

Vorlesungsskript

LinA II* SoSe 24

Inhaltsverzeichnis

| | |
|--|-----------|
| 1. Eigenwerte und Eigenvektoren | 3 |
| 1.1. Definition und grundlegende Eigenschaften | 3 |
| 1.2. Das charakteristische Polynom | 7 |
| 2. Diagonalisierbarkeit und Normalform | 16 |
| 2.1. Diagonalisierbarkeit | 16 |
| 2.2. Dualräume | 22 |
| 2.3. Zyklische f -invariant Unterräume | 26 |
| 2.4. Die Jordan-Normalform | 30 |
| 3. Euklidische und unitäre Vektorräume | 39 |
| 3.1. Skalarprodukt und Normen | 39 |
| 3.2. Winkel und Orthogonalität | 44 |
| 3.3. Selbstadjungierte Abbildungen | 50 |

Definitionen

1 .

- 1.1:** Eigenwert und Eigenvektor
- 1.2:** Eigenwert und Eigenvektor
- 1.7:** Eigenraum
- 1.10:** Geometrische Vielfachheit
- 1.12:** Charakteristisches Polynom
- 1.17:** ähnliche Matrizen
- 1.20:** Algebraische Vielfachheit

2 .

- 2.1:** Diagonalisierbar
- 2.8:** Jordan
- 2.9:** Linearform, Dualraum
- 2.12:** duale Abbildung
- 2.15:** nilpotent vom Grad
- 2.16:** equation
- 2.17:** Bilinearform
- 2.19:** Grad von
- 2.20:** Krylov

3 .

- 3.1:** Sesquilinearform
- 3.2:** Skalarprodukt
- 3.3:** hermitesche Matrix
- 3.6:** Norm
- 3.9:** orthogonal
- 3.14:** Orthogonale und unitäre Matrizen
- 3.16:** orthogonale Abbildung
- 3.17:** linebreak
- 3.22:** adjungierter Endorphismus
- 3.23:** selbstadjungiert
- 3.27:** positiv definite Matrix

Wiederholung:

K sei ein beliebiger Körper, V ein n -dimensionaler K -Vektorraum,

$$L(V, V) = \{f : V \rightarrow V \mid f \text{ lin. Abbildung}\}$$

$f \in L(V, V)$ heißt Endomorphismus. Ist $f \in L(V, V)$, so läßt sich f bezüglich einer Basis $B = \{v_1, \dots, v_n\}$ von V eindeutig durch eine Matrix

$$A_f^{B,B} = (a_{ij})_{1 \leq i, j \leq n} \in K^{n,n}$$

Es gilt

$$f(v_j) = \sum_{i=1}^n a_{ij} v_i \quad 1 \leq j \leq n$$

Abbildung

$$F : L(V, V) \rightarrow K^{n,n}$$

ist ein Isomorphismus.

Basiswechsel? Basen B, C von V



(siehe Lem. 5.27, LinA I*)

Eine zentrale Frage: Sei $f \in L(V, V)$, existiert eine Basis $B = \{v_1, \dots, v_n\}$ von V , so dass $A_f^{B,B}$ eine möglichst einfache Form besitzt?

z.B. Diagonalmatrix:

$$A_f^{B,B} = \begin{pmatrix} \lambda_1 & \dots & 0 \\ \vdots & \ddots & \vdots \\ 0 & \dots & \lambda_n \end{pmatrix}$$

Wir werden:

- Endomorphismen charakterisieren, die sich durch eine Diagonalmatrix beschreiben lassen.

Wenn ja: Dann gilt $f(v_j) = \lambda_j v_j$

$\Rightarrow f$ ist eine Streckung von v_j um den Faktor λ_j .

- Die Jordan-Normalform herleiten.

1. Eigenwerte und Eigenvektoren

Eigenwerte charakterisieren zentrale Eigenschaften linearer Abbildungen. Z.B.

- Lösbarkeit von linearen Gleichungssystemen
 - Eigenschaften von physikalischen Systemen
 - gewöhnliche Differentialgleichungen
 - Eigenschwingungen / Resonanzkatastrophe
- Zerstörung einer Brücke über dem Fluß Maine / Millenium-Bridge London

1.1. Definition und grundlegende Eigenschaften

Definition 1.1: Eigenwert und Eigenvektor (Endomorphismus)

Sei V ein K -Vektorraum. Ein Vektor $v \in V, v \neq 0_V$, heißt **Eigenvektor** von $f \in L(V, V)$, falls $\lambda \in K$ mit

$$f(v) = \lambda v$$

existiert. Der Skalar $\lambda \in K$ heißt der **Eigenwert** zum Eigenvektor $v \in V$.

Definition 1.2: Eigenwert und Eigenvektor (Matrix)

Sei K ein Körper und $n \in \mathbb{N}$. Ein Vektor $v \in K^n, v \neq 0_{K^n}$, heißt Eigenvektor von $A \in K^{n,n}$, falls $\lambda \in K$ mit

$$Av = \lambda v$$

existiert. Der Skalar $\lambda \in K$ heißt der Eigenwert zum Eigenvektor $v \in V$.

Bemerkungen:

- In Def 1.1 kann $\dim(V) = \infty$ sein. Dies ist für viele Definitionen/Aussagen in denen wir Endomorphismen betrachten, der Fall.
- Für $\dim(V) < \infty$ kann man jedes $f \in L(V, V)$ eindeutig mit einer Matrix A identifizieren. Dann: Def 1.2 ist Spezialfall von Def 1.1.

- **Achtung:** $0 \in K$ kann ein Eigenwert sein:

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

Der Nullvektor $0 \in V$ ist **nie** ein Eigenvektor.

Für $\dim(V) = 0$ besitzt f keinen Eigenvektor für $f \in L(V, V)$.

- Ist v Eigenvektor zum Eigenwert λ , so ist auch αv für jedes $\alpha \in K \setminus \{0\}$ ein Eigenvektor

$$f(\alpha v) = \alpha f(v) = \alpha \lambda v = \lambda(\alpha v)$$

Zentrale Frage dieses Kapitels:

Existenz von Eigenwerten? Wenn sie existieren: Weitere Eigenschaften?

Beispiel 1.3: Sei $I \subset \mathbb{R}$ ein offenes Intervall und V der unendlichdimensionale Vektorraum der auf I beliebig oft differenzierbaren Funktionen. Ein Endomorphismus $f \in L(V, V)$ ist gegeben durch

$$f(\varphi) = \varphi' \quad \forall \varphi \in V$$

Die Abbildung f hat jedes $\lambda \in \mathbb{R}$ als Eigenwert, da für $c \in \mathbb{R} \setminus \{0\}$ und die Funktion

$$\varphi(x) := c \cdot e^{\lambda x} \neq 0_V \quad \forall x \in I$$

gilt

$$f(\varphi(x)) = f(c \cdot e^{\lambda x}) = \lambda(c e^{\lambda x}) = \lambda \varphi(x)$$

Hier: $\varphi'(x) = f(\varphi)$ ist eine gewöhnliche Differentialgleichung.

Beispiel 1.4: Wir betrachten die lineare Abbildung $f : \mathbb{R}^2 \rightarrow \mathbb{R}^2$, welche durch

$$f\left(\begin{pmatrix} x_1 \\ x_2 \end{pmatrix}\right) = \begin{pmatrix} x_2 \\ -x_1 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 0 & 1 \\ -1 & 0 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} x_1 \\ x_2 \end{pmatrix}$$

definiert ist. Sei x ein Eigenvektor, dann gilt

$$\begin{aligned} f\left(\begin{pmatrix} x_1 \\ x_2 \end{pmatrix}\right) &= \begin{pmatrix} x_2 \\ -x_1 \end{pmatrix} = \lambda \begin{pmatrix} x_1 \\ x_2 \end{pmatrix} \\ \Leftrightarrow x_2 &= \lambda x_1 \quad \text{und} \quad -x_1 = \lambda x_2 \end{aligned}$$

O.B.d.A: $x_2 \neq 0$

$$\Rightarrow x_2 = \lambda(-\lambda x_2) = -\lambda^2 x_2 \Rightarrow -\lambda^2 = 1, \quad \lambda \in \mathbb{R} \Rightarrow \lambda^2 \geq 0 \Rightarrow -\lambda^2 \leq 0 \quad \nexists$$

D.h. f besitzt keinen Eigenwert/-vektor. Für $f : \mathbb{C}^2 \rightarrow \mathbb{C}^2$ ändert sich dies! \Rightarrow Die Wahl von K entscheidet!

Beispiel 1.5: Wieder $f : \mathbb{R}^2 \rightarrow \mathbb{R}^2$, diesmal

$$f\left(\begin{pmatrix} x_1 \\ x_2 \end{pmatrix}\right) = \begin{pmatrix} 2x_2 \\ 2x_1 \end{pmatrix} = \underbrace{\begin{pmatrix} 0 & 2 \\ 2 & 0 \end{pmatrix}}_{=:A} \begin{pmatrix} x_1 \\ x_2 \end{pmatrix}$$

Dann gilt für $v_1 = \begin{pmatrix} 1 \\ 0 \end{pmatrix}$, $v_2 = \begin{pmatrix} 1 \\ 1 \end{pmatrix}$, $v_3 = (-1, 1)$ dass $f(v_1) = \begin{pmatrix} 0 \\ 2 \end{pmatrix}$, $f(v_2) = \begin{pmatrix} 2 \\ 2 \end{pmatrix} = 2 \cdot v_2$ und $f(v_3) = \begin{pmatrix} 2 \\ -2 \end{pmatrix} = (-2) \cdot v_3$.



Beobachtung: $\dim(V) = 2$

zwei Eigenwerte: $2, -2$, es existieren keine Weiteren,

zwei Eigenvektoren: $v_2 = \begin{pmatrix} 1 \\ 1 \end{pmatrix}$, $v_3 = \begin{pmatrix} -1 \\ 1 \end{pmatrix}$, sind linear unabhängig

Lemma 1.6: Es sei $f \in L(V, V)$ ein Endomorphismus. Eigenvektoren zu paarweise verschiedenen Eigenwerten von f sind linear unabhängig.

Beweis: Es seien v_1, \dots, v_m Eigenvektoren zu den paarweise verschiedenen Eigenwerten $\lambda_1, \dots, \lambda_m$ von f . Beweis durch Induktion:

Induktionsanfang: $m = 1$, $\lambda_1, v_1 \neq 0 \implies v_1$ lin. unabh.

Induktionsschritt: $m - 1 \rightarrow m$

Induktionsvoraussetzung: Behauptung gelte für $m - 1$

Betrachte

$$\alpha_1 v_1 + \alpha_2 v_2 + \dots + \alpha_m v_m = 0 \quad (*) \quad \alpha_m \in K$$

EV, f()

$$\implies \alpha_1 \lambda_1 v_1 + \alpha_2 \lambda_2 v_2 + \dots + \alpha_m \lambda_m v_m = 0$$

(*) · λ_m

$$\implies \lambda_m \alpha_1 v_1 + \lambda_m \alpha_2 v_2 + \dots + \lambda_m \alpha_m v_m = 0$$

Wir bilden die Differenz aus Zeile 1 und 2

$$\underbrace{(\lambda_1 - \lambda_m)}_{\neq 0} \alpha_1 v_1 + \underbrace{(\lambda_2 - \lambda_m)}_{\neq 0} \alpha_2 v_2 + \dots + \underbrace{(\lambda_{m-1} - \lambda_m)}_{\neq 0} \alpha_{m-1} v_{m-1} = 0$$

v_1, \dots, v_{m-1} lin. unabh. $\implies \alpha_1 = \alpha_2 = \dots = \alpha_{m-1} = 0$ Einsetzen in (*) liefert

$$\underbrace{\alpha_m v_m}_{\neq 0} = 0 \implies \alpha_m = 0$$

$\Rightarrow v_1, \dots, v_m$ lin unabh.

□

Folgerung: Es gibt höchstens $n = \dim(V)$ verschiedene Eigenwerte für $n = \dim(V) < \infty$.

Definition 1.7: Eigenraum

Ist $f \in L(V, V)$ und $\lambda \in K$, so heißt

$$\text{Eig}(f, \lambda) = \{v \in V \mid f(v) = \lambda v\}$$

der **Eigenraum** von f bezüglich λ .

Es gilt:

- $\text{Eig}(f, \lambda) \subseteq V$ ist ein Untervektorraum
- λ ist Eigenwert von $f \iff \text{Eig}(f, \lambda) \neq \{0\}$
- $\text{Eig}(f, \lambda) \setminus \{0\}$ ist die Menge der zu λ gehörenden Eigenvektoren von f .
- $\text{Eig}(f, \lambda) = \ker(f - \lambda \text{Id})$
- $\dim(\text{Eig}(f, \lambda)) = \dim(V) - \text{rg}(f - \lambda \text{Id})$
- Sind $\lambda_1, \lambda_2 \in K$ verschiedene Eigenwerte, so ist $\text{Eig}(f, \lambda_1) \cap \text{Eig}(f, \lambda_2) = \{0\}$

Die letzte Aussage kann verallgemeinert werden zu:

Lemma 1.8: Sei V ein K -Vektorraum mit $\dim(V) = n < \infty$ und $f \in L(V, V)$. Sind $\lambda_1, \dots, \lambda_m, m \leq n$, paarweise verschiedene Eigenwerte von f , so gilt

$$\text{Eig}(f, \lambda_i) \cap \sum_{\substack{j=1 \\ j \neq i}}^m \text{Eig}(f, \lambda_j) = \{0\} \quad \forall i = 1, \dots, m$$

Beweis: Summe von Vektorräumen, vgl. Def 3.32 LinA I.

Sei $i \in \{1, \dots, m\}$ fest gewählt.

$$v \in \text{Eig}(f, \lambda_i) \cap \sum_{\substack{j=1 \\ i \neq j}}^m \text{Eig}(f, \lambda_j)$$

Also ist

$$v = \sum_{\substack{j=1 \\ j \neq i}}^m v_j \quad \text{für } v_j \in \text{Eig}(f, \lambda_j) \quad \text{für } j \neq i$$

$$\Rightarrow -v + \sum_{\substack{j=1 \\ j \neq i}}^m v_j = 0 \quad \text{Aus Lemma 1.6 folgt damit } v = 0.$$

□

Über die Identifikation von Endomorphismen und Matrizen für $\dim(V) < \infty$ erhält man:

Korollar 1.9: Für ein $n \in \mathbb{N}$ und einem Körper K sei $A \in K^{n,n}$. Dann gilt für jedes $\lambda \in K$, dass

$$\dim(\text{Eig}(A, \lambda)) = n - \text{rg}(A - \lambda I_n)$$

Insbesondere ist $\lambda \in K$ ein Eigenwert von A , wenn $\text{rg}(A - \lambda I_n) < n$ ist.

Definition 1.10: Geometrische Vielfachheit

Ist $f \in L(V, V)$ und $\lambda \in K$ ein Eigenwert von f , so heißt

$$g(f, \lambda) := \dim(\text{Eig}(f, \lambda)) \quad (> 0)$$

die geometrische Vielfachheit des Eigenwerts λ .

1.2. Das charakteristische Polynom

Wir bestimmt man Eigenwerte?

Lemma 1.11: Seien $A \in K^{n,n}$ und $\lambda \in K$. Dann ist

$$\det(A - \lambda I_n)$$

ein Polynom n -ten Grades in λ .

Beweis: Mit der Leibniz-Formel folgt,

$$\begin{aligned} \det(\underbrace{A - \lambda I_n}_{\tilde{a}_{ij}}) &= \sum_{\sigma \in S_1} \text{sgn}(\sigma) \cdot \tilde{a}_{1\sigma(1)} \cdot \dots \cdot \tilde{a}_{n\sigma(n)} \\ &= \underbrace{(a_{11} - \lambda) \cdot (a_{22} - \lambda) \cdot \dots \cdot (a_{nn} - \lambda)}_{\substack{\sigma = \text{Id} \\ \in \mathcal{P}_n \text{ in } \lambda}} + \underbrace{\sum_{\substack{\sigma \neq \text{Id} \\ \in \mathcal{P}_{n-2} \text{ in } \lambda}} S}_{S_1} \end{aligned}$$

Weiter gilt:

$$(a_{11} - \lambda) \cdot \dots \cdot (a_{nn} - \lambda) = (-1)^n \lambda^n + (-1)^{n-1} \lambda^{n-1} (a_{11} + \dots + a_{nn}) + \underbrace{S_1}_{\in \mathcal{P}_{n-2} \text{ in } \lambda}$$

Insgesamt: Es existieren Koeffizienten $a_0, \dots, a_n \in K$ mit

$$\det(A - \lambda I_n) = a_n \lambda^n + a_{n-1} \lambda^{n-1} + \dots + a_1 \lambda + a_0$$

$$a_n = (-1)^n$$

$$a_{n-1} = (-1)^{n-1} (a_{11} + \dots + a_{nn})$$

man kann zeigen: $a_0 = \det(A)$

□

Man nennt $a_{11} + a_{22} + \dots + a_{nn}$ auch die **Spur** von A .

Definition 1.12: Charakteristisches Polynom

Sei $A \in K^{n,n}$ und $\lambda \in K$. Dann heißt das Polynom n -ten Grades

$$P_A(\lambda) := \det(A - \lambda I_n)$$

das charakteristische Polynom zu A .

Lemma 1.13: Sei $A \in K^{n,n}$ und $\lambda \in K$. Der Skalar λ ist genau dann Eigenwert von A , wenn

$$P_A(\lambda) = 0$$

gilt.

