第一章 复数

1.1 复数域

我们从熟悉的实数集 \mathbb{R} 讨论。熟知 \mathbb{R} 上有一个加法 +, 乘法 · 使之成为一个域。现考虑

$$\mathbb{R}^2 = \{(x, y); x, y \in \mathbb{R}\}.$$

它是一个二维实向量空间,基为 $e_1=(1,0), e_2=(0,1)$ 。 任一向量 $u=(x,y)=xe_1+ye_2\in\mathbb{R}^2$ 的长度定义为 $|u|=\sqrt{x^2+y^2}$ 。两个向量 $u=(x_1,y_1), v=(x_2,y_2)$ 之和与差为

$$u \pm v = (x_1 \pm x_2, y_1 \pm y_2).$$

一个自然而基本的问题是: \mathbb{R}^2 是否可赋予一个乘法运算,使之成为一个域?

这个问题的回答是肯定的。我们将在假设乘法满足一些自然的要求后,将它构造出来。同时可见,在将 \mathbb{R} 等同于 \mathbb{R}^2 的子集 $\widehat{\mathbb{R}} = \{(x,0); x \in \mathbb{R}\}$ 后,这个乘法是实数乘法的一个自然的延拓! 这种方法具有启发性,它出自 Richmond 的一篇论文 1 。

我们将要找的乘法记为·,先对它施加一些自然的要求。为保证 \mathbb{R} 等同于 \mathbb{R} , 乘法需以 \mathbf{e}_1 为单位元, 即对任意 $\mathbf{u} \in \mathbb{R}^2$, 成立

$$u \cdot e_1 = e_1 \cdot u = u$$
.

此外, 有一虽不明显却也自然的要求, 即关于向量长度的可乘性;

$$|oldsymbol{u}\cdotoldsymbol{v}|=|oldsymbol{u}||oldsymbol{v}|,\;oralloldsymbol{u},oldsymbol{v}\in\mathbb{R}^2.$$

以下定理表明, 这两个条件足以确定唯一的乘法。它满足交换性, 且使 $(\mathbb{R}^2, +, \cdot)$ 具有域结构。

 $^{^{1}}$ Richmond, D. E. Complex numbers and vector algebra. Amer. Math. Monthly 58 (1951), 622–628.

定理 1.1. 向量空间 ℝ² 上存在唯一的乘法·,满足

- (单位元) $\boldsymbol{u} \cdot \boldsymbol{e}_1 = \boldsymbol{e}_1 \cdot \boldsymbol{u} = \boldsymbol{u}, \ \forall \boldsymbol{u} \in \mathbb{R}^2$;
- (长度可乘性) $|\boldsymbol{u}\cdot\boldsymbol{v}|=|\boldsymbol{u}||\boldsymbol{v}|,\ \forall \boldsymbol{u},\boldsymbol{v}\in\mathbb{R}^2$.

此乘法满足交换律, 且使 $(\mathbb{R}^2, +, \cdot)$ 成为域。

证明: 对任意向量

$$u = (a, b) = ae_1 + be_2, v = (c, d) = ce_1 + de_2,$$

利用乘法 · 的第一条性质知

$$\mathbf{u} \cdot \mathbf{v} = ac\mathbf{e}_1 + (ad + bc)\mathbf{e}_2 + bd\mathbf{e}_2 \cdot \mathbf{e}_2.$$

由此可见 $\mathbf{u} \cdot \mathbf{v} = \mathbf{v} \cdot \mathbf{u}$ 。 因此乘法满足交换律。 同时可知, 要定义 乘法, 关键是定义 $\mathbf{e}_2 \cdot \mathbf{e}_2$ 的值。

记
$$e_2 \cdot e_2 = (x, y)$$
。 由长度可乘性知 $x^2 + y^2 = 1$ 。另一方面

$$(e_1 + e_2) \cdot (e_1 - e_2) = e_1 - e_2 \cdot e_2 = (1 - x, y).$$

由 $|e_1 + e_2| = |e_1 - e_2| = \sqrt{2}$ 以及长度可乘性可得

$$4 = |(\mathbf{e}_1 + \mathbf{e}_2) \cdot (\mathbf{e}_1 - \mathbf{e}_2)|^2 = (1 - x)^2 + y^2.$$

由此求出 x = -1, y = 0。这说明

$$e_2 \cdot e_2 = -e_1$$
.

