Дата последней сборки документа:
30 апреля 2022 г. в 14:00

Сборник заметок по линейной алгебре и сопряженным вопросам

Подвойский А.О.

Содержание

1. Мера обусловленности матрицы

Мера (или *число*) *обусловленности матрицы* A определяется как [3, стр. 306]

$$\nu(A) = \|A\| \, \|A^{-1}\|$$

Поскольку *любая норма* матрицы не меньше своего наибольшего по модулю собственного значения, то $\|A\| \geqslant \max|\lambda_A|$ и поскольку собственные значения матриц A и A^{-1} взаимо обратны, то

$$\|A^{-1}\| \geqslant \max \frac{1}{|\lambda_A|} = \frac{1}{\min |\lambda_A|}$$

Таким образом, мера обусловленности матрицы A

$$\boxed{\nu(A) \geqslant \frac{\max |\lambda_A|}{\min |\lambda_A|} \geqslant 1}$$

В частности, при $A = A^T$ (то есть если матрица симметричная) имеем $\|A\|_2 = \max |\lambda_A|$. Следовательно, в случае нормы $\| \cdot \|_2$

$$\nu(A) = \frac{\max |\lambda_A|}{\min |\lambda_A|}.$$

2. Линейно зависимые и линейно независимые системы

Система из k столбцов $A_1, \ldots, A_k$ называется *линейно зависимой*, если существуют такие числа $\alpha_1, \ldots, \alpha_k$ не все равные нулю одновременно, что [1, стр. 128]

$$\alpha_1 A_1 + \alpha_2 A_2 + \ldots \alpha_k A_k = o,$$

где o – нулевой вектор соответствующего размера.

То есть другими словами система k столбцов называется *линейно зависимой*, если эти столбцы *суммируются в нулевой столбец* для нетривиального случая коэффициентов α_i (когда эти коэффициенты не все одновременно равны нулю).

Система из k столбцов называется *линейно независимой*, если $\sum\limits_{j=1}^{k} \alpha_j A_j = o$ возможно только в тривиальном случае, т.е. когда $\alpha_1 = \alpha_2 = \ldots = \alpha_k = 0$.

2.1. Свойства линейно зависимых и линейно независимых столбцов

Замечание

Понятия линейной зависимости и линейной независимости формулируются одинаково как для строк, и так для столбцов

- Если в систему входит *нулевой столбец*, то она *линейно зависима*,
- Если в систему входит *два равных столбца*, то она *линейно зависима*,
- Если в системе столбцов имеется два пропорциональных столбца $A_i = \lambda A_j$, то она линейно зависима,
- Любые столбцы, входящие в *линейно независимую систему*, образуют *линейно независимую подсистему*,
- Система столбцов, содержащая *линейно зависимую подсистему*, сама *линейно зависима*,
- Если система столбцов $A_1, \ldots, A_k$ – линейно независима, а после присоединения к ней столбца A – оказывается линейно зависимой, то столбец A можно разложить по столбцам $A_1, \ldots, A_k$ и притом единственным образом, т.е. коэффициенты определяются однозначно.

3. Система m линейных алгебраических уравнений с n неизвестными

Матричная запись неоднородной системы уравнений имеет вид

$$Ax = b,$$

а однородной

$$Ax = o,$$

где o в правой части обозначает нулевой столбец размеров $m \times 1$.

Эту матричную запись неоднородной системы уравнений можно представить в эквивалентной форме

$$\begin{pmatrix} a_{11} \\ \vdots \\ a_{m1} \end{pmatrix} x_1 + \begin{pmatrix} a_{12} \\ \vdots \\ a_{m2} \end{pmatrix} x_2 + \ldots + \begin{pmatrix} a_{1n} \\ \vdots \\ a_{mn} \end{pmatrix} x_n = \begin{pmatrix} b_1 \\ \vdots \\ b_m. \end{pmatrix}$$

Тогда решение системы представляется столбцом

$$x = \begin{pmatrix} \alpha_1 \\ \vdots \\ \alpha_n \end{pmatrix}$$

и удовлетворяте равенству

$$\begin{pmatrix} a_{11} \\ \vdots \\ a_{m1} \end{pmatrix} \alpha_1 + \begin{pmatrix} a_{12} \\ \vdots \\ a_{m2} \end{pmatrix} \alpha_2 + \ldots + \begin{pmatrix} a_{1n} \\ \vdots \\ a_{mn} \end{pmatrix} \alpha_n = \begin{pmatrix} b_1 \\ \vdots \\ b_m, \end{pmatrix}$$

т.е. столбец свободных членов b является линейной комбинацией столбцов матрицы системы.

