第六章欧几里德空间

- ◆内积的定义与性质
- ◆向量的模、单位向量
- ●向量的夹角
- ●正交组、标准正交组
- ◆正交基、标准正交基(底)
- 施密特正交化方法
- ●正交矩阵、正交变换

§ 6.1 欧几里德空间

§ 6.1.1 向量的标准内积

一、内积的定义及性质

定义1: 设V是实线性空间(数域为R), 若对于V内任意一对向量 α , β 按照某一法则在R中有一个唯一确定的实数 $\langle \alpha, \beta \rangle$ 与之对应,且满足条件:

(I)
$$\langle \alpha, \beta \rangle = \langle \beta, \alpha \rangle$$
;
(II) $\langle \alpha + \beta, \gamma \rangle = \langle \alpha, \gamma \rangle + \langle \beta, \gamma \rangle$; $(\gamma \in V)$
(III) $\langle k\alpha, \beta \rangle = k \langle \alpha, \beta \rangle$; $(k \in R)$
(IV) $\langle \alpha, \alpha \rangle \ge 0$, 当且仅当 $\alpha = 0$ 时 $\langle \alpha, \alpha \rangle = 0$;

则实数 $\langle \alpha, \beta \rangle$ 称为向量 α , β 的标准内积,简称为内积. 定义了内积的实线性空间称为欧几里得空间,简称欧氏空间. 注:有的书上对内积用 (α, β) 表示

注意:

定义1是个抽象定义,不同的实线性空间中的内积可以有完全不同的内容与形式.

同一个实线性空间中也可以定义<mark>不同</mark>的内积, 而构成不同的欧氏空间.

例1: 在
$$R^n$$
中,对于任意向量 $\alpha = (x_1, x_2, \dots, x_n)$,
$$\beta = (y_1, y_2, \dots, y_n)$$
定义
$$\langle \alpha, \beta \rangle = x_1 y_1 + x_2 y_2 + \dots + x_n y_n$$
 (1)

显然设 $\gamma = (z_1, z_2, \dots, z_n), k \in \mathbb{R}$ 则

(I)
$$\langle \alpha, \beta \rangle = x_1 y_1 + x_2 y_2 + \dots + x_n y_n = y_1 x_1 + y_2 x_2 + \dots + y_n x_n$$

= $\langle \beta, \alpha \rangle$

(II)
$$\langle \alpha + \beta, \gamma \rangle = (x_1 + y_1)z_1 + (x_2 + y_2)z_2 + \dots + (x_n + y_n)z_n$$

$$= (x_1z_1 + x_2z_2 + \dots + x_nz_n) + (y_1z_1 + y_2z_2 + \dots + y_nz_n)$$

$$= \langle \alpha, \gamma \rangle + \langle \beta, \gamma \rangle$$

(III)
$$\langle k\alpha, \beta \rangle = kx_1y_1 + kx_2y_2 + \dots + kx_ny_n = k\langle \alpha, \beta \rangle$$

(IV)
$$\langle \alpha, \alpha \rangle = x_1^2 + x_2^2 + \dots + x_n^2 \ge 0$$
, 当且仅当 $\alpha = 0$ 时 $\langle \alpha, \alpha \rangle = 0$;

显然,它<mark>适合</mark>内积定义中的条件 (I)-(IV),这样 R^n 中按(1)得到一个内积,于是 R^n 关于这个内积成为一个欧几里得空间.

例2: 在 R^n 中,对于任意向量 $\alpha = (x_1, x_2, \dots, x_n)$, $\beta = (y_1, y_2, \dots, y_n)$ 定义 $\langle \alpha, \beta \rangle = x_1 y_1 + 2x_2 y_2 + \dots + nx_n y_n$ (2)

容易验证它也适合内积定义中的条件(I)-(IV),这样 R*中按(2)也得到一个内积,这时R*关于这个内积也构成一个欧氏空间.

注意:由于内积的定义不同,这是两个不同的欧氏空间.以后凡说到欧氏空间 R^* 均指例1所述的欧氏空间.

