§ 2.2 Jordan标准形

定义 形式为

 $egin{bmatrix} \lambda & 1 & & & \\ & \lambda & \ddots & & \\ & & \ddots & 1 \\ & & & \lambda \end{bmatrix}_{r imes r}$

的r≥1阶方阵称为一个Jordan块, 其中λ是实数或复数. 由若干个(包括单个) Jordan块所构成的对角块矩阵称为 Jordan矩阵。 $\begin{bmatrix} -2 & 1 & & \\ & -2 & 1 \\ & & -2 \end{bmatrix}, \begin{bmatrix} 0 & 1 & & \\ & 0 & 1 \\ & & 0 & 1 \\ & & 0 \end{bmatrix}, \begin{bmatrix} 1-i & 1 & \\ & 1-i & 1 \\ & & 1-i \end{bmatrix}$

等都是Jordan块(如果把它们看作是单个Jordan块的方阵,

则它们是Jordan矩阵).而

$$A = \begin{bmatrix} 1 & 1 & & & \\ & 1 & & \\ & & -2 & \\ & & -2 & 1 \\ & & & -2 \end{pmatrix}$$

等都是Jordan矩阵.并且上列的最后一个Jordan矩阵可以 看成是由两个子Jordan矩阵

$$J_1 = \begin{bmatrix} 1 & 1 \\ 1 \end{bmatrix}, \ J_2 = \begin{bmatrix} -2 \\ --- \\ -2 \end{bmatrix}$$

组成的,其中 J_1 是Jordan块, J_2 是关于-2的Jordan矩阵. 记为J=diag $\{J_1,J_2\}$.

对角矩阵就是1阶Jordan块所组成的对角块矩阵,所以 Jordan矩阵包含对角矩阵。

本节的目的是论证复数域上任一 n 阶方阵都相似于一个Jordan矩阵,并且Jordan块的个数等于该方阵的线性无关特征向量的个数.

例1 方阵

$$A = \begin{bmatrix} -3 & 3 & -2 \\ -7 & 6 & -3 \\ 1 & -1 & 2 \end{bmatrix}$$

是不可对角化的. 事实上,A 的特征多项式是 $\det(\lambda I - A) = (\lambda - 1)(\lambda - 2)^2,$

故A有两个互异的特征值: $\lambda_1 = 1, \lambda_2 = 2$ (二重).

关于 $\lambda_1 = 1$ 的一个特征向量为 $x_1 = \begin{bmatrix} 1 & 2 & 1 \end{bmatrix}^T$,由于齐

次线性方程组

$$(A-2I)x = \begin{bmatrix} -5 & 3 & -2 \\ -7 & 4 & -3 \\ 1 & -1 & 0 \end{bmatrix} x = 0$$

的系数矩阵 A-2I 的秩是2,所以它的基础解系只有一个

向量. $x_2 = \begin{bmatrix} -1 & -1 & 1 \end{bmatrix}^T$. 因而dim $E_{\lambda_2} = 1 < 2$,故A不可对角化.

我们看出,A不可对角化的原因就是特征值 $\lambda_2 = 2$

的几何重数小于代数重数,而这又是因为 A-2I 的秩是2 引起的.

由于矩阵乘积的秩的不等式(2.1-10),所以有 $rank(A-2I)^2 \leq rank(A-2I)$,

故考虑求解下述齐次线性方程组

$$(A-2I)^{2} x = \begin{bmatrix} 2 & -1 & 1 \\ 4 & -2 & 2 \\ 2 & -1 & 1 \end{bmatrix} x = 0.$$

因 $rank(A-2I)^2=1$,故 $dim N[(A-2I)^2]=2$,恰好等于 $\lambda_2=2$ 的代数重数,因此方程组有两个线性无关的解,由于 $N[(A-2I)]\subset N[(A-2I)^2]$,所以上述的 $x_2=[-1 \ -1 \ 1]^T$ 是一个解,它是 A 关于 $\lambda_2=2$ 的特征向量. 另一个与 x_2 线性无关的解可取为 $x_3=[-1 \ -2 \ 0]^T$,

它满足关系式

$$(A-2I)x_3=x_2,$$

即

$$Ax_3 = x_2 + 2x_3.$$

因此,

$$A[x_1 \ x_2 \ x_3] = [Ax_1 \ Ax_2 \ Ax_3] = [x_1 \ x_2 \ x_3]$$



$$P = \begin{bmatrix} x_1 & x_2 & x_3 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 1 & -1 & -1 \\ 2 & -1 & -2 \\ 1 & 1 & 0 \end{bmatrix},$$

它是可逆阵,则有

$$P^{-1}AP = \begin{bmatrix} \frac{1}{2} & \frac{1}{2} \\ \frac{1}{2} & \frac{1}{2} \end{bmatrix},$$

即 A 相似于Jordan矩阵.

