

0 说明

4.1 矩阵的LU分解

为什么需要LU分解

LU分解

其他分解形式

PLU 分解

LDU 分解

4.2 高斯消元算法复杂度

4.3 转置矩阵

转置矩阵的性质

特殊转置矩阵

对称矩阵

正交矩阵

斜对称矩阵

4.4 置换矩阵

置换矩阵的定义

置换矩阵的性质

5 向量空间

空间

向量空间的定义

常见的向量空间

向量空间的子空间

向量空间的基与维数

6.1 列空间

列空间的定义

线性方程组与列空间

6.2 零空间

零空间的定义

零空间的维数

特例分析

一般分析

7 $A\vec{x} = \vec{0}$ 的求解

思路

计算机求解的过程

8 $A\vec{x} = \vec{b}$ 的求解

$A\vec{x} = \vec{b}$ 何时解?

$A\vec{x} = \vec{b}$ 解的结构

0 说明

笔记标题: MIT_LA_Lecture4-8

笔记版本: v1.0

对于文档的说明:

1. 你可以在我的Github[仓库](#)中下载本笔记的Markdwon源文档，并通过浏览目录进行更方便高效地浏览；也欢迎在[知乎文章](#)中进行浏览。
2. 本笔记参考的课程为MIT Linear Algebra（麻省理工线性代数），本课程在[网易公开课](#)、[Bilibili](#)和[youtube](#)等网站上都有视频资源，读者可以选择合适的平台观看。
3. 本笔记并未完全按照视频课的内容记录，添加了许多自己的理解、资料的补充和顺序的调整。
4. 本系列笔记在不断更新，已经发布的笔记也会偶尔进行内容更新，版本号可以在文件标题或说明的开头查看，你可以通过Github的commit信息来查看笔记更新内容。
5. 如果你对笔记内容有好的建议，请提出来，笔者在这里表示感谢。

对于内容的说明：

1. 小写字母表示的向量，比如 \vec{a} ，除非在特殊说明的情况下，都表示的是列向量。用 \vec{a}^T 来表示行向量。
2. 部分矩阵中 \cdot 用来表示元素省略，并不表示元素为0。
3. 单位矩阵用 I 表示。

4.1 矩阵的LU分解

为什么需要LU分解

在[上一节](#)中，我们知道通过高斯消元法可以容易地求解线性方程组，用矩阵表示即 $EA = U$ ，E为若干初等矩阵的积，包含了我们进行初等变换的所有信息，U为上三角矩阵（upper triangular）。我们以1中（6）为例 $E_{32}E_{21}A = U$ ：

$$\begin{bmatrix} 1 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & 0 \\ 0 & -2 & 1 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} 1 & 0 & 0 \\ -3 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 1 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} 1 & 2 & 1 \\ 3 & 8 & 1 \\ 0 & 4 & 1 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 1 & 2 & 1 \\ 0 & 2 & -2 \\ 0 & 0 & 5 \end{bmatrix} \quad (1)$$

我们先不考虑行的交换，观察 $E_{32}E_{21} = E$ ：

$$\begin{bmatrix} 1 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & 0 \\ 0 & -2 & 1 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} 1 & 0 & 0 \\ -3 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 1 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 1 & 0 & 0 \\ -3 & 1 & 0 \\ -6 & -2 & 1 \end{bmatrix} \quad (2)$$

我们可以发现，E除了初等行变换信息（即E中的-3，-2两项），还多了一个额外信息-6，这个是我们不想要的信息，那么有没有只包含行变换信息的分解或等式呢？有，这就是我们即将介绍的LU分解。

LU分解

在线性代数与数值分析中，LU分解是矩阵分解的一种，将一个矩阵分解为一个下三角矩阵和一个上三角矩阵的乘积，有时需要再乘上一个置换矩阵。LU分解可以被视为高斯消元法的矩阵形式。在数值计算上，LU分解经常被用来解线性方程组、且在求反矩阵和计算行列式中都是一个关键的步骤。

--[维基百科](#)

仍先不考虑行变换，LU分解简单地说就是 $A = LU$ ，同样写出上例的LU分解式：

$$\begin{bmatrix} 1 & 2 & 1 \\ 3 & 8 & 1 \\ 0 & 4 & 1 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 1 & 0 & 0 \\ 3 & 1 & 0 \\ 0 & 2 & 1 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} 1 & 2 & 1 \\ 0 & 2 & -2 \\ 0 & 0 & 5 \end{bmatrix} \quad (3)$$

