

# Семинар 8

Алексеев Василий

31 марта + 4 апреля 2023

## Содержание

<b>1</b>	<b>Diag 1. Часть 2</b>	<b>1</b>
1.1	Инвариантность характеристического многочлена . . . . .	1
1.2	Собственные подпространства преобразования . . . . .	1
1.3	Инвариантные подпространства преобразования . . . . .	2
<b>2</b>	<b>Задачи</b>	<b>3</b>
2.1	# 24.42(1) . . . . .	3
2.2	# 24.70 . . . . .	5
2.3	# 24.55(1) . . . . .	6

# 1. Diag 1. Часть 2

## 1.1. Инвариантность характеристического многочлена

Пусть  $\phi: X \rightarrow X$  линейное преобразование вещественного линейного пространства  $X$  размерности  $n$ . Пусть в  $X$  выбран некоторый базис  $e = (e_1, \dots, e_n)$ , в котором матрица преобразования  $\phi$  есть  $A \in \mathbb{R}^{n \times n}$ . Тогда собственные значения *преобразования* (то есть все числа  $\lambda \in \mathbb{R}$ , такие что  $\phi(x) = \lambda x$  для хотя бы одного ненулевого вектора  $x$ ) можно было искать как действительные корни характеристического уравнения *матрицы* этого преобразования:

$$\det(A - \lambda E) = 0 \quad (1)$$

В этом месте стоило задаться вопросом: а корректен ли такой способ поиска собственных значений? В том смысле, не получится ли так, что у характеристического уравнения для матрицы  $A$  преобразования  $\phi$  в базисе  $e$  будут одни корни, а у характеристического уравнения для матрицы  $A'$  *того же* преобразования  $\phi$ , но уже в *другом* базисе  $e'$ , корни будут другие? Пусть “старый” и “новый” базисы связаны матрицей перехода:  $e' = eS$ ,  $S \in \mathbb{R}^{n \times n}$ ,  $\det S \neq 0$ . Тогда матрица  $A'$  в “новом” базисе  $e'$  так выражается через матрицу  $A$  в “старом” базисе  $e$ :  $A' = S^{-1}AS$ . Распишем характеристический многочлен матрицы  $A'$ :

$$\begin{aligned} \det(A' - \lambda E) &= \det(S^{-1}AS - \lambda S^{-1}S) \\ &= \det(S^{-1} \cdot (A - \lambda E) \cdot S) \\ &= \det S^{-1} \cdot \det(A - \lambda E) \cdot \det S = \det(A - \lambda E) \end{aligned}$$

То есть характеристические многочлены матриц одного и того же преобразования в разных базисах совпадают! Получается, будут одинаковыми все коэффициенты в характеристических многочленах, стоящие при  $\lambda$  в одинаковых степенях:

$$(-1)^n \lambda^n + (-1)^{n-1} \lambda^{n-1} \operatorname{Sp} A' + \dots + \det A' = (-1)^n \lambda^n + (-1)^{n-1} \lambda^{n-1} \operatorname{Sp} A + \dots + \det A$$

То есть у матриц  $A$  и  $A'$  преобразования  $\phi$  совпадают след и определитель. Эти величины являются *инвариантами*, связанными с преобразованием, то есть они не зависят от выбора базиса. А раз совпадают характеристические многочлены, то и корни характеристических уравнений матриц  $A$  и  $A'$  будут одинаковыми (вплоть до кратностей). Поэтому характеристическое уравнение *матрицы* (1) можно называть характеристическим уравнением *преобразования*.

## 1.2. Собственные подпространства преобразования

Пусть найдено собственное значение  $\lambda \in \mathbb{R}$  преобразования. Рассмотрим множество всех векторов  $L_\lambda$ , каждый из которых под действием  $\phi$  остаётся параллелен себе с коэффициентом  $\lambda$ :

$$L_\lambda = \{x \in X \mid \phi(x) = \lambda x\} \quad (2)$$

то есть  $L_\lambda$  состоит из собственных векторов, относящихся к собственному значению  $\lambda$ , а также из нулевого вектора (который по определению собственным вектором не является). Покажем, что  $L_\lambda$  *есть подпространство* в  $X$ . Пусть  $x_1, x_2 \in L_\lambda$ . Тогда для их суммы имеем:

$$\phi(x_1 + x_2) = \phi(x_1) + \phi(x_2) = \lambda x_1 + \lambda x_2 = \lambda(x_1 + x_2)$$

то есть сумма  $x_1 + x_2$  тоже вектор из  $L_\lambda$ . Аналогично  $\alpha x \in L_\lambda$ ,  $\alpha \in \mathbb{R}$ ,  $x \in L_\lambda$ . Получается,  $L_\lambda$  замкнуто относительно операций сложения векторов и умножения вектора на число, поэтому является подпространством  $X$ .

