


第一届八一赛数学组 A 类试题解析

1. (本题 15 分) 从点 $P(1, 1, \frac{\sqrt{2}}{2})$ 处引椭球面 $C: 2x^2 + 3y^2 + 4z^2 = 1$ 的切线, 切点的轨迹在平面 yOz 上的投影为 Γ , 试证明 Γ 为椭圆, 并求 Γ 的中心, 主方向与面积.

 解: 椭球面 C 上任意一点 $Q(x_0, y_0, z_0)$ 的法向量为 $(4x_0, 6y_0, 8z_0)$, 从而 Q 处的切线方程为:

$$(x - x_0) \cdot 4x_0 + (y - y_0) \cdot 6y_0 + (z - z_0) \cdot 8z_0 = 0$$

即 $2x_0x + 3y_0y + 4z_0z = 1$

若该切线经过 P 点, 则有 $2x_0 + 3y_0 + 2\sqrt{2}z_0 = 1$, 也就是说从 P 点引出的切线与椭球面 C 的切点 (x, y, z) 必然满足: $2x + 3y + 2\sqrt{2}z = 1$. 于是切点的轨迹方程为:

$$\begin{cases} 2x + 3y + 2\sqrt{2}z = 1 \\ 2x^2 + 3y^2 + 4z^2 = 1 \end{cases}$$

消去 x 得到切点轨迹在平面 yOz 上的投影方程

$$\Gamma: 15y^2 + 16z^2 + 12\sqrt{2}yz - 6y - 4\sqrt{2}z - 1 = 0$$

Γ 为二次曲线, 令 $a_{11} = 15, a_{22} = 16, a_{12} = 6\sqrt{2}, b_1 = -3, b_2 = -2\sqrt{2}, c = -1$,

$$A_0 = \begin{pmatrix} a_{11} & a_{12} \\ a_{12} & a_{22} \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 15 & 6\sqrt{2} \\ 6\sqrt{2} & 16 \end{pmatrix}, A = \begin{pmatrix} a_{11} & a_{12} & b_1 \\ a_{12} & a_{22} & b_2 \\ b_1 & b_2 & c \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 15 & 6\sqrt{2} & -3 \\ 6\sqrt{2} & 16 & -2\sqrt{2} \\ -3 & -2\sqrt{2} & -1 \end{pmatrix}$$

得到 Γ 的不变量 $I_1 = a_{11} + a_{22} = 31, I_2 = |A_0| = 168, I_3 = |A| = -288$, 于是 $I_2 > 0, I_1 I_3 < 0$, 所以 Γ 为椭圆.

由于 Γ 的中心 $O'(0, y, z)$ 满足:

$$\begin{cases} a_{11}y + a_{12}z + b_1 = 15y + 6\sqrt{2}z - 3 = 0 \\ a_{12}y + a_{22}z + b_2 = 6\sqrt{2}y + 16z - 2\sqrt{2} = 0 \end{cases}$$

解得 $y = \frac{1}{7}, z = \frac{\sqrt{2}}{14}$, 所以 Γ 的中心为 $O'\left(0, \frac{1}{7}, \frac{\sqrt{2}}{14}\right)$.

Γ 的特征方程为 $|\lambda E - A_0| = \lambda^2 - 31\lambda + 168$, 特征根 $\lambda_1 = 7, \lambda_2 = 24$.

特征根 λ_1 对应的单位特征向量 $u_1 = \left(\frac{3\sqrt{17}}{17}, -\frac{2\sqrt{34}}{17}\right)$

特征根 λ_2 对应的单位特征向量 $u_2 = \left(\frac{2\sqrt{34}}{17}, \frac{3\sqrt{17}}{17}\right)$

所以椭圆 Γ 的主方向为

$$e'_1 = \left(0, \frac{3\sqrt{17}}{17}, -\frac{2\sqrt{34}}{17}\right), e'_2 = \left(0, \frac{2\sqrt{34}}{17}, \frac{3\sqrt{17}}{17}\right)$$