上面例子说明,方阵 A 虽然不可对角化,但相似于 Jordan矩阵. 这个结论具有一般性,即复数域上任一方阵 A ,都能找到可逆矩阵 P,使 $P^{-1}AP$ 是 Jordan矩阵. 用线性变换的 语言来说就是,若 T 是复数域上线性空间 V 的一个线性变换,那么在 V 中必能找到一个基,使 T 在该基下的矩阵是 Jordan 矩阵.

定义 设 λ_0 是方阵A的特征值.如果对于向量X,存在一个

正整数k,使

(2.2-1)

则称x为A关于 λ_0 的k 级根向量(或广义特征向量). 简称 x为 λ_0 的k 级根向量.

按根向量的定义可知,1级根向量为特征向量,反之,特征向量必为1级根向量. 而例1中的 x_3 ,例2中的 x_4 都是2级根向量.

定理 设 λ_0 是方阵A 的特征值,则 A关于 λ_0 的不同级的根向量是线性无关的.

证 设 x_i ($i = 1, 2, \dots, p$) 是A 关于 λ_0 的 i 级根向量, 要证明向量组 $x_1x_2, \dots x_p$ 线性无关.

设有等式

$$a_1 x_1 + a_2 x_2 + \dots + a_p x_p = 0.$$

用 $(A-\lambda_0 I)^{p-1}$ 左乘上式两边, 得

$$a_{1}(A - \lambda_{0}I)^{P-1}x_{1} + a_{2}(A - \lambda_{0}I)^{P-1}x_{2} + \cdots$$
$$+ a_{p}(A - \lambda_{0}I)^{P-1}x_{p} = 0.$$

由根向量的定义知,

$$(A - \lambda_0 I)^{p-1} x_1 = 0, \dots, (A - \lambda_0 I)^{p-1} x_{p-1} = 0,$$

 $(A - \lambda_0 I)^{p-1} x_p \neq 0$,因此 $a_p = 0$ 类似地可证

$$a_{p-1} = \cdots = a_1 = 0.$$

因此,

$$a_1 = a_2 = \dots = a_p = 0$$

即向量组 $\{x_1, x_2, \cdots, x_p\}$ 线性无关.

定理 A 关于不同特征值的根向量是线性无关的.

证 设 $\lambda_1, \lambda_2, \dots, \lambda_s$ 是A的不同特征值, $x_i (i = 1, 2, \dots, s)$ 为 λ_i 的 n_i

级根向量,要证明向量组x₁,x₂,···,x_s是线性无关的.

设有等式

$$b_1 \mathbf{x}_1 + b_2 \mathbf{x}_2 + \dots + b_s \mathbf{x}_s = 0. \tag{2.2-2}$$

用 $(A-\lambda_1 I)^{n_1-1}(A-\lambda_2 I)^{n_2}\cdots(A-\lambda_s I)^{n_s}$ 左乘(2.2-2)式两边,得

$$b_{1}(A - \lambda_{1}I)^{n_{1}-1}(A - \lambda_{2}I)^{n_{2}} \cdots (A - \lambda_{s}I)^{n_{s}} \mathbf{x}_{1}$$

$$+ b_{2}(A - \lambda_{1}I)^{n_{1}-1}(A - \lambda_{2}I)^{n_{2}} \cdots (A - \lambda_{s}I)^{n_{s}} \mathbf{x}_{2} + \cdots$$

$$+ b_{s}(A - \lambda_{1}I)^{n_{1}-1}(A - \lambda_{2}I)^{n_{2}} \cdots (A - \lambda_{s}I)^{n_{s}} \mathbf{x}_{s} = 0.$$
(2.2-3)

