

**正规阵定义：若方阵  $A$  适合  $A^H A = AA^H$ ，则  $A$  叫正规阵。**

**注：**正规阵必为方阵（ $A^H A = AA^H$  叫正规条件）

例：1.  $A = \begin{pmatrix} 1 & -1 \\ 1 & 1 \end{pmatrix}$  正规， $\because A^H A = \begin{pmatrix} 2 & 0 \\ 0 & 2 \end{pmatrix} = AA^H \Rightarrow A$  为正规

2.  $A = \begin{pmatrix} i & -i \\ i & i \end{pmatrix}$  正规：因  $A^H A = \begin{pmatrix} 2 & 0 \\ 0 & 2 \end{pmatrix} = AA^H$

**备注：**由正规条件  $A^H A = AA^H$ ，且  $(A^H)^H = A$  可知

**“ $A$  正规  $\Leftrightarrow A^H$  正规，且  $A$  不正规  $\Leftrightarrow A^H$  不正规”**

**(记住) 常见正规阵：**

1. 对角阵  $A = \begin{pmatrix} a_1 & & 0 \\ & \ddots & \\ 0 & & a_n \end{pmatrix}$  必正规

$\because$

$$A^H A = \begin{pmatrix} \overline{a_1} & & 0 \\ & \ddots & \\ 0 & & \overline{a_n} \end{pmatrix} \begin{pmatrix} a_1 & & 0 \\ & \ddots & \\ 0 & & a_n \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} \overline{a_1} a_1 & & 0 \\ & \ddots & \\ 0 & & \overline{a_n} a_n \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} a_1 & & 0 \\ & \ddots & \\ 0 & & a_n \end{pmatrix} \begin{pmatrix} \overline{a_1} & & 0 \\ & \ddots & \\ 0 & & \overline{a_n} \end{pmatrix} = AA^H$$

例：  $A = \begin{pmatrix} i & 0 \\ 0 & 3i \end{pmatrix}$  对角必正规， $\because A^H A = \begin{pmatrix} 1 & 0 \\ 0 & 9 \end{pmatrix} = AA^H$

2. Hermite 阵与斜 Hermite 阵必正规（ $\because A^H = \pm A$ ）

$\because A^H A = AA^H = \pm AA$ ； 例  $A = \begin{pmatrix} 1 & -i \\ i & 1 \end{pmatrix}$  Hermite 必正规；  $B = \begin{pmatrix} i & -1 \\ 1 & i \end{pmatrix}$  斜 Hermit 正规

3. 实对称与实反对称阵都正规（ $\because A^T = \pm A \in R^{n \times n}$ ；且  $A^H = A^T$ ）

例： 实对称  $\begin{pmatrix} 2 & 1 \\ 1 & 2 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 0 & 1 & 1 \\ 1 & 0 & 1 \\ 1 & 1 & 0 \end{pmatrix}$  必正规； 实反对称  $\begin{pmatrix} 0 & -1 \\ 1 & 0 \end{pmatrix}$  必正规

4. 优阵(包含实正交阵)必正规  $\because A^H A = I = AA^H$  ( $A^H = A^{-1}$ )

例如，优阵  $A = \frac{1}{\sqrt{2}} \begin{pmatrix} i & 1 \\ 1 & i \end{pmatrix}$ ，优阵  $B = \begin{pmatrix} 0 & -i \\ i & 0 \end{pmatrix}$  (也是 hermit) 必正规

由已知正规阵可得新正规阵的方法如下:

倍数法则: 若  $A$  正规, 任取倍数  $k$ , 则  $kA$  正规, 特别  $-A$  正规 (证明显然)

例如

$$\begin{pmatrix} 0 & i & i \\ i & 0 & i \\ i & i & i \end{pmatrix} = i \begin{pmatrix} 0 & 1 & 1 \\ 1 & 0 & 1 \\ 1 & 1 & 0 \end{pmatrix}, \quad \begin{pmatrix} i & i \\ i & 2i \end{pmatrix} = i \begin{pmatrix} 1 & 1 \\ 1 & 2 \end{pmatrix} \text{ 都正规;}$$

$$\text{又例: } A = \frac{1}{\sqrt{2}} \begin{pmatrix} i & 1 \\ 1 & i \end{pmatrix} \text{ (U 阵) 正规} \Rightarrow \sqrt{2}A = \begin{pmatrix} i & 1 \\ 1 & i \end{pmatrix} = B \text{ 也正规}$$