Подпространство  $L_\lambda$  называется *собственным подпространством, соответствующим собственному значению  $\lambda$* . Собственные векторы, относящиеся к  $\lambda$ , являются ненулевыми векторами  $L_\lambda$ .

Раз  $\lambda$  собственное значение, то оно будет корнем характеристического уравнения преобразования (1)<sup>1</sup>. Пусть кратность  $\lambda$  как корня есть  $p \geq 1$ . Что можно сказать о *размерности собственного подпространства  $L_\lambda$ , соответствующего  $\lambda$* ? Очевидно,  $\dim L_\lambda \geq 1$ . Также очевидно, что  $\dim L_\lambda \leq n = \dim X$ . Можно ли указать более точную верхнюю границу для  $\dim L_\lambda$ ? Допустим,  $\dim L_\lambda \equiv d > p$ . Тогда в подпространстве  $L_\lambda$  можно выбрать  $d$  линейно независимых векторов. Дополним эту систему векторов до базиса  $e'$  пространства  $X$ . Что можно сказать про матрицу  $A'$  преобразования  $\phi$  в этом базисе? Так как первые  $d$  векторов базиса  $e'$  собственные, то:

$$A' = \begin{pmatrix} \lambda & 0 & 0 & \dots & 0 & \cdot & \cdot & \dots & \cdot \\ 0 & \lambda & 0 & \dots & 0 & \cdot & \cdot & \dots & \cdot \\ 0 & 0 & \lambda & \dots & 0 & \cdot & \cdot & \dots & \cdot \\ \vdots & \vdots & \vdots & \ddots & \vdots & \vdots & \vdots & \ddots & \vdots \\ 0 & 0 & 0 & \dots & \lambda & \cdot & \cdot & \dots & \cdot \\ \vdots & \vdots & \vdots & \ddots & \vdots & \vdots & \vdots & \ddots & \vdots \\ 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & \cdot & \cdot & \dots & \cdot \end{pmatrix}$$

$\underbrace{\hspace{10em}}_d \qquad \underbrace{\hspace{10em}}_{n-d}$

Но характеристическое уравнение такой матрицы<sup>2</sup>:

$$\det(A' - lE) = (\lambda - l)^d \cdot (\dots) = 0$$

и у него  $\lambda$ , очевидно, корень кратности как минимум  $d$ . Но такого не может быть, потому что корни вплоть до кратностей инварианты, а изначальная кратность  $p$  по предположению меньше  $d$ . Поэтому верно следующее утверждение.

**Утверждение 1.1.** Пусть  $\lambda$  есть корень характеристического уравнения преобразования  $\phi$  (1) кратности  $p \geq 1$ . Тогда размерность соответствующего собственного подпространства  $L_\lambda$  не превосходит  $p$ .

### 1.3. Инвариантные подпространства преобразования

Посмотрим ещё раз на собственное подпространство  $L_\lambda$  (2). Заметим, что если  $x \in L_\lambda$ , то

$$\phi(\phi(x)) = \phi(\lambda x) = \lambda \phi(x)$$

то есть образ  $\phi(x)$  любого вектора  $x$  из  $L_\lambda$  также лежит в  $L_\lambda$ . Тогда про подпространство  $L_\lambda$  говорят, что оно является инвариантным относительно преобразования  $\phi$ .

**Определение 1.1.** Подпространство  $L'$  линейного пространства  $L$  называется *инвариантным* относительно преобразования  $\phi: L \rightarrow L$ , если  $\forall x \in L' \rightarrow \phi(x) \in L'$ . Иными словами, если  $\phi(L') \subseteq L'$ .