根据根向量的定义,有

$$(A-\lambda_2 I)^{n_2}\mathbf{x}_2=0,\cdots,(A-\lambda_s I)^{n_s}\mathbf{x}_s=0,$$

从而由(2.2-3)式得

$$b_{1}(A - \lambda_{1}I)^{n_{1}-1}(A - \lambda_{2}I)^{n_{2}} \cdots (A - \lambda_{s}I)^{n_{s}} \mathbf{x}_{1}$$

$$= b_{1}(A - \lambda_{2}I)^{n_{2}} \cdots (A - \lambda_{s}I)^{n_{s}}(A - \lambda_{1}I)^{n_{1}-1} \mathbf{x}_{1}$$

$$= 0.$$

(2.2-4)

$$\diamondsuit y \stackrel{\Delta}{=} (A - \lambda_1 I)^{n_1 - 1} x_1 \neq 0, \quad \forall (A - \lambda_1 I) \mathbf{y} = (A - \lambda_1 I)^{n_1} \mathbf{x}_1 = 0, \quad \forall \mathbf{y} \neq \mathbf{A}$$

关于4的特征向量,因而(2.2-4)式成为

$$b_1(\lambda_1 - \lambda_2)^{n_2} \cdots (\lambda_1 - \lambda_s)^{n_s} \mathbf{y} = 0.$$

由于 $\lambda_1, \lambda_2, \dots, \lambda_s$ 是互异的,有 $\mathbf{y} \neq 0$,所以 $b_1 = 0$. 同理可得

$$b_2 = \cdots = b_s = 0$$
. 因此向量组 $\mathbf{x_1, x_2, \cdots, x_s}$ 线性无关.

定义 设 λ_0 是A的k重特征值, $(A-\lambda_0 I)^K$ 的零空间

$$N[(A - \lambda_0 I)^k] = \{x | (A - \lambda_0 I)^k x = 0\}$$

(2.2-5)

称为A关于 λ_0 的根空间,简称 λ_0 的根空间,记为 N_{λ_0} .

容易看出, N_{λ_0} 是 λ_0 的级数至多到k的所有根向量所张成的线性空间,并且 N_{λ_0} 是A的不变子空间.

值得指出的是, N_{λ_0} 中根向量的最高级数可能小于k.例如, 若对于特征值 λ_2 =1的代数重数是3, 但由于 $(A-1\cdot I)^2=(A-1\cdot I)^3$ 所以 N_{λ_0} 中根向量的最高级数是2, 小于3.

N_{λ_0} 中根向量的最高级数r 称为 λ_0 的指标,从而

$$N_{\lambda_0} = N [(A - \lambda_0 I)^r]$$

我们将会知道, λ_0 的指标 r即是关于 λ_0 的子Jordan矩阵中 Jordan块的最大阶数.

定理 设n阶方阵A的特征多项式为

$$f(\lambda) = (\lambda - \lambda_1)^{n_1} (\lambda - \lambda_{12})^{n_2} \cdots (\lambda - \lambda_s)^{n_s}$$

其中 λ_1 λ_2 ,…, λ_s ,是A的所有不同的特征值, n_1,n_2 ,…, n_s

是相应的代数重数,则有

$$N_{\lambda_1} \oplus N_{\lambda_2} \oplus \cdots \oplus N_{\lambda_n} = C^n \qquad (2.2-6)$$

证 由前述有关根向量线性无关性的两个定理可知

$$N_{\lambda_1} + N_{\lambda_2} + \cdots + N_{\lambda_s} = N_{\lambda_1} \oplus N_{\lambda_2} \oplus \cdots \oplus N_{\lambda_s} \subset C^n$$
.

又因
$$f(A) = (A - \lambda_1 I)^{n_1} (A - \lambda_1 I)^{n_2} \cdots (A - \lambda_s I)^{n_s} = O.$$
 故(2.1-11)式给出
$$\dim N_{\lambda_1} + \dim N_{\lambda_2} + \cdots + \dim N_{\lambda_s} \ge n.$$

因而有

$$\dim N_{\lambda_1} + \dim N_{\lambda_2} + \cdots + \dim N_{\lambda_s} = n,$$

即(2.2-6)式成立.

