线性代数

第2讲,线性映射的基本概念

清华大学数学科学系 梁 恒

荷二楼215

liangh@mail.tsinghua.edu.cn

什么是"线性"

若
$$f(x) = x$$
, 则 $f(x+y) = x + y = f(x) + f(y)$

$$f(kx) = kx = kf(x)$$

若
$$f(x) = c$$
, 则 $f(x+y) = c \neq f(x) + f(y)$

$$f(kx) = c \neq kf(x)$$

若
$$f(x) = x^2$$
, 则 $f(x+y) = (x+y)^2 \neq x^2 + y^2 = f(x) + f(y)$

$$f(kx) = k^2 x^2 \neq kf(x)$$

线性就是1次,保持加法和数乘的运算关系

若
$$f$$
 $\begin{pmatrix} x_1 \\ x_2 \\ \vdots \\ x_m \end{pmatrix}$ $= a_1 x_1 + a_2 x_2 + \dots + a_m x_m$

加法

$$\text{If } \begin{bmatrix} x_1 \\ x_2 \\ \vdots \\ x_m \end{bmatrix} + \begin{bmatrix} y_1 \\ y_2 \\ \vdots \\ y_m \end{bmatrix} = f \begin{bmatrix} x_1 + y_1 \\ x_2 + y_2 \\ \vdots \\ x_m + y_m \end{bmatrix}$$

$$= a_1(x_1 + y_1) + a_2(x_2 + y_2) + \dots + a_m(x_m + y_m) = f \begin{bmatrix} x_1 \\ x_2 \\ \vdots \\ x_m \end{bmatrix} + f \begin{bmatrix} y_1 \\ y_2 \\ \vdots \\ y_m \end{bmatrix}$$

若
$$f$$
 $\begin{pmatrix} x_1 \\ x_2 \\ \vdots \\ x_m \end{pmatrix}$ $= a_1 x_1 + a_2 x_2 + \dots + a_m x_m$

$$\text{Mod } f \left[\begin{array}{c} x_1 \\ x_2 \\ \vdots \\ x_m \end{array} \right] = f \left[\begin{array}{c} kx_1 \\ kx_2 \\ \vdots \\ kx_m \end{array} \right]$$

$$= a_1(kx_1) + a_2(kx_2) + \dots + a_m(kx_m) = k \cdot f \begin{bmatrix} x_1 \\ x_2 \\ \vdots \\ x_m \end{bmatrix}$$

向量

定义 1.1.2 (向量) 一个
$$m$$
 元有序数组 $a=\begin{bmatrix}a_1\\a_2\\\vdots\\a_m\end{bmatrix}$ 称为一个 m 维向量,实数 a_1,\cdots,a_m

称为向量a的分量或坐标.

分量都是实数的 m 维向量的全体构成的集合记为 \mathbb{R}^m .

注 1.1.3 分量都是复数的 m 维向量的全体构成的集合记为 \mathbb{C}^m . 分量也可以取其他范围内的数,本书主要讨论分量为实数和复数的两种情形.

两个向量相等是指二者的每个分量都相等。向量常常用黑体小写字母表示¹,如 a. 由于分量纵向排列,向量又称为列向量。根据问题需要,向量也可以把分量横向排列,称为

行向量。为了与列向量区分,用符号
$$\mathbf{a}^{\mathrm{T}}$$
 表示,即如果 $\mathbf{a} = \begin{bmatrix} a_1 \\ \vdots \\ a_m \end{bmatrix}$,则 $\mathbf{a}^{\mathrm{T}} = \begin{bmatrix} a_1 & \cdots & a_m \end{bmatrix}$.



向量的加法和数乘运算

定义 1.1.4 (线性运算) 为 \mathbb{R}^m 中的向量定义两种运算²

1. 两个
$$m$$
 维向量的**向量加法**:
$$\begin{bmatrix} a_1 \\ \vdots \\ a_m \end{bmatrix} + \begin{bmatrix} b_1 \\ \vdots \\ b_m \end{bmatrix} := \begin{bmatrix} a_1 + b_1 \\ \vdots \\ a_m + b_m \end{bmatrix};$$

$$2.$$
 一个 m 维向量与一个数的**数乘**: $k \begin{bmatrix} a_1 \\ \vdots \\ a_m \end{bmatrix} := \begin{bmatrix} ka_1 \\ \vdots \\ ka_m \end{bmatrix}$;

向量的加法和数乘统称向量的线性运算.

