

SF1681 LINJÄR ALGEBRA, FORTSÄTTNINGSKURS FÖRELÄSNING 8

DAVID RYDH

8. REKURSION OCH DIFFERENTIALEKVATIONER; ADJUNGERADE OPERATORER OCH SJÄLVADJUNGERADE OPERATORER

Målet för idag.

- Tillämpningar på egenvärden och egenvektorer
 - Rekursion
 - Ordinära differentialekvationer
- Adjungerade operatorer L^\dagger och deras matriser
- Självdjungeoperatorer och deras matriser
- Egenvärden och egenvektorer till självdjungeoperatorer

Linjär rekursion.

Definition 8.1. En *linjär rekursion* (av ordning m) är en talföljd x_0, x_1, \dots som ges av

$$x_n = \sum_{i=1}^m a_{m-i} x_{n-i}, \quad \forall n \geq m$$

tillsammans med begynnelsedata x_0, x_1, \dots, x_{m-1} . Här är a_0, a_1, \dots, a_{m-1} och x_0, x_1, \dots tal ur en fixerad kropp k (alternativt skulle man kunna jobba med heltalen eller en godtycklig så kallad ring).

Anmärkning 8.2. Genom att betrakta vektorerna $\mathbf{y}(n) = (x_n, x_{n-1}, \dots, x_{n-m+1})$ kan rekursionen skrivas som $\mathbf{y}(n) = A\mathbf{y}(n-1)$ för alla $n \geq m$.

$$\underbrace{\begin{bmatrix} x_n \\ x_{n-1} \\ \vdots \\ x_{n-m+2} \\ x_{n-m+1} \end{bmatrix}}_{\mathbf{y}(n)} = \underbrace{\begin{bmatrix} a_{m-1} & a_{m-2} & \cdots & a_1 & a_0 \\ 1 & 0 & \cdots & 0 & 0 \\ 0 & 1 & \cdots & 0 & 0 \\ \vdots & \vdots & \ddots & \vdots & \vdots \\ 0 & 0 & \cdots & 1 & 0 \end{bmatrix}}_A \underbrace{\begin{bmatrix} x_{n-1} \\ x_{n-2} \\ \vdots \\ x_{n-m+1} \\ x_{n-m} \end{bmatrix}}_{\mathbf{y}(n-1)}$$

Begynnelsedata är alltså samlade i begynnelsevektorn $\mathbf{y}(m-1)$. Man kan visa att det karakteristiska polynomet till A är

$$p_A(x) = x^m - a_{m-1}x^{m-1} - a_{m-2}x^{m-2} - \cdots - a_1x - a_0$$

(använda radutveckling kring den första raden för att beräkna determinanten av $xI - A$).

Exempel 8.3. Fibonaccitalen ges av rekursionen

$$x_n = x_{n-1} + x_{n-2}, \quad n \geq 2$$

med begynnelsedata $x_0 = 0, x_1 = 1$. Vi kan skriva det som

$$\mathbf{y}(n) = \begin{bmatrix} 1 & 1 \\ 1 & 0 \end{bmatrix} \mathbf{y}(n-1), \quad \mathbf{y}(1) = \begin{bmatrix} 1 \\ 0 \end{bmatrix}$$

och egenvärdena ges av

$$\lambda_{\pm} = \frac{\text{tr}(A)}{2} \pm \sqrt{\left(\frac{\text{tr}(A)}{2}\right)^2 - \det(A)} = \frac{1}{2} \pm \frac{\sqrt{5}}{2}.$$

Om motsvarande egenvektorer är ξ_+ och ξ_- så kan vi skriva begynnelsevektorn

$$\mathbf{y}(1) = \begin{bmatrix} x_1 \\ x_0 \end{bmatrix} = \alpha_+ \xi_+ + \alpha_- \xi_-$$

vilket ger

$$\begin{bmatrix} x_n \\ x_{n-1} \end{bmatrix} = \mathbf{y}(n) = A^{n-1} \mathbf{y}(1) = \alpha_+ \lambda_+^{n-1} \xi_+ + \alpha_- \lambda_-^{n-1} \xi_-$$

