangle}{\|\alpha\| \|\beta\|} \leq 1,$$

于是有向量夹角的定义.

定义 9 对 n 维非零向量 α, β , 称

$$\varphi = \arccos \frac{\langle \alpha, \beta \rangle}{\|\alpha\| \|\beta\|} \quad (5.6)$$

为向量 α 与 β 的夹角.

例 7 已知 $\alpha = (1, 1, 1, 1)^T, \beta = (1, 4, -2, 2)^T$, 求 $\langle \alpha, \beta \rangle, \|\alpha\|, \|\beta\|$ 及 α 和 β 的夹角 φ .

解 $\langle \alpha, \beta \rangle = 1 \times 1 + 1 \times 4 + 1 \times (-2) + 1 \times 2 = 5,$

$$\|\alpha\| = \sqrt{1^2 + 1^2 + 1^2 + 1^2} = 2,$$

$$\|\beta\| = \sqrt{1^2 + 4^2 + (-2)^2 + 2^2} = 5,$$

$$\varphi = \arccos \frac{\langle \alpha, \beta \rangle}{\|\alpha\| \|\beta\|} = \arccos \left(\frac{1}{2} \right) = \frac{\pi}{3}.$$

2. 向量的正交性

定义 10 当 n 维向量 α, β 满足 $\langle \alpha, \beta \rangle = 0$ 时, 称 α 与 β 正交 (或垂直), 记作 $\alpha \perp \beta$.

显然零向量和任何向量都正交, 两个非零向量正交当且仅当它们的夹角为 $\frac{\pi}{2}$.

定理 3 向量 α 与 β 正交的充分必要条件是 $\|\alpha + \beta\|^2 = \|\alpha\|^2 + \|\beta\|^2$.

这就是几何上熟知的勾股定理, 证明略.

定义 11 当若干非零向量两两正交时, 称它们构成的向量组为正交向量组; 进一步地, 若它们又都是单位向量, 则称为标准正交向量组 (或正交规范向量组).

定理 4 设 $\alpha_1, \alpha_2, \dots, \alpha_m$ 是正交向量组, 则 $\alpha_1, \alpha_2, \dots, \alpha_m$ 线性无关.

证明 不妨设存在实数 k_1, k_2, \dots, k_m 使得

$$k_1 \alpha_1 + k_2 \alpha_2 + \dots + k_m \alpha_m = 0$$

成立, 用 α_i 和上式两端作内积, 得

$$\langle \alpha_i, k_1 \alpha_1 + k_2 \alpha_2 + \dots + k_m \alpha_m \rangle = 0, \quad (5.7)$$

结合正交性可得 $k_i \|\alpha_i\|^2 = 0$, 因为 α_i 不是零向量, 所以 $\|\alpha_i\|^2 \neq 0$, 得 $k_i = 0$. 由 i 的任

意性知不存在不全为 0 的实数 k_1, k_2, \dots, k_m 使得 (5.7) 式成立, 因此 $\alpha_1, \alpha_2, \dots, \alpha_m$ 线性无关.

3. 施密特正交化

下面介绍**施密特 (Schmidt) 正交化方法**. 正交向量组必定线性无关, 它是线性无关向量组的特殊情况. 一般的线性无关的向量组 $\alpha_1, \alpha_2, \dots, \alpha_m$ 未必正交, 但可以将其正交化. 可由已知的向量组 $\alpha_1, \alpha_2, \dots, \alpha_m$ 构造正交向量组 $\beta_1, \beta_2, \dots, \beta_m$. 下面是把向量组 $\alpha_1, \alpha_2, \dots, \alpha_m$ 正交化的过程.

首先取 $\beta_1 = \alpha_1$, 然后构造一个 α_1, α_2 的线性组合 $\beta_2 = \alpha_2 + k\alpha_1 = \alpha_2 + k\beta_1$, 使 β_2 与 β_1 正交. 为此, 令 $\langle \beta_2, \beta_1 \rangle = 0$, 即 $\langle \alpha_2, \beta_1 \rangle + k \langle \beta_1, \beta_1 \rangle = 0$, 解得 $k = -\frac{\langle \alpha_2, \beta_1 \rangle}{\langle \beta_1, \beta_1 \rangle}$, 得到

$$\beta_2 = \alpha_2 - \frac{\langle \alpha_2, \beta_1 \rangle}{\langle \beta_1, \beta_1 \rangle} \beta_1, \quad (5.8)$$

这样 β_1, β_2 正交, 且与 α_1, α_2 等价.

再作线性组合 $\beta_3 = \alpha_3 + k_1\beta_1 + k_2\beta_2$, 分别令 $\langle \beta_3, \beta_1 \rangle = 0, \langle \beta_3, \beta_2 \rangle = 0$, 解得

$$k_1 = -\frac{\langle \alpha_3, \beta_1 \rangle}{\langle \beta_1, \beta_1 \rangle}, k_2 = -\frac{\langle \alpha_3, \beta_2 \rangle}{\langle \beta_2, \beta_2 \rangle},$$

于是得到

$$\beta_3 = \alpha_3 - \frac{\langle \alpha_3, \beta_1 \rangle}{\langle \beta_1, \beta_1 \rangle} \beta_1 - \frac{\langle \alpha_3, \beta_2 \rangle}{\langle \beta_2, \beta_2 \rangle} \beta_2, \quad (5.9)$$

这样 $\beta_1, \beta_2, \beta_3$ 两两正交, 且与 $\alpha_1, \alpha_2, \alpha_3$ 等价.

同样的方式一直做下去, 直到

$$\beta_m = \alpha_m - \frac{\langle \alpha_m, \beta_1 \rangle}{\langle \beta_1, \beta_1 \rangle} \beta_1 - \frac{\langle \alpha_m, \beta_2 \rangle}{\langle \beta_2, \beta_2 \rangle} \beta_2 - \dots - \frac{\langle \alpha_m, \beta_{m-1} \rangle}{\langle \beta_{m-1}, \beta_{m-1} \rangle} \beta_{m-1}, \quad (5.10)$$

这样即得到与 $\alpha_1, \alpha_2, \dots, \alpha_m$ 等价的正交向量组 $\beta_1, \beta_2, \dots, \beta_m$.

