

1. 笛卡尔积

1.1. 定义

设 S, M 是两个集合, 则从 S, M 分别取一个元素, 组成的集合称为 S, M 的笛卡尔积, 记作 $S \times M$, 数学上的表示为:

$$S \times M = \{(a, b) \mid a \in S, b \in M\} \quad (1)$$

如果 $S \times M$ 中的两个元素 $(a_1, b_1), (a_2, b_2)$ 满足 $a_1 = b_1, a_2 = b_2$, 则称两者相等。

笛卡尔积最直接的例子是直角坐标系, 我们从 x, y 轴上分别取值构成的有序数对 (x_0, y_0) 就是一个坐标, 其刻画了一个平面的点的位置。

1.2. 二元关系

设 S 是一个非空集合, 如果有一个 W 是 $S \times S$ 的非空子集, 则称 W 是 S 上的一个二元关系。如果 $a, b \in S; (a, b) \in W$, 则称 a, b 具有 W 关系, 记作 aWb 或者 $a \sim b$ 。如果 $a, b \in S; (a, b) \notin W$, 则称 a, b 没有 W 关系

1.3. 等价关系

如果 S 上的一个关系满足以下性质

1.3.1. 反身性 $a \sim a$

1.3.2. 对称性 $a \sim b \Rightarrow b \sim a$

1.3.3. 传递性 $a \sim b, b \sim c \Rightarrow a \sim c$

那么这样的关系称作等价关系

1.4. 等价类

设 \sim 是 S 上的一个等价关系, 那么, 令:

$$a \in S, \bar{a} \triangleq \{x \in S \mid x \sim a\} \quad (2)$$

称 \bar{a} 是 S 上由 a 确定的等价类, 由定义可知, \bar{a} 是一个集合

1.4.1. 性质 1. $a \in \bar{a}$

1.4.2. 性质 2. $x \in \bar{a} \Leftrightarrow x \sim a$

1.4.3. 性质 3. $\bar{x} = \bar{y} \Leftrightarrow x \sim y$

证明:

1. 必要性: 因为 $\bar{x} = \bar{y} \Rightarrow x \in \bar{x} \Rightarrow x \in \bar{y} \Rightarrow x \sim y$ (性质 1. 性质 2.)

2. 充分性: 设 $\forall c \in \bar{x} \Rightarrow c \sim x; x \sim y \Rightarrow c \sim y \Rightarrow c \in \bar{y} \Rightarrow \bar{x} \subseteq \bar{y}$, 同理从 \bar{y} 任取元素可得 $\bar{y} \subseteq \bar{x}$ 结合两者可得 $\bar{x} = \bar{y}$

1.4.4. 定理 设 \sim 是 S 上的一个等价关系, 则任取 $a, b \in S$, 有 $\bar{a} = \bar{b}$ 或者 $\bar{a} \cap \bar{b} = \emptyset$

1. 先证明 $\bar{a} \neq \bar{b} \Rightarrow \bar{a} \cap \bar{b} = \emptyset$. 设 $c \in \bar{a} \cap \bar{b} \Rightarrow c \sim a, c \sim b \Rightarrow a \sim b \Rightarrow \bar{a} = \bar{b}$ 与假设矛盾, 因此其交集必为空集。同理, 当 $\bar{a} \cap \bar{b} \neq \emptyset$ 时, 存在上述的 c 使得结果成立, 从而必有 $\bar{a} = \bar{b}$

1.5. 定义 S 的划分

设有 I 个 S 的非空子集的并集 $\cup S_i, i \in I$, 并且满足 $S_i \cap S_j = \emptyset, i \neq j$, 则称 $\{S_i, i \in I\}$ 是 S 的一个划分, 记作 $\pi(S)$

1.5.1. 定理 设 \sim 是 S 上的一个等价关系, 则所有等价类组成的集合是 S 的一个划分, 记作 $\pi_{\sim}(S)$

证明:

$$\forall a \in S, a \in \bar{a} \Rightarrow S = \cup_{a \in S} \{\bar{a}\}, \text{ 又 } a_i, a_j \in S, a_i \neq a_j \Rightarrow \bar{a}_i \cap \bar{a}_j = \emptyset \Rightarrow \cup_{a \in S} \{\bar{a}\} \text{ 满足划分条件} \quad (3)$$

1.5.2. 商集

我们可以在整数集上定义这样的一个关系:

$$a \sim b \triangleq a \bmod 7 = b \bmod 7 \quad (4)$$

这个关系是否满足等价关系?