平移法则: 若  $A$  正规, 则  $A \pm cI$  正规 ( $cI \pm A$  也正规)

$$\text{证: } (A + cI)^H (A + cI) = (A^H + \bar{c}I)(A + cI) \stackrel{A^H A = A A^H}{=} (A + cI)(A^H + \bar{c}I) = (A + cI)(A + cI)^H$$

即  $A + cI$  正规. 用  $-c$  代替  $c$  可知  $A - cI$  正规

由此可知

备注: 若  $A$  正规, 则  $I + A, I - A, cI \pm kA$  都正规

补充定理: 若  $A$  正规, 则  $A$  与  $A^H$  必有相同特征向量

即 若  $A$  正规, 且  $AX = cX$ , 则  $A^H X = \bar{c}X$

证明: 只要证  $(A^H - \bar{c}I)X = 0$ , 即  $(A - cI)^H X = 0$ .

因为  $(A - cI)X = 0$  可知  $|(A - cI)X|^2 = 0$ , 利用模长公式  $|X|^2 = X^H X$

$$\text{可得 } 0 = |(A - cI)X|^2 = ((A - cI)X)^H (A - cI)X = X^H (A - cI)^H (A - cI)X$$

利用平移法可知  $A - cI$  正规:  $(A - cI)^H (A - cI) = (A - cI)(A - cI)^H$

$$\text{故 } 0 = |(A - cI)X|^2 = X^H (A - cI)(A - cI)^H X = |(A - cI)^H X|^2$$

$$\text{即 } |(A - cI)^H X|^2 = 0 \Rightarrow (A - cI)^H X = 0 \Rightarrow A^H X = \bar{c}X \quad \text{证毕}$$

备注: 上面结论可写为 “若  $A$  正规, 则  $AX = cX \Leftrightarrow A^H X = \bar{c}X$ ”

备注: 若  $A$  的特根为  $\lambda(A) = \{\lambda_1, \dots, \lambda_n\}$ , 则  $A^H$  特根为

$$\lambda(A^H) = \{\bar{\lambda}_1, \dots, \bar{\lambda}_n\}$$

$$\text{例: } A = \begin{pmatrix} 0 & -1 \\ 1 & 0 \end{pmatrix} \text{ 正规, 则平移后 } A + tI = tI + A = \begin{pmatrix} t & -1 \\ 1 & t \end{pmatrix} \text{ 也正规}$$

$$\text{特别, } \begin{pmatrix} 1 & -1 \\ 1 & 1 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 0 & -1 \\ 1 & 0 \end{pmatrix} + I = A + I \text{ 正规}$$

优相似定理：若  $A$  正规，则  $Q^H A Q$  也正规，其中  $Q$  为优阵 ( $Q^H = Q^{-1}$ )

即，正规阵的优相似必正规

证明：  $\because A^H A = A A^H$  且  $Q^H Q = Q Q^H = I$ ，令  $B = Q^H A Q$  验证  $B^H B = B B^H$  如下：

$$B^H B = (Q^H A Q)^H Q^H A Q = Q^H A^H Q Q^H A Q = Q^H A^H A Q = Q^H A A^H Q$$

$$\text{且 } B B^H = Q^H A Q (Q^H A Q)^H = Q^H A Q Q^H A^H Q = Q^H A A^H Q \Rightarrow B^H B = B B^H \text{ 证毕}$$

.....