进一步, 将上述正交向量组 $\beta_1, \beta_2, \dots, \beta_m$ 单位化, 令

$$\gamma_i = \frac{\beta_i}{\|\beta_i\|}, i = 1, \dots, m \quad (5.11)$$

得到与 $\alpha_1, \alpha_2, \dots, \alpha_m$ 等价的正交规范向量组 $\gamma_1, \gamma_2, \dots, \gamma_m$, 整个过程称为**正交规范化**.

(5.8) 式的几何解释是: 已知 α_1, α_2 线性无关但不正交, 显然二者不在同一直线上,

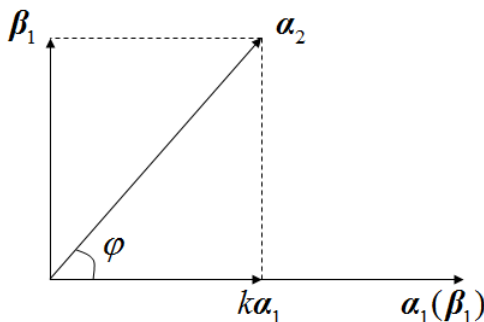
假定 α_1, α_2 的夹角 φ 为锐角 (如图 5.1, φ 为钝角的情况类似). 先取 $\beta_1 = \alpha_1$, 然后将 α_2 做一个正交分解 (比如物理学中经常把力或速度等向量分解为两个相互垂直的向量), 将其分解为跟 α_1 平行的向量 $k\alpha_1$ 和跟 α_1 垂直的向量 β_2 , 即

$$\alpha_2 = k\alpha_1 + \beta_2,$$

其中 $k\alpha_1$ 中的数因子 k 等于多少呢? 注意到 $k\alpha_1$ 可以看作向量 α_2 在 α_1 上的投影, 因此其长度

为 $\|\alpha_2\| \cdot \cos \varphi$, 而 α_1 方向上的单位向量为 $\frac{\alpha_1}{\|\alpha_1\|}$, 所以

$$k\alpha_1 = \|\alpha_2\| \cdot \cos \varphi \cdot \frac{\alpha_1}{\|\alpha_1\|} = \|\alpha_2\| \cdot \frac{\langle \alpha_2, \alpha_1 \rangle}{\|\alpha_2\| \cdot \|\alpha_1\|} \cdot \frac{\alpha_1}{\|\alpha_1\|} = \frac{\langle \alpha_2, \alpha_1 \rangle}{\langle \alpha_1, \alpha_1 \rangle} \alpha_1,$$



(图 5.1)

例 8 设 $\alpha_1 = \begin{pmatrix} 1 \\ -1 \\ 0 \end{pmatrix}, \alpha_2 = \begin{pmatrix} 2 \\ 1 \\ 3 \end{pmatrix}, \alpha_3 = \begin{pmatrix} 3 \\ 1 \\ 2 \end{pmatrix}$, 试将它们正交规范化.

解 取 $\beta_1 = \alpha_1 = \begin{pmatrix} 1 \\ -1 \\ 0 \end{pmatrix}$, 然后令

$$\beta_2 = \alpha_2 - \frac{\langle \alpha_2, \beta_1 \rangle}{\langle \beta_1, \beta_1 \rangle} \beta_1 = \begin{pmatrix} 2 \\ 1 \\ 3 \end{pmatrix} - \frac{1}{2} \begin{pmatrix} 1 \\ -1 \\ 0 \end{pmatrix} = \frac{3}{2} \begin{pmatrix} 1 \\ 1 \\ 2 \end{pmatrix},$$

再令

$$\begin{aligned} \beta_3 &= \alpha_3 - \frac{\langle \alpha_3, \beta_1 \rangle}{\langle \beta_1, \beta_1 \rangle} \beta_1 - \frac{\langle \alpha_3, \beta_2 \rangle}{\langle \beta_2, \beta_2 \rangle} \beta_2 \\ &= \begin{pmatrix} 3 \\ 1 \\ 2 \end{pmatrix} - \frac{2}{2} \begin{pmatrix} 1 \\ -1 \\ 0 \end{pmatrix} - \frac{12}{27/2} \cdot \frac{3}{2} \begin{pmatrix} 1 \\ 1 \\ 2 \end{pmatrix} = \frac{2}{3} \begin{pmatrix} 1 \\ 1 \\ -1 \end{pmatrix}, \end{aligned}$$

最后将它们单位化, 得

$$\gamma_1 = \frac{\beta_1}{\|\beta_1\|} = \frac{1}{\sqrt{2}} \begin{pmatrix} 1 \\ -1 \\ 0 \end{pmatrix}, \gamma_2 = \frac{\beta_2}{\|\beta_2\|} = \frac{1}{\sqrt{6}} \begin{pmatrix} 1 \\ 1 \\ 2 \end{pmatrix}, \gamma_3 = \frac{\beta_3}{\|\beta_3\|} = \frac{1}{\sqrt{3}} \begin{pmatrix} 1 \\ 1 \\ -1 \end{pmatrix}$$

即为所求的正交规范组.

定义 12 若 R^n 的一个基 $\alpha_1, \alpha_2, \dots, \alpha_n$ 是一个正交向量组, 则称它们是 R^n 的一个正交基, 进一步, 如果 $\alpha_1, \alpha_2, \dots, \alpha_n$ 是标准正交向量组, 则称它们是 R^n 的一个标准正交基.

对给定的 n 维向量空间 R^n 的一组基 $\alpha_1, \alpha_2, \dots, \alpha_n$, 可以利用上述施密特正交化方法得到 R^n 的一组正交基, 再利用单位化得到 R^n 的一组标准正交基.

思考题二

1. 线性无关的向量组一定正交吗? 请举一个例子.
2. 任何一个向量组都可以正交化吗? 对向量组施密特正交化时, 可以先单位化再正交化吗? 与先正交化再单位化有何区别?
3. 设 $\alpha, \beta, \gamma \in R^n$, 判断下列给出的是向量还是数量? 那个无意义?