4. Теорема (правило) Крамера

Система называется **совместной**, если она имеет *хотя бы одно решение*. Система называется **несовместной**, если она *не имеет ни одного решения*.

Если определитель $\Delta = \det A$ матрицы системы n линейный независимых уравнений с n неизвестными отличен от нуля ($\det A \neq 0$), то система имеет *единственное* решение, которое находится по формулам

$$x_i = \frac{\Delta_i}{\Delta}, \; i = 1, \ldots, n, \quad (\Delta = \det A \neq 0),$$

где Δ_i – определитель матрицы, полученной из матрицы системы $A = [a_{ij}]_{i,j=1}^{n}$ заменой i-ого столбца столбцом свободных членов.

ЗАМЕЧАНИЕ: на практике при больших n правило Крамера не применяется!

Если $\Delta = 0$ (матрица коэффициентов системы вырождена) и хотя бы один определитель $\Delta_i \neq 0$, то система *несовместна*, т.е. не имеет ни одного решения. Если же $\Delta = \Delta_1 = \Delta_2 = \ldots, \Delta_n = 0$, то возможны два случая: либо система несовместна (не имеет ни одного решения), либо система имеет бесконечно много решений [1, стр. 188].

5. Условие совместности системы линейных уравнений. Теорема Кронекера-Капелли

Рассмотрим систему m линейных уравнений с n неизвестными. Составим блочную матрицу, приписав к матрице A справа столбец свободных членов b. Получим *расширенную матрицу системы*

$$\underset{m\times(n+1)}{(A \mid b)} = \begin{pmatrix} a_{11} & \dots & a_{1n} & b_1 \\ a_{21} & \dots & a_{2n} & b_2 \\ \vdots & \ddots & \vdots & \vdots \\ a_{m1} & \dots & a_{mn} & b_m \end{pmatrix}$$

Эта матрица содержит всю информацию о системе уравнений, за исключением обозначений неизвестных.

Теорема Кронекера-Капелли. Система $Ax = b$ *совместна* (т.е. имеет хотя бы одно решение) тогда и только тогда, когда ранг матрицы системы равен рангу расширенной матрицы $\operatorname{rg} A = \operatorname{rg}(A \mid b)$.

Если $\operatorname{rg} A \neq \operatorname{rg}(A \mid b)$, то система несовместна – не имеет решений.

Если система имеет решение, то столбец свободных членов есть линейная комбинация столбцов матрицы системы. Поэтому при вычеркивании столбца b из расширенной матрицы $(A \mid b)$ ее ранг не изменяется. Следовательно, $\operatorname{rg}(A \mid b) = \operatorname{rg} A$.

ЗАМЕЧАНИЕ: теорема Кронекера-Капелли дает лишь критерий существования решения системы, но не указывает способа отыскать этого решения.

6. Общее решение системы линейных алгебраических уравнений

Неизвестные, которым соответствуют столбцы, входящие в базисный минор, называются *базисными переменными*, остальные неизвестные – *свободными переменными*.

Общее решение системы, выржающее базисные переменные через свободные, имеет вид [1, стр. 192]

$$\begin{cases} x_1 = b_1^{'} - a_{1,r+1}^{'} x_{r+1} - \ldots - a_{1,n}^{'} x_n, \\ \ldots \\ x_r = b_r^{'} - a_{r,r+1}^{'} x_{r+1} - \ldots - a_{r,n}^{'} x_n, \end{cases}$$

где $x_1, x_2, \ldots, x_r$ – базисные переменные; $x_{r+1}, x_{r+2}, \ldots, x_n$ – свободные переменные.

Частное решение системы – решение системы, получающееся из общего решения, заданием конкретных значений свободными переменным.

Пусть x – решение неоднородной системы. Тогда любое решение x неоднородной системы можно представить в виде $x = x^{\text{н}} + x^{\text{о}}$, где $x^{\text{о}}$ – решение однородной системы.

Говорят, что *общее решение* неоднородной системы есть сумма *частного решения* неоднородной системы и *общего решения* соответствующей однородной системы [1, стр. 200]

$$x = x^{\text{н}} + C_1\varphi_1 + C_2\varphi_2 + \ldots + C_{n-r}\varphi_{n-r}.$$

7. Решение систем уравнений с помощью полуобратных матриц

Требуется решить систему линейных уравнений

$$Ax = b,$$

где A – произвольная матрица размера $m \times n$.

