



北京師範大學
BEIJING NORMAL UNIVERSITY

计算语言学的数学基础

(1) 线性代数提要

王予沛

2025 年 3 月 3 日

北京师范大学数字人文系

绪论

向量和向量空间

从线性变换到矩阵

线性方程组和矩阵的关系

特征值与特征向量

小结



绪论



本课程的主要内容

麻省理工学院数学系荣休教授 Gilbert Strang¹ 所认为的线性代数
的基础内容包括：

1. 消元法求解 $Ax = b$
2. 矩阵运算、逆运算和行列式
3. 向量空间和子空间
4. 无关性、维数和矩阵的秩
5. 特征值和特征向量

本课程中，我们将覆盖上述内容，但并不会按照这个顺序讲授。
我们将首先复习高中接触过的向量及其运算，然后从直观的线性
变换开始，逐步进入矩阵的世界。

¹<https://math.mit.edu/~gs/>

什么是线性代数？

代数：用字母代替数。

研究算数的时候发现的一些和具体的数无关的性质，例如：

- 加法交换律： $a + b = b + a$
- 加法结合律： $(a + b) + c = a + (b + c)$
- 乘法交换律： $ab = ba$
- 乘法结合律： $(ab)c = a(bc)$

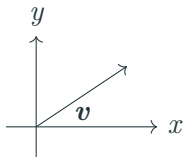


向量和向量空间



向量

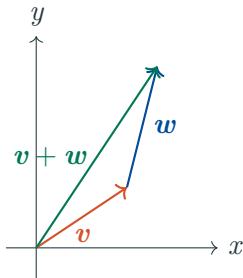
- 向量²是具有大小和方向的量。
- 向量可以表示为有序的数构成的元组，例如 $v = (3, 2)$



²向量可以表示为字母在字母上方加箭头，例如 \vec{v} ，也可以用黑体表示，例如 \mathbf{v} ，本课程中我们会同时使用这两种表示方法，但更多使用后者。

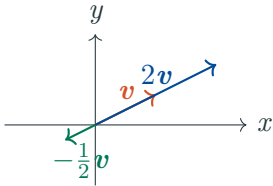
向量加法

- 向量加法可以理解为“位移的叠加”
- 例如：从家到学校的路径 $v = (3, 2)$ ，从学校到图书馆的路径 $w = (1, 4)$
- 那么从家到图书馆的直接路径就是：
 $v + w = (3 + 1, 2 + 4) = (4, 6)$



数量乘法（标量乘法）

- 向量的数量乘法表示向量在同一直线上的“伸缩变换”
- 正数：保持方向，改变大小
- 负数：改变方向，改变大小
- 例如：速度向量 $v = (2, 1)$
 - $2v = (4, 2)$ 表示“速度加倍”
 - $-\frac{1}{2}v = (-1, -0.5)$ 表示“速度减半且方向相反”



向量的线性组合

向量加法和数量乘法是线性代数的两种核心操作。我们将两向量相加得到 $v + w$ ，将向量与标量相乘得到 cv 和 dw 。结合两种操作，我们得到向量的**线性组合**： $cv + dw$ 。

$$cv + dw = c \begin{pmatrix} 1 \\ 1 \end{pmatrix} + d \begin{pmatrix} 2 \\ 3 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} c + 2d \\ c + 3d \end{pmatrix}$$

其中， c 和 d 是标量，称为线性组合的**组合系数**。

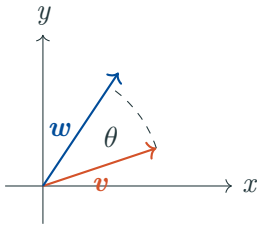
当 c 取不同的值， cv 均在一条直线上，当 w 不在这条直线上时，**线性组合 $cv + dw$ 填满了整个二维平面**。

向量内积（点乘）

- 两个向量 v 和 w 的**内积**³定义为：

$$v \cdot w = a_1 b_1 + a_2 b_2$$

- 几何意义： $v \cdot w = |v||w| \cos \theta$
- 其中 θ 是两个向量之间的夹角
- 重要性质：
 - 内积为零 \Leftrightarrow 两向量垂直
 - $v \cdot v = |v|^2$



³向量的内积也称**数量积**、**点积**、**点乘**；相对地，还存在一种称为外积，也称向量积、叉积、叉乘的运算，这里不展开。

- 向量的长度⁴通过内积定义⁵:

$$\|v\| = \sqrt{v \cdot v}$$

- 两点间的距离⁶自然也可以用内积定义:

$$d(v, w) = \|v - w\| = \sqrt{(v - w) \cdot (v - w)}$$

- 内积的重要性:
 - 定义了空间中的度量（距离）
 - 使我们能够谈论长度、距离，进而可以讨论角度

⁴向量的长度也称为**向量的模**。

⁵中学时，我们用单竖线 $|$ 表示向量的长度，现在起我们用双竖线 $\|$ 表示向量的长度。这是为了与绝对值区分。

⁶两点间的距离即两个向量终点间的距离。

向量组及向量间的线性相关性

向量组是向量构成的集合。

考虑向量 $v = (1, 2)$ 和 $w = (2, 4)$ 。它们构成的集合 $\{v, w\}$ 是一个向量组。同时，我们观察到 $w = 2v$ ，即两个向量的终点在一条直线上。此时，我们称向量 v 和 w **线性相关**，向量 w 可以由 v **线性表出**，反过来， v 也可以由 w 线性表出。

考虑向量 $i = (1, 0)$ 和 $j = (0, 1)$ 。它们构成的集合 $\{i, j\}$ 也是一个向量组，但这两个向量并不平行，即 i 和 j 不能相互线性表示。此时，我们称向量 i, j **线性无关**。

向量组及向量间的线性相关性

线性相关

向量组 $\{v_1, v_2, \dots, v_s\}$, ($s \geq 1$) 是**线性相关**的, 如果存在一组不全为零的实数⁷ k_1, k_2, \dots, k_s , 使得

$$k_1 v_1 + k_2 v_2 + \dots + k_s v_s = \mathbf{0} \quad (1)$$

线性无关

向量组 $\{v_1, v_2, \dots, v_s\}$, ($s \geq 1$) 是**线性无关**的, 如果式 (1) 只有零解 $k_1 = k_2 = \dots = k_s = 0$ 。