- | | | |
|--|---|--|
| (1) $\langle \alpha, \beta \rangle \gamma$; | (2) $\langle \alpha, \beta \rangle \langle \gamma, \alpha \rangle$; | (3) $\langle \alpha, \beta \rangle \gamma + \beta$; |
| (4) $\ \langle \alpha, \beta \rangle\ $; | (5) $\frac{1}{\langle \alpha, \beta \rangle}(\alpha + \gamma)$; | (6) $\langle \alpha, \frac{\beta}{\ \beta\ } \rangle \gamma$; |
| (7) $\langle \alpha, \beta \rangle + \gamma$; | (8) $\alpha - \langle \frac{\alpha}{\ \alpha\ }, \beta \rangle \frac{\gamma}{\ \gamma\ }$; | (9) $\langle \langle \alpha, \beta \rangle \alpha, \gamma \rangle$. |

第三节 线性方程组的解空间

一、齐次线性方程组的基础解系

齐次方程组 $AX = \theta$ 的解向量集合记作

$$X_A = \{ X \mid X \in R^n, AX = \theta \} \quad (5.12)$$

由于 $\tilde{A} = (A:0)$, 故恒有 $\tilde{r} = r(\tilde{A}) = r(A) = r$, 也就是说, 齐次方程组必定有解, 因此解集 X_A 非空, 对于解集 X_A 的秩, 有如下的重要定理:

定理 5 对于 n 元齐次线性方程组 $AX = \theta$, 系数矩阵的秩和解集的秩满足

$$r(A) + r(X_A) = n. \quad (5.13)$$

证明 设 $r(\mathbf{A}) = r (r \leq n)$, 不失一般性假设齐次方程组 $\mathbf{A}\mathbf{X} = \mathbf{0}$ 经同解变形得到如下最简形式 (即系数矩阵的行最简形所对应的方程组):

$$\begin{cases} x_1 + d_{1,r+1}x_{r+1} + \cdots + d_{1n}x_n = 0 \\ \vdots \\ x_r + d_{r,r+1}x_{r+1} + \cdots + d_{rn}x_n = 0 \end{cases}$$

此方程组有 r 个方程独立, 有 $n-r$ 个自由未知量可以转化为自由参数, 移项并补齐得:

$$\begin{cases} x_1 = -d_{1,r+1}x_{r+1} - \cdots - d_{1n}x_n \\ \vdots \\ x_r = -d_{r,r+1}x_{r+1} - \cdots - d_{rn}x_n \\ x_{r+1} = x_{r+1} \\ \vdots \\ x_n = x_n \end{cases}$$

把上式写成向量形式为:

$$\begin{pmatrix} x_1 \\ \vdots \\ x_r \\ x_{r+1} \\ \vdots \\ x_n \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} -d_{1,r+1} \\ \vdots \\ -d_{r,r+1} \\ 1 \\ \vdots \\ 0 \end{pmatrix} x_{r+1} + \cdots + \begin{pmatrix} -d_{1n} \\ \vdots \\ -d_{rn} \\ 0 \\ \vdots \\ 1 \end{pmatrix} x_n,$$

把自由变元记为自由参数, 就得到方程组的通解:

$$\begin{pmatrix} x_1 \\ \vdots \\ x_r \\ x_{r+1} \\ \vdots \\ x_n \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} -d_{1,r+1} \\ \vdots \\ -d_{r,r+1} \\ 1 \\ \vdots \\ 0 \end{pmatrix} t_1 + \cdots + \begin{pmatrix} -d_{1n} \\ \vdots \\ -d_{rn} \\ 0 \\ \vdots \\ 1 \end{pmatrix} t_{n-r}, \quad \begin{matrix} t_i \in R \\ (i=1, \cdots, n-r) \end{matrix}$$

可记作:

$$\mathbf{X} = t_1 \xi_1 + \cdots + t_{n-r} \xi_{n-r}, \quad t_i \in R, (i=1, \cdots, n-r), \quad (5.14)$$

式中的向量组 ξ_1, \cdots, ξ_{n-r} 显然线性无关 (这只要看它们的后 $n-r$ 个分量就清楚了); 同时,

(5.14) 式表明方程组所有的解都可以由 ξ_1, \cdots, ξ_{n-r} 线性表示, 故这组向量就是解集 \mathbf{X}_A 的一个极大无关组, 因此 $r(\mathbf{X}_A) = n-r = n-r(\mathbf{A})$, 即 (5.13) 成立。

定义 13 齐次线性方程组 $\mathbf{A}\mathbf{X} = \mathbf{0}$ 的解集 \mathbf{X}_A 的一个极大无关组 ξ_1, \cdots, ξ_{n-r} , 称为

$AX=0$ 的一个基础解系。(5.14) 为该方程组的一般通解形式。

X_A 也可以表示为基础解系的线性组合的形式:

$$X_A = \{x = t_1 \xi_1 + \cdots + t_{n-r} \xi_{n-r} \mid t_i \in R, i = 1, \cdots, n-r\}. \quad (5.15)$$

特别若 $r = n$, 方程组只有唯一零解, 从而 $X_A = \{0\}$ 。此时 $AX=0$ 没有基础解系,

因此 $r(X_A) = 0$, 亦满足 $r(X_A) + r(A) = n$ 。

例 9 解齐次线性方程组
$$\begin{cases} x_1 + 2x_2 + x_3 + x_4 + x_5 = 0, \\ 2x_1 + 4x_2 + 3x_3 + x_4 + x_5 = 0, \\ -x_1 - 2x_2 + x_3 + 3x_4 - 3x_5 = 0. \end{cases}$$

解 对系数矩阵作行初等变换:

$$A = \begin{pmatrix} 1 & 2 & 1 & 1 & 1 \\ 2 & 4 & 3 & 1 & 1 \\ -1 & -2 & 1 & 3 & -3 \end{pmatrix} \rightarrow \begin{pmatrix} 1 & 2 & 1 & 1 & 1 \\ 0 & 0 & 1 & -1 & -1 \\ 0 & 0 & 0 & 1 & 0 \end{pmatrix} \rightarrow \begin{pmatrix} 1 & 2 & 0 & 0 & 2 \\ 0 & 0 & 1 & 0 & -1 \\ 0 & 0 & 0 & 1 & 0 \end{pmatrix},$$

