

КОЛЛОКВИУМ ПО ЛИНЕЙНОЙ АЛГЕБРЕ

Лектор: Чубаров И. А. • Автор: Пшеничный Никита*, группа 109

1 курс • Весенний семестр 2024 г.

Аннотация

При подготовке данного файла я использовал курсы лекций И. А. Чубарова, Т. Е. Панова и О. В. Куликовой и книги «Курс алгебры» Э. Б. Винберга, «Сборник задач по аналитической геометрии и линейной алгебре» под редакцией Ю. М. Смирнова и «Задачи по линейной алгебре» А. А. Гайфуллина, А. В. Пенского и С. В. Смирнова.

Обо всех ошибках и опечатках пишите мне, исправлю.

Программа коллоквиума

1	Векторные пространства. Линейная зависимость и независимость векторов. Базис, размерность. Примеры	3
2	Матрица перехода от одного базиса к другому. Изменение координат вектора при замене базиса	6
3	Изоморфизм векторных пространств одинаковой размерности	7
4	Векторные подпространства, равносильность двух способов их задания. Сумма и пересечение подпространств. Формула Грассмана	7
5	Прямая сумма подпространств. Внешняя прямая сумма векторных пространств	11
6	Факторпространство, его размерность. Коразмерность. Связь с решениями неоднородной системы линейных уравнений	12
7	Линейные функции на векторном пространстве, их ядра. Изменение коэффициентов линейной формы при замене базиса. Сопряжённое пространство V^* , дуальный базис. Канонический изоморфизм $V \simeq V^{**}$	14
8	Линейные отображения и операторы. Ядро и образ, связь их размерностей. Критерий инъективности	16
9	Задание линейных отображений (операторов) матрицами. Изменение матрицы линейного отображения при переходе к другим базисам. Нахождение ядра и образа при помощи матрицы	17
10	Линейные операторы. Изменение матрицы линейного оператора при переходе к новому базису. Подобные матрицы	18
11	Векторное пространство линейных отображений. Алгебра линейных операторов. Изоморфизм алгебры матриц и алгебры линейных операторов	18

*Telegram: @pshenikita. Последняя компиляция: 3 апреля 2024 г.

12	Инвариантные подпространства линейного оператора. Ограничение линейного оператора на инвариантное подпространство. Вид матрицы линейного оператора при наличии инвариантных подпространств	19
13	Собственные векторы и собственные значения линейного оператора. Линейная независимость собственных векторов линейного оператора, отвечающих попарно различным собственным значениям	20
14	Вычисление собственных значений и собственных векторов с помощью матрицы. Характеристический многочлен	20
15	Собственные подпространства. Неравенство между размерностью собственного подпространства и кратностью корня характеристического многочлена	21
16	Диагонализуемость (матрицы) линейного оператора. Критерии диагонализуемости и достаточное условие	21
17	Аннулирующие многочлены линейного оператора (матрицы). Минимальный многочлен. Критерий диагонализуемости в терминах минимального многочлена	22
18	Теорема Гамильтона — Кэли	25
19	Существование одномерного или двумерного инвариантного подпространства для любого линейного оператора над полем действительных чисел	25
20	Корневые подпространства. Разложение пространства в прямую сумму корневых подпространств	28
21	Жордановы клетки и матрицы, их характеристические и минимальные многочлены. Жорданов базис	29

1. ВЕКТОРНЫЕ ПРОСТРАНСТВА. ЛИНЕЙНАЯ ЗАВИСИМОСТЬ И НЕЗАВИСИМОСТЬ ВЕКТОРОВ. БАЗИС, РАЗМЕРНОСТЬ. ПРИМЕРЫ

Определение 1. *Линейным (или векторным) пространством над полем \mathbb{F} называется множество V с заданными на нём операциями сложения $+$: $(u, v) \in V \times V \mapsto (u + v) \in V$ и умножения элементов V на элементы \mathbb{F} : $(\lambda, v) \in \mathbb{F} \times V \mapsto (\lambda \cdot v) \in V$, удовлетворяющие следующим аксиомам:*