⁷事实上, 这里并不一定是实数, 只需要是某一个数域 \mathcal{F} 中的数即可。由于数域需要额外进行定义, 这里不展开。在计算语言学中, 我们通常也只需考虑实数域。

向量组的最大线性无关组

一个向量组的一个部分向量组称为一个**最大线性无关组**，如果这个部分组本身是线性无关的，并且从这向量组中任意添一个向量（如果还有的话），所得的部分向量组都线性相关。

例 1：向量 $v_1 = (1, 1)$, $v_2 = (2, 2)$ 构成的向量组 $\{v_1, v_2\}$ 的最大线性无关组为 $\{v_1\}$ 或 $\{v_2\}$ 。

例 2：向量 $v_1 = (1, 1)$, $v_2 = (1, 2)$, $v_3 = (2, 2)$ 构成的向量组 $\{v_1, v_2, v_3\}$ 的最大线性无关组为 $\{v_1, v_2\}$ 或 $\{v_2, v_3\}$ 。

例 3：向量 $v_1 = (1, 0)$, $v_2 = (0, 1)$ 构成的向量组 $\{v_1, v_2\}$ 的最大线性无关组为 $\{v_1, v_2\}$ 。

例 4：向量 $v_1 = (1, 0)$, $v_2 = (0, 1)$, $v_3 = (2, 3)$ 构成的向量组 $\{v_1, v_2, v_3\}$ 的最大线性无关组为 $\{v_1, v_2\}$ 或 $\{v_2, v_3\}$ 或 $\{v_1, v_3\}$ 。

一个向量组的最大线性无关组不唯一，但所有最大线性无关组所含向量的个数相同。

向量空间 \mathbb{R}^n 是所有包含 n 个实数分量 (components) 的向量构成的向量组。向量空间简称**空间 (space)**。

例如, \mathbb{R}^2 表示常见的 xy 平面, 其中每一个向量有两个分量。“空间”这个词旨在强调所有这样的向量构成的集合, 即整个平面。每一个向量给出横坐标 x 和纵坐标 y , 表示在平面中的一个点 $\boldsymbol{v} = (x, y)$ 。

类似地, \mathbb{R}^3 中的向量表示三维空间中的点 (x, y, z) 。一维空间则是一条直线 (比如 x 轴), 表示为 \mathbb{R}^1 。

向量空间的核心要求

在向量空间中，向量的两种核心操作（加法和数量乘法）的结果仍然在这个向量空间中。这叫做对加法和数量乘法的**封闭性**。

严格来说，向量空间是一个满足 8 条性质且对加法和数量乘法封闭的向量组。

向量空间的定义

我们称向量组 V 是定义在一个域 \mathcal{F} 上的向量空间，当且仅当 V 需要满足以下八条性质⁸：

- 向量加法的交换律： $\forall x, y \in V, \quad x + y = y + x$
- 向量加法的结合律： $\forall x, y, w \in V, \quad (x + y) + z = x + (y + z)$
- 向量加法的单位元 0 存在且唯一：

$$\exists 0 \in V, \quad \forall y \in V, \quad y + 0 = y$$

- 向量加法的逆元素存在且唯一：

$$\forall y \in V, \quad \exists -y \in V \text{ 使得 } y + (-y) = 0$$

⁸建议将这 8 条性质作为向量计算的参考，因为在计算语言学研究中我们只需要实数域上的实向量空间 \mathbb{R}^n 。对八条性质是否必要的讨论有很多，参见：<https://math.stackexchange.com/q/1412899>

向量空间的定义

- 数乘（标量乘法）对于向量加法分配律：

$$\forall c \in \mathcal{F}, \forall \mathbf{x}, \mathbf{y} \in V, \quad c(\mathbf{x} + \mathbf{y}) = c\mathbf{x} + c\mathbf{y}$$

- 数乘对于域 \mathcal{F} 上标量加法的分配律：

$$\forall c_1, c_2 \in \mathcal{F}, \forall \mathbf{y} \in V, \quad (c_1 + c_2)\mathbf{y} = c_1\mathbf{y} + c_2\mathbf{y}$$

- 数乘对于域 \mathcal{F} 上标量乘法的结合律：

$$\forall c_1, c_2 \in \mathcal{F}, \forall \mathbf{y} \in V, \quad (c_1 c_2)\mathbf{y} = c_1(c_2\mathbf{y})$$

- 数域 \mathcal{F} 中存在单位元 1，使得：

$$\exists 1 \in \mathcal{F}, \quad \forall \mathbf{y} \in V, \quad 1\mathbf{y} = \mathbf{y}$$

向量空间的子空间

设 V 是向量空间， W 是 V 的子集。如果 W 对向量加法和数量乘法封闭，则称 W 是 V 的**子空间**。这时候，8 条性质将自动满足。请回答：

- 为什么向量加法的逆元素一定在子空间中？
- 为什么向量加法的单位元（零向量 $\mathbf{0}$ ）一定在子空间中？

例子：

- \mathbb{R}^3 : 整个三维空间
- \mathbb{L} : 所有穿过原点的直线
- \mathbb{P} : 所有穿过原点的平面
- $\{\mathbf{0}\}$: 零向量

思考：向量 (x, y) 在 $x, y \geq 0$ 时是否构成 \mathbb{R}^2 的子空间？如果加上 $x, y \leq 0$ 呢？

“张成”子空间的向量组

如果一向量组的所有线性组合填满了 (fill) 整个空间，则称该向量组张成 (span) 该空间。

例 1: $v_1 = (1, 0)$ 和 $v_2 = (0, 1)$ 张成整个二维空间 \mathbb{R}^2 。

例 2: $v_1 = (1, 0)$, $v_2 = (0, 1)$, $v_3 = (4, 7)$ 同样张成整个 \mathbb{R}^2 。

例 3: $w_1 = (1, 1)$, $w_2 = (-1, -1)$ 仅张成 \mathbb{R}^2 中的一条直线。
 $w_1 = (1, 1)$ 自己也是如此。

向量空间的基底和维数

如果一向量组张成一个向量空间，并且这个向量组中所有的向量都是线性无关的，则称该向量组为该向量空间的一个**基底**。基底也简称**基**。基底中的向量称为**基向量**。