把A相似简化为Jordan矩阵的关键是,寻找A关于其特征值的各级根向量.1级根向量可以解齐次线性方程组

$$(A - \lambda_i I)x = 0, i = 1, 2, \dots, s$$

求得. 如果rank $(A-\lambda_i I) = r_i$,那么有 $n-r_i$ 个线性无关的属于 λ_i 的1级根向量.若 $n-r_i < n_i$,则必有 λ_i 的2级根向量.按定义,可以通过解方程 $(A-\lambda_i I)x \neq 0$; $(A-\lambda_i I)^2 x = 0$ 求得.

但这样求解是比较困难的,又不能得到与1级根向量有规律的关系,因此我们用下述方法.由于

$$(A - \lambda_i I)^2 x = (A - \lambda_i I)(A - \lambda_i I)x = 0$$

所以若令

$$(A - \lambda_{i} I) x = y,$$

(2.2-7)

则 $(A-\lambda_i I)y=0$,且 $y\neq 0$. 这就是说, y是属于 λ_i 的1级根向量。

由于 (2.2-7) 式是非齐次线性方程组,所以要求它有解, 增广矩阵 $[A-\lambda_i I:y]$ 的秩必须也是 r_i .这就对y的选取作了限制.

如果还有更高级的根向量,我们仍是利用(2.2-7)式从这级的根向量 y 求高一级的根向量 x ,但要注意 y 的选取应使方程组(2.2-7)的解存在.

例3 求方阵A的根向量,其中

$$A = \begin{bmatrix} 3 & 0 & 1 \\ 0 & 2 & 0 \\ -1 & 0 & 1 \end{bmatrix}.$$

 \mathbf{p} 由于 $\det(\lambda I - A) = (\lambda - 2)^3$,故 A有三重特征值2.又因齐次线性方程组

$$(A-2I)x = \begin{bmatrix} 1 & 0 & 1 \\ 0 & 0 & 0 \\ -1 & 0 & -1 \end{bmatrix} x = 0$$

的系数矩A-2I 阵秩是1,所以特征值2的几何重数是3-1=2,

小于代数重数3,因而存在2级根向量.

为了从1级根向量求得2级根向量,首先求出1级根向量的一般表达式,即给出上述方程组的通解.由于它的基础解系有两个向量:

$$x_1 = \begin{bmatrix} 0 & 1 & 0 \end{bmatrix}^T, x_2 = \begin{bmatrix} 1 & 0 & -1 \end{bmatrix}^T$$

所以它的通解为

$$y = c_1 x_1 + c_2 x_2 = [c_2 \quad c_1 \quad -c_2]^T.$$

代入(2.2-7)式得

$$\begin{bmatrix} 1 & 0 & 1 \\ 0 & 0 & 0 \\ -1 & 0 & -1 \end{bmatrix} x = \begin{bmatrix} c_2 \\ c_1 \\ -c_2 \end{bmatrix}$$

容易看出,当且仅当 $c_1 = 0$ 时,这个非齐次线性方程才有解,且它的通解是

$$y = [c_2 \quad 0 \quad -c_2]^T + b_1 x_1 + b_2 x_2, c_2 \neq 0.$$

这就是2级根向量的一般表达式.

于是

$$N_{\lambda=2} = span\{x_1, x_2, x_3\}, \quad \dim N_{\lambda=2} = 3,$$

其中 $x_3 = \begin{bmatrix} 1 & 0 & 0 \end{bmatrix}$ ".特征值 2 的根空间的维数恰好等于它的代数重数.

那么是否还会有更高级的根向量呢?回答是不可能再有了.因为上一定理表明,特征值的根空间的维数只能等于它的代数重数,而不能大于代数重数.