- | | | |
|--|---|---------------------------------------|
| <ol style="list-style-type: none"> 1. $v + u = u + v \ \forall u, v \in V$; 2. $(u + v) + w = u + (v + w) \ \forall u, v, w \in V$; 3. $\exists \mathbf{0} \in V : v + \mathbf{0} = v \ \forall v \in V$; 4. $\forall v \in V \exists (-v) \in V : v + (-v) = \mathbf{0}$; | } | $(V, +)$ — абелева группа |
| <ol style="list-style-type: none"> 5. $\lambda \cdot (u + v) = \lambda \cdot u + \lambda \cdot v \ \forall u, v \in V, \forall \lambda \in \mathbb{F}$; 6. $(\lambda + \mu) \cdot v = \lambda \cdot v + \mu \cdot v \ \forall v \in V, \forall \lambda, \mu \in \mathbb{F}$; 7. $\lambda \cdot (\mu \cdot v) = (\lambda\mu) \cdot v \ \forall v \in V, \forall \lambda, \mu \in \mathbb{F}$; 8. $1 \cdot v = v \ \forall v \in V$. | } | \mathbb{F} линейно действует на V |

Определение 2. Элементы множества V называются *векторами*, элемент $\mathbf{0}$ называется *нулевым вектором*, а элемент $(-v)$ называется *противоположным к v* . Элементы \mathbb{F} называют *скалярами*.

Предложение 1.

1. $\mathbf{0} \cdot v = \lambda \cdot \mathbf{0} = \mathbf{0} \ \forall v \in V, \forall \lambda \in \mathbb{F}$;
2. $(-1) \cdot v = -v \ \forall v \in V$;
3. $\lambda v = \mathbf{0} \Rightarrow \lambda = 0$ или $v = \mathbf{0}$.

Доказательство.

1. $0 \cdot v + 0 \cdot v = (0 + 0) \cdot v = 0 \cdot v \Rightarrow 0 \cdot v = \mathbf{0}$. Аналогично, $\lambda \cdot \mathbf{0} + \lambda \cdot \mathbf{0} = \lambda(\mathbf{0} + \mathbf{0}) = \lambda \cdot \mathbf{0} \Rightarrow \lambda \cdot \mathbf{0} = \mathbf{0}$;
2. $v + (-1) \cdot v = 1 \cdot v + (-1) \cdot v = (1 - 1) \cdot v = 0 \cdot v = \mathbf{0} \Rightarrow -v = (-1) \cdot v$.
3. $\lambda \neq 0 \Rightarrow \mathbf{0} = \lambda^{-1} \lambda v = v$.

■

Пример 1.

1. Множество $\{\mathbf{0}\}$ из одного элемента является линейным пространством над любым полем.
2. Множества геометрических векторов на прямой, плоскости или пространстве являются линейными пространствами над полем \mathbb{R} .
3. Поле \mathbb{F} является векторным пространством над самим собой.
4. Поле \mathbb{C} является линейным пространством над полем \mathbb{R} , а поле \mathbb{R} является линейным пространством над полем \mathbb{Q} .

5. Пусть $\mathbb{F}^n := \left\{ \begin{pmatrix} x_1 \\ x_2 \\ \vdots \\ x_n \end{pmatrix} : x_i \in \mathbb{F} \right\}$ — множество столбцов фиксированной длины n из элементов поля \mathbb{F} . Операции покомпонентного сложения и умножения на скаляры

$$\begin{pmatrix} x_1 \\ x_2 \\ \vdots \\ x_n \end{pmatrix} + \begin{pmatrix} y_1 \\ y_2 \\ \vdots \\ y_n \end{pmatrix} := \begin{pmatrix} x_1 + y_1 \\ x_2 + y_2 \\ \vdots \\ x_n + y_n \end{pmatrix}, \quad \lambda \cdot \begin{pmatrix} x_1 \\ x_2 \\ \vdots \\ x_n \end{pmatrix} := \begin{pmatrix} \lambda x_1 \\ \lambda x_2 \\ \vdots \\ \lambda x_n \end{pmatrix}.$$

задают на \mathbb{F}^n структуру линейного пространства над \mathbb{F} . Его часто называют *координатным*.