由此得乘法定义 $\mathbf{u} \cdot \mathbf{v} = (ac - bd)\mathbf{e}_1 + (ad + bc)\mathbf{e}_2$, 即

$$(a,b) \cdot (c,d) = (ac - bd, ad + bc).$$

可验证, 此乘法以 e_1 为单位元。等式

$$(ac - bd)^2 + (ad + bc)^2 = (a^2 + b^2)(c^2 + d^2)$$

表明乘法满足长度可乘性。上述证明亦表明乘法唯一。

 \mathbb{R}^2 上两个运算 +.. 满足如下性质:

• 运算 * \in {+,·} 满足交换律 u*v = v*u, 结合律 (u*v)*w = u*(v*w);

- 加法有单位元 $\mathbf{0} = (0,0)$, 乘法有单位元 e_1 ;
- $\mathbf{u} = (a, b)$ 关于加法有逆元 (-a, -b); 当 $\mathbf{u} \neq \mathbf{0}$ 时, 关于乘法 有逆元

$$\left(\frac{a}{a^2+b^2}, \frac{-b}{a^2+b^2}\right).$$

• 分配律 $\mathbf{u} \cdot (\mathbf{v}_1 + \mathbf{v}_2) = \mathbf{u} \cdot \mathbf{v}_1 + \mathbf{u} \cdot \mathbf{v}_2$ 成立.

这说明
$$(\mathbb{R}^2, +, \cdot)$$
 是一个域.

称 $(\mathbb{R}^2, +, \cdot)$ 为复数域, 简记为 \mathbb{C} .

假设 F 是一个域, 我们称之为有序域, 如果 F 上有一个二元 关系 < 满足如下性质

- 1. (三分性) 对任意 $a, b \in F$, 三种关系 a < b, a = b, b < a 之一成立:
 - 2. (传递性) $a < b, b < c \Longrightarrow a < c$;
 - 3. (平移不变性) $a < b \Longrightarrow a + c < b + c, \forall c \in F$;
 - 4. (保向性) $a < b, 0 < c \Longrightarrow a \cdot c < b \cdot c$.
 - 易见, 任给有序集 Y, 在 $Y \times Y$ 有一个自然的字典序

复数域上的字典序满足除了保向性之外的三个性质。那么是 否存在一个顺序使复数域成为有序域呢?答案是否定的。

定理 1.2. 复数域 ℂ 不是有序域。

证明: (反证法) 假设 \mathbb{C} 是有序域。先证明: 对任意 $u \in \mathbb{C}$, 成立 $0 < u^2$ 。如果 0 < u, 利用保向性得 $0 = 0 \cdot u < u^2$ 。如果 u < 0, 利用平移不变性得 0 = u - u < 0 - u = -u。仍由保向性 得 $0 < (-u) \cdot (-u) = u^2$ 。

下面考虑 e_2 。由上述讨论 $0 < e_2^2 = -e_1$,因此 $e_1 < 0$ 。但这矛盾于 $0 < e_1^2 = e_1$ 。

1.2 复数的表示

在定理1.1赋予的乘法下, $(\mathbb{R}^2, +, \cdot)$ 成为复数域 \mathbb{C} ,且 \mathbb{R}^2 的子集 $\widehat{\mathbb{R}} = \{(x,0); x \in \mathbb{R}\}$ 与实数域同构,同构映射由 $(x,0) \mapsto x$ 给出。因此,可将 (a,0) 合理简记为 a,同时记 e_2 为 i。利用

 $e_2^2 = -e_1$,可知 $i^2 = -1$ (可按记号理解)。在此记号约定下,(a,b) 即为 a+bi。称 z=a+bi 为一个复数。这样,复数域可记为 $\mathbb{C} = \{a+bi; a,b \in \mathbb{R}\}$ 。每一个复数 a+bi 以自然的方式对应于平面 \mathbb{R}^2 上的点,其坐标为 (a,b)。