例： $v_1 = (1, 0)$ 和 $v_2 = (0, 1)$ 是 \mathbb{R}^2 的“标准基”。

在给定基底的情况下，向量空间中的任意一个向量都可以**唯一地**表示为基底的线性组合。

思考：为什么这样的线性组合是唯一的？（反证法）

一个向量空间可以有无穷多个不同的基底，但**不同基底中基向量的个数相同**（请尝试用反证法说明这一点）。

向量空间的各基底中所含基向量的个数称为该向量空间的**维数**。
例如， \mathbb{R}^2 的维数为 2。

向量空间的一般性

向量空间是线性代数的核心概念，它不仅适用于几何向量，还可以推广到更一般的对象。下面列举一些常见的非几何向量空间。

- 所有实系数多项式构成的集合 $\mathbb{R}[x]$ 。
- 所有次数小于等于 n 的实系数多项式的集合 $\mathbb{R}[x]_{\leq n}$ 。
- 所有实函数 $f: \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ 构成的集合 $\mathbb{F}(\mathbb{R})$ 。



从线性变换到矩阵



向量的几何变换

本节讨论向量在空间中的几何变换，比如：

- 旋转：绕定点（通常是原点）转动
- （镜像）反射：按横/纵坐标轴翻转

注意到，**向量仅有方向和长度属性，没有位置信息**。数学上，平移向量没有意义，因为改变向量的起点不会改变其本质。因此向量没有平移变换。

恒等变换

什么是恒等变换？

恒等变换是最基本的几何变换，它将每个点都映射到自身，因此在坐标系中，点的坐标保持不变，向量的终点也保持不变，故任何向量在恒等变换后都保持不变。

恒等变换的数学表示

设点 $P(x, y)$ 经过恒等变换后变为 $P'(x', y')$ ：

$$\begin{cases} x' = x, \\ y' = y. \end{cases} \quad (2)$$

式 (2) 可改写为：

$$\begin{cases} x' = 1 \cdot x + 0 \cdot y, \\ y' = 0 \cdot x + 1 \cdot y. \end{cases} \quad (3)$$

恒等变换的矩阵表示

我们可以将式 (3) 的系数取出来写成下面的“数表”:

$$\begin{pmatrix} 1 & 0 \\ 0 & 1 \end{pmatrix}$$

这是一个由数字构成的矩形表格，称为**矩阵**。一般使用大写字母表示矩阵，例如我们可以把上面的矩阵记为 A 。矩阵 A 有 2 行 2 列，这时我们称 A 是一个 2×2 的矩阵。用于表示变换的矩阵就称为**变换矩阵**。特别地，恒等变换的变换矩阵称为**单位矩阵**（一般记为 I ），它唯一确定了恒等变换。

可以看出，变换可以写成变换矩阵以某种方式 $\boxed{?}$ 作用在向量上：

$$\begin{pmatrix} 1 & 0 \\ 0 & 1 \end{pmatrix} \boxed{?} \begin{pmatrix} x \\ y \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} x \\ y \end{pmatrix}$$

旋转变换

什么是旋转变换？

旋转变换是将平面内每个点绕原点旋转固定角度的几何变换，对向量而言，就是将向量的终点绕原点旋转相应角度，保持向量的长度不变但改变其方向。

旋转变换的数学表示

如图1所示，在直角坐标系 Oxy 中，点 $P(x, y)$ 绕原点 O 逆时针旋转 180° 后变为点 $P'(x', y')$ ：

$$\begin{cases} x' = -x, \\ y' = -y. \end{cases} \quad (4)$$

式 (4) 可改写为：

$$\begin{cases} x' = -1 \cdot x + 0 \cdot y, \\ y' = 0 \cdot x + -1 \cdot y. \end{cases} \quad (5)$$

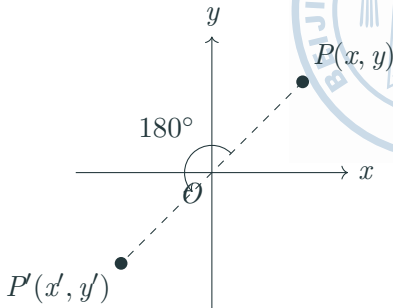


图 1: 旋转变换示意图

旋转变换的矩阵表示

我们可以将式 (5) 的系数取出来写成矩阵：

$$\begin{pmatrix} -1 & 0 \\ 0 & -1 \end{pmatrix}$$

这个**旋转矩阵**唯一确定了旋转 180° 这个变换。实际上，对于任意角度 θ 的旋转，都存在唯一的旋转矩阵与之对应。同样地，我们可以将旋转变换写成其变换矩阵以某种方式 $\boxed{?}$ 作用在向量上：

$$\begin{pmatrix} -1 & 0 \\ 0 & -1 \end{pmatrix} \boxed{?} \begin{pmatrix} x \\ y \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} -x \\ -y \end{pmatrix}$$

补充：在直角坐标系 Oxy 内，将任意一点 $P(x, y)$ 绕原点 O 按逆时针方向旋转 θ 角得到点 $P'(x', y')$ 的旋转变换矩阵是

$$\begin{pmatrix} \cos \theta & -\sin \theta \\ \sin \theta & \cos \theta \end{pmatrix}$$

伸缩变换

伸缩变换 (stretching) 是将直角坐标系内每个点的横坐标变为原来的 k_1 倍, 纵坐标变为原来的 k_2 倍的几何变换, 其中 k_1, k_2 均为非零常数。对向量而言, 就是将向量的各个分量分别伸缩相应倍数。

如图2所示, 在直角坐标系 Oxy 中, 将点 $P(x, y)$ 的纵坐标变为原来的两倍, 横坐标不变, 得到点 $P'(x', y')$:

$$\begin{cases} x' = x, \\ y' = 2y. \end{cases} \quad (6)$$

式 (6) 可以改写为:

$$\begin{cases} x' = 1 \cdot x + 0 \cdot y, \\ y' = 0 \cdot x + 2 \cdot y. \end{cases} \quad (7)$$

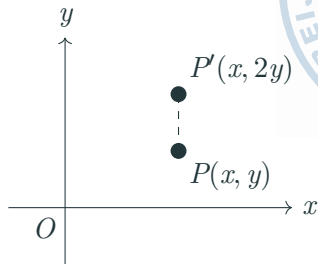


图 2: 伸缩变换示意图

伸缩变换的矩阵表示

我们可以将式 (7) 的系数取出来写成矩阵：

$$\begin{pmatrix} 1 & 0 \\ 0 & 2 \end{pmatrix}$$

这个**伸缩矩阵**唯一确定了纵坐标放大 2 倍这个变换。同样地，我们可以将伸缩变换写成其变换矩阵以某种方式 $\boxed{?}$ 作用在向量上：

$$\begin{pmatrix} 1 & 0 \\ 0 & 2 \end{pmatrix} \boxed{?} \begin{pmatrix} x \\ y \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} x \\ 2y \end{pmatrix}$$

