

§ 4.4 向量空间

三维向量空间 \mathbf{R}^3 中，向量之间的关系——线性结构：

$$\left. \begin{array}{l} (1) \quad \forall \alpha, \beta \in \mathbf{R}^3 \quad \Rightarrow \alpha + \beta \in \mathbf{R}^3 \\ (2) \quad \forall \alpha \in \mathbf{R}^3, \forall k \in \mathbf{R} \quad \Rightarrow k\alpha \in \mathbf{R}^3 \end{array} \right\} \begin{array}{l} \text{对加法运算封闭} \\ \text{对数乘运算封闭} \end{array}$$

加法与数乘合称线性运算，三维向量空间对线性运算封闭.

一、向量空间的概念

1. 向量空间的定义

定义4.11 设 V 是非空的 n 维实向量集合，

若 (1) 对 $\forall \alpha, \beta \in V$ ，有 $\alpha + \beta \in V$ ； (对加法运算封闭)

(2) 对 $\forall \alpha \in V, \forall k \in \mathbf{R}$ ，有 $k\alpha \in V$. (对数乘运算封闭)

则称 V 为**向量空间**(**线性空间**).

命题 若 V 是向量空间, 则 V 必含有零向量.

即 V 含零向量是 V 为向量空间的必要条件.

证明 设 V 是向量空间, 所以

$$\text{任取 } \alpha \in V, 0 \in \mathbf{R} \quad \Rightarrow 0 \cdot \alpha = \mathbf{0} \in V.$$

例

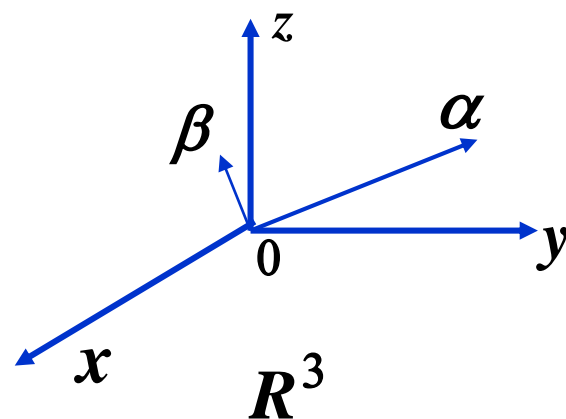
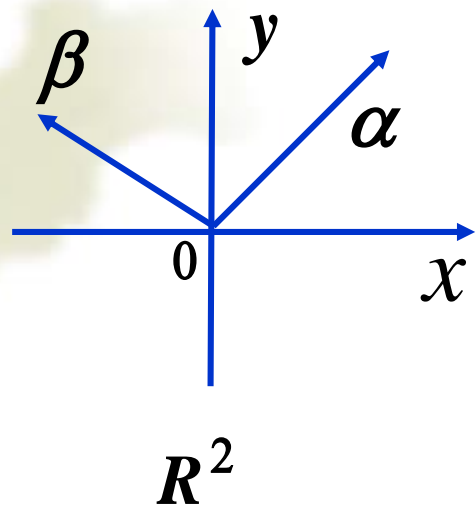
(1) $\mathbf{R}^n \triangleq \{x = (x_1, x_2, \dots, x_n) \mid x_j \in \mathbf{R}, j = 1, 2, \dots, n\}$ 是向量空间.

特别: \mathbf{R}^1 是实数集, 每个 $x \in \mathbf{R}^1$ 是实数轴上的向量;

\mathbf{R}^2 是实数对集, 每个 $x \in \mathbf{R}^2$ 是 XOY 平面上的向量;

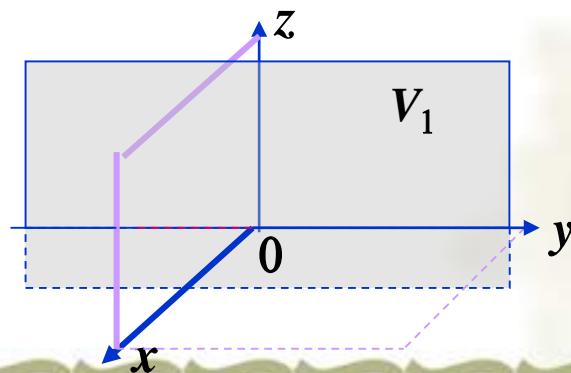
\mathbf{R}^3 是三元有序实数组的集,

每个 $x \in \mathbf{R}^3$ 是 $O-XYZ$ 空间中的向量.



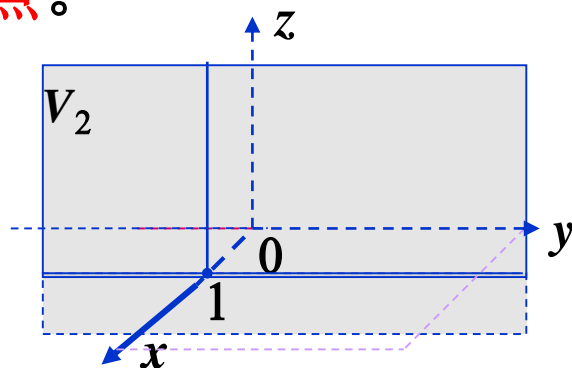
(2) $V_1 = \{ \mathbf{x} = (0, x_2, \dots, x_n) \mid x_j \in \mathbf{R}, j = 2, \dots, n \}$ 是向量空间。

特别: $V_1 = \{ (0, x_2, x_3) \mid x_2, x_3 \in \mathbf{R} \}$ 是 $Oxyz$ 中的 yoz 平面。



(3) $V_2 = \{ x = (1, x_2, \dots, x_n) \mid x_j \in \mathbf{R}, j = 2, \dots, n \}$ 不是向量空间。

特别: $V_2 = \{ x = (1, x_2, x_3) \mid x_j \in \mathbf{R}, j = 2, 3 \}$ 是 xyz 中的平面,
不通过坐标原点。



(4) $V_3 = \{ x = (0, \dots, 0) \}$ 是向量空间.