可以看到， L 除了是下三角阵外，还包含且仅包含了矩阵行变换的所有信息。同时我们有以下结论：

$$\begin{aligned} EA &= U \\ A &= LU \\ \therefore L &= E^{-1} \end{aligned} \quad (4)$$

这样，当我们通过高斯消元法变换矩阵后，就能立即写出 $A = LU$ 这种分解形式，对消元的过程和结果进行完整地记录，而不需要额外去计算 $E = E_{32}E_{21}$ ，我们写出 L 就相当于记录了 E ，因为 $L = E^{-1}$ 。

总之，对于 $A = LU$ ，如果不存在行交换，消元乘数（消元步骤中需要乘以并减去的倍数）可以直接写入 L 中。因此可以这样看待消元，只要步骤正确，就可以在得到LU的过程中把A抛开，这是对矩阵形式进行消元的更深刻的认识。

其他分解形式

除了上面给出的LU分解，有些矩阵还能进行PLU分解和LDU分解。

PLU 分解

方阵A的**PLU分解**是是将它分解成一个置换矩阵P、一个下三角矩阵L与上三角矩阵U的乘积，即

$$A = PLU \quad (5)$$

事实上，所有的方阵都可以写成PLU分解的形式，由于左乘排列矩阵 P^{-1} 是在交换行的顺序（也就是后面即将说到的置换矩阵），所以由 $P^{-1}A = LU$ 推得适当的交换A的行的顺序，即可将A做LU分解。事实上，PLU分解有很高的[数值稳定性](#)，因此实用上是很好用的工具。

有时为了计算上的方便，会同时交换行与列的顺序，此时会将A分解成

$$A = PLUQ \quad (6)$$

其中P、L、U同上，Q是一个置换矩阵（这里是右乘以交换列）。

LDU 分解

方阵A的**LDU分解**是是将它分解成一个单位下三角矩阵L、对角矩阵D与单位上三角矩阵U的乘积，即

$$A = LDU \quad (7)$$

其中单位上、下三角矩阵是指对角线上全是1的上、下三角矩阵。

事实上，LDU分解可以推广到A是一般的矩阵，而非方阵。此时，L和D是方阵，并且与A有相同的行，U则有和A相同的长宽。注意到现在U是上三角的定义改为主对角线的下方都是0，而主对角线是收集所有 U_{ij} 满足 $i=j$ 。

我们将 (3) 中的 $A=LU$ 分解再进一步化为 LDU 分解：

$$\begin{bmatrix} 1 & 2 & 1 \\ 3 & 8 & 1 \\ 0 & 4 & 1 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 1 & 0 & 0 \\ 3 & 1 & 0 \\ 0 & 2 & 1 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} 1 & 0 & 0 \\ 0 & 2 & 0 \\ 0 & 0 & 5 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} 1 & 2 & 1 \\ 0 & 1 & -1 \\ 0 & 0 & 1 \end{bmatrix} \quad (3)$$

4.2 高斯消元算法复杂度

关于高斯消元算法的复杂度：

1. 用每一行减去第一行的倍数，以消除第一行以外的第一列的元素，因为每行有 n 个元素，所以计算次数为 n^2 ；
2. 排除第一行，用每一行减去第二行的倍数，计算以此类推，因为共有 n 行，所以我们一共进行了 n 次，算法复杂度为 $n^2 + (n-1)^2 + \dots + 1^2 = O(\frac{1}{3}n^3)$ 。
3. 这里我们仅讨论得到阶梯型矩阵的复杂度，高斯-若当消元法会有额外的计算步骤，但后续计算量小，并不影响其复杂度，这里不予证明。

4.3 转置矩阵

转置矩阵的性质

转置矩阵 (transpose) 有很多值得我们记住的基本的性质，对于矩阵 A , B 和标量 c ，转置矩阵有下列性质：

- $(A^T)^T = A$
- $(A + B)^T = A^T + B^T$
- $(AB)^T = B^T A^T$
- $(cA)^T = cA^T$
- $|A^T| = |A|$
- $\vec{a} \cdot \vec{b} = \vec{a}^T \vec{b}$
- 若 $AA^T = C$ ，则 C 为对称矩阵，即 $C = C^T$ 。