思考：将直角坐标系 Oxy 内每个点的横坐标变为原来的 k_1 倍，纵坐标变为原来的 k_2 倍（ k_1, k_2 均为非零常数）的伸缩变换的变换矩阵是什么？

切变变换的概念

切变变换 (shearing) 是一种保持某一坐标轴方向不变，而其他位置的平移量与到该轴的垂直距离成正比的线性变换。

在二维平面上，切变变换主要有两种：

- **水平切变**：保持 x 轴方向不变，点的水平平移量与其 y 坐标成正比；
- **垂直切变**：保持 y 轴方向不变，点的垂直平移量与其 x 坐标成正比。

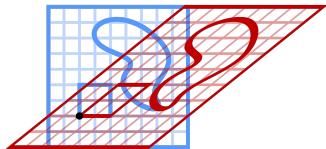


图 3: 平面的水平剪切，将蓝色转变为红色，黑点为原点

水平切变变换

水平切变变换的数学表示

如图4所示, 在直角坐标系 Oxy 内, 水平切变将每一点 $P(x, y)$ 沿着与 x 轴平行的方向平移 ky 个单位变成点 $P'(x', y')$, 其中 k 是非零常数:

$$\begin{cases} x' = x + ky, \\ y' = y. \end{cases} \quad (8)$$

式 (8) 可以改写为:

$$\begin{cases} x' = 1 \cdot x + k \cdot y, \\ y' = 0 \cdot x + 1 \cdot y. \end{cases} \quad (9)$$

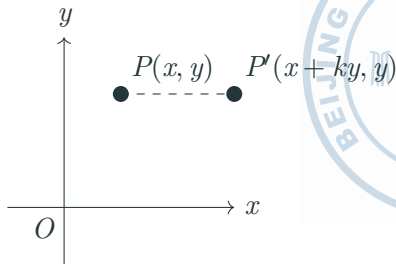


图 4: 水平切变变换示意图

切变变换的矩阵表示

我们可以将式 (9) 的系数取出来写成矩阵：

$$\begin{pmatrix} 1 & k \\ 0 & 1 \end{pmatrix}$$

这个**切变矩阵**唯一确定了水平切变这个变换，其中 k 表示切变的程度。同样地，我们可以将切变变换写成其变换矩阵以某种方式 $\boxed{?}$ 作用在向量上：

$$\begin{pmatrix} 1 & k \\ 0 & 1 \end{pmatrix} \boxed{?} \begin{pmatrix} x \\ y \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} x + ky \\ y \end{pmatrix}$$

思考：

- 垂直切变变换的矩阵形式是什么？
- 为什么切变变换的矩阵主对角线上的元素都是 1？

线性变换

线性变换是从一个向量空间到另一个向量空间的映射

$\mathcal{T}: V \rightarrow W$, 对于所有的 $v, w \in V$ 和任意标量 k_1, k_2 , 满足以下两个条件:

1. 加法保持性: $\mathcal{T}(v + w) = \mathcal{T}(v) + \mathcal{T}(w)$
2. 数量乘法保持性: $\mathcal{T}(kv) = k\mathcal{T}(v)$

线性变换也称为**线性映射**。

满足上述条件的映射**不会改变直线的形状、平行性、与其他直线的交叉点的位置以及直线上点的相对距离**。这就是“线性”这一定语的来源。可以看出, 之前介绍的旋转、伸缩、切变都是线性变换。

不满足上述条件的映射称为**非线性变换**。例子有很多, 如 $f(x) = x^2$, 它将直线映射为抛物线。

矩阵与向量的乘法

从前面的例子可见，几种几何变换可以通过矩阵以某种方式作用在向量上来实现。这种作用 [?] 实际上就是**矩阵与向量的乘法**。具体来说，矩阵 A （从左边）乘以向量 x 的结果是一个向量，这个向量的第 i 个分量等于 A 的第 i 行**行向量**与**列向量** x 的内积。

以水平切变为例，矩阵 A 乘以向量 x 的结果是：

$$Ax = \begin{pmatrix} 1 & k \\ 0 & 1 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} x \\ y \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} (1, k) \cdot (x, y) \\ (0, 1) \cdot (x, y) \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} x + ky \\ y \end{pmatrix}$$

可以看到，结果向量的第一个分量是矩阵 A 的第一行行向量与 x 的内积，第二个分量是矩阵 A 的第二行行向量与 x 的内积。

注意到，如果矩阵 A 的列数与向量 x 无法做内积，则矩阵与向量的乘法无法进行。因此，**矩阵与向量的乘法要求矩阵的列数（即行向量的分量数）与向量的行数（即列向量的分量数）相等。**

线性变换的复合

我们可以先后在一个向量上施加多个线性变换，得到一个复合变换。取水平剪切矩阵 A 和垂直剪切矩阵 B ：

$$A = \begin{pmatrix} 1 & 1 \\ 0 & 1 \end{pmatrix}, \quad B = \begin{pmatrix} 1 & 0 \\ 1 & 1 \end{pmatrix}$$

考虑一个向量 $x = \begin{pmatrix} 1 \\ 1 \end{pmatrix}$ ，比较两种不同的变换顺序：

- 先施加 B ，再施加 A ：

$$A(Bx) = A \left(\begin{pmatrix} 1 & 0 \\ 1 & 1 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} 1 \\ 1 \end{pmatrix} \right) = A \begin{pmatrix} 1 \\ 2 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 3 \\ 2 \end{pmatrix}$$

- 先施加 A ，再施加 B ：

$$B(Ax) = B \left(\begin{pmatrix} 1 & 1 \\ 0 & 1 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} 1 \\ 1 \end{pmatrix} \right) = B \begin{pmatrix} 2 \\ 1 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 2 \\ 3 \end{pmatrix}$$