例3: 在连续函数空间 C[a,b]中,对任意的

由定积分的性质可知:设

$$f(x),g(x),h(x)\in C[a,b],k\in R$$

(1)
$$\langle g(x), f(x) \rangle = \int_a^b g(x) f(x) dx$$

= $\int_a^b f(x) g(x) dx = \langle f(x), g(x) \rangle$

(2)
$$\langle g(x) + f(x), h(x) \rangle = \int_a^b (g(x) + f(x))h(x)dx$$

$$= \int_a^b g(x)h(x)dx + \int_a^b f(x)h(x)dx = \langle g(x), h(x) \rangle + \langle f(x), h(x) \rangle$$

(3)
$$\langle kf(x), g(x) \rangle = \int_a^b kf(x)g(x)dx = k \int_a^b f(x)g(x)dx = k \langle f(x), g(x) \rangle$$

(4) 当f(x)不是恒等于0时

$$\langle f(x), f(x) \rangle = \int_a^b f(x)f(x)dx = \int_a^b (f(x))^2 dx > 0$$

因此,该定积分满足内积定义的4个条件,因而它也成为C[a,b]中的一个内积. 于是,关于这个内积C[a,b]也成为一个欧氏空间.

欧几里得空间的一些基本性质:

(I)
$$\langle \alpha, \beta \rangle = \langle \beta, \alpha \rangle$$

定义1的条件(I)表明内积是对称的,故有

$$\langle \alpha, k\beta \rangle = \langle k\beta, \alpha \rangle = k \langle \beta, \alpha \rangle = k \langle \alpha, \beta \rangle = \langle k\alpha, \beta \rangle$$
$$\langle \alpha, \beta + \gamma \rangle = \langle \beta + \gamma, \alpha \rangle = \langle \beta, \alpha \rangle + \langle \gamma, \alpha \rangle = \langle \alpha, \beta \rangle + \langle \alpha, \gamma \rangle$$

又
$$\langle 0, \alpha \rangle = \langle 0 + 0, \alpha \rangle = \langle 0, \alpha \rangle + \langle 0, \alpha \rangle = 2\langle 0, \alpha \rangle$$
 故 $\langle 0, \alpha \rangle = 0$



性质1 $\forall \alpha \in V$,有 $\langle 0,\alpha \rangle = 0$,特别 $\langle 0,0 \rangle = 0$.

性质2 α 是V中某一向量,若对于 $\forall \beta \in V$,有 $\langle \alpha, \beta \rangle = 0$,则 $\alpha = 0$.

性质3
$$\forall \alpha_i, \beta_j \in V$$
及 $\forall a_i, b_j \in R$ $(i = 1, 2, \dots, l; j = 1, 2, \dots, t)$, 恒有 $\left\langle \sum_{i=1}^{l} a_i \alpha_i, \sum_{j=1}^{t} b_j \beta_j \right\rangle = \sum_{i=1}^{l} \sum_{j=1}^{t} \left\langle \alpha_i, \beta_j \right\rangle a_i b_j$

二、向量的长度及性质

定义2: $\sqrt{\langle \alpha, \alpha \rangle}$ 称为欧氏空间V中向量 α 的模(或长度),记为 $|\alpha|$,即 $|\alpha| = \sqrt{\langle \alpha, \alpha \rangle}$.

注:模为1的向量称为单位向量,若 $\alpha \neq 0$,则 $\frac{1}{|\alpha|}^{\alpha}$ 就是一个单位向量,这样得到的向量一般称为把 α 单位化(或标准化).

向量的长度具有下述性质:

 $\forall \lambda \in R, \forall \alpha, \beta \in V$

1. 非负性 当 $\alpha \neq 0$ 时, $|\alpha| > 0$; 当 $\alpha = 0$ 时, $|\alpha| = 0$.