1. 反身: $a \bmod 7 = a \bmod 7$

2. 对称: $a \bmod 7 = b \bmod 7 \Leftrightarrow b \bmod 7 = a \bmod 7$

3. 传递: $a \bmod 7 = b \bmod 7, b \bmod 7 = c \bmod 7 \Leftrightarrow a \bmod 7 = c \bmod 7$ (mod 取得的是一个具体的数, 因此是满足传递性质的)

从而模 7 同余关系是一个等价关系, 易知 \mathbb{Z} 中有 7 个等价类 $\{0, 1, 2, 3, 4, 5, 6\}$. 由此引入商集概念:

设 \sim 是 S 上的一个等价关系, 由所有等价类组成的集合称为 S 对于 \sim 关系的商集, 记作 S/\sim 。注意商集是一个集合, 不是元素

2. 矩阵相抵

K 上的所有 $s \times n$ 的矩阵的集合记作 $M_{s \times n}$, 当 $s = n$ 时, 简记为 M_n , 表示 K 上所有 n 阶矩阵的集合。

2.1. 相抵定义:

$M_{s \times n}$ 上的矩阵 A 经过一系列初等行列变换得到 B , 则称 A, B 是相抵的, 记作 $A \sim B$. 相抵是 $M_{s \times n}$ 上的一个二元关系, 容易验证, 相抵满足等价关系的三条性质:

1. 反身: A 和自身相抵
2. 对称: A, B 相抵 等价于 B, A 相抵
3. 传递: A, B, C , 如果 $A \sim B, B \sim C \Rightarrow A \sim C$

相抵关系下, A 的等价类称为其相抵类

回忆: 矩阵的初等行变换等价于, 矩阵左乘以一系列初等矩阵 (矩阵被视作行向量组合); 矩阵的初等列变换等价于矩阵右乘以一系列初等矩阵 Q . 从而矩阵的相抵关系可以表达为:

$$B = (\Pi_k P_k) A (\Pi_k Q_k) = PAQ \quad (5)$$

式 5 中的 P, Q 均是可逆矩阵

2.2. 定理

设 $A \in M_{s \times n}, \text{rank}(A) = r$, 如果 $r > 0$, 则 A 相抵于矩阵: $\begin{pmatrix} I_r & 0 \\ 0 & 0 \end{pmatrix}$, 这个 $\begin{pmatrix} I_r & 0 \\ 0 & 0 \end{pmatrix}$ 矩阵称为 A 的相抵标准形。如果 $r = 0$, 那么 A 相抵于 0 矩阵。

证明:

1. 如果 $r > 0$, 那么矩阵 A 可以经过初等行变换为简化阶梯型 J , 但是 J 的列分布不一定是连续的, 我们可以通过初等列变换, 将主元的列分布控制位连续的, 其形式如下:

$$\begin{pmatrix} 1 & 0 & 0 & \dots & 0 & c_{1,r+1} & \dots & c_{1,n} \\ 0 & 1 & 0 & \dots & 0 & c_{2,r+1} & \dots & c_{2,n} \\ 0 & 0 & 1 & \dots & 0 & c_{3,r+1} & \dots & c_{3,n} \\ \dots & & & & & & & \\ 0 & 0 & 0 & \dots & 1 & c_{r,r+1} & \dots & c_{r,n} \\ 0 & 0 & 0 & \dots & 0 & 0 & \dots & 0 \\ \dots & & & & & & & \\ 0 & 0 & 0 & \dots & 0 & 0 & \dots & 0 \end{pmatrix} \quad (6)$$