Пусть V — линейное пространство над полем \mathbb{F} .

Определение 3. *Линейной комбинацией* системы векторов $\{v_i : i \in I\}$ называется формальная сумма вида $\sum_{i \in I} \lambda_i v_i$, в которой лишь конечное число скаляров λ_i отличны от нуля.

Примечание. Линейную комбинацию системы $\{v_i : i \in I\}$ можно также определить как функцию $i \in I \mapsto \lambda_i \in \mathbb{F}$, которая принимает ненулевое значение только на конечном числе индексов.

Определение 4. Линейная комбинация $\sum_{i \in I} \lambda_i v_i$ называется *тривиальной*, если $\lambda_i = 0 \forall i \in I$.

Определение 5. Система векторов $\{v_i : i \in I\}$ называется *линейно зависимой*, если существует нетривиальная линейная комбинация, представляющая нулевой вектор. В противном случае система называется *линейно независимой*.

Лемма 1. Если система векторов $\{v_i : i \in I\}$ линейно зависима, то в ней найдётся вектор, представленный линейной комбинацией всех остальных.

Доказательство. Пусть $\sum_{i \in I} \lambda_i v_i = \mathbf{0}$, причём $\exists \lambda_j \neq 0$. Тогда $v_j = \sum_{i \in I \setminus \{j\}} \frac{-\lambda_i}{\lambda_j} v_i$. ■

Определение 6. *Базисом* пространства V называется линейно независимая система $\{v_i : i \in I\}$, порождающая всё пространство V , т.е. такая, что каждый вектор из V представляется какой-то линейной комбинацией системы $\{v_i : i \in I\}$.

Определение 7. Линейное пространство называется *конечномерным*, если в нём существует базис, состоящий из конечного числа векторов. В противном случае пространство называется *бесконечномерным*.

Предложение 2. Представление любого вектора линейного пространства в виде линейной комбинации базисных векторов единственно.

Доказательство. Действительно, если $v = \sum_{i \in I} \lambda_i v_i = \sum_{i \in I} \mu_i v_i$ (где $\{v_i : i \in I\}$ — базис), то получаем $\mathbf{0} = \sum_{i \in I} (\lambda_i - \mu_i) v_i$. Из линейной независимости базиса, линейная комбинация в правой части тривиальна и $\lambda_i = \mu_i \forall i \in I$ и два представления v совпадают. ■

Определение 8. *Линейная комбинация* системы векторов $\langle v_i : i \in I \rangle$ есть множество всевозможных линейных комбинаций $\sum_{i \in I} \lambda_i v_i$.

Теорема 1. В конечномерном пространстве все базисы состоят из одного числа элементов.

Доказательство этой теоремы будет опираться на следующую лемму.

Лемма 2 (О линейной зависимости). Пусть $\{e_1, \dots, e_m\}$ и f_1, \dots, f_n — две (конечные) линейно независимые системы, причём $\{f_1, \dots, f_n\} \subseteq \langle e_1, \dots, e_m \rangle \Rightarrow n \leq m$.

Доказательство. Пусть $f_j = a_{1j}e_1 + \dots + a_{mj}e_m$, $a_{ij} \in \mathbb{F}$, $j = 1, \dots, n$. Т.к. f_1, \dots, f_n — линейно независимая система векторов, то $x_1 f_1 + \dots + x_n f_n = \mathbf{0} \Leftrightarrow x_1 = \dots = x_n = 0$. Подставляя сюда выражения f_i через e_1, \dots, e_m , получаем

$$\begin{aligned} \mathbf{0} &= x_1(a_{11}e_1 + \dots + a_{m1}e_m) + \dots + x_n(a_{1n}e_1 + \dots + a_{mn}e_m) = \\ &= (a_{11}x_1 + \dots + a_{1n}x_n)e_1 + \dots + (a_{m1}x_1 + \dots + a_{mn}x_n)e_m. \end{aligned}$$

