Содержание

1 Линейное пространство над произвольным полем. Ранг и база системы векторов.

Опр. *Множество V называется линейным пространством над полем $\mathbb{P}$, если V является аддитивной абелевой группой относительно операции сложения векторов, а операция умножения вектора на число обладает следующими свойствами:*

- $(\alpha\beta)v = \alpha(\beta v)$;
- $(\alpha+\beta)v = \alpha v + \beta v$;
- $\alpha(v+u) = \alpha v + \alpha u$;
- $1 * v = v$

Эти свойства выполняются для любых чисел $\alpha, \beta \in \mathbb{P}$ и любых векторов $u, v \in V$.

Опр. *Рангом системы векторов называется максимальное число линейно независимых векторов системы.*

Опр. *Базой системы векторов называется базис их линейной оболочки, состоящий из векторов системы.*

2 Изоморфизм линейных пространств.

Опр. *Гомоморфизмом двух линейных пространств V и W над одним полем $\mathbb{P}$ называется отображение $\varphi : V \to W$ такое, что $\varphi(\alpha v + \beta u) = \alpha\varphi(v) + \beta\varphi(u) \forall u, v \in V$. Если отображение φ взаимооднозначно (является биекцией), то оно называется изоморфизмом.*

Теорема. *Два линейных пространства над одним полем изоморфны тогда и только тогда, когда они имеют одинаковую размерность.*

Д-во. ($\Longrightarrow$) Пусть линейные пространства V и W над полем $\mathbb{P}$ изоморфны, и $\varphi : V \to W$. Рассмотрим базис V: $v_1, \dots, v_n$. $\forall y \in W, y \neq \theta \exists x \in V, x \neq 0 : \varphi(x) = y$. Далее $\forall x \in V \exists \alpha_1, \dots, \alpha_n \in \mathbb{P} : x = \alpha_1 v_1 + \dots + \alpha_n v_n$, $y = \varphi(x) = \alpha_1\varphi(v_1) + \dots + \alpha_n\varphi(v_n)$. Значит любой вектор из W линейно выражается через образы базисных векторов V. А так же образы этих векторов линейно независимы. Если бы существовала нетривиальная линейная комбинация этих векторов равная нулю, то $\theta = \beta_1\varphi(v_1) + \dots + \beta_n\varphi(v_n) = \varphi(\beta_1 v_1 + \dots + \beta_n v_n) = \varphi(0)$, получили что векторы $v_1, \dots, v_n$ линейно зависимы - противоречие. Значит образ базисных векторов в V является базисом в W, а значит их количество совпадает и размерности линейных пространств равны.
($\Longleftarrow$) Пусть V, W - линейные пространства над полем $\mathbb{P}$ и $\dim V = \dim W = n$, $e_1, \dots, e_n$ - базис V, $f_1, \dots, f_n$ - базис W. Построим отображение $\varphi : V \to W$, поставим в соответствие каждому вектору $x = \sum\limits_{i=1}^{n} \alpha_i e_i$ вектор $y = \sum\limits_{i=1}^{n} \alpha_i f_i \in W$. В силу единственности разложения вектора по базису отображение φ. При этом φ - изоморфизм, так как координаты вектора обладают свойством линейности. $\square$

3 Сумма и пересечение линейных пространств.

Опр. *Непустое подмножество $L \subseteq V$ называется подпространством линейного пространства V, если оно само является линейным пространством относительно операций, действующих в V. Для этого необходимо и достаточно, чтобы результата этих операций над векторами из L оставался в L.*

Опр. *Сумма подпространств $L = L_1 + \cdots + L_s$ пространства V называется множество вида $L = \{x_1 + \cdots + x_s : x_1 \in L_1, \ldots, x_s \in L_s\}$, которое так же является подпространством V. Пересечением подпространств $L_1, \ldots, L_n$ пространства V называется множество $L = \{x : x \in L_1, \ldots, L_n\}$, которое так же является подпространством V.*

Теорема (Теорема Грассмана)**.** *Пусть L и M - конечно мерные подпространства некоторого линейного пространства. Тогда* $\dim(L + M) = \dim L + \dim M - \dim(L \cap M)$.