这个矩阵的前 r 行, 可以通过初等列变换将后面的列全部消去 (如同矩阵初等行变换生成阶梯型一样), 从而最终就变成形如 $\begin{pmatrix} I_r & 0 \\ 0 & 0 \end{pmatrix}$ 的矩阵。这个变换过程只涉及初等行变换和列变换, 从而矩阵与之相抵

2.3. 定理 矩阵相抵判定定理

设 $A, B \in M_{s \times n}$, A, B 相抵的充要条件是 $\text{rank}(A) = \text{rank}(B)$ () 证明:

1. 必要性, 如果 A, B 相抵, 根据定义, 矩阵的初等行列变换不会改变矩阵的秩 (注意不是行列式), 从而 $\text{rank}(A) = \text{rank}(B)$
2. 充分性, 如果 $\text{rank}(A) = \text{rank}(B)$, 则它们的标准型相等, 再根据相抵的传递性可知, A, B 相抵。

根据该定理, 可以得知, 对于 $0 \leq r \leq \min(s, n)$, r 唯一决定了相抵类。这种称为相抵关系下的完全不变量。

2.4. 定义 不变量与完全不变量

设 \sim 是 S 上的一个等价关系, 一个量或者表达式对于等价类里的元素是相等的, 则称该量或表达式是该关系下的一个不变量。如果能恰好完全决定等价类的一组不变量则称为完全不变量

结合以上信息, 我们可以有以下推论:

$$A \in M_{s \times n}, \text{rank}(A) \neq 0 \Rightarrow A = P \begin{pmatrix} I_r & 0 \\ 0 & 0 \end{pmatrix} Q \quad (7)$$

3. 广义逆矩阵

如果 A 是一个可逆矩阵, 那么 $AXA = A$ 的一个解是 $X = A^{-1}$. 当 A 不可逆时, 这个方程是否有解呢?

3.1. 定理

设 $A \in M_{s \times n}, \text{rank}(A) = r > 0$, 则矩阵方程: $AXA = A$ 一定有解。设 $A = P \begin{pmatrix} I_r & 0 \\ 0 & 0 \end{pmatrix} Q$, P 是 s 阶矩阵, Q 是 n 阶矩阵。则该矩阵方程的解为: $X = Q^{-1} \begin{pmatrix} I_r & B \\ C & D \end{pmatrix} P^{-1}$. 其中 $B \in M_{r \times (s-r)}, C \in M_{(n-r) \times r}, D \in M_{(n-r) \times (s-r)}$, 矩阵 $\begin{pmatrix} I_r & B \\ C & D \end{pmatrix}$ 是一个 $n \times s$ 矩阵

证明:

$$\begin{aligned}
AXA &= P \begin{pmatrix} I_r & 0 \\ 0 & 0 \end{pmatrix} Q Q^{-1} \begin{pmatrix} I_r & B \\ C & D \end{pmatrix} P^{-1} A \\
&= P \begin{pmatrix} I_r & 0 \\ 0 & 0 \end{pmatrix} I_n \begin{pmatrix} I_r & B \\ C & D \end{pmatrix} P^{-1} A \\
&= P \begin{pmatrix} I_r & 0 \\ 0 & 0 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} I_r & B \\ C & D \end{pmatrix} P^{-1} A \\
&= P \begin{pmatrix} I_r & 0 \\ 0 & 0 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} I_r & B \\ C & D \end{pmatrix} \begin{pmatrix} I_r & 0 \\ 0 & 0 \end{pmatrix} Q
\end{aligned} \tag{8}$$

式 8 中的左侧矩阵 $\begin{pmatrix} I_r & 0 \\ 0 & 0 \end{pmatrix}$ 的列划分是 $(r, n-r)$, 右侧矩阵 $\begin{pmatrix} I_r & B \\ C & D \end{pmatrix}$ 的行划分是 $(r, n-r)$, 因此两者可以相乘(参考分块矩阵乘积, 证明比较复杂), 其结果为: $\begin{pmatrix} I_r & B \\ 0 & 0 \end{pmatrix}$, 从而: 式 8 就可写作:

$$P \begin{pmatrix} I_r & B \\ 0 & 0 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} I_r & 0 \\ 0 & 0 \end{pmatrix} Q = P \begin{pmatrix} I_r & 0 \\ 0 & 0 \end{pmatrix} Q = A \tag{9}$$