Beweis: Die Gleichung

$$Av = \lambda v \iff Av - \lambda v = 0 \iff (A - \lambda I_n)v = 0$$

hat genau eine Lösung $v \in V, v \neq 0$, wenn $\text{rg}(A - \lambda I_n) < n$, vgl. Satz 6.3 aus LinA I. Dies ist genau dann der Fall, wenn

$$\det(A - \lambda I_n) = 0, \text{ vgl. D10 aus LinA I}$$

□

Beispiel 1.14: Eigenwerte und -vektoren von

$$A = \begin{pmatrix} 3 & 8 & 16 \\ 0 & 7 & 8 \\ 0 & -4 & -5 \end{pmatrix}$$

Regel von Sarrus liefert

$$\begin{aligned}
P_A(\lambda) &= \begin{pmatrix} 3-\lambda & 8 & 16 \\ 0 & 7-\lambda & 8 \\ 0 & -4 & -5-\lambda \end{pmatrix} \\
&= (3-\lambda)(-35-7\lambda+5\lambda+\lambda^2+32) \\
&= (3-\lambda)[(7-\lambda)(-5-\lambda)-8(-4)]-8(0-0)+16(0-0) \\
&= (3-\lambda)(\lambda^2-2\lambda-3) = (3-\lambda)(\lambda+1)(\lambda-3)
\end{aligned}$$

\Rightarrow Eigenwerte sind $\lambda = 3$ und $\lambda = -1$

Zugehörige Eigenvektoren?

$\lambda = -1$:

$$\begin{aligned}
Av &= -v \Leftrightarrow (A + I_3)v = 0 \\
\begin{pmatrix} 4 & 8 & 26 \\ 0 & 8 & 8 \\ 0 & -4 & -4 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} v_1 \\ v_2 \\ v_3 \end{pmatrix} &= \begin{pmatrix} 0 \\ 0 \\ 0 \end{pmatrix}
\end{aligned}$$

LGS lösen: $\Rightarrow v_2 = -v_3, v_1 = -2v_3$

Damit ist z.B.: $w_1 = (2, 1, -1)^\top$ Eigenvektor.

$\lambda = 3$:

$$\begin{aligned}
(A - 3I_3)v &= 0 \Leftrightarrow \\
\begin{pmatrix} 0 & 8 & 16 \\ 0 & 4 & 8 \\ 0 & -4 & -8 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} v_1 \\ v_2 \\ v_3 \end{pmatrix} &= 0 \in \mathbb{R}^3 \Leftrightarrow v_2 + 2v_3 = 0
\end{aligned}$$

Damit sind z.B.: $w_2 = (1, 2, -1)^\top, w_3 = (-1, 2, -1)$ Eigenvektoren.

$\lambda = -1$: einfache Nullstelle und $\dim(\text{Span}(w_1)) = 1$ passt zu $\text{rg}(A - (-1)I_n) = 2$ und $\dim(\text{Eig}(A_1 - 1)) = 3 - 2 = 1$.

$\lambda = -3$: doppelte Nullstelle und $\dim(\text{Span}(w_2, w_3)) = 2$ passt zu $\text{rg}(A - 3I_n) = 1$ und $\dim(\text{Eig}(A, 3)) = 3 - 1 = 2$

Lemma 1.15: Sei $A \in K^{n,n}$. Dann gilt

$$p_A(\cdot) = p_{A^\top}(\cdot)$$

D.h. eine Matrix und ihre Transponierte haben die gleichen Eigenwerte.

Beweis:

$$p_A(\lambda) = \det(A - \lambda I_n) \stackrel{\text{D12}}{=} \det((A - \lambda I_n)^\top) = \det(A^\top - \lambda I_n) = p_{A^\top}(\lambda)$$

□

Achtung: Die Eigenwerte bleiben gleich, aber nicht die Eigenvektoren.

Beispiel 1.16: Für die Matrix A aus Bsp. 1.14 gilt

$$A^\top = \begin{pmatrix} 3 & 0 & 0 \\ 8 & 7 & -4 \\ 16 & 8 & -5 \end{pmatrix} \implies \det(A^\top - \lambda I_n) = (3 - \lambda)[(7 - \lambda)(-5 - \lambda) + 4 \cdot 8] \\ = -(\lambda - 3)^2(\lambda + 1)$$

Aber

$$\begin{pmatrix} 3 & 0 & 0 \\ 8 & 7 & -4 \\ 16 & 8 & -5 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} 2 \\ 1 \\ -1 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 6 \\ 27 \\ 45 \end{pmatrix} \neq (-1) \begin{pmatrix} 2 \\ 1 \\ -1 \end{pmatrix}$$

Man kann ausrechnen:

$$\tilde{w}_1 = \begin{pmatrix} 0 \\ 1 \\ 2 \end{pmatrix} \text{ EV zu EW } -1, \tilde{w}_2 = \begin{pmatrix} 0 \\ 1 \\ 1 \end{pmatrix}, \tilde{w}_3 \text{ EV zu EW } 3$$

Übertragung auf Endomorphismen?

$$p_f(\lambda) \quad f \in L(V, V), B \text{ Basis} \implies \exists! A_f^{B,B}, C \text{ Basis} \implies \exists! A_f^{C,C}$$

$$p_{A_f^{B,B}}(\lambda) \stackrel{?}{=} p_{A_f^{C,C}}(\lambda)$$

Definition 1.17: ähnliche Matrizen

Zwei Matrizen $A, B \in K^{n,n}$ heißen **ähnlich**, wenn es eine Matrix $T \in \text{GL}_n(K)$ gibt, so dass $A = TBT^{-1}$ gilt.

Man kann leicht beweisen, dass die Ähnlichkeit von Matrizen eine Äquivalenzrelation auf der Menge der quadratischen Matrizen ist.

Mit $\det(A^{-1}) \stackrel{\text{D11}}{=} (\det(A))^{-1}$ folgte für zwei ähnliche Matrizen A und B , dass

$$\det(A) = \det(TBT^{-1}) = \det(T) \det(B) \det(T^{-1}) = \det(B)$$

Beispiel 1.18: Sei $f \in L(\mathbb{R}^3, \mathbb{R}^3)$, d.h. $V = \mathbb{R}^3$, gegeben durch

$$f\left(\begin{pmatrix} x_1 \\ x_2 \\ x_3 \end{pmatrix}\right) = \begin{pmatrix} x_1 \\ -4x_1 + 7x_2 \\ 3x_1 + 5x_2 + 3x_3 \end{pmatrix}$$

Wir betrachten für den \mathbb{R}^3 die Basen

$$E = \left\{ \begin{pmatrix} 1 \\ 0 \\ 0 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 0 \\ 1 \\ 0 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 0 \\ 0 \\ 1 \end{pmatrix} \right\},$$

$$B = \left\{ \begin{pmatrix} 1 \\ 0 \\ 0 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 1 \\ 1 \\ 0 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 1 \\ 1 \\ 1 \end{pmatrix} \right\},$$

$$C = \left\{ \begin{pmatrix} 0 \\ 0 \\ -1 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 1 \\ 0 \\ 0 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 0 \\ -1 \\ 0 \end{pmatrix} \right\}$$

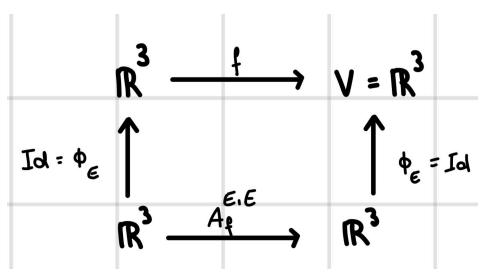
Für darstellende Matrix von f bezüglich der Standardmatrix E erhalten wir aus Satz 5.18, LinA I,

$$f(e_j) = \sum_{i=1}^3 a_{ij} e_i \quad \forall j \in \{1, 2, 3\}$$

dass

$$A_f^{E,E} = \begin{pmatrix} 1 & 0 & 0 \\ -4 & 7 & 0 \\ 3 & 5 & 3 \end{pmatrix}$$

Das zugehörige kommutative Diagramm ist gegeben durch



Für die Basis B erhalten wir

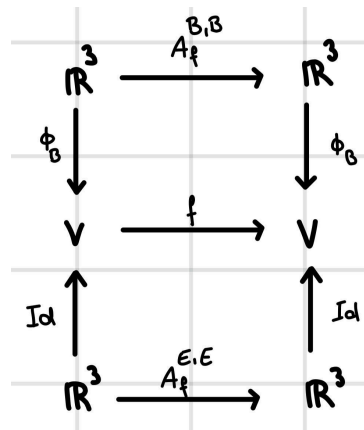
$$f\left(\begin{pmatrix} 1 \\ 0 \\ 0 \end{pmatrix}\right) = \begin{pmatrix} 1 \\ -4 \\ 3 \end{pmatrix} = 5\begin{pmatrix} 1 \\ 0 \\ 0 \end{pmatrix} + (-7)\begin{pmatrix} 1 \\ 1 \\ 0 \end{pmatrix} + 3\begin{pmatrix} 1 \\ 1 \\ 1 \end{pmatrix}$$

$$f\left(\begin{pmatrix} 1 \\ 1 \\ 0 \end{pmatrix}\right) = \begin{pmatrix} 1 \\ 3 \\ 8 \end{pmatrix} = (-2)\begin{pmatrix} 1 \\ 0 \\ 0 \end{pmatrix} + (-5)\begin{pmatrix} 1 \\ 1 \\ 0 \end{pmatrix} + 8\begin{pmatrix} 1 \\ 1 \\ 1 \end{pmatrix}$$

$$f\left(\begin{pmatrix} 1 \\ 1 \\ 1 \end{pmatrix}\right) = \begin{pmatrix} 1 \\ 3 \\ 11 \end{pmatrix} = (-2)\begin{pmatrix} 1 \\ 0 \\ 0 \end{pmatrix} + (-8)\begin{pmatrix} 1 \\ 1 \\ 0 \end{pmatrix} + 11\begin{pmatrix} 1 \\ 1 \\ 1 \end{pmatrix}$$

$$\Rightarrow A_f^{B,B} = \begin{pmatrix} 5 & -2 & -2 \\ -7 & -5 & -8 \\ 3 & 8 & 11 \end{pmatrix}$$

Herleitung bezüglich Matrizen?



Koordinatenabbildung Φ_B ?

Abbildung vom \mathbb{R}^3 + Standardbasis E in den $V(= \mathbb{R}^3)$ + Basis B .

$$\Phi_B = (e_i) = v_i \quad \text{für} \quad B = \{v_1, v_2, v_3\}$$

$$\Rightarrow A_{\Phi_B}^{E,B} = \begin{pmatrix} 1 & 1 & 1 \\ 0 & 1 & 1 \\ 0 & 0 & 1 \end{pmatrix}$$

Damit folgt insgesamt:

$$A_f^{B,B} = (A_{\Phi_B}^{E,B})^{-1} I_n A_f^{E,E} I_n^{-1} A_{\Phi_B}^{E,B} = (A_{\Phi_B}^{E,B})^{-1} A_f^{E,E} \underbrace{A_{\Phi_B}^{E,B}}_{\in \text{GL}_n(\mathbb{R})}$$

$$\Rightarrow A_f^{B,B} \text{ und } A_f^{E,E} \text{ sind ähnlich}$$

Für die Basis C erhalten wir

$$f\left(\begin{pmatrix} 0 \\ 0 \\ -1 \end{pmatrix}\right) = \begin{pmatrix} 0 \\ 0 \\ -3 \end{pmatrix} = 3 \begin{pmatrix} 0 \\ 0 \\ -1 \end{pmatrix} + 0 \begin{pmatrix} 1 \\ 0 \\ 0 \end{pmatrix} + 0 \begin{pmatrix} 0 \\ -1 \\ 0 \end{pmatrix}$$

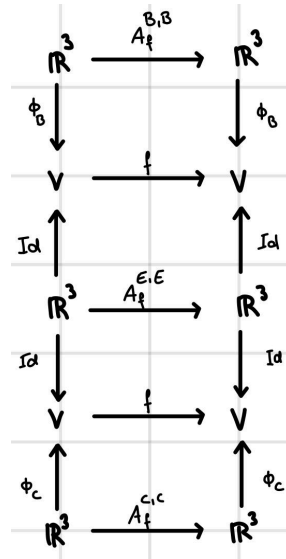
$$f\left(\begin{pmatrix} 1 \\ 0 \\ 0 \end{pmatrix}\right) = \begin{pmatrix} 1 \\ -4 \\ 3 \end{pmatrix} = (-3) \begin{pmatrix} 0 \\ 0 \\ -1 \end{pmatrix} + 1 \begin{pmatrix} 1 \\ 0 \\ 0 \end{pmatrix} + 4 \begin{pmatrix} 0 \\ -1 \\ 0 \end{pmatrix}$$

$$f\left(\begin{pmatrix} 0 \\ -1 \\ 0 \end{pmatrix}\right) = \begin{pmatrix} 0 \\ -7 \\ -5 \end{pmatrix} = 5 \begin{pmatrix} 0 \\ 0 \\ -1 \end{pmatrix} + 0 \begin{pmatrix} 1 \\ 0 \\ 0 \end{pmatrix} + 7 \begin{pmatrix} 0 \\ -1 \\ 0 \end{pmatrix}$$

Als Darstellungsmatrix erhält man

$$A_f^{C,C} = \begin{pmatrix} 3 & -3 & 5 \\ 0 & 1 & 0 \\ 0 & 4 & 7 \end{pmatrix}$$

Als Matrizenmultiplikation



Darstellung von Φ_C ? $\Phi_C(e_i) = w_i$ für $C = \{w_1, w_2, w_3\}$

$$A_{\Phi_C}^{E,C} = \begin{pmatrix} 0 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & -1 \\ -1 & 0 & 0 \end{pmatrix}$$

$$A_f^{C,C} = (A_{\Phi_C}^{E,C})^{-1} I_n A_f^{E,E} I_n^{-1} A_{\Phi_C}^{E,C} = (A_{\Phi_C}^{E,C})^{-1} A_f^{E,E} A_{\Phi_C}^{E,C}$$

Also auch: $A_f^{C,C}$ ist ähnlich zu $A_f^{E,E}$.

Alternativ:

$$\begin{aligned} A_f^{C,C} &= (A_{\Phi_C}^{E,C})^{-1} I_n I_n^{-1} A_{\Phi_B}^{E,B} A_f^{B,B} (A_{\Phi_B}^{E,B})^{-1} I_n A_{\Phi_C}^{E,C} \\ &= \underbrace{(A_{\Phi_C}^{E,C})^{-1} A_{\Phi_B}^{E,B} A_f^{B,B} (A_{\Phi_B}^{E,B})^{-1}}_{\in \text{GL}_n(\mathbb{R})} A_{\Phi_C}^{E,C} \end{aligned}$$

Jetzt allgemein: $f \in L(V, V)$, $\dim(V) < \infty$, B, C seien Basen von $V \Rightarrow$

$$A := A_f^{B,B} \quad \tilde{A} := A_f^{C,C}$$

und es existiert $T \in \text{GL}_n(K)$ als Basistransformationsmatrix, so dass

$$\tilde{A} = T A T^{-1}$$

Dann gilt

$$\begin{aligned} p_{\tilde{A}}(\lambda) &= \det(\tilde{A} - \lambda I_n) = \det(T A T^{-1} - \lambda T T^{-1}) \\ &= \det(T(A - \lambda I_n)T^{-1}) \\ &= \det(T) \det(A - \lambda I_n) \det(T^{-1}) \\ &= p_A(\lambda) \end{aligned}$$

D.h. für einen Endomorphismus ist das charakteristische Polynom der zugehörigen Darstellungsmatrix unabhängig von der Wahl der Basis!

Damit ist es sinnvoll, für $f \in L(V, V)$, $\dim(V) < \infty$,

$$p_f(\cdot) := p_A(\cdot)$$

für A als Darstellungsmatrix $A_f^{B,B}$ für eine Basis B .

Lemma 1.19: Sei V ein K -Vektorraum mit $\dim(V) = n < \infty$ und $f \in L(V, V)$. Dann sind folgende Aussagen äquivalent:

1. $\lambda \in K$ ist ein Eigenwert von f .
2. $\lambda \in K$ ist ein Eigenwert der Darstellungsmatrix $A_f^{B,B}$ für eine gewählte B von V .

Des weiteren gilt auch. Für zwei ähnliche A und B gilt $p_A(\lambda) = p_B(\lambda)$

$$A, B \text{ ähnlich} \implies p_A(\lambda) = p_B(\lambda)$$

z.B.

$$A = \begin{pmatrix} 1 & 0 \\ 2 & 1 \end{pmatrix} \quad B = \begin{pmatrix} 1 & 0 \\ 0 & 1 \end{pmatrix}$$

$$p_A(\lambda) = (1 - \lambda)^2 = p_B(\lambda), \text{ aber für jedes } T \in \text{GL}_2(\mathbb{R}) \text{ gilt}$$

$$TBT^{-1} = TT^{-1} = I \neq A \text{ also } A, B \text{ nicht ähnlich}$$

Weitere Beobachtung: Aus Lemma 1.13 und Lemma 1.19 folgt, dass die Eigenwerte von $f \in L(V, V)$ die Nullstellen des charakteristischen Polynoms der Matrix $A_f^{B,B}$ für eine Basis B ist. Dies gilt **nicht** i.a. für Darstellungsmatrizen $A_f^{B,C}$ für $B \neq C$.