例1 由 n 维向量 $\alpha_1, \alpha_2, \dots, \alpha_m$ ($m \geq 1$) 所有可能的线性组合生成的向量集合

$$V = \{ x = k_1 \alpha_1 + k_2 \alpha_2 + \dots + k_m \alpha_m \mid k_j \in \mathbf{R}, j = 1, 2, \dots, m \}$$

是向量空间。

证明

$\because m \geq 1, \therefore \alpha_1 \in V$, 即 V 非空.

(1) 对 $\forall \alpha, \beta \in V, \exists k_j \in \mathbf{R}, l_j \in \mathbf{R}, j=1, 2, \dots, m$, 使

$$\alpha = k_1 \alpha_1 + k_2 \alpha_2 + \dots + k_m \alpha_m \quad \text{加法封闭}$$

$$\beta = l_1 \alpha_1 + l_2 \alpha_2 + \dots + l_m \alpha_m$$

$$\Rightarrow \alpha + \beta = (k_1 + l_1) \alpha_1 + (k_2 + l_2) \alpha_2 + \dots + (k_m + l_m) \alpha_m \in V$$

(2) 对 $\forall \alpha \in V, \forall k \in \mathbf{R}$ 数乘封闭

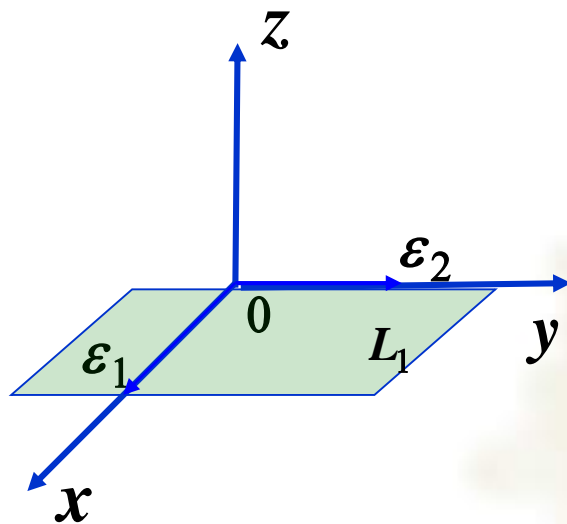
$$\Rightarrow k\alpha = (kk_1) \alpha_1 + (kk_2) \alpha_2 + \dots + (kk_m) \alpha_m \in V$$

$\therefore V$ 是向量空间。

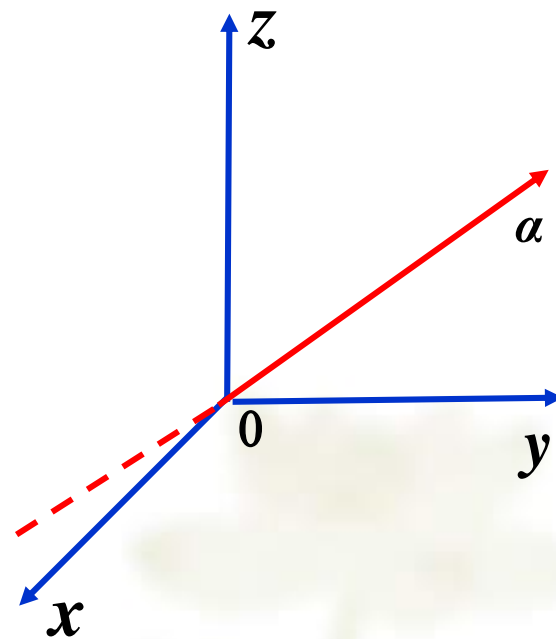
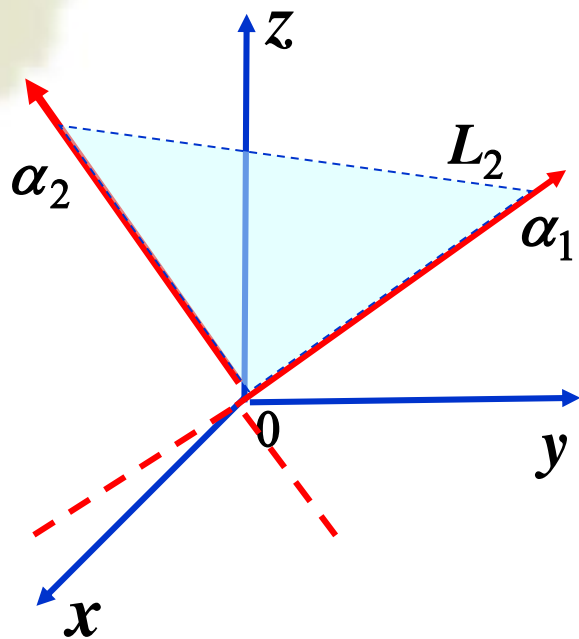
定义 $V = \{ \mathbf{x} = k_1 \mathbf{a}_1 + k_2 \mathbf{a}_2 + \cdots + k_m \mathbf{a}_m \mid k_j \in \mathbf{R}, j = 1, 2, \cdots, m \}$

称为由 $\mathbf{a}_1, \mathbf{a}_2, \cdots, \mathbf{a}_m$ 生成的向量空间, 记为 $L(\mathbf{a}_1, \mathbf{a}_2, \cdots, \mathbf{a}_m)$ 或 $\text{span}(\mathbf{a}_1, \mathbf{a}_2, \cdots, \mathbf{a}_m)$.

例 (1) $\mathbf{\varepsilon}_1 = (1, 0, 0), \mathbf{\varepsilon}_2 = (0, 1, 0)$, 则由 $\mathbf{\varepsilon}_1, \mathbf{\varepsilon}_2$ 生成的向量空间为 $L(\mathbf{\varepsilon}_1, \mathbf{\varepsilon}_2) = \{ \mathbf{x} = (k_1, k_2, 0) \mid k_1, k_2 \in \mathbf{R} \}$
此为 $Oxyz$ 中的 xoy 平面上的向量全体.