多项正规定理：若  $A$  正规阵，则  $f(A) = c_0 I + c_1 A + \dots + c_k A^k$  必正规（略证！）

其中  $f(x) = c_0 + c_1 x + \dots + c_k x^k$  为任一多项式

即，正规阵  $A$  的多项式  $f(A)$  也正规！

特注：若  $A$  正规，则  $I + A, I - A, aI \pm bA, kA$  都正规

$$\text{例： } A = \begin{pmatrix} 0 & -1 \\ 1 & 0 \end{pmatrix} \text{ 正规，则 } f(A) = 2iI + A + A^2 = \begin{pmatrix} 2i-1 & -1 \\ 1 & 2i-1 \end{pmatrix} \text{ 正规}$$

三角正规定理：三角正规阵一定是对角阵

$$\text{即，若三角阵 } B = \begin{pmatrix} b_1 & b_{12} & \cdots & b_{1n} \\ & b_2 & \cdots & b_{2n} \\ & & \ddots & \vdots \\ O & & & b_n \end{pmatrix} \text{ 正规，则 } B = \begin{pmatrix} b_1 & & & O \\ & b_2 & & \\ & & \ddots & \\ O & & & b_n \end{pmatrix} \text{ 为对角阵！}$$

（同理，下三角正规阵也是对角阵）

推论：严格三角阵（非对角阵）不是正规阵！

Pf: (只证  $n=3$ )

$$\text{设 } B = \begin{pmatrix} b_1 & b_{12} & b_{13} \\ & b_2 & b_{23} \\ 0 & & b_3 \end{pmatrix} \text{ 正规 } (B^H B = B B^H), B^H = \begin{pmatrix} \overline{b_1} & & 0 \\ \overline{b_{12}} & \overline{b_2} & \\ \overline{b_{13}} & \overline{b_{23}} & \overline{b_3} \end{pmatrix}$$

$$B B^H = \begin{pmatrix} b_1 & b_{12} & b_{13} \\ & b_2 & b_{23} \\ 0 & & b_3 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} \overline{b_1} & & 0 \\ \overline{b_{12}} & \overline{b_2} & \\ \overline{b_{13}} & \overline{b_{23}} & \overline{b_3} \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} |b_1|^2 + |b_{12}|^2 + |b_{13}|^2 & * & \\ & |b_{23}|^2 + |b_2|^2 & \\ * & & |b_3|^2 \end{pmatrix},$$

$$B^H B = \begin{pmatrix} |b_1|^2 & & * \\ & |b_{12}|^2 + |b_2|^2 & \\ * & & |b_{13}|^2 + |b_{23}|^2 + |b_3|^2 \end{pmatrix}, \text{ 比较可得}$$

$$\Rightarrow \begin{cases} |b_1|^2 = |b_1|^2 + |b_{12}|^2 + |b_{13}|^2 \\ |b_{12}|^2 + |b_2|^2 = |b_{23}|^2 + |b_2|^2 \Rightarrow 0 = |b_{12}|^2 + |b_{13}|^2 = 0, |b_{13}|^2 + |b_{23}|^2 = 0 \Rightarrow |b_{12}|^2 = 0, |b_{13}|^2 = 0, |b_{23}|^2 = 0 \\ |b_{13}|^2 + |b_{23}|^2 + |b_3|^2 = |b_3|^2 \end{cases}$$

$$\Rightarrow b_{12} = b_{13} = b_{23} = 0 \text{ 即 } B = \begin{pmatrix} b_1 & & \\ & b_2 & \\ & & b_3 \end{pmatrix} \text{ 对角形}$$

用递推方法, 可证  $n = n$  阶成立.

**练习题 1:** 若三角阵  $B = \begin{pmatrix} b_1 & c \\ 0 & b_2 \end{pmatrix}$  正规, 则  $B = \begin{pmatrix} b_1 & 0 \\ 0 & b_2 \end{pmatrix}$  为对角形

**练习题 2:** 若分块阵  $A = \begin{pmatrix} B & C \\ 0 & D \end{pmatrix}$  正规, 则  $C = 0$ , 且  $B, D$  都正规,  $A = \begin{pmatrix} B & 0 \\ 0 & D \end{pmatrix}$

其中“0 表示 0 阵”