Definition 1.20: Algebraische Vielfachheit

Sei V ein K -Vektorraum mit $\dim(V) = n < \infty$. Ist $f \in L(V, V)$ und $\tilde{\lambda}$ ist Eigenwert von f hat das charakteristische Polynom $p_f(\lambda)$ die Form

$$p_f(\lambda) = (\lambda - \tilde{\lambda})^d \cdot \tilde{p}(\lambda)$$

für ein $\tilde{p}(\cdot) \in \mathbb{K}[\lambda]$ mit $\tilde{p}(\tilde{\lambda}) \neq 0$, so nennt man d die **algebraische Vielfachheit** von $\tilde{\lambda}$ und bezeichnet sie $a(f, \tilde{\lambda})$.

Lemma 1.21: Seien V ein K -Vektorraum, $\dim(V) = n < \infty$, und $f \in L(V, V)$. Für Eigenwert $\tilde{\lambda}$ von f gilt

$$g(f, \tilde{\lambda}) \leq a(f, \tilde{\lambda})$$

Beweis: Ist $\tilde{\lambda}$ EW von f mit der geometrischen Vielfachheit $m := g(f, \tilde{\lambda})$, so gibt es nach Def. 1.10 zu $\tilde{\lambda}$ m linear unabhängige Eigenvektoren $v_1, \dots, v_m \in V$.

Gilt $m = n = \dim(V)$ sind $\{v_1, \dots, v_m\}$ schon Basis von V .

Gilt $m < n$, so folgt aus dem Basisergänzungssatz (Satz 3.21, LinA I), dass man $\{v_1, \dots, v_m\}$ zu einer Basis $\{v_1, \dots, v_m, v_{m+1}, \dots, v_n\} =: B$ ergänzen. Wegen $f(v_j) = \tilde{\lambda}v_j, 1 \leq j \leq m$, gilt

$$A_f^{B,B} = \begin{pmatrix} \tilde{\lambda}I_n & A_1 \\ 0 & A_2 \end{pmatrix} \in K^{n,n}$$

für zwei Matrizen $A_1 \in K^{m,n-m}, A_2 \in K^{n-m,n-m}$.

Mit D9 aus LinA I folgt

$$p_f(\lambda) = (\tilde{\lambda} - \lambda)^m \cdot \det(A_2 - \lambda I_{n-m,n-m})$$

\Rightarrow EW $\tilde{\lambda}$ ist mindestens m -fache Nullstelle von $p_f(\lambda)$. Für $m = n \Rightarrow A_f^{B,B} = \tilde{\lambda}I_n \Rightarrow p_f(\lambda) = (\tilde{\lambda} - \lambda)^n$

□

2. Diagonalisierbarkeit und Normalform

2.1. Diagonalisierbarkeit

Definition 2.1: Diagonalisierbar

Sei V ein K -Vektorraum mit $\dim(V) = n < \infty$. Ein $f \in L(V, V)$ heißt **diagonalisierbar**, wenn es eine Basis B von V gibt, so dass $A_f^{B,B}$ eine Diagonalmatrix ist. D.h. es existieren $\lambda_1, \dots, \lambda_n \in K$ mit

$$A_f^{B,B} = \begin{pmatrix} \lambda_1 & \dots & 0 \\ \vdots & \ddots & \vdots \\ 0 & \dots & \lambda_n \end{pmatrix} \in K^{n,n}$$

Entsprechend nennen wir eine Matrix $A \in K^{n,n}$ **diagonalisierbar**, wenn es eine Matrix $T \in \text{GL}_n(K)$ und eine Diagonalmatrix $D \in K^{n,n}$ gibt mit

$$A = TDT^{-1}$$

D.h. A ist ähnlich zu einer Diagonalmatrix.

Satz 2.2: Sei V ein K -Vektorraum mit $\dim(V) = n < \infty$ und $f \in L(V, V)$. Dann sind folgende Aussagen äquivalent:

1. f ist diagonalisierbar
2. Es gibt eine Basis B von V bestehend aus Eigenvektoren von f .
3. Das charakteristische Polynom $p_f(\cdot)$ zerfällt in n Linearfaktoren über K , d.h.

$$p_f(\lambda) = (\lambda - \lambda_1) \cdot \dots \cdot (\lambda - \lambda_n)$$

mit Eigenwerten $\lambda_1, \dots, \lambda_n \in K$ für f und für jeden Eigenwert $\tilde{\lambda}$ gilt $a(f, \tilde{\lambda}) = g(f, \tilde{\lambda})$.

Beweis:

“1 \Rightarrow 2”: f diagonalisierbar $\Rightarrow \exists \{v_1, \dots, v_n\} = B$ Basis von V , $\lambda_1, \dots, \lambda_n \in K$:

$$\tilde{A} := A_f^{B,B} = \begin{pmatrix} \lambda_1 & \dots & 0 \\ \vdots & \ddots & \vdots \\ 0 & \dots & \lambda_n \end{pmatrix} \quad f(v_j) = \sum_{i=1}^n a_{ij} v_i$$

$\Rightarrow f(v_j) = \lambda_j v_j, 1 \leq j \leq n, v_j \neq 0. \Rightarrow$ Damit sind $\lambda_1, \dots, \lambda_n$ Eigenwerte von f mit zugehörigen Eigenvektoren $v_1, \dots, v_n. \Rightarrow 2$.

“2 \Rightarrow 1”: Ist $B = \{v_1, \dots, v_n\}$ eine Basis von V bestehend aus Eigenvektoren, so gibt es zugehörige Eigenwerte $\lambda_1, \dots, \lambda_n$ mit $f(v_j) = \lambda_j v_j, 1 \leq j \leq n \Rightarrow$

$$A_f^{B,B} = \begin{pmatrix} \lambda_1 & \dots & 0 \\ \vdots & \ddots & \vdots \\ 0 & \dots & \lambda_n \end{pmatrix}$$

“2 \Rightarrow 3”: Sei $B = \{v_1, \dots, v_n\}$ eine Basis von Eigenvektoren, $\lambda_1, \dots, \lambda_n$ seien die zugehörigen Eigenwerte \Rightarrow

$$\begin{aligned} p_f(\lambda) &= p_{A_f^{B,B}}(\lambda) = \det(A_f^{B,B} - \lambda I_n) \\ &= (\lambda_1 - \lambda) \cdot (\lambda_2 - \lambda) \cdot \dots \cdot (\lambda_n - \lambda) \end{aligned}$$

$\Rightarrow p_f(\cdot)$ zerfällt in Linearfaktoren. Verschiedene Eigenwerte $\tilde{\lambda}_1, \dots, \tilde{\lambda}_k, k \leq n$. Der Eigenwert $\tilde{\lambda}_i$ besitzt die algebraische Vielfachheit $m_j := a(f, \tilde{\lambda}_j)$ genau dann, wenn er m_j -mal auf den Diagonalen von $A_f^{B,B}$ steht. Dies ist genau dann der Fall, wenn m_j Eigenvektoren zu $\tilde{\lambda}_j$ in B enthalten sind. Diese sind linear unabhängig \Rightarrow

$$1. \dim(\text{Eig}(f, \tilde{\lambda}_j)) = g(f, \tilde{\lambda}_j) \geq m_j = a(f, \tilde{\lambda}_j)$$

$$2. \text{ Lemma 1.21: } g(f, \tilde{\lambda}_j) \leq a(f, \tilde{\lambda}_j)$$

$$1 \wedge 2 \Rightarrow g(f, \tilde{\lambda}_j) = a(f, \tilde{\lambda}_j)$$

“3 \Rightarrow 2”: Seien $\tilde{\lambda}_1, \dots, \tilde{\lambda}_k, k \leq n$ die paarweise verschiedenen Eigenwerte von f . Wir wissen: $\mathcal{P}_n \in p_f(\cdot)$ zerfällt in Linearfaktoren, $a(f, \tilde{\lambda}_j) = g(f, \tilde{\lambda}_j), 1 \leq j \leq n$.

$$\dim(V) = n = \sum_{j=1}^k a(f, \tilde{\lambda}_j) = \sum_{j=1}^k g(f, \tilde{\lambda}_j) = \sum_{j=1}^k \dim(\text{Eig}(f, \tilde{\lambda}_j))$$

Es gilt (Lemma 1.8):

$$\text{Eig}(f, \tilde{\lambda}_j) \cap \sum_{i=1}^k \text{Eig}(f, \tilde{\lambda}_i) = 0 \quad \forall j = 1, \dots, k$$

Dann folgt (Lemma 3.31, (2), Lemma 3.35, Satz 3.14) (direkte Summe, $U \subset V$ UVR $\Rightarrow \dim(U) \leq \dim(V)$, $U = V \Leftrightarrow \dim(U) = \dim(V)$, Basis \Leftrightarrow eindeutige Darstellung), dass die zu $\tilde{\lambda}_1, \dots, \tilde{\lambda}_n$ linear unabhängigen Eigenvektoren, die jeweils eine Basis von $\text{Eig}(f, \tilde{\lambda}_j), 1 \leq j \leq k$, eine Basis von V bilden.

□

In Verbindung mit Lemma 1.6 folgt unmittelbar:

Korollar 2.3: Sei V ein K -Vektorraum mit $\dim(V) = n < \infty$ und $f \in L(V, V)$ mit n paarweise verschiedenen Eigenwerten, dann ist f diagonalisierbar.

Bemerkung: Das Kriterium der n paarweise verschiedenen Eigenwerte ist nicht notwendig z.B. $V = K^n$, $B = E$ Standardbasis

$$f : \text{Id} : K^n \rightarrow K^n, \implies A_f^{E,E} = I_n \implies 1n\text{-facher Eigenwert}$$

Beispiel 2.4: Fortsetzung von Bsp. 1.14

$$A = \begin{pmatrix} 3 & 8 & 16 \\ 0 & 7 & 8 \\ 0 & -4 & -5 \end{pmatrix}, \text{EW: } -1, 3$$

$$w_1 = \begin{pmatrix} 2 \\ 1 \\ -1 \end{pmatrix} \text{ EV zu } -1, \quad w_2 = \begin{pmatrix} 1 \\ 2 \\ -1 \end{pmatrix}, \quad w_3 = \begin{pmatrix} -1 \\ 2 \\ -1 \end{pmatrix} \text{ EV zu } 3$$

$\implies \exists$ Basis von Eigenvektoren $\xrightarrow{\text{Satz 2.2}} A$ ist diagonalisierbar

$$p_A(\lambda) = (3 - \lambda)(\lambda + 1)(\lambda - 3)$$

$$a(f, -1) = 1 = g(f, -1)$$

$$a(f, 3) = 2 = g(f, 3)$$

$T \in \text{GL}_n(\mathbb{R})$ so, dass $T^{-1}AT = D$?

Die zu $B = \{w_1, w_2, w_3\}$ gehörende Koordinatentransformation Φ_B ist gegeben durch

$$A_{\Phi_B}^{E,B} = \begin{pmatrix} 2 & 1 & -1 \\ 1 & 2 & 2 \\ -1 & -1 & -1 \end{pmatrix}$$

Dann gilt: Für $f \in L(\mathbb{R}^3, \mathbb{R}^3)$ mit

$$A_f^{E,E} = A \quad A_f^{B,B} = \begin{pmatrix} -1 & 0 & 0 \\ 0 & 3 & 0 \\ 0 & 0 & 3 \end{pmatrix} = D$$

Mit Basiswechsel von A zu D

$$D = (A_{\Phi_B}^{E,B})^{-1} \underbrace{A A_{\Phi_B}^{E,B}}_{=T}$$

Beispiel 2.5: Nicht jeder Endomorphismus bzw. jede Matrix ist diagonalisierbar. Bsp. 1.4:

$$f : \mathbb{R}^2 \rightarrow \mathbb{R}^2, \quad f\left(\begin{pmatrix} x_1 \\ x_2 \end{pmatrix}\right) = \overbrace{\begin{pmatrix} 0 & 1 \\ -1 & 0 \end{pmatrix}}^A \begin{pmatrix} x_1 \\ x_2 \end{pmatrix}, \quad p_f(\lambda) = \lambda^2 + 1$$

D.h. über \mathbb{R} zerfällt $p_f(\cdot)$ nicht in Linearfaktoren.

Ein weiteres Beispiel

$$A = \begin{pmatrix} 5 & 10 & 7 \\ 0 & -3 & -3 \\ 0 & 3 & 3 \end{pmatrix}$$

$\Rightarrow p_A(\lambda) = (5 - \lambda)\lambda^2 \Rightarrow p_A(\cdot)$ zerfällt in Linearfaktoren. $a(f, \lambda_i), g(f, \lambda_i)$ für $\lambda_1 = 5, \lambda_2 = 0$. Lemma 1.21: $g(f, \lambda_i) \leq a(f, \lambda_i) \Rightarrow g(f, 5) = 1 = a(f, 5)$, $a(f, 0) = 2, g(f, 0) \geq 1$ Ein Eigenvektor zu $\lambda = 0$ sind

$$w_1 = \begin{pmatrix} 3 \\ -5 \\ 5 \end{pmatrix} \Rightarrow g(f, 0) = 1 < 2 = a(f, 0)$$

$\Rightarrow f$ nicht diagonalisierbar.

Mit Satz 2.2 erhält man einen Algorithmus zur Überprüfung, ob ein gegebenes $f \in L(V, V)$ (bzw. $A \in K^{n,n}$) diagonalisierbar ist:

1. Bestimme mit einer Basis B von V die Darstellungsmatrix $A = A_f^{B,B}$
2. Bestimme für A das charakteristische Polynom $p_A(\cdot)$ (Determinantenberechnung)
3. Zerfällt $p_A(\cdot)$ in Linearfaktoren über K ? Nein: f nicht diagonalisierbar. Ja: Seien $\lambda_i, 1 \leq i \leq k \leq n = \dim(V)$ die paarweise verschiedene Eigenwerte von f .

Für $i = 1, \dots, k$

1. Bestimme eine Basis von $\text{Eig}(f, \lambda_i)$
2. Prüfe, ob $a(f, \lambda_i) = g(f, \lambda_i)$

Gilt $a(f, \lambda_i) = g(f, \lambda_i)$ für alle $i \in \{1, \dots, k\}$. Nein: f ist nicht diagonalisierbar. Ja: f ist diagonalisierbar.

Beispiel 2.6: Fischer/Springborn

Betrachtet wird: Masse aufgehängt an einer Feder. Zur Zeit $t = 0$ in Position $y(0) = \alpha$ und ausgelenkt in senkrechter Richtung mit Geschwindigkeit $\beta = \dot{y}(0)$

$y(t) \hat{=}$ Position der Masse zum Zeitpunkt t



Dieses System wird durch die gewöhnliche Differentialgleichungen

$$\ddot{y} + 2\mu\dot{y} + \omega^2 y = 0, \quad y(0) = \alpha, \dot{y}(0) = \beta$$

Umschreiben

$$\dot{y}_0 = y_1$$

$$\dot{y}_1 = -\omega^2 y_0 - 2\mu y_1$$

mit $y_0 = y, \ddot{y}_0 = \ddot{y}, y_0(0) = \alpha, y_1(0) = \beta$.

$$\dot{\tilde{y}} := \begin{pmatrix} \dot{y}_0 \\ \dot{y}_1 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 0 & 1 \\ -\omega^2 & -2\mu \end{pmatrix} \begin{pmatrix} y_0 \\ y_1 \end{pmatrix}$$

$$p_A(\lambda) = \lambda^2 + 2\mu\lambda + \omega^2$$

mit den potentiellen Nulstellen

$$\lambda = -\mu \pm \sqrt{\mu^2 - \omega^2}$$

Man unterscheidet drei Fälle:

- $0 \leq \mu < \omega$, d.h. $\mu^2 - \omega^2 < 0 \implies$ schwache Dämpfung
- $\mu = \omega$, d.h. $\mu^2 = \omega^2 \implies$ aperiodischer Fall $\implies a(A, -\mu) = 2$,
 $\dim(\text{Eig}(A, -\mu)) = 1$, A nicht diagonalisierbar
- $\mu > \omega$, d.h. $\mu^2 > \omega^2$, starke Dämpfung

Eine solche Eigenwertanalyse kann auch nutzen, um das Langzeitverhalten von Lösungen von gewöhnlichen DGL zu bestimmen.



Satz 2.7: Sei V ein K -Vektorraum mit $\dim(V) = n < \infty$ und $f \in L(V, V)$. Dann sind folgende Aussagen äquivalent:

1. Das charakteristische Polynom $p_f(\cdot)$ zerfällt über K in Linearfaktoren.
2. Es gibt eine Basis B von V , so dass $A_f^{B,B}$ eine obere Dreiecksmatrix ist, d.h.

$$A_f^{B,B} = \begin{pmatrix} 1 & \dots & * \\ \vdots & \ddots & \vdots \\ 0 & \dots & * \end{pmatrix}$$

und f ist damit **triangulierbar**.

Beweis: Beweis von Satz 14.18 im Liesen/Mehrmann

□

Nun ist das Ziel:

Bestimmung einer Basis B von V , so dass $A_f^{B,B}$ eine obere Dreiecksmatrix ist, die möglichst nah an einer Diagonalmatrix ist und von der geometrischen Vielfachheiten der Eigenwerte abgelesen werden können.