(2) 设 $\alpha_1, \alpha_2 \in \mathbf{R}^3$, 且线性无关, $L(\alpha_1, \alpha_2)$ 为由原点 O , α_1, α_2 决定的平面.



(3) 设 $\alpha \in \mathbf{R}^3$ 且 $\alpha \neq 0$, $L(\alpha)$ 为过原点 O , 方向为 α 的直线.

(4) $\mathbf{R}^3 = L(\varepsilon_1, \varepsilon_2, \varepsilon_3)$.

定义4.12 对两个 n 维向量集合 V_1 与 V_2 , 若

(1) $V_1 \subset V_2$,

(2) V_1, V_2 都是向量空间,

则称 V_1 是 V_2 的**子空间**.

例 (1) 设 $m < n, \alpha_i \in \mathbf{R}^n (i=1, 2, \dots, m)$, 则

$L(\alpha_1, \alpha_2, \dots, \alpha_m) \subset \mathbf{R}^n$ 是 \mathbf{R}^n 的子空间;

(2) $V_1 = \{(0, x_2, \dots, x_n) \mid x_j \in \mathbf{R}, j=2, \dots, n\} \subset \mathbf{R}^n$

是 \mathbf{R}^n 的子空间;

(3) 设 $\alpha_1, \alpha_2 \in \mathbf{R}^3$, 且 α_1, α_2 线性无关

$\Rightarrow L(\alpha_1)$ 是 $L(\alpha_1, \alpha_2)$ 的子空间,

$L(\alpha_1, \alpha_2)$ 是 \mathbf{R}^3 的子空间.

命题 (例4.11)

设向量组 $\alpha_1, \alpha_2, \dots, \alpha_m$ 和向量组 $\beta_1, \beta_2, \dots, \beta_s$ 等价.

若 $V_1 \triangleq L(\alpha_1, \alpha_2, \dots, \alpha_m), \quad V_2 \triangleq L(\beta_1, \beta_2, \dots, \beta_s)$

则 $V_1 = V_2$

即：等价向量组生成相同的向量空间.

证明 欲证, 对 $\forall \alpha \in V_1$, 有 $\alpha \in V_2$.

$\because \alpha \in V_1, \therefore \alpha$ 可由 $\alpha_1, \alpha_2, \dots, \alpha_m$ 线性表示.

又 $\alpha_1, \alpha_2, \dots, \alpha_m$ 可由 $\beta_1, \beta_2, \dots, \beta_s$ 线性表示,

$\therefore \alpha$ 可由 $\beta_1, \beta_2, \dots, \beta_s$ 线性表示 $\Rightarrow \alpha \in V_2 \Rightarrow V_1 \subset V_2$.

同理可证 $V_2 \subset V_1. \quad \therefore V_1 = V_2.$

证毕

有必要寻求 $L(\alpha_1, \alpha_2, \dots, \alpha_m)$ 的**最小生成**:

即在 $\alpha_1, \alpha_2, \dots, \alpha_m$ 中, 生成 L 的最少向量.

根据向量组与极大无关组等价 \Rightarrow

推论 设向量组 $\alpha_1, \alpha_2, \dots, \alpha_m$ 的一个极大无关组为

$$\alpha_{i_1}, \alpha_{i_2}, \dots, \alpha_{i_r}, r \geq 1$$

则 $L(\alpha_1, \alpha_2, \dots, \alpha_m) = L(\alpha_{i_1}, \alpha_{i_2}, \dots, \alpha_{i_r})$

即 $L(\alpha_1, \alpha_2, \dots, \alpha_m)$ 可由 $\alpha_1, \alpha_2, \dots, \alpha_m$ 的任一个极大无关组生成.

问题: 对向量空间, 可否寻求其最少生成?

需引出如下“基”概念。

2. 向量空间的基

定义4.13 设 V 为向量空间, 若

(1) V 中有 r 个向量 $\alpha_1, \alpha_2, \dots, \alpha_r$ 线性无关,

且(2) V 中任一向量 α 都可由 $\alpha_1, \alpha_2, \dots, \alpha_r$ 线性表示;

则称 $\alpha_1, \alpha_2, \dots, \alpha_r$ 是 V 的一个**基**, 称 r 是 V 的**维数**,

记作 $\dim V = r$.

规定： 只含零向量的向量空间 V ， $\dim V=0$.

注意： 向量空间的维数与向量的维数是两个不同的概念

向量空间维数： 其基所含的向量个数；

向量维数： 此向量所含的坐标个数；

确定 V 的基的一般方法：先通过观察找出 V 的一组向量，并证明其线性无关，再验证 V 中任一向量都可由该向量组线性表示，这组向量即为 V 的一组基。

例

(1) 向量空间 \mathbf{R}^n , 取

$$\boldsymbol{\varepsilon}_1 = (1, 0, 0, \dots, 0), \quad \boldsymbol{\varepsilon}_2 = (0, 1, 0, \dots, 0), \dots, \boldsymbol{\varepsilon}_n = (0, 0, \dots, 0, 1)$$

$$\therefore \begin{cases} \textcircled{1} \quad \boldsymbol{\varepsilon}_1, \boldsymbol{\varepsilon}_2, \dots, \boldsymbol{\varepsilon}_n \in \mathbf{R}^n \text{ 线性无关} \\ \textcircled{2} \quad \forall \mathbf{x} = (x_1, x_2, \dots, x_n) \in \mathbf{R}^n \Rightarrow \mathbf{x} = x_1 \boldsymbol{\varepsilon}_1 + x_2 \boldsymbol{\varepsilon}_2 + \dots + x_n \boldsymbol{\varepsilon}_n \end{cases}$$

$\therefore \boldsymbol{\varepsilon}_1, \boldsymbol{\varepsilon}_2, \dots, \boldsymbol{\varepsilon}_n$ 是 \mathbf{R}^n 的基, 且 $\dim \mathbf{R}^n = n$