<sup>1</sup>Почему это верно? То есть обычно как, находим корни, и они — собственные значения. Почему верно наоборот: что если собственное значение, то обязательно корень?

<sup>2</sup>Из-за небольшой коллизии обозначений в этом месте пришлось вместо “стандартного”  $\det(A - \lambda E) = 0$  написать  $\det(A - lE) = 0$ , то есть *переменная в уравнении* есть  $l$ , потому что  $\lambda$  уже означает *некоторое собственное значение*.

Пусть вектор  $x_1$  собственный, соответствующий  $\lambda$ , то есть  $\phi(x_1) = \lambda x_1$  и  $x_1$  ненулевой. Тогда множество векторов  $L_{x_1} = \{x \in X \mid x = \alpha x_1, \alpha \in \mathbb{R}\}$ , очевидно, будет одномерным подпространством. Но оно также будет инвариантно относительно  $\phi$ :

$$\phi(\alpha x_1) = \alpha \phi(x_1) = \underbrace{\alpha \cdot \lambda}_{\beta \in \mathbb{R}} x_1 = \beta x_1$$

(то есть образ любого вектора вида  $\alpha x_1$  также лежит в  $L_{x_1}$ , более того,  $\alpha x_1$  будет собственным при  $\alpha \neq 0$ , так как  $\phi(\alpha x_1) = \alpha \cdot \lambda x_1 = \lambda \cdot \alpha x_1$ ). Итого, на каждый собственный вектор  $x_1$  преобразования натянуто одномерное инвариантное подпространство.

Есть ли какие-нибудь “другие” примеры инвариантных подпространств?

*Пример.* Для любого преобразования  $\phi: X \rightarrow X$  инвариантными будут нулевое подпространство  $\{0\}$  и всё пространство  $X$ .

*Пример.* Если  $\lambda_1$  и  $\lambda_2$  есть два различных собственных значения преобразования  $\phi$ , то инвариантной будет сумма соответствующих собственных подпространств:  $L_{\lambda_1} + L_{\lambda_2}$ .

*Пример.* Вспомним про номер, в котором рассматривается преобразование  $\phi$  геометрического трёхмерного пространства векторов  $\mathcal{L}$ , суть которого — ортогональная проекция на прямую  $\mathcal{L}_1: x = y = z$  (базис ортонормированный). Формула преобразования:  $\phi(x) = \frac{(x, a)}{|a|^2} a$ , где  $a$  есть направляющий вектор прямой  $\mathcal{L}_1$ . Матрица преобразования:  $A = \frac{1}{3} \begin{pmatrix} 1 & 1 & 1 \\ 1 & 1 & 1 \\ 1 & 1 & 1 \end{pmatrix}$ . Какие подпространства будут инвариантны относительно  $\phi$ ?

Очевидно, нулевое подпространство  $\{0\}$  и всё пространство  $\mathcal{L}$  инвариантны.

Найдутся ли одномерные инвариантные подпространства? Да — очевидно, это сама прямая  $\mathcal{L}_1$ .

Найдутся ли двумерные инвариантные подпространства? Да — очевидно, это плоскость, перпендикулярная  $\mathcal{L}_1$ . А также... любая плоскость, содержащая  $\mathcal{L}_1$ . То есть все плоскости вида  $\{t_1 a + t_2 b \mid t_1, t_2 \in \mathbb{R}\}$ , где  $b$  есть некоторый вектор, не параллельный  $a$ .

Заметим, что  $\phi(a) = 1 \cdot a$ , то есть вектор  $a$  собственный, соответствующий собственному значению  $\lambda = 1$ . И через него, как через собственный вектор, проходит одномерное инвариантное подпространство. Так и получилось: это подпространство и есть прямая  $\mathcal{L}_1$ .

## 2. Задачи

### 2.1. # 24.42(1)

Найти собственные значения и собственные векторы дифференцирования  $D: \mathcal{P}^{(n)} \rightarrow \mathcal{P}^{(n)}$  как линейного преобразования пространства многочленов степени не выше  $n$ .