Т. к. e_1, \dots, e_m — линейно независимая система, то последнее равенство равносильно

$$\begin{cases} a_{11}x_1 + \dots + a_{1n}x_n = 0, \\ \dots \\ a_{m1}x_1 + \dots + a_{mn}x_n = 0. \end{cases}$$

Если $n > m$, то эта система имеет ненулевое решение, что противоречит линейной независимости системы f_1, \dots, f_n . ■

Теперь докажем теорему 1:

Доказательство. Пусть V — конечномерное пространство. По определению, в V существует базис e_1, \dots, e_m . Пусть $\{f_i : i \in I\}$ — другой базис. Если этот базис бесконечен, то в нём содержится конечная линейно независимая система векторов f_1, \dots, f_n , где $n > m$. При этом, т. к. e_1, \dots, e_m — базис, мы имеем $\{f_1, \dots, f_n\} \subseteq \langle e_1, \dots, e_m \rangle$, что противоречит лемме о линейной зависимости. Следовательно, базис $\{f_i : i \in I\}$ конечен, т. е. имеет вид f_1, \dots, f_n . Тогда $\{f_1, \dots, f_n\} \subseteq \langle e_1, \dots, e_m \rangle$ и $\{e_1, \dots, e_m\} \subseteq \langle f_1, \dots, f_n \rangle$. Отсюда $n = m$. ■

Лемма 3. В конечномерном пространстве любую линейно независимую систему можно дополнить до базиса.

Доказательство. Пусть $\{e_1, \dots, e_k\}$ — конечная подсистема в V . Тогда, если эта система максимальна по включению, то она базис. Иначе существует $e_{k+1} \in V$ такой, что система $\{e_1, \dots, e_k, e_{k+1}\}$ линейно независима. Продолжая процесс далее, за конечное число шагов получим базис (в силу конечномерности пространства V). ■

Примечание. Ниже изложен удобный алгоритм дополнения линейно независимой системы до базиса. Пусть

$$u_1 = \begin{pmatrix} u_{11} \\ \vdots \\ u_{1n} \end{pmatrix}, \quad u_2 = \begin{pmatrix} u_{21} \\ \vdots \\ u_{2n} \end{pmatrix}, \quad \dots, \quad u_m = \begin{pmatrix} u_{m1} \\ \vdots \\ u_{mn} \end{pmatrix}$$

линейно независимы. Обозначим

$$U = \begin{pmatrix} u_{11} & u_{21} & \dots & u_{m1} \\ \vdots & \vdots & \ddots & \vdots \\ u_{1n} & u_{2n} & \dots & u_{mn} \end{pmatrix}.$$

Отметим, что $\text{rk } U = m$, а $\text{rk}(U \mid E) = n$. Так что нужно привести матрицу $(U \mid E)$ элементарными преобразованиями к ступенчатому виду и дополнить столбцы матрицы U единичными столбцами, вошедшими в базис матрицы $(U \mid E)$.

Лемма 4. Всякое конечномерное линейное пространство V обладает базисом. Более точно, из всякого конечного порождающего множества $S \subset V$ можно выбрать базис пространства V .

Доказательство. Если множество S линейно независимо, то по лемме 1 в нём найдётся вектор, линейно выражающийся через остальные. Выкидывая этот вектор, мы получаем порождающее множество из меньшего числа векторов. Продолжая так дальше, мы в конце концов получим линейно независимое порождающее множество, т. е. базис. ■

Примечание. Чтобы сделать это на практике, выписываем векторы в матрицу по столбцам, приводим её к ступенчатому виду и те столбцы, в которых стоят лидеры, будут базисными.

Определение 9. *Размерностью* конечномерного линейного пространства V (обозначается $\dim V$) называется число элементов в базисе V . Если V бесконечномерно, то пишут $\dim V = \infty$.

Лемма 5 (Свойство монотонности размерности). Подпространство W конечномерного пространства V конечномерно, причём $\dim W \leq \dim V$ и равенство достигается только при $W = V$.

Доказательство. Пусть $\dim V = m$ и e_1, \dots, e_m — базис пространства V . Если $\dim W > m$, то в W найдётся линейно независимая система f_1, \dots, f_n с $n > m$. Причём $\{f_1, \dots, f_n\} \subseteq \langle e_1, \dots, e_m \rangle = V$, что противоречит лемме о линейной зависимости. Следовательно, $\dim W \leq \dim V$.