称 \mathbf{R}^n 为 n 维向量空间。

(2) 向量空间 $V_1 = \{ \mathbf{x} = (0, x_2, x_3) \mid x_2, x_3 \in \mathbf{R} \}$

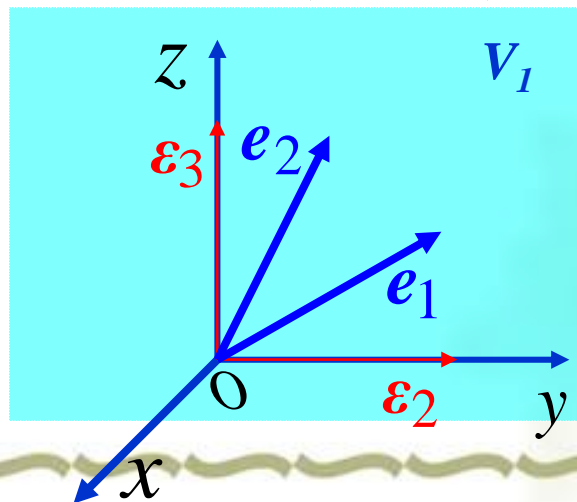
基 (I): $\varepsilon_2 = (0, 1, 0), \varepsilon_3 = (0, 0, 1)$

$\therefore \begin{cases} \varepsilon_2, \varepsilon_3 \text{ 线性无关} \\ \forall \mathbf{x} \in V_1, \text{ 有 } \mathbf{x} = x_2 \varepsilon_2 + x_3 \varepsilon_3 \end{cases}$

$\therefore \dim V_1 = 2, V_1 \text{ 是 } yoz \text{ 平面.}$

基 (II): $e_1 = (0, 1, 0.5), e_2 = (0, 0.5, 1)$

$\begin{cases} e_1, e_2 \text{ 线性无关} \\ \forall \mathbf{x} = (0, x_2, x_3), \\ \text{有 } \mathbf{x} = \left(\frac{4}{3} x_2 - \frac{2}{3} x_3 \right) e_1 + \left(-\frac{2}{3} x_2 + \frac{4}{3} x_3 \right) e_2 \end{cases}$



命题 设 V 是由 n 维向量构成的 r 维向量空间, 则

1. V 的任意 $r+1$ 个向量必定线性相关.

证明 设 $\alpha_1, \alpha_2, \dots, \alpha_r$ 是 V 的一个基,

则对任意 $\beta_1, \beta_2, \dots, \beta_{r+1} \in V$,

\therefore 每个 β_j 可由 $\alpha_1, \alpha_2, \dots, \alpha_r$ 线性表示

\therefore 向量组 $\beta_1, \beta_2, \dots, \beta_{r+1}$ 的秩 \leq 向量组 $\alpha_1, \alpha_2, \dots, \alpha_r$ 的秩 $=r$.

$\therefore \beta_1, \beta_2, \dots, \beta_{r+1}$ 线性相关.

证毕

2. V 的基 $\alpha_1, \alpha_2, \dots, \alpha_r$ 是向量组 V 的一个极大无关组, 从而 $\dim V = r$.

证明 \because 基向量 $\alpha_1, \alpha_2, \dots, \alpha_r$ 线性无关,

由命题1, V 中 $r+1$ 个向量线性相关,

\therefore 由极大无关组定义, $\alpha_1, \alpha_2, \dots, \alpha_r$ 是 V 的一个极大无关组.

3. V 中任意 r 个线性无关向量都可作为 V 的一个基.

证明 设 $\beta_1, \beta_2, \dots, \beta_r$ 是 V 中任一组线性无关向量,

由命题1, 对 $\forall \alpha \in V, \alpha, \beta_1, \beta_2, \dots, \beta_r$ 线性相关,

$\therefore \alpha$ 可由 $\beta_1, \beta_2, \dots, \beta_r$ 线性表示 $\Rightarrow \beta_1, \beta_2, \dots, \beta_r$ 是 V 的基.

证毕

4. (例4.12) V 可由基 $\alpha_1, \alpha_2, \dots, \alpha_r$ 所生成, 即
 $V = L(\alpha_1, \alpha_2, \dots, \alpha_r)$.

证明 $\because \alpha_1, \alpha_2, \dots, \alpha_r$ 是 V 的基,

$\therefore \forall \alpha \in V, \exists$ 数 l_1, l_2, \dots, l_r , 使

$$\alpha = l_1 \alpha_1 + l_2 \alpha_2 + \dots + l_r \alpha_r,$$

$\therefore \alpha \in L(\alpha_1, \alpha_2, \dots, \alpha_r) \Rightarrow V \subset L(\alpha_1, \alpha_2, \dots, \alpha_r)$.

反之, 对 $\forall \alpha \in L(\alpha_1, \alpha_2, \dots, \alpha_r)$, \exists 数 l_1, l_2, \dots, l_r , 使
 $\alpha = k_1 \alpha_1 + k_2 \alpha_2 + \dots + k_r \alpha_r$, 而 $\alpha_1, \alpha_2, \dots, \alpha_r$ 是 V 的基,
 $\therefore \alpha \in V \Rightarrow L(\alpha_1, \alpha_2, \dots, \alpha_r) \subset V$.

故 $V = L(\alpha_1, \alpha_2, \dots, \alpha_r)$

证毕

5. $\dim V \leq n$;

证明 $\because V$ 中任意 $n+1$ 向量线性相关,

$\therefore V$ 秩 $\leq n \Rightarrow \dim V \leq n$.

证毕

6. 当 V_1 是 V_2 子空间时, $\dim V_1 \leq \dim V_2$.

证明 设 $\dim V_1 = r_1, \dim V_2 = r_2$, 且

V_1 基: $\alpha_1, \alpha_2, \dots, \alpha_{r_1}$; V_2 基: $\beta_1, \beta_2, \dots, \beta_{r_2}$

$\therefore \alpha_j \in V_1 \subset V_2, \alpha_j$ 可由组 $\beta_1, \beta_2, \dots, \beta_{r_2}$ 线性表示, ($j=1, 2, \dots, r_1$)

\Rightarrow 秩 $r_1 \leq$ 秩 r_2 , 即 $\dim V_1 \leq \dim V_2$.