D.h. $p_f(\cdot)$ zerfällt in Linearfaktoren mit den Eigenwerten $\lambda_1, \dots, \lambda_k$ (notwendig, Satz 2.7) und wir wollen eine Basis B bestimmen, so dass $A_f^{B,B}$ Diagonalblockgestalt hat mit

$$A_f^{B,B} = \begin{pmatrix} J_1(\lambda_1) & \dots & 0 \\ \vdots & \ddots & \vdots \\ 0 & \dots & J_m(\lambda_m) \end{pmatrix}$$

wobei jeder Diagonalblock die Form

$$J_i(\lambda_i) = \begin{pmatrix} \lambda_i & 1 & \dots & 0 \\ 0 & \ddots & \ddots & \vdots \\ \vdots & \ddots & \ddots & 1 \\ 0 & \dots & 0 & \lambda_i \end{pmatrix} \in K^{d_i, d_i} \quad (*)$$

Definition 2.8: Jordan-Block

Sei V ein K -Vektorraum mit $\dim(V) = n < \infty$, $f \in L(V, V)$ und λ_i ein Eigenwert von f . Eine Matrix der Form $(*)$ heißt **Jordan-Block** der Größe d_i zum Eigenwert λ_i .

Wegen der Bedeutung der Jordan-Normalform gibt es zahlreiche Herleitungen mit unterschiedlichen mathematischen Hilfsmitteln.

Hier: Beweis über die Dualitätstheorie basierend auf einer Arbeit von V. Pt \bar{a} k (1956)

2.2. Dualräume

Definition 2.9: Linearform, Dualraum

Sei V ein K -Vektorraum. Eine Abbildung $f \in L(V, K)$ heißt **Linearform**. Den K -Vektorraum $V^* := L(V, K)$ nennt man **Dualraum**.

Gilt $\dim(V) = n < \infty$ so folgt aus Satz 5.18 LinA I, dass $\dim(V^*) = n$ gilt. Ist $B = \{v_1, \dots, v_n\}$ eine Basis von V und $C = \{1\}$ eine Basis des K -Vektorraum K , dann gilt für

$$f(v_i) = \mu_i \in K \quad \text{für } f \in V^*, \text{ d.h. } f : V \rightarrow K,$$

für $i = 1, \dots, n$ und damit

$$A_f^{B,C} = (\mu_1, \dots, \mu_n) \in K^{1,n}$$

Beispiel 2.10: Sei V der \mathbb{R} -Vektorraum der auf dem Intervall $[0, 1]$ stetigen, reellwertigen Funktionen und $a \in [0, 1]$. Dann sind

$$g_1 : V \rightarrow \mathbb{R}, \quad g_1(f) := \int_0^1 f(x) dx$$

$$g_2 : V \rightarrow \mathbb{R}, \quad g_2(f) := f(a)$$

Linearformen auf V .

Basis des Dualraums?

Satz 2.11: Sei V ein K -Vektorraum mit $\dim(V) = n < \infty$ und $B = \{v_1, \dots, v_n\}$ eine Basis von V . Dann gibt es genau eine Basis $B^* = \{v_1^*, \dots, v_n^*\}$ von $V^* = L(V, K)$ für die

$$v_i^*(v_j) = \delta_{ij} \quad i, j = 1, \dots, n$$

gilt. Diese Basis heißt die zu B duale Basis.

Beweis: Lemma 4.10: LinA I. Es gibt eine lineare Abbildung v_i^* für die $v_i^*(v_j) = \delta_{ij}$ für $j = 1, \dots, n$, für $i = 1, \dots, n$. Noch zu zeigen: v_i^* sind Basis von V^* . Wir wissen schon: $\dim(V^*) = n$. Also: Es reicht zu zeigen: $\{v_i^*\}_{i=1, \dots, n}$ linear unabhängig. Seien $\mu_i \in K$ so, dass

$$\sum_{i=1}^n \mu_i v_i^* = 0 \in V^* = L(V, K)$$

Dann gilt:

$$0_K = 0_{V^*}(v_j) = \sum_{i=1}^n \mu_i v_i^*(v_j) = \mu_j \quad j = 1, \dots, n$$

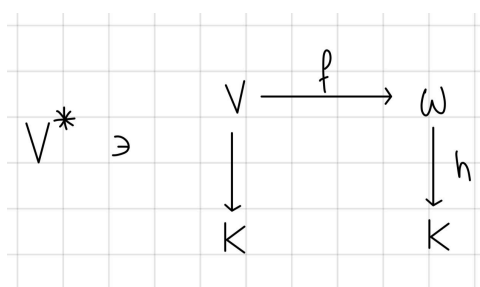
□

Definition 2.12: duale Abbildung

Seien V und W zwei K -Vektorräume mit den zugehörigen Dualräumen V^* und W^* . Für $f \in L(V, W)$ heißt

$$f^* : W^* \rightarrow V^*, \quad f^*(h) = h \circ f$$

die zu f **duale Abbildung**.



Seien $U \subseteq V$ und $Z \subseteq V^*$ zwei Unterräume. Dann heißt die Menge

$$U^0 := \{h \in V^* \mid h(u) = 0 \text{ für alle } u \in U\}$$

Annihilator von U und die Menge

$$Z^0 := \{v \in V \mid z(v) = 0 \text{ für alle } z \in Z\}$$

Annihilator von Z .

Man kann sich überlegen:

- Die Mengen $U^0 \subseteq V^*$ und $Z^0 \subseteq V$ sind Untervektorräume von V^* bzw V
- Es gilt für $f \in L(V, V)$

$$(f^k)^* = (f^*)^k$$

Des Weiteren besitzt die duale Abbildung folgende Eigenschaften:

Lemma 2.13: Sind V, W und X drei K -Vektorräume. Dann gilt

1. Ist $f \in L(V, W)$, dann ist die duale Abbildung f^* linear, d.h. $f^* \in L(W^*, V^*)$
2. Ist $f \in L(V, W)$ und $g \in L(W, X)$, dann ist $(g \circ f)^* \in L(X^*, V^*)$ und es gilt $(g \circ f)^* = f^* \circ g^*$
3. Ist $f \in L(V, W)$ bijektiv, dann ist $f^* \in L(W^*, V^*)$ bijektiv und es gilt $(f^*)^{-1} = (f^{-1})^*$

Beweis: ÜB



Lemma 2.14: Sei V ein endlichdimensionaler Vektorraum, $f \in L(V, V)$, $f^* \in L(V^*, V^*)$ und $U \subseteq V$, sowie $W \subseteq V^*$ zwei Vektorräume. Dann gilt:

1. $\dim(V) = \dim(W) + \dim(W^0)$
2. Ist f nilpotent vom Grad m , dann ist die duale Abbildung f^* ebenfalls nilpotent vom Grad m .
3. Ist $W \subseteq V^*$ ein f^* -invarianter Vektorraum, dann ist W^0 ein f -invarianter Unterraum.

Beweis: ÜA



Definition 2.15: nilpotent vom Grad m

Sei $\{0\} \neq V$ ein K -Vektorraum. Man nennt $f \in L(V, V)$ **nilpotent**, wenn ein $m \in \mathbb{N}$ existiert, so dass $f^m = 0 \in L(V, V)$ gilt. Gilt für dieses m , dass $f^{m-1} \neq 0 \in L(V, V)$, so heißt f **nilpotent vom Grad m** und m ist der **Nilpotenzindex** von f .

Definition 2.16: f -invarianter Unterraum

Sei V ein K -Vektorraum mit $\dim(V) = n < \infty$, $U \subseteq V$ ein Unterraum und $f \in L(V, V)$. Gilt $f(U) \subseteq U$, d.h. ist $f(u) \in U$ für alle $u \in U$, so nennt man U einen f -invarianten Unterraum von V .

Definition 2.17: Bilinearform

Seien V und W zwei K -Vektorräume. Eine Abbildung $a : V \times W \rightarrow K$ heißt Bilinearform, wenn

1. $a(\cdot, w) : V \rightarrow K$ für alle $w \in W$ eine lineare Abbildung ist und
2. $a(v, \cdot) : W \rightarrow K$ für alle $v \in V$ eine lineare Abbildung ist

Eine Bilinearform $a(\cdot, \cdot)$ heißt **nicht ausgeartet** in der ersten Variable, wenn aus

$$a(v, w) = 0 \quad \text{für alle } w \in W$$

folgt, dass $v = 0$ ist. Eine Bilinearform heißt nicht ausgeartet in der zweiten Variable, wenn aus

$$a(v, w) = 0 \quad \text{für alle } v \in V$$

folgt, dass $w = 0$ ist. Falls $a(\cdot, \cdot)$ in beiden Variablen nicht ausgeartet ist, so nennt man $a(\cdot, \cdot)$ eine **nicht ausgeartete Bilinearform** und die Räume V, W ein **duales Paar von Räumen** oder **duales Raumpaar** bezüglich $a(\cdot, \cdot)$. Ist $V = W$, so heißt $a(\cdot, \cdot)$ eine **Bilinearform auf V** . Eine Bilinearform $a(\cdot, \cdot)$ auf V heißt **symmetrisch**, wenn $a(v, w) = a(w, v)$ für alle $v, w \in V$, ansonsten heißt $a(\cdot, \cdot)$ unsymmetrisch.

Bemerkung: Damit V, W ein duales Raumpaar für eine nicht ausgeartete Bilinearform bilden können, muss $\dim(V) = \dim(W)$ gelten.

Lemma 2.18: Sei V ein endlichdimensionaler K -Vektorraum, $f \in L(V, V)$, $f^* \in L(V^*, V^*)$ die duale Abbildung zu f , $U \subseteq V$ und $W \subseteq V^*$ zwei Untervektorräume. Ist die Bilinearform

$$a : U \times W \rightarrow K, (v, h) \mapsto h(v)$$

nicht ausgeartet ist, d.h. sind U und W ein duales Raumpaar bezüglich dieser Bilinearform, so ist

$$V = U \oplus W^0$$

Beweis: Sei $u \in U \cap W^0$. Dann gilt $h(u) = 0$ für alle $h \in W$. Weil U, W ein duales Raumpaar bzgl. $a(\cdot, \cdot)$ bilden, folgt $u = 0$. Außerdem $\dim(U) = \dim(W)$ gelten. Damit folgt aus Lemma 2.14, 1., dass

$$\begin{aligned} \dim(V) &= \dim(W) + \dim(W^0) \\ &= \dim(U) + \dim(W^0) \end{aligned}$$

$$\Rightarrow V = U \oplus W^0$$

□

2.3. Zyklische f -invariant Unterräume

Jetzt: Genauere Analyse der Struktur von Eigenräumen

Beispiel: Ist V ein K -Vektorraum, $f \in L(V, V)$ und $\lambda \in K$ ein Eigenwert von f , so ist $\text{Eig}(f, \lambda)$ ein f -invarianter Unterraum, da: Für $v \in \text{Eig}(f, \lambda)$ gilt $f(v) = \lambda v \in \text{Eig}(f, \lambda)$.

Sei V ein K -Vektorraum mit $\dim(V) = n < \infty$ und $f \in L(V, V)$. Ist $v \in V \setminus \{0\}$, so existiert ein eindeutig definiertes $m = m(f, v) \in \mathbb{N}$, sodass die Vektoren

$$v, f(v), f(f(v)), \dots, f^{m-1}(v)$$

linear unabhängig, die Vektoren

$$v, f(v), \dots, f^m(v)$$

jedoch linear abhängig sind. Wegen $\dim(V) = n$, muss $m \leq n$ gelten!

Definition 2.19: Grad von v

Die eindeutig definiert Zahl $m(f, v) \in \mathbb{N}$ heißt Grad von v bezüglich f .

$$0 \neq v, f(v), f^2(v), \dots, f^{m-1}(v) \text{ lin. unabh.}$$

$$v, f(v), \dots, f^m(v) \text{ lin. abh.}$$

\implies Grad m von v , $m \in \mathbb{N}$.

Bemerkungen:

- Der Vektor $v = 0 \in V$ ist lin. abhängig. Deswegen muss man $v \neq 0$ fordern oder $m \in \mathbb{N} \cup \{0\}$.
- Der Grad von $0 \neq v \in V$ ist gleich 1, genau dann wenn $v, f(v)$ linear abhängig sind. Das ist genau dann der Fall wenn v ein Eigenvektor von f ist. Damit folgt auch: Ist $v \in V$ kein Eigenvektor von f und $v \neq 0$, so ist der Grad von v also $m(v, f) \geq 2$.

Definition 2.20: Krylov-Raum

Sei V ein K -Vektorraum mit $\dim(V) = n < \infty$, $f \in L(V, V)$, $v \in V$ und $j \in \mathbb{N}$. Der Unterraum

$$\mathcal{K}_j(f, v) := \text{Span}\{v, f(v), f^2(v), \dots, f^{j-1}(v)\} \subseteq V$$

heißt **j-ter Krylov-Raum** von f und v .

Alexei Krylov (russischer Schiffsbauingenieur und Mathematiker, 1863-1945). Krylov-Räume spielen auch eine wichtige Rolle für das CG-Verfahren (Conjugate Gradients).

Lemma 2.21: Sei V ein K -Vektorraum mit $\dim(V) = n < \infty$ und $f \in L(V, V)$. Dann gilt:

1. Hat $0 \neq v \in V$ den Grad m bzgl. f , so ist $\mathcal{K}_m(f, v)$ ein f -invarianter Unterraum und es gilt:

$$\text{Span } \{v\} = \mathcal{K}_1(f, v) \subset \mathcal{K}_2(f, v) \subset \dots \subset \mathcal{K}_m(f, v) = \mathcal{K}_{m+j}(f, v)$$

für alle $j \in \mathbb{N}$.

2. Hat $0 \neq v \in V$ den Grad m bzgl. f und ist $U \subseteq V$ ein f -invarianter Unterraum, so dass $v \in U$, so ist

$$\mathcal{K}_m(f, v) \subseteq U$$

D.h. betrachtet man alle f -invarianten Unterräume von V , die v enthalten, so ist $\mathcal{K}_m(f, v)$ derjenige mit der kleinsten Dimension.

3. Gilt für $v \in V$, dass $f^{m-1}(v) \neq 0$ und $f^m(v) = 0$ für ein $m \in \mathbb{N}$, dann ist

$$\dim(\mathcal{K}_j(f, v)) = j \quad \text{für } j = 1, \dots, m$$

Beweis:

1. ÜA
2. Sei $U \subseteq V$ ein f -invarianter Unterraum mit $v \in U$. Dann gilt $f^j(v) \in U$ für $j = 1, \dots, m-1$. Da v den Grad m hat, sind $v, f(v), \dots, f^{m-1}(v)$ linear unabhängig. $\implies \mathcal{K}_m(f, v) \subseteq U$ und $\dim(\mathcal{K}_m(f, v)) = m \leq \dim(U)$
3. Seien $\mu_0, \dots, \mu_{m-1} \in K$ so gewählt, dass

$$0 = \mu_0 v + \mu_1 f(v) + \dots + \mu_{m-1} f^{m-1}(v)$$

gilt. Anwendung f^{m-1}

$$0 = \mu_0 f^{m-1}(v) + \mu_1 f^m(v) = \mu_0 \underbrace{f^{m-1}(v)}_{\neq 0}$$

$$\implies \mu_0 = 0$$

Für $m > 1$ kann man dieses Argument induktiv für f^{m-j} , $j = 2, \dots, m$, anwenden und erhält damit

$$\mu_1 = \dots = \mu_{m-1} = 0$$

\implies Beh.

□

Beobachtungen: Hat v den Grad m bzgl. f gilt

- $\mathcal{K}_j(f, v)$ ist für $j < m$ kein f -invarianter Unterraum, da $0 \neq f(f^{j-1}(v)) = f^j(v) \notin \mathcal{K}_j(f, v)$

- wie oben gezeigt, bilden die Vektoren $v, f(v), \dots, f^{m-1}(v)$ eine Basis von $\mathcal{K}_m(f, v)$.
Wendet man f auf ein Element dieser Basis an, d.h. $f^{k+1}(v)$, $k = 0, \dots, m-1$, so erhält man für $k = m-1$ $f^m(v)$ als Linearkombination von $v, f(v), \dots, f^{m-1}(v) \Rightarrow f^m(v) \in \mathcal{K}_m(f, v)$. Deswegen wird $\mathcal{K}_m(f, v)$ auch **zyklische invarianter Unterraum** zu v von f genannt.

Lemma 2.22: Sei $\{0\} \neq V$ ein K -Vektorraum. Ist $f \in L(V, V)$ nilpotent vom Grad m , so gilt $m \leq \dim(V)$.

Beweis: Nach Definition existiert ein $v \in V$ mit $f^{m-1}(v) \neq 0$ und $f^m(v) = 0$. Lemma 2.21 sichert, dass $v, f(v), \dots, f^{m-1}(v)$ linear unabhängig $\Rightarrow m \leq \dim(V)$. □

Beobachtung: Sei V ein K -Vektorraum und $f \in L(V, V)$. Ist $U \subseteq V$ ein f -invarianter Unterraum, so gilt für die Einschränkung von f auf U , d.h.

$$f|_U : U \rightarrow U, \quad u \mapsto f(u),$$

dass $f|_U \in L(U, U)$.

