

Квадратичные формы

Квадратичная форма

Краткий план:

- Определение квадратичной формы.

Краткий план:

- Определение квадратичной формы.
- Определённость формы.

Квадратичная форма

Определение

Многочлен от нескольких переменных $f(x_1, x_2, \dots, x_n)$, который содержит только слагаемые вида x_i^2 и $x_i x_j$ квадратичной формой.

Квадратичная форма

Определение

Многочлен от нескольких переменных $f(x_1, x_2, \dots, x_n)$, который содержит только слагаемые вида x_i^2 и $x_i x_j$ квадратичной формой.

Функция $f(x, y) = x^2 + 6xy - 7y^2$ — квадратичная форма.

Квадратичная форма

Определение

Многочлен от нескольких переменных $f(x_1, x_2, \dots, x_n)$, который содержит только слагаемые вида x_i^2 и $x_i x_j$ квадратичной формой.

Функция $f(x, y) = x^2 + 6xy - 7y^2$ — квадратичная форма.

Функция $f(x, y, z) = x^2 + 6xz - 8xy + 3z + 9$ — не квадратичная форма.

Зачем нужны квадратичные формы?

Многие функции хорошо аппроксимируются суммой вида

$$f(x, y) \approx 6 + 2x + 4y + 7x^2 + 8xy - 9y^2$$

Зачем нужны квадратичные формы?

Многие функции хорошо аппроксимируются суммой вида

$$f(x, y) \approx 6 + 2x + 4y + 7x^2 + 8xy - 9y^2$$

Свойства квадратичной формы позволяют понять свойства многих функций!

Квадратичная форма и матрицы

$$\begin{pmatrix} x_1 & x_2 & x_3 \end{pmatrix} \cdot \begin{pmatrix} 5 & -1 & -3 \\ -1 & 7 & 2 \\ -3 & 2 & 11 \end{pmatrix} \cdot \begin{pmatrix} x_1 \\ x_2 \\ x_3 \end{pmatrix} =$$

Квадратичная форма и матрицы

$$\begin{pmatrix} x_1 & x_2 & x_3 \end{pmatrix} \cdot \begin{pmatrix} 5 & -1 & -3 \\ -1 & 7 & 2 \\ -3 & 2 & 11 \end{pmatrix} \cdot \begin{pmatrix} x_1 \\ x_2 \\ x_3 \end{pmatrix} =$$
$$= 5x_1^2 + 7x_2^2 + 11x_3^2 - 2x_1x_2 - 6x_1x_3 + 4x_2x_3$$

Квадратичная форма и матрицы

$$\begin{pmatrix} x_1 & x_2 & x_3 \end{pmatrix} \cdot \begin{pmatrix} 5 & -1 & -3 \\ -1 & 7 & 2 \\ -3 & 2 & 11 \end{pmatrix} \cdot \begin{pmatrix} x_1 \\ x_2 \\ x_3 \end{pmatrix} =$$
$$= 5x_1^2 + 7x_2^2 + 11x_3^2 - 2x_1x_2 - 6x_1x_3 + 4x_2x_3$$

Утверждение

Любая квадратичная форма $f(\mathbf{x})$ может быть записана в виде

$$f(\mathbf{x}) = \mathbf{x}^T A \mathbf{x},$$

где A — симметричная матрица, $A^T = A$.

Квадратичные формы в нуле

Утверждение

Любая квадратичная форма f равна 0 в точке 0,

$$f(\mathbf{0}) = \mathbf{0}^T \cdot A \cdot \mathbf{0} = 0.$$

Квадратичные формы в нуле

Утверждение

Любая квадратичная форма f равна 0 в точке 0,

$$f(\mathbf{0}) = \mathbf{0}^T \cdot A \cdot \mathbf{0} = 0.$$

Нас будет интересовать знак формы $f(\mathbf{x})$ при $\mathbf{x} \neq \mathbf{0}$.