证毕

3. 向量坐标

定义4.14 设向量空间 V , $\alpha_1, \alpha_2, \dots, \alpha_r$ 是基, 则对 $\alpha \in V$, 必有 $\alpha = x_1\alpha_1 + x_2\alpha_2 + \dots + x_r\alpha_r$, $(x_1, x_2, \dots, x_r \in \mathbf{R})$ 称有序数组 (x_1, x_2, \dots, x_r) 为 α 在基 $\alpha_1, \dots, \alpha_r$ 下的**坐标**。

注: 坐标通常记做列向量, 即 $\alpha = (\alpha_1, \alpha_2, \dots, \alpha_r) \begin{pmatrix} x_1 \\ x_2 \\ \vdots \\ x_r \end{pmatrix}$

例4.13 在向量空间 \mathbf{R}^3 中, 给定两组基:

基 I : $\varepsilon_1 = (1, 0, 0)$, $\varepsilon_2 = (0, 1, 0)$, $\varepsilon_3 = (0, 0, 1)$

基 II : $\alpha_1 = (1, 1, 1)$, $\alpha_2 = (1, 1, -1)$, $\alpha_3 = (1, -1, -1)$

求 $\alpha = (1, 2, 1)$ 分别在这两个基下的坐标。

解 (1) $\because (1, 2, 1) = \alpha = 1 \cdot \varepsilon_1 + 2 \cdot \varepsilon_2 + 1 \cdot \varepsilon_3$

$\therefore \alpha$ 在基 (I) 下的坐标为 $(1, 2, 1)$.

$$(2) \text{ 设 } \alpha = x_1\alpha_1 + x_2\alpha_2 + x_3\alpha_3 \\ = x_1(1,1,1) + x_2(1,1,-1) + x_3(1,-1,-1)$$

$$\Leftrightarrow \begin{cases} x_1 + x_2 + x_3 = 1 \\ x_1 + x_2 - x_3 = 2 \\ x_1 - x_2 - x_3 = 1 \end{cases} \Leftrightarrow \begin{cases} x_1 = 1 \\ x_2 = \frac{1}{2} \\ x_3 = -\frac{1}{2} \end{cases}$$

$\therefore \alpha$ 在基(II)下的坐标为 $(1, \frac{1}{2}, -\frac{1}{2})$

注1: 同一向量在不同基下的坐标一般不相同。

注2: 向量的分量和其在某组基下的坐标一般不相同。

注3: $\because \forall \alpha \in V$, 关于基 $\alpha_1, \alpha_2, \dots, \alpha_r$ 的线性表示

$x_1\alpha_1 + x_2\alpha_2 + \dots + x_r\alpha_r$ 是唯一的,

\therefore 坐标 (线性表示的系数) x_1, x_2, \dots, x_r 是唯一的,

$\therefore V$ 中向量 $\alpha \xleftrightarrow{\text{一一对应}} (x_1, x_2, \dots, x_r)$

二、正交基

1. 正交基概念

定义4.15 设向量空间 V 中的一个基 $\alpha_1, \alpha_2, \dots, \alpha_r$ 满足条件

$$[\alpha_i, \alpha_j] = 0, \quad (i \neq j, \quad i, j = 1, 2, \dots, r)$$

即 $\alpha_1, \alpha_2, \dots, \alpha_r$ 两两正交, 则称 $\alpha_1, \alpha_2, \dots, \alpha_r$ 是 V 的**正交基**.

进而, 若 $\|\alpha_i\| = 1 (i = 1, \dots, r)$, 则称 $\alpha_1, \alpha_2, \dots, \alpha_r$

是**标准正交基**.

简言之,

正交基 \Leftrightarrow 基中向量两两正交.

标准正交基 \Leftrightarrow 正交基中每个向量都是单位向量.

注意: 两两正交的非零向量组, 必定线性无关.

例

(1) \mathbf{R}^n 中, $\varepsilon_1, \varepsilon_2, \dots, \varepsilon_n$ 是标准正交基.

(2) $V = \{(0, x_2, x_3) \mid x_2, x_3 \in \mathbf{R}\}$

$$\alpha_1 = (0, \frac{1}{\sqrt{2}}, \frac{1}{\sqrt{2}}), \quad \alpha_2 = (0, \frac{1}{\sqrt{2}}, -\frac{1}{\sqrt{2}})$$

$$\Rightarrow [\alpha_1, \alpha_2] = 0, \quad \|\alpha_1\| = \|\alpha_2\| = 1,$$

$\therefore \alpha_1, \alpha_2$ 是 V 的标准正交基.

分析: 设向量空间 V .

(1) 正交基 $\alpha_1, \alpha_2, \dots, \alpha_r$,

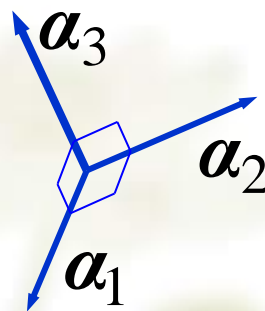
$\forall \alpha \in V$, 有 $\alpha = x_1 \alpha_1 + x_2 \alpha_2 + \dots + x_r \alpha_r$,

两边与 α_i 作内积 $\Rightarrow [\alpha, \alpha_i] = x_i [\alpha_i, \alpha_i]$

$$\Rightarrow x_i = \frac{[\alpha, \alpha_i]}{[\alpha_i, \alpha_i]} = \frac{[\alpha, \alpha_i]}{\|\alpha_i\|^2},$$

$(i=1, 2, \dots, r)$

形式简单!