Д-во. Рассмотрим базис $g_1, \ldots, g_r$ подпространства $L \cap M$ и дополним его до базисов L и M:

$$g_1, \ldots, g_r, p_1, \ldots, p_k (\text{базис} L) \quad g_1, \ldots, g_r, q_1, \ldots, q_m (\text{базис} M).$$

Заметим, что вектора $p_1, \ldots, p_k, q_1, \ldots, q_m$ линейное независимы, так как если бы они были линейно зависимы, то существовал бы вектор q_i, который выражается через $p_1, \ldots, p_k$, а значит принадлежит $L \cap M$ - противоречие.
Ясно, что $L + M$ является линейной оболочкой векторов $g_1, \ldots, g_r, p_1, \ldots, p_k, q_1, \ldots, q_m$ и остается лишь установить их линейную независимость. Пусть

$$\alpha_1 g_1 + \cdots + \alpha_r g_r + \beta_1 p_1 + \cdots + \beta_k p_k + \gamma_1 q_1 + \cdots + \gamma_m q_m = 0 \implies$$
$$z := \alpha_1 g_1 + \cdots + \alpha_r g_r + \beta_1 p_1 + \cdots + \beta_k p_k = -(\gamma_1 q_1 + \cdots + \gamma_m q_m) \in L \cap M$$

Будучи элементом из $L \cap M$, вектор z представляется в виде $z = \delta_1 g_1 + \cdots + \delta_r g_r \implies$

$$\delta_1 g_1 + \cdots + \delta_r g_r + \gamma_1 q_1 + \cdots + \gamma_m q_m = 0 \implies \delta_1 = \cdots = \delta_r = \gamma_1 = \cdots = \gamma_m = 0. \implies$$

$$z = 0 \implies \alpha_1 = \cdots = \alpha_r = \beta_1 = \cdots = \beta_k.$$

□

4 Прямая сумма линейных пространств.

Опр. *Пусть L - сумма подпространств $L_1, \ldots, L_n$. Если для любого вектора $x \in L$ компоненты разложения $x_i \in L_i$ определены однозначно, то L называется прямой суммой подпространств $L_1, \ldots, L_n$. Обозначение: $L = L_1 \oplus \cdots \oplus L_n$.*

Теорема (Критерий прямой суммы)**.** *Для подпространств $L_1, \ldots, L_k$ конечномерного пространства V следующие утверждения равносильны:*

1. *Сумма подпространств $L_1, \ldots, L_k$ - прямая;*

2. *Совокупность базисов подпространств* $L_1, \dots, L_k$ *линейно независима;*

3. *Совокупность базисов подпространств* $L_1, \dots, L_k$ *образует базис суммы* $\sum\limits_{i=1}^{k} L_i$

4. $\dim \sum\limits_{i=1}^{k} L_i = \sum\limits_{i=1}^{k} \dim L_i$*;*

5. *Существует вектор* $a \in \sum\limits_{i=1}^{k} L_i$*, для которого разложение по подпространствам* $L_1, \dots, L_k$ *единственно;*

6. *Произвольная система ненулевых векторов* $a_1, ..., a_k$*, взятых по одному из каждого подпространства* L_i*,* $i = 1, \dots, k$*, линейно независима;*

7. $L_1 \cap L_2 = \{\theta\}$ *(для* $k = 2$*).*

Д-во. ($1 \implies 2$) Пусть совокупность $e_1, \dots, e_m, f_1, \dots, f_s, \dots, g_1, \dots, g_s$ базисов подпространств $L_1, \dots, L_k$ линейно зависима и

$$\sum_{i=1}^{m} \alpha_i e_i + \sum_{i=1}^{s} \beta_i f_i + \dots + \sum_{i=1}^{t} \gamma_i g_i = \theta.$$