Положительно определённая форма

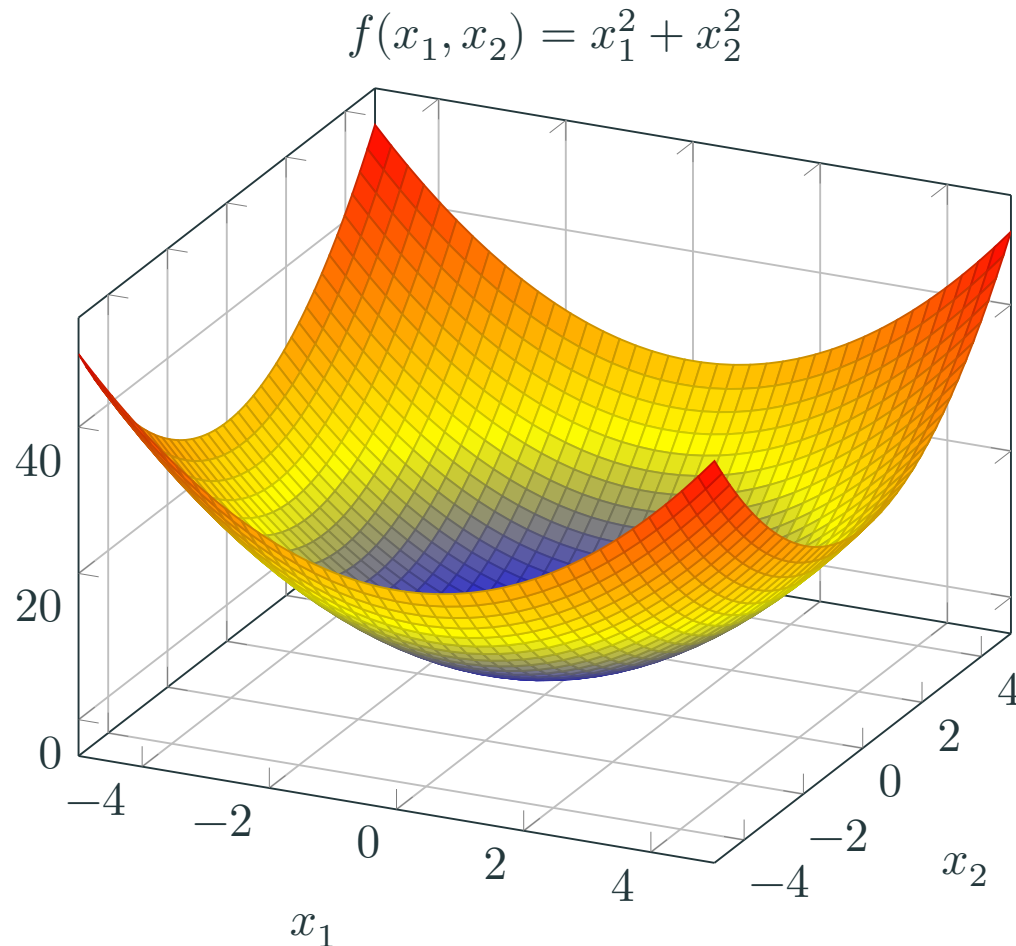
Определение

Форма f называется **положительно определённой**, если $f(\mathbf{x}) > 0$ при $\mathbf{x} \neq \mathbf{0}$.

Положительно определённая форма

Определение

Форма f называется **положительно определённой**, если $f(\mathbf{x}) > 0$ при $\mathbf{x} \neq \mathbf{0}$.