*Решение.*

*Способ 1: “Из определения”.*

Ищем собственный многочлен в виде:

$$p(t) = a_0 + a_1 t + a_2 t^2 + \dots + a_{n-1} t^{n-1} + a_n t^n \quad (3)$$

Его образ:

$$(D(p))(t) = a_1 + 2a_2 t + \dots + n a_n t^{n-1}$$

Раз  $p(t)$  собственный, то должно найтись число  $\lambda \in \mathbb{R}$  (собственное значение):

$$\begin{aligned} D(p) = \lambda p &\Leftrightarrow a_1 + 2a_2 t + \dots + n a_n t^{n-1} \\ &= \lambda a_0 + \lambda a_1 t + \dots + \lambda a_{n-1} t^{n-1} + \lambda a_n t^n \end{aligned} \quad (4)$$

Приравнивая коэффициенты при  $t$  в одинаковых степенях у многочленов “слева” и “справа”, получаем систему:

$$\begin{cases} a_1 = \lambda a_0 \\ 2a_2 = \lambda a_1 \\ \vdots \\ na_n = \lambda a_{n-1} \\ 0 = \lambda a_n \end{cases}$$

Из последнего уравнения следует две возможности:  $\lambda \neq 0$  (и  $a_n$  обязательно ноль) и  $\lambda = 0$  (тогда  $a_n$  любой). Если  $\lambda \neq 0$ , то из предпоследнего уравнения следует  $a_{n-1} = 0$ . И далее, все коэффициенты получаются нулевыми, вплоть до  $a_1$  (второе уравнение системы) и  $a_0$  (первое уравнение). То есть в рассматриваемом случае  $p \equiv 0$ . Но собственный по определению не нулевой. Поэтому выбор  $\lambda \neq 0$  ни к чему не привёл.

Пусть теперь  $\lambda = 0$ . Из предпоследнего уравнения следует  $a_n = 0$ . И таким образом за-нуляются все коэффициенты вплоть до  $a_2$  (второе уравнение системы) и  $a_1$  (первое уравнение). Но... про  $a_0$  так ничего и не известно! То есть  $a_0$  может быть любым. Получается, любой многочлен вида  $p(t) = a_0$ ,  $a_0 \neq 0$  будет собственным для  $\lambda = 0$ . И если бы требовалось, например, найти максимальную по числу линейно независимую систему из собственных векторов преобразования  $D$ , то это была бы, например, система из одного вектора  $\{-17.5\}$ .

Способ 2: “Стандартная схема”.

Введём базис в пространстве многочленов  $\mathcal{P}^{(n)}$ . Например:

$$e = (1, t, t^2, \dots, t^{n-1}, t^n)$$

В этом базисе у многочлена  $p$  (3) будет координатный столбец  $\xi = (a_0, a_1, \dots, a_{n-1}, a_n)^T$ , а у его образа  $D(p)$  будет столбец  $\eta = (a_1, 2a_2, \dots, na_n, 0)$ .

В базисе  $e$  у преобразования  $D$  будет матрица  $A \in \mathbb{R}^{(n+1) \times (n+1)}$ :

$$A\xi = \eta \quad \leftrightarrow \quad A \begin{pmatrix} a_0 \\ a_1 \\ \vdots \\ a_{n-1} \\ a_n \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} a_1 \\ 2a_2 \\ \vdots \\ na_n \\ 0 \end{pmatrix} \Rightarrow A = \begin{pmatrix} 0 & 1 & 0 & \dots & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 2 & \dots & 0 & 0 \\ \vdots & \vdots & \vdots & \ddots & \vdots & \vdots \\ 0 & 0 & 0 & \dots & 0 & n \\ 0 & 0 & 0 & \dots & 0 & 0 \end{pmatrix}$$

Характеристическое уравнение матрицы:

$$\det(A - \lambda E) = 0$$

$$\begin{vmatrix} -\lambda & 1 & 0 & \dots & 0 & 0 \\ 0 & -\lambda & 2 & \dots & 0 & 0 \\ \vdots & \vdots & \vdots & \ddots & \vdots & \vdots \\ 0 & 0 & 0 & \dots & -\lambda & n \\ 0 & 0 & 0 & \dots & 0 & -\lambda \end{vmatrix} = 0 \Rightarrow \lambda = 0 \quad (\text{кратность } n+1)$$