在直角坐标系下 $[O'; e'_1, e'_2]$, Γ 的标准方程为:

$$\begin{cases} \lambda_1 y'^2 + \lambda_2 z'^2 + \frac{I_3}{\lambda_1 \lambda_2} = 0 \\ x' = 0 \end{cases}, \text{ 即 } \begin{cases} \frac{y'^2}{\frac{12}{49}} + \frac{z'^2}{\frac{1}{14}} = 1 \\ x' = 0 \end{cases}$$

所以椭圆 Γ 的面积 $S = \pi \cdot \sqrt{\frac{12}{49}} \cdot \sqrt{\frac{1}{14}} = \frac{\sqrt{42}}{49} \pi$. □

2. (本题 15 分) 证明: 对于 n 阶实方阵 A, B , 若 $E - A^T A$ 与 $E - B^T B$ 是半正定矩阵, 则

$$|E - A^T B|^2 \geq |E - A^T A| |E - B^T B|$$

 **证明:** 由熟知的结论

$$|E - A^T B| = |E - BA^T| = |E - AB^T| = |E - B^T A|$$

构造矩阵

$$M = \begin{pmatrix} E & -A^T \\ -B & E \end{pmatrix}, N = \begin{pmatrix} E & B^T \\ A & E \end{pmatrix}$$

则

$$\begin{aligned} |M||N| &= |E - BA^T| |E - AB^T| = |E - A^T B|^2 \\ &= \begin{vmatrix} E & -A^T \\ -B & E \end{vmatrix} \begin{vmatrix} E & B^T \\ A & E \end{vmatrix} = \begin{vmatrix} E - A^T A & B^T - A^T \\ A - B & E - BB^T \end{vmatrix} \end{aligned}$$

下面用摄动法证明

$$\begin{vmatrix} E - A^T A & B^T - A^T \\ A - B & E - BB^T \end{vmatrix} \geq |E - A^T A| |E - B^T B|$$

设

$$F(\lambda) = \begin{vmatrix} (1+\lambda)E - A^T A & B^T - A^T \\ A - B & (1+\lambda)E - BB^T \end{vmatrix}$$

由 $E - A^T A$ 与 $E - B^T B$ 半正定知, 对任意的 $\lambda > 0$, 有 $(1+\lambda)E - A^T A$, $(1+\lambda)E - BB^T$ 均正定, 故可逆, 故对 $F(\lambda)$ 做初等变换得:

$$\begin{aligned} F(\lambda) &= \begin{vmatrix} (1+\lambda)E - A^T A & B^T - A^T \\ A - B & (1+\lambda)E - BB^T \end{vmatrix} \\ &= \begin{vmatrix} (1+\lambda)E - A^T A & B^T - A^T \\ 0 & (1+\lambda)E - BB^T - (A - B)((1+\lambda)E - A^T A)^{-1}(B^T - A^T) \end{vmatrix} \\ &= |(1+\lambda)E - A^T A| |(1+\lambda)E - BB^T + (B - A)((1+\lambda)E - A^T A)^{-1}(B^T - A^T)| \end{aligned}$$

由于 $(1+\lambda)E - BB^T$ 正定且 $(B - A)((1+\lambda)E - A^T A)^{-1}(B^T - A^T)$ 半正定, 故

$$|(1+\lambda)E - BB^T + (B - A)((1+\lambda)E - A^T A)^{-1}(B^T - A^T)| \geq |(1+\lambda)E - BB^T| \geq |E - BB^T|$$

所以 $F(\lambda) \geq |E - A^T A| |E - BB^T| = |E - A^T A| |E - B^T B|$. 对任意的 $\lambda > 0$ 成立, 由于 $F(\lambda)$ 是关于 λ 的实系数多项式, 故令 λ 趋于 0, 则有

$$\begin{vmatrix} E - A^T A & B^T - A^T \\ A - B & E - BB^T \end{vmatrix} \geq |E - A^T A| |E - B^T B|$$

即证. □

3. (本题 20 分) 设 S 为 R_n 的一个非空闭凸集, A 为 \mathbb{R} 上 $n \times n$ 的矩阵.

(1) 证明: 对 $\forall y \notin S$, 存在唯一的一个 \bar{x} , 使得 $\|y - \bar{x}\| = \inf_{x \in S} \|y - x\|$

(2) 证明: 对于 $y \notin S$, 存在非零向量 p 以及 $\varepsilon > 0$, 使得对 $\forall x \in S$, 有 $p^T y \geq \varepsilon + p^T x$

(3) 证明: $Ax < 0$ 有解的充分必要条件是存在非零向量 $p \geq 0$ 使得 $A^T p = 0$.