2. 齐次性
$$|\lambda \alpha| = |\lambda| |\alpha|$$

3. 三角不等式 $|\alpha+\beta| \leq |\alpha|+|\beta|$ (后面证明)

柯西——布涅柯夫斯基不等式

定理:对于欧氏空间中任意二向量 α , β ,恒有

$$\langle \alpha, \beta \rangle^2 \le \langle \alpha, \alpha \rangle \langle \beta, \beta \rangle \quad (\overline{\mathfrak{R}} |\langle \alpha, \beta \rangle) \le |\alpha| |\beta|)$$

其中等号成立的充要条件是 α 与 β 线性相关.

$$\sqrt{|\beta|} \langle k\alpha + \beta, k\alpha + \beta \rangle = \langle k\alpha, k\alpha \rangle + 2\langle k\alpha, \beta \rangle + \langle \beta, \beta \rangle$$

$$= \langle \alpha, \alpha \rangle k^2 + 2\langle \alpha, \beta \rangle k + \langle \beta, \beta \rangle > 0$$

(这是一个关于k的一元二次多项式.)

因为 $\langle \alpha, \alpha \rangle > 0$, 因此上述不等式成立的条件是

$$\Delta = 4\langle \alpha, \beta \rangle^2 - 4\langle \alpha, \alpha \rangle \langle \beta, \beta \rangle < 0$$

即
$$\langle \alpha, \beta \rangle^2 < \langle \alpha, \alpha \rangle \langle \beta, \beta \rangle$$

总之恒有
$$\langle \alpha, \beta \rangle^2 \le \langle \alpha, \alpha \rangle \langle \beta, \beta \rangle$$
 或 $|\langle \alpha, \beta \rangle| \le |\alpha| \beta|$

下面证等号成立的充要条件是 α , β 线性相关。

必要性: 若上式等号成立, (用反证法), 假设 α , β 无关,则由上面分析立得:

$$\langle \alpha, \beta \rangle^2 < \langle \alpha, \alpha \rangle \langle \beta, \beta \rangle$$

矛盾,故必有 α , β 线性相关。

应用实例

如在前面例1所定义的线性空间 R^n 中,由该定理的不等式得到:对于任意实数 a_1, a_2, \dots, a_n , b_1, b_2, \dots, b_n ,有不等式

$$(a_1b_1 + a_2b_2 + \dots + a_nb_n)^2 \le (a_1^2 + a_2^2 + \dots + a_n^2)(b_1^2 + b_2^2 + \dots + b_n^2)$$

或者

$$|a_1b_1 + a_2b_2 + \dots + a_nb_n| \le \sqrt{a_1^2 + a_2^2 + \dots + a_n^2} \sqrt{b_1^2 + b_2^2 + \dots + b_n^2}$$

又如
$$\left| \int_a^b f(x)g(x)dx \right| \leq \left(\int_a^b f^2(x)dx \right)^{\frac{1}{2}} \left(\int_a^b g^2(x)dx \right)^{\frac{1}{2}}$$

前面三角不等式性质的证明:

证明在欧氏空间中,对于任意向量 α , β 有

$$|\alpha + \beta| \leq |\alpha| + |\beta|$$

i.E:
$$|\alpha + \beta|^2 = \langle \alpha + \beta, \alpha + \beta \rangle = \langle \alpha, \alpha \rangle + 2\langle \alpha, \beta \rangle + \langle \beta, \beta \rangle$$

 $= |\alpha|^2 + |\beta|^2 + 2\langle \alpha, \beta \rangle$
 $\leq |\alpha|^2 + |\beta|^2 + 2|\langle \alpha, \beta \rangle|$

由前面定理知 $|\langle \alpha, \beta \rangle| \leq |\alpha||\beta|$,于是

$$|\alpha + \beta|^2 \le |\alpha|^2 + |\beta|^2 + 2|\alpha||\beta| = (|\alpha| + |\beta|)^2$$

开方得 $|\alpha + \beta| \le |\alpha| + |\beta|$

两个非零向量的夹角

定义3: 非零向量 α , β 的夹角 (α, β) 规定为

$$\theta = \arccos \frac{\langle \alpha, \beta \rangle}{|\alpha||\beta|}, \ (0 \le \theta \le \pi), \$$
记为 $(\widehat{\alpha, \beta})$

若两个非零向量的夹角为 $\pi/2$,则称这两个向量正交或相互垂直,记 $\alpha \perp \beta$.