带有线性运算的集合 \mathbb{R}^m ,称为向量空间 \mathbb{R}^m 或线性空间 \mathbb{R}^m .

注意,"线性空间 \mathbb{R}^m " 中的向量能做加法和数乘,而 "集合 \mathbb{R}^m " 则不能,二者并不是同一个数学对象. 另外,线性空间 \mathbb{R}^n 和线性空间 \mathbb{R}^m 中的向量在 $m \neq n$ 时无法做加法;线性空间 \mathbb{R}^m 上的数乘运算中的数,需要是实数.



向量 (线性) 空间

用加法和数乘运算,对向量进行管理,将向量组织起来

$$\begin{bmatrix} 13 \\ 15 \\ 18 \end{bmatrix} = 13 \cdot \begin{bmatrix} 1 \\ 0 \\ 0 \end{bmatrix} + 15 \cdot \begin{bmatrix} 0 \\ 1 \\ 0 \end{bmatrix} + 18 \cdot \begin{bmatrix} 0 \\ 0 \\ 1 \end{bmatrix}$$

$$\begin{bmatrix} a \\ b \\ c \end{bmatrix} = a \cdot \begin{bmatrix} 1 \\ 0 \\ 0 \end{bmatrix} + b \cdot \begin{bmatrix} 0 \\ 1 \\ 0 \end{bmatrix} + c \cdot \begin{bmatrix} 0 \\ 0 \\ 1 \end{bmatrix}$$

空间=集合+运算

m维向量空间=m维向量+加法与数乘运算

$$a = \begin{bmatrix} a_1 \\ a_2 \\ \vdots \\ a_m \end{bmatrix}, \quad b = \begin{bmatrix} b_1 \\ b_2 \\ \vdots \\ b_m \end{bmatrix}, \quad c = \begin{bmatrix} c_1 \\ c_2 \\ \vdots \\ c_m \end{bmatrix}$$

$$(a+b)+c = \begin{pmatrix} \begin{bmatrix} a_1 \\ a_2 \\ \vdots \\ a_m \end{bmatrix} + \begin{bmatrix} b_1 \\ b_2 \\ \vdots \\ b_m \end{bmatrix} + \begin{bmatrix} c_1 \\ c_2 \\ \vdots \\ c_m \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} a_1+b_1 \\ a_2+b_2 \\ \vdots \\ a_m+b_m \end{bmatrix} + \begin{bmatrix} c_1 \\ c_2 \\ \vdots \\ c_m \end{bmatrix}$$

$$= \begin{bmatrix} a_1 + b_1 + c_1 \\ a_2 + b_1 + c_1 \\ \vdots \\ a_m + b_m + c_1 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} a_1 \\ a_2 \\ \vdots \\ a_m \end{bmatrix} + \begin{bmatrix} b_1 + c_1 \\ b_2 + c_2 \\ \vdots \\ b_m + c_m \end{bmatrix} = a + (b + c)$$

命题 1.1.5 向量加法和数乘满足如下八条运算法则:

- 1. 加法结合律: (a+b)+c=a+(b+c);
- 2. 加法交换律: a + b = b + a:

3. 零向量:存在
$$m$$
 维**零向量 0** = $\begin{bmatrix} 0 \\ \vdots \\ 0 \end{bmatrix}$,满足 $\mathbf{a} + \mathbf{0} = \mathbf{a}$;

4. 负向量: 对任意
$$\mathbf{a} = \begin{bmatrix} a_1 \\ \vdots \\ a_m \end{bmatrix}$$
,记 $-\mathbf{a} = \begin{bmatrix} -a_1 \\ \vdots \\ -a_m \end{bmatrix}$,它满足 $\mathbf{a} + (-\mathbf{a}) = \mathbf{0}$,称它为 \mathbf{a}

的负向量;

- 5. 单位数: 1a = a;
- 6. 数乘结合律: (kl)a = k(la);
- 7. 数乘关于数的分配律: (k+l)a = ka + la;
- 8. 数乘关于向量的分配律: k(a+b) = ka + kb.