证明: 本题实际上是一个以凸优化为背景的线性代数题目, 本体的最后一问原型即为 Gordan 定理, 在优化理论中有很高的地位, 相对来说, 前两问是有着一定的引导作用来进行题目完整的证明, 在问题解答的过程中, 不知不觉已经将凸优化中的闭集情况下的凸集分离定理证明出来了, 这也是数学分析和线性代数结合的一个典型例子.

(1) 令 $\inf_{x \in S} \|y - x\| = r > 0$, 由下确界的定义可知, 存在序列 $\{x^{(k)}\}, x^{(k)} \in S$, 使得 $\|y - x^{(k)}\| \rightarrow r$. 首先

$$\begin{aligned}\|x^{(k)} - x^{(m)}\|^2 &= 2\|x^{(k)} - y\|^2 + 2\|x^{(m)} - y\|^2 - 4\left\|\frac{x^{(k)} + x^{(m)}}{2} - y\right\|^2 \\ &\leq 2\|x^{(k)} - y\|^2 + 2\|x^{(m)} - y\|^2 - 4r^2\end{aligned}$$

因此 k 和 m 无穷大的时候 $\|x^{(k)} - x^{(m)}\|$ 趋近于 0, $\{x^{(k)}\}$ 为柯西列, 极限 \bar{x} 存在且 $\bar{x} \in S$. 唯一性: 设 $\hat{x} \in S$ 且 $\|y - \bar{x}\| = \|y - \hat{x}\| = r$. 由于 $(\bar{x} + \hat{x})/2 \in S$, 则由 Schwartz 不等式, 我们有

$$\|y - (\bar{x} + \hat{x})/2\| \leq \frac{1}{2}\|y - \bar{x}\| + \frac{1}{2}\|y - \hat{x}\| = r$$

又 $\left\|y - \frac{\bar{x} + \hat{x}}{2}\right\| = \frac{1}{2}\|y - \bar{x}\| + \frac{1}{2}\|y - \hat{x}\|$, 因此 $y - \bar{x} = \lambda(y - \hat{x})$, 表明 $\|y - \bar{x}\| = |\lambda|\|y - \hat{x}\|$ 因此 $|\lambda| = 1$, 如果 $\lambda = -1$, 则显然 $y \in S$, 矛盾, 所以 $\lambda = 1$, 又 $y - \bar{x} = \lambda(y - \hat{x})$, 问题得证.

(2) S 为闭凸集, $y \notin S$, 由上一问可知存在 $\bar{x} \in S$, 使得 $\|y - \bar{x}\| = \inf_{x \in S} \|y - x\|$

令 $p = y - \bar{x}, \varepsilon = p^T(y - \bar{x})$, 下面证明这样的 p 和 ε 是符合要求的.

$$p^T(y - x) = p^T(y - \bar{x} + \bar{x} - x) = p^T(y - \bar{x}) + p^T(\bar{x} - x) = \varepsilon + (y - \bar{x})^T(\bar{x} - x)$$

又

$$\begin{aligned}\|y - \bar{x}\|^2 &\leq \|y - [\lambda x + (1 - \lambda)\bar{x}]\|^2 = \|(y - \bar{x}) + \lambda(\bar{x} - x)\|^2 \\ &= \|y - \bar{x}\|^2 + \lambda^2\|\bar{x} - x\|^2 + 2\lambda(y - \bar{x})^T(\bar{x} - x)\end{aligned}$$

因此 $(y - \bar{x})^T(\bar{x} - x) + \frac{\lambda}{2}\|\bar{x} - x\|^2 \geq 0$. 令 $\lambda \rightarrow 0$, 有 $(y - \bar{x})^T(\bar{x} - x) \geq 0$, 因此 $p^T(y - x) \geq \varepsilon$ 得证.

(3) **必要性:** 若 $Ax < 0$ 有解, 则存在 \bar{x} 使得 $A\bar{x} < 0$. 若存在非零向量 $p \geq 0$ 使得 $A^T p = 0$, 即 $y^T A = 0$. 则 $p^T A\bar{x} = 0$, 因为 $A\bar{x} < 0$, 所以 p 的每个分量不可能全部为非负, 因此矛盾, 必要性得证.