显然,两个正交向量的内积为零,即若 $\alpha \perp \beta$ 则 $\langle \alpha, \beta \rangle = 0$.

特别的, 规定零向量与任何向量都正交.



向量 α , β 正交 $\Leftrightarrow \langle \alpha, \beta \rangle = 0$.

注:

- 1) 只有零向量才与自己正交.
- 2) 当向量正交时,存在类似勾股定理结论

$$|\alpha + \beta|^2 = |\alpha|^2 + |\beta|^2$$

欧氏空间中向量的距离

在一个欧氏空间中,两个向量 α , β 的距离定义为 $|\alpha-\beta|$,有时用符号 $d(\alpha,\beta)$ 表示.

例4 在欧氏空间 R^n 中,向量组 $e_1 = (1,0,\dots,0)$, $e_2 = (0,1,\dots,0)$,…, $e_n = (0,0,\dots,1)$ 两两正交.

例5 在欧氏空间里,若向量 α 与向量组 $\beta_1,\beta_2,\cdots,\beta_t$ 中每个向量正交,则 α 与该向量组的任意线性组合也正交.

例6 求向量 $\alpha = (1,2,2,3)$ 与 $\beta = (3,1,5,1)$ 的夹角.

解:
$$\because \cos \theta = \frac{\langle \alpha, \beta \rangle}{|\alpha||\beta|} = \frac{18}{3\sqrt{2} \cdot 6} = \frac{\sqrt{2}}{2}$$
 $\therefore \theta = \frac{\pi}{4}$.

§ 6.1.2 标准正交基底

定义 欧氏空间V中一组两两正交的非零向量, 称为V 的一个正交(向量)组. 若这个正交组中的每个向量都是单位向量,则此正交组称为标准正交组.

定理1 欧氏空间中的正交组是线性无关组.

由定理1知,n维线性空间中,正交组所含向量个数不会超过n.

如果 $\alpha_1,\alpha_2,\cdots,\alpha_n$ 是n维欧氏空间的一个正交组,那么它是V的一个基底,称为正交基(底). 如果正交基底是一个标准正交组,则称为标准正交基(底),或者 规范正交基.

标准正交基 $e_1, e_2, ..., e_n$ 满足关系式:

$$\langle e_i, e_j \rangle = \delta_{ij} = \begin{cases} 1 & i = j \\ 0 & i \neq j \end{cases}$$

例1 验证向量组 $\alpha_1 = (0,1,0), \quad \alpha_2 = (\frac{1}{\sqrt{2}},0,\frac{1}{\sqrt{2}}),$ $\alpha_3 = (\frac{1}{\sqrt{2}},0,-\frac{1}{\sqrt{2}})$ 构成 R^3 的一个标准正交组.

容易验证:
$$|\alpha_1| = |\alpha_2| = |\alpha_3| = 1$$
,且 $\langle \alpha_1, \alpha_2 \rangle = \langle \alpha_1, \alpha_3 \rangle = \langle \alpha_2, \alpha_3 \rangle = 0$

这又是一个单位向量构成的向量组,故又是一个标准正交组. 它们构成 R^3 的一个标准正交基底.

定理2 设 $\alpha_1, \alpha_2, \dots, \alpha_m$ 是欧氏空间V的一组线性无关向量,则存在V的一个正交组 $\beta_1, \beta_2, \dots, \beta_m$,其中 β_k 是向量 $\alpha_1, \alpha_2, \dots, \alpha_k$ $(k = 1, 2, \dots, m)$ 的线性组合.

满足要求的正交组为

$$\begin{cases} \beta_1 = \alpha_1 \\ \beta_k = \alpha_k - \sum_{j=1}^{k-1} \frac{\langle \alpha_k, \beta_j \rangle}{\langle \beta_j, \beta_j \rangle} \beta_j & (k = 2, \dots, m) \end{cases}$$

该求解方法称为施密特(Schimidt)正交化方法.

书上证明: 180-181页.

定理3 任何 $n(n\geq 1)$ 维欧氏空间,一定有正交基底,从而也一定有标准正交基底.