**提示:** 设  $A = \begin{pmatrix} B & C \\ 0 & D \end{pmatrix}$  正规, 则  $A^H A = A A^H$ , 且  $A^H = \begin{pmatrix} B & C \\ 0 & D \end{pmatrix}^H = \begin{pmatrix} B^H & 0 \\ C^H & D^H \end{pmatrix}$

$$A^H A = \begin{pmatrix} B^H & 0 \\ C^H & D^H \end{pmatrix} \begin{pmatrix} B & C \\ 0 & D \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} B^H B & B^H C \\ C^H B & C^H C + D^H D \end{pmatrix},$$

$$A A^H = \begin{pmatrix} B & C \\ 0 & D \end{pmatrix} \begin{pmatrix} B^H & 0 \\ C^H & D^H \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} B B^H + C C^H & C D^H \\ D C^H & D D^H \end{pmatrix}, \text{ 比较 2 个对角元可得}$$

$$B B^H + C C^H = B^H B, \text{ 且 } D D^H = C^H C + D^H D, \text{ 则 } \text{tr}(B B^H) + \text{tr}(C C^H) = \text{tr}(B^H B)$$

利用迹换位公式:  $\text{tr}(B B^H) = \text{tr}(B^H B)$  代入上式可知  $\text{tr}(C C^H) = 0$

利用迹公式可写  $\text{tr}(C C^H) = \sum |c_{i,j}|^2 = 0$ , 其中  $C = (c_{i,j})$ , 必有  $C = 0$  (零阵)

且可知  $B B^H = B^H B$ ,  $D D^H = D^H D$ , 即  $B, D$  都正规.

**备注:** 利用习题 2 结论可直接证明“三角正规定理”(自己证明)

**三角正规定理: 三角正规阵一定是对角形**

**备注(推论): 严格三角阵(非对角形)不是正规阵!**

**反例:** 严格上三角  $A = \begin{pmatrix} 2 & 1 \\ 0 & 1 \end{pmatrix}, B = \begin{pmatrix} 0 & 1 \\ 0 & 0 \end{pmatrix}$  非正规 (不是正规阵)

由备注：“ $A$  正规 $\Leftrightarrow A^H$  正规，且  $A$  不正规 $\Leftrightarrow A^H$  不正规”

同理，严格下三角  $A^H = \begin{pmatrix} 2 & 0 \\ 1 & 1 \end{pmatrix}$ ,  $B^H = \begin{pmatrix} 0 & 0 \\ 1 & 0 \end{pmatrix}$  非正规

.....

**正规分解定理：** 若  $A = A_{n \times n}$  正规，则存在优阵  $Q$  ( $Q^H = Q^{-1}$ ) 使

$$Q^{-1}AQ = Q^H A Q = D = \begin{pmatrix} \lambda_1 & & 0 \\ & \ddots & \\ 0 & & \lambda_n \end{pmatrix} \text{ (对角形)}$$

其中，特根  $\lambda_1, \dots, \lambda_n$  次序任意， $\lambda(A) = \{\lambda_1, \dots, \lambda_n\}$

证：设  $A = A_{n \times n}$  正规，由优相似定理， $Q^H A Q$  也正规 ( $Q$  为任一优阵)

用许尔公式，存在优阵  $Q$ ，使  $Q^H A Q = D = \begin{pmatrix} \lambda_1 & & * \\ & \ddots & \\ 0 & & \lambda_n \end{pmatrix}$  (上三角)

$\because B = Q^H A Q$  是正规三角阵，由“三角正规定理”可知，

$$D = \begin{pmatrix} \lambda_1 & & 0 \\ & \ddots & \\ 0 & & \lambda_n \end{pmatrix} \text{ 为对角}$$

$$\text{即 } Q^{-1}AQ = D = \begin{pmatrix} \lambda_1 & & 0 \\ & \ddots & \\ 0 & & \lambda_n \end{pmatrix} \text{ 成立}$$