Отрицательно определённая форма

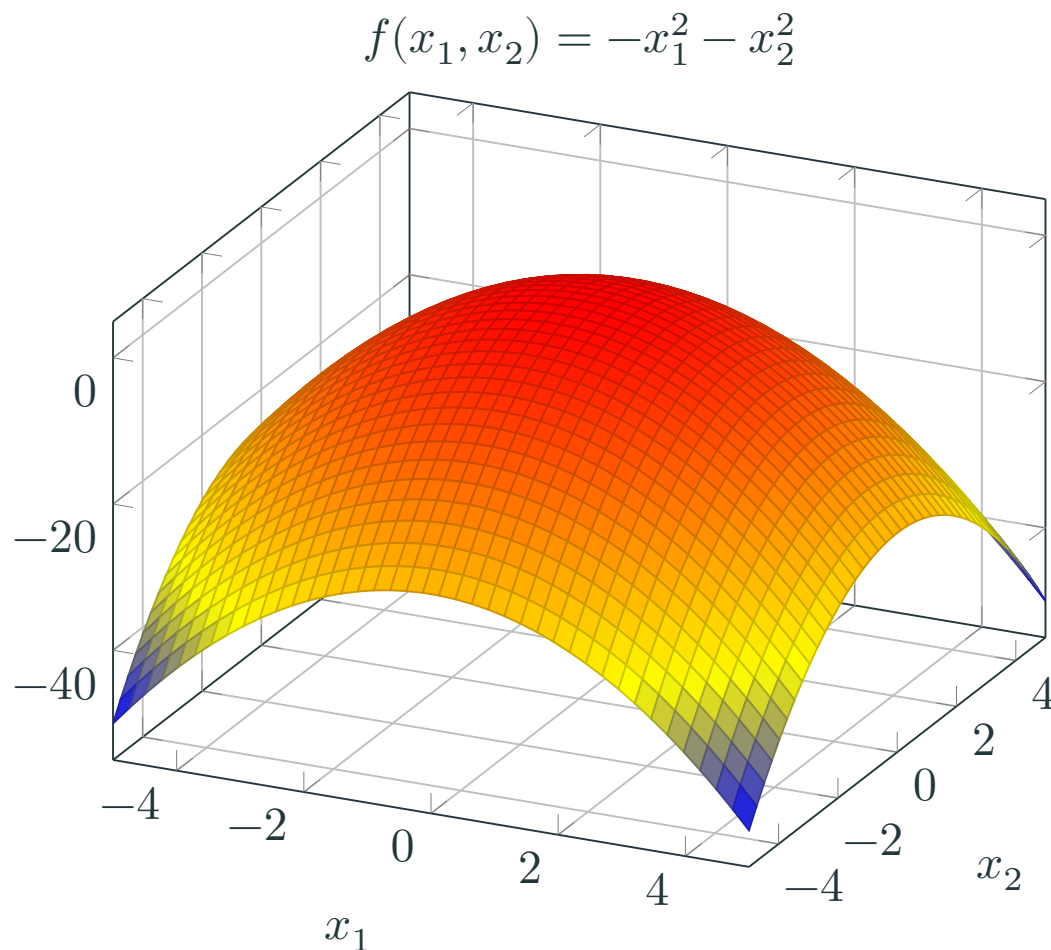
Определение

Форма f называется отрицательно определённой, если $f(\mathbf{x}) < 0$ при $\mathbf{x} \neq \mathbf{0}$.

Отрицательно определённая форма

Определение

Форма f называется **отрицательно определённой**, если $f(\mathbf{x}) < 0$ при $\mathbf{x} \neq \mathbf{0}$.