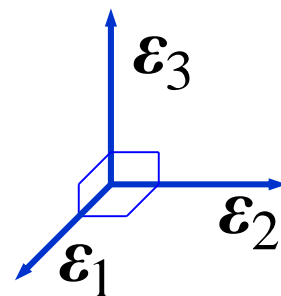


(2) 标准正交基 $\alpha_1, \alpha_2, \dots, \alpha_r$

$$\Rightarrow x_i = [\alpha, \alpha_i],$$

$$= \|\alpha_i\| \cdot \|\alpha\| \cos \langle \alpha_i, \alpha \rangle$$

$(i=1, 2, \dots, r)$ 形式更简单!



问题: 如何根据
向量空间的已知基,
求正交基,
或单位正交基?

3. 正交化方法 (施密特方法)

目的：由已知 V 的一个基 $\alpha_1, \alpha_2, \dots, \alpha_r$,
构造 V 的正交基 $\beta_1, \beta_2, \dots, \beta_r$.

(1) 令 $\beta_1 = \alpha_1$;

(2) 令 $\beta_2 = \alpha_2 + k_{21}\beta_1$, 使 $[\beta_2, \beta_1] = 0$

$$\Rightarrow k_{21} = -\frac{[\alpha_2, \beta_1]}{[\beta_1, \beta_1]}, \quad \text{即 } \beta_2 = \alpha_2 - \frac{[\alpha_2, \beta_1]}{[\beta_1, \beta_1]} \beta_1$$

$\Rightarrow \beta_2 \neq 0$ (否则 α_1, α_2 线性相关)

(3) 令 $\beta_3 = \alpha_3 + k_{32}\beta_2 + k_{31}\beta_1$, 使 $[\beta_3, \beta_2] = 0$, $[\beta_3, \beta_1] = 0$

$$\Rightarrow k_{32} = -\frac{[\alpha_3, \beta_2]}{[\beta_2, \beta_2]}, \quad k_{31} = -\frac{[\alpha_3, \beta_1]}{[\beta_1, \beta_1]}$$

$$\text{即 } \beta_3 = \alpha_3 - \frac{[\alpha_3, \beta_2]}{[\beta_2, \beta_2]} \beta_2 - \frac{[\alpha_3, \beta_1]}{[\beta_1, \beta_1]} \beta_1$$

$\Rightarrow \beta_3 \neq 0$ (否则 $\alpha_1, \alpha_2, \alpha_3$ 线性相关)

(4)最后令 $\beta_r = \alpha_r + k_{r,r-1}\beta_{r-1} + \cdots + k_{r,1}\beta_1$,

使 $[\beta_r, \beta_j] = 0, (j=1, \cdots, r-1)$

$$\Rightarrow k_{rj} = -\frac{[\alpha_r, \beta_j]}{[\beta_j, \beta_j]}, \quad (j=1, \cdots, r-1) \quad \Rightarrow \beta_r \neq 0$$

由上述正交化步骤 \Rightarrow

1°. $\beta_1, \beta_2, \cdots, \beta_r$, 两两正交, 非零向量 (\Rightarrow 线性无关);

2°. $\beta_1, \beta_2, \cdots, \beta_r$ 与 $\alpha_1, \alpha_2, \cdots, \alpha_r$ 等价 (可互相线性表示),

从而 $\beta_1, \beta_2, \cdots, \beta_r$ 是 V 的一个正交基;

3°. 进一步令 $\gamma_i = \frac{\beta_i}{\|\beta_i\|}, (i=1, 2, \cdots, r),$

从而 $\gamma_1, \gamma_2, \cdots, \gamma_r$ 是 V 的一个标准正交基。

例4.14 设 $\alpha_1 = (1, 1, 0, 0)$, $\alpha_2 = (1, 0, 1, 0)$, $\alpha_3 = (-1, 0, 0, 1)$

求 $V = L(\alpha_1, \alpha_2, \alpha_3)$ 的

- (1) 一个正交基,
- (2) 一个标准正交基.

解 先证明 $\alpha_1, \alpha_2, \alpha_3$ 为 V 的一个基.

$$(1) \text{ 令 } \beta_1 = \alpha_1 = (1, 1, 0, 0), \quad \therefore [\beta_1, \beta_1] = 2$$

$$\beta_2 = \alpha_2 - \frac{[\alpha_2, \beta_1]}{[\beta_1, \beta_1]} \beta_1 = \alpha_2 - \frac{1}{2} \beta_1 = \left(\frac{1}{2}, -\frac{1}{2}, 1, 0 \right),$$

$$\therefore [\beta_2, \beta_2] = \frac{3}{2}$$

$$\begin{aligned}\beta_3 &= \alpha_3 - \frac{[\alpha_3, \beta_2]}{[\beta_2, \beta_2]} \beta_2 - \frac{[\alpha_3, \beta_1]}{[\beta_1, \beta_1]} \beta_1 \\ &= \alpha_3 + \frac{1}{3} \beta_2 + \frac{1}{2} \beta_1 = \left(-\frac{1}{3}, \frac{1}{3}, \frac{1}{3}, 1\right) \quad \therefore [\beta_3 \ \beta_3] = \frac{4}{3}\end{aligned}$$

此 $\beta_1, \beta_2, \beta_3$ 为所求正交基.

$$(2) \ \gamma_1 = \frac{\beta_1}{\|\beta_1\|} = \left(\frac{1}{\sqrt{2}}, \frac{1}{\sqrt{2}}, 0, 0\right)$$

$$\gamma_2 = \frac{\beta_2}{\|\beta_2\|} = \left(\frac{1}{\sqrt{6}}, -\frac{1}{\sqrt{6}}, \frac{2}{\sqrt{6}}, 0\right)$$

$$\gamma_3 = \frac{\beta_3}{\|\beta_3\|} = \left(-\frac{1}{2\sqrt{3}}, \frac{1}{2\sqrt{3}}, \frac{1}{2\sqrt{3}}, \frac{\sqrt{3}}{2}\right)$$

注意验证!

此 $\gamma_1, \gamma_2, \gamma_3$ 为所求的标准正交基.