还有比如我们刚刚学到的：

$$AA^{-1} = I \xrightarrow{T} (A^{-1})^T A^T = I \rightarrow (A^T)^{-1} = (A^{-1})^T \quad (4)$$

当然，还有一些之后会学到的：

- 如果 A 只有实数元素，则 $A^T A$ 是半正定矩阵。
- 如果 A 是在某个域上，则 A 相似与 A^T 。

特殊转置矩阵

对称矩阵

其转置等于自身的方块矩阵叫做**对称矩阵**。

正交矩阵

其转置也是它的逆矩阵的方块矩阵叫做**正交矩阵**；就是说 G 是正交的，如果 $GG^T = G^T G = I$ 。

斜对称矩阵

其转置等于它的负矩阵的方块矩阵叫做斜对称矩阵；就是 A 是斜对称的，如果 $A^T = -A$ 。

4.4 置换矩阵

置换矩阵的定义

在以上的消元的讨论中，我们为了方便都事先假定不需要进行行的交换，如果需要考虑这些行交换或列交换， $A=LU$ 分解就不能完全表示出矩阵消元的所有信息了，这个时候我们需要在 LU 左边乘上一个置换矩阵，用以记录行交换的信息，从而我们得到了 $A=PLU$ 分解；当然，有时候我们也会进行列交换，那么同样地在 LU 右端乘上一个置换矩阵，就得到了 $A=PLUQ$ 分解。

在数学中的矩阵论里，置换矩阵（permutation matrix）是一种系数只由0和1组成的方块矩阵。置换矩阵的每一行和每一列都恰好有一个1，其余的系数都是0。在线性代数中，每个 n 阶的置换矩阵都代表了一个对 n 个元素（ n 维空间的基）的置换。当一个矩阵乘上一个置换矩阵时，所得到的原来是矩阵的横行（置换矩阵在左）或纵列（置换矩阵在右）经过置换后得到的矩阵。

来自[维基百科](#)。

我们考虑 $n=3$ 时的置换矩阵，一共有以下6个：

$$\begin{bmatrix} 1 & & \\ & 1 & \\ & & 1 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} 1 & & \\ & 1 & \\ & & 1 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} 1 & & \\ & 1 & \\ & & 1 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} 1 & & \\ & 1 & \\ & & 1 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} 1 & & \\ & 1 & \\ & & 1 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} 1 & & \\ & 1 & \\ & & 1 \end{bmatrix} \quad (5)$$

相应地，左乘分别代表不变，交换2、3行，交换1、2行等；右乘分别代表不变，交换2、3列，交换1、2列等。

置换矩阵的性质

- 从定义可以看出， n 维置换矩阵共有 $n!$ 个。
- 从定义也可以很容易得到，置换矩阵的逆等于其转置，即 $P^{-1} = P^T$ 。
- 这 $n!$ 个置换矩阵任意相乘的结果仍在其中，其逆也在其中，也就是这 $n!$ 个矩阵构成了一个[矩阵群](#)，对矩阵乘法和逆运算封闭。

5 向量空间

空间

什么是空间？如果让一只蚂蚁沿着一条细绳爬行，那么对蚂蚁来说，空间就是一条直线 R ，如果把蚂蚁放到地图上，那么空间就是一个平面 R^2 ，而现实里，蚂蚁还能往上往下，那么就像我们人类感知的一样，空间就是三维空间 R^3 。

而数学上，空间是指一种具有特殊性质及一些额外结构的集合，也就是说，我们规定一些性质或结构，若集合能满足这些要求，那它就是一个我们规定的某种空间。在数学上，空间可以有很多种，比如函数空间、仿射空间、概率空间等等，向量空间也是规定的一种满足特定性质和要求的元素的集合。

那么，从这个定义来说，向量空间里的元素只要满足这些要求就行了，是不是向量空间里的元素不是向量也可以呢？还真是这样。向量空间的元素还可以是函数、矩阵、多项式、映射等等，只要这些元素满足向量空间的所规定的线性运算规律就好了。