两复数 z = a + bi 与 w = c + di 的加法与乘法:

$$z + w = (a+c) + (b+d)i.$$

$$zw = (a+bi)(c+di) = (ac-bd) + (ad+bc)i.$$

给定复数 z = x + iy, 其中 $x, y \in \mathbb{R}$ 。称 x 为 z 的实部 (real part), y 为 z 的虚部 (imaginary part), 分别记为

$$x = \operatorname{Re}(z), \quad y = \operatorname{Im}(z).$$

如果 z 的实部为 0, 称 z 为纯虚数。复数 z 的模长为 $|z|=\sqrt{x^2+y^2}$ 。从几何直观看,模长表示原点到点 (x,y) 的距离。复数 z=x+iy 的共轭复数为 $\bar{z}=x-iy$.

容易验证

$$\operatorname{Re}(z) = \frac{z + \bar{z}}{2}, \ \operatorname{Im}(z) = \frac{z - \bar{z}}{2i},$$
$$|\operatorname{Re}(z)| \le |z|, \ |\operatorname{Im}(z)| \le |z|,$$
$$\overline{zw} = \bar{z}\bar{w}, \ |z|^2 = z\bar{z}.$$

模长满足三角不等式

$$|z+w| \le |z| + |w|.$$

为证明此不等式,将两边平方

$$|z+w|^2 = (z+w)(\bar{z}+\bar{w}) = |z|^2 + 2\operatorname{Re}(z\bar{w}) + |w|^2$$

 $< |z|^2 + 2|z\bar{w}| + |w|^2 = (|z| + |w|)^2.$

等号成立当且仅当 $z\bar{w}$ 为非负实数。此时,要么 z,w 之一为 0,要么都非零且 (由等式 $(z\bar{w})w=z|w|^2$ 可见) z,w 位于从原点出发的同一条射线上。

非零复数 z = x + iy 也可写成极坐标形式 $z = r(\cos \theta + i \sin \theta)$, 其中 r = |z|, $\theta \in \mathbb{R}$ 为连接原点与 z 的有向线段与 x 轴正方向的 夹角 (在相差 2π 的整数倍的意义下唯一)。称 θ 为复数 z 的辐角 (argument)。 给定数学对象 A(比如实数,复数,矩阵,微分算子等),抽象的记号 e^A 可按如下幂级数定义

$$e^A = \sum_{n=0}^{\infty} \frac{A^n}{n!}.$$

按此定义,如果 $A = i\theta$,则

$$e^{i\theta} = \sum_{n=0}^{\infty} \frac{(i\theta)^n}{n!} = \sum_{k=0}^{\infty} \frac{(i\theta)^{2k}}{(2k)!} + \sum_{k=0}^{\infty} \frac{(i\theta)^{2k+1}}{(2k+1)!}$$
$$= \sum_{k=0}^{\infty} (-1)^k \frac{\theta^{2k}}{(2k)!} + i \sum_{k=0}^{\infty} (-1)^k \frac{\theta^{2k+1}}{(2k+1)!}.$$

上式右端实部虚部分别为 $\cos(\theta)$ 和 $\sin(\theta)$ 的幂级数展式。由此得著名的 Euler 等式

$$e^{i\theta} = \cos(\theta) + i\sin(\theta).$$

在上式中令 $\theta = \pi$, 得恒等式

$$e^{i\pi} = -1.$$

利用复数的乘法,可以验证

$$e^{i\alpha} \cdot e^{i\beta} = (\cos(\alpha) + i\sin(\alpha)) \cdot (\cos(\beta) + i\sin(\beta))$$

$$= (\cos(\alpha)\cos(\beta) - \sin(\alpha)\sin(\beta)) + i(\cos(\alpha)\sin(\beta) + \sin(\alpha)\cos(\beta))$$

$$= \cos(\alpha + \beta) + i\sin(\alpha + \beta) = e^{i(\alpha + \beta)}.$$

由此得 $(e^{i\theta})^n=e^{in\theta},\,1/e^{i\theta}=e^{-i\theta}.$ 这样得两个复数 $z=re^{i\theta}$ 与 $w=\rho e^{i\alpha}$ 的乘积公式与求商公式

$$zw = r\rho e^{i(\theta+\alpha)}, \ \frac{z}{w} = \frac{r}{\rho}e^{i(\theta-\alpha)}(w \neq 0).$$