Положительно полуопределённая форма

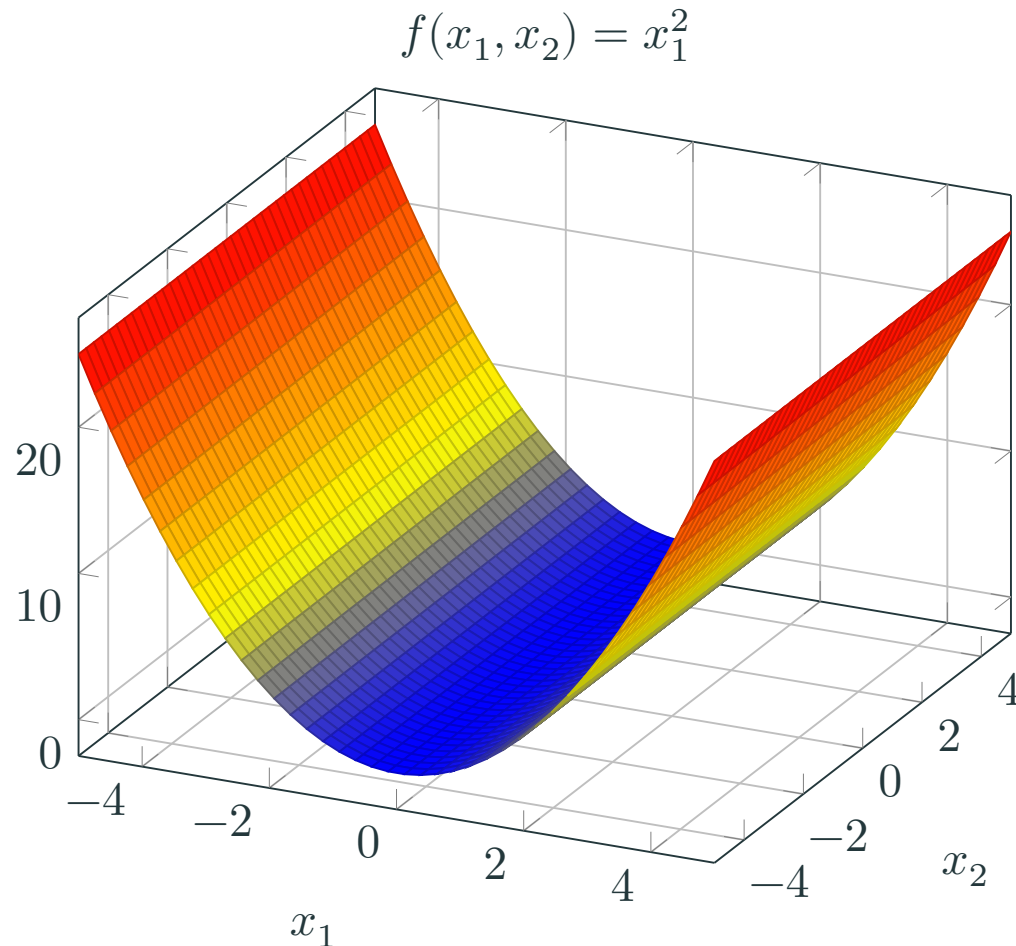
Определение

Форма f называется **положительно полуопределённой** или **неотрицательно определённой**, если $f(\mathbf{x}) \geq 0$.

Положительно полуопределённая форма

Определение

Форма f называется **положительно полуопределённой** или **неотрицательно определённой**, если $f(\mathbf{x}) \geq 0$.



Отрицательно полуопределённая форма

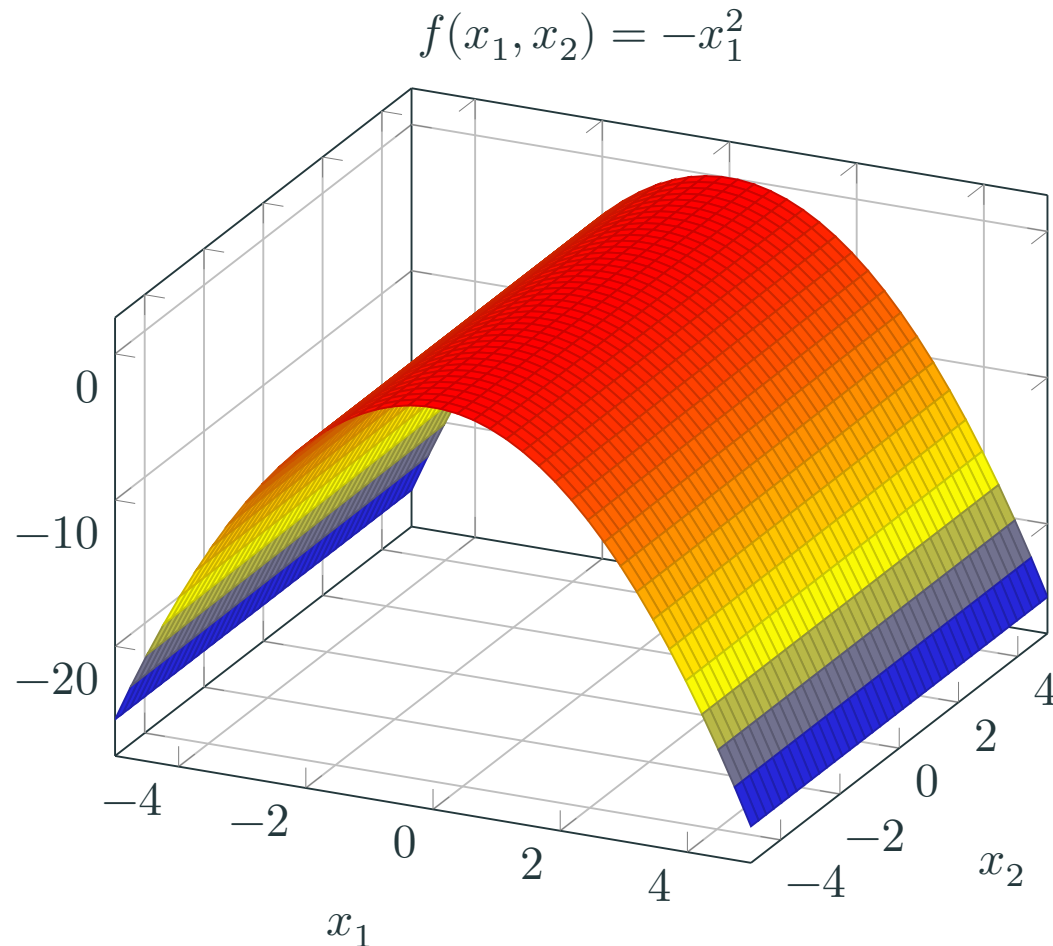
Определение

Форма f называется отрицательно полуопределённой или неположительно определённой, если $f(\mathbf{x}) \leq 0$.