从而我们验证了这个定理, 上面的定理中对 BCD 除了形状之外, 没有特殊要求

3.2. 广义逆

设 $A \in M_{s \times n}$, 矩阵方程 $AXA = A$ 的每一个解都称为 A 的广义逆矩阵, 简称 A 的广义逆, 记作 A^- 根据定义显然 $AA^-A = A$. 同时根据上述定理, $rank(A) = r, A = P \begin{pmatrix} I_r & 0 \\ 0 & 0 \end{pmatrix} Q \Rightarrow X = Q^{-1} \begin{pmatrix} I_r & B \\ C & D \end{pmatrix} P^{-1} = A^-$, 可见 A^- 通常是一个集合

对于 $0_{s \times n}$ 任意 $B \in M_{n \times s} \Rightarrow 0B0 = 0_{s \times n} \Rightarrow B = 0^-$

3.3. 定理 非齐次线性方程组的相容性定理

非齐次线性方程组 $Ax = \beta$ 有解的充要条件是 $\beta = AA^-\beta$

证明:

1. 必要性: 设 b 是 $Ax = \beta$ 的解, 那么 $Ab = \beta \Rightarrow AA^-(Ab) = \beta$, 又 $Ab = \beta \Rightarrow \beta = AA^-\beta$
2. 充分性:

$$\beta = AA^-\beta = A(A^-\beta) \Rightarrow A[A^-\beta] = \beta \tag{10}$$

从而 $A^-\beta$ 是 $Ax = \beta$ 的一个解

3.4. 定理 非齐次线性方程组的解的结构定理

如果 $Ax = \beta$ 有解, 则其通解为

$$x = A^-\beta \tag{11}$$

证明: 设 γ 是一个解, 则 $A\gamma = \beta$. 那么有:

$$\begin{aligned}
P \begin{pmatrix} I_r & 0 \\ 0 & 0 \end{pmatrix} Q \gamma &= \beta \\
\begin{pmatrix} I_r & 0 \\ 0 & 0 \end{pmatrix} Q \gamma &= P^{-1} \beta
\end{aligned} \tag{12}$$

式 12 中, Q 是 n 阶可逆矩阵, γ 是一个 $n \times 1$ 的向量, 从而 $Q\gamma$ 是一个 $n \times 1$ 的矩阵 (向量), 将 $Q\gamma$ 写作 $Q\gamma = \begin{pmatrix} \gamma_{1r} \\ \gamma_{2n-r} \end{pmatrix}$. 同理 $P^{-1}\beta = \begin{pmatrix} \beta_{1r} \\ \beta_{2n-r} \end{pmatrix}$ 从而式 12 可以写作:

$$\begin{pmatrix} I_r & 0 \\ 0 & 0 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} \gamma_{1r} \\ \gamma_{2n-r} \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} \beta_{1r} \\ \beta_{2n-r} \end{pmatrix} \Rightarrow \gamma_{1r} = \beta_{1r}, \gamma_{2n-r} = 0 \Rightarrow P^{-1}\beta = \begin{pmatrix} \beta_{1r} \\ 0 \end{pmatrix} \tag{13}$$

这里要证明一个推论, 就是 P_s 可逆时, $\forall x \neq 0, Px \neq 0$. 设 $\exists x \neq 0$ s.t. $Px = 0$, 因为 P 是可逆矩阵 $\Rightarrow rank(P) = s \Rightarrow Px = 0$ 只有 0 解, 与假设矛盾, 从而 $Px \neq 0$