由行阶梯形知 $r(A) = 3$, 而 $n = 5$, 故方程组有非零解, 且其通解中应含有 $n - r = 2$ 个自由参数, 即基础解系应含 2 个非零解向量。再由行最简形, 经还原、移项、补齐, 可求出基础解系, 过程为

$$\begin{aligned} A \rightarrow \cdots \rightarrow \begin{pmatrix} 1 & 2 & 0 & 0 & 2 \\ 0 & 0 & 1 & 0 & -1 \\ 0 & 0 & 0 & 1 & 0 \end{pmatrix} &\Rightarrow \begin{cases} x_1 + 2x_2 + 2x_5 = 0 \\ x_3 - x_5 = 0 \\ x_4 = 0 \end{cases} \Rightarrow \\ \Rightarrow \begin{cases} x_1 = -2x_2 - 2x_5 \\ x_2 = x_2 \\ x_3 = x_5 \\ x_4 = 0 \\ x_5 = x_5 \end{cases} &\Rightarrow \begin{pmatrix} x_1 \\ x_2 \\ x_3 \\ x_4 \\ x_5 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} -2 \\ 1 \\ 0 \\ 0 \\ 0 \end{pmatrix} t_1 + \begin{pmatrix} -2 \\ 0 \\ 1 \\ 0 \\ 1 \end{pmatrix} t_2 \quad (t_1, t_2 \in R). \end{aligned}$$

这里 $\xi_1 = (-2, 1, 0, 0, 0)^T$, $\xi_2 = (-2, 0, 1, 0, 0)^T$ 为一基础解系。

二、齐次线性方程组的解空间

对 $m \times n$ 齐次线性方程组 $AX=0$, 它的解集记作

$$X_A = \{X \mid X \in R^n, AX=0\} \quad (5.16)$$

对于齐次线性方程组 $AX=0$, 其解具有如下性质:

性质 1 若 $AX_1=0$, $AX_2=0$, 则 $A(X_1+X_2)=0$.

性质 2 若 $AX_1=0$ ($k \neq 0$), 则 $A(kX_1)=0$.

由性质 1、2, 根据向量空间的定义, 易知 X_A 构成一个向量空间, 称它为方程组 $AX = 0$ 的解空间。当 $r(A) = r$ 时, 解空间 X_A 的维数为 $n - r$, 它的一组基础解系 ξ_1, \dots, ξ_{n-r} 即为解空间的一组基。

例 10 设 $\alpha_1, \alpha_2, \alpha_3$ 是齐次方程组 $AX = 0$ 的解空间 X_A 的一组基, 令 $\beta_1 = \alpha_1 + \alpha_2$, $\beta_2 = \alpha_2 + \alpha_3$, $\beta_3 = \alpha_3 + \alpha_1$, 问 $\beta_1, \beta_2, \beta_3$ 能否也能作为 X_A 的一组基?

解 方程组 $AX = 0$ 的解空间 X_A 的一组基 $\alpha_1, \alpha_2, \alpha_3$ 也就是方程组的一组基础解系, 由于 $A\beta_1 = A(\alpha_1 + \alpha_2) = A\alpha_1 + A\alpha_2 = 0 + 0 = 0$, 同理有 $A\beta_2 = 0$ 、 $A\beta_3 = 0$, 故 $\beta_1, \beta_2, \beta_3$ 也属于 X_A 。又因 $\alpha_1, \alpha_2, \alpha_3$ 线性无关, 易知 $\beta_1, \beta_2, \beta_3$ 也线性无关, 再由 $\alpha_1, \alpha_2, \alpha_3$ 为 X_A 的一组基知 $r(X_A) = 3$, 故 $\beta_1, \beta_2, \beta_3$ 也是 X_A 的一组基, 从而也可作为 $AX = 0$ 的一组基础解系。

三、非齐次线性方程组的解集

非齐次线性方程组 $AX = \beta$ 有解时, 将它的所有解向量构成的集合记作

$$X_{\bar{A}} = \{X \mid X \in \mathbb{R}^n, AX = \beta\} \quad (5.17)$$

称为这个非齐次方程组的解集。下面来讨论它的结构。

非齐次方程组 $AX = \beta$ ($\beta \neq 0$) 对应的齐次方程组 $AX = 0$ 常常被称为它的导出方程组 (简称导出组)。

性质 1 若 $AX_1 = \beta$, $AX_2 = \beta$, 则 $A(X_1 - X_2) = 0$;

性质 2 若 $AX_1 = \beta$, $AX = 0$, 则 $A(X_1 + X) = \beta$ 。

定理 6 设 $m \times n$ 线性方程组 $AX = \beta$ 有解, 若导出组 $AX = 0$ 的基础解系为 ξ_1, \dots, ξ_{n-r} , 而 η 是 $AX = \beta$ 的一特解, 则 $AX = \beta$ 的通解为

$$X = \eta + t_1 \xi_1 + \dots + t_{n-r} \xi_{n-r} \quad (t_i \in \mathbb{R}, i = 1, \dots, n-r) \quad (5.18)$$

证明 首先由(5.18)式, 易知向量 X 满足方程组, 即有:

$$AX = A(\eta + \sum_{i=1}^{n-r} t_i \xi_i) = A\eta + \sum_{i=1}^{n-r} t_i (A\xi_i) = \beta + \sum_{i=1}^{n-r} t_i 0 = \beta;$$

其次设 X 为 $AX = \beta$ 的任一解, 则 $X - \eta$ 为 $AX = 0$ 的解, 故可由基础解系表示为

$X - \eta = t_1 \xi_1 + \cdots + t_{n-r} \xi_{n-r}$, 移项便得(5.5)式。特别地, 若 $r(\tilde{A}) = r(A) = n$, 则 $AX = \beta$ 的

导出组 $AX = 0$ 只有唯一零解, 故 $AX = \beta$ 也只有唯一解 $X = \eta + 0 = \eta$ 。

例 11 求解线性方程组
$$\begin{cases} x_1 & -2x_2 & +3x_3 & -x_4 & =1 & , \\ 3x_1 & -x_2 & +5x_3 & -3x_4 & =2 & , \\ 2x_1 & +x_2 & +2x_3 & -2x_4 & =1 & . \end{cases}$$

解 方程组增广矩阵经初等行变换化为行最简型:

$$\tilde{A} = \left(\begin{array}{cc|cc} 1 & -2 & 3 & -1 & 1 \\ 3 & -1 & 5 & -3 & 2 \\ 2 & 1 & 2 & -2 & 1 \end{array} \right) \rightarrow \cdots \rightarrow \left(\begin{array}{cc|cc} 1 & 0 & \frac{7}{5} & -1 & \frac{3}{5} \\ 0 & 1 & -\frac{4}{5} & 0 & -\frac{1}{5} \\ 0 & 0 & 0 & 0 & 0 \end{array} \right),$$