但正如名字所示，我们最常见和研究的向量空间还有一些有序数组，也就是向量的集合，这一节我们还是以它为主介绍。

那么，向量空间应该满足什么性质呢？

向量空间的定义

设 V 为 n 维向量的集合，如果集合 V 非空，且集合 V 对于向量的加法及数乘两种运算封闭，那么就称集合 V 为向量空间。所谓封闭，是指在集合 V 中可以进行向量的加法及数乘两种运算。具体地说：

$$\begin{aligned} \text{若 } \vec{a}, \vec{b} \in V, \text{ 则 } \vec{a} + \vec{b} \in V; \\ \text{若 } \vec{a} \in V, \lambda \in R, \text{ 则 } \lambda \vec{a} \in V. \end{aligned} \quad (6)$$

当然，我们这里前提还是以有序数组，即向量为对象考虑的，对于一般化的向量空间，我们会在后面介绍。

常见的向量空间

在思考这个问题之前，我们先回过头看一看（6）这个定义，其中 \vec{a}, \vec{b} 既然可以相加，首先它们的维数必须相同，也就是说，不同维数的向量构成的向量空间肯定是不同的，比如，举个最简单的例子，两个集合 A 和 B ， $A = \{\vec{0} = [0, 0]^T\}$ ， $B = \{\vec{0} = [0, 0, 0]^T\}$ ，很容易验证这两个向量都分别满足向量空间的定义，但它们是不同的向量空间。

同样地，我们还能举出一个例子 R ， R^2 ，和 R^3 都是向量空间，可以说是 n 维列向量能构成的最大的向量空间。

还有哪些呢？比如我们考虑 R^2 内，一条过原点的直线也是一个向量空间，因为我们很容易能验证（6）中的两条性质。但线段、射线和不过原点的直线都不是向量空间，也就是没有其他种类的向量空间了。

我们再考虑 R^3 中，同样，过原点的直线是向量空间，更进一步，过原点的任一平面也是一个向量空间，也没有其他种类的向量空间了。

现在我们将加上最开始考虑的零向量和 R^n 本身，总结一下， R^n 中，一共有多少种向量空间呢？

首先是零向量，然后是 R^n 中任一过原点的直线，然后是 R^n 中任一过原点的平面，当 $n=4$ 时，还有 R^4 中任一过原点的三维空间，当然4维是抽象的， $n>4$ 时以此类推。最后再加上 R^n 本身，就是 R^n 内所有不同种类的向量空间，共有 $n+1$ 种。

向量空间的子空间

我们知道了 R^n 中，一共有 $n+1$ 种向量空间，并且，前 n 种向量空间都是 R^n 的子集（当然 R^n 本身也是 R^n 的子集），那么就称前 n 种低维向量空间是 R^n 的**子空间**。

一个集合 A 首先应该是一个向量空间，其次它是另一个向量空间 V 的子集，这样它就是向量空间 V 的子空间。

那么，是在 R^n 中的这 $n+1$ 种向量空间，前 n 种向量空间只能是 R^n 的子空间吗？并不是，比如， R^n 上的一个二维向量空间，即 R^n 中一个过原点的平面，在其中任找一条过原点的直线，那么这条直线就是这个二维向量空间的子空间。当然， n 维零向量也是 R^n 中任一向量空间的子空间。

向量空间的基与维数

设 V 为向量空间，如果 r 和向量 $\vec{a}_1, \vec{a}_2, \dots, \vec{a}_r \in V$ ，且满足：

- $\vec{a}_1, \vec{a}_2, \dots, \vec{a}_r$ 线性无关；
- V 中任一向量都可由 $\vec{a}_1, \vec{a}_2, \dots, \vec{a}_r$ 线性表示，

那么，向量组 $\vec{a}_1, \vec{a}_2, \dots, \vec{a}_r$ 就成为向量空间 V 的一个**基**， r 称为向量空间 V 的**维数** $\dim V$ ，并称 V 为 r 维向量空间。多说一句，如果 \vec{a}_1 是 m 维列向量，那么我们通常称 V 为 R^m 上的 r 维向量空间。

如果向量空间 V 没有基，那么 V 的维数是0。0维向量空间只含一个零向量 $\vec{0}$ 。

以上，我们介绍了向量空间的概念，接下来介绍两种常用的向量空间来帮助理解和求解线性方程组 $A\vec{x} = \vec{b}$ ：**列空间**和**零空间**。

6.1 列空间

列空间的定义

设一 m 行 n 列实元素矩阵为 A_{mn} ，则其列空间（column space）是由矩阵 A 的所有列向量张成（span）的 R^m 上的子空间，记作 $C(A)$ 。