例2由R3的一个基底

$$\alpha_1 = (1,1,1), \quad \alpha_2 = (0,1,2), \quad \alpha_3 = (2,0,3)$$

求 R^3 的一个标准正交基底.

解:先由施密特(Schimidt)正交化方法求出等价的正交组,得

$$\beta_1 = \alpha_1 = (1,1,1)$$

$$\beta_2 = \alpha_2 - \frac{\langle \alpha_2, \beta_1 \rangle}{\langle \beta_1, \beta_1 \rangle} \beta_1 = (0,1,2) - \frac{3}{3}(1,1,1)$$

$$= (0,1,2) - (1,1,1) = (-1,0,1)$$

$$\beta_{3} = \alpha_{3} - \frac{\langle \alpha_{3}, \beta_{1} \rangle}{\langle \beta_{1}, \beta_{1} \rangle} \beta_{1} - \frac{\langle \alpha_{3}, \beta_{2} \rangle}{\langle \beta_{2}, \beta_{2} \rangle} \beta_{2}$$

$$= (2, 0, 3) - \frac{5}{3} (1, 1, 1) - \frac{1}{2} (-1, 0, 1) = \frac{5}{6} (1, -2, 1)$$

再单位化,得

$$\eta_{1} = \frac{\beta_{1}}{|\beta_{1}|} = \left(\frac{1}{\sqrt{3}}, \frac{1}{\sqrt{3}}, \frac{1}{\sqrt{3}}\right)$$

$$\eta_{2} = \frac{\beta_{2}}{|\beta_{2}|} = \left(\frac{-1}{\sqrt{2}}, 0, \frac{1}{\sqrt{2}}\right)$$

$$\eta_{3} = \frac{\beta_{3}}{|\beta_{3}|} = \left(\frac{1}{\sqrt{6}}, \frac{-2}{\sqrt{6}}, \frac{1}{\sqrt{6}}\right)$$

则 $[\eta_1,\eta_2,\eta_3]$ 就是 R^3 的一个标准正交基底.

例3 已知
$$\alpha_1 = \begin{pmatrix} 1 \\ 1 \\ 1 \end{pmatrix}$$
,求一组非零向量 α_2, α_3 ,使 $\alpha_1, \alpha_2, \alpha_3$ 两两正交.

解: α_2, α_3 应满足方程 $\alpha_1^T x = 0$,即 $x_1 + x_2 + x_3 = 0$ 它的基础解系为 $\xi_1 = (1,0,-1)^T$, $\xi_2 = (0,1,-1)^T$.

把基础解系正交化,即为所求.

$$\alpha_{2} = \xi_{1} = (1, 0, -1)^{T},$$

$$\alpha_{3} = \xi_{2} - \frac{\langle \xi_{2}, \alpha_{2} \rangle}{\langle \alpha_{2}, \alpha_{2} \rangle} \alpha_{2}$$

$$= (0, 1, -1)^{T} - \frac{1}{2} (1, 0, -1)^{T} = (-\frac{1}{2}, 1, -\frac{1}{2})^{T}.$$

定理4 设 $[\varepsilon_1, \varepsilon_2, \dots, \varepsilon_n]$ 是n维欧氏空间V的一个标准正交基底. 向量 α , β 在该基底下的坐标分别为

$$(x_1, x_2, \dots, x_n), (y_1, y_2, \dots, y_n)$$
则有 $\langle \alpha, \beta \rangle = x_1 y_1 + x_2 y_2 + \dots + x_n y_n$

$$|\alpha| = \sqrt{\langle \alpha, \alpha \rangle} = \sqrt{x_1^2 + x_2^2 + \dots + x_n^2}$$

注:定理4 给出的公式显示出在欧氏空间中引入标准正交基的优越性.任意的欧氏空间定义的任意内积,如果两个向量用同一标准正交基表示的话,这两个向量的内积等于它们的坐标构成的n维向量在Rn中的内积.

小结

- ◆内积的定义与性质(重点)
- ◆一些概念:向量的模、单位向量,向量的 夹角,正交组、标准正交组,正交基、标 准正交基(底)等
- ◆施密特正交化方法(重点)

思考题

1. 求一单位向量, 使它与

$$\alpha_1 = (1,1,-1,1), \quad \alpha_2 = (1,-1,-1,1), \quad \alpha_3 = (2,1,1,3)$$
 正交.