, где $\sum\limits_{i=1}^{m} \alpha_i^2 + \sum\limits_{i=1}^{s} \beta_i^2 + \dots + \sum\limits_{i=1}^{t} \gamma_i^2 \neq 0$. Положим

$$x_1 = \sum_{i=1}^{m} \alpha_i e_i, \quad x_2 = \sum_{i=1}^{s} \beta_i f_i, \quad \dots, \quad x_k = \sum_{i=1}^{t} \gamma_i g_i.$$

Заметим, что $x_i \in L_i, i = 1, \dots, k$, причем среди $x_1, \dots, x_k$ существует $x_i \neq 0$. Тогда можно записать: $\theta = x_1 + \dots + x_i + \dots + x_n$. Получили второе разложение вектора θ по подпространствам $L_1, \dots, L_k$. Противоречие. Значит совокупность базисов линейно независима.

($2 \implies 3$) Утверждение очевидно если учесть, что сумма подпространств является линейной оболочкой объединения их базисов.

($3 \Leftrightarrow 4$) Эти утверждения отличаются только терминологией.

($3 \implies 1$) Пусть $e_1, \dots, e_m, f_1, \dots, f_s, \dots, g_1, \dots, g_s$ - совокупность базисов подпространств $L_1, \dots, L_k$. Тогда $\forall x \in V \ \exists! \alpha_1, \dots, \alpha_m, \beta_1, \dots, \beta_s, \dots, \gamma_1, \dots, \gamma_t$:

$$\sum_{i=1}^{m} \alpha_i e_i + \sum_{i=1}^{s} \beta_i f_i + \dots + \sum_{i=1}^{t} \gamma_i g_i = x$$

, где $\sum\limits_{i=1}^{m} \alpha_i^2 + \sum\limits_{i=1}^{s} \beta_i^2 + \dots + \sum\limits_{i=1}^{t} \gamma_i^2 \neq 0$. Положим

$$x_1 = \sum_{i=1}^{m} \alpha_i e_i, \quad x_2 = \sum_{i=1}^{s} \beta_i f_i, \quad \dots, \quad x_k = \sum_{i=1}^{t} \gamma_i g_i.$$

Заметим, что $x_i \in L_i, i = 1, \dots, k$. Получили, что каждый вектор имеет единственное разложение по подпространствам. Значит сумма $L_1, \dots, L_k$ прямая.
$(1 \implies 5)$ Это очевидно.
$(5 \implies 1)$ Пусть $L_1 + \dots + L_k$ - не прямая сумма. Тогда существует вектор b из этой суммы, для которого имеются два различных разложения. Вычитая эти разложения, получим нетривиальное разложение нулевого вектора. Если сложить его с разложением вектора a, то получиться еще одно разложение вектора a. Противоречие. Значит сумма $L_1 + \dots + L_k$ прямая.
$(1 \implies 6)$ Пусть система векторов $a_1, \dots, a_k$ линейно зависима. Тогда существуют числа $\alpha_1, \dots, \alpha_k \in \mathbb{P}$, одновременно не равные нулю и такие, что $\alpha_1 a_1 + \dots + \alpha_k a_k = \theta$. Это равенство дает второе разложение нулевого вектора, отличное от тривиального, что противоречит утверждению 1. $(6 \implies 1)$ Пусть $L_1 + \dots + L_k$ - не прямая сумма. Тогда существует вектор b, для которого существуют два разложения $b = b_1 + \dots + b_k = b'_1 + \dots + b_{k'}, b_i, b'_i \in L_i$, $i = 1, \dots, k$. Вычитая одно из другого, получим, что $a_1 + \dots + a_k = 0$, где $a_i = b_i - b'_i$, $a_i \in L_i$, $i = 1, \dots, k$, причем хотя бы одно $a_j \neq \theta$. Пусть $a_{i_1}, \dots, a_{i_m}$ - ненулевые вектора из $a_1, \dots, a_k$. Система $a_{i_1}, \dots, a_{i_m}$ - линейно зависима, а значит и любая система ненулевых векторов, взятых по одному из каждого L_i, $i = 1, \dots, k$, содержащая эти векторы линейно зависима. Противоречие. Значит $L_1 + \dots + L_k$ - прямая сумма.
$(4 \Leftrightarrow 7)$ Сразу следует из теоремы Грассмана. $\square$