充分性: 我们考虑充分性的等价命题: 若 $Ax < 0$ 无解, 则存在非零向量 $p \geq 0$ 使得 $A^T p = 0$. 设 $S_1 = \{z | z = Ax, x \in \mathbb{R}^n\}$ 和 $S_2 = \{z | z < 0\}$, 显然这两个集合均为凸集, 知 $Ax < 0$ 无解, 因此 $S_1 \cap S_2 = \emptyset$. 令 $S = S_2 - S_1 = \{z | z = x^{(2)} - x^{(1)}, x^{(1)} \in S_1, x^{(2)} \in S_2\}$, 则 S 为非空闭凸集, 而且 $0 \notin S$. 因此若想利用第 (2) 问的结论我们需要进行一些极限逼近操作, 我们考虑 S 的闭包 $\text{cl}S$, 这显然是一个闭集.

- i. 如果 $0 \notin clS$, 则可以对 clS 利用第二问的结论, 对于所有的 $z \in S$ ($S \in clS$), 存在非零向量 p , 使得 $p^T(0-z) = -p^T z \geq \varepsilon$. 因此 $p^T z \leq 0$, 再者 $z = x^{(2)} - x^{(1)}$, 由 $x^{(2)} x^{(1)}$ 的定义, 我们有 $p^T Ax \geq p^T y$, 其中 $x \in R$ $y > 0$. 当 $x = 0$ 时, 我们有 $p^T y \leq 0$, 因为 $y > 0$ (y 可以取小于零的任意值), 所以 $p \geq 0$.
再令 $p^T Ax \geq p^T y$ 中的 y 趋近于 0, 我们有 $p^T Ax \geq 0$, 令 $x = -A^T p$, 我们有 $-\|A^T p\| \geq 0$, 因此 $A^T p = 0$, 所以存在 $p \geq 0$ 使得 $A^T p = 0$.
- ii. 如果 $0 \in clS$, 由于 $0 \notin S$, 则 $0 \in \partial S$ (意为 S 的边界点集合), 显然存在一个序列 $\{y^{(k)}\} \notin clS$, 使得 $y^{(k)} \rightarrow 0$. 每一个 $y^{(k)}$ 则可以对 clS 利用第 (2) 问的结论, $\forall z \in S$ (应当注意到 $S \in clS$), 存在非零向量 $p^{(k)}$, 使得 $p^{(k)T}(y^{(k)} - z) \geq \varepsilon \geq 0$, 然后将 $p^{(k)}$ 单位化并记为 $p_*^{(k)}$, 则 $\{p_*^{(k)}\}$ 有界, 因此必存在收敛子列 $\{p_*^{(k_j)}\}$, 记此收敛子列的极限为 p .
令 $p_*^{(k_j)T}(y^{(k)} - z) \geq \varepsilon \geq 0$ 中的 $k_j \rightarrow \infty$, 我们有 $p^T(0-z) \geq 0$, 此时模仿 i 中的操作 $p^T z \leq 0$, 再者 $z = x^{(2)} - x^{(1)}$, 由 $x^{(2)} x^{(1)}$ 的定义, 我们有 $p^T Ax \geq p^T y$, 其中 $x \in R$ $y > 0$. 当 $x = 0$ 时, 我们有 $p^T y \leq 0$, 因为 $y > 0$ (y 可以取小于零的任意值), 所以 $p \geq 0$.
再令 $p^T Ax \geq p^T y$ 中的 y 趋近于 0, 我们有 $p^T Ax \geq 0$, 令 $x = -A^T p$, 我们有 $-\|A^T p\| \geq 0$, 因此 $A^T p = 0$, 所以存在 $p \geq 0$ 使得 $A^T p = 0$.

至此证明完毕.