4

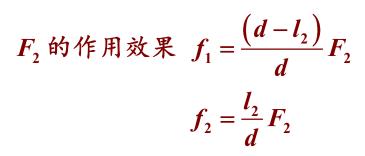
合并同类项

$$2a + 4(2a + (3b + 0)) + 4((a + (2 + 3)c) - a) = 10a + 12b + 20c.$$

$$a = \begin{bmatrix} a_1 \\ a_2 \\ \vdots \\ a_m \end{bmatrix}, \quad b = \begin{bmatrix} b_1 \\ b_2 \\ \vdots \\ b_m \end{bmatrix}, \quad c = \begin{bmatrix} c_1 \\ c_2 \\ \vdots \\ c_m \end{bmatrix}$$



叠加原理



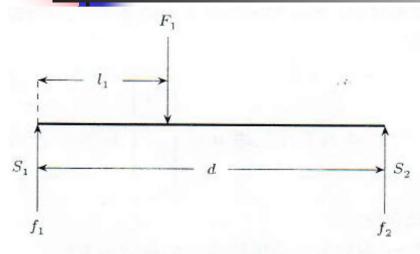


图 1.1.1: 桥墩载荷

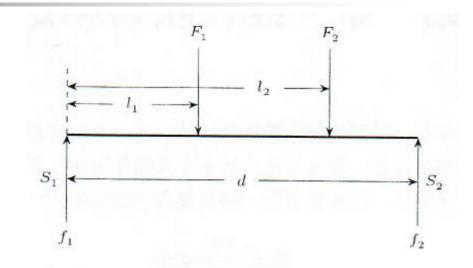


图 1.1.2: 桥墩载荷

$$F_1 \cdot (d - l_1) = f_1 \cdot d \Rightarrow f_1 = \frac{(d - l_1)}{d} F_1$$

$$F_1 \cdot l_1 = f_2 \cdot d \Rightarrow f_2 = \frac{l_1}{d} F_1$$

两个重物的线性系统可以表示成如下映射:

一般地,n个输入m个输出的线性系统可以表示成如下映射:

$$f \colon \mathbb{R}^{n} \to \mathbb{R}^{m}$$

$$\mathbf{x} = \begin{bmatrix} x_{1} \\ \vdots \\ x_{n} \end{bmatrix} \mapsto \mathbf{y} = \begin{bmatrix} y_{1} \\ y_{2} \\ \vdots \\ y_{m} \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} a_{11}x_{1} + \dots + a_{1n}x_{n} \\ a_{21}x_{1} + \dots + a_{2n}x_{n} \\ \vdots \\ a_{m1}x_{1} + \dots + a_{mn}x_{n} \end{bmatrix}$$

$$(1.1.1)$$

$$\begin{split} f(x+x') &= \begin{bmatrix} a_{11}(x_1+x_1') + \dots + a_{1n}(x_n+x_n') \\ \vdots \\ a_{m1}(x_1+x_1') + \dots + a_{mn}(x_n+x_n') \end{bmatrix} \\ &= \begin{bmatrix} a_{11}x_1 + \dots + a_{1n}x_n \\ \vdots \\ a_{m1}x_1 + \dots + a_{mn}x_n \end{bmatrix} + \begin{bmatrix} a_{11}x_1' + \dots + a_{1n}x_n' \\ \vdots \\ a_{m1}x_1' + \dots + a_{mn}x_n' \end{bmatrix} = f(x) + f(x'), \\ f(kx) &= \begin{bmatrix} a_{11}kx_1 + \dots + a_{1n}kx_n \\ \vdots \\ a_{m1}kx_1 + \dots + a_{mn}kx_n \end{bmatrix} = k \begin{bmatrix} a_{11}x_1 + \dots + a_{1n}x_n \\ \vdots \\ a_{m1}x_1 + \dots + a_{mn}x_n \end{bmatrix} = kf(x), \end{split}$$