Låt $\lambda = \lambda_+ = \frac{1+\sqrt{5}}{2}$. Då är $\lambda_- = -\lambda^{-1}$ (ty $\det A = -1 = \lambda_+ \lambda_-$) och egenvektorerna är

$$\xi_+ = \begin{bmatrix} \lambda \\ 1 \end{bmatrix} \quad \text{och} \quad \xi_- = \begin{bmatrix} -\lambda^{-1} \\ 1 \end{bmatrix}$$

($\lambda^2 = \lambda + 1$). Konstanterna α_+ och α_- bestäms till

$$\alpha_+ = \frac{1}{\sqrt{5}}, \quad \alpha_- = \frac{-1}{\sqrt{5}}$$

och alltså

$$x_n = \alpha_+ \lambda^n + \alpha_- (-\lambda)^{-n} = \frac{1}{\sqrt{5}} \left(\frac{1+\sqrt{5}}{2} \right)^n - \frac{1}{\sqrt{5}} \left(\frac{1-\sqrt{5}}{2} \right)^n$$

Utveckling i diskret tid. Vid vissa tillämpningar har vi tillståndsvektorer som ändras stegvis $\mathbf{x}(0), \mathbf{x}(1), \mathbf{x}(2), \dots$ i k^n och som uppfyller relationen

$$\mathbf{x}(i) = A\mathbf{x}(i-1), \quad i \geq 1$$

för en matris A . Vi såg att linjär rekursion är ett sådant fall.

Om vi kan diagonalisera A kan vi uttrycka allt i termer egenvektorer och vi får

$$\mathbf{x}(i) = A^i \mathbf{x}(0) = \sum_j \alpha_j (\lambda_j)^i \xi_j$$

där $A\xi_i = \lambda_i \xi_i$ och $\mathbf{x}(0) = \sum_j \alpha_j \xi_j$.

Större Jordanblock. Om $n \times n$ -matrisen A inte är diagonaliserbar, men vi har att $\oplus \tilde{E}_\lambda = k^n$, dvs att de generaliserade egenrummen spänner upp k^n (vilket inträffar om A har n stycken egenvärden räknat med algebraisk multiplicitet, t ex $k = \mathbb{C}$) kan vi hantera de generaliserade egenrummen i Jordanblock. För ett block Λ av storlek $s \times s$ med egenvärde λ har vi att $\Lambda = \lambda I + N$ och

$$\begin{bmatrix} \lambda & 1 & \cdots & 0 & 0 \\ 0 & \lambda & \cdots & 0 & 0 \\ \vdots & \vdots & \ddots & \vdots & \vdots \\ 0 & 0 & \cdots & \lambda & 1 \\ 0 & 0 & \cdots & 0 & \lambda \end{bmatrix}^i = \left(\begin{bmatrix} \lambda & \cdots & 0 & 0 \\ 0 & \lambda & \cdots & 0 \\ \vdots & \vdots & \ddots & \vdots \\ 0 & 0 & \cdots & \lambda \\ 0 & 0 & \cdots & 0 & \lambda \end{bmatrix} + \begin{bmatrix} 0 & 1 & \cdots & 0 & 0 \\ 0 & 0 & \cdots & 0 & 0 \\ \vdots & \vdots & \ddots & \vdots & \vdots \\ 0 & 0 & \cdots & 0 & 1 \\ 0 & 0 & \cdots & 0 & 0 \end{bmatrix} \right)^i$$

$$= \begin{bmatrix} \lambda^i & \binom{i}{1}\lambda^{i-1} & \dots & \binom{i}{s-2}\lambda^{i-s+2} & \binom{i}{s-1}\lambda^{i-s+1} \\ 0 & \lambda^i & \dots & \binom{i}{s-3}\lambda^{i-s+3} & \binom{i}{s-2}\lambda^{i-s+2} \\ \vdots & \vdots & \ddots & \vdots & \vdots \\ 0 & 0 & \dots & \lambda^i & \binom{i}{1}\lambda^{i-1} \\ 0 & 0 & \dots & 0 & \lambda^i \end{bmatrix}$$