Satz 2.23: Fittingzerlegung

Sei V ein endlichdimensionaler K -Vektorraum und $f \in L(V, V)$. Dann existieren f -invariante Unterräume $U \subseteq V$ und $W \subseteq V$, so dass gilt:

1. $V = U \oplus W$
2. $f|_U \in L(U, U)$ ist bijektiv
3. $f|_W \in L(W, W)$ ist nilpotent

Beweis: $v \in \ker(f)$. Dann gilt wegen der Linearität von f , sodass $f^2(v) = f(f(v)) \stackrel{f(v)=0}{=} 0 \Rightarrow \ker(f) \subseteq \ker(f^2)$

Induktiv zeigt man:

$$\{0\} \subseteq \ker(f) \subseteq \ker(f^2) \subseteq \ker(f^3) \subseteq \dots$$

Da $\dim(V) < \infty$, muss es eine kleinste Zahl $m \in \mathbb{N} \cup \{0\}$ geben, so dass $\ker(f^m) = \ker(f^{m+j})$ für alle $j \in \mathbb{N}$. Damit sehen wir

$$U = \operatorname{im}(f^m) \quad \text{und} \quad W = \ker(f^m)$$

Zeige: U und W sind f -invariant. Sei $u \in U$. Dann existiert $w \in V$ mit $f^m(w) = u \Rightarrow f(u) = f(f^m(w)) = f^m(f(w)) \in U$.

Sei $w \in W$. Dann gilt

$$f^m(f(w)) = f(f^m(w)) = 0 \Rightarrow f(w) \in W$$

Also existieren f -invariante Unterräume $U \subseteq V$ und $W \subseteq V$.

1. Es gilt $U + W \subseteq V$. Die Dimensionsformel für lineare Abbildungen (Satz 4.16, LinA I) liefert für f^m , dass

$$\dim(V) = \dim(U) + \dim(W)$$

$$\text{Ist } v \in U \cap W \implies \exists w \in V : v = f^m(w) (v \in U)$$

$$v \in W \implies 0 = f^m(v) = f^m(f^m(v)) = f^{2m}(v)$$

$$\text{Es gilt } \ker(f^m) = \ker(f^{2m}) \implies v = f^m(v) = 0$$

$$\implies V = U \oplus W$$

2. Sei $v \in \ker(f|_U) \subseteq U$. Dann existiert ein $w \in V$, so dass $f^m(w) = v$ gilt. \implies
 $0 = f(v) = f(f^m(w)) = f^{m+1}(w)$. Mit
 $\ker(f^m) = \ker(f^{m+1}) \implies w \in \ker(f^m) \implies v = f^m(w) = 0 \implies f$ injektiv.

Aus der Dimensionsformel folgt, dass f surjektiv ist.

3. Sei $v \in W$. Dann gilt

$$0 = f^m(v) = (f|_W)^m(v)$$

$$\implies (f|_W)^m = 0 \in L(W, W), \text{ d.h. } (f|_W)^m \text{ ist die Nullabbildung} \implies f|_W \text{ nilpotent.}$$

Satz 2.24: Sei V ein endlichdimensionaler K -Vektorraum, $f \in L(V, V)$ nilpotent vom Grad m , $v \in V$ ein beliebiger Vektor mit $f^{m-1}(v) \neq 0$ und $h \in V^*$ mit $h(f^{m-1}(v)) \neq 0$. Dann sind v und h vom Grad m bzgl. f und f^* . Die beiden Räume $\mathcal{K}_m(f, v)$ bzw. $\mathcal{K}_m(f^*, h)$ sind zyklisch f - bzw. f^* -invariante Unterräume von V bzw. V^* . Sie bilden ein duales Raumpaar bzgl. der Bilinearform

$$a : \mathcal{K}_m(f, v) \times \mathcal{K}_m(f^*, h) \rightarrow K, \quad (\bar{v}, \bar{h}) \mapsto \bar{h}(\bar{v})$$

und es gilt

$$V = \mathcal{K}_m(f, v) \oplus (\mathcal{K}_m(f^*, h))^0$$

Hierbei ist $\mathcal{K}_m(f^*, h)^0$ ein f -invarianter Unterraum von V .

Beweis: Für $v \in V$ gilt $f^{m-1}(v) \neq 0$. Lemma 2.20 $\implies \mathcal{K}_m(f, v)$ m -dimensionaler zyklischer f -invarianter Unterraum von V . Für V^* gilt

$$0 \neq h(f^{m-1}(v)) = (f^*)^{m-1}(h)(v)$$

Dann ist $0 \neq (f^*)^{m-1}(h) \in L(V^*, V^*)$. f nilpotent von Grad $m \implies$ (Lemma 2.14) f^* nilpotent von Grad $m \implies$

$$(f^*)^m(h) = 0 \in L(V^*, V^*)$$

\implies (Lemma 2.20) $\mathcal{K}_m(f^*, h)$ ist m -dimensionaler zyklischer f^* -invarianter Unterraum von V^* .

Nun zu zeigen: $\mathcal{K}_m(f, v), \mathcal{K}_m(f^*, h)$ sind ein duales Raumpaar. Sei

$$\bar{v} = \sum_{i=0}^{m-1} \mu_i f^i(v) \in \mathcal{K}_m(f, v)$$

so gewählt, dass

$$\bar{h}(\bar{v}) = a(\bar{v}, \bar{h}) = 0 \quad \forall \bar{h} \in \mathcal{K}_m(f^*, h)$$

Zeige induktiv, dass $\mu_k = 0, k = 0, \dots, m-1$. Wegen $((f^*)^{m-1}(h)) \in \mathcal{K}_m(f^*, h)$ folgt

$$0 = ((f^*)^{m-1}(h))(\bar{v}) = h(f^{m-1}(\bar{v})) = \sum_{i=0}^{m-1} \mu_i h(f^{m-1+i}(v)) = \underbrace{\mu_0 h(f^{m-1}(v))}_{\neq 0} \\ \Rightarrow \mu_0 = 0$$

Sei nun $\mu_0 = \dots = \mu_{k-1} = 0$ für ein $k \in \{1, \dots, m-2\}$. Wegen $(f^*)^{m-1-k}(h) \in \mathcal{K}_m(f^*, h)$ folgt aus der Darstellung von \bar{v} , dass

$$0^{(*)} = ((f^*)^{m-1-k}(h))(\bar{v}) = h(f^{m-1-k}(\bar{v})) = \sum_{i=0}^{m-1} \mu_i h(f^{m-1-k+i}(v)) = \underbrace{\mu_k h(f^{m-1}(v))}_{\neq 0} = \mu_k \\ \Rightarrow \bar{v} = 0$$

$\Rightarrow a(., .)$ ist nicht ausgeartet in der ersten Komponente. Analog zeigt man, dass $a(., .)$ auch in der zweiten Komponente nicht ausgeartet ist $\Rightarrow \mathcal{K}_m(f, v)$ und $\mathcal{K}_m(f^*, h)$ sind ein duales Raumpaar.

Mit Lemma 2.18: $V = \mathcal{K}_m(f, v) \oplus (\mathcal{K}_m(f^*, h))^0$

Mit Lemma 2.14, 3: $(\mathcal{K}_m(f^*, h))^0$ ist f -invarianter UR von V .

□

(zyklisch f -invarianter UR: $v, f(v), f^2(v), \dots$)

2.4. Die Jordan-Normalform

Satz 2.25: Sei V ein endlichdimensionaler K -Vektorraum und $f \in L(V, V)$. Ist $\lambda \in K$ ein Eigenwert von f , dann gibt es f -invariante Unterräume $U \subset V$ und $\{0\} \neq W \subseteq V$, so dass

1. $V = U \oplus W$
2. die Abbildung $f|_U - \lambda \text{Id}_U$ ist bijektiv und
3. die Abbildung $f|_W - \lambda \text{Id}_W$ ist nilpotent

Des Weiteren ist λ kein Eigenwert von $f|_U$.

Beweis: Wir definieren

$$g := f - \lambda \text{Id}_V \in L(V, V)$$

Satz 2.23: $\exists g$ -invariante UR $U \subseteq V$ und $W \subseteq V$:

$$V = U \oplus W, \quad g|_U \text{ bijektiv, } g|_W \text{ nilpotent}$$

Annahme: $\{0\} = W \implies V = U$

$$\implies g|_U = g|_V = g \text{ bijektiv}$$

λ ist Eigenwert von $f \implies \exists 0 \neq v : f(v) = \lambda v$

$$\implies g(v) = f(v) - \lambda v = \lambda v - \lambda v = 0$$

$$\implies \ker(g) \supseteq \{0, v\} \neq \{0\} \nmid g \text{ bijektiv}$$

$$\implies U \subset V$$

Annahme: λ ist Eigenwert von $f|_U$

$$\implies \exists 0 \neq v \in U : f(v) = \lambda v$$

$$\implies g|_U(v) = f(v) - \lambda v = \lambda v - \lambda v = 0 \nmid g|_U \text{ bijektiv}$$

□

Beispiel 2.26: Wir betrachten $V = \mathbb{R}^5$, die Standardbasis E und $f \in L(V, V)$ gegeben durch

$$A = \begin{pmatrix} -3 & -1 & 4 & -3 & -1 \\ 1 & 1 & -1 & 1 & 0 \\ -1 & 0 & 2 & 0 & 0 \\ 4 & 1 & -4 & 5 & 1 \\ -2 & 0 & 2 & -2 & 1 \end{pmatrix}$$

Dann gilt

$$p_f(\lambda) = p_A(\lambda) = (\lambda - 1)^4(\lambda - 2)^1$$

$$\implies \text{EW: } 1, 2 \quad a(f, 1) = 4 \quad a(f, 2) = 1$$

$\implies p_A(\cdot)$ zerfällt in Linearfaktoren

$\lambda_1 = 1$: Es gilt $\ker(g_1^3) = \ker(g_1^4)$ für $g_1 := f - \lambda_1 \text{Id}_V$

$$\implies m_1 = 3$$

$$U_1 = \text{Span} \left\{ \begin{pmatrix} 0 \\ 1 \\ 2 \\ 3 \\ -2 \end{pmatrix} \right\} \quad W_1 = \text{Span} \left\{ \begin{pmatrix} 1 \\ -1 \\ 1 \\ 0 \\ 1 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 1 \\ 1 \\ 1 \\ 0 \\ -1 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 0 \\ 0 \\ 1 \\ 1 \\ 0 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 0 \\ 0 \\ 0 \\ 0 \\ 1 \end{pmatrix} \right\}$$

$\lambda_2 = 2$: Für $g_2 = f - \lambda_2 \text{Id}_V$ gilt $\ker(g_2) = \ker(g_2^2)$

$$\implies m_2 = 1$$

$$U_2 = \text{Span} \left\{ \begin{pmatrix} -5 \\ 1 \\ -1 \\ 4 \\ -2 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} -1 \\ -1 \\ 0 \\ 1 \\ 0 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 4 \\ -1 \\ 0 \\ -4 \\ 2 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} -3 \\ 1 \\ 0 \\ 3 \\ -2 \end{pmatrix} \right\}, W_2 = \text{Span} \left\{ \begin{pmatrix} 0 \\ 1 \\ 2 \\ 3 \\ -2 \end{pmatrix} \right\}$$

Beobachtung: $\dim(W_1) = a(f, \lambda_1)$, $\dim(W_2) = a(f, \lambda_2)$

Satz 2.27: Sei V ein endlichdimensionaler K -Vektorraum und $f \in L(V, V)$. Ist $\lambda \in K$ ein Eigenwert von f , dann existieren für den Unterraum W aus Satz 2.25 Vektoren $w_1, \dots, w_k \in W$ und $d_1, \dots, d_k \in \mathbb{N}$, so dass

$$W = \mathcal{K}_{d_1}(f, w_1) \oplus \mathcal{K}_{d_2}(f, w_2) \oplus \dots \oplus \mathcal{K}_{d_k}(f, w_k)$$

Des Weiteren gibt es eine Basis B von W , so dass

$$A_{f|_W}^{B,B} = \begin{pmatrix} J_{d_1}(\lambda) & & 0 \\ & \ddots & \\ 0 & & J_{d_k}(\lambda) \end{pmatrix}$$

Beweis: Sei wie in Satz 2.25 $g := f - \lambda \text{Id}_V$ und $g_1 := g|_W$ nilpotent vom Grad d_1 . Dann gilt $1 \leq d_1 \leq \dim(W)$.

Sei $w_1 \in W$ ein Vektor mit $g_1^{d_1-1}(w_1) \neq 0$. Wegen $g^{d_1}(w_1) = 0$

$\Rightarrow g_1^{d_1-1}(w_1)$ ist ein Eigenvektor von g_1 zum Eigenwert 0.

Lemma 2.21, 3, liefert, dass die d_1 Vektoren

$$\{w_1, g(w_1), \dots, g_1^{d_1-1}(w_1)\}$$

linear unabhängig sind. Außerdem ist $W_1 := \mathcal{K}_{d_1}(g_1, w_1)$ ein d_1 -dimensionaler zyklischer g_1 -invarianter UR von W . Also ist

$$B_1 := \{g_1^{d_1-1}(w_1), g_1^{d_1-2}(w_1), \dots, g_1(w_1), w_1\}$$

eine Basis von $\mathcal{K}_{d_1}(g_1, w_1) = W_1$ und

$$A_{g_1|_{W_1}}^{B_1, B_1} = \begin{pmatrix} 0 & 1 & & 0 \\ & \ddots & \ddots & \\ & & \ddots & 1 \\ 0 & & & 0 \end{pmatrix} = J_{d_1}(0) \in K^{d_1, d_1}$$

Per Definition gilt $A_{g_1|_{W_1}}^{B_1, B_1} = A_{g|_{W_1}}^{B_1, B_1}$. Ist $d_1 = \dim(W)$: siehe unten $\bullet \bullet \bullet$.

Sei nun $d_1 < \dim(W)$. Satz 2.25 sichert, dass es für $g_1 \in L(W, W)$ einen g_1 -invarianten Unterraum $\tilde{W} \neq \{0\}$ mit $W = W_1 \oplus \tilde{W}$ gibt.

Die Abbildung $g_2 := g_1|_{\tilde{W}}$ ist nilpotent vom Grad λ_2 mit $1 \leq d_2 \leq d_1$.

Wiederholung der Konstruktion:

$\exists w_2 \in \tilde{W} : g_2^{d_2-1}(w_1) \neq 0, \dots, W_2 := \mathcal{K}_{d_2}(g_2, w_2) \dots$ UR von $\tilde{W} \subseteq W$,

$$B_2 := \{g_2^{d_2-1}(w_2), g_2^{d_2-2}(w_2), \dots, g_2(w_2), w_2\}$$

$$A_{g|_{W_2}}^{B_2, B_2} = A_{g_2|_{W_2}}^{B_2, B_2} = \begin{pmatrix} 0 & 1 & & 0 \\ & \ddots & \ddots & \\ & & \ddots & 1 \\ 0 & & & 0 \end{pmatrix}$$

Nach $k \leq \dim(W)$ Schritten muss diese Konstruktion abbrechen und es gilt

$$\begin{aligned} W &= \mathcal{K}_{d_1}(g_1, w_1) \oplus \mathcal{K}_{d_2}(g_2, w_2) \oplus \dots \oplus \mathcal{K}_{d_k}(g_k, w_k) \\ &= \mathcal{K}_{d_1}(g, w_1) \oplus \mathcal{K}_{d_2}(g, w_2) \oplus \dots \oplus \mathcal{K}_{d_k}(g, w_k) \end{aligned}$$

Vereinigt man die Basen B_1, \dots, B_k zu einer Basis B von W (direkte Summe!), so erhält man

$$A_{g|_W}^{B, B} = \begin{pmatrix} A_{g|_{W_1}}^{B_1, B_1} & & 0 \\ & \ddots & \\ 0 & & A_{g|_{W_k}}^{B_k, B_k} \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} J_{d_1}(0) & & 0 \\ & \ddots & \\ 0 & & J_{d_k}(0) \end{pmatrix}$$

Jetzt: Übertragung auf $f = g + \lambda \text{Id}_V$. Man kann sich leicht überlegen, dass jeder g -invariante Unterraum von V auch f -invariant ist und damit gilt:

$$\mathcal{K}_{d_i}(f, w_i) = \mathcal{K}_{d_i}(g, w_i) \quad \text{für } i = 1, \dots, k$$

$$\stackrel{\text{ÜA}}{\implies} W = \mathcal{K}_{d_1}(f, w_1) \oplus \dots \oplus \mathcal{K}_{d_k}(f, w_k)$$

Für $j \in \{1, \dots, k\}$ und $0 \leq l \leq d_j - 1$ ist

$$\begin{aligned} f(g^l(w_j)) &= g(g^l(w_j)) + \lambda g^l(w_j) \\ &= \lambda g^l(w_j) + \underbrace{g^{l+1}(w_j)}_{=0, l=d_j-1} \end{aligned}$$

$$\implies A_{f|_W}^{B, B} = \begin{pmatrix} A_{f|_{W_1}}^{B_1, B_1} & & 0 \\ & \ddots & \\ 0 & & A_{f|_{W_k}}^{B_k, B_k} \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} J_{d_1}(\lambda) & & 0 \\ & \ddots & \\ 0 & & J_{d_k}(\lambda) \end{pmatrix}$$

□

Beispiel 2.28: Fortsetzung von Bsp 2.26

$$A = \begin{pmatrix} -3 & -1 & 4 & -3 & -1 \\ 1 & 1 & -1 & 1 & 0 \\ -1 & 0 & 2 & 0 & 0 \\ 4 & 1 & -4 & 5 & 1 \\ -2 & 0 & 2 & -2 & 1 \end{pmatrix} \quad \text{EW: } \begin{aligned} \lambda_1 &= 1, a(f, \lambda_1) = 4 = \dim(W_1) \\ \lambda_2 &= 2, a(f, \lambda_2) = 1 = \dim(W_2) \end{aligned}$$

$\lambda_1 = 1$: $g_1^1|_{W_1}$ nilpotent vom Grad $\lambda_1^1 = 3$ und $1 < d_1^1 < \dim(W_1)$

Erinnerung: $g_1^1 = f - \lambda_1 I_d$. Für $w_1^1 = (0 \ 0 \ 0 \ 0 \ 1)^T$ ist $(g_1^1)^2(w_1^1) = (1 \ 0 \ 1 \ 0 \ 0)^T \neq 0$ und $(g_1^1)^3(w_1^1) = 0 \in V = \mathbb{R}^5$.