其中
3
, $\boldsymbol{x} = \begin{bmatrix} x_1 \\ \vdots \\ x_n \end{bmatrix}$, $\boldsymbol{x}' = \begin{bmatrix} x_1' \\ \vdots \\ x_n' \end{bmatrix} \in \mathbb{R}^n$, $k \in \mathbb{R}$. 由观察可知,等式左边的 $\boldsymbol{x} + \boldsymbol{x}'$, $k\boldsymbol{x}$ 是 \mathbb{R}^n

中的线性运算, 而等式右边的 f(x) + f(x'), kf(x) 是 \mathbb{R}^m 中的线性运算.

定义 1.1.7 (线性映射) 映射 $f: \mathbb{R}^n \to \mathbb{R}^m$, 如果满足

- 1. 任取 $\mathbf{x}, \mathbf{x}' \in \mathbb{R}^n$, 都有 $f(\mathbf{x} + \mathbf{x}') = f(\mathbf{x}) + f(\mathbf{x}')$;
- 2. 任取 \mathbf{x} , $\in \mathbb{R}^n$, $k \in \mathbb{R}$, 都有 $f(k\mathbf{x}) = kf(\mathbf{x})$,

则称 f 为从 \mathbb{R}^n 到 \mathbb{R}^m 的线性映射.

定义域上的加法映射成陪域上的加法

定义域上的数乘映射成陪域上的数乘

$$f(ax+by) = af(x)+bf(y)$$

简单来说:线性映射保持线性运算

线性映射一定把零向量映射为零向量: $f(0_n) = 0_m$

定义 1.1.9 (线性变换) 从 \mathbb{R}^n 到自身的线性映射称为 \mathbb{R}^n 上的线性变换.

特别地, \mathbb{R}^n 上的 恒同变换

$$I = id: \mathbb{R}^n \to \mathbb{R}^n$$

$$x \mapsto x$$

$$(1.1.2)$$

是线性变换.

4

线性映射的例子

超市里面买水果,苹果、香蕉、樱桃,每公斤的价格分别是12.98、9.98和129.98元

设苹果
$$\boldsymbol{a} = \begin{bmatrix} 1 \\ 0 \\ 0 \end{bmatrix}$$
,香蕉 $\boldsymbol{b} = \begin{bmatrix} 0 \\ 1 \\ 0 \end{bmatrix}$,和樱桃 $\boldsymbol{c} = \begin{bmatrix} 0 \\ 0 \\ 1 \end{bmatrix}$

苹果、香蕉、樱桃各买 x_1, x_2, x_3 公斤

结账:
$$\mathbb{R}^3 \rightarrow \mathbb{R}$$
,
$$\begin{bmatrix} x_1 \\ x_2 \\ x_3 \end{bmatrix} \mapsto 12.98x_1 + 9.98x_2 + 129.98x_3.$$



线性映射的例子

假设每千克苹果含有 12 克纤维素和 135 克糖,每千克香蕉含有 12 克纤维素和 208 克糖,每千克樱桃含有 3 克纤维素和 99 克糖. 所有纤维素和糖的含量的组合组成一个二维线性空间 \mathbb{R}^2 ,设纤维素 $\mathbf{f} = \begin{bmatrix} 1 \\ 0 \end{bmatrix}$,糖 $\mathbf{s} = \begin{bmatrix} 0 \\ 1 \end{bmatrix}$. 把每种水果组合映射到对应的纤维素和糖的含量,是一个从 \mathbb{R}^3 到 \mathbb{R}^2 的映射,称为"营养":

营养:
$$\mathbb{R}^3 \to \mathbb{R}^2$$
,
$$\begin{bmatrix} x_1 \\ x_2 \\ x_3 \end{bmatrix} \mapsto \begin{bmatrix} 12x_1 + 12x_2 + 3x_3 \\ 135x_1 + 208x_2 + 99x_3 \end{bmatrix}.$$

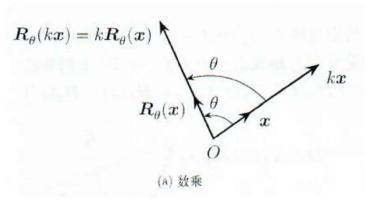
容易看出,这是一个线性映射.