Exempel 8.4. Om vi har $x_{n+1} = 4x_n - 4x_{n-1}$ får vi matrisen

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

med karakteristiskt polynom $p_A(x) = (x-2)^2$. Den är inte diagonaliserbar och vi bestämmer generaliserade egenvektorer som får matrisen på Jordans normalform.

$$\xi_1 = \begin{bmatrix} 2 \\ 1 \end{bmatrix} \in \ker \begin{bmatrix} 2 & -4 \\ 1 & -2 \end{bmatrix} \quad \text{och} \quad \xi_2 = \begin{bmatrix} 1 \\ 0 \end{bmatrix} \quad \text{eftersom} \quad \xi_1 = (A - 2I)\xi_2$$

Vi får att

$$A^n = (2I + (A - 2I))^n = 2^n I^n + n2^{n-1}I^{n-1}(A - 2I) = 2^n I + n2^{n-1}(A - 2I)$$

med hjälp av binomialsatsen eftersom $(A - 2I)^2 = 0$. Explicit ger det

$$A^n = \begin{bmatrix} 4 & -4 \\ 1 & 0 \end{bmatrix}^n = 2^n \begin{bmatrix} 1 & 0 \\ 0 & 1 \end{bmatrix} + n2^{n-1} \begin{bmatrix} 2 & -4 \\ 1 & -2 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} (1+n)2^n & -n2^{n+1} \\ n2^{n-1} & (1-n)2^n \end{bmatrix}.$$

Om vi skriver $\mathbf{x}(0) = \alpha_1 \xi_1 + \alpha_2 \xi_2$ får vi

$$\begin{aligned} A^n \mathbf{x}(0) &= \alpha_1 A^n \xi_1 + \alpha_2 A^n \xi_2 = \alpha_1 (2^n I + n2^{n-1}(A - 2I)) \xi_1 + \alpha_2 (2^n I + n2^{n-1}(A - 2I)) \xi_2 \\ &= \alpha_1 2^n \xi_1 + \alpha_2 (2^n \xi_2 + n2^{n-1} \xi_1) = (2^n \alpha_1 + n2^{n-1} \alpha_2) \xi_1 + 2^n \alpha_2 \xi_2. \end{aligned}$$

Utveckling i kontinuerlig tid. I andra tillämpningar beror tillståndsvektorerna på tiden som $\mathbf{x}(t)$ och uppfyller en första ordningens linjär differentialekvation

$$\mathbf{x}'(t) = A\mathbf{x}(t)$$

med begynnelsevärden $\mathbf{x}(0) = \mathbf{x}_0$.

Lösningen kan skrivas som $\mathbf{x}(t) = \exp(At)\mathbf{x}_0$ och om vi kan diagonalisera får vi

$$\mathbf{x}(t) = \sum_j \alpha_j \exp(\lambda_j t) \xi_j$$

där $A\xi_i = \lambda_i \xi_i$ och $\mathbf{x}_0 = \sum_j \alpha_j \xi_j$.

Kan vi inte diagonalisera kan vi välja en bas av generaliserade egenvektorer (inte nödvändigtvis en Jordan-bas) så att matrisen blir blockdiagonal med ett egenvärde per block och skriva $A = D + N$ där D är diagonal och N är nilpotent och D och N kommuterar och vi får formeln

$$\exp(At) = \exp(Dt) \exp(Nt) = \exp(Dt) \left(1 + Nt + \frac{N^2}{2}t^2 + \dots + \frac{N^{n-1}}{(n-1)!}t^{n-1} \right)$$

Högre ordningen. Om vi har en högre ordningens linjärt system av differentialekvationer

$$\mathbf{x}''(t) = A\mathbf{x}(t) + B\mathbf{x}'(t)$$

kan vi omformulera det som en första ordningens differentialekvation genom

$$\begin{bmatrix} \mathbf{x}'(t) \\ \mathbf{x}''(t) \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 0 & I \\ A & B \end{bmatrix} \begin{bmatrix} \mathbf{x}(t) \\ \mathbf{x}'(t) \end{bmatrix}$$

och vi får

$$\begin{bmatrix} \mathbf{x}(t) \\ \mathbf{x}'(t) \end{bmatrix} = \exp \left(\begin{bmatrix} 0 & It \\ At & Bt \end{bmatrix} \right) \begin{bmatrix} \mathbf{x}(0) \\ \mathbf{x}'(0) \end{bmatrix}$$

Adjungerad operator.