Отрицательно полуопределённая форма

Определение

Форма f называется отрицательно полуопределённой или неположительно определённой, если $f(\mathbf{x}) \leq 0$.



Неопределённая форма

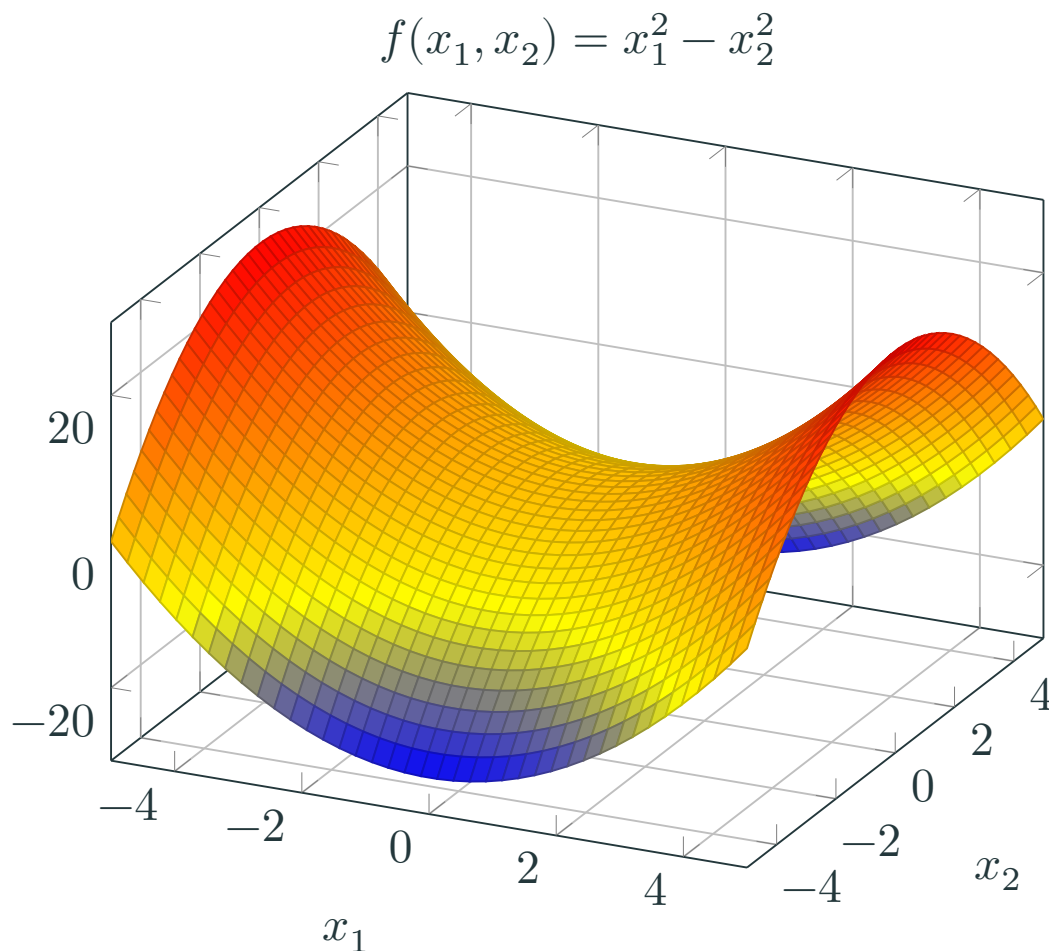
Определение

Форма f называется **неопределённой**, если она принимает и положительные и отрицательные значения.

Неопределённая форма

Определение

Форма f называется **неопределённой**, если она принимает и положительные и отрицательные значения.



Когда форма равна нулю?

Утверждение

Если форма f равна 0 в точке x , то она равна нулю и в любой точке tx .

Когда форма равна нулю?

Утверждение

Если форма f равна 0 в точке \mathbf{x} , то она равна нулю и в любой точке $t\mathbf{x}$.

Доказательство

$$f(t\mathbf{x}) = t\mathbf{x}^T \cdot A \cdot t\mathbf{x} = t^2\mathbf{x}^T A\mathbf{x} = 0$$

Когда форма равна нулю?

Утверждение

Если форма f равна 0 в точке \mathbf{x} , то она равна нулю и в любой точке $t\mathbf{x}$.