从而 $P^{-1}\beta \neq 0 \Rightarrow Z_1 \neq 0_r$, 因此设 $Z_1 = \begin{pmatrix} k_1 \\ k_2 \\ \vdots \\ k_r \end{pmatrix}, \exists k_i \neq 0$; 根据前述广义逆定理, $A^- = Q^{-1} \begin{pmatrix} I_r & B \\ C & D \end{pmatrix} P^{-1}$, 我们将 $C_{(n-r) \times (r)}$ 写

作 $C = (0, 0, \dots, k_i^{-1}Y_2, \dots, 0)$, 这里要注意 Y_2 是一个列向量. 那么 $CZ_1 = (0, 0, \dots, k_i^{-1}Y_2, \dots, 0) \begin{pmatrix} k_1 \\ k_2 \\ \vdots \\ k_r \end{pmatrix} = Y_2$, 那么:

$$\begin{aligned}
Q\gamma &= \begin{pmatrix} Y_1 \\ Y_2 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} Z_1 \\ CZ_1 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} I_r & 0 \\ C & 0 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} Z_1 \\ 0 \end{pmatrix} \Rightarrow \\
\gamma &= Q^{-1} \begin{pmatrix} I_r & 0 \\ C & 0 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} Z_1 \\ 0 \end{pmatrix}, \because P^{-1}\beta = \begin{pmatrix} Z_1 \\ 0 \end{pmatrix} \Rightarrow \\
\gamma &= Q^{-1} \begin{pmatrix} I_r & 0 \\ C & 0 \end{pmatrix} P^{-1}\beta = A^-\beta
\end{aligned} \tag{14}$$

我们也可以反过来验证，对于 A^- ，由 3.3. 定理可知， $\beta = AA^-\beta$ ，从而 $A^-\beta$ 一定是 $Ax = \beta$ 的解

综上，如果 $Ax = \beta$ 有解，则其解可表示为 $x = A^-\beta$

3.5. 齐次线性方程组的解的结构定理：

$Ax = 0$ 的通解为：

$$x = (I_n - A^-A)Z, Z \in K^n \tag{15}$$

证明：

$$Z \in K^n, A[(I_n - A^-A)Z] = A[(I_n - A^-A)]Z = (A - AA^-A)Z = 0 \tag{16}$$

这里注意 $A^- \in M_{n \times s}$ ，同时这个证明只证明了 $x = (I_n - A^-A)Z, Z \in K^n$ 是 $Ax = 0$ 的解的一部分而不是全部，接下来要证明任意解的情况

$$b.s.t. Ab = 0, (I_n - A^-A)b = b - A^-(Ab) = b - A^-0 = b \Rightarrow A(I_n - A^-A)b = 0 \tag{17}$$

综上，定理得证

此处证明实际上有重复证明的情况，并且没有说明式 15 为何包含了全部解

1. 重复证明 $b \in K^n, s.t. Ab = 0$ 而第一步证明时取得向量 $Z \in K^n$ 一定包含 b
2. 没有包含全部情况 $(I_n - A^-A)Z$ 会对 Z 做变换，验证全部情况，应当说明 $Ax = 0$ 的解的空间和 $(I_n - A^-A)Z$ 是同一个空间

3.6. 推论

设 $\beta \in K^n, \beta \neq 0$ ，则如果 $Ax = \beta$ 有解时，其通解为：

$$x = A^-\beta + (I_n - A^-A)Z, Z \in K^n \tag{18}$$

证明：由定理 3.4. 知 $x \in \{A^-\beta\}, s.t. Ax = \beta$ ，又 $Ax = \beta = \beta + 0 = Ax + A\gamma, A\gamma = 0$ ，由 3.5. 知 $\gamma \in \{(I_n - A^-A)Z, Z \in K^n\}$ 从而 $Ax + A\gamma = A^-\beta + (I_n - A^-A)Z, Z \in K^n$

3.7. (略) 设 A 是复数域上的 $s \times n$ 矩阵，那么

$$\begin{cases} AXA = A \\ XAX = X \\ (AX)^* = AX \\ (XA)^* = XA \end{cases} \tag{19}$$

称为 A 的 **Penrose** 方程组，他的解叫做 A 的 **Moore-Penrose** 广义逆，记作 A^+