显然， $A(Bx) \neq B(Ax)$ 。线性变换的顺序不同，结果也不同。

矩阵与矩阵的乘法

线性变换的复合可以表示为矩阵与矩阵的乘法：

$$A(Bx) = (AB)x, \quad B(Ax) = (BA)x$$

这种乘法和向量乘法满足结合律，且可以看作多次矩阵与向量的乘法 $AB = [Ab_1 \cdots Ab_n]$ ，其中 b_i 是 B 的列向量：

$$AB = \begin{pmatrix} 1 & 1 \\ 0 & 1 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} 1 & 0 \\ 1 & 1 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 2 & 1 \\ 1 & 1 \end{pmatrix}$$

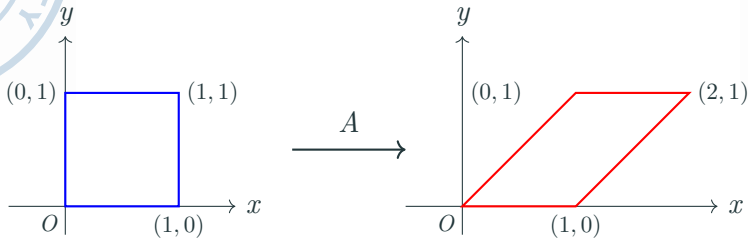
$$BA = \begin{pmatrix} 1 & 0 \\ 1 & 1 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} 1 & 1 \\ 0 & 1 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 1 & 1 \\ 1 & 2 \end{pmatrix}$$

显然， $AB \neq BA$ 。

矩阵的行列式

方形矩阵的**行列式** (determinant) 表示改矩阵对应的线性变换将单位 (超) 立方体变换后得到的新 (超) 立方体的**有向体积**, 其绝对值是**体积比率** (volume distortion), 符号表示**定向**⁹是否翻转。
矩阵 A 的行列式记作 $\det(A)$ 。

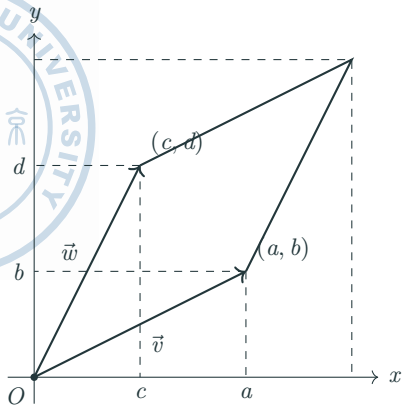
以水平切变为例, 考虑变换矩阵 $A = \begin{pmatrix} 1 & 1 \\ 0 & 1 \end{pmatrix}$, 它将单位正方形变换为平行四边形。



⁹定向是坐标轴之间的相对位置, 也即**手性**(chirality)。

矩阵的行列式

考虑一般的 2×2 矩阵 $A = \begin{pmatrix} a & c \\ b & d \end{pmatrix}$ ，它将单位正方形变换为如下的平行四边形：



- 外框大矩形面积: $(a + c) \times (b + d)$

- 需减去的区域：

$$2 \times \frac{1}{2} ab = ab \quad (\text{上下两个三角形})$$

$$2 \times \frac{1}{2} cd = cd \quad (\text{左右两个三角形})$$

$$2 \times ac \quad (\text{左上和右下两个矩形})$$

- 平行四边形面积：

$$\begin{aligned} & (a + c)(b + d) - (ab + cd + ac + bd) \\ &= \cancel{ab} + ad + bc + \cancel{cd} - \cancel{ab} - \cancel{cd} - ac - bd \\ &= ad - bc \end{aligned}$$

- 最终结果: $\det(A) = \begin{vmatrix} a & c \\ b & d \end{vmatrix} = ad - bc$

特别地，当 $\det(A) = 0$ 时，矩阵 A 对应的线性变换将单位（超）立方体压缩为零体积的低维几何体（点或线），这时我们称矩阵 A 是**奇异矩阵**。

反之，如果 $\det(A) \neq 0$ ，我们称矩阵 A 是**非奇异矩阵**。

奇异矩阵意味着线性变换过程中发生了某种信息损失。



线性方程组和矩阵的关系



线性变换的逆问题

之前，我们通过大量的例子，将对向量的线性变换抽象为了矩阵与向量的乘法，记作 $Ax = b$ ，其中 A, x 已知， b 作为待求的变换后的结果，是未知的。

现在，我们考虑一个逆问题：已知 A 和 b ，求 x 。具体地，

$$Ax = b \Leftrightarrow \begin{pmatrix} a_{11} & a_{12} \\ a_{21} & a_{22} \end{pmatrix} \begin{pmatrix} x_1 \\ x_2 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} b_1 \\ b_2 \end{pmatrix} \quad (10)$$

利用矩阵乘法，我们可以将上式写为：

$$\begin{cases} a_{11}x_1 + a_{12}x_2 = b_1 \\ a_{21}x_1 + a_{22}x_2 = b_2 \end{cases} \quad (11)$$

由于其中 $a_{11}, a_{12}, a_{21}, a_{22}, b_1, b_2$ 是已知的， x_1, x_2 是未知的，所以式 (11) 是一个线性方程组， A 称为方程组的系数矩阵，式 (10) 则称为线性方程组的矩阵形式，也可简称为线性方程组。

鸡兔同笼

有若干只鸡兔同在一个笼子里，从上面数，有 10 个头；从下面数，有 28 只脚。求笼中各有几只鸡和兔？

设笼中鸡有 x 只，兔有 y 只，则该问题对应的线性方程组为：

$$\begin{cases} x + y = 10 \\ 2x + 4y = 28 \end{cases} \quad (12)$$

将该方程组写成矩阵形式：

$$A\mathbf{x} = \mathbf{b} \Leftrightarrow \begin{pmatrix} 1 & 1 \\ 2 & 4 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} x \\ y \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 10 \\ 28 \end{pmatrix} \Leftrightarrow \begin{pmatrix} 1 \cdot x + 1 \cdot y \\ 2 \cdot x + 4 \cdot y \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 10 \\ 28 \end{pmatrix} \quad (13)$$

式 (13) 可解读为将矩阵 A 作用于向量 \mathbf{x} ，得到向量 \mathbf{b} 。矩阵 A 表示一个线性映射，含义是“数头数脚”。

鸡兔同笼

注意到，矩阵 A 的列向量分别为 $\begin{pmatrix} 1 \\ 2 \end{pmatrix}$ 和 $\begin{pmatrix} 1 \\ 4 \end{pmatrix}$ ，它们分别表示