Доказательство

$$f(t\mathbf{x}) = t\mathbf{x}^T \cdot A \cdot t\mathbf{x} = t^2\mathbf{x}^T A\mathbf{x} = 0$$

Квадратичная форма возможно равна нулю на прямых, проходящих через 0.

Метод полных квадратов

Это видеофрагмент с доской, слайдов здесь нет :)

Диагонализация квадратичной формы

Краткий план:

- Симметричная матрица и собственные числа.

Краткий план:

- Симметричная матрица и собственные числа.
- Диагонализация квадратичной формы.

Всегда диагонализуема!

Утверждение

Если A — симметричная матрица, $A^T = A$, то у неё всегда найдётся ровно n действительных собственных чисел λ_i

Всегда диагонализуема!

Утверждение

Если A — симметричная матрица, $A^T = A$, то у неё всегда найдётся ровно n действительных собственных чисел λ_i и ровно n линейно независимых ортогональных собственных векторов.

Всегда диагонализуема!

Утверждение

Если A — симметричная матрица, $A^T = A$, то у неё всегда найдётся ровно n **действительных** собственных чисел λ_i и ровно n линейно независимых **ортогональных** собственных векторов.

Следствие

У симметричной A можно найти n ортогональных собственных векторов единичной длины.

Симметричная матрица A всегда диагонализуема!

Чем хороши ортогональные векторы?

Векторы $\mathbf{v}_1, \dots, \mathbf{v}_n$ — ортогональные и единичной длины.

$$P = \begin{pmatrix} \vdots & \vdots & \vdots \\ \mathbf{v}_1 & \vdots & \mathbf{v}_n \\ \vdots & \vdots & \vdots \end{pmatrix}$$

Чем хороши ортогональные векторы?

Векторы $\mathbf{v}_1, \dots, \mathbf{v}_n$ — ортогональные и единичной длины.

$$P = \begin{pmatrix} \vdots & \vdots & \vdots \\ \mathbf{v}_1 & \vdots & \mathbf{v}_n \\ \vdots & \vdots & \vdots \end{pmatrix} \quad P^T = \begin{pmatrix} \dots & \mathbf{v}_1^T & \dots \\ \dots & \dots & \dots \\ \dots & \mathbf{v}_n^T & \dots \end{pmatrix}$$

Чем хороши ортогональные векторы?

Векторы $\mathbf{v}_1, \dots, \mathbf{v}_n$ — ортогональные и единичной длины.

$$P = \begin{pmatrix} \vdots & \vdots & \vdots \\ \mathbf{v}_1 & \vdots & \mathbf{v}_n \\ \vdots & \vdots & \vdots \end{pmatrix} \quad P^T = \begin{pmatrix} \dots & \mathbf{v}_1^T & \dots \\ \dots & \dots & \dots \\ \dots & \mathbf{v}_n^T & \dots \end{pmatrix}$$

$$P^T P = \begin{pmatrix} 1 & 0 & \dots & 0 \\ 0 & 1 & \dots & 0 \\ 0 & 0 & \dots & 0 \\ 0 & 0 & \dots & 1 \end{pmatrix} = I$$

Чем хороши ортогональные векторы?

Векторы $\mathbf{v}_1, \dots, \mathbf{v}_n$ — ортогональные и единичной длины.

$$P = \begin{pmatrix} \vdots & \vdots & \vdots \\ \mathbf{v}_1 & \vdots & \mathbf{v}_n \\ \vdots & \vdots & \vdots \end{pmatrix} \quad P^T = \begin{pmatrix} \dots & \mathbf{v}_1^T & \dots \\ \dots & \dots & \dots \\ \dots & \mathbf{v}_n^T & \dots \end{pmatrix}$$

$$P^T P = \begin{pmatrix} 1 & 0 & \dots & 0 \\ 0 & 1 & \dots & 0 \\ 0 & 0 & \dots & 0 \\ 0 & 0 & \dots & 1 \end{pmatrix} = I$$

$$P^T = P^{-1}$$

Диагонализация формы

Утверждение

Квадратичная форма $f(\mathbf{x}) = \mathbf{x}^T A \mathbf{x}$ с симметричной A представима в виде

$$f(\mathbf{x}) = \mathbf{x}^T P D P^{-1} \mathbf{x},$$

где D — диагональная матрица из собственных чисел матрицы A , а P — матрица из линейно независимых собственных векторов матрицы A .