矩阵 A 的列空间 $C(A)$ 中的所有向量均为矩阵 A 中列向量的某种线性组合，都为 R^m 上的向量（即 m 维向量）。

$C(A)$ 的维度等于矩阵 A 的列秩，最大为 $\min(m, n)$ 。即：

$$\dim C(A) = \text{rank}(A) \leq \min(m, n) \quad (7)$$

列空间 $C(A)$ 的一组自然基底是矩阵 A 的列向量的最大线性无关组。

线性方程组与列空间

我们考虑以下线性方程组 $A\vec{x} = \vec{b}$:

$$\begin{bmatrix} 1 & 1 & 2 \\ 2 & 1 & 3 \\ 3 & 1 & 4 \\ 4 & 1 & 5 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} x_1 \\ x_2 \\ x_3 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} b_1 \\ b_2 \\ b_3 \\ b_4 \end{bmatrix} \quad (8)$$

我们很容易验证列空间 $C(A)$ 是一个向量空间。

A的列空间 $C(A)$ 为所有列的线性组合，因为第3列为前两列之和，前两列线性无关，所以 $C(A)$ 是 R^4 上的一个2维向量空间。

那么，由（8）可知，求解线性方程组从列向量角度讲，本质就是 \vec{b} 是否可以由系数矩阵A的列向量线性表出。那么什么时候 $A\vec{x} = \vec{b}$ 解有什么时候无解呢？从列空间的角度，当 $\vec{b} \in C(A)$ 时，线性方程组有解；反之则无解。

6.2 零空间

零空间的定义

对于所有使齐次线性方程组 $A\vec{x} = \vec{0}$ 成立的向量 \vec{x} 的集合，称为矩阵A的零空间（null spaces），用符号表示为 $N(A)$ 。

零空间是一个向量空间。当A为m行n列实元素矩阵，所以 \vec{x} 是一个n维列向量：

- 若 $\vec{w} \in N(A)$ ，则 $A(k\vec{w}) = kA\vec{w} = \vec{0}$ ，即 $k\vec{w} \in N(A)$ ；
- 若 $\vec{w}, \vec{u} \in N(A)$ ，则 $A(\vec{w} + \vec{u}) = A\vec{w} + A\vec{u} = \vec{0}$ ，即 $\vec{w} + \vec{u} \in N(A)$ 。

所以 $N(A)$ 就是 R^n 的一个子空间。

零空间的维数

很容易知道， $\vec{0} \in N(A)$ ，以下我们来讨论 $A\vec{x} = \vec{0}$ 的非零解。

特例分析

比如我们考虑例（8）所对应的其次线性方程组：

$$\begin{bmatrix} 1 & 1 & 2 \\ 2 & 1 & 3 \\ 3 & 1 & 4 \\ 4 & 1 & 5 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} x_1 \\ x_2 \\ x_3 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 0 \\ 0 \\ 0 \\ 0 \end{bmatrix} \quad (9)$$

很明显，一个解为 $\vec{x} = [-1, -1, 1]^T$ ，当然所有 $k\vec{x}$ 也都是解，那么还有与 \vec{x} 不共线的解吗？

我们可以设非零解为 $\vec{x} = [c\lambda_1, c\lambda_2, c]^T$ ，（这里 $c \neq 0$ ，因为 c 若等于 0，前两列线性无关，得到的就是零解）由于所有 $k\vec{x}$ 也都是解，我们不妨取 $1/c$ ，即 $\vec{x} = [\lambda_1, \lambda_2, 1]^T$ ，来剔除线性相关的解，来讨论：**到底有多少线性无关的 \vec{x} ？也就是零空间的维数。**

我们知道 A 三个列向量的前两个列向量线性无关，也就是前两列是 $C(A)$ 的一个基，第三列可以表示成前两列的线性组合：

$$\vec{a}_3 = k_1 \vec{a}_1 + k_2 \vec{a}_2 \quad (10)$$

这种表示方法一定是唯一的。因为若有 $\vec{a}_3 = c_1 \vec{a}_1 + c_2 \vec{a}_2$ ，且 $[k_1, k_2]^T \neq [c_1, c_2]^T$ ，那么两式相减，我们可以得到 $\vec{0} = (c_1 - k_1) \vec{a}_1 + (c_2 - k_2) \vec{a}_2$ ，又因为 a_1, a_2 线性无关，所以只有系数都为 0 时，其线性组合才为 $\vec{0}$ ，所以得到 $c_1 = k_1, c_2 = k_2$ ，这和我们的假设矛盾，即证明了 (10) 的表示方法一定是唯一的。