Теорема. *Линейное пространство является прямой суммой двух своих подпространств тогда и только тогда, когда:*

1. $\dim V = \dim L_1 + \dim L_2$;
2. $L_1 \cap L_2 = \{\theta\}$.

Д-во. $(\implies)$ Сразу следует из критерия прямой суммы.
$(\impliedby)$ Из условия 2 следует, что $L_1 + L_2$ - прямая сумма. Положим, что $L = L_1 \oplus L_2$. Тогда $\dim L = \dim L_1 + \dim L_2 = \dim V$. Это означает, что $L = V$. $\square$

5 Евклидово и унитарное пространство. Неравенство Коши-Буняковского.

Опр. *Пусть V - вещественное линейное пространство, на котором каждой упорядоченной паре векторов $x, y \in V$ поставлено в соответствие вещественное число (x, y) таким образом, что:*

- $(x, x) \geq 0 \, \forall x \in V$; $(x, x) = 0 \Leftrightarrow x = 0$;
- $(x, y) = (y, x) \, \forall x, y \in V$;
- $(x + y, z) = (x, z) + (y, z) \, \forall x, y, z \in V$;

- $(\alpha x, y) = \alpha(x, y)\, \forall \alpha \in \mathbb{R}\, \forall x, y \in V$.

Число (x, y) называется скалярным произведением векторов x, y. Вещественное линейное пространство со скалярным произведение называется евклидовым.

Опр. *Пусть V - комплексное линейное пространство, на котором каждой упорядоченной паре векторов $x, y \in V$ поставлено в соответствие комплексное число (x, y) таким образом, что:*

- $(x, x) \geq 0\, \forall x \in V$; $(x, x) = 0 \Leftrightarrow x = 0$;
- $(x, y) = \overline{(y, x)}\, \forall x, y \in V$;
- $(x + y, z) = (x, z) + (y, z)\, \forall x, y, z \in V$;
- $(\alpha x, y) = \alpha(x, y)\, \forall \alpha \in \mathbb{C}\, \forall x, y \in V$.

Число (x, y) называется скалярным произведением векторов x, y. Комплексное линейное пространство со скалярным произведение называется унитарным.

Опр. *В произвольном евклидовом или унитарном пространстве величина $|x| := \sqrt{(x, x)}$ называется длиной вектора. Равенство достигается в том и только в том случае, когда векторы x и y линейно зависимы.*

Теорема (Неравенство Коши-Буняковского-Шварца). *Скалярное произведение векторов и их длины связано неравенством $|(x, y)| \leq |x||y|$.*

Д-во. Случай $(x, y) = 0$ очевиден. В противном случае запишем $(x, y) = |(x, y)|\xi$, где $\xi = e^{i\phi}$, и рассмотрим функцию вещественного аргумента $F(t) = (x + t\xi y, x + t\xi y) = (x, x) + t\xi\overline{(x, y)} + t\bar{\xi}(x, y) + t^2\xi\bar{\xi}(y, y) = t^2|y|^2 + 2t|(x, y)| + |x|^2$. В силу свойств скалярного произведения $F(t) \geq 0$ при всех вещественных t. Значит $D \leq 0$, $D = |(x, y)|^2 - |x|^2|y|^2 \leq 0 \implies |(x, y)| \leq |x||y|$. Равенство означает, что $D = 0 \implies (x + t\xi y, x + t\xi y) = 0 \implies x + t\xi y = 0$. □

6 Скалярное произведение в ортонормированном базисе. Существование ортонормированного базиса.