Definition 8.5. Om L är en operator på ett inre produktrum V är den *adjungerade operatör* L^\dagger unikt definierad av att

$$\langle L^\dagger(\mathbf{x}) | \mathbf{y} \rangle = \langle \mathbf{x} | L(\mathbf{y}) \rangle, \quad \forall \mathbf{x}, \mathbf{y} \in V.$$

Anmärkning 8.6. Vi behöver kontrollera att det finns en unik sådan operator. När V är ändligdimensionellt så följer det av att titta på matrisen (nästa avsnitt). När V är oändligdimensionellt så finns inte alltid L^\dagger .

Exempel 8.7. Betrakta operatör L på $\ell^2(\mathbb{R})$ definierad av $L(\mathbf{e}_i) = \mathbf{e}_{i+1}$, dvs $L((a_0, a_1, a_2, \dots)) = (0, a_0, a_1, a_2, \dots)$. Då är

$$\langle L^\dagger(\mathbf{e}_i) | \mathbf{e}_j \rangle = \langle \mathbf{e}_i | L(\mathbf{e}_j) \rangle = \langle \mathbf{e}_i | \mathbf{e}_{j+1} \rangle = \delta_{i, (j+1)}$$

Det följer att $L^\dagger(\mathbf{e}_i) = \mathbf{e}_{i-1}$, dvs $L^\dagger((a_0, a_1, a_2, \dots)) = (a_1, a_2, a_3, \dots)$. (Vi kan också notera att $L^\dagger \circ L$ är identiteten medan $L \circ L^\dagger$ inte är identiteten.)

Exempel 8.8. Betrakta operatör L på $\ell^2(\mathbb{R})$ definierad av $L(\mathbf{e}_i) = \mathbf{e}_1 + \mathbf{e}_2 + \dots + \mathbf{e}_i$. Då är

$$\langle L^\dagger(\mathbf{e}_i) | \mathbf{e}_j \rangle = \langle \mathbf{e}_i | L(\mathbf{e}_j) \rangle = \langle \mathbf{e}_i | \mathbf{e}_1 + \mathbf{e}_2 + \dots + \mathbf{e}_j \rangle = \begin{cases} 1 & \text{om } j \geq i \\ 0 & \text{annars} \end{cases}$$

Detta ger att $L(\mathbf{e}_i) = \mathbf{e}_i + \mathbf{e}_{i+1} + \dots = (0, 0, \dots, 0, 1, 1, 1, \dots)$ vilket inte är en konvergent följd. Därför existerar inte den adjungerade operatör.

Matrisen för den adjungerade operator.

Sats 8.9 (Sadun, Thm. 7.2). Om A är matrisen för L med avseende på en *ortonormal* bas $\{\mathbf{e}_i\}_{i \in I}$ ges matrisen A^\dagger för L^\dagger av

$$(A^\dagger)_{ij} = \overline{A_{ji}}.$$

Bevis.

$$(A^\dagger)_{ij} = \langle \mathbf{e}_i | L^\dagger(\mathbf{e}_j) \rangle = \overline{\langle L^\dagger(\mathbf{e}_j) | \mathbf{e}_i \rangle} = \overline{\langle \mathbf{e}_j | L(\mathbf{e}_i) \rangle} = \overline{A_{ji}} \quad \square$$

Definition 8.10. Det *Hermiteiska konjugatet* A^\dagger av en matris A är konjugatet av transponatet.

Alltså är $[L^\dagger]_{\mathcal{B}} = ([L]_{\mathcal{B}})^\dagger$.