Диагонализация формы

Утверждение

Квадратичная форма $f(\mathbf{x}) = \mathbf{x}^T A \mathbf{x}$ с симметричной A представима в виде

$$f(\mathbf{x}) = \mathbf{x}^T P D P^{-1} \mathbf{x},$$

где D — диагональная матрица из собственных чисел матрицы A , а P — матрица из линейно независимых собственных векторов матрицы A .

Утверждение

Всегда можно выбрать ортогональные собственные векторы A единичной длины, при этом представление примет вид:

$$f(\mathbf{x}) = \mathbf{x}^T P D P^T \mathbf{x} = (P^T \mathbf{x})^T D (P^T \mathbf{x}),$$

Диагонализация формы

Утверждение

Всегда можно выбрать ортогональные собственные векторы единичной длины, при этом представление примет вид:

$$f(\mathbf{x}) = \mathbf{x}^T P D P^T \mathbf{x} = (P^T \mathbf{x})^T D (P^T \mathbf{x}),$$

где D — диагональная матрица из собственных чисел матрицы A , а P — матрица из собственных векторов матрицы A .

Диагонализация формы

Утверждение

Всегда можно выбрать ортогональные собственные векторы единичной длины, при этом представление примет вид:

$$f(\mathbf{x}) = \mathbf{x}^T P D P^T \mathbf{x} = (P^T \mathbf{x})^T D (P^T \mathbf{x}),$$

где D — диагональная матрица из собственных чисел матрицы A , а P — матрица из собственных векторов матрицы A .

$$\begin{aligned} f(\mathbf{x}) &= (P^T \mathbf{x})^T D (P^T \mathbf{x}) = \mathbf{y}^T D \mathbf{y} = \\ &= \lambda_1 y_1^2 + \lambda_2 y_2^2 + \dots + \lambda_n y_n^2 \end{aligned}$$

Диагонализация формы

Утверждение

Всегда можно выбрать ортогональные собственные векторы единичной длины, при этом представление примет вид:

$$f(\mathbf{x}) = \mathbf{x}^T P D P^T \mathbf{x} = (P^T \mathbf{x})^T D (P^T \mathbf{x}),$$

где D — диагональная матрица из собственных чисел матрицы A , а P — матрица из собственных векторов матрицы A .

$$\begin{aligned} f(\mathbf{x}) &= (P^T \mathbf{x})^T D (P^T \mathbf{x}) = \mathbf{y}^T D \mathbf{y} = \\ &= \lambda_1 y_1^2 + \lambda_2 y_2^2 + \dots + \lambda_n y_n^2 \end{aligned}$$

Это просто удачная замена переменных $\mathbf{y} = P^T \mathbf{x}$!

Определённость формы

Пример, $f(\mathbf{x}) = 5y_1^2 + 6y_2^2 - 9y_3^2$.

Определённость формы

Пример, $f(\mathbf{x}) = 5y_1^2 + 6y_2^2 - 9y_3^2$.

Квадратичная форма f неопределена.

Определённость формы

Пример, $f(\mathbf{x}) = 5y_1^2 + 6y_2^2 - 9y_3^2$.

Квадратичная форма f неопределена.

Утверждение

Квадратичная форма

$$f(\mathbf{x}) = \lambda_1 y_1^2 + \lambda_2 y_2^2 + \dots + \lambda_n y_n^2$$

является...

Определённость формы

Пример, $f(\mathbf{x}) = 5y_1^2 + 6y_2^2 - 9y_3^2$.

Квадратичная форма f неопределена.

Утверждение

Квадратичная форма

$$f(\mathbf{x}) = \lambda_1 y_1^2 + \lambda_2 y_2^2 + \dots + \lambda_n y_n^2$$

является...

положительно определённой, если все $\lambda_i > 0$.

Определённость формы

Пример, $f(\mathbf{x}) = 5y_1^2 + 6y_2^2 - 9y_3^2$.

Квадратичная форма f неопределена.

Утверждение

Квадратичная форма

$$f(\mathbf{x}) = \lambda_1 y_1^2 + \lambda_2 y_2^2 + \dots + \lambda_n y_n^2$$

является...

положительно определённой, если все $\lambda_i > 0$.

отрицательно определённой, если все $\lambda_i < 0$.

Определённость формы

Пример, $f(\mathbf{x}) = 5y_1^2 + 6y_2^2 - 9y_3^2$.

Квадратичная форма f неопределена.