那么 $-\vec{a}_3 = -k_1 \vec{a}_1 + -k_2 \vec{a}_2 = \lambda_1 \vec{a}_1 + \lambda_2 \vec{a}_2$ 的表示方法也一定是唯一的，移项就能得到，使 $\lambda_1 \vec{a}_1 + \lambda_2 \vec{a}_2 + \vec{a}_3 = \vec{0}$ 成立的 $[\lambda_1, \lambda_2, 1]^T$ ，也就是非零解 \vec{x} 也是唯一的，从而原齐次线性方程组

$A\vec{x} = \vec{0}$ 的系数矩阵 A 的零空间的维数为一，也就是说： **$N(A)$ 是 R^n 上的一维向量空间，即 R^n 中的一条过原点的直线。**

一般分析

有了以上特例分析作为基础，我们就能容易地推广到一般情况。

对于一般的 m 行 n 列矩阵 A ，考虑 A 的列向量 a_1, a_2, \dots, a_n ，一定可以（但并不唯一地）分为两部分，即 a_1, \dots, a_r 为列空间的一组基（即最大线性无关组）， a_{r+1}, \dots, a_n 为分别可以由基唯一线性表出的列向量。

这里的基虽然在原列向量 a_1, a_2, \dots, a_n 内，不一定就是最左边的 r 列，但是可以通过交换列向量得到这种形式，相应的零空间内各列向量的位置也需要做相应的调换，比如交换 2、4 列的位置，那么零空间向量 $[1, 2, 3, 4]^T$ 相应交换 2、4 行的位置，变成 $[1, 4, 3, 2]^T$ ，但这并不会影响零空间维数这个结果，我们这么做只是为了方便地分析问题。

我们任意从后面 $n-r$ 个列向量中取某个 a_k 系数为 1，使其他 $n-r-1$ 个系数均为 0，同样的分析思路，我们有使

$$\lambda_1 \vec{a}_1 + \lambda_2 \vec{a}_2 + \dots + \lambda_r \vec{a}_r + \vec{a}_k = \vec{0} \quad (11)$$

成立的 $[\lambda_1, \lambda_2, \dots, \lambda_r, 0_{r+1}, 0_{k-1}, 0_k, 0_{k+1}, \dots, 0_n]^T$ 是唯一的，由于我们假设的一般性，这样的列向量有 $n-r$ 个，也就是说至少有 $n-r$ 个线性无关的 n 维向量在零空间中，即零空间至少 $n-r$ 维。

尝试写出这 $n-r$ 个向量：

$$\begin{bmatrix} \lambda_{1(r+1)} \\ \lambda_{2(r+1)} \\ \dots \\ \lambda_{r(r+1)} \\ 1 \\ 0 \\ \dots \\ 0 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} \lambda_{1(r+2)} \\ \lambda_{2(r+2)} \\ \dots \\ \lambda_{r(r+2)} \\ 0 \\ 1 \\ \dots \\ 0 \end{bmatrix} \dots \begin{bmatrix} \lambda_{1(n)} \\ \lambda_{2(n)} \\ \dots \\ \lambda_{r(n)} \\ 0 \\ 0 \\ \dots \\ 1 \end{bmatrix} \quad (12)$$

这下我们就能很容易看出为什么要取一个为1，其他都为0，目的就是为了一定能得到n-r个线性无关且各自唯一表示的列向量。

那么有可能还有其他的线性无关的向量吗？

也就是比如我们再随便给出一个列向量：

$$\vec{x}^* = [\lambda_1, \lambda_2, \dots, \lambda_r, c_{r+1}, c_{r+2}, \dots, c_n]^T \quad (13)$$