因为 $r(A) = r(\tilde{A}) = 2 < n = 4$, 所以该方程组有无穷多解。选定 x_3, x_4 为自由未知量并将其移到右边, 则可将原方程组化为同解的方程组:

$$\begin{cases} x_1 = \frac{3}{5} - \frac{7}{5}x_3 - x_4, \\ x_2 = -\frac{1}{5} + \frac{4}{5}x_3 + 0x_4, \\ x_3 = 0 + x_3 + 0x_4, \\ x_4 = 0 + 0x_3 + x_4. \end{cases}$$

因此得到通解式:
$$\begin{pmatrix} x_1 \\ x_2 \\ x_3 \\ x_4 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} \frac{3}{5} \\ -\frac{1}{5} \\ 0 \\ 0 \end{pmatrix} + \begin{pmatrix} -\frac{7}{5} \\ \frac{4}{5} \\ 1 \\ 0 \end{pmatrix} t_1 + \begin{pmatrix} 1 \\ 0 \\ 0 \\ 1 \end{pmatrix} t_2, \text{ 其中 } t_1, t_2 \text{ 为任意实数。}$$

例 12 求解线性方程组
$$\begin{cases} x_1 - x_2 + 2x_3 + x_4 = 1, \\ 2x_1 - x_2 + x_3 + 2x_4 = 3, \\ x_1 - x_3 + x_4 = 2, \\ 3x_1 - x_2 + 3x_4 = 5. \end{cases}$$

解 对增广矩阵施行初等行变换, 化为行阶梯形:

$$B = (A | \beta) = \left(\begin{array}{cccc|c} 1 & -1 & 2 & 1 & 1 \\ 2 & -1 & 1 & 2 & 3 \\ 1 & 0 & -1 & 1 & 2 \\ 3 & -1 & 0 & 3 & 5 \end{array} \right) \xrightarrow{r} \left(\begin{array}{cccc|c} 1 & -1 & 2 & 1 & 1 \\ 0 & 1 & -3 & 0 & 1 \\ 0 & 0 & 0 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 0 & 0 \end{array} \right),$$

则 $R(A) = R(B) = 2 < 4$ ，方程组有无穷多解. 对增广矩阵施行初等行变换，化为行最简形：

$$B = (A | \beta) \xrightarrow{r} \begin{pmatrix} 1 & 0 & -1 & 1 & \vdots & 2 \\ 0 & 1 & -3 & 0 & \vdots & 1 \\ 0 & 0 & 0 & 0 & \vdots & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 0 & \vdots & 0 \end{pmatrix},$$

得对应方程组： $\begin{cases} x_1 = 2 + x_3 - x_4, \\ x_2 = 1 + 3x_3, \end{cases}$ 其中选 x_3, x_4 为自由变量.

下面求方程组的通解.

方法一：令 $x_3 = c_1, x_4 = c_2$ ，得方程组的通解

$$X = \begin{pmatrix} 2 \\ 1 \\ 0 \\ 0 \end{pmatrix} + c_1 \begin{pmatrix} 1 \\ 3 \\ 1 \\ 0 \end{pmatrix} + c_2 \begin{pmatrix} -1 \\ 0 \\ 0 \\ 1 \end{pmatrix},$$

其中 $\xi_1 = (1, 3, 1, 0)^T$ ， $\xi_2 = (-1, 0, 0, 1)^T$ 为导出组的一个基础解系， $\eta^* = (2, 1, 0, 0)^T$ 为方程组的特解， c_1, c_2 为任意常数.

方法二：先令 $\begin{pmatrix} x_3 \\ x_4 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 0 \\ 0 \end{pmatrix}$ ，得原方程组的一个特解为 $\eta^* = (2, 1, 0, 0)^T$ ；齐次由导出组的

解为（只要令方程组的解中的常数项为零）

$$\begin{cases} x_1 = x_3 - x_4, \\ x_2 = 3x_3, \end{cases}$$

其中 x_3, x_4 为自由变量. 分别令 $\begin{pmatrix} x_3 \\ x_4 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 1 \\ 0 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 0 \\ 1 \end{pmatrix}$ ，得导出组的一个基础解系为

$$\xi_1 = (1, 3, 1, 0)^T, \quad \xi_2 = (-1, 0, 0, 1)^T.$$

则方程组的通解为 $X = \eta^* + c_1 \xi_1 + c_2 \xi_2$ ，其中 c_1, c_2 为任意常数.

例 13 设线性方程组为 $\begin{cases} x_1 + 2x_2 - x_3 - 2x_4 = 0, \\ 2x_1 - x_2 - x_3 + x_4 = 1, \\ 3x_1 + x_2 - 2x_3 - x_4 = a. \end{cases}$ 试确定 a 的值，使方程组有解；

并求其全部解.

解 对增广矩阵施行初等行变换，化为行阶梯形：

$$B = (A | \beta) = \begin{pmatrix} 1 & 2 & -1 & -2 & \vdots & 0 \\ 2 & -1 & -1 & 1 & \vdots & 1 \\ 3 & 1 & -2 & -1 & \vdots & a \end{pmatrix} \xrightarrow{r} \begin{pmatrix} 1 & 2 & -1 & -2 & \vdots & 0 \\ 0 & -5 & 1 & 5 & \vdots & 1 \\ 0 & 0 & 0 & 0 & \vdots & a-1 \end{pmatrix},$$

要使方程组有解, 则 $R(B) = R(A) = 2$, 因此当 $a=1$ 时, 方程组有无穷多解.

当 $a=1$ 时,

$$B = (A | \beta) \xrightarrow{r} \begin{pmatrix} 1 & 2 & -1 & -2 & \vdots & 0 \\ 0 & -5 & 1 & 5 & \vdots & 1 \\ 0 & 0 & 0 & 0 & \vdots & 0 \end{pmatrix} \xrightarrow{r} \begin{pmatrix} 1 & -3 & 0 & 3 & \vdots & 1 \\ 0 & -5 & 1 & 5 & \vdots & 1 \\ 0 & 0 & 0 & 0 & \vdots & 0 \end{pmatrix},$$

对应方程组可化为 $\begin{cases} x_1 = 1 + 3x_2 - 3x_4, \\ x_3 = 1 + 5x_2 - 5x_4, \end{cases}$ 其中 x_2, x_4 为自由变量. 令 $x_2 = c_1, x_4 = c_2$, 得方

程组的通解为

$$X = (1, 0, 1, 0)^T + c_1(3, 1, 5, 0)^T + c_2(-3, 0, -5, 1)^T, \text{ 其中 } c_1, c_2 \text{ 为任意常数.}$$

例 14 已知 3 元非齐次线性方程组 $AX = \beta$ 的系数矩阵 A 的秩为 2, η_1, η_2, η_3 是它的

三个解, 其中 $\eta_1 = (2, 3, 4)^T$, $\eta_2 + \eta_3 = (1, 2, 3)^T$, 求 $AX = \beta$ 的通解.