例题 1.1. 求三角和 (其中 $\theta \in \mathbb{R}$)

$$\sum_{k=1}^{n} \cos(k\theta), \ \sum_{k=1}^{n} \sin(k\theta).$$

解答: 考虑复形式

$$\sum_{k=1}^{n} \cos(k\theta) + i \sum_{k=1}^{n} \sin(k\theta) = \sum_{k=1}^{n} (\cos(k\theta) + i \sin(k\theta)) = \sum_{k=1}^{n} e^{ik\theta}.$$

如果 $e^{i\theta}=1(\Longleftrightarrow\theta\in2\pi\mathbb{Z})$, 则上式和为 n, 此时 $\sum_{k=1}^{n}\cos(k\theta)=n$, $\sum_{k=1}^{n}\sin(k\theta)=0$ 。 如果 $e^{i\theta}\neq1$, 则

$$\sum_{k=1}^{n} e^{ik\theta} = \frac{e^{i\theta}(1 - e^{in\theta})}{1 - e^{i\theta}} = \frac{e^{i\theta}e^{in\theta/2}(e^{-in\theta/2} - e^{in\theta/2})}{e^{i\theta/2}(e^{-i\theta/2} - e^{i\theta/2})} = \frac{\sin((n+1)\theta/2)}{\sin(\theta/2)}e^{in\theta/2}.$$

比较两端实部与虚部, 可得

$$\sum_{k=1}^{n} \cos(k\theta) = \frac{\sin((n+1)\theta/2)}{\sin(\theta/2)} \cos(n\theta/2),$$

$$\sum_{k=1}^{n} \cos(k\theta) = \frac{\sin((n+1)\theta/2)}{\sin(\theta/2)} \sin(n\theta/2).$$

1.3 Lagrange 恒等式

定理 1.3.(Lagrange) 给定 2n 个复数 $z_1, \dots, z_n, w_1, \dots, w_n$, 成立

$$\Big| \sum_{j=1}^n z_j w_j \Big|^2 = \Big(\sum_{j=1}^n |z_j|^2 \Big) \Big(\sum_{j=1}^n |w_j|^2 \Big) - \sum_{1 \le j < k \le n} |z_j \bar{w}_k - z_k \bar{w}_j|^2.$$

证明: 利用等式

$$\left| \sum_{j=1}^{n} a_j \right|^2 = \sum_{j=1}^{n} |a_j|^2 + \sum_{1 \le j \ne k \le n} a_j \bar{a}_k$$

可得

$$\Big|\sum_{j=1}^{n} z_j w_j\Big|^2 = \sum_{j=1}^{n} |z_j|^2 |w_j|^2 + \sum_{1 \le j \ne k \le n} z_j w_j \bar{z}_k \bar{w}_k.$$

计算另一项

$$\begin{split} & \sum_{1 \leq j < k \leq n} |z_j \bar{w}_k - z_k \bar{w}_j|^2 \\ = & \sum_{1 \leq j < k \leq n} (z_j \bar{w}_k - z_k \bar{w}_j) (\bar{z}_j w_k - \bar{z}_k w_j) \\ = & \sum_{1 \leq j < k \leq n} (|z_j|^2 |w_k|^2 - z_j w_j \bar{z}_k \bar{w}_k - \bar{z}_j \bar{w}_j z_k w_k + |z_k|^2 |w_j|^2) \\ = & \sum_{1 \leq j \neq k \leq n} |z_j|^2 |w_k|^2 - \sum_{1 \leq j \neq k \leq n} z_j w_j \bar{z}_k \bar{w}_k. \end{split}$$