例4 设

$$A = \begin{bmatrix} -4 & 1 & 4 \\ -12 & 4 & 8 \\ -6 & 1 & 6 \end{bmatrix}$$

求可逆矩阵P使 $P^{-1}AP$ 为Jordan矩阵。

 \mathbf{M} $\det(\lambda I - A) = (\lambda - 2)^3$, $\lambda = 2$ 是 \mathbf{A} 的三重特征值。齐次线性方程组

$$(A-2I)x = \begin{bmatrix} -6 & 1 & 4 \\ -12 & 2 & 8 \\ -6 & 1 & 4 \end{bmatrix} x = 0$$

的系数矩阵 A-2I 的秩是1,因而基础解系有两个解向量,

例如,
$$x_1 = \begin{bmatrix} 4 & 4 & 5 \end{bmatrix}^T$$
, $z_1 = \begin{bmatrix} 5 & 2 & 7 \end{bmatrix}^T$

且通解的表达式为

$$y = c_1 x_1 + c_2 z_1 = \begin{bmatrix} 4c_1 + 5c_2 & 4c_1 + 2c_2 & 5c_1 + 7c_2 \end{bmatrix}^T$$

代入 (2.2-7) 式得

$$\begin{bmatrix} -6 & 1 & 4 \\ -12 & 2 & 8 \\ -6 & 1 & 4 \end{bmatrix} x = \begin{bmatrix} 4c_1 + 5c_2 \\ 4c_1 + 2c_2 \\ 5c_1 + 7c_2 \end{bmatrix}$$

对它的增广矩阵施行行初等变换:

$$\begin{bmatrix}
-6 & 1 & 4 & 4c_1 + 5c_2 \\
-12 & 2 & 8 & 4c_1 + 2c_2 \\
-6 & 1 & 4 & 5c_1 + 7c_2
\end{bmatrix}
\rightarrow
\begin{bmatrix}
-6 & 1 & 4 & 4c_1 + 5c_2 \\
0 & 0 & 0 & -4(c_1 + 2c_2) \\
0 & 0 & 0 & c_1 + 2c_2
\end{bmatrix}$$

由此可见,当且仅当 $c_1 + 2c_2 = 0$ 时这个非齐次方程组才有解。

若取 $c_1 = 2/3$, $c_2 = -1/3$, 这时 $y = x_2 = \begin{bmatrix} 1 & 2 & 1 \end{bmatrix}^T$, 上述非齐次线

性方程组的一个解是 $x_3 = [0 \ 1 \ 0]^T$,且有 $(A-2I)x_3 = x_2$,即

$$Ax_3 = x_2 + 2x_3$$

$$P^{-1}AP = \begin{pmatrix} 2 & & \\ & 2 & 1 \\ & & 2 \end{pmatrix}$$

因为若在(2.2-7)式中令y=0,也就是齐次线性方程组, $(A-\lambda_i I)x=0$ 它的非零解是A关于 λ_i 的特征向量,亦即 λ_i 的1级根向量,所以我们可以直接从(2.2-7)式出发求 λ_i 的各级根向量。如果是求A的Jordan标准形,所需要求的只是线性无关的根向量。

例5 求方阵的Jordan标准形。

$$A = \begin{bmatrix} 4 & 3 & 0 & 1 \\ 0 & 2 & 0 & 0 \\ 1 & 3 & 2 & 1 \\ 0 & 0 & 0 & 2 \end{bmatrix}$$

解 A的特征多项式 $det(\lambda I - A) = (\lambda - 2)^3(\lambda - 4)$,故它有两

个不同的特征值:代数重数是3的特征值 $\lambda_1 = 2$ 和单重特

征值 $\lambda_1 = 4$ 。

关于 $\lambda_1 = 2$,考察线性方程组(2.2-7),即

$$(A-2I)x = \begin{bmatrix} 2 & 3 & 0 & 1 \\ 0 & 0 & 0 & 0 \\ 1 & 3 & 0 & 1 \\ 0 & 0 & 0 & 0 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} x_1 \\ x_2 \\ x_3 \\ x_4 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} y_1 \\ y_2 \\ y_3 \\ y_4 \end{bmatrix}$$

由于rank(A-2I)=2,所以 $dim V_{\lambda_1}=4-2=2<3$,因而还有2级根向量。

对此方程组的增广矩阵施行行初等变换

$$\begin{bmatrix}
2 & 3 & 0 & 1 & y_1 \\
0 & 0 & 0 & 0 & y_2 \\
1 & 3 & 0 & 1 & y_3 \\
0 & 0 & 0 & 0 & y_4
\end{bmatrix}
\rightarrow
\begin{bmatrix}
1 & 0 & 0 & 0 & y_1 - y_3 \\
0 & 0 & 0 & 0 & y_2 \\
0 & 1 & 0 & \frac{1}{3} & \frac{1}{3}(-y_1 + 2y_3) \\
0 & 0 & 0 & 0 & y_4
\end{bmatrix}$$