解 由已知条件有 $A\eta_1 = \beta$, $A(\eta_2 + \eta_3) = 2\beta$, 记 $2\eta_1 - \eta_2 - \eta_3 = \xi$, 易见

$$\xi = \begin{pmatrix} 3 \\ 4 \\ 5 \end{pmatrix} \neq 0, \text{ 故 } \xi \text{ 线性无关. 由于}$$

$$A\xi = A(2\eta_1 - \eta_2 - \eta_3) = 2A\eta_1 - A(\eta_2 + \eta_3) = 2\beta - 2\beta = 0,$$

知 ξ 是导出组 $AX = 0$ 的解, 再由已知条件知, $n - r = 3 - 2 = 1$, 故 ξ 可作 $AX = 0$

的基础解系, 于是 $AX = \beta$ 的通解可表为

$$X = \eta_1 + t\xi = \eta_1 + t(2\eta_1 - \eta_2 - \eta_3) = \begin{pmatrix} 2 \\ 3 \\ 4 \end{pmatrix} + t \begin{pmatrix} 3 \\ 4 \\ 5 \end{pmatrix}.$$

思考题三

1. 齐次线性方程组的基础解系为什么不唯一?
2. 齐次线性方程组有无穷多组解时的表示形式有哪些?
3. 非齐次线性方程组有无穷多组解时的表示形式为什么不唯一? 经常使用的形式为

何?

4. 非齐次线性方程组的解集与对应导出组的解集有相同的秩吗? 为什么?

5. 齐次线性方程组 $AX = 0$ 解的全体 $\{X \mid AX = 0\}$ 构成向量空间, 那么非齐次线性方程组 $AX = \beta$ 解的全体 $\{X \mid AX = \beta\}$ 是否构成向量空间?

6. 设非齐次线性方程组 $A_{m \times n} X_{n \times 1} = \beta_{m \times 1}$, 对应齐次线性方程组 $A_{m \times n} X_{n \times 1} = 0_{m \times 1}$, 下面结论是否正确?

(1) 若 $A_{m \times n} X_{n \times 1} = \beta_{m \times 1}$ 有无穷多解, 则 $A_{m \times n} X_{n \times 1} = 0_{m \times 1}$, 有非零解;

(2) 若 $A_{m \times n} X_{n \times 1} = \beta_{m \times 1}$ 有唯一解, 则 $A_{m \times n} X_{n \times 1} = 0_{m \times 1}$, 只有零解;

(3) 若 $A_{m \times n} X_{n \times 1} = 0_{m \times 1}$, 有非零解, 则 $A_{m \times n} X_{n \times 1} = \beta_{m \times 1}$ 有无穷多解;

(4) 若 $A_{m \times n} X_{n \times 1} = 0_{m \times 1}$, 只有零解, 则 $A_{m \times n} X_{n \times 1} = \beta_{m \times 1}$ 有唯一解.

习 题 五

(A)

1. 证明 $V = \{(x, y)^T \mid x^2 + y^2 \leq 1, x, y \in R\}$ 不是 R^2 的一个子空间.

2. 证明: 等价的两个向量组生成同一个向量空间.

3. 设 $\alpha_1 = \begin{pmatrix} 3 \\ 6 \\ 2 \end{pmatrix}, \alpha_2 = \begin{pmatrix} -1 \\ 0 \\ 1 \end{pmatrix}, \beta = \begin{pmatrix} 3 \\ 12 \\ 7 \end{pmatrix}$, 问向量 β 是否属于向量空间 $Span(\alpha_1, \alpha_2)$? 如果

是, 求 β 在基 α_1, α_2 下的坐标.

4. 设 $\alpha_1 = \begin{pmatrix} 1 \\ -3 \\ 2 \\ -4 \end{pmatrix}, \alpha_2 = \begin{pmatrix} -3 \\ 9 \\ -6 \\ 12 \end{pmatrix}, \alpha_3 = \begin{pmatrix} 2 \\ -1 \\ 4 \\ 2 \end{pmatrix}, \alpha_4 = \begin{pmatrix} -4 \\ 5 \\ -3 \\ 7 \end{pmatrix}$, 求由该向量组生成的子空间

$Span(\alpha_1, \alpha_2, \alpha_3, \alpha_4)$ 的一组基和该子空间的维数. 若向量 $\beta = \begin{pmatrix} -1 \\ 1 \\ 3 \\ 5 \end{pmatrix}$, 求向量 β 在此组基下

的坐标.

5. 设 $\alpha_1 = (1, 0, -1)^T, \alpha_2 = (2, 1, 0)^T, \alpha_3 = (1, 1, 0)^T$, 证明向量组 $\alpha_1, \alpha_2, \alpha_3$ 是 \mathbf{R}^3 的一组基, 并求向量 $\beta = (5, 2, -2)^T$ 在这组基下的坐标.

6*. 在 \mathbf{R}^3 中取两组基: $\alpha_1 = (1, 2, 1)^T, \alpha_2 = (2, 3, 3)^T, \alpha_3 = (3, 7, 1)^T$, 和 $\beta_1 = (3, 1, 4)^T, \beta_2 = (5, 2, 1)^T, \beta_3 = (1, 1, -6)^T$.

- (1) 求由基 $\alpha_1, \alpha_2, \alpha_3$ 到基 $\beta_1, \beta_2, \beta_3$ 的过渡矩阵.
- (2) 若向量 γ 在基 $\beta_1, \beta_2, \beta_3$ 下的坐标为 $(1, 1, 1)$, 求向量 γ 在基 $\alpha_1, \alpha_2, \alpha_3$ 下的坐标.