鸡和兔 $\begin{pmatrix} \text{头} \\ \text{脚} \end{pmatrix}$ 的数量，可分别称“鸡向量”和“兔向量”。

在我们中学的认识中，线性方程组中的不同方程间是孤立的，不同方程之间 x 的系数是孤立的， y 的系数和等式右边的常数项也是如此。这种认识方程的方式是一行一行地看的，不同方程表示不同的约束条件，最后再把约束条件联立起来。

观察式 (13)，我们发现，鸡 x 和兔 y 对于结果 b 的贡献是独立的。这种独立体现在鸡向量和兔向量可以通过线性组合得到结果向量 b ：

$$x \begin{pmatrix} 1 \\ 2 \end{pmatrix} + y \begin{pmatrix} 1 \\ 4 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 10 \\ 28 \end{pmatrix} \quad (14)$$

矩阵的列空间和方程组的解

式 (14) 表明，矩阵 A 左乘向量 x 可以看作将向量 x 的各个分量作为组合系数将矩阵 A 的各个对应列向量进行线性组合，组合的结果向量便是 b 。

这意味着，如果 b 存在于矩阵 A 的列向量所张成的空间中，则方程组一定有解；反之，如果 b 不在矩阵 A 的列向量所张成的空间中，则方程组无解。

我们将矩阵 A 的列向量所张成的空间，称为矩阵 A 的**列空间**。

因此，**方程组有解的充要条件是 b 在矩阵 A 的列空间中。**

矩阵的列秩和增广矩阵

矩阵 A 的列向量组的最大线性无关组的向量个数称为矩阵 A 的列秩。我们将矩阵 A 和向量 b 并在一起，称为方程组 $Ax = b$ 的增广矩阵，记作 $[A|b]$ 。此时，方程组有解的充要条件是增广矩阵的 $[A|b]$ 列秩等于矩阵 A 的列秩。（为什么？）

矩阵 A 的列秩表示未知数向量 x 可以自由取值的分量个数，也就是方程组 $Ax = b$ 独立参数的个数。

矩阵的秩

对照列空间的概念，我们将矩阵 A 的行向量所张成的空间，称为矩阵 A 的**行空间**。

在方程组 (11) 中，每个方程实际上都给出了一个线性约束，要求未知向量 x 与对应的行向量的内积必须等于特定值。因此，方程组的解就是同时满足所有这些行向量给出的线性约束的 x 。

如果某个方程（即某个行向量）可以由其他方程（行向量）线性组合得到，那么这个方程实际上是**冗余的**，因为它提供的约束已经被其他方程隐含了。

矩阵 A 的行向量组的最大线性无关组的向量个数称为矩阵 A 的**行秩**，它恰好等于方程组中实际起作用的独立约束的数量。

由于线性方程组中独立约束的数量一定等于独立参数的数量¹⁰，故**矩阵的行秩和列秩相等**，合称矩阵的**秩**，记作 $\text{rank}(A)$ 。

¹⁰这只是一种理解，证明较为复杂。

线性方程组解的存在性和结构

对于齐次线性方程组 $Ax = 0$ (其中 A 为 $m \times n$ 矩阵, x 为 n 维列向量, 0 为 m 维零向量) 分以下两种情况:

- 如果 $\text{rank}(A) = n$, 则方程组有唯一解, 即 $x = 0$;
- 如果 $\text{rank}(A) < n$, 则方程组有无穷多解。

对于非齐次线性方程组 $Ax = b$ (其中 $b \neq 0$) 分以下三种情况:

- 如果 $\text{rank}(A) = \text{rank}([A|b]) = n$, 则方程组有唯一解;
- 如果 $\text{rank}(A) = \text{rank}([A|b]) < n$, 则方程组有无穷多解;
- 如果 $\text{rank}(A) < \text{rank}([A|b])$, 则方程组无解。

特别地, 非齐次线性方程组 $Ax = b$ (其中 $b \neq 0$) 的通解可以表示为齐次线性方程组 $Ax = 0$ 的通解加上一个特解。(为什么?)

矩阵的逆与方程组求解

当确定方程组 $Ax = b$ 有唯一解时，我们希望找到它的解 x 。

回忆一元一次方程 $ax = b$ ，其中 a 和 b 已知， x 未知，且 $a \neq 0$ ，它的解为 $x = \frac{b}{a}$ 。这时我们想，如果矩阵也有除法就好了。

换个写法， $x = \frac{b}{a} = a^{-1}b$ ，这时候我们不把 $\frac{\bullet}{a} = a^{-1} \cdot$ 看成除法，而是视为 $a \cdot$ 的逆运算。

那么，对于矩阵 A 表示的线性变换，是否存在对应的逆变换 B ，使得 $B \cdot A = I$ 呢？如果存在，我们称 A 是**可逆矩阵**，并称 B 为 A 的**逆矩阵**，记作 A^{-1} 。

矩阵的逆与方程组求解

考虑矩阵 A 的可逆性实际上是考虑矩阵 A 对应的线性变换的可逆性。我们之前按照特征值 $\det(A)$ 是否为零讨论了线性变换中的信息损失，据此也可以对矩阵的可逆性做下面的分类讨论¹¹：

- 若矩阵 A 对应的线性变换可逆，则变换过程不应该存在信息损失，因此 A 的行列式 $\det(A) \neq 0$ 。
- 若矩阵 A 对应的线性变换存在信息损失，则变换过程存在信息损失，因此 A 的行列式 $\det(A) = 0$ 。