Mit Lemma 2.21:

$$\left\{ w_1, (g_1^1)^1(w_1^1), (g_1^1)^2(w_1^1) \right\} = \left\{ \begin{pmatrix} 0 \\ 0 \\ 0 \\ 0 \\ 1 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} -1 \\ 0 \\ 0 \\ 1 \\ 0 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 1 \\ 0 \\ 1 \\ 0 \\ 0 \end{pmatrix} \right\}$$

$$\implies \text{Span}\{w_1, g_1^1(w_1^1), (g_1^1)^2(w_1^1)\} = \mathcal{K}_3(g_1^1, w_1^1)$$

$d_1^1 < \dim(W_1) \implies$ es existiert zu $W_{11} := \mathcal{K}(g_1^1, w_1^1)$ ein $\tilde{W}_1 \neq \{0\}$ mit $W_1 = W_{11} \oplus \tilde{W}_1$.

Zum Beispiel: $w_2^1 = (1 \ -1 \ 1 \ 0 \ 1)^T \implies$

$$w_2^1, w_1^1, g_1^1(w_1^1), (g_1^1)^2(w_1^1) \quad \text{lin. unab.}$$

$$\tilde{W}_1 := \text{Span}\{w_2^1\} \cap \mathcal{K}_3(g_1^1, w_1^1) = \{0\}$$

Es gilt $g_2^1 := g_1^1|_{\tilde{W}_1}$ nilpotent vom Grad 1

$$\implies d_2^1 = 1 \quad W_1 = \mathcal{K}_3(g_1^1, w_1^1) \oplus \mathcal{K}_1(g_2^1, w_2^1)$$

Weitherhin kann man nachrechnen

$$\mathcal{K}_3(f, w_1^1) = \text{Span}\{w_1, g_1^1(w_1^1), (g_1^1)^2(w_1^1)\} = \mathcal{K}_3(g_1^1, w_1^1)$$

$$\mathcal{K}_1(f, w_2^1) = \text{Span}\{w_2^1\} = \mathcal{K}_1(g_2^1, w_2^1)$$

$\lambda_2 = 2$:

$g_1^2|_{W_2}$ nilpotent vom Grad $\lambda_1^2 = 1$

$$\lambda_1^2 = \dim(W_2)$$

$$w_1^2 = (0 \ 1 \ 2 \ 3 \ -2)^T \neq 0$$

$$(g_1^2)^1(w_1^2) = 0 \in V \implies W_2 = \mathcal{K}_1(f, w_1^2)$$

$$A_{f|_{W_1}}^{B^1, B^1} = \begin{pmatrix} 1 & 1 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 1 \end{pmatrix}, \quad A_{f|_{W_2}}^{B^2, B^2} = (2)$$

$$\stackrel{\text{Ziel:}}{\implies} A_f^{B, B} = \begin{pmatrix} 1 & 1 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & 1 & \\ 0 & 0 & 1 & \\ & & & 1 \\ 0 & & & & 2 \end{pmatrix}$$

Satz 2.29: Sei V ein K -Vektorraum mit $\dim(V) < \infty$ und $f \in L(V, V)$. Ist $\lambda \in K$ ein Eigenwert von f , dann gilt für die d_j , $1 \leq j \leq k$ aus Satz 2.27, dass

$$a(f, \lambda) = \dim(W) = d_1 + \dots + d_k$$

$$g(f, \lambda) = k$$

Beweis: Für den Unterraum U aus Satz 2.23/2.25 ist die Abbildung $f|_U = (f - \lambda \text{Id})|_U$ bijektiv $\implies \lambda$ ist kein Eigenwert von $f|_U$. Daraus erhält man

$$a(f, \lambda) = \dim W = d_1 + \dots + d_k$$

Zur Bestimmung von $g(f, \lambda)$ sei $v \in W$ ein beliebiger Vektor. Dann ist

$$v = \sum_{j=1}^k \sum_{l=0}^{d_j-1} \mu_{jl} g^l(w_j)$$

und es gilt

$$\begin{aligned} f(v) &= \sum_{j=1}^k \sum_{l=0}^{d_j-1} \mu_{jl} f(g^l(w_j)) = \sum_{j=1}^k \sum_{l=0}^{d_j-1} \mu_{jl} g^l(w_j) + \sum_{j=1}^k \sum_{l=0}^{d_j-1} \mu_{jl} g^{l+1}(w_j) \\ &= \underbrace{\lambda v + \sum_{j=1}^k \sum_{l=0}^{d_j-2} \mu_{jl} g^{l+1}(w_j)}_{=0} \quad \overbrace{\text{lin. unab.}} \end{aligned}$$

$$v \in \text{Eig}(f, \lambda) \iff \mu_{jl} = 0, 1 \leq j \leq k, 0 \leq l \leq d_j - 2$$

$$\iff v = \sum_{j=1}^k \mu_j g^{d_j-1}(w_j)$$

Für $v \neq 0$ muss mindestens ein Koeffizient $\mu_j \neq 0$, $j = 1, \dots, k$. Daraus folgt

$$\text{Eig}(f, \lambda) = \text{Span} \underbrace{\{g^{d_1-1}(w_1), \dots, g^{d_k-1}(w_k)\}}_{\text{lin. unab. wegen direkter Summe}}$$

Beispiel 2.30: Fortsetzung von Bsp. 2.28. Es gilt

$$\text{Eig}(f, 1) = \text{Span} \left\{ \begin{pmatrix} 1 \\ -1 \\ 1 \\ 0 \\ 1 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 1 \\ 1 \\ 1 \\ 0 \\ -1 \end{pmatrix} \right\} \Rightarrow g(f, 1) = 2$$

$$\lambda_1 = 1: a(f, 1) = 4 = 3 + 1 = d_1^1 + d_2^1, g(f, 1) = 2 = k$$

$$\lambda_2 = 2: a(f, 2) = 1 = d_1^2, g(f, 2) = 1$$

Fazit: Für einen Eigenwert λ zu $f \in L(V, V)$ gilt:

- Die geometrische Vielfachheit des Eigenwert λ ist gleich der Anzahl der Jordanblöcke zu diesem Eigenwert in der entsprechenden Darstellungsmatrix

$$A_f^{B,B} = \begin{pmatrix} J_{d_1}(\lambda_1) & & 0 \\ & \ddots & \\ 0 & & J_{d_k}(\lambda_m) \end{pmatrix}$$

- Die algebraische Vielfachheit des Eigenwert λ ist gleich der Summe der Dimensionen der zugehörigen Jordanblöcke
- In jedem Unterraum $\mathcal{K}_{d_j}(f, w_j)$ gehört genau ein Eigenvektor und seine Vielfachheiten.

Was gilt für weitere Eigenwerte?

Ist $\tilde{\lambda} \neq \lambda$ ein weiterer Eigenwert von f , dann ist $\tilde{\lambda}$ auch ein Eigenwert der Einschränkung $f|_U \in L(U_\lambda, U_\lambda)$

\Rightarrow Man kann die Sätze 2.25-2.29 auf $f|_{U_\lambda}$ anwenden. Damit erhält man

- $U_\lambda = X \oplus Y$
- $f|_X - \tilde{\lambda} \text{Id}_X$ ist bijektiv
- $f|_Y - \tilde{\lambda} \text{Id}_Y$ ist nilpotent
- Der UVR Y ist die direkte Summe von Krylovräumen
- Es gibt eine Darstellungsmatrix von $f|_Y$ bestehend aus Jordanblöcken

Da man dieses Argument für alle paarweise verschiedene Eigenwerte von f anwenden kann, erhält man.

Satz 2.31: Sei V ein endlichdimensionaler K -Vektorraum und $f \in L(V, V)$. Zerfällt das charakteristische Polynom $p_f(\cdot)$ in Linearfaktoren, so gibt es eine Basis B von V für welche die Darstellungsmatrix in Jordan-Normalform ist, d.h.

$$A_f^{B,B} = \begin{pmatrix} J_{d_1}(\lambda_1) & & 0 \\ & \ddots & \\ 0 & & J_{d_k}(\lambda_m) \end{pmatrix}$$

Beweis: s.o.

□

Marie Ennemond Jordan (fr. Mathematiker, 1838-1922) gab diese Form 1870 an. Zwei Jahre vor Jordan bewies Karl Weierstraß (dt. Mathematiker, 1815-1897) ein Resultat, aus dem die JNF folgt.

Beispiel 2.32:

$$A = \begin{pmatrix} -3 & -1 & 4 & -3 & -1 \\ 1 & 1 & -1 & 1 & 0 \\ -1 & 0 & 2 & 0 & 0 \\ 4 & 1 & -4 & 5 & 1 \\ -2 & 0 & 2 & -2 & 1 \end{pmatrix} \rightsquigarrow J = \begin{pmatrix} 1 & 1 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & 1 \\ 0 & 0 & 1 & \\ & & & 1 \\ 0 & & & & 2 \end{pmatrix} = A_f^{B,B}$$

$$B = \left\{ (g_1^1)^2(w_1^1), g_1^1(w_1^1), w_1^1, w_2^1, w_1^2 \right\}$$

Für

$$S = \begin{pmatrix} 1 & -1 & 0 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & -1 & 1 \\ 1 & 0 & 0 & 1 & 2 \\ 0 & 1 & 0 & 0 & 3 \\ 0 & 0 & 1 & 1 & -2 \end{pmatrix}$$

gilt $J = S^{-1}AS$. Also J ähnlich zu A .

Für $f \in L(V, V)$ hatten wir:

- f ist diagonalisierbar \iff
 - $p_f(\cdot)$ zerfällt in Linearfaktoren
 - \forall EW λ von $f : a(f, \lambda) = g(f, \lambda)$
- zerfällt $p_f(\cdot)$ in Linearfaktor $\implies \exists$ Basis $B : A_f^{B,B}$ in JNF

Folgerung: Existiert eine Darstellungsmatrix in Jordan-Normalform: f ist diagonalisierbar $\iff d_i = 1 \forall i \in \{1, \dots, k\}$

Frage: Wann zerfällt $p_f(\cdot)$ in Linearfaktoren?

Fundamentalsatz der Algebra:

Jedes Polynom $p \in P[t]$ über \mathbb{C} mit einem Grad größer 0 hat mindestens eine Nullstelle.

Beweis: Liesen, Mehrmann, Kapitel 15, braucht substantiell Hilfsmittel aus der Analysis.

Damit folgt unmittelbar:

Korollar 2.33: Jedes Polynom $p \in P[t]$ über \mathbb{C} zerfällt in Linearfaktoren, d.h. es gibt $a, \lambda_1, \dots, \lambda_n \in \mathbb{C}$ mit $n = \text{grad}(p)$ und

$$p(t) = a(t - \lambda_1)(t - \lambda_2) \dots (t - \lambda_n)$$

Daraus folgt direkt:

Korollar 2.34: Sei V ein endlichdimensionaler \mathbb{C} -Vektorraum. Dann besitzt jedes $f \in L(V, V)$ eine Jordan-Normalform.

Matrix-Version:

Korollar 2.35: Sei K ein Körper und $A \in K^{n,n}$, so dass das charakteristische Polynom $p_A(\cdot)$ in Linearfaktoren zerfällt. Dann ist A ähnlich zu einer Matrix J in Jordan-Normalform.

Ist die Jordan-Normalform eindeutig bestimmt?

Satz 2.36: Sei V ein K -Vektorraum mit $\dim(V) = n < \infty$. Bestitzt $f \in L(V, V)$ eine Jordan-Normalform, so ist diese bis auf die Reihenfolge der Jordanblöcke eindeutig bestimmt.

Beweis: sehr technisch, z.B. Liesen, Mehrmann Satz 16.12, Fischer/Springborn, Abschnitt 5.7.

□

Alternativer Beweis für die JNF über Hauptvektoren und Haupträume, vgl. Fischer/Springborn, Abschnitt 5.5.

Damit: Für Bsp. 2.32 wären

$$\begin{pmatrix} 2 & & \\ & J_3(1) & \\ & & 1 \end{pmatrix} \quad \text{oder} \quad \begin{pmatrix} 2 & & \\ & 1 & \\ & & J_3(1) \end{pmatrix}$$

alternative JNF. Jordanblöcke bleiben gleich. D.h. Satz 2.36 rechtfertigt den Namen "Normalform".

3. Euklidische und unitäre Vektorräume

Jetzt: V Vektorraum über \mathbb{R} oder \mathbb{C} mit $\dim(V) < \infty$.

Damit: Definition eines Skalarproduktes und Verallgemeinerung von Begriffen aus der Geometrie für \mathbb{R}^2 bzw. \mathbb{R}^3 . Dies beinhaltet auch Orthogonalität und orthonormale Basen.

3.1. Skalarprodukt und Normen

Für $K = \mathbb{R}$ werden wir Bilinearformen (Def. 2.17) verwenden. Für $K = \mathbb{C}$ benötigen wir

Definition 3.1: Sesquilinearform

Seien V und W zwei \mathbb{C} -Vektorräume. Man nennt eine Abbildung

$$s : V \times W \rightarrow \mathbb{C}, (v, w) \mapsto s(v, w)$$

Sesquilinearform auf $V \times W$, wenn für alle $v, v_1, v_2 \in V$, $w, w_1, w_2 \in W$ und $\lambda \in \mathbb{C}$ gilt

1. $s(v_1 + v_2, w) = s(v_1, w) + s(v_2, w)$ und $s(\lambda v, w) = \lambda s(v, w)$
 $\hat{=}$ $s(., .)$ ist linear in der ersten Komponente
2. $s(v, w_1 + w_2) = s(v, w_1) + s(v, w_2)$ und $s(v, \lambda w) = \bar{\lambda} s(v, w)$

Ist $V = W$, so heißt s Sesquilinearform auf V . Eine Sesquilinearform auf V nennt man hermitesch, wenn

$$s(v, w) = \overline{s(w, v)} \quad \forall v, w \in V$$

Definition 3.2: Skalarprodukt

Sei V ein K -Vektorraum. Eine Abbildung

$$\langle ., . \rangle : V \times V \rightarrow K, (v, w) \mapsto \langle v, w \rangle$$

nennt man **Skalarprodukt** oder **inneres Produkt** auf V , wenn gilt

1. Ist $K = \mathbb{R}$, so ist $\langle ., . \rangle$ eine symmetrische Bilinearform
2. Ist $K = \mathbb{C}$, so ist $\langle ., . \rangle$ eine hermitesche Sesquilinearform
3. $\langle ., . \rangle$ ist positiv definit, d.h. es gilt

$$\langle v, v \rangle \geq 0 \quad \forall v \in V$$

$$\langle v, v \rangle = 0 \iff v = 0 \in V$$

Ein \mathbb{R} -Vektorraum mit einem Skalarprodukt nennt man **euklidischen Vektorraum** und einen \mathbb{C} -Vektorraum mit einem Skalarprodukt **unitären Vektorraum**.

Bemerkungen:

- Für alle $v \in V$ gilt $\langle v, v \rangle \in \mathbb{R}^+$ unabhängig von $K = \mathbb{R}$ oder $K = \mathbb{C}$
- Ein Unterraum eines euklidischen (unitären) Vektorraums ist wieder ein euklidischer (unitärer) Vektorraum.

Definition 3.3: hermitesche Matrix

Für eine Matrix $A = (a_{ij}) \in \mathbb{C}^{m,n}$ ist die hermitesch transponierte von A definiert als

$$A^H = (\bar{a}_{ji}) \in \mathbb{C}^{n,m}$$

Gilt $A = A^H$, so heißt A **hermitesche Matrix**.

Ist $A \in \mathbb{R}^{m,n}$, so $A^H = A^T$. Für eine hermitesche Matrix A gilt $a_{ii} = \bar{a}_{ii} \Rightarrow a_{ii} \in \mathbb{R}$.

Beispiel 3.4: Man kann leicht nachrechnen:

- Für $V = \mathbb{R}^n$ ist

$$\langle v, w \rangle := v^T w = \sum_{i=1}^n v_i w_i$$

ein Skalarprodukt. Es ist das Standardskalarprodukt im \mathbb{R}^n .

- Für $V = \mathbb{C}^n$ ist

$$\langle v, w \rangle := w^H v = \sum_{i=1}^n \bar{w}_i v_i$$

ein Skalarprodukt. Es ist das Standardskalarprodukt im \mathbb{C}^n .

- Für $V = K^{m,n}$ ist

$$\langle A, B \rangle := \text{Spur} \underbrace{(B^H A)}_{\in K^{n,n}} = \sum_{i=1}^n \left(\sum_{j=1}^m \bar{b}_{ij} a_{ji} \right)$$

- Auf dem Vektorraum der auf dem Intervall $[0, 1]$ stetigen, reellwertigen Funktionen ist

$$\langle f, g \rangle := \int_0^1 f(x)g(x)dx$$

ein Skalarprodukt.