Собственные векторы для единственного найденного  $\lambda = 0$ :

$$(A - \lambda E)\xi = 0$$

$$\begin{pmatrix} 0 & 1 & 0 & \dots & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 2 & \dots & 0 & 0 \\ \vdots & \vdots & \vdots & \ddots & \vdots & \vdots \\ 0 & 0 & 0 & \dots & 0 & n \\ 0 & 0 & 0 & \dots & 0 & 0 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} a_0 \\ a_1 \\ \vdots \\ a_{n-1} \\ a_n \end{pmatrix} = 0 \Rightarrow \begin{cases} a_0 \in \mathbb{R} \\ a_1, a_2, \dots, a_n = 0 \end{cases}$$

То есть собственные векторы, соответствующие  $\lambda = 0$ , это константные ненулевые многочлены. Собственное подпространство, соответствующее  $\lambda = 0$ , это одномерное подпространство с базисом, например,  $\{-17.5\}$ .  $\square$

## 2.2. # 24.70

Пусть  $\phi: L \rightarrow L$  линейное преобразование линейного пространства  $X$ . Доказать, что любое подпространство  $L' \subseteq L$ , содержащее  $\text{Im } \phi$ , инвариантно.

*Решение.* Проверим инвариантность подпространства  $L'$  просто по определению:

$$x \in L' \Rightarrow \phi(x) \in \text{Im } \phi \subseteq L'$$

То есть, да, инвариантно.

(Решение получилось до неприличия коротким, поэтому попробуем далее немного “раскрутить сюжет” и заметить “что-нибудь интересное”).

Так как  $\text{Im } \phi \subseteq L' \subseteq L$ , то

$$\dim \text{Im } \phi \leq \dim L' \leq \dim L$$

Минимальное по размерности подпространство  $L'$ , удовлетворяющее условию задачи, это  $\text{Im } \phi$ . Максимальное по размерности — это всё  $L$ .

Если  $L' \neq L$ , то существует ненулевое прямое дополнение  $L''$  подпространства  $L'$ :

$$L' \oplus L'' = L$$

Выберем теперь базисы в  $L'$  и  $L''$ . Пусть это будут базисы  $p = (p_1, \dots, p_k)$  и  $q = (q_1, \dots, q_l)$  соответственно ( $k = \dim L'$ ,  $l = \dim L''$ ,  $k + l = \dim L \equiv n$ ). Тогда можно в качестве базиса в  $L$  взять объединение базисов  $p$  и  $q$ :

$$e = (p_1, \dots, p_k, q_1, \dots, q_l)$$

Какой будет матрица  $A$  преобразования  $\phi$  в этом базисе? Можно выписать её по столбцам. Так, первый столбец — это координаты  $\phi(p_1)$  в  $e$ . Единственное, что можно сказать про  $\phi(p_1)$  — это то, что  $\phi(p_1) \in \text{Im } \phi$ , а потому и  $\phi(p_1) \in L'$ , и, значит, раскладывается по базису  $p$ . Аналогично и с образами остальных векторов базиса  $e$ . Поэтому матрица  $A$  имеет вид:

$$A = \begin{pmatrix} a_{11} & a_{12} & \dots & a_{1n} \\ a_{21} & a_{22} & \dots & a_{2n} \\ \vdots & \vdots & \ddots & \vdots \\ a_{k1} & a_{k2} & \dots & a_{kn} \\ 0 & 0 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 0 \\ \vdots & \vdots & \ddots & \vdots \\ 0 & 0 & 0 & 0 \end{pmatrix}$$

Причём  $\text{Rg } A = \dim \text{Im } \phi$ , а потому из  $k$  ненулевых строк можно максимум выбрать  $\dim \text{Im } \phi$  линейно независимых.