由以上两式得

$$\left| \sum_{j=1}^{n} z_j w_j \right|^2 + \sum_{1 \le j < k \le n} |z_j \bar{w}_k - z_k \bar{w}_j|^2$$

$$= \sum_{1 \le j,k \le n} |z_j|^2 |w_k|^2 = \left(\sum_{j=1}^{n} |z_j|^2 \right) \left(\sum_{k=1}^{n} |w_k|^2 \right).$$

Lagrange 恒等式有一个有趣的特例: 取所有 $w_k = 1$ 得

$$\left| \sum_{j=1}^{n} z_j \right|^2 = n \sum_{j=1}^{n} |z_j|^2 - \sum_{1 \le j < k \le n} |z_j - z_k|^2.$$

此式的几何理解如下: 假设 n 边形 $P_1P_2\cdots P_n$ 的每个顶点 P_j 的 复坐标为 z_j , n 边形的重心记为 Q, 其复坐标为 $\frac{1}{n}\sum_{j=1}^n z_j$. 原点记为 Q, 则多边形所有顶点间距离的平方和满足等式

$$\sum_{1 \le j < k \le n} P_j P_k^2 = n \sum_{j=1}^n OP_j^2 - n^2 OQ^2.$$

由此得一有趣事实:如果 n 边形的所有顶点都在单位圆周上,则所有顶点间距离的平方和不超过 n^2 .达到 n^2 时当且仅当 n 边形的重心即为坐标原点.

Lagrange 恒等式的一个直接推论是 Cauchy-Schwarz 不等式:

定理 1.4. 给定 2n 个复数 $z_1, \dots, z_n, w_1, \dots, w_n$, 成立不等式

$$\Big| \sum_{j=1}^{n} z_j w_j \Big|^2 \le \Big(\sum_{j=1}^{n} |z_j|^2 \Big) \Big(\sum_{j=1}^{n} |w_j|^2 \Big).$$

等号成立当且仅当存在复数 $\lambda\in\mathbb{C}$, 满足要么 $z_j=\lambda\bar{w}_j, 1\leq j\leq n$, 要么 $w_j=\lambda\bar{z}_j, 1\leq j\leq n$.

下面给出一个直接证明.

证明: 如果 $\sum_{j=1}^{n} |w_j|^2 = 0$,则所有 $w_j = 0$,不等式显然成立。不妨假设 $\sum_{j=1}^{n} |w_j|^2 > 0$. 显然对任意复数 $\lambda \in \mathbb{C}$,成立

$$\sum_{j=1}^{n} |z_j - \lambda \bar{w}_j|^2 = \sum_{j=1}^{n} |z_j|^2 + |\lambda|^2 \sum_{j=1}^{n} |w_j|^2 - 2\operatorname{Re}\left(\bar{\lambda} \sum_{j=1}^{n} z_j w_j\right) \ge 0.$$

在上式中取

$$\lambda = \sum_{j=1}^{n} z_j w_j / \sum_{j=1}^{n} |w_j|^2$$

可得

$$\sum_{j=1}^{n} |z_j|^2 \ge \Big| \sum_{j=1}^{n} z_j w_j \Big|^2 / \sum_{j=1}^{n} |w_j|^2.$$

即为 Cauchy-Schwarz 不等式。等号成立条件如命题所言。

1.4 习题

"你们的事业的成长,应像一棵树的成长一样。应该是顺其自然的,无间断的和全面的。我希望你们的根能够在这个学院的沃土下面尽量深入,以使你们的树干长的既粗且壮。这样,将来无论树叶多么茂盛丰满,也永远不会有水分供应不暇的毛病。在上空将不时有狂风大雨,亦会有行雷闪电。所以切勿长得太快太高。"

—罗伦士奥利维亚, 英国演员, 1947

1. (Euler 等式) 利用复数的性质证明欧拉的一个等式

$$\arctan\left(\frac{1}{2}\right) + \arctan\left(\frac{1}{3}\right) = \frac{\pi}{4}.$$

2. (三角不等式的推广) 证明不等式

$$|z_1 + \cdots + z_n| < |z_1| + \cdots + |z_n|$$

并给出不等式中等号成立的条件.