备注：由  $Q^{-1}AQ = D$  为对角形，可知  $Q = (q_1, \dots, q_n)$  中列都是特向量：

$$Aq_1 = \lambda_1 q_1, \dots, Aq_n = \lambda_n q_n$$

另外，优阵  $Q = (q_1, \dots, q_n)$  中各列互正交  $q_1 \perp q_2, \dots \perp q_n$

**推论(记住)：** 正规阵  $A$  恰有  $n$  个正交特向 ( $q_1 \perp q_2, \dots \perp q_n$ )

$$\text{使 } Aq_1 = \lambda_1 q_1, \dots, Aq_n = \lambda_n q_n$$

注：正规分解定理也是本科“实对称阵定理”的推广

备注(补充定理)：正规阵不同特征根对应的特征向量正交！

即, 若正规阵A满足:  $AX = \lambda_1 X$ ,  $AY = \lambda_2 Y$ , 且  $\lambda_2 \neq \lambda_1$ , 则  $X \perp Y$

**Pf**(提示): 设  $AX = \lambda_1 X$ ,  $AY = \lambda_2 Y$ , 且  $\lambda_2 \neq \lambda_1$  要证明内积  $(X, Y) = 0$

由于内积定义  $(X, Y) = Y^H X$ , 且  $A$  正规可知  $A^H Y = \bar{\lambda}_2 Y$  (上面补充定理),

计算可得:

$$\begin{aligned}\lambda_2 (X, Y) &= (X, \bar{\lambda}_2 Y) = (X, A^H Y) = (A^H Y)^H X = Y^H A X = Y^H (AX) = (AX, Y) \\ (AX, Y) &= (\lambda_1 X, Y) = \lambda_1 (X, Y), \text{ 可知 } \lambda_2 (X, Y) = \lambda_1 (X, Y)\end{aligned}$$

因为  $\lambda_2 \neq \lambda_1$  且,  $(\lambda_2 - \lambda_1)(X, Y) = 0$ , 则  $(X, Y) = 0$  (正交) **证毕**

**正规分解方法: 先求特根**  $\lambda_1, \dots, \lambda_n$ , 求正交特向量  $X_1 \perp \dots \perp X_n$

$$\text{令 优阵 } Q = (q_1, \dots, q_n) = \left( \frac{X_1}{|X_1|}, \dots, \frac{X_n}{|X_n|} \right)$$

$$\text{则有 正规分解 } Q^H A Q = D = \begin{pmatrix} \lambda_1 & & 0 \\ & \ddots & \\ 0 & & \lambda_n \end{pmatrix} \text{ 为对角}$$

$$\text{可写 正规分解 } A = Q D Q^H, \quad D = \begin{pmatrix} \lambda_1 & & 0 \\ & \ddots & \\ 0 & & \lambda_n \end{pmatrix} \text{ 为对角}$$

$$\text{例, } A = \begin{pmatrix} 0 & -1 \\ 1 & 0 \end{pmatrix} \text{ 正规, } \lambda_1 = i, \lambda_2 = -i \text{ (不同根), 取 } X_1 = \begin{pmatrix} i \\ 1 \end{pmatrix}, AX_1 = \begin{pmatrix} -1 \\ i \end{pmatrix} = i \begin{pmatrix} i \\ 1 \end{pmatrix} = iX_1$$

$$\text{取 } X_2 = \begin{pmatrix} 1 \\ i \end{pmatrix}, AX_2 = \begin{pmatrix} -i \\ 1 \end{pmatrix} = -i \begin{pmatrix} 1 \\ i \end{pmatrix} = -iX_2 \text{ 可知: } X_1 = \begin{pmatrix} i \\ 1 \end{pmatrix}, X_2 = \begin{pmatrix} 1 \\ i \end{pmatrix} \text{ 为 } A \text{ 的正交特向,}$$

$$(x_1 \perp x_2) \text{ 令 优阵 } Q = \left( \frac{x_1}{|x_1|}, \frac{x_2}{|x_2|} \right) = \frac{1}{\sqrt{2}} \begin{pmatrix} i & 1 \\ 1 & i \end{pmatrix}, \text{ 可得 } Q^H A Q = D = \begin{pmatrix} i & 0 \\ 0 & -i \end{pmatrix}$$