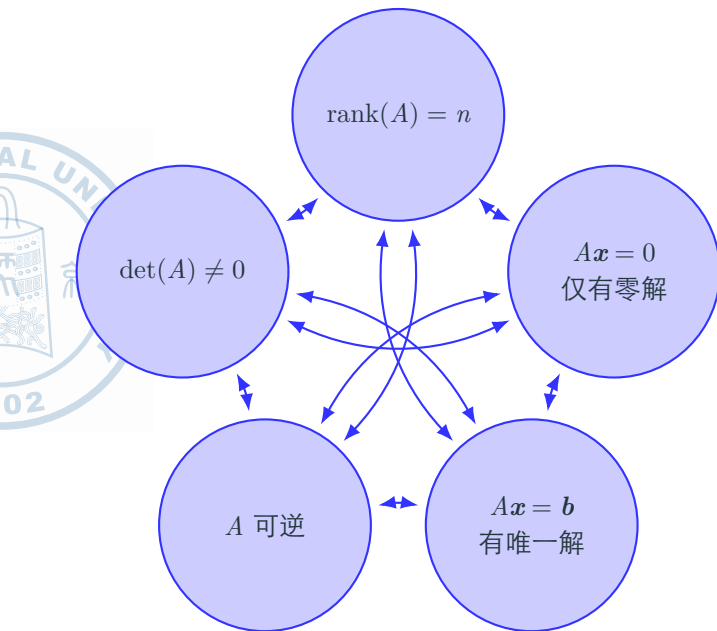
因此，矩阵 A 可逆的充要条件是 $\det(A) \neq 0$ 。

进一步地，我们可以建立矩阵的可逆性和方程组解的存在性之间的联系：

- 若矩阵 A 可逆，则方程组 $Ax = b$ 有唯一解 $x = A^{-1}b$ 。
- 若矩阵 A 不可逆，则方程组 $Ax = b$ 无解或有无穷多解。

¹¹这只是一种理解方法，证明较为复杂。

重要结论回顾





特征值与特征向量



变换中的不变量

考虑线性变换 $A = \begin{pmatrix} 2 & 1 \\ 0 & 3 \end{pmatrix}$ ，它改变了二维平面中大多数向量的方向，但将向量 $\begin{pmatrix} 1 \\ 1 \end{pmatrix}$ 变换为 $\begin{pmatrix} 3 \\ 3 \end{pmatrix}$ ；将向量 $\begin{pmatrix} 1 \\ 0 \end{pmatrix}$ 变换为 $\begin{pmatrix} 2 \\ 0 \end{pmatrix}$ 。

事实上，在许多线性变换中，存在一些特殊的向量，它们在变换后只改变了长度，而方向保持不变。我们将这些在变换后方向不变的向量称为**特征向量**(eigenvector)，变换后它们的长度相比原向量长度的倍数称为**特征值**(eigenvalue)。设特征向量为 \boldsymbol{x} ，特征值为 λ ，则满足 $A\boldsymbol{x} = \lambda\boldsymbol{x}$ 。

如果 $A\boldsymbol{x} = \lambda\boldsymbol{x}$ 成立，则：

- $A^2\boldsymbol{x} = \lambda^2\boldsymbol{x} \implies A^n\boldsymbol{x} = \lambda^n\boldsymbol{x}$
- $A^{-1}\boldsymbol{x} = \lambda^{-1}\boldsymbol{x}$
- $(A + cI)\boldsymbol{x} = (\lambda + c)\boldsymbol{x}$

特征值求解与特征多项式

$$A\mathbf{x} = \lambda\mathbf{x} \Leftrightarrow (A - \lambda I)\mathbf{x} = \mathbf{0} \quad (15)$$

这是一个齐次线性方程组，称为**特征方程**，为了得到非零的特征向量¹²，需要 $\det(A - \lambda I) = 0$ 。

以 2 阶矩阵为例，设 $A = \begin{pmatrix} a & b \\ c & d \end{pmatrix}$ ，则

$$\begin{aligned} \det(A - \lambda I) &= \det \begin{pmatrix} a - \lambda & b \\ c & d - \lambda \end{pmatrix} \\ &= (a - \lambda)(d - \lambda) - bc \\ &= \lambda^2 - (a + d)\lambda + (ad - bc) \end{aligned} \quad (16)$$

式 (16) 称为 A 的**特征多项式**(characteristic polynomial)，其根即为 A 的特征值。

¹²零向量的方向是任意的，作为特征向量没有意义。

求解特征向量示例

设矩阵 $A = \begin{pmatrix} 2 & 1 \\ 0 & 3 \end{pmatrix}$ ，下面求解其特征值和特征向量。

1. 求特征方程 $\det(A - \lambda I) = 0$:

$$(2 - \lambda)(3 - \lambda) = 0 \Rightarrow \lambda = 2, 3$$

2. 对 $\lambda = 2$:

- 解 $(A - 2I)v = 0$: $\begin{pmatrix} 0 & 1 \\ 0 & 1 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} x \\ y \end{pmatrix} = 0$
- 方程组 $y = 0$ ，得特征向量 $v_1 = k \begin{pmatrix} 1 \\ 0 \end{pmatrix}$, $k \neq 0$

3. 对 $\lambda = 3$:

- 解 $(A - 3I)v = 0$: $\begin{pmatrix} -1 & 1 \\ 0 & 0 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} x \\ y \end{pmatrix} = 0$
- 方程 $-x + y = 0$ ，得特征向量 $v_2 = k \begin{pmatrix} 1 \\ 1 \end{pmatrix}$, $k \neq 0$

结论：示例中的 $\begin{pmatrix} 1 \\ 0 \end{pmatrix}$ 和 $\begin{pmatrix} 1 \\ 1 \end{pmatrix}$ 分别为对应 $\lambda = 2$ 和 $\lambda = 3$ 的特征向量。注意特征向量不唯一，成比例的向量都是特征向量，可以差常数倍。

特征向量是特定变换下最“自然”的基

如果我们不知道矩阵 A 的具体形式，只知道其对特征向量（即特征值），我们是否可以知道任何一个其他点，如 $(2, 1)$ ，经由 A 变换后的结果？

由于特征向量 $\begin{pmatrix} 1 \\ 0 \end{pmatrix}$ 和 $\begin{pmatrix} 1 \\ 1 \end{pmatrix}$ 是无关的，因此它们可以线性表出任何二维向量。

容易看出，

$$\begin{pmatrix} 2 \\ 1 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 1 \\ 0 \end{pmatrix} + \begin{pmatrix} 1 \\ 1 \end{pmatrix} \quad (17)$$

在经过 A 变换后，特征向量分别变为 $\begin{pmatrix} 2 \\ 0 \end{pmatrix}$ 和 $\begin{pmatrix} 3 \\ 3 \end{pmatrix}$ ，因此

$$A \begin{pmatrix} 2 \\ 1 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 2 \\ 0 \end{pmatrix} + \begin{pmatrix} 3 \\ 3 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 5 \\ 3 \end{pmatrix} \quad (18)$$

验证一下结果，直接计算 $A \begin{pmatrix} 2 \\ 1 \end{pmatrix}$ ，发现结果与上式一致：

$$A \begin{pmatrix} 2 \\ 1 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 2 & 1 \\ 0 & 3 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} 2 \\ 1 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 5 \\ 3 \end{pmatrix} \quad (19)$$