Lemma 3.5: Cauchy-Schwarz-Ungleichung

Ist V ein euklidischer oder unitärer Vektorraum, so gilt

$$|\langle v, w \rangle|^2 \leq \langle v, v \rangle \cdot \langle w, w \rangle \quad \forall v, w \in V$$

wobei das Gleichheitszeichen genau dann gilt, wenn v und w linear abhängig sind.

Beweis: Für $w = 0$ folgt die (Un-)gleichung.

Für $w \neq 0$ definiert man

$$\lambda := \frac{\langle v, w \rangle}{\langle w, w \rangle}$$

Dann folgt

$$\begin{aligned} 0 &\leq \langle v - \lambda w, v - \lambda w \rangle = \langle v, v \rangle - \bar{\lambda} \langle v, w \rangle - \lambda \langle w, v \rangle - \lambda \cdot (-\bar{\lambda}) \langle w, w \rangle \\ &= \langle v, v \rangle - \frac{\overline{\langle v, w \rangle}}{\langle w, w \rangle} \langle v, w \rangle - \frac{\langle v, w \rangle}{\langle w, w \rangle} \langle w, v \rangle + \frac{|\langle v, w \rangle|^2}{(\langle w, w \rangle)^2} \langle w, w \rangle \\ &= \langle v, v \rangle - \frac{|\langle v, w \rangle|^2}{\langle w, w \rangle} \\ &\implies |\langle v, w \rangle|^2 \leq \langle v, v \rangle \cdot \langle w, w \rangle \end{aligned}$$

“=”:

$$\begin{aligned} 0 &= \langle v - \lambda w, v - \lambda w \rangle \\ \iff v - \lambda w &= 0 \iff v = \lambda w \iff w = \lambda^{-1} v \end{aligned}$$

□

$$\langle v, \lambda w \rangle = \bar{\lambda} \langle v, w \rangle$$

Deshalb:

Die Cauchy-Schwartzsche Ungleichung ist ein sehr wichtiges Instrument der Analysis, z.B. für Approximationsfehler.

Nächstes Ziel: Vektoren $v \in V$ eine Länge zuzuordnen \rightarrow Norm als Verallgemeinerung des Betrags

Für die reellen Zahlen: $|\cdot| : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}^+, x \mapsto |x|$ mit

- $|\lambda x| = |\lambda| \cdot |x| \quad \forall \lambda \in \mathbb{R}, \forall x \in \mathbb{R}$
- $|x| \geq 0 \quad \forall x \in \mathbb{R}, |x| = 0 \iff x = 0$
- $|x + y| \leq |x| + |y| \quad \forall x, y \in \mathbb{R}$

Definition 3.6: Norm

Sei V ein K -Vektorraum. Eine Abbildung

$$\|\cdot\| : V \rightarrow \mathbb{R}, \quad v \mapsto \|v\|$$

nennt man Norm auf V , wenn für alle $v, w \in V$ und $\lambda \in K$ gilt:

- sie ist homogen, d.h.

$$\|\lambda v\| = |\lambda| \cdot \|v\|$$

- sie ist positiv definit, d.h:

$$\|v\| \geq 0, \quad \|v\| = 0 \iff v = 0 \in V$$

- sie erfüllt die Dreiecksungleichung, d.h.

$$\|v + w\| \leq \|v\| + \|w\|$$

Einen K -Vektorraum, auf dem eine Norm definiert ist, nennt man **normierten Raum**.

Beispiel 3.7: Man kann leicht nachrechnen:

- Ist $\langle \cdot, \cdot \rangle$ das Standardskalarprodukt auf \mathbb{R}^m oder \mathbb{C}^m , dann definiert

$$\|v\| := \langle v, v \rangle^{\frac{1}{2}} = (v^T v)^{\frac{1}{2}} \quad \text{bzw.} \quad = (v^H v)^{\frac{1}{2}}$$

eine Norm auf \mathbb{R}^m bzw. \mathbb{C}^m . Sie wird **euklidische Norm** genannt

- Für $V = K^{m,n}$ ist

$$\|A\|_F := (\text{Spur}(A^H A))^{\frac{1}{2}} = \left(\sum_{i=1}^n \left(\sum_{j=1}^m |a_{ji}|^2 \right) \right)^{\frac{1}{2}}$$

eine Norm. Sie wird Frobeniusnorm genannt. Es gilt $\|A\|_F = \|A^H\|_F$ für alle $A \in K^{m,n}$.

- Auf dem Vektorraum der auf dem Intervall $[0, 1]$ stetigen, reellwertigen Funktionen ist

$$\|f\| := \langle f, f \rangle^{\frac{1}{2}} = \left(\int_0^1 (f(x))^2 dx \right)^{\frac{1}{2}}$$

eine Norm. Sie wird L_2 - oder L^2 -Norm genannt.

- Sei $p \in \mathbb{R}, p \geq 1$ und $V = K^n$. Dann definiert

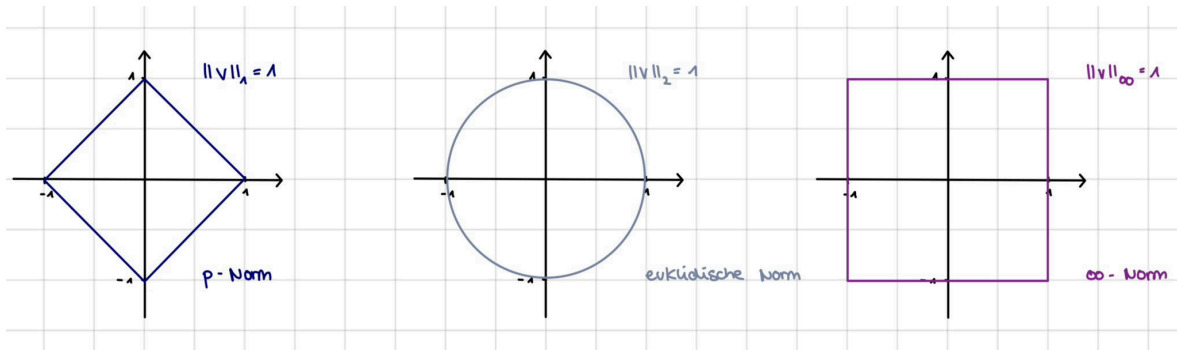
$$\|v\|_p = \left(\sum_{i=1}^n |v_i|^p \right)^{\frac{1}{p}}$$

eine Norm im K^n . Sie wird p -Norm genannt. Für $n = 2$ erhält man die euklidische Norm.

Für $p \rightarrow \infty$ erhält man die sogenannte ∞ -Norm

$$\|v\|_{\infty} := \max_{1 \leq i \leq n} |v_i|$$

Je nach Situation kann es einem erheblichen Unterschied bedeuten, welche Norm betrachtet wird. Für $V = \mathbb{R}^2$:



- Die p -Norm auf $K^{m,n}$ ist definiert durch

$$\|A\|_p := \sup_{0 \neq v \in \mathbb{K}^n} \frac{\|Av\|_p}{\|v\|_p}$$

$\|A\|_p$ ist die durch die p -Norm induzierte Matrix-Norm.

Man kann zeigen:

- Supremum wird angenommen
- $\|A\|_p = \max_{\substack{v \in K^n \\ \|v\|_p = 1}} \|Av\|_p$

Man kann zeigen:

$$\|A\|_1 = \max_{1 \leq j \leq m} \sum_{i=1}^n |a_{ij}| \quad (\text{Spaltensummennorm})$$

$$\|A\|_\infty = \max_{1 \leq i \leq n} \sum_{j=1}^m |a_{ij}| \quad (\text{Zeilensummennorm})$$

Korollar 3.8: Sei V ein K -Vektorraum mit einem Skalarprodukt. Dann ist die Abbildung

$$\|\cdot\| : V \rightarrow \mathbb{R}, \quad v \mapsto \|v\| := (\langle v, v \rangle)^{\frac{1}{2}}$$

eine Norm auf V . Man nennt sie die durch das Skalarprodukt induzierte Norm.

Beweis:

- Homogenität: (Es gilt mit $\text{Re}(z) \leq |z| \forall z \in \mathbb{C}$)^(*))

$$\|\lambda v\|^2 = \langle \lambda v, \lambda v \rangle = \lambda \bar{\lambda} \langle v, v \rangle = |\lambda|^2 \langle v, v \rangle$$

- Positive Definitheit:

$$\begin{aligned}\langle v, v \rangle &\geq 0 \implies \|v\| \geq 0 \\ \langle v, v \rangle &= 0 \iff v = 0, \\ &\iff \|v\| = 0\end{aligned}$$

$$3. \quad \|v + w\| \leq \|v\| + \|w\|$$

$$\begin{aligned}\|v + w\|^2 &= \langle v + w, v + w \rangle = \langle v, v \rangle + \langle v, w \rangle + \langle w, v \rangle + \langle w, w \rangle \\ &= \langle v, v \rangle + \langle v, w \rangle + \overline{\langle v, w \rangle} + \langle w, w \rangle \\ &= \langle v, v \rangle + 2 \operatorname{Re}(\langle v, w \rangle) + \langle w, w \rangle \\ &\stackrel{(*)}{\leq} \langle v, v \rangle + 2|\langle v, w \rangle| + \langle w, w \rangle \\ &\stackrel{\text{CSU}}{\leq} \langle v, v \rangle + 2\langle v, v \rangle \langle w, w \rangle + \langle w, w \rangle \\ &= \|v\|^2 + 2\|v\| \|w\| + \|w\|^2 \\ &= (\|v\| + \|w\|)^2 \\ &\implies \sqrt{} \|v + w\| \leq \|v\| + \|w\|\end{aligned}$$

3.2. Winkel und Orthogonalität

In \mathbb{R}^2 bzw. \mathbb{R}^3 ist der von zwei Vektoren eingeschlossene Winkel anschaulich klar.
Übertragung auf allgemeine Vektorräume?

Zunächst: $V = \mathbb{R}^2$, Standardskalarprodukt $\langle v, w \rangle = w^T v$ und der damit induzierten Norm.

Aus Cauchy-Schwartz folgt:

$$-1 \leq \frac{\langle v, w \rangle}{\|v\| \cdot \|w\|} \quad \forall v, w \in \mathbb{R}^2 \setminus \{0\}$$

D.h. dieser Quotient ist gleich $\cos(\theta)$ für ein $\theta \in [0, \pi]$. Diesen nennt man den zwischen v und w eingeschlossenen Winkel.

$$\frac{\langle v, w \rangle}{\|v\| \cdot \|w\|} = \cos(\theta) \quad \rightarrow \quad \angle(v, w) := \arccos \frac{\langle v, w \rangle}{\|v\| \cdot \|w\|}$$

Passt das zur “üblichen” Winkeldefinition?

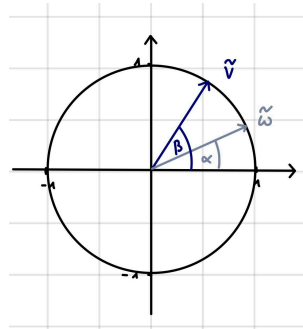
Aufgrund der Eigenschaften des Skalarprodukts folgt

$$\angle(v, w) = \angle(w, v), \quad \angle(\lambda v, w) = \angle(v, w) = \angle(v, \lambda w) \quad \forall \lambda > 0$$

Für $v \neq 0 \neq w$ und

$$\tilde{v} = \frac{1}{\|v\|} v \quad (\Rightarrow \|\tilde{v}\| = 1) \quad \text{und} \quad \tilde{w} = \frac{1}{\|w\|} w \quad (\Rightarrow \|\tilde{w}\| = 1)$$

gilt $\angle(v, w) = \angle(\tilde{v}, \tilde{w})$. Im Einheitskreis erhält man



Also gibt es $\alpha, \beta \in [0, 2\pi]$ mit

$$\tilde{v} = (\cos \beta, \sin \beta)^T \quad \tilde{w} = (\cos \alpha, \sin \alpha)^T$$

Gilt $\alpha, \beta \in [0, \pi]$ folgt aus einem Additionstheorem für \cos

$$\begin{aligned} \cos(\beta - \alpha) &= \cos \alpha \cos \beta + \sin \alpha \sin \beta \\ &= \langle \tilde{v}, \tilde{w} \rangle \cdot 1 \cdot 1 \end{aligned}$$

$$\angle(\tilde{v}, \tilde{w}) = \cos(\beta - \alpha)$$

Man kann den Winkel auch über die Gleichung

$$\langle v, w \rangle = \|v\| \cdot \|w\| \cdot \cos(\angle(v, w))$$

definiere. Dann ist auch $v = 0$ und/oder $w = 0$ erlaubt. Stehen v und w senkrecht aufeinander ($v \perp w$)

$$\cos(\angle(v, w)) = \cos\left(\frac{\pi}{2}\right) = 0 \quad \Rightarrow \quad \langle v, w \rangle = 0$$

Definition 3.9: orthogonal

Sei V ein endlichdimensionaler euklidischer oder unitärer Vektorraum.

1. Zwei Vektoren $v, w \in V$ heißen **orthogonal** bezüglich des gegebenen Skalarproduktes $\langle \cdot, \cdot \rangle$, wenn gilt $\langle v, w \rangle = 0$.
2. Für dieses Skalarprodukt heißt eine Basis $\{v_1, \dots, v_n\}$ von V **Orthogonalbasis**, wenn

$$\langle v_i, v_j \rangle = 0 \quad i, j = 1, \dots, n, \quad i \neq j$$

Ist zusätzlich für die induzierte Norm

$$\langle v_i, v_i \rangle^{\frac{1}{2}} = \|v_i\| = 1 \quad i = 1, \dots, n$$

so heißt $\{v_1, \dots, v_n\}$ **Orthonormalbasis** von V . ($\Leftrightarrow \langle v_i, v_j \rangle = \delta_{ij}$)

Satz 3.10: Sei V ein euklidischer oder unitärer Vektorraum mit $\dim(V) = n < \infty$. Sei $\{v_1, \dots, v_n\}$ eine Basis von V . Dann existiert eine Orthonormalbasis $\{w_1, \dots, w_n\}$ von V .

Beweis: Per Induktion über n .

Induktionsanfang: $n = 1$

Sei $v_1 \in V$, $v_1 \neq 0$. Dann gilt für $w_1 = \|v_1\|^{-1}v_1$, $\|w_1\| = 1$ und $\text{Span}\{v_1\} = \text{Span}\{w_1\}$.
 $\Rightarrow \{w_1\}$ ONB

Induktionsschritt: $n \rightarrow n + 1$

Die Aussage gelte für n . Sei $\dim(V) = n + 1$ und $\{v_1, \dots, v_{n+1}\}$ eine Basis von V . Dann ist $U = \text{Span}\{v_1, \dots, v_n\}$ ein n -dimensionaler Unterraum von V . Nach Induktionsvoraussetzung existiert eine ONB $\{w_1, \dots, w_n\}$ von U . D.h.,

$$\text{Span}\{w_1, \dots, w_n\} = \text{Span}\{v_1, \dots, v_n\}$$

Für

$$\tilde{w}_{n+1} = v_{n+1} - \sum_{k=1}^n \langle v_{n+1}, w_k \rangle w_k$$

gilt wegen $v_{n+1} \notin U$, dass $\tilde{w}_{n+1} \neq 0$. Mit dem Austauschsatz von Steinitz (Satz 2.23, LinA I) folgt für $w_{n+1} = \|\tilde{w}_{n+1}\|^{-1}\tilde{w}_{n+1}$, dass

$$V = \text{Span}\{v_1, \dots, v_{n+1}\} = \text{Span}\{w_1, \dots, w_{n+1}\}$$

Für $j = 1, \dots, n$ erhält man

$$\begin{aligned} \langle w_{n+1}, w_j \rangle &= \langle \|\tilde{w}_{n+1}\|^{-1} \tilde{w}_{n+1}, w_j \rangle \\ \|\tilde{w}_{n+1}\|^{-1} \langle v_{n+1} - \sum_{k=1}^n \langle v_{n+1}, w_k \rangle w_k, w_j \rangle \\ &= \|\tilde{w}_{n+1}\|^{-1} \left(\langle v_{n+1}, w_j \rangle - \sum_{k=1}^n \langle v_{n+1}, w_k \rangle \langle w_k, w_j \rangle \right) \\ \|\tilde{w}_{n+1}\|^{-1} (\langle v_{n+1}, w_j \rangle - \langle v_{n+1}, w_j \rangle) &= 0 \end{aligned}$$

$\Rightarrow \{w_1, \dots, w_{n+1}\}$ sind ONB.

□

Diese Orthogonalisierung ist als Gram-Schmidt-Verfahren bekannt. Jorgen Gram (dänischer Mathematiker, 1850-1916), Erhard Schmidt (deutscher Mathematiker, 1876-1959). Das Verfahren wurde bereits vor Laplace und Cauchy verwendet.