□

4. (本题 15 分) 已知复系数多项式

$$f(x) = x^k + c_1 x^{k-1} + c_2 x^{k-2} + \cdots + c_{k-1} x + c_k$$

证明: 对多项式 $f(x)$ 的任意一根 z , 都有

$$|z| \leq 2 \cdot \max \left\{ |c_1|, \sqrt{|c_2|}, \sqrt[3]{|c_3|}, \cdots, \sqrt[k]{|c_k|} \right\}$$

 **证明: 引理:** 令复数 z_1, z_2, \cdots, z_k 是下述复系数多项式的根, 设 $r_{\max} = \max \{|z_1|, |z_2|, \cdots, |z_k|\}$;

$$f(x) = x^k + c_1 x^{k-1} + c_2 x^{k-2} + \cdots + c_{k-1} x + c_k$$

① 对于满足 $r^k > |c_1| r^{k-1} + |c_2| r^{k-2} + \cdots + |c_{k-1}| r + |c_k|$ 的任意正实数 r , 都有 $r > r_{\max}$;

② 对于满足 $r > r_{\max}$ 的正实数 r , 不一定有 $r^k > |c_1| r^{k-1} + |c_2| r^{k-2} + \cdots + |c_{k-1}| r + |c_k|$.

首先先证明引理: 定义两个复系数多项式整函数 $f(z) = z^k + c_1 z^{k-1} + c_2 z^{k-2} + \cdots + c_{k-1} z + c_k$ 与 $g(z) = z^k$, 于是有

$$h(z) = c_1 z^{k-1} + c_2 z^{k-2} + \cdots + c_{k-1} z + c_k = f(z) - g(z) \in \mathbb{C}$$

记正实数 $r = |z|$ 则有 $r^k = |g(z)|$, 结合引理中的条件知, 若 r 满足 $r^k > |c_1| r^{k-1} + |c_2| r^{k-2} + \cdots + |c_{k-1}| r + |c_k|$, 则有:

$$|h(z)| \leq |c_1| r^{k-1} + |c_2| r^{k-2} + \cdots + |c_{k-1}| r + |c_k| < r^k = |g(z)|$$

整函数 $g(z) = z^k$ 与 $f(z) = g(z) + h(z)$ 在闭圆盘 $|z| \leq r$ 内解析, 根据 Rouché 定理,

整函数 $g(z) = z^k$ 与 $f(z) = g(z) + h(z)$ 在开圆盘 $|z| < r$ 内有相同数量的零点。

整函数 $g(z) = z^k$ 在闭圆盘 $|z| \leq r$ 内必有 k 个零点；

故整函数 $f(z) = g(z) + h(z)$ 在闭圆盘 $|z| \leq r$ 内也有 k 个零点。

于是就表明了方程 $f(z) = 0$ 根的模长的最大值 $r_{\max} < r$ ，引理得证。

设 $r_1 = 2 \cdot \max \{|c_1|, \sqrt{|c_2|}, \sqrt[3]{|c_3|}, \dots, \sqrt[k]{|c_k|}\}$ ，于是

$$\begin{aligned} r_1 &= 2 \cdot \max \{|c_1|, \sqrt{|c_2|}, \sqrt[3]{|c_3|}, \dots, \sqrt[k]{|c_k|}\} \\ &= 2 \cdot \max_{1 \leq j \leq k} \sqrt[j]{|c_j|} = \max_{1 \leq j \leq k} \sqrt[j]{2^j |c_j|} \end{aligned}$$

对所有正实数 $r > r_1$ (即 $r > \max_{1 \leq j \leq k} \sqrt[j]{2^j |c_j|}$) 可推出 $r^j > 2^j |c_j| \Rightarrow \frac{1}{2^j} > \frac{|c_j|}{r^j}$ ，因此：

$$1 = \sum_{j=1}^{+\infty} \frac{1}{2^j} > \sum_{j=1}^k \frac{1}{2^j} > \sum_{j=1}^k \frac{|c_j|}{r^j}$$


那么，可得出 $r^k > |c_1| r^{k-1} + |c_2| r^{k-2} + \dots + |c_{k-1}| r + |c_k|$ ，根据上述引理，必有 $r > r_{\max}$ ，

又根据满足 $r > r_1$ 条件的正实数 r 的任意性，故有 $r_1 \geq r_{\max}$ ，命题得证。

(蓝色部分为较难思考到的部分)