Утверждение

Квадратичная форма

$$f(\mathbf{x}) = \lambda_1 y_1^2 + \lambda_2 y_2^2 + \dots + \lambda_n y_n^2$$

является...

положительно определённой, если все $\lambda_i > 0$.

отрицательно определённой, если все $\lambda_i < 0$.

положительно полуопределённой, если все $\lambda_i \geq 0$.

Определённость формы

Пример, $f(\mathbf{x}) = 5y_1^2 + 6y_2^2 - 9y_3^2$.

Квадратичная форма f неопределена.

Утверждение

Квадратичная форма

$$f(\mathbf{x}) = \lambda_1 y_1^2 + \lambda_2 y_2^2 + \dots + \lambda_n y_n^2$$

является...

положительно определённой, если все $\lambda_i > 0$.

отрицательно определённой, если все $\lambda_i < 0$.

положительно полуопределённой, если все $\lambda_i \geq 0$.

отрицательно полуопределённой, если все $\lambda_i \leq 0$.

Определённость формы

Пример, $f(\mathbf{x}) = 5y_1^2 + 6y_2^2 - 9y_3^2$.

Квадратичная форма f неопределена.

Утверждение

Квадратичная форма

$$f(\mathbf{x}) = \lambda_1 y_1^2 + \lambda_2 y_2^2 + \dots + \lambda_n y_n^2$$

является...

положительно определённой, если все $\lambda_i > 0$.

отрицательно определённой, если все $\lambda_i < 0$.

положительно полуопределённой, если все $\lambda_i \geq 0$.

отрицательно полуопределённой, если все $\lambda_i \leq 0$.

неопределённой, если найдётся $\lambda_i > 0$ и $\lambda_j < 0$.

Кусочек доказательства

Утверждение

Для симметричной матрицы A , $A^T = A$, собственные вектора, соответствующие разным λ , ортогональны.

Кусочек доказательства

Утверждение

Для симметричной матрицы A , $A^T = A$, собственные вектора, соответствующие разным λ , ортогональны.

Доказательство

К примеру, $Ax = 5x$ и $Ay = 7y$.

Кусочек доказательства

Утверждение

Для симметричной матрицы A , $A^T = A$, собственные вектора, соответствующие разным λ , ортогональны.

Доказательство

К примеру, $Ax = 5x$ и $Ay = 7y$.

$$\langle Ax, y \rangle = \langle 5x, y \rangle = 5\langle x, y \rangle$$

Кусочек доказательства

Утверждение

Для симметричной матрицы A , $A^T = A$, собственные вектора, соответствующие разным λ , ортогональны.

Доказательство

К примеру, $Ax = 5x$ и $Ay = 7y$.

$$\langle Ax, y \rangle = \langle 5x, y \rangle = 5\langle x, y \rangle$$

$$\langle x, Ay \rangle = \langle x, 7y \rangle = 7\langle x, y \rangle$$

Кусочек доказательства

Утверждение

Для симметричной матрицы A , $A^T = A$, собственные вектора, соответствующие разным λ , ортогональны.

Доказательство

К примеру, $Ax = 5x$ и $Ay = 7y$.

$$\langle Ax, y \rangle = \langle 5x, y \rangle = 5\langle x, y \rangle$$

$$\langle x, Ay \rangle = \langle x, 7y \rangle = 7\langle x, y \rangle$$

$$\langle Ax, y \rangle = \langle x, A^T y \rangle = \langle x, Ay \rangle$$

Кусочек доказательства

Утверждение

Для симметричной матрицы A , $A^T = A$, собственные вектора, соответствующие разным λ , ортогональны.

Доказательство

К примеру, $Ax = 5x$ и $Ay = 7y$.

$$\langle Ax, y \rangle = \langle 5x, y \rangle = 5\langle x, y \rangle$$

$$\langle x, Ay \rangle = \langle x, 7y \rangle = 7\langle x, y \rangle$$

$$\langle Ax, y \rangle = \langle x, A^T y \rangle = \langle x, Ay \rangle$$

Равенство возможно, только если $x \perp y$:

$$5\langle x, y \rangle = 7\langle x, y \rangle$$

Расширенный критерий Сильвестра: пример

Это видеофрагмент с доской, слайдов здесь нет :)

Ортогонализация Грамма-Шмидта: пример

Это видеофрагмент с доской, слайдов здесь нет :)

Бонус: задача про переливание красок

Это видеофрагмент с доской, слайдов здесь нет :)