Опр. *Система ненулевых векторов $x_1, \ldots, x_m$ называется ортогональной, если $(x_i, x_j) = 0$ при $i \neq j$. Ортогональная система, в которой длина каждого вектора равна 1, называется ортонормированной.*

Теорема. *Для любой линейно независимой системы векторов $a_1, \ldots, a_m$ существует ортогональная система $p_1, \ldots, p_m$ такая, что $L(p_1, \ldots, p_k) = L(a_1, \ldots, a_k)$, $1 \leq k \leq m$.*

Д-во. Положим, что $p_1 = a_1 \implies L(p_1) = L(a_1)$. Предположим, что уже постоена ортогональная система $p_1, \dots, p_{k-1}$ такая, что $L(p_1, \dots, p_i) = L(a_1, \dots, a_i)$ при $1 \le i \le k-1$. Тогда вектор

$$p_k = a_k - \sum_{i=1}^{k-1} \frac{(a_k, p_i)}{(p_i, p_i)} p_i.$$

будет ортогонален каждому из векторов $p_1, \dots, p_{k-1}$:

$$(p_k, p_j) = (a_k, p_j) - \left(\sum_{i=1}^{k-1} \frac{(a_k, p_i)}{(p_i, p_i)} p_i, p_j \right) = (a_k, p_j) - \frac{(a_k, p_j)}{(p_j, p_j)} (p_j, p_j) = 0.$$

Кроме того, $p_k \in L(p_1, \dots, p_{k-1}, a_k) = L(a_1, \dots, a_{k-1}, a_k)$ и $a_k \in L(p_1, \dots, p_{k-1}, p_k) \implies L(p_1, \dots, p_{k-1}, p_k) = L(a_1, \dots, a_{k-1}, a_k)$. □

Следствие. *Для любой линейно независимой системы $a_1, \dots, a_m$ существует ортонормированная система $q_1, \dots, q_m$ такая, что $L(q_1, \dots, q_k) = L(a_1, \dots, a_k)$, $1 \le k \le m$.*

Следствие. *В любом конечномерном пространстве со скалярным произведением существует ортонормированный базис.*

7 Изометрия.

Опр. *Два линейных пространства V_1 и V_2 со скалярным произведениями называются изометричными, если $\exists$ биективное отображение $\varphi : V_1 \to V_2$, которое сохраняет законы композиции и скалярное произведение, т.е.:*

- $\varphi(x + y) = \varphi(x) + \varphi(y) \, \forall x, y \in V_1$;
- $\alpha\varphi(x) = \varphi(\alpha x) \, \forall x \in V_1 \, \forall \alpha \in \mathbb{P}$;
- $(\varphi(x), \varphi(y)) = (x, y) \, \forall x, y \in V_1$.

Само отображение φ при этом называется изометрией.

Теорема. *Два пространства со скалярными произведениями изометричны тогда и только тогда, когда равны их размерности.*

Д-во. ($\implies$) Вытекает из изоморфизма изометричных пространств.
($\impliedby$) Пусть V_1 и V_2 - два линейных пространства со скалярными произведениями и $\dim V_1 = \dim V_2 = n$. $e_1, \dots, e_n$ - базис V_1, $e'_1, \dots, 2'_n$ - базис V_2. Построим отображение $\varphi : V_1 \to V_2$, сопоставив каждому вектору $x = \sum\limits_{i=1}^{n} x_i e_i$ вектор $y = \sum\limits_{i=1}^{n} x_i e'_i \implies$ отображение φ - линейных пространств V_1 и V_2. Оно сохраняет скалярное произведение, т.к. если $x = \sum\limits_{i=1}^{n} x_i e_i$, $y = \sum\limits_{i=1}^{n} y_i e_i$, то $(x, y) = \sum\limits_{i=1}^{n} x_i \overline{y_i} = (\varphi(x), \varphi(y))$. □

8 Матрица Грама. Критерий линейной независимости.