Если матрица системы нулевая $A = O$, то система либо несовместна (при $b = o$), либо имеет бесконечное множество решений (при $b = o$ любой подходящий по размерам столбец x является решением). Далее рассматривается случай ненулевой матрицы A.

Пусть $A^{\neg 1}$ – матрица, полуобратная к матрице системы A. Используя определение полуобратной матрицы, неоднородную систему $Ax = b$ можно переписать так

$$AA^{\neg 1}Ax = b.$$

Если x – решение системы, то подставляя $Ax = b$ в левую часть последнего соотношения

$$AA^{\neg 1}Ax = b, \quad \to \quad AA^{\neg 1}b = b.$$

Тогда

$$\left(E_m - AA^{\neg 1}\right) b = o.$$

Это необходимое и достаточное условие совместности системы.

Решением системы будет $x = A^{\neg 1}b$. Но поскольку *полуобратная матрица* определена *неоднозначно*, то эта формула фактически задает множество решений системы. Преобразуем так, чтобы была видна структура этого множества, в частности, выявим количество независимых параметров

$$A_0^{\neg 1} = T\Lambda^T S = T \left(\begin{array}{c|c} E_r & O \\ \hline O & O \end{array}\right) S,$$

где S и T – элементарные матрицы порядков n и m соответственно, Λ – матрица простейшего вида, эквивалентная матрице A ($\Lambda \sim A$), $\operatorname{rg} A$.

Теорема о совместности неоднородной системы и о структуре ее общего решения. Неоднородная система $Ax = b$ *совместна* тогда и только тогда, когда столбец свободных членов является решением однородной системы $\Psi b = o$. Если система $Ax = b$ совместна, то ее общее решение имеет вид [1, стр. 205]

$$x = x^{\text{н}} + x^{\text{о}} = A_0^{\neg 1}\, b + \Psi\, c = T \left(\begin{array}{c|c} E_r & O \\ \hline O & O \end{array}\right) S\, b + T \left(\begin{array}{c} O \\ \hline E_{n-r} \end{array}\right) c, \quad \Psi = \left(\begin{array}{c|c} O & E_{m-r}S \end{array}\right),$$

где T, S – элементарные преобразующие матрицы, $c = (C_1 \ldots C_{n-r})^T$ – столбец произвольных постоянных.

Алгоритм применения полуобратной матрицы:

1. Привести матрицу A системы $Ax = b$ к простейшему виду: $\Lambda = SAT$. При этом находятся элементраные преобразующие матрицы S и T, а также ранг $r = \operatorname{rg} A \geqslant 1$.
2. Проверить условие совместности системы $\Psi b = o$. При $r = m$ система совместна. Если $r < m$, то составить матрицу $\Psi = (O \mid E_{m-r})\, S$ и проверить условие $\Psi b = o$. Если условие выполняется, то система совместна. В противном случае система несовместна и процесс решения заканчивается.
3. Найти частное решение неоднородной системы по формуле
$$x^{\text{н}} = A_o^{-1}\, b = T \left(\begin{array}{c|c} E_r & O \\ \hline O & O \end{array} \right) S\, b$$
4. Составить фундаментальную матрицу
$$\Phi = T \left(\begin{array}{c} O \\ \hline E_{n-r}. \end{array} \right)$$
5. Записать общее решение системы в виде
$$x = x^{\text{н}} + \Phi\, c,$$
где $c = (C_1 \ldots C_{n-r})^T$ – столбец произвольных постоянных.

8. Псевдорешения системы линейных уравнений

Система m линейных алгебраических уравнений с n неизвестными $Ax = b$ может иметь единственное решение, бесконечно много решений или вообще не иметь решений. Нужно изменить понятие решения так, чтобы любая система линейных уравнений имела бы единственное в некотором смысле «решение».

Поставим каждому столбцу в соответсвие неотрицательное действительное число, а именно норму (модуль)
$$|x| = \left(\sum_{i=1}^{n} x_i^2 \right)^{1/2}.$$

Псевдорешением системы линейных уравнений называется наименьший по норме столбец $\tilde{x}$ среди всех столбцов, минимизирующих величину $|Ax - b|$.

ЗАМЕЧАНИЕ: *любая* система имеет единственное псевдорешение [1, стр. 209]
$$\tilde{x} = A^{\sim 1} b,$$
где $A^{\sim 1}$ – псевдообратная матрица для матрицы системы.