$$\text{例: (用 平移法) 令 } B = I + A = \begin{pmatrix} 1 & -1 \\ 1 & 1 \end{pmatrix} \text{ 正规, } \lambda(B) = \{\lambda_1, \lambda_2\} = \{1+i, 1-i\} \text{ 且}$$

$$x_1 = \begin{pmatrix} i \\ 1 \end{pmatrix}, x_2 = \begin{pmatrix} 1 \\ i \end{pmatrix} \text{ 为正交特向, 取 优阵 } Q = \frac{1}{\sqrt{2}} \begin{pmatrix} i & 1 \\ 1 & i \end{pmatrix} \quad (Q^H = Q^{-1})$$

$$\text{得 正规分解 } Q^H B Q = \begin{pmatrix} 1+i & 0 \\ 0 & 1-i \end{pmatrix}$$

例(平移法): 设  $A = \begin{pmatrix} 0 & -1 \\ 1 & 0 \end{pmatrix}$ ,  $B = 2iI + A = \begin{pmatrix} 2i & -1 \\ 1 & 2i \end{pmatrix}$  (正规)

$\lambda(B) = \{\lambda_1, \lambda_2\} = \{3i, i\}$  且  $x_1 = \begin{pmatrix} i \\ 1 \end{pmatrix}, x_2 = \begin{pmatrix} 1 \\ i \end{pmatrix}$  为正交特向

取  $Q = \frac{1}{\sqrt{2}} \begin{pmatrix} i & 1 \\ 1 & i \end{pmatrix}$  (优阵  $Q^H = Q^{-1}$ ), 得正规分解  $Q^H B Q = \begin{pmatrix} 3i & 0 \\ 0 & i \end{pmatrix}$

备注: 设 A 正规, 且  $Q^H A Q = D = \begin{pmatrix} \lambda_1 & & 0 \\ & \ddots & \\ 0 & & \lambda_n \end{pmatrix}$

设  $\lambda_1 \dots \lambda_n$  有  $s$  个不同(互异)根  $\lambda_1 \dots \lambda_s$ , 可把重根排在一起可写

$$B = \begin{pmatrix} \lambda_1 I_1 & & 0 \\ & \ddots & \\ 0 & & \lambda_s I_s \end{pmatrix}$$

$$\text{例如: } B = \begin{pmatrix} 2 & & & \\ & 2 & & \\ & & 3 & \\ & & & 3 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 2 \begin{pmatrix} 1 & \\ & 1 \end{pmatrix} & \\ & 3 \begin{pmatrix} 1 & \\ & 1 \end{pmatrix} \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 2I_1 & \\ & 3I_2 \end{pmatrix} \quad (I_1, I_2 \text{ 为小单位阵})$$

$$\text{可写正规分解: } Q^H A Q = B = \begin{pmatrix} \lambda_1 I_1 & & 0 \\ & \ddots & \\ 0 & & \lambda_s I_s \end{pmatrix}.$$

Ex.用法则或定义判定下列为正规:

$$(1) A = \begin{pmatrix} 1 & -1 \\ 1 & 1 \end{pmatrix} \quad (2) A = \begin{pmatrix} 1 & 1-i \\ 1+i & 0 \end{pmatrix} \quad (3) A = \begin{pmatrix} 1 & -i \\ i & 1 \end{pmatrix}$$

$$(4) A = \begin{pmatrix} 1 & -i & 0 \\ i & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 1 \end{pmatrix} \quad (5) A = \begin{pmatrix} 0 & 0 & 1 \\ 0 & 1 & 0 \\ 1 & 0 & 0 \end{pmatrix} \quad (6) A = \begin{pmatrix} 1 & 1 & 1 \\ 1 & 1 & 1 \\ 1 & 1 & 1 \end{pmatrix}$$

Ex2 求正规分解

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

Ex. 证: 斜 Hermite 阵  $A = -A^H$  的特征值全为纯虚或 0 (利用  $\frac{A}{i}$  为 Hermit 阵)