7*. 设 $\alpha_1, \alpha_2, \alpha_3$ 和 $\beta_1, \beta_2, \beta_3$ 是向量空间 V 的两组基, 且

$$\beta_1 = 2\alpha_1 - \alpha_2 + \alpha_3, \beta_2 = 3\alpha_2 + \alpha_3, \beta_3 = -3\alpha_1 + 2\alpha_3.$$

- (1) 求由基 $\alpha_1, \alpha_2, \alpha_3$ 到基 $\beta_1, \beta_2, \beta_3$ 的过渡矩阵.
- (2) 对 $\gamma = \beta_1 - 2\beta_2 + 2\beta_3$, 求 γ 在基 $\alpha_1, \alpha_2, \alpha_3$ 下的坐标.

8. 设向量 $\alpha = (1, 1, 0, -1)^T$ 与 $\beta = (1, k, 1, 0)^T$ 的夹角为 45° , 求 k .

9. 将下列向量组正交规范化:

$$(1) \alpha_1 = \begin{pmatrix} 1 \\ 1 \\ 1 \end{pmatrix}, \alpha_2 = \begin{pmatrix} 1 \\ 2 \\ 3 \end{pmatrix}, \alpha_3 = \begin{pmatrix} 1 \\ 4 \\ 9 \end{pmatrix};$$

$$(2) \alpha_1 = \begin{pmatrix} 1 \\ 0 \\ -1 \\ 1 \end{pmatrix}, \alpha_2 = \begin{pmatrix} 1 \\ -1 \\ 0 \\ 1 \end{pmatrix}, \alpha_3 = \begin{pmatrix} -1 \\ 1 \\ 1 \\ 0 \end{pmatrix}.$$

10. 已知 $\alpha = (1, 2, -1, 1)^T, \beta = (2, 3, 1, -1)^T, \gamma = (-1, -1, -2, 2)^T$, 求:

- (1) 内积 $\langle \alpha, \beta \rangle$ 、 $\langle \alpha, \gamma \rangle$;
- (2) 向量 α, β, γ 的范数;
- (3) 与 α, β, γ 都正交的所有向量.

11. 设 $A = \begin{pmatrix} 2 & 1 & -1 & 1 & -3 \\ 1 & 1 & 1 & 0 & 1 \\ -3 & -2 & 0 & 1 & -2 \end{pmatrix}$, 并设 X_A 为齐次线性方程组 $AX = 0$ 的解空间,

试求 X_A 的维数及其一组正交基.

12. 已知 $\alpha_1 = (1, 1, 1, 1)^T$, 试由它出发构造 R^4 的一组规范正交基. 这样的基唯一吗?

13. 求下列齐次线性方程组的基础解系和通解:

$$(1) \begin{cases} x_1 + x_2 + x_3 = 0, \\ x_2 + x_3 = 0, \\ x_1 + 2x_2 + 2x_3 = 0. \end{cases}$$

$$(2) \begin{cases} x_1 + x_2 - x_3 + x_4 = 0, \\ x_1 - x_2 + 2x_3 - x_4 = 0, \\ 3x_1 + x_2 + x_4 = 0. \end{cases}$$

$$(3) \begin{cases} x_1 - x_2 + x_3 + x_4 = 0, \\ x_1 - x_2 - x_3 + 3x_4 = 0, \\ x_1 - x_2 - 2x_3 + 4x_4 = 0. \end{cases}$$

$$(4) \begin{cases} x_1 + 2x_2 + x_3 - x_4 = 0 \\ 3x_1 + 6x_2 - x_3 - 3x_4 = 0 \\ 5x_1 + 10x_2 + x_3 - 5x_4 = 0 \end{cases}$$

14. 选择 p, q 的值使下列线性方程组有解, 并求其解:

$$(1) \begin{cases} px_1 + x_2 + x_3 = 1 \\ x_1 + px_2 + x_3 = p \\ x_1 + x_2 + px_3 = p^2 \end{cases};$$

$$(2) \begin{cases} x_1 + 2x_2 - 2x_3 + 2x_4 = 2 \\ x_2 - x_3 - x_4 = 1 \\ x_1 + x_2 - x_3 + 3x_4 = p \\ x_1 - x_2 + x_3 + 5x_4 = q \end{cases};$$

$$(3) \begin{cases} (2-p)x + 2y - 2z = 1 \\ 2x + (5-p)y - 4z = 2 \\ -2x - 4y + (5-p)z = -p-1 \end{cases};$$

$$(4) \begin{cases} px + qy + 2z = 1 \\ (q-1)y + z = 0 \\ px + qy + (1-q)z = 3-2q \end{cases}.$$

15. 设五元线性方程组为

$$\begin{cases} x_1 - x_2 = a_1 \\ x_2 - x_3 = a_2 \\ x_3 - x_4 = a_3 \\ x_4 - x_5 = a_4 \\ -x_1 + x_5 = a_5 \end{cases},$$

证明: 此方程组有解当且仅当 $\sum_{i=1}^5 a_i = 0$; 在此条件下, 求其通解.

16. 设三元非齐次线性方程组 $AX = \beta$, 其中矩阵 A 的秩为 2, 且

$$\eta_1 = (1, 2, 2)^T, \eta_2 = (3, 2, 1)^T$$

是方程组的两个特解, 试求此方程组的全部解.

17. 求一个齐次线性方程组, 使它的基础解系为

$$\xi_1 = (0, 1, 2, 3)^T, \xi_2 = (3, 2, 1, 0)^T.$$

18. 设 4 元非齐次线性方程组的系数矩阵的秩为 3, 已知 η_1, η_2, η_3 是其三个解, 且有

$$\eta_1 = \begin{pmatrix} 2 \\ 3 \\ 4 \\ 5 \end{pmatrix}, \eta_2 + \eta_3 = \begin{pmatrix} 1 \\ 2 \\ 3 \\ 4 \end{pmatrix}, \text{ 求该方程组的通解.}$$

19. 已知 ξ_1, ξ_2, ξ_3 是齐次线性方程组 $AX = 0$ 的一组基础解系, 记 $\eta_1 = \xi_1 - \xi_2$,

$\eta_2 = 2\xi_2 + \xi_3$, $\eta_3 = -\xi_3 + 3\xi_1$, 问 η_1, η_2, η_3 是否也可以作为 $AX = 0$ 的基础解系?

20. 设 A 是 $m \times s$ 矩阵, B 是 $s \times n$ 矩阵, x 是 n 维列向量. 证明: 若齐次方程组 $(AB)X = 0$ 与 $BX = 0$ 同解, 则有 $r(AB) = r(B)$.