Exempel 8.11. I Exempel 8.7 har vi:

$$[L]_{\mathcal{B}} = \begin{bmatrix} 0 & 0 & 0 & 0 & \dots \\ 1 & 0 & 0 & 0 & \dots \\ 0 & 1 & 0 & 0 & \dots \\ 0 & 0 & 1 & 0 & \dots \\ \vdots & \vdots & \vdots & \vdots & \ddots \end{bmatrix} \quad [L^\dagger]_{\mathcal{B}} = \begin{bmatrix} 0 & 1 & 0 & 0 & \dots \\ 0 & 0 & 1 & 0 & \dots \\ 0 & 0 & 0 & 1 & \dots \\ 0 & 0 & 0 & 0 & \dots \\ \vdots & \vdots & \vdots & \vdots & \ddots \end{bmatrix}$$

Exempel 8.12. I Exempel 8.8 har vi:

$$[L]_{\mathcal{B}} = \begin{bmatrix} 1 & 1 & 1 & 1 & \dots \\ 0 & 1 & 1 & 1 & \dots \\ 0 & 0 & 1 & 1 & \dots \\ 0 & 0 & 0 & 1 & \dots \\ \vdots & \vdots & \vdots & \vdots & \ddots \end{bmatrix} \quad [L]_{\mathcal{B}}^\dagger = \begin{bmatrix} 1 & 0 & 0 & 0 & \dots \\ 1 & 1 & 0 & 0 & \dots \\ 1 & 1 & 1 & 0 & \dots \\ 1 & 1 & 1 & 1 & \dots \\ \vdots & \vdots & \vdots & \vdots & \ddots \end{bmatrix}$$

Men $[L]_{\mathcal{B}}^\dagger$ är inte matrisen för en operator eftersom normen av varje kolumn är oändlig.

Självadjungerade operatorer och Hermiteska matriser.

Definition 8.13. En operator L på ett inre produktrum är *självadjungerad*, eller *Hermitesk*, om $L = L^\dagger$. En matris A är *Hermitesk* om $A = A^\dagger$.

Sats 8.14 (Sadun, Thm. 7.3). *En operator L är självadjungerad om och endast om matrisen för L är Hermitesk för varje val av ortonormal bas för V .*

Bevis. L är självadjungerad $\iff L = L^\dagger \iff [L]_{\mathcal{B}} = [L^\dagger]_{\mathcal{B}} = [L]_{\mathcal{B}}^\dagger$ (om \mathcal{B} är ortonormal). \square

Anmärkning 8.15. För reella inre produktrum är $A^\dagger = A^T$ och Hermiteska matriser är symmetriska matriser.

Eigenvärden och egenvektorer till självadjungerade operatorer.

Sats 8.16 (Sadun, Thm. 7.4(a)). *Eigenvärden till självadjungerade operatorer är reella.*

Bevis. $L(\xi) = \lambda \xi \implies \bar{\lambda} |\xi|^2 = \langle \lambda \xi | \xi \rangle = \langle L(\xi) | \xi \rangle = \langle \xi | L(\xi) \rangle = \langle \xi | \lambda \xi \rangle = \lambda |\xi|^2 \implies \bar{\lambda} = \lambda$. \square

Sats 8.17 (Sadun, Thm. 7.4(b)). *Egenvektorer till en självadjungerad operator som hör till olika eigenvärden är ortogonala.*

Bevis. Om $L(\xi_1) = \lambda_1 \xi_1$ och $L(\xi_2) = \lambda_2 \xi_2$ får vi

$$\lambda_1 \langle \xi_1 | \xi_2 \rangle = \langle L(\xi_1) | \xi_2 \rangle = \langle \xi_1 | L(\xi_2) \rangle = \lambda_2 \langle \xi_1 | \xi_2 \rangle$$

och $\langle \xi_1 | \xi_2 \rangle = 0$ om $\lambda_1 \neq \lambda_2$ \square

Ortogonal baser av egenvektorer.

Sats 8.18 (Sadun, Cor. 7.5). *Om L är självadjungerad och diagonaliserbar finns en ortogonal bas av egenvektorer.*

Bevis. Eftersom L är diagonaliserbar är $V = \bigoplus_{\lambda} E_{\lambda}$. Enligt förra satsen är $E_{\lambda} \perp E_{\mu}$ om $\lambda \neq \mu$. De ortogonala baserna för varje egenrum ger en ortogonal bas för V som består av egenvektorer till L . \square

Ortogonal diagonalisering av självadjungerade operatorer.