□

5. 设 $f(x) \in C^1[0, +\infty)$ ，且 $\lim_{x \rightarrow +\infty} f(x) = 0$ ，已知积分 $I = \int_0^{+\infty} t^{a+1} f'(t) dt$ 对某个常数 $a > -1$ 收敛，证明：积分 $\int_0^{+\infty} t^a f(t) dt$ 收敛，并且等于 $-\frac{I}{a+1}$ 。

 **证明：** 令 $F(x) = \int_0^x t^a f(t) dt$ ， $G(x) = \int_0^x t^{a+1} f'(t) dt$ ，首先有

$$\frac{d}{dt}(t^{a+1} f(t)) = (a+1)t^a f(t) + t^{a+1} f'(t), \quad (1)$$

注意到 $F'(x) = x^a f(x)$ ，将 (1) 式在 $[0, x]$ 上积分可得

$$x^{a+1} f(x) = (a+1)F(x) + G(x) = xF'(x) \quad (2)$$

由此我们得到

$$\begin{aligned} \frac{d}{dx}(x^{-a-1} F(x)) &= -(a+1)x^{-a-2} F(x) + x^{-a-1} F'(x) \\ &= x^{-a-2} (-(a+1)F(x) + xF'(x)) = -x^{-a-2} G(x). \end{aligned}$$

又当 $x \rightarrow +\infty$ 时， $G(x) \rightarrow I$ ，所以

$$G(x) = I - \int_x^{+\infty} t f'(t) dt = I + o(1) \quad (x \rightarrow +\infty). \quad (3)$$

那么由此得

$$\frac{d}{dt}(t^{-a-1} F(t)) = I t^{-a-2} + o(t^{-a-2}) \quad (t \rightarrow +\infty). \quad (4)$$

由 (2) 知 $(a+1)x^{-a-1}F(x) + x^{-a-1}G(x) = f(x)$, 令 $x \rightarrow +\infty$, 由题意知 $f(x) \rightarrow 0, G(x) \rightarrow I$, 所以


$$\lim_{x \rightarrow +\infty} (x^{-a-1}F(x)) = 0.$$

将 (4) 在 $[x, +\infty)$ 上积分可得

$$\begin{aligned} -\frac{F(x)}{x^{a+1}} &= \left(t^{-a-1}F(t) \right) \Big|_x^{+\infty} = \frac{I}{(a+1)x^{a+1}} + \int_x^{+\infty} o(t^{-a-2}) dt \\ &= \frac{I}{(a+1)x^{a+1}} + o(x^{-a-1}) \quad (x \rightarrow +\infty). \end{aligned}$$

即 $F(x) = -\frac{I}{a+1} + o(1), x \rightarrow +\infty$, 这就是说 $\lim_{x \rightarrow +\infty} F(x) = \int_0^{+\infty} t^a f(t) dt = -\frac{I}{a+1}$. \square

6. (本题 20 分) 设 b_n 表示正整数 n 的最大素因子, 以及单调递增的正实数列 $\{a_n\}$. 满足无穷级数 $\sum_{n=1}^{+\infty} \frac{1}{na_n}$ 收敛, 问无穷级数 $\sum_{n=1}^{+\infty} \frac{1}{na_{b_n}}$ 是否也是收敛的? 并证明你的结论.

 **证明:** 设 m 为正整数, 定义

$$G(m) = \sum_{p(n) \leq m} \frac{1}{n} = \sum_{p \leq m} \left(1 + \frac{1}{p} + \frac{1}{p^2} + \cdots \right) = \prod_{p \leq m} \left(1 - \frac{1}{p} \right)^{-1} \leq k \ln(m+1)$$

其中 k 为常数. 故

$$\begin{aligned} \prod_{p \leq N} \frac{1}{nf(p(n))} &= \sum_{m=1}^N \frac{G(m) - G(m-1)}{f(m)} \\ &\leq \sum_{m=1}^{N-1} k \ln(m+1) \left(\frac{1}{f(m)} - \frac{1}{f(m+1)} \right) + \frac{k \ln(N+1)}{f(N)} \\ &= \sum_{m=1}^N \frac{k \ln(m+1) - k \ln m}{f(m)} < \sum_{m=1}^N \frac{k}{mf(m)} \end{aligned}$$

故无穷级数 $\sum_{n=1}^{+\infty} \frac{1}{na_{b_n}}$ 是收敛. \square