三、基变换与坐标变换

总结：对向量空间 V ：

- (1) 基不唯一，但各个基所含线性无关的向量组个数相同；
- (2) 不同基等价，即可互相线性表示；
- (3) 同一个向量，在不同基下坐标不同。

问题：(1) 两个不同基之间的关系，即互相表示方法(基变换公式)；

(2) 同一个向量在不同基下，坐标之间的关系，即互相表示方法(坐标变换公式)。

1. 基变换与过渡矩阵

设 r 维向量空间 V 的两个基为

(I): $\alpha_1, \alpha_2, \dots, \alpha_r$; (II): $\beta_1, \beta_2, \dots, \beta_r$;

(1) 基(II)可以由基(I)表示, 或用基(I)表示基(II):

设
$$\begin{cases} \beta_1 = c_{11}\alpha_1 + c_{21}\alpha_2 + \dots + c_{r1}\alpha_r \\ \beta_2 = c_{12}\alpha_1 + c_{22}\alpha_2 + \dots + c_{r2}\alpha_r \\ \vdots \\ \beta_r = c_{1r}\alpha_1 + c_{2r}\alpha_2 + \dots + c_{rr}\alpha_r \end{cases}$$
 从基(I)到基(II)的
基变换公式

矩阵

$$C = (c_{ij})_{r \times r} = \begin{pmatrix} c_{11} & c_{12} & \cdots & c_{1r} \\ c_{21} & c_{22} & \cdots & c_{2r} \\ \vdots & \vdots & \ddots & \vdots \\ c_{r1} & c_{r2} & \cdots & c_{rr} \end{pmatrix}$$
 从基(I)到基(II)的
过渡矩阵

\therefore 基变换公式的矩阵形式:

$$(\beta_1, \beta_2, \dots, \beta_r) = (\alpha_1, \alpha_2, \dots, \alpha_r)C$$

注意：上式中各向量 α_i, β_i 都看作单个量，其分量还不能代入运算，是形式上的矩阵相乘

$$(\beta_1, \beta_2, \dots, \beta_r) = (\alpha_1, \alpha_2, \dots, \alpha_r) \begin{pmatrix} c_{11} & c_{12} & \cdots & c_{1r} \\ c_{21} & c_{22} & \cdots & c_{2r} \\ \vdots & \vdots & \ddots & \vdots \\ c_{r1} & c_{r2} & \cdots & c_{rr} \end{pmatrix}$$

或

$$\begin{pmatrix} \beta_1 \\ \beta_2 \\ \vdots \\ \beta_r \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} c_{11} & c_{21} & \cdots & c_{r1} \\ c_{12} & c_{22} & \cdots & c_{r2} \\ \vdots & \vdots & \ddots & \vdots \\ c_{1r} & c_{2r} & \cdots & c_{rr} \end{pmatrix} \begin{pmatrix} \alpha_1 \\ \alpha_2 \\ \vdots \\ \alpha_r \end{pmatrix}$$

(2) **定理4.10:** 过渡矩阵 C 是可逆的。

证明 (反证法) 假设 $\det C = 0$.

\therefore 齐次线性方程组 $Cx = 0$ ($x = (x_1, x_2, \dots, x_r)^T$)
必有非零解。设此非零解为 $k = (k_1, k_2, \dots, k_r)^T$,
即有 $Ck = 0$. 考察线性组合

$$\begin{aligned} k_1\beta_1 + k_2\beta_2 + \dots + k_r\beta_r &= (\beta_1, \beta_2, \dots, \beta_r)k \\ &= (\alpha_1, \alpha_2, \dots, \alpha_r)Ck = 0 \end{aligned}$$

与 $\beta_1, \beta_2, \dots, \beta_r$ 线性无关矛盾.

$\therefore \det C \neq 0$, 即 C 可逆。

证毕

(3) 由基 (II) 到基 (I) 的基变换公式

$$\begin{aligned} (\alpha_1, \alpha_2, \dots, \alpha_r) &= (\beta_1, \beta_2, \dots, \beta_r)C^{-1} \\ \Leftrightarrow (\beta_1, \beta_2, \dots, \beta_r) &= (\alpha_1, \alpha_2, \dots, \alpha_r)C \end{aligned}$$

2. 坐标变换公式

设 V 中向量 α , 在基 (I) 下坐标为 (x_1, x_2, \dots, x_r)
在基 (II) 下坐标为 (y_1, y_2, \dots, y_r)

$$\begin{aligned}\Rightarrow \alpha &= x_1 \alpha_1 + x_2 \alpha_2 + \cdots + x_r \alpha_r = (\alpha_1, \alpha_2, \cdots, \alpha_r) \begin{pmatrix} x_1 \\ x_2 \\ \vdots \\ x_r \end{pmatrix} \\ \alpha &= y_1 \beta_1 + y_2 \beta_2 + \cdots + y_r \beta_r = (\beta_1, \beta_2, \cdots, \beta_r) \begin{pmatrix} y_1 \\ y_2 \\ \vdots \\ y_r \end{pmatrix} \\ &= (\alpha_1, \alpha_2, \cdots, \alpha_r) C \begin{pmatrix} y_1 \\ y_2 \\ \vdots \\ y_r \end{pmatrix}\end{aligned}$$

由 α 在基 (I) 下表示唯一性 \Rightarrow 坐标变换公式

$$\begin{array}{ccc} \begin{pmatrix} x_1 \\ x_2 \\ \vdots \\ x_r \end{pmatrix} = \mathbf{C} \begin{pmatrix} y_1 \\ y_2 \\ \vdots \\ y_r \end{pmatrix} & \Leftrightarrow & \begin{pmatrix} y_1 \\ y_2 \\ \vdots \\ y_r \end{pmatrix} = \mathbf{C}^{-1} \begin{pmatrix} x_1 \\ x_2 \\ \vdots \\ x_r \end{pmatrix} \\ \text{(I)} & & \begin{matrix} \text{(II)} & \text{(I)} \end{matrix} \end{array}$$

例4 (2005.5 五 10分)

已知三维向量空间 \mathbf{R}^3 的两个基

$$(I) \begin{cases} \alpha_1 = (1, 1, 1) \\ \alpha_2 = (1, 0, -1) \\ \alpha_3 = (1, 0, 1) \end{cases} \quad (II) \begin{cases} \beta_1 = (-1, -2, -1) \\ \beta_2 = (-2, -3, -4) \\ \beta_3 = (-3, -4, -3) \end{cases}$$

(1) 求由基(I)到基(II)的过渡矩阵;

(2) 求在两个基下有相同坐标的全部向量 α .