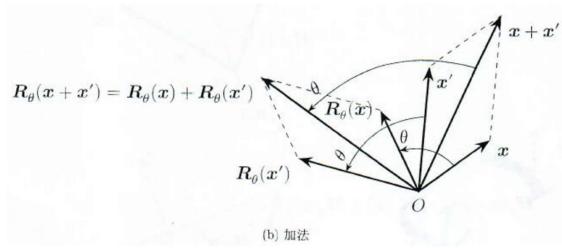
例 1.1.10 考虑例 1.1.6 中由平面向量构成的线性空间 \mathbb{R}^2 ,下面讨论平面 4 上的几类线性变换.



对任意实数 θ ,将所有向量绕原点逆时针旋转 θ 大小的角

这是一个 R^2 上的变换,记为 R_{θ} 。满足 $R_{\theta}(kx)=kR_{\theta}(x)$, $R_{\theta}(x+x')=R_{\theta}(x)+R_{\theta}(x')$





线性变换例1, 旋转变换:

$$\boldsymbol{R}_{\theta}\left(\begin{bmatrix}x_{1}\\x_{2}\end{bmatrix}\right) = \boldsymbol{R}_{\theta}\left(x_{1}\begin{bmatrix}1\\0\end{bmatrix} + x_{2}\begin{bmatrix}0\\1\end{bmatrix}\right) = x_{1}\boldsymbol{R}_{\theta}\left(\begin{bmatrix}1\\0\end{bmatrix}\right) + x_{2}\boldsymbol{R}_{\theta}\left(\begin{bmatrix}0\\1\end{bmatrix}\right).$$

容易知道,

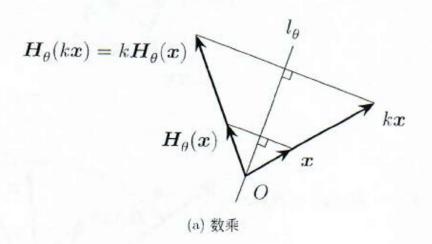
$$R_{\theta} \begin{pmatrix} \begin{bmatrix} 1 \\ 0 \end{bmatrix} \end{pmatrix} = \begin{bmatrix} \cos \theta \\ \sin \theta \end{bmatrix}, \quad R_{\theta} \begin{pmatrix} \begin{bmatrix} 0 \\ 1 \end{bmatrix} \end{pmatrix} = \begin{bmatrix} \cos(\theta + \frac{\pi}{2}) \\ \sin(\theta + \frac{\pi}{2}) \end{bmatrix},$$

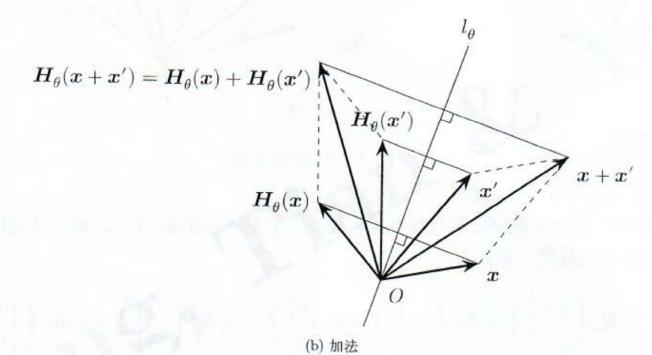
因此

$$\boldsymbol{R}_{\boldsymbol{\theta}} \left(\begin{bmatrix} x_1 \\ x_2 \end{bmatrix} \right) = x_1 \begin{bmatrix} \cos \boldsymbol{\theta} \\ \sin \boldsymbol{\theta} \end{bmatrix} + x_2 \begin{bmatrix} -\sin \boldsymbol{\theta} \\ \cos \boldsymbol{\theta} \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} x_1 \cos \boldsymbol{\theta} - x_2 \sin \boldsymbol{\theta} \\ x_1 \sin \boldsymbol{\theta} + x_2 \cos \boldsymbol{\theta} \end{bmatrix}.$$