Пусть в качестве  $L'$  выбрано просто  $\text{Im } \phi$  (один из “граничных случаев”, минимальное по размерности  $L'$ ). Тогда в матрице преобразования первые  $\dim \text{Im } \phi$  строчек будут и ненулевыми, и линейно независимыми. Также можно заметить, что в этом случае размерность прямого дополнения  $L''$  получается равной:

$$\dim L'' = \dim L - \dim L' = \dim L - \dim \text{Im } \phi = \dim \text{Ker } \phi$$

то есть равна размерности ядра преобразования  $\text{Ker } \phi$ ! Однако значит ли это, что  $L''$  обязательно и есть ядро?.. На самом деле, нет, может, и не ядро. Потому что если  $\text{Ker } \phi \cap \text{Im } \phi \neq \{0\}$ , то их сумма не прямая и  $\text{Ker } \phi$  не будет прямым дополнением  $\text{Im } \phi$ <sup>3</sup>.  $\square$

### 2.3. # 24.55(1)

Пусть  $\phi: \mathbb{R}^{2 \times 2} \rightarrow \mathbb{R}^{2 \times 2}$  есть линейное преобразование квадратных матриц второго порядка, заданное формулой:

$$\phi(X) = AX, \quad A = \begin{pmatrix} -4 & 0 \\ 1 & 4 \end{pmatrix}$$

Надо найти собственные значения и максимальную линейно независимую систему собственных векторов преобразования  $\phi$ . В случае, если эта система из собственных векторов может быть выбрана в качестве базиса, записать в нём матрицу преобразования  $\phi$ .

*Решение.* Пойдём по “стандартной схеме”: найдём собственные значения из характеристического уравнения  $\det(A - \lambda E) = 0$ , потом для каждого собственного значения  $\lambda_i$  будем искать собственные векторы как решения соответствующей однородной системы с матрицей  $(A - \lambda_i E)$ .

Характеристическое уравнение:

$$\det(A - \lambda E) = 0$$

$$\begin{vmatrix} -4 - \lambda & 0 \\ 1 & 4 - \lambda \end{vmatrix} = 0 \Rightarrow \begin{cases} \lambda_1 = 4 \\ \lambda_2 = -4 \end{cases}$$

Собственные векторы для  $\lambda_1$ :

$$(A - \lambda_1 E)x = 0$$

$$\begin{pmatrix} -8 & 0 \\ 1 & 0 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} x_1 \\ x_2 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 0 \\ 0 \end{pmatrix} \Rightarrow \boxed{x_1 = \begin{pmatrix} 0 \\ 2023 \end{pmatrix}}$$

Собственные векторы можно либо просто подобрать, глядя на матрицу (и понимая при этом, сколько линейно независимых векторов должно получиться: в данном случае это всего один вектор  $x_1$ , так как в системе  $(A - \lambda_1 E)x = 0$  одна параметрическая неизвестная — переменная  $x_2$ ). Либо можно просто по-честному решить систему, получив базис в пространстве решений (фундаментальную матрицу) — этот базис и будет давать максимальную линейно независимую систему собственных векторов для  $\lambda_1$  (базис в соответствующем собственном подпространстве).

Собственные векторы для  $\lambda_2$ :

$$(A - \lambda_2 E)x = 0$$

$$\begin{pmatrix} 0 & 0 \\ 1 & 8 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} x_1 \\ x_2 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 0 \\ 0 \end{pmatrix} \Rightarrow \boxed{x_2 = \begin{pmatrix} -8 \\ 1 \end{pmatrix}}$$

Снова всего один собственный вектор, который тоже несложно подобрать из по сути единственного уравнения системы  $x_1 + 8x_2 = 0$ .

<sup>3</sup>А у какого преобразования, например, ядро будет иметь ненулевое пересечение со множеством значений?

Получается, нашли собственные векторы  $x_1$  и  $x_2$ , их два. Можно взять в качестве базиса систему  $e' = \{x_1, x_2\}$ . В этом базисе из собственных векторов матрица  $A'$  преобразования будет иметь вид:

$$A' = \begin{pmatrix} 4 & 0 \\ 0 & -4 \end{pmatrix}$$

где на диагонали стоят собственные значения, которые соответствуют векторам базиса  $e'$  из собственных векторов, так как  $\phi(x_1) = \lambda_1 x_1$  и  $\phi(x_2) = \lambda_2 x_2$ .

Нашли базис из собственных векторов, получили диагональный вид матрицы преобразования  $\phi$ . Преобразования квадратных матриц второго порядка  $\mathbb{R}^{2 \times 2}$ ... размерности *четыре*... Но мы нашли базис  $\{x_1, x_2\}$  — в котором всего *два* вектора!?

Какой сейчас год?.. Какой сейчас год?.. AAAAAAAAAAAAAA!