Algorithmus 3.11: Gram-Schmidt-Verfahren

Gegeben: $\{v_1, \dots, v_n\}$ als Basis eines euklidischen (unitären) Vektorraums V

1. Setze $w_1 := \|v_1\|^{-1}v_1$
2. Für $j = 2, \dots, n$ setze

$$\tilde{w}_j := v_j - \sum_{k=1}^{j-1} \langle v_j, w_k \rangle w_k$$

$$w_j := \|\tilde{w}_j\|^{-1} \tilde{w}_j$$

Die ursprüngliche Basis $\{v_1, \dots, v_n\}$ hat dann die Darstellung

$$(v_1, \dots, v_n) = (w_1, \dots, w_n) \underbrace{\begin{pmatrix} \|v_1\| & \langle v_1, w_1 \rangle & \dots & \langle v_n, w_1 \rangle \\ 0 & \|\tilde{w}_2\| & \ddots & \vdots \\ \vdots & \vdots & \ddots & \langle v_n, w_{n-1} \rangle \\ 0 & 0 & & \|\tilde{w}_n\| \end{pmatrix}}_{=R}$$

Da alle Diagonaleinträge von R ungleich 0 sind, ist R invertierbar. Sei nun U ein m -dimensionaler Unterraum von \mathbb{R}^n oder \mathbb{C}^n mit dem Skalarprodukt. Wir definieren eine Orthonormalbasis $\{w_1, \dots, w_m\}$ die Matrix

$$Q = (w_1, \dots, w_m) \in K^{n,m}$$

Damit gilt im reellen Fall

$$\mathbb{R}^{m,m} \ni Q^T Q = (w_i^T w_j)_{i,j=1,\dots,m} = (\delta_{ij})_{i,j=1,\dots,m} = I_m$$

und im komplexen Fall

$$\mathbb{C}^{m,m} \ni Q^H Q = (w_i^H w_j)_{i,j=1,\dots,m} = I_m$$

für $m = n$: $Q^T = Q^{-1}$ bzw. $Q^H = Q^{-1}$

Umgekehrt gilt: Ist für eine Matrix $Q \in K^{m,n}$ $Q^T Q = I_m$ bzw. $Q^H Q = I_m$, so sind die Spalten von Q eine ONB bzgl. des Standardskalarproduktes eines m -dimensionalen Unterraums von \mathbb{R}^n bzw. \mathbb{C}^n . Damit gilt:

Satz 3.12: Sind $v_1, \dots, v_m \in K^n$ linear unabhängig, dann gibt es eine Matrix $Q \in K^{n,m}$ mit orthonormalen Spalten bezüglich des Standardskalarproduktes und eine obere Dreiecksmatrix $R \in \text{GL}_m(K)$ mit

$$K^{n,m} \ni (v_1, \dots, v_m) = QR$$

als sogenannte QR -Zerlegung

$QR \rightarrow$ numerische lineare Algebra \rightarrow kleinste Quadrate-Problem

Die Matrix Q ist längenerhaltend:

Lemma 3.13: Sei $Q \in K^{m,n}$ eine Matrix mit orthogonalen Spalten bzgl. des Standardskalarproduktes. Dann gilt $\|v\|_2 = \|Qv\|_2$ für alle $v \in K^n$, wobei hier $\|\cdot\|_2$ die euklidische Norm ist.

Beweis:

$$\|v\|_2^2 = \langle v, v \rangle = v^H v = v^H I v = v^H Q^H Q v = \|Qv\|_2^2$$

□

Definition 3.14: Orthogonale und unitäre Matrizen

- Eine Matrix $Q \in \mathbb{R}^{n,n}$ heißt **orthogonal**, wenn $Q^T Q = I_n$ gilt. Wir definieren

$$\mathcal{O}_n(\mathbb{R}) := \{Q \in \mathbb{R}^{n,n} \mid Q \text{ orthogonal}\}$$

- Eine Matrix $Q \in \mathbb{C}^{n,n}$ heißt **unitär**, wenn $Q^H Q = I_n$. Wir definieren

$$U_n(\mathbb{C}) := \{Q \in \mathbb{C}^{n,n} \mid Q \text{ unitär}\}$$

Für orthogonale bzw. unitäre Matrizen gilt

$$\mathbb{R}^{n,n} \ni Q^T Q = I_n \implies Q^T = Q^{-1}, \mathbb{C}^{n,n} \ni Q^H Q = I_n \implies Q^H = Q^{-1}$$

D.h.

Lemma 3.15: Die Mengen $\mathcal{O}_n(\mathbb{R})$ und $U_n(\mathbb{C})$ bilden Untergruppen von $\text{GL}_n(\mathbb{R})$ und $\text{GL}_n(\mathbb{C})$.

Beweis: Hier nur $\text{GL}_n(\mathbb{R})$

Für $I_n \in \mathbb{R}^{n,n}$ gilt $I_n^T I_n = I_n \implies I_n \in \mathcal{O}_n(\mathbb{R}) \implies \mathcal{O}_n(\mathbb{R}) \neq \emptyset$.

zu zeigen: Gruppeneigenschaften

1. Abgeschlossenheit bzgl. der inneren Verknüpfung

Sind $Q_1, Q_2 \in \mathcal{O}_n(\mathbb{R})$. Dann gilt:

$$\begin{aligned} (Q_1 Q_2)^T Q_1 Q_2 &= Q_2^T Q_1^T Q_1 Q_2 = I_n \\ \implies Q_1 Q_2 &\in \mathcal{O}_n(\mathbb{R}) \end{aligned}$$

2. Neutrales Element: I_n

3. Inverses Element: $Q^{-1} = Q^T$

Jetzt: Übertragung auf Endomorphismen, auch der geometrische Aspekt

Definition 3.16: orthogonale Abbildung

Eine Abbildung $f \in L(V, V)$ heißt **orthogonal** ($V = \mathbb{R}$) bzw. **unitär** ($V = \mathbb{C}$) falls gilt

$$\langle f(v), f(w) \rangle = \langle v, w \rangle \quad \forall v, w \in V$$

Definition 3.17:

Wir definieren für einen euklidischen Vektorraum V

$$\mathcal{O}(V) := \{f \in L(V, V) \mid f \text{ orthogonal}\}$$

bzw. für einen unitären Vektorraum V

$$U(V) := \{f \in L(V, V) \mid f \text{ unitär}\}$$

Lemma 3.18: Sei $f \in L(V, V)$ orthogonal bzw. unitär. Dann gilt:

1. $\|f(v)\| = \|v\| \quad \forall v \in V$ für die durch das Skalarprodukt induzierte Norm
2. $v \perp w \implies f(v) \perp f(w)$
3. f ist ein Isomorphismus und f^{-1} ist ebenfalls orthogonal bzw. unitär.
4. Ist $\lambda \in K$ ein Eigenwert von f , so gilt $|\lambda| = 1$

Beweis: 1 und 2 folgt direkt aus der Definition.

3: Injektivität folgt aus 1 + pos. Definitheit der Norm. Surjektivität folgt dann aus der Dimensionsformel. Aus der Surjektivität von f und f orthogonal bzw. unitär folgt diese Eigenschaft auch für f^{-1} . 4: Ist λ ein Eigenwert von f mit dem Eigenvektor $v \neq 0$, so gilt

$$\begin{aligned} \|v\| &= \|f(v)\| = \|\lambda v\| = |\lambda| \|v\| \\ 1 &= |\lambda| \end{aligned}$$

Aus der Definition des Skalarproduktes und orthogonal bzw. unitär folgt

Korollar 3.19: Gilt für $f \in L(V, V)$, dass

$$\|f(v)\| = \|v\|$$

für die durch das Skalarprodukt induzierte Norm, so ist f orthogonal bzw. unitär.

Aus diesen Gründen werden orthogonale bzw. unitäre Abbildungen auch Isometrien genannt.

Satz 3.20: Sei V ein euklidischer (unitärer) Vektorraum mit einer Orthonormalbasis $B = \{v_1, \dots, v_n\}$ und $f \in L(V, V)$. Dann gilt:

$$f \in \mathcal{O}(V) \text{ bzw. } f \in U(V) \iff A_f^{B,B} \in \mathcal{O}_n(\mathbb{R}) \text{ bzw. } A_f^{B,B} \in U_n(\mathbb{C})$$

D.h. die Abbildungen

$$\mathcal{O}(V) \rightarrow \mathcal{O}_n(\mathbb{R}), f \mapsto A_f^{B,B} \text{ bzw. } U(V) \rightarrow U_n(\mathbb{C}), f \mapsto A_f^{B,B}$$

Beweis: Hier nur für $K = \mathbb{R}$

“ \implies ”: f orthogonal

Dann gilt wegen der Orthonormalität von B für $A_f^{B,B} = (a_{ij})$, dass

$$\delta_{ij} = \langle v_i, v_j \rangle \stackrel{3.16}{=} \langle f(v_i), f(v_j) \rangle = \left\langle \sum_{l=1}^n a_{li} v_l, \sum_{k=1}^n a_{kj} v_k \right\rangle = \sum_{l=1}^n a_{li} a_{lj}$$

Also:

$$I_n = (A_f^{B,B})^T A_f^{B,B} \implies A_f^{B,B} \in \mathcal{O}_n(\mathbb{R})$$

“ \impliedby ”: $A_f^{B,B} \in \mathcal{O}_n(\mathbb{R})$. Für die zugehörige lineare Abbildung f gilt wegen

$$f(v_i) = \sum_{l=1}^n a_{li} v_l,$$

dass

$$\begin{aligned} \langle f(v_i), f(v_j) \rangle &= \left\langle \sum_{l=1}^n a_{li} v_l, \sum_{k=1}^n a_{kj} v_k \right\rangle = \sum_{l=1}^n a_{li} a_{lj} \stackrel{A_f^{B,B} \in \mathcal{O}_n(\mathbb{R})}{=} \delta_{ij} = \langle v_i, v_j \rangle \\ &\implies f \in \mathcal{O}(V) \end{aligned}$$

□

3.3. Selbstadjungierte Abbildungen

Was ist ein adjungierter Endomorphismus?

Lemma 3.21: Sei V ein euklidischer (unitärer) Vektorraum und $f \in L(V, V)$. Dann gibt es genau ein $g \in L(V, V)$ mit

$$\langle f(v), w \rangle = \langle v, g(w) \rangle \quad \forall v, w \in V$$

Ist B eine Orthonormalbasis von V , so gilt

$$A_g^{B,B} = \left(A_f^{B,B} \right)^H$$

Beweis: Hier nur für $K = \mathbb{R}$. Da B orthonormal ist gilt für $v = \Phi_B(x)$ und $w = \Phi_B(y)$, dass

$$\langle v, w \rangle = \langle A_{\Phi_B}^{E,B}, A_{\Phi_B}^{E,B} \rangle = x^T \underbrace{\left(A_{\Phi_B}^{E,B} \right)^T A_{\Phi_B}^{E,B}}_I y = x^T y = \langle x, y \rangle_{\mathbb{R}^n} \quad \forall v, w \in V$$

Dann gilt für $A_f^{B,B}$

$$\langle A_f^{B,B} x, y \rangle_{\mathbb{R}^n} = \left(A_f^{B,B} x \right)^T y = x^T \left(A_f^{B,B} \right)^T y = \langle x, \left(A_f^{B,B} \right)^T y \rangle_{\mathbb{R}^n}$$

Damit ist wegen der Definition des Skalarproduktes eindeutig eine lineare Abbildung mit der Darstellungsmatrix $\left(A_f^{B,B} \right)^T$ gegeben. Diese bestimmt eindeutig den gesuchten Endomorphismus g .

□

Definition 3.22: adjungierter Endomorphismus

Die in Lemma 3.21 eindeutig definierte Abbildung $g \in L(V, V)$ nennt man den zu $f \in L(V, V)$ **adjungierten Endomorphismus**. Er wird mit f^{ad} bezeichnet.

Definition 3.23: selbstadjungiert

Sei V ein euklidischer (unitärer) Vektorraum und $f \in L(V, V)$. Der Endomorphismus f heißt **selbstadjungiert**, wenn

$$\langle f(v), w \rangle = \langle v, f(w) \rangle \quad \forall v, w \in V$$

gilt. D.h. $f^{\text{ad}} = f$.

Bemerkungen: Es folgt unmittelbar

- Ist $f \in L(V, V)$ und B eine ONB, so gilt

$$f \text{ selbstadjungiert} \iff A_f^{B,B} \text{ ist symmetrisch bzw. hermitesch, d.h. } A = A^H$$

- Ist f orthogonal bzw. unitär, so ist $f^{\text{ad}} = f^{-1}$, denn für $u, v \in V$ mit $w = f(u)$ d.h. $u = f^{-1}(w)$ gilt

$$\langle f(v), w \rangle = \langle f(v), f(u) \rangle = \langle v, u \rangle = \langle v, f^{-1}(w) \rangle$$

Lemma 3.24: Sei V ein euklidischer (unitärer) Vektorraum und $f \in L(V, V)$ selbstadjungiert. Dann sind alle Eigenwerte von f reell und das charakteristische Polynom zerfällt in Linearfaktoren.

Beweis: Sei zunächst $K = \mathbb{C}$. Sei λ ein Eigenwert von f mit zugehörigen Eigenvektor $v \neq 0$. Dann gilt

$$\lambda \underbrace{\langle v, v \rangle}_{>0} = \langle \lambda v, v \rangle = \langle f(v), v \rangle = \langle v, f(v) \rangle = \langle v, \lambda v \rangle = \bar{\lambda} \langle v, v \rangle$$

$$\Rightarrow \lambda = \bar{\lambda} \in \mathbb{R}$$

Fundamentalsatz der Algebra $\Rightarrow p_f(\cdot) = p_A(\cdot)$ zerfällt über \mathbb{C} in Linearfaktoren.

Sei nun $K = \mathbb{R}$. B ONB $\Rightarrow A := A_f^{B,B} = (A_f^{B,B})^T$ ist eine spezielle komplexe Matrix \Rightarrow wie oben folgt für $p_A(\cdot)$ betrachtet über \mathbb{C} , dass $p_A(\cdot)$ in Linearfaktoren zerfällt

$$(\lambda - \lambda_i) \quad (\lambda_i \text{ ist EW} \in \mathbb{R})$$

$\Rightarrow p_A(\cdot)$ zerfällt auch über \mathbb{R} in Linearfaktoren.

□

Satz 3.25: Sei V ein euklidischer (unitärer) Vektorraum und $f \in L(V, V)$ selbstadjungiert. Dann gibt es eine Orthonormalbasis von V die aus Eigenvektoren zu den reellen Eigenwerten von f besteht.

Beweis: Sei $n = \dim(V) < \infty$.

Für $n = 1$: klar ✓

$n - 1 \rightarrow n$:

Wegen Lemma 3.24 gilt

$$p_f(\lambda) = \pm(\lambda - \lambda_1) \cdot \dots \cdot (\lambda - \lambda_n)$$

mit $\lambda_1, \dots, \lambda_n \in \mathbb{R}$. Zu λ_1 existiert ein Eigenvektor v_1 mit $\|v_1\| = 1$. Dann gilt für

$$u \in U := \{u \in V \mid \langle v_1, u \rangle = 0\},$$

dass

$$\langle v_1, f(u) \rangle = \langle f(v_1), u \rangle = \lambda_1 \underbrace{\langle v_1, u \rangle}_{=0} = 0$$

d.h. $f(U) \subseteq U$. Also ist U invariant unter f . Die Einschränkung $f|_U : U \rightarrow U$ ist selbstadjungiert mit

$$p_{f|_U} = \pm(\lambda - \lambda_2) \cdot \dots \cdot (\lambda - \lambda_k)$$

Nach Induktionsvoraussetzung ex. ONB für U . Die Vereinigung dieses ONB mit v_1 ist ONB für V .

□

Für die Matrixform erhalten wir analog:

Lemma 3.26: Sei $A \in K^{n,n}$ symmetrisch (hermitesch). Dann gibt es ein $T \in \text{GL}_n(K)$ und $\lambda_1, \dots, \lambda_n \in \mathbb{R}$ so dass gilt

$$TAT^{-1} = \begin{pmatrix} \lambda_1 & & 0 \\ & \ddots & \\ 0 & & \lambda_n \end{pmatrix}$$

Beweis: Über Darstellungsmatrix eines selbstadjungierten Endomorphismus.

□

Definition 3.27: positiv definite Matrix

Eine symmetrische (hermitesche) Matrix $A \in K^{n,n}$ heißt **positiv definit**, wenn

$$v^T Av > 0 \text{ bzw. } v^H Av > 0 \quad \forall v \in V \setminus \{0\}$$

Lemma 3.26 $\implies A$ symmetrisch (hermitesch) $\implies A$ diagonalisierbar

Des Weiteren gilt:

Satz 3.28: Sei $A \in K^{n,n}$ symmetrisch (hermitesch). Dann sind folgende Aussagen äquivalent:

1. A ist positiv definit
2. Alle Eigenwerte $\lambda_1, \dots, \lambda_n \in \mathbb{R}$ von A sind positiv.

Beweis: Vorlesung Donnerstag

□

Zur Berechnung einer solchen ONB:

Algorithmus 3.29: Gegeben: $A \in K^{n,n}$ bzw. $f \in L(V, V)$ mit $A_f^{B,B} = A$.

- Bestimme

$$p_A(\lambda) = \pm(\lambda - \lambda_1)^{k_1} \cdot \dots \cdot (\lambda - \lambda_m)^{k_m}$$

mit paarweise verschiedenen λ_i , $1 \leq i \leq m$. Ist dies nicht möglich: STOP

- Für jeden Eigenwert λ_i der algebraischen Vielfachheit k_i bestimme eine Basis des dazugehörigen Eigenraums $\text{Eig}(A, \lambda_i)$. Stimmen geometrische und algebraische Vielfachheit überein: STOP

- Orthonormalisiere die Vereinigung der jeweiligen Basen mit dem Gram-Schmidt-Verfahren.