注意,线性映射 \mathbf{R}_0 仅仅由它在 $\begin{bmatrix} 1 \\ 0 \end{bmatrix}$ 和 $\begin{bmatrix} 0 \\ 1 \end{bmatrix}$ 这两个向量上的取值决定。这是线性 映射最特殊的地方。我们称 $\begin{bmatrix} 1 \\ 0 \end{bmatrix}$ 和 $\begin{bmatrix} 0 \\ 1 \end{bmatrix}$ 这两个向量为 \mathbb{R}^2 的标准坐标向量。

2. **反射变换**: 给定直线 l_{θ} : $x_{2}\cos\theta - x_{1}\sin\theta = 0$, 其中 θ 是直线与 x_{1} 坐标轴的夹角. 任意向量关于 l_{θ} 的反射,定义了一个 \mathbb{R}^{2} 上的变换,记为 H_{θ} . 图 1.1.4 证明了 $H_{\theta}(kx) = kH_{\theta}(x)$, $H_{\theta}(x+x') = H_{\theta}(x) + H_{\theta}(x')$.





因此,反射变换 H_{θ} 是线性变换. 类似地,由于

$$m{H}_{ heta}\left(egin{bmatrix} 1 \\ 0 \end{bmatrix}
ight) = egin{bmatrix} \cos 2 heta \\ \sin 2 heta \end{bmatrix}, \quad m{H}_{ heta}\left(egin{bmatrix} 0 \\ 1 \end{bmatrix}
ight) = egin{bmatrix} \cos(2 heta - rac{\pi}{2}) \\ \sin(2 heta - rac{\pi}{2}) \end{bmatrix},$$

因此

$$\boldsymbol{H}_{\boldsymbol{\theta}}\left(\begin{bmatrix}x_1\\x_2\end{bmatrix}\right) = x_1\begin{bmatrix}\cos 2\theta\\\sin 2\theta\end{bmatrix} + x_2\begin{bmatrix}\sin 2\theta\\-\cos 2\theta\end{bmatrix} = \begin{bmatrix}x_1\cos 2\theta + x_2\sin 2\theta\\x_1\sin 2\theta - x_2\cos 2\theta\end{bmatrix}.$$

特别地,如果直线就是 x_1 坐标轴,即 $\theta=0$,则 $\boldsymbol{H}_{\theta}\left(\begin{bmatrix}x_1\\x_2\end{bmatrix}\right)=\begin{bmatrix}x_1\\-x_2\end{bmatrix}$.

3. **对换变换**: 对换 \mathbb{R}^2 中向量的两个分量 x_1, x_2 也构成一个线性变换:

$$P \colon \mathbb{R}^2 \longrightarrow \mathbb{R}^2$$

$$\begin{bmatrix} x_1 \\ x_2 \end{bmatrix} \mapsto \begin{bmatrix} x_2 \\ x_1 \end{bmatrix}.$$

可以看到,其实 P 也是关于直线 $x_2 - x_1 = 0$ 的反射.

4. **伸缩变换**: 设 $k \in \mathbb{R}$, 定义一个 \mathbb{R}^2 上的变换 C_k , 它把向量在 x_1 方向拉伸 k 倍, x_2 方向保持不变, 其表达式为:

$$\begin{array}{ccc} \boldsymbol{C}_k \colon & \mathbb{R}^2 & \to & \mathbb{R}^2 \\ \begin{bmatrix} x_1 \\ x_2 \end{bmatrix} & \mapsto & \begin{bmatrix} kx_1 \\ x_2 \end{bmatrix}. \end{array}$$

容易验证 C_k 是线性变换. 它把单位正方形 $\{0 \le x_1 \le 1, 0 \le x_2 \le 1\}$ 映射成矩形 $\{0 \le x_1 \le k, 0 \le x_2 \le 1\}$.