Понятие псевдорешения позволяет обойти не только факт неединственности, но и факт несуществования решений.

Если система несовместна, то псевдорешение $\tilde{x}$ обеспечивает наименьшую величину погрешности $\varepsilon(x) = |Ax - b|$.

Если система совместна, то псевдорешение $\tilde{x}$ является ее решением, т.е. $\varepsilon(\tilde{x}) = 0$, причем наименьшим по норме.

Алгоритм нахождения псевдорешения неоднородной системы:

1. Найти псевдообратную матрицу $A^{\sim 1}$.
2. Найти псевдорешение $\tilde{x} = A^{\sim 1}b$.

ЗАМЕЧАНИЕ: *полуобратная* матрица определена неоднозначно и потому задает не конкретное решение, а *множество решений* системы. *Псевдорешение*, полученное с помощью псевдообратной матрицы, всегда вычисляется в *конкретное решение*.

9. Свойства решений однородной системы

Общее решение однородной системы $Ax = o$ имеет вид [1, стр. 194]

$$\begin{cases} x_1 = -a'_{1,r+1}x_{r+1} - \ldots - a'_{1,n}x_n, \\ \ldots \\ x_r = -a'_{r,r+1}x_{r+1} - \ldots - a'_{r,n}x_n. \end{cases}$$

Некоторые свойства:

- Если столбцы $\varphi_1, \varphi_2, \ldots, \varphi_k$ – решения однородной системы уравнений, то любая их линейная комбинация $\alpha_1\,\varphi_1 + \alpha_2\,\varphi_2 + \ldots + \alpha_k\,\varphi_k$ также является решением однородной системы,
- Если ранг матрицы однородной системы равен r, то система имеет $(n - r)$ *линейно независимых решений.*

Любая совокупность $(n-r)$ линейно независимых решений $\varphi_1, \varphi_2, \ldots, \varphi_{n-r}$ однородной системы называется *фундаментальной системой решений.*

Теорема об общем решении однородной системы. Если $\varphi_1, \varphi_2, \ldots, \varphi_{n-r}$ – фундаментальная система решений однородной системы уравнений, то столбец

$$x = C_1\varphi_1 + C_2\varphi_2 + \ldots + C_{n-r}\varphi_{n-r} \tag{1}$$

при любых значениях произвольных постоянных $C_1, C_2, \ldots, C_{n-r}$ также является решением системы $Ax = o$, и, наоборот, для каждого решения x этой системы найдутся такие значения произвольных постоянных $C_1, C_2, \ldots, C_{n-r}$, при которых это решение x удовлетворяет равенству (1).

10. Функциональные матрицы скалярного аргумента

Функциональной матрицей скалярного аргумента t называется матрица, элементы которой являются функциями независимой переменной t

$$\underset{m\times n}{A(t)} = [\,a_{ij}(t)\,]_{i,j=1}^{m,n}$$

Производная функциональной матрицы

$$\underset{m\times n}{\frac{dA(t)}{dt}} = \left[\frac{da_{ij}(t)}{dt}\right]_{i,j=1}^{m,n}.$$

Производная обратной матрицы (если она существует)

$$\underset{m\times n}{\frac{dA^{-1}(t)}{dt}} = -A^{-1}(t)\,\frac{dA(t)}{dt}\,A^{-1}(t).$$

Производная определителя квадратной матрицы $A(t)$ n-ого порядка

$$\frac{d}{dt}\det A(t) = \sum_{i=1}^{n}\sum_{j=1}^{n} A_{ij}(t)\frac{da_{ij}(t)}{dt} = \operatorname{tr}\left[A^{+}(t)\,\frac{dA(t)}{dt}\right],$$

где $A_{ij}(t)$ – алгебраическое дополнение элемента $a_{ij}(t)$ матрицы $A(t)$; $A^{+}(t)$ – присоединенная матрица.

11. Производные скалярной функции по векторному аргументу

Рассмотрим скалярную (числовую) функцию нескольких переменных $f(x_1, x_2, \ldots, x_n)$. Упорядоченный набор переменных $x_1, x_2, \ldots, x_n$ будем называть *векторным аргументом* этой функции.