- 2. (习题12) 设V是n维欧氏空间, α 是V的一个固定向量, $M = \{ \beta \in V : \langle \beta, \alpha \rangle = 0 \}$,证明:
 - (1) M是 V的一个子空间.
 - (2) 当 $\alpha \neq 0$ 时,dim{M}=n-1.

思考题解答

1. 解 设所求向量为x = (a,b,c,d),则由题意可得:

$$\begin{cases} \sqrt{a^2 + b^2 + c^2 + d^2} = 1, \\ a + b - c + d = 0, \\ a - b - c + d = 0, \\ 2a + b + c + 3d = 0. \end{cases}$$

解之可得:
$$x = (-\frac{4}{\sqrt{26}}, 0, -\frac{1}{\sqrt{26}}, \frac{3}{\sqrt{26}})$$

或 $x = (\frac{4}{\sqrt{26}}, 0, \frac{1}{\sqrt{26}}, -\frac{3}{\sqrt{26}}).$

解2:设单位向量 β 与 α_1 , α_2 , α_3 都正交,以 α_1 , α_2 , α_3 为行向量的矩阵为A,则有

$$A\beta^{T}=0$$

求解方程组 $AX=0$,即
 $\begin{pmatrix} 1 & 1 & -1 & 1 \\ 1 & -1 & -1 & 1 \\ 2 & 1 & 1 & 3 \end{pmatrix} X=0$

得基础解系 $X_1 = (-\frac{4}{3}, 0, -\frac{1}{3}, 1)^T$ 单位化得 $\beta = \frac{1}{|X_1|} X_1^T = \frac{3}{\sqrt{26}} (-\frac{4}{3}, 0, -\frac{1}{3}, 1)$

$$=(\frac{4}{\sqrt{26}},0,\frac{1}{\sqrt{26}},-\frac{3}{\sqrt{26}}).$$

- 2. (习题12) 设V是n维欧氏空间, α 是V的一个固定向量, $M = \{ \beta \in V : \langle \beta, \alpha \rangle = 0 \}$,证明:
 - (1) M是V的一个子空间.
 - (2) 当 $\alpha \neq 0$ 时,dim{M}=n-1.

证明:(1)显然M非空,对于 $\forall \beta_1, \beta_2 \in M, \forall k \in R$,有

$$\langle \beta_1, \alpha \rangle = 0, \quad \langle \beta_2, \alpha \rangle = 0.$$

则 $\langle \beta_1 + \beta_2, \alpha \rangle = \langle \beta_1, \alpha \rangle + \langle \beta_2, \alpha \rangle = 0 + 0 = 0.$ $\langle k\beta_1, \alpha \rangle = \langle k\beta_1, \alpha \rangle = k\langle \beta_1, \alpha \rangle = 0.$

因此 $\beta_1 + \beta_2 \in M$, $k\beta_1 \in M$.

所以M是V的一个子空间.

(2) 由V是n维欧氏空间, $\alpha \neq 0$ 知,在V中必可找到n-1个向量 $\alpha_1, \alpha_2, ..., \alpha_{n-1}$ 使 $\alpha, \alpha_1, \alpha_2, ..., \alpha_{n-1}$ 为线性无 关向量组. 设对该向量组正交化得向量组为 $\beta = \alpha, \beta_1, \beta_2, ..., \beta_{n-1}$. 于是 $\langle \beta_i, \alpha \rangle = 0, i = 1, 2, ..., n-1,$ 则 $\beta_1, \beta_2, ..., \beta_{n-1}$ 都属于M, 且它们性无关,从而 $\dim\{M\}$ ≥n-1. 若 $\dim\{M\}=n$,则 M=V,于是 $\alpha \in M$. 而由 $\alpha\neq 0$ 知 $\langle \alpha, \alpha \rangle\neq 0$,则 $\alpha\notin M$,这与M=V矛盾. 因此只能 $\dim\{M\}=n-1$.