- 5. **投影变换**: 对伸缩变换 C_k , 取 k=0, 得到的变换是对 x_2 轴的投影 C_0 .
- 6. **错切变换**: 设 $k \in \mathbb{R}$, 定义 \mathbb{R}^2 上的一个变换 S_k , 它把 x_1 方向的 k 倍加到 x_2 方向上,并保持 x_1 方向不变,其表达式为:

$$\begin{array}{cccc} S_k \colon & \mathbb{R}^2 & \to & \mathbb{R}^2 \\ & \begin{bmatrix} x_1 \\ x_2 \end{bmatrix} & \mapsto & \begin{bmatrix} x_1 \\ kx_1 + x_2 \end{bmatrix}. \end{array}$$

容易验证 S_k 是线性变换. 它把单位正方形 $\{0 \le x_1 \le 1, 0 \le x_2 \le 1\}$ 映射成平行 四边形 $\{0 \le x_1 \le 1, kx_1 \le x_2 \le kx_1 + 1\}$,而面积保持不变. ②

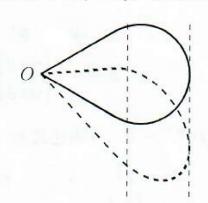


图 1.1.5: 错切变换

4

不是线性变换的例子

1. 平面上的平移变换: 设 $a=\begin{bmatrix}a_1\\a_2\end{bmatrix}$ 是平面向量, $T_a\colon\mathbb{R}^2\to\mathbb{R}^2$ 是关于向量 a 的平移,其表达式为:

$$\begin{array}{cccc} \boldsymbol{T_a} \colon & \mathbb{R}^2 & \to & \mathbb{R}^2 \\ & \begin{bmatrix} x_1 \\ x_2 \end{bmatrix} & \mapsto & \begin{bmatrix} x_1 + a_1 \\ x_2 + a_2 \end{bmatrix}. \end{array}$$

当 $a \neq 0$ 时, $T_a(0) = 0 + a = a$,即 T_a 不保持零向量,因此不是线性映射. 类似地,如果直线 l 不经过原点,那么关于 l 的反射变换就不是线性映射.

2. 取长度: 定义映射 $l: \mathbb{R}^2 \to \mathbb{R}$, 它将平面上的任意向量 x 映射到这个向量的长度. 其表达式为:

$$l \colon \mathbb{R}^2 \to \mathbb{R}$$

$$\begin{bmatrix} x_1 \\ x_2 \end{bmatrix} \mapsto \sqrt{x_1^2 + x_2^2}.$$

3. 绕圆旋转: 定义映射 $c: \mathbb{R} \to \mathbb{R}^2$, 它将输入的角度映射到单位圆上对应的位置. 如果将输入看作时间,那么这个映射就可以看作是一个点匀速绕定点旋转.

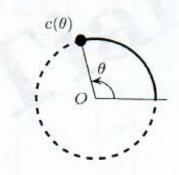


图 1.1.6: 匀速圆周运动

这个映射的表达式为:

$$c: \mathbb{R} \to \mathbb{R}^2$$

$$\theta \mapsto \begin{bmatrix} \cos \theta \\ \sin \theta \end{bmatrix}.$$

4. 齐次非线性: 定义映射 $f: \mathbb{R}^2 \to \mathbb{R}$. 其表达式为:

$$f \colon \quad \mathbb{R}^2 \quad \to \quad \mathbb{R}$$

$$\begin{bmatrix} x_1 \\ x_2 \end{bmatrix} \quad \mapsto \quad (x_1^3 + x_2^3)^{\frac{1}{3}}.$$

注意,这个映射虽然满足 f(ka) = kf(a), 但是 $f(a+b) \neq f(a) + f(b)$.

作业 (9月15日)

练习1.1

5 (2, 3, 6, 8), 6, 9, 11, 12

9月18日提交

4

作业分组信息 (按学号)

第一组: 学号≤2021010585

第二组: 2021010585<学号≤2021011551

第三组: 2021011551<学号≤2021012653

第四组: 2021012653<学号