Первый дифференциал функции $f(x) = f(x_1, x_2, \ldots, x_n)$ имеет вид

$$df(x) = \frac{\partial f(x)}{\partial x_1}dx_1 + \frac{\partial f(x)}{\partial x_2}dx_2 + \ldots + \frac{\partial f(x)}{\partial x_n}dx_n.$$

Сумму в правой части можно представить как произведение строки $\frac{df(x)}{dx} = \left(\frac{\partial f(x)}{\partial x_1} \ldots \frac{\partial f(x)}{\partial x_n}\right)$ на столбец $dx = (dx_1 \ldots dx_n)^T$, либо как произведение строки dx^T на столбец $dx = \frac{df(x)}{dx^T} = \left(\frac{df(x)}{dx}\right)^T$.

Так как первый дифференциал $\underset{1\times 1}{df(x)}$ – это одноэлементная матрица (а одноэлементая матрица совпадает со своей транспонированной), то $\underset{1\times 1}{df(x)} = \big(\underset{1\times 1}{df(x)}\big)^T$

$$\underset{1\times 1}{df(x)} = \underset{1\times n}{\frac{df(x)}{dx}}\,\underset{n\times 1}{dx} = \left(\frac{df(x)}{dx}dx\right)^T = dx^T\left(\frac{df(x)}{dx}\right)^T = \underset{1\times n}{dx}^T\,\underset{n\times 1}{\frac{df(x)}{dx^T}}.$$

Второй дифференциал функции имеет вид

$$d^2f(x) = \sum_{i=1}^{n}\sum_{j=1}^{n}\frac{\partial^2 f(x)}{\partial x_i \partial x_j}dx_i dx_j.$$

Обозначим через $\frac{d^2f(x)}{dx^T dx} = \left[\frac{\partial^2 f(x)}{\partial x_i^2 \partial x_j^2}\right]_{i,j=1}^{n}$ квадратную матрицу частных производных второго порядка (*матрицу Гессе*). Определитель матрицы Гессе называется *гессианом.*

Тогда можно переписать

$$\underset{1\times 1}{d^2f(x)} = \underset{1\times n}{dx}^T\,\underset{n\times n}{\frac{d^2f(x)}{dx^T dx}}\,\underset{n\times 1}{dx}.$$

Для скалярной функции скалярного аргумента второй дифференциал будет иметь вид

$$d^2 f(x) = \frac{d^2 f(x)}{dx^2} dx^2.$$

Для записи производных можно использовать символические векторы (столбцы или строки)

$$\nabla = \frac{d}{dx} = \left(\frac{\partial}{\partial x_1} \dots \frac{\partial}{\partial x_n}\right), \quad \nabla^T = \frac{d}{dx^T} = \begin{pmatrix} \dfrac{\partial}{\partial x_1} \\ \vdots \\ \dfrac{\partial}{\partial x_n} \end{pmatrix}.$$

При этом дифференциирование функции формально записывается как как умножение функции на символический вектор производных. Например, градиент функции есть произведение вектора ∇ на функцию $f(x)$

$$\nabla f(x_1, \dots, x_n) = \left(\frac{\partial f}{\partial x_1} \dots \frac{\partial f}{\partial x_n}\right),$$

$$\underset{n\times 1}{\nabla}^T \underset{1\times n}{\nabla} = \begin{pmatrix} \dfrac{\partial}{\partial x_1} \\ \dots \\ \dfrac{\partial}{\partial x_n} \end{pmatrix} \left(\frac{\partial}{\partial x_1} \dots \frac{\partial}{\partial x_n}\right) = \left[\frac{\partial^2}{\partial x_i \partial x_j}\right]_{i,j=1}^n.$$

Найти первую и вторую производные сложной функции $g(t) = f(x_1(t), \dots, x_n(t))$, применяя матричные обозначения.

Находим производные функции, заменяя суммирование операциями умножения соответствующих матриц. Первая производная

$$\frac{dg(t)}{dt} = \frac{d}{dt}\Big(f(x_1(t), \dots, x_n(t))\Big) = \sum_{i=1}^n \frac{\partial f(x(t))}{\partial x_i} \cdot \frac{dx_i(t)}{dt} = \frac{df(x(t))}{dx} \cdot \frac{dx(t)}{dt}$$

В случае скалярной функции скалярного аргумента первая производная от функции $g(x)$ будет выглядеть так же.