Теорема (теорема о перпендикуляре)**.** *Для любого вектора x в произвольном пространстве со скалярным произведением и любого конечномерного подпространства $L \subset V$ существуют и единственны перпендикуляр h и проекция z такие, что*

$$x = z + h,\ z \in L,\ h \perp L, \quad |x - z| = |h| \leq |x - y|\ \forall y \in L.$$

Д-во. Если $x \in L$, то полагаем $z = x$ и $h = 0$. Пусть $v_1, \ldots, v_k$ - базис подпространства L. В случае $x \notin L$ система $v_1, \ldots, v_k, x$ будет линейно независимой. Применив к ней процесс ортогонализации Грама-Шмидта, получим ортонормированную системы $q_1, \ldots, q_k, q_{k+1}$ такую, что $L = L(q_1, \ldots, q_k)$ и $x \in L(q_1, \ldots, q_k, q_{k+1})$, а искомые проекция и перпендикуляр получаются из разложения $x = \alpha_1 q_1 + \cdots + \alpha_k q_k + \alpha_{k+1} q_{k+1}$ очевидным образом: $z = \alpha_1 q_1 + \cdots + \alpha_k q_k$, $h = \alpha_{k+1} q_{k+1}$.
Единственность: если $x = z + h = z' + h'$, где $z, z' \in L$ и $h, h' \perp L$, то $c := z - z' = h' - h \in L \cap L^{\perp} \implies v = 0$.
Наконец, для любого $y \in L$ находим $x - y = (z - y) + h$, и, согласно теореме Пифагора, $|x - y|^2 = |z - h|^2 + |h|^2 \geq |h|^2$. Равенство, очевидно, имеет место в том и только в том случае, когда $y = z$. □

Если $v_1, \ldots, v_k$ - произвольный базис подпространства L, то ортогональная проекция $z = x_1 v_1 + \cdots + x_k v_k$ вектора x на L однозначно определяется уравнением $x - z \perp L$. Для этого необходимо и достаточно, чтобы вектор $x - z$ был ортогонален каждому из векторов $v_1, \ldots, v_k$:

$$\begin{cases} (v_1, v_1)x_1 + \cdots + (v_k, v_1)x_k = (x, v_1) \Leftrightarrow (x - z, v_1) = 0 \\ (v_1, v_2)x_1 + \cdots + (v_k, v_2)x_k = (x, v_2) \Leftrightarrow (x - z, v_2) = 0 \\ \ldots \\ (v_1, v_k)x_1 + \cdots + (v_k, v_k)x_k = (x, v_k) \Leftrightarrow (x - z, v_k) = 0 \end{cases}$$

Из теоремы о перпендикуляре следует, что эта система линейных алгебраических уравнений имеет и притом единственное решение, определяющее коэффициенты $x_1, \ldots, x_k$.

Опр. *Матрицы $A = [a_{ij}]$ полученной нами системы линейны алгебраических уравнений имеет элементы $a_{ij} = (v_i, v_j)$. Матрица такого вида называется матрицей Грама системы векторов $v_1, \ldots, v_k$.*

Теорема. *Для линейно независимой системы матрица Грама невырождена.*

Д-во. Сразу следует из теоремы о перпендикуляре, так как система должна иметь единственное решение. □

9 Ортогональное дополнение. Ортогональная сумма подпространств. Расстояние от вектора до подпространства.