想要使 $A\vec{x}^* = \vec{0}$ ，且与（12）我们已经得到的n-r个解线性无关。这是不可能的。

我们用反证法来证明这个命题，现在有一个 \vec{x}^* 满足“想要使 $A\vec{x}^* = \vec{0}$ ，且与（12）我们已经得到的n-r个解线性无关”这个假设，那么，我们一定可以将 \vec{x}^* 表示成如下的形式：

$$\vec{x}^* = c_{r+1} \begin{bmatrix} \lambda_{1(r+1)} \\ \lambda_{2(r+1)} \\ \dots \\ \lambda_{r(r+1)} \\ 1 \\ 0 \\ \dots \\ 0 \end{bmatrix} + c_{r+2} \begin{bmatrix} \lambda_{1(r+2)} \\ \lambda_{2(r+2)} \\ \dots \\ \lambda_{r(r+2)} \\ 0 \\ 1 \\ \dots \\ 0 \end{bmatrix} + \dots + c_n \begin{bmatrix} \lambda_{1(n)} \\ \lambda_{2(n)} \\ \dots \\ \lambda_{r(n)} \\ 0 \\ 0 \\ \dots \\ 1 \end{bmatrix} + \begin{bmatrix} \lambda_1^* \\ \lambda_2^* \\ \dots \\ \lambda_r^* \\ 0 \\ 0 \\ \dots \\ 0 \end{bmatrix} \quad (14)$$

简写为：

$$\vec{x}^* = c_{r+1} \vec{x}_{r+1} + c_{r+2} \vec{x}_{r+2} + \dots + c_n \vec{x}_{r+n} + \vec{x}_s^* \quad (15)$$

关键来了， \vec{x}_s^* 一定不是零向量，因为这是我们假设要求的线性无关。

然后我们在（15）等式两端乘以A，便得到：

$$\begin{aligned} A\vec{x}^* &= c_{r+1} A\vec{x}_{r+1} + c_{r+2} A\vec{x}_{r+2} + \dots + c_n A\vec{x}_{r+n} + A\vec{x}_s^* \\ \vec{0} &= c_{r+1} \vec{0} + c_{r+2} \vec{0} + \dots + c_n \vec{0} + A\vec{x}_s^* \\ A\vec{x}_s^* &= \vec{0} \end{aligned} \quad (16)$$

再以列向量的线性组合表示出来：

$$\lambda_1^* \vec{a}_1 + \lambda_2^* \vec{a}_2 + \dots + \lambda_r^* \vec{a}_r + 0\vec{a}_{r+1} + 0\vec{a}_{r+2} + \dots + 0\vec{a}_n = \vec{0} \quad (17)$$

$$\lambda_1^* \vec{a}_1 + \lambda_2^* \vec{a}_2 + \dots + \lambda_r^* \vec{a}_r = \vec{0} \quad (18)$$

由 (18) 式, 我们得到了 a_1, \dots, a_r 线性相关, 这和我们最开始的假定是矛盾的, 所以我们由反证法得出, 不存在更多线性无关的解了, 也就是说 $\dim N(A) = n - r$, r 为 A 的秩。

当然, 以上这种证明只是我自己做笔记时想出来的, 肯定很繁琐, 之后学习了矩阵的秩会有相关性质进行简洁的证明。

综合列空间, 我们可以得到, 对于 A_{mn} , 若 $\text{rank}(A) = r$, 则有:

$$\dim C(A) = r, \dim N(A) = n - r \quad (19)$$

列空间和零空间对于理解非齐次线性方程组的解是非常有帮助的, 列空间告诉我们什么时候有解什么时候无解, 零空间告诉我们, 解的结构应该是什么样子。

7 $A\vec{x} = \vec{0}$ 的求解

思路

考虑以下 A , 并进行行变换得到简化阶梯型矩阵 R :

$$A = \begin{bmatrix} 1 & 2 & 2 & 2 \\ 2 & 4 & 6 & 8 \\ 3 & 6 & 8 & 10 \end{bmatrix} \sim \begin{bmatrix} 1 & 2 & 2 & 2 \\ 0 & 0 & 2 & 4 \\ 0 & 0 & 0 & 0 \end{bmatrix} \sim \begin{bmatrix} 1 & 2 & 0 & -2 \\ 0 & 0 & 1 & 2 \\ 0 & 0 & 0 & 0 \end{bmatrix} = R \quad (20)$$

现在, 记:

$$I_{r \times r} = \begin{bmatrix} 1 & 0 \\ 0 & 1 \end{bmatrix}, F_{r \times (n-r)} = \begin{bmatrix} 2 & -2 \\ 0 & 2 \end{bmatrix} \quad (21)$$