Вторая производная скалярной функции векторного аргумента

$$\frac{d^2 g(t)}{dt^2} = \sum_{j=1}^n \sum_{i=1}^n \frac{\partial^2 f(x(t))}{\partial x_j \partial x_i} \cdot \frac{dx_i(t)}{dt} \cdot \frac{dx_j(t)}{dt} + \sum_{i=1}^n \frac{\partial f(x(t))}{\partial x_i} \cdot \frac{dx_i^2}{dt^2} = \dots$$
$$\dots = \left(\frac{dx(t)}{dt}\right)^T \frac{d^2 f(x(t))}{dx^T dx} \cdot \frac{dx(t)}{dt} + \frac{df(x(t))}{dx} \cdot \frac{d^2 x(t)}{dt^2}.$$

В случае скалярной функции скалярного аргумента вторая производная будет выглядеть так

$$\frac{d^2 g(t)}{dt^2} = \frac{d^2 f(x(t))}{dx^2} \left(\frac{dx(t)}{dt}\right)^2 + \frac{df(x(t))}{dx} \cdot \frac{d^2 x(t)}{dt^2}.$$

Выражения для первой производной совпадают, а для второй производной – отличаются незначительно, причем полное совпадение будет, если учесть, что $x^T = x$ для *скалярной* величины x.

12. Производные от векторной функции векторного аргумента

Пусть задан столбец

$$f(x) = \begin{pmatrix} f_1(x_1,\ldots,x_n) \\ \vdots \\ f_n(x_1,\ldots,x_n) \end{pmatrix}$$

функций нескольких переменных (говорят, что задана *вектор-функция векторного аргумента*).

Первый дифференциал вектор-функции имеет вид

$$df(x) = \begin{pmatrix} df_1(x_1,\ldots,x_n) \\ \vdots \\ df_m(x_1,\ldots,x_n) \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} \sum\limits_{j=1}^{n} \dfrac{\partial f_1(x_1,\ldots,x_n)}{\partial x_j}\, dx_j \\ \vdots \\ \sum\limits_{j=1}^{n} \dfrac{\partial f_m(x_1,\ldots,x_n)}{\partial x_j}\, dx_j \end{pmatrix} = \sum_{j=1}^{n} \begin{pmatrix} \dfrac{\partial f_1(x)}{\partial x_j} \\ \vdots \\ \dfrac{\partial f_m(x)}{\partial x_j} \end{pmatrix} dx_j$$

Обозначим через

$$\frac{df(x)}{dx} = \begin{pmatrix} \dfrac{\partial f_1(x)}{\partial x_1} & \ldots & \dfrac{\partial f_1(x)}{\partial x_n} \\ \vdots & \ddots & \vdots \\ \dfrac{\partial f_m(x)}{\partial x_1} & \ldots & \dfrac{\partial f_m(x)}{\partial x_n} \end{pmatrix} = \left[\frac{\partial f_i(x)}{\partial x_j} \right]_{i,j=1}^{m,n}$$

матрицу частных производных первого порядка заданных функций (*матрицу Якоби*).

Тогда выражение для первого дифференциала можно записать в виде $df(x) = \dfrac{df(x)}{dx} dx$, т.е. $\dfrac{df(x)}{dx}$ – производная вектор-функции векторного аргумента.

Как и в случае с аргументом x, упорядоченный набор функций можно считать не матрицей-столбцом, а матрицей-строкой $(f(x))^T$. Этот случай сводится к предыдущему, учитывая, что операции дифференциирования и транспонирования можно выполнять в любом порядке, так как $d(f^T) = (df)^T$. Тогда из равенства $df = \dfrac{df}{dx} dx$ получаем $df^T = (dx)^T \Big(\dfrac{df}{dx}\Big)^T = (dx)^T \dfrac{df^T}{dx^T}$, где

$$\Big(\frac{df(x)}{dx}\Big)^T = \frac{df^T}{dx^T} = \begin{pmatrix} \dfrac{\partial f_1(t)}{\partial x_1} & \ldots & \dfrac{\partial f_m(x)}{\partial x_1} \\ \vdots & \ddots & \vdots \\ \dfrac{\partial f_1(x)}{\partial x_n} & \ldots & \dfrac{\partial f_m(x)}{\partial x_n} \end{pmatrix}$$

– транспонированная матрица Якоби вектор-функции векторного аргумента.

13. Правила дифференциирования по векторному аргументу

Векторный аргумент x, его приращение dx считаем вектор-столбцами размеров $n \times 1$.

Первый дифференциал скалярной функции векторного аргумента $f(x_1,\ldots,x_n)$ (одноэлементная матрица) имеет вид

$$df = \frac{df}{dx}\, dx = dx^T\, \frac{df}{dx^T},$$

где $\dfrac{df}{dx} = \left(\dfrac{df}{dx_1} \dots \dfrac{df}{dx_n}\right)$ – градиент функции, а $\left(\dfrac{df}{dx}\right)^T = \dfrac{df}{dx^T}$, так как функция скалярная.