Опр. *Вектор x называется ортогональным вектору y, если $(x, y) = 0$, и ортогональным множеству $L \neq \emptyset$, если он ортогонален каждому вектору множества L. Непустые множества M и L называются ортогональными, если $(x, y) = 0\,\forall x \in L,\, y \in M$.*

Опр. *Пусть L - подпространство V. Множество $L^{\perp} = \{x \in V : x \perp L\}$ называется ортогональным дополнением к L.*

Теорема. *Ортогональное дополнение к подпространству является линейным подпространством.*

Д-во. Пусть $y_1, y_2 \in L^{\perp}$, тогда $(y_1, x) = (y_2, x) = 0\,\forall x \in L$. Складывая эти равенства, получим, что $(y_1 + y_2, x) = 0\,\forall y_1, y_2 \in L^{\perp}$, т.е. $y_1 + y_2 \in L^{\perp}$. Аналогично, если $(y, x) = 0\,\forall x \in L$, то $(\alpha y, x) = 0\,\forall y \in L\,\forall \alpha \in \mathbb{P} \implies \alpha y \in L^{\perp}$. Значит, $L^{\perp}$ - линейное подпространство. □

Теорема. *Если L - линейное подпространство V, то $E = L \oplus L^{\perp}$.*

Д-во. Если L - тривиальное подпространство, то утверждение очевидно. Пусть L - нетривиальное подпространство. Возьмем $e_1, \ldots, e_k$ - ортонормированный базис L, $e_{k+1}, \ldots, e_n$ - ортонормированный базис $L^{\perp}$. Система векторов $e_1, \ldots, e_n$ ортонормирована и, следовательно, линейно независима. Покажем, что $e_1, \ldots, e_n$ образует базис в V. Пусть это не так. Тогда $\exists f \in V : e_1, \ldots, e_n, f$ - линейно независимая система. Применим к ней процесс ортогонализации, получим систему $e_1, \ldots, e_n, e_{n+1}$. e_{n+1} ортогонален $e_1, \ldots, e_k \implies e_{n+1} \in L$. С другой стороны, e_{n+1} ортогонален $e_{k+1}, \ldots, e_n \implies e_{n+1} \in L^{\perp}$. Значит $e_{n+1} = 0$, а значит f выражается через $e_1, \ldots, e_n$ и система была линейно зависимой. Противоречие. Значит $e_1, \ldots, e_n$ - базис. Получили, что $\dim L + \dim L^{\perp} = \dim V$, и, поскольку, $L \cap L^{\perp} = \{\emptyset\}$, то $E = L \oplus L^{\perp}$. □

Теорема. *Расстояние между вектором f и линейным подпространством L в евклидовом (унитарном) пространстве равно длине перпендикуляра из вектора f на L.*

Д-во. Пусть $f = g + h$, где $g \in L$, $h \in L^{\perp}$, и y - произвольный вектор из L. Тогда $\rho(f, y) = |f - y| = |(g + h) - y| = |h + (g - y)| = \sqrt{(h + (g - y), h + (g - y))} = \sqrt{(h, h) + (g - y, g - y)} = \sqrt{|h|^2 + |g - y|^2} \geq |h|\,\forall y \in L$ и $\rho(f, y) = |h|$, если $y = g$. Это означает, что $|h| = \inf\limits_{y \in L} \rho(f, y) = \rho(f, L)$. □

10 Ортонормированный базис и унитарные (ортогональные) матрицы.

(определение ортонормированности и теорема о существовании ортогонального базиса из 6 вопроса)

Рассмотрим комплексную матрицу $Q = [q_1, \ldots, q_n]$ порядка n и предположим, что ее столбцы $q_1, \ldots, q_n$ ортонормированы относительно естественного скалярного произведения пространства $\mathbb{C}^n$. Тогда имеет место равенство:

$$(q_i, q_j) = q_j^* q_i = \delta_{ij} \Leftrightarrow Q^* Q = I.$$

Здесь используется символ Кронекера: $\delta_{ij} = 1$ при $i = j$ и $\delta_{ij} = 0$ при $i \neq j$.

Опр. *Квадратная комплексная матрица Q называется унитарной, если $Q^*Q = I$. Как видим, свойство унитарности матрицы равносильно ортонормированности ее системы столбцов относительно естественного скалярного произведения. Вещественная унитарная матрица называется ортогональной.*

11 Процесс ортогонализации Грама-Шмидта. QR-разложение матрицы.