基变换

在式 (17) 中, 我们将向量 $\begin{pmatrix} 2 \\ 1 \end{pmatrix}$ 分解为了特征向量的线性组合。虽然这个例子很简单, 但对于一般的向量, 这种分解往往不直接。这个过程本质是基的转换, 换了一个视角看同一个向量。

事实上, 我们能写出任何 2 维向量 (x, y) 的坐标, 是因为我们默认选择了标准基, 即 $w = xi + yj$ 。如果我们希望选择特征向量作为基, 那么应该寻找使得 $w = x'v_1 + y'v_2$ 成立的 x' 和 y' 作为在特征向量基下 w 的新坐标。写成等式:

$$xi + yj = w = x'v_1 + y'v_2 \implies x \begin{pmatrix} 1 \\ 0 \end{pmatrix} + y \begin{pmatrix} 1 \\ 0 \end{pmatrix} = x' \begin{pmatrix} 1 \\ 0 \end{pmatrix} + y' \begin{pmatrix} 1 \\ 1 \end{pmatrix}$$

注意, 这里两个等式之间的 \implies 成立的关键在于用标准基下特征向量的坐标表达了特征向量。这是一种**以标准基为中心的表达式**, 目的是将特征向量基的视角中看到的“翻译”为标准基的视角中看到的。进一步写成矩阵形式:

$$\begin{pmatrix} 1 & 0 \\ 0 & 1 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} x \\ y \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 1 & 1 \\ 0 & 1 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} x' \\ y' \end{pmatrix}$$

我们可以得到:

$$\begin{pmatrix} x' \\ y' \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 1 & 1 \\ 0 & 1 \end{pmatrix}^{-1} \begin{pmatrix} 1 & 0 \\ 0 & 1 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} x \\ y \end{pmatrix} = P^{-1} \begin{pmatrix} x \\ y \end{pmatrix}, \quad P = \begin{pmatrix} 1 & 1 \\ 0 & 1 \end{pmatrix}$$

基变换

我们将矩阵 P 称为**基变换矩阵**，其列向量是特征向量在标准基下的坐标。矩阵 P 将特征向量基下表示的向量重新表示为标准基下的线性组合（即标准基下的坐标）；矩阵 P^{-1} 将标准基下表示的向量重新表示为特征向量基下的线性组合（即特征向量基下的坐标）¹³。再来看看矩阵 P 的意义：

$$\begin{pmatrix} x \\ y \end{pmatrix} = P \begin{pmatrix} x' \\ y' \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 1 & 1 \\ 0 & 1 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} x' \\ y' \end{pmatrix}$$

将特征向量基的语言翻译为标准基的语言

$$\begin{pmatrix} x' \\ y' \end{pmatrix} = P^{-1} \begin{pmatrix} x \\ y \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 1 & 1 \\ 0 & 1 \end{pmatrix}^{-1} \begin{pmatrix} x \\ y \end{pmatrix}$$

将标准基的语言翻译为特征向量基的语言

¹³更多关于基变换的理解和动画演示，参考 3Blue1Brown 的讲解：

https://youtu.be/P2LTAU01TdA?si=Uugs8Xm3h_5M46LS

特征分解

对于任何一般的向量，我们都可以这样做：

- 将向量表示为特征向量的线性组合
- 将每个特征向量缩放特征值倍
- 按照之前线性组合的系数组合变换后的特征向量

现在我们称使用矩阵表示这个过程，首先利用矩阵 P^{-1} 将任意向量分解为特征向量的线性组合，然后利用对角矩阵 $\Lambda = \begin{pmatrix} 2 & 0 \\ 0 & 3 \end{pmatrix}$ 将每个特征向量缩放特征值倍，最后利用矩阵 P 将变换后的特征向量重新表示为标准基下的线性组合。

因此，可以将 A 分解为：

$$A = P\Lambda P^{-1} = \begin{pmatrix} 1 & 1 \\ 0 & 1 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} 2 & 0 \\ 0 & 3 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} 1 & 1 \\ 0 & 1 \end{pmatrix}^{-1} \quad (20)$$



小结



矩阵的转置

矩阵的**转置**是将矩阵的行和列互换。

例如，矩阵 $A = \begin{bmatrix} 1 & 2 & 3 \\ 4 & 5 & 6 \end{bmatrix}$ 的转置记作 A^T :

$$A^T = \begin{bmatrix} 1 & 4 \\ 2 & 5 \\ 3 & 6 \end{bmatrix}$$

沿着从左上角到右下角 45° 的直线翻转矩阵，即可得到矩阵的转置。这条直线叫做矩阵的**主对角线**。

对矩阵 A, B , 我们有 $(AB)^T = B^T A^T$ 。（提示：想一下矩阵相乘的尺寸对齐关系）

矩阵相乘的逆

对可逆矩阵 A, B , 我们有 $(AB)^{-1} = B^{-1}A^{-1}$ 。(提示: 套定义和原矩阵相乘就可以证明)

- 我们从向量开始，回顾了向量的加法、数乘、内积运算。
- 之后引入了线性组合的概念，从而引入了线性空间的概念。
- 之后我们讨论了线性变换，并借此引入矩阵的概念，并进一步介绍了矩阵和向量、矩阵和矩阵的乘法，以及行列式的概念。
- 通过线性变换的逆问题，我们引入了方程组的矩阵形式、矩阵的秩以及逆矩阵的概念。
- 之后我们讨论了方程组的解、矩阵的秩、矩阵的可逆性、方阵的行列式之间的关系。
- 最后我们通过“变换中的不变量”引入特征值和特征向量，并指出特征分解的含义是先用特征向量表示标准基中的任意向量，进一步通过特征值缩放特征向量后将结果映射回标准基中。

- Gilbert Strang 教授的教材 *Introduction to Linear Algebra*;
- Gilbert Strang 教授的 MIT 18.06 Linear Algebra 课程视频 (<https://youtu.be/7UJ4CFRGd-U?si=5EZDUaXEqaJoYi9G>);
- 高中数学选修 4-2 矩阵与变换;
- 3Blue1Brown 线性代数课程 (<https://www.3blue1brown.com/topics/linear-algebra>);
- UP 主: 漫士沉思录 (<https://space.bilibili.com/266765166>) 的“无痛线代”系列视频.