Второй дифференциал скалярной функции векторного аргумента $f(x_1, \dots, x_n)$

$$d^2 f = dx^T \frac{d^2 f}{dx^T dx} dx,$$

где $\dfrac{d^2 f}{dx^T dx} = \left[\dfrac{\partial^2 f(x)}{\partial x_i \partial x_j}\right]_{i,j=1}^n$ – матрица Гессе.

Первый дифференциал вектор-функции векторного аргумента (вектора-столбца) $f(x)$ имеет вид

$$df = \frac{df(x)}{dx} dx,$$

где $\dfrac{df(x)}{dx}$ – матрица Якоби.

Первый дифференциал вектора-строки

$$(df)^T = d(f^T) = dx^T \frac{df^T}{dx^T}.$$

В частном случае, когда $f(x_1, \dots, x_n) = (x_1, \dots, x_n)$, получаем

$$\frac{dx}{dx} = E, \quad \frac{dx^T}{dx^T} = E,$$

где E – единичная матрица n-ого порядка.

Числовую матрицу C соответствующих размеров можно выносить за знак производной

$$\frac{d(Cf)}{dx} = C \frac{df}{dx}, \quad \frac{d(f^T C)}{dx^T} = \frac{df^T}{dx^T} C$$

Производные суммы, разности и произведения вектор-функций векторного аргумента $u(x)$ и $v(x)$ одинаковых размеров $m \times 1$

$$\frac{d(u+v)}{dx} = \frac{du}{dx} + \frac{dv}{dx}, \quad \frac{d(u-v)}{dx} = \frac{du}{dx} - \frac{dv}{dx},$$
$$\frac{d(u^T v)}{dx} = u^T \frac{dv}{dx} + v^T \frac{du}{dx}, \quad \frac{d(u^T v)}{dx^T} = \frac{du^T}{dx^T} v + \frac{dv^T}{dx^T} u.$$

Производная сложной функции $z(y(x))$, где $z = z(y) = \begin{pmatrix} z_1(y) \\ \vdots \\ z_k(y) \end{pmatrix}$ и $y = y(x) = \begin{pmatrix} y_1(x) \\ \vdots \\ y_m(x) \end{pmatrix}$, вычисляется по формуле $\dfrac{dz(y(x))}{dx} = \dfrac{dz(y(x))}{dy} \dfrac{dy(x)}{dx}$ или, опуская аргументы, $\dfrac{dz}{dx} = \underset{k\times m}{\dfrac{dz}{dy}} \underset{m\times n}{\dfrac{dy}{dx}}$.

След матрицы Якоби (при $m = n$) определяет *дивергенцию*

$$\operatorname{div} f = \operatorname{tr} \frac{df}{dx} = \sum_{i=1}^n \frac{\partial f_i}{\partial x_i},$$

где $f(x)$ – векторная функция векторного аргумента.

14. Производные матричной функции по векторному аргументу

Рассмотрим функциональную матрицу $A(x)$, элементами которой служат скалярные функции $a_{ij}(x)$ векторного аргумента x. То есть такая матрица представляет собой трехмерную сущность, в которой на пересечении строки и столбца стоит скалярная функция, имеющая «глубину» в виде вектора аргументов.

Первый дифференциал этой функции

$$dA(x) = \sum_{i=1}^{n} \frac{\partial A(x)}{\partial x_i} dx_i,$$

где $\dfrac{\partial A(x)}{\partial x_i}$ – частная производная матрицы по одной переменной.

Совокупность частных производных (градиент функциональной матрицы) представляет собой объект, элементы которого $\dfrac{\partial a_{ij}(x)}{\partial x_k}$ нумеруются тремя индексами: номер строки, номер столбца и номер переменной дифференциирования. Поэтому заменить операцию суммирования в правой части формулы операцией умножения матриц в данном случае не представляется возможным. Необходимо вводить тензоры и операции над ними.

Элементы матрицы $A = (a^i_j)$ обозначаются a^i_j, где i – номер строки, а j – номер столбца. В частности, $x = (x^i)$ – столбец, а $y = (y_j)$ – строка.