那么 R 可以表示为:

$$R_{m \times n} = \begin{bmatrix} I_{r \times r} & F_{r \times (n-r)} \\ \vec{0}_{(m-r) \times r} & \vec{0}_{(m-r) \times (n-r)} \end{bmatrix} \quad (22)$$

设 $N_{n \times (n-r)}$ 为:

$$N_{n \times (n-r)} = \begin{bmatrix} -F_{r \times (n-r)} \\ I_{n-r} \end{bmatrix} \quad (23)$$

接下来计算 RN :

$$R_{m \times n} N_{n \times (n-r)} = \begin{bmatrix} -F_{r \times (n-r)} + F_{r \times (n-r)} \\ \vec{0}_{(m-r) \times (n-r)} + \vec{0}_{(m-r) \times (n-r)} \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} \vec{0}_{r \times (n-r)} \\ \vec{0}_{(m-r) \times (n-r)} \end{bmatrix} = \vec{0} \quad (24)$$

这样我们就找出了 $A\vec{x} = \vec{0}$ 的一组解 $N_{n \times (n-r)}$ 。

计算机求解的过程

第一步，通过消元找出R。

第二步，找出主元变量和自由变量。

第三步，给自由变量赋值0和1，并通过回代解出主变量。

举个例子：

$$A = \begin{bmatrix} 1 & 2 & 3 \\ 2 & 4 & 6 \\ 2 & 6 & 8 \\ 2 & 8 & 10 \end{bmatrix} \sim \begin{bmatrix} 1 & 0 & 1 \\ 0 & 1 & 1 \\ 0 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 0 \end{bmatrix} \quad (25)$$
$$I = \begin{bmatrix} 1 & 0 \\ 0 & 1 \end{bmatrix}, F = \begin{bmatrix} 1 \\ 1 \end{bmatrix}$$

由 (23) 可知解的形式为：

$$N_{3 \times 1} = \begin{bmatrix} -F_{2 \times 1} \\ I_1 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} -1 \\ -1 \\ 1 \end{bmatrix} \quad (26)$$

所以原齐次线性方程组的通解为：

$$\vec{x} = k \begin{bmatrix} -1 \\ -1 \\ 1 \end{bmatrix} \quad (27)$$

其中，k为任意实数。

8 $A\vec{x} = \vec{b}$ 的求解

在了解了列空间和零空间之后，就可以对 $A\vec{x} = \vec{b}$ 何时解和结构进行分析了。

$A\vec{x} = \vec{b}$ 何时解？

以下两命题等价：

- 当 $\vec{b} \in C(A)$ 时， $A\vec{x} = \vec{b}$ 有解。
- 当 $\text{rank}(A) = \text{rank}(A, \vec{b})$ 时， $A\vec{x} = \vec{b}$ 有解。

具体而言，n元线性方程组 $A\vec{x} = \vec{b}$ ：

- 无解的充要条件是 $\text{rank}(A) < \text{rank}(A, \vec{b})$
- 有唯一解的充要条件是 $\text{rank}(A) = \text{rank}(A, \vec{b}) = n$
- 有无穷多解的充要条件是 $\text{rank}(A) = \text{rank}(A, \vec{b}) < n$

接下来从简化行阶梯型R来分类：

$$\begin{array}{cccc}
r = m = n & r = m < n & r = n < m & r < m, r < n \\
R = I & , R = \begin{bmatrix} I & F \end{bmatrix} , & R = \begin{bmatrix} I \\ 0 \end{bmatrix} , & R = \begin{bmatrix} I & F \\ 0 & 0 \end{bmatrix} \\
\text{一解} & \text{无穷解} & \text{无解或一解} & \text{无解或无穷解}
\end{array} \tag{28}$$

$A\vec{x} = \vec{b}$ 解的结构

非齐次线性方程组 $A\vec{x} = \vec{b}$ 的通解为齐次线性方程组 $A\vec{x} = \vec{0}$ 的通解，加上非齐次线性方程组的任一特解 \vec{x}^* ：

$$\vec{x} = \begin{bmatrix} -F_{r \times (n-r)} \\ I_{n-r} \end{bmatrix} \begin{bmatrix} k_1 \\ \vdots \\ k_{n-r} \end{bmatrix} + \vec{x}^* \tag{29}$$