(B)

1. 设 $V_1 = \{X = (x_1, x_2, x_3) \mid x_i \in \mathbf{R}, x_1 + x_2 = x_3\}$;

$$V_2 = \{X = (x_1, x_2, x_3) \mid x_i \in \mathbf{R}, x_1 \times x_2 = x_3\};$$

问 V_1 、 V_2 关于 \mathbf{R}^3 中的向量线性运算是否构成向量空间?

2. 设 $\alpha_1 = \begin{pmatrix} 2 \\ 1 \\ -2 \end{pmatrix}, \alpha_2 = \begin{pmatrix} 0 \\ 3 \\ 1 \end{pmatrix}, \alpha_3 = \begin{pmatrix} 0 \\ 0 \\ k-2 \end{pmatrix}$ 是 \mathbf{R}^3 的基, 则 k _____.

3. 设 $\alpha_1, \alpha_2, \alpha_3, \alpha_4 \in \mathbf{R}^n$, 由它们生成空间 V , 则 V 的维数是 ().

(A) $= 4$; (B) $= n$; (C) ≤ 4 ; (D) ≥ 4 .

4. 设 $\alpha \in \mathbf{R}^n$, 则 α 与任意 n 维向量都正交的充要条件是 $\|\alpha\| =$ ().

(A) 1; (B) 0; (C) -1; (D) ∞ .

5. 设 $\alpha, \beta, \gamma \in \mathbf{R}^n$, 则 () 是向量.

(A) $\langle \alpha, \beta \rangle \beta + \gamma$; (B) $\gamma + \langle \alpha, \beta \rangle$; (C) $\langle \frac{\alpha}{\|\alpha\|}, \frac{\beta}{\|\beta\|} \rangle$; (D) $\langle \langle \alpha, \beta \rangle \beta, \gamma \rangle$.

6. 设 $\alpha, \beta \in \mathbf{R}^n$, 则 $G(\alpha, \beta) = \begin{vmatrix} \langle \alpha, \alpha \rangle & \langle \alpha, \beta \rangle \\ \langle \beta, \alpha \rangle & \langle \beta, \beta \rangle \end{vmatrix} = 0$ 是 α, β 线性相关的 () 条件.

(A) 必要; (B) 充分; (C) 充要; (D) 既不充分也不必要。

7. 设矩阵 $A = \begin{pmatrix} 1 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & 0 \\ 3 & 1 & 2 \end{pmatrix}$, 求所有与矩阵 A 可交换的矩阵全体所构成的子空间的维数和一组基。

8. 设向量组 $\alpha_1, \alpha_2, \alpha_3$ 是 R^3 的一组基, 且 $\beta_1 = \alpha_1 + \alpha_2, \beta_2 = \alpha_2 + \alpha_3, \beta_3 = \alpha_3 + \alpha_1$ 。

(1) 证明 $\beta_1, \beta_2, \beta_3$ 是 R^3 的一组基。

(2) 求由基 $\alpha_1, \alpha_2, \alpha_3$ 到基 $\beta_1, \beta_2, \beta_3$ 的过渡矩阵。

(3) 若向量 γ 在基 $\alpha_1, \alpha_2, \alpha_3$ 下的坐标为 $(1, 0, 0)$, 求向量 γ 在基 $\beta_1, \beta_2, \beta_3$ 下的坐标。

9. 设 $AX = \beta$ 为非齐次线性方程组, $AX = 0$ 为其导出组。下列命题正确的有 ()。

(1) 若 $AX = 0$ 有非零解, 则 $AX = \beta$ 有无穷多解。

(2) 若 $AX = \beta$ 有无穷多解, 则 $AX = 0$ 必有非零解。

(3) 若 $AX = 0$ 只有唯一零解, 则 $AX = \beta$ 只有唯一解。

(4) 若 $AX = \beta$ 只有唯一解, 则 $AX = 0$ 只有零解。

(5) 若 $AX = \beta$ 无解, 则 $AX = 0$ 也无解。

10. 设 $AX = \beta$ ($\beta \neq 0$) 为 $m \times n$ 方程组, $r(A) = r(A | \beta) = r < n$, 且已知 ξ_1, ξ_2 是

$AX = \beta$ 的两个不同解, η 是导出组 $AX = 0$ 的解, 则下列命题正确的有 ()。

(1) $\xi_1 + \xi_2$ 是 $AX = \beta$ 的解; (2) $\forall k \in R, k(\xi_1 - \xi_2) + \xi_1$ 是 $AX = \beta$ 的解;

(3) $\eta + \xi_1$ 是 $AX = \beta$ 的解; (4) $\forall k \in R, \frac{1}{2}(\xi_1 + \xi_2) + k\eta$ 是 $AX = \beta$ 的解。

(5) $\forall k_1, k_2 \in R, k_1(\xi_1 - \xi_2) + k_2\eta$ 是 $AX = \theta$ 的解;

11. n 阶矩阵 A 可逆当且仅当 ()。

(1) $\exists n$ 阶矩阵 B , 使 $AB = BA = E$ 成立; (2) $|A| \neq 0$;

(3) $r(A) = n$; (4) A 的列 (行) 秩为 n ;

(5) A 的 n 列 (行) 线性无关; (6) A 的最大非零子式为 $|A|$;

(7) $AX = 0$ 只有零解 ($r(X_A) = 0$); (8) $\forall b, AX = b$ 均有唯一解;

(9) $\forall n$ 阶矩阵 B, C , $AB = AC$ 当且仅当 $B = C$;

(10) A 可表为若干初等阵之积; (11) A 等价于同阶单位阵 E_n ;

12、设 $\alpha = \begin{pmatrix} a_1 \\ a_2 \\ a_3 \end{pmatrix}, \beta = \begin{pmatrix} b_1 \\ b_2 \\ b_3 \end{pmatrix}, \gamma = \begin{pmatrix} c_1 \\ c_2 \\ c_3 \end{pmatrix}$, 其中 $a_i, b_i (i = 1, 2, 3)$ 全不为零。则三条直线

$l_i : a_i x + b_i y + c_i = 0 (i = 1, 2, 3)$ 交于一点的充要条件为 ()。

(A) α, β, γ 线性相关; (B) α, β, γ 线性无关;

(C) $r(\alpha, \beta, \gamma) = r(\alpha, \beta)$; (D) α, β, γ 线性相关, 而 α, β 线性无关。