3. (常用不等式) 给定复数 a, z 满足 |a| < 1, |z| < 1. 证明:

$$\frac{||z|-|a||}{1-|a||z|}\leq \left|\frac{z-a}{1-a\overline{z}}\right|\leq \frac{|z|+|a|}{1+|a||z|}<1.$$

4. (单位圆周上的正三角形) 给定三个点 z_1, z_2, z_3 满足 $|z_1| = |z_2| = |z_3| = 1$, 证明 z_1, z_2, z_3 是正三角形的三个顶点的充要条件是

$$z_1 + z_2 + z_3 = 0.$$

5. (恒等式) 给定两个复数 z1, z2, 证明恒等式

$$|z_1 + z_2|^2 + |z_1 - z_2|^2 = 2(|z_1|^2 + |z_2|^2),$$

并说明等式的几何意义.

6. (复数的几何性质) 单位圆周上 2n+1 个复数 z_1, \dots, z_{2n+1} 在直径一侧,证明 $|z_1 + \dots + z_{2n+1}| > 1$.

1.4 习题 9

***(以下为附加题,不做要求)

7. (复数的几何性质) 给定 $n \ge 1$ 个复数 z_1, \dots, z_n , 模长都不超过 1, 证明存在 $\epsilon_k \in \{\pm 1\}$, 满足

$$|\epsilon_1 z_1 + \dots + \epsilon_n z_n| \le \sqrt{2}.$$

8. (复数的代数性质) 如果 a,b,c 三个复数满足 |a|=|b|=|c|=r, 证明

$$\left| \frac{ab + bc + ca}{a + b + c} \right| = r.$$

推广这个结论.

9. (Fibonacci 数列) 记 Fibonacci 数列为 $\{F_n\}$,

$$F_1 = F_2 = 1, \ F_n = F_{n-1} + F_{n-2}, n \ge 3.$$

证明

$$\frac{\pi}{4} = \sum_{n=1}^{+\infty} \arctan\left(\frac{1}{F_{2n+1}}\right).$$

10. (\mathbb{R}^3 没有域结构) 向量空间 \mathbb{R}^3 的一组基为

$$e_1 = (1,0,0), e_2 = (0,1,0), e_3 = (0,0,1).$$

证明 \mathbb{R}^3 没有乘法同时满足以下性质:

- (单位元) $\boldsymbol{u} \cdot \boldsymbol{e}_1 = \boldsymbol{e}_1 \cdot \boldsymbol{u} = \boldsymbol{u}, \ \forall \boldsymbol{u} \in \mathbb{R}^3$;
- (交換性) $\boldsymbol{u} \cdot \boldsymbol{v} = \boldsymbol{v} \cdot \boldsymbol{u}, \ \forall \boldsymbol{u}, \boldsymbol{v} \in \mathbb{R}^3$;
- (长度可乘性) $|\boldsymbol{u}\cdot\boldsymbol{v}|=|\boldsymbol{u}||\boldsymbol{v}|, \ \forall \boldsymbol{u},\boldsymbol{v}\in\mathbb{R}^3$.

按照如下思路给出详细过程: 反证, 假设乘法存在, 则

(1). 通过计算 $(e_1 + e_2) \cdot (e_1 - e_2)$, $(e_1 + e_3) \cdot (e_1 - e_3)$, 证明

$$e_2 \cdot e_2 = -e_1, \ e_3 \cdot e_3 = -e_1.$$

- (2). 证明 $(e_2 + e_3) \cdot (e_2 e_3) = 0$, 由此得矛盾。
- 11. (复数性质的应用) 单位圆周上有一个正 n 边形,其顶点分别为 P_1, \cdots, P_n, Q 为单位圆周上一点,记 QP_k 为线段长度。证明

$$\max_{Q} \prod_{k=1}^{n} Q P_k = 2.$$

$$\max_{Q} \sum_{k=1}^{n} Q P_k = \frac{2}{\sin(\pi/(2n))}.$$