Частную производную функции $F(x)$ (склалярной, векторной или матричной), то по ним производится суммирование (хотя знак суммы не указывается). Например, если $A = (a^i_j)$ – матрица размеров $m \times n$, $x = (x^j)$ – столбец размеров $n \times 1$, $y = (y_i)$ – строка размеров $1 \times m$, то

$$a^i_j x^j = \sum_{j=1}^{n} a^i_j x^j, \quad a^i_j y_i = \sum_{i=1}^{m} a^i_j y_i, \quad a^i_j x^j y_i = \sum_{i=1}^{m} \sum_{j=1}^{n} a^i_j x^j y_i,$$

т.е. $a^i_j x^j$ – i-ый элемент столбца Ax; $a^i_j y_i$ – j-ый элемент строки yA; $a^i_j x^j y_i$ – число yAx.

Применяя эти соглашения, запишем дифференциалы

$$\begin{aligned} df = f_{(i)} dx^i, \quad d^2 f &= f_{(i)(j)} dx^i dx^j, \\ df^i &= f^i_{(j)} dx^j, \\ df^i_j &= f^i_{j(k)} dx^k, \end{aligned}$$

где $f^i_{j(k)} = \dfrac{\partial f^i_j}{\partial x^k}$ – частная производная первого порядка элемента f^i_j функциональной матрицы F по переменной x^k.

15. Линейные и квадратичные формы

Многочлен первой степени от n переменных $x_1, \ldots, x_n$ называется выражением вида

$$p_1(x) = c_1 x_1 + c_2 x_2 + \ldots + c_n x_n + c_0,$$

где $c_0, c_1, \ldots, c_n$ – коэффициенты многочлена (предполагается, что среди коэффициентов есть отличные от нуля); коэффициент c_0 называется свободным членом. Многочлен перовой степени называется однородным, если $p_1(\lambda x) = \lambda p_1(x)$ для любого числа λ (это возможно только когда $c_0 = 0$).

Линейной формой переменных $x_1, \ldots, x_n$ называется однородный многочлен первой степени

$$g(x) = \sum_{i=1}^{n} c_i x_i,$$

где $\{c_i\}_{i=1}^{n}$ – коэффициенты линейной формы.

Составляя из коэффициентов строку $c = (c_1 \ldots c_n)$, а из переменных – столбец $x = (x_1 \ldots x_n)^T$, линейную форму можно записать в виде

$$g(x) = cx.$$

Многочлен второй степени от n переменных $x_1, \ldots, x_n$ называется выражение

$$p_2(x) = \sum_{i=1}^{n} \sum_{j=1}^{m} a_{ij} x_i x_j + \sum_{i=1}^{n} b_i x_i + c_0,$$

где числа a_{ij}, b_i, c_0 – коэффициенты многочлена: a_{ij} – страшие коэффициенты; b_i – коэффициенты линейных членов; c_0 – свободный член.

Многочлен второй степени называется однородным, если $p_2(\lambda x) = \lambda^2 p_2(x)$ (это возможно только когда $b_1 = b_2 = \ldots = b_n = 0, c_0 = 0$).

Квадратичной формой переменных $x_1, \ldots, x_n$ называется однородный многочлен второй степени

$$q(x) = \sum_{i=1}^{n} \sum_{j=1}^{n} a_{ij} x_i x_j, \quad a_{ij} = a_{ji}.$$

Симметрическая матрица $A = (a_{ij})$, составленная из коэффициентов квадратичной формы, называется *матрицей квадратичной формы.*

Квадратичная форма называется *вырожденной*, если ее матрица вырожденая ($\mathrm{rg}\, A < n$), в противном случае, когда матрица невырожденная ($\mathrm{rg}\, A = n$), квадратичная форма называется *невырожденной.*

Составляя из переменных столбец $x = (x_1 \ldots x_n)^T$, квадратичную форму можно записать в виде

$$q(x) = x^T A x.$$

Список литературы

1. *Бортаковский А.С.* Линейная алгебра в примерах и задачах. – М.: Высш. шк., 2005. – 591 с.
2. *Гмурман В.Е.* Теория вероятностей и математическая статистика. – М.: Высшая школа, 1972. – 368 с.
3. *Бахвалов Н. С.* Численные методы. – М.: Лаборатория Базовых Знаний, 2000. –624 с.
4. *Лагутин М.Б.* Наглядная математическая статистика. – М.: БИНОМ, 2009. – 472 с.
5. *Кобзарь А.И.* Прикладная математическая статистика. Для инженеров и научных работников. – М.: ФИЗМАТЛИТ, 2012. – 816 с.