解

(1) 引入“中介基”: 基本坐标向量 $\varepsilon_1, \varepsilon_2, \varepsilon_3$

$$\begin{cases} \alpha_1 = (1, 1, 1) = 1 \cdot \varepsilon_1 + 1 \cdot \varepsilon_2 + 1 \cdot \varepsilon_3 \\ \alpha_2 = (1, 0, -1) = 1 \cdot \varepsilon_1 + 0 \cdot \varepsilon_2 + (-1) \cdot \varepsilon_3 \\ \alpha_3 = (1, 0, 1) = 1 \cdot \varepsilon_1 + 0 \cdot \varepsilon_2 + 1 \cdot \varepsilon_3 \end{cases}$$

$$\therefore (\alpha_1, \alpha_2, \alpha_3) = (\varepsilon_1, \varepsilon_2, \varepsilon_3) \begin{pmatrix} 1 & 1 & 1 \\ 1 & 0 & 0 \\ 1 & -1 & 1 \end{pmatrix} = (\varepsilon_1, \varepsilon_2, \varepsilon_3) \underbrace{(\alpha_1^T \ \alpha_2^T \ \alpha_3^T)}_A$$

$$\text{同理 } (\beta_1, \beta_2, \beta_3) = (\varepsilon_1, \varepsilon_2, \varepsilon_3) \underbrace{(\beta_1^T, \beta_2^T, \beta_3^T)}_B$$

$$\begin{aligned} \therefore (\alpha_1, \alpha_2, \alpha_3) &= (\varepsilon_1, \varepsilon_2, \varepsilon_3) A \\ \Rightarrow (\varepsilon_1, \varepsilon_2, \varepsilon_3) &= (\alpha_1, \alpha_2, \alpha_3) A^{-1} \end{aligned}$$

$$\begin{aligned} \text{代入 } (\beta_1, \beta_2, \beta_3) &= (\varepsilon_1, \varepsilon_2, \varepsilon_3) B \\ &= (\alpha_1, \alpha_2, \alpha_3) A^{-1} B \end{aligned}$$

所以基(I)到基(II)的过渡矩阵为 $C = A^{-1}B$

又因为

$$\begin{pmatrix} 1 & 1 & 1 & | & -1 & -2 & -3 \\ 1 & 0 & 0 & | & -2 & -3 & -4 \\ 1 & -1 & 1 & | & -1 & -4 & -3 \end{pmatrix} \rightarrow \begin{pmatrix} 1 & 0 & 0 & | & -2 & -3 & -4 \\ 0 & 1 & 0 & | & 0 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 1 & | & 1 & 0 & 1 \end{pmatrix}$$

$\begin{matrix} \parallel & \parallel & \parallel & \parallel \\ \mathbf{A} & \mathbf{B} & \mathbf{E} & \mathbf{A}^{-1}\mathbf{B} \end{matrix}$

所以基(I)到基(II)的过渡矩阵为 $\mathbf{C} = \begin{pmatrix} -2 & -3 & -4 \\ 0 & 1 & 0 \\ 1 & 0 & 1 \end{pmatrix}$

(2) 设向量 α 在基(I)和基(II)下的坐标均为 $(x_1, x_2, x_3)^T$

$$\begin{aligned} \text{则有 } \alpha &= (\alpha_1, \alpha_2, \alpha_3) \begin{pmatrix} x_1 \\ x_2 \\ x_3 \end{pmatrix} = (\beta_1, \beta_2, \beta_3) \begin{pmatrix} x_1 \\ x_2 \\ x_3 \end{pmatrix} \\ &= (\alpha_1, \alpha_2, \alpha_3) \mathbf{C} \begin{pmatrix} x_1 \\ x_2 \\ x_3 \end{pmatrix} \end{aligned}$$

所以有 $\begin{pmatrix} x_1 \\ x_2 \\ x_3 \end{pmatrix} = \mathbf{C} \begin{pmatrix} x_1 \\ x_2 \\ x_3 \end{pmatrix}$, 即 $(\mathbf{C} - \mathbf{E}) \begin{pmatrix} x_1 \\ x_2 \\ x_3 \end{pmatrix} = \mathbf{0}$

由于 $\mathbf{C} - \mathbf{E} = \begin{pmatrix} -3 & -3 & -4 \\ 0 & 0 & 0 \\ 1 & 0 & 0 \end{pmatrix} \rightarrow \begin{pmatrix} 1 & 0 & 0 \\ 0 & 3 & 4 \\ 0 & 0 & 0 \end{pmatrix}$

同解方程组为 $\begin{cases} x_1 = 0 \\ 3x_2 + 4x_3 = 0 \end{cases}$ 通解为 $\begin{cases} x_1 = 0 \\ x_2 = k \\ x_3 = -\frac{3}{4}k \end{cases}$

所以在基(I)和基(II)下有相同坐标的非零向量为

$$\alpha = 0 \cdot \alpha_1 + k \cdot \alpha_2 - \frac{3}{4}k \alpha_3 = \left(\frac{1}{4}k, 0, -\frac{7}{4}k \right) \quad (k \neq 0)$$

例5 (2009年 数一 4分)

设 $\alpha_1, \alpha_2, \alpha_3$ 是三维向量空间 R^3 的一组基, 则由基

$\alpha_1, \frac{1}{2}\alpha_2, \frac{1}{3}\alpha_3$ 到基 $\alpha_1 + \alpha_2, \alpha_2 + \alpha_3, \alpha_3 + \alpha_1$ 的过渡矩阵
为 ()