(2.2-8)

容易看出,当且仅当 $y_2 = y_4 = 0$,增广矩阵的秩等于系数

矩阵的秩时,它才有解。

令 $y_1 = y_2 = y_3 = y_4 = 0$, 便得到 λ_1 的两个线性无关的

特征向量

$$x_1 = \begin{bmatrix} 0 & -1 & 0 & 3 \end{bmatrix}^T, x_2 = \begin{bmatrix} 0 & 0 & 1 & 0 \end{bmatrix}^T$$

且 x_2 的第二、第四个分量是0,从而由 x_2 可求得 λ_1 的2级

根向量 $x_3 = [-1 \ 0 \ 0 \ 2]^T$,且有 $Ax_3 = x_2 + 2x_3$ 。

关于 λ_2 =4的一个特征向量是 x_4 =[2 0 1 0]^T。

于是, 若取

$$P = \begin{bmatrix} 0 & 0 & -1 & 2 \\ -1 & 0 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & 0 & 1 \\ 3 & 0 & 2 & 0 \end{bmatrix}$$

若取

$$P = \begin{bmatrix} 0 & 0 & -1 & 2 \\ -1 & 0 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & 0 & 1 \\ 3 & 0 & 2 & 0 \end{bmatrix}$$

它是可逆的,则有

$$P^{-1}AP = \begin{bmatrix} 2 & 1 & 1 \\ & 2 & 1 \\ & & 2 \end{bmatrix}$$

通过上面几个例子,可以对方阵A的Jordan标准的结构

得到下列几点结论:

- (1) A的Jordan标准形中子Jordan矩阵的数目等于A的不同的特征值的个数;
- (2)每个子Jordan矩阵的阶数等于相应的根空间的维数,亦即相应特征值的代数重数;
- (3)每个子Jordan矩阵中Jordan块的数目恰好等于相应特征值的线性无关的特征向量的个数,即特征子空间的维数,亦即相应特征值的几何重数;
- (4)每个子Jordan矩阵中Jordan块的最大阶数恰好等于相应特征值的指标,也即相应的根空间中根向量的最高级数。

例7 设

求办。

$$\mathbf{R}$$
 $J=-2I+U$,其中

$$U = \begin{bmatrix} 0 & 1 & & & \\ & 0 & 1 & & \\ & & 0 & 1 & \\ & & & 0 \end{bmatrix}$$

是幂零矩阵, U具有一些特殊的性质, 如

$$U^{2} = \begin{bmatrix} 0 & 0 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 1 \\ 0 & 0 & 0 \end{bmatrix}, U^{3} = \begin{bmatrix} 0 & 0 & 0 & 1 \\ 0 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 0 \end{bmatrix}, U^{4} = O$$

由于单位矩阵与任一方阵的乘积是可交换的, 所以

$$J^{5} = (-2I + U)^{5} = (-2I)^{5} + C_{5}^{1}(-2I)^{4}U + C_{5}^{2}(-2I)^{3}U^{2} + C_{5}^{3}(-2I)^{2}U^{3} + C_{5}^{4}(-2I)U^{4} + U^{5}$$

$$= (-2)^{5} I + 5 \cdot (-2)^{4} U + 10 \cdot (-2)^{3} U^{2}$$

$$+ 10 \cdot (-2)^{2} U^{3}$$

$$= (-2)^{5} I + 5 \cdot (-2)^{4} U + \frac{5 \cdot 4}{1 \cdot 2} (-2)^{3} U^{2}$$

$$+ \frac{5 \cdot 4 \cdot 3}{1 \cdot 2 \cdot 3} (-2)^{2} U^{3}$$

$$= \begin{bmatrix} (-2)^5 & 5 \cdot (-2)^4 & 10 \cdot (-2)^3 & 10 \cdot (-2)^2 \\ & (-2)^5 & 5 \cdot (-2)^4 & 10 \cdot (-2)^3 \\ & (-2)^5 & 5 \cdot (-2)^4 \\ & & (-2)^5 \end{bmatrix}$$