Теорема. *Для любой линейно независимой системы векторов $a_1, \ldots, a_m$ существует ортогональная система $p_1, \ldots, p_m$ такая, что $L(p_1, \ldots, p_k) = L(a_1, \ldots, a_k)$, $1 \leq k \leq m$.*

Д-во. Положим, что $p_1 = a_1 \implies L(p_1) = L(a_1)$. Предположим, что уже постоена ортогональная система $p_1, \ldots, p_{k-1}$ такая, что $L(p_1, \ldots, p_i) = L(a_1, \ldots, a_i)$ при $1 \leq i \leq k-1$. Тогда вектор

$$p_k = a_k - \sum_{i=1}^{k-1} \frac{(a_k, p_i)}{(p_i, p_i)} p_i.$$

будет ортогонален каждому из векторов $p_1, \ldots, p_{k-1}$:

$$(p_k, p_j) = (a_k, p_j) - \left(\sum_{i=1}^{k-1} \frac{(a_k, p_i)}{(p_i, p_i)} p_i, p_j \right) = (a_k, p_j) - \frac{(a_k, p_j)}{(p_j, p_j)} (p_j, p_j) = 0.$$

Кроме того, $p_k \in L(p_1, \ldots, p_{k-1}, a_k) = L(a_1, \ldots, a_{k-1}, a_k)$ и $a_k \in L(p_1, \ldots, p_{k-1}, p_k) \implies L(p_1, \ldots, p_{k-1}, p_k) = L(a_1, \ldots, a_{k-1}, a_k)$. $\square$

Теорема об ортогонализации содержит, по существу, следующий алгоритм построения ортонормированной системы $q_1, \ldots, q_m$ в линейной оболочке заданной линейно независимой системы $a_1, \ldots, a_m$:

$$p_k := a_k - \sum_{i=1}^{k-1} (a_k, q_i) q_i, \quad q_k := \frac{p_k}{|p_k|}, \; k = 1, 2, \ldots, m.$$

Этот алгоритм называется процессом ортогонализации Грама-Шмидта.

Пусть матрица A имеет линейно независимые столбцы $a_1, \ldots, a_m$, а процесс ортогонализации ее столбцов относительно естественного скалярного произведения дает ортонормированные столбцы $q_1, \ldots, q_m$. Процесс ортогоналиации устроен таким образом, что a_k есть линейная комбинация столбцов $q_1, \ldots, q_k$:

$$a_k = \sum_{i=1}^{k} r_{ik} q_i \Leftrightarrow A = QR,\ Q = [q_1, \ldots, q_m],\ R = \begin{bmatrix} r_{11} & r_{12} & \ldots & r_{1m} \\ & r_{22} & \ldots & r_{2m} \\ & & \ddots & \vdots \\ & & & r_{mm} \end{bmatrix}.$$

Опр. *Разложение $A = QR$, где Q имеет ортонормированные столбцы, а R - верхняя треугольная матрица, называется QR-разложением матрицы A. Таким образом, для любой прямоугольной матрицы с линейно независимыми столбцами существует QR-разложение.*

Теорема (Теорема о QR-разложении)**.** *Любая квадратная комплексная матрица представима в виде произведения унитарной и верхней треугольной матрицы.*

Д-во. Любая квадратная матрица A является пределом последовательности невырожденных матриц $A_k = A - \alpha_k I$, так как заведомо имеется последовательность чисел $\alpha_k \to 0$, отличных от собственных значений матрицы A. Для каждой невырожденной матрицы A_k, как мы уже знаем, существует QR-разложение: $A_k = Q_k R_k$. Последовательность Q_k принадлежит компактному множеству матриц, поэтому из нее можно выделить сходящуюся подпоследовательность $Q_{k_l} \to Q$. Матрица Q будет, конечно, унитарной, а придел последовательности $R_{k_l} = Q_{k_l}^* A_{k_l} \to Q^* A$ является, очевидно, верхней треугольной матрицей. $\square$