Sats 8.19 (Sadun, Thm. 7.6). *För en självadjungerad operator på ett ändligt dimensionellt inre produktrum över \mathbb{C} finns en ortogonal bas av egenvektorer.*

Bevis. Det finns minst ett eigenvärde λ . Tag $\xi \neq 0$ med $L(\xi) = \lambda \xi$ och låt $W = \text{Span}\{\xi\}$. Vi kan skriva $V = W \oplus W^\perp$ (explicit: vi har basen $\{\xi\}$ för W ; utöka till en bas \mathcal{B} för hela V och gör basen ortogonal med Gram-Schmidt; andra delen av basen är nu en ortogonal bas för W^\perp). Vidare är $L(W) \subseteq W$ eftersom ξ en egenvektor och $L(W^\perp) \subseteq W^\perp$ eftersom

$$\mathbf{y} \in W^\perp \implies \langle \mathbf{x} | L(\mathbf{y}) \rangle = \langle L(\mathbf{x}) | \mathbf{y} \rangle = \langle \lambda \mathbf{x} | \mathbf{y} \rangle = 0 \implies L(\mathbf{y}) \in W^\perp.$$

Alternativt kan vi skriva ner matrisen för L i basen \mathcal{B} . I blockform:

$$[L]_{\mathcal{B}} = \begin{bmatrix} \lambda_1 & * \\ 0 & B \end{bmatrix}$$

Eftersom $[L]_{\mathcal{B}}$ är Hermitesk så är $[L]_{\mathcal{B}}^\dagger = [L]_{\mathcal{B}}$. Alltså är radvektorn märkt med $*$ lika med noll-vektorn. Alltså är $[L]_{\mathcal{B}}$ block-diagonal och $L(W^\perp) \subseteq W^\perp$. Matrisen för restriktionen av L till W^\perp är B .

Per induktion över $\dim V$ kan vi anta att det finns ortogonal bas \mathcal{B}' av egenvektorer för L på W^\perp och vi får då att $\{\xi\} \cup \mathcal{B}'$ är en ortogonal bas av egenvektorer. (Basfallet för induktionen är trivialt.) \square

BILAGA A. LITE EXTRAMATERIAL SOM INTE TOGS UPP PÅ FÖRELÄSNINGEN

Duala avbildningar och duala operatorer. Lite mer om detta kommer i slutet av kursen.

Definition A.1. Om $L: V \longrightarrow W$ är en linjär avbildning ges den *duala avbildningen* $L^*: W^* \longrightarrow V^*$ av

$$L^*(\varphi)(\mathbf{x}) = \varphi(L(\mathbf{x})), \quad \forall \mathbf{x} \in V, \forall \varphi \in W^*.$$

Sats A.2. Om A är matrisen för L med avseende på baser $\{\mathbf{e}_1, \mathbf{e}_2, \dots, \mathbf{e}_n\}$ och $\{\mathbf{f}_1, \mathbf{f}_2, \dots, \mathbf{f}_m\}$ för V respektive W är A^T matrisen för L^* med avseende på de duala baserna $\{\mathbf{f}_1^*, \mathbf{f}_2^*, \dots, \mathbf{f}_m^*\}$, respektive $\{\mathbf{e}_1^*, \mathbf{e}_2^*, \dots, \mathbf{e}_n^*\}$.

Anmärkning A.3. Om L är en operator på ett reellt inre produktrum och $\mathcal{B} = \{\mathbf{e}_1, \mathbf{e}_2, \dots, \mathbf{e}_n\}$ är en ortogonal bas kan vi se V^* som V genom den inre produkten och den duala basen är \mathcal{B} . Den duala operatoren L^* sammanfaller då med den adjungerade operatoren L^\dagger .

För ett komplext inre produktrum gäller inte samma sak eftersom identifikationen av V med V^* som ges av den inre produkten inte är en linjär avbildning och därför inte en isomorfi av vektorrum.