Пусть $\dim W = \dim V = m$ и пусть f_1, \dots, f_m — базис в W . Тогда каждый вектор линейно выражается через f_1, \dots, f_m , так как иначе получили бы линейно независимую систему f_1, \dots, f_m, e_i из $m + 1$ векторов в V , что противоречит теореме 1. Следовательно, любой вектор из V лежит в $\langle f_1, \dots, f_m \rangle = W$, т. е. $V \subseteq W$, а обратное включение верно из условия. Итак, получаем $V = W$. ■

Примечание. В нулевом пространстве $\{0\}$ базисом естественно считать пустое множество \emptyset . Поэтому $\dim\{0\} = 0$.

2. МАТРИЦА ПЕРЕХОДА ОТ ОДНОГО БАЗИСА К ДРУГОМУ. ИЗМЕНЕНИЕ КООРДИНАТ ВЕКТОРА ПРИ ЗАМЕНЕ БАЗИСА

Определение 1. Пусть V — линейное пространство, и e_1, \dots, e_n — базис в V . Любой вектор $x \in V$ единственным образом представляется в виде линейной комбинации базисных векторов: $x = \sum_{i=1}^n x_i e_i$. Числа $x_1, \dots, x_n \in \mathbb{F}$ называются *координатами* вектора x в базисе e_1, \dots, e_n .

Обозначения Эйнштейна. Вместо $\sum_{i=1}^n x_i e_i$ пишем $x^i e_i$ (суммирование производится по повторяющемуся индексу). В связи с этим обозначением, нам будет также удобно обозначать координаты вектора верхними индексами вместо нижних. Для произведения матриц: $c_k^i = a_j^i b_k^j$ (суммирование опять производится по повторяющемуся индексу). Матрица (d_k^j) является обратной к (c_j^i) , если $c_j^i d_k^j = \delta_k^i$ — символ Кронекера.

Пусть в пространстве V заданы два базиса: «старый» e_1, \dots, e_n и «новый» e'_1, \dots, e'_n . Нам будет удобно обозначать векторы нового базиса через e'_1, \dots, e'_n . Элементы нового базиса выражаются через элементы старого: $e_{i'} = c_{ij}^i e_i$, $i' = 1, \dots, n$. Эти формулы равносильны одному матричному равенству

$$(e'_1, \dots, e'_{n'}) = (e_1, \dots, e_n) \cdot \begin{pmatrix} c_{1'}^1 & \cdots & c_{n'}^1 \\ \vdots & \ddots & \vdots \\ c_{1'}^n & \cdots & c_{n'}^n \end{pmatrix}.$$

Определение 2. Матрица $C := (c_{i'}^i)$ называется *матрицей перехода* от базиса e_1, \dots, e_n к базису $e'_1, \dots, e'_{n'}$. Её столбцами являются координаты новых базисных векторов в старом базисе.

Предложение 1.

1. Матрица $C_{e' \rightarrow e} = (c_{i'}^i)$ перехода от базиса $e'_1, \dots, e'_{n'}$ к базису e_1, \dots, e_n является обратной к матрице $C_{e \rightarrow e'}$ перехода от e_1, \dots, e_n к $e'_1, \dots, e'_{n'}$, т. е. $C_{e \rightarrow e'} \cdot C_{e' \rightarrow e} = E$. В частности, матрица перехода всегда невырождена.
2. Если $e_1, \dots, e_n, e'_1, \dots, e'_{n'}, e''_1, \dots, e''_{n''}$ — три базиса, то для соответствующих матриц перехода выполнено $C_{e \rightarrow e'} \cdot C_{e' \rightarrow e''} = C_{e \rightarrow e''}$.

Доказательство. Первое утверждение следует из второго, если положить $e'' = e$, поэтому будем доказывать второе утверждение. Пусть $C_{e \rightarrow e'} = (c_{i'}^i)$, $C_{e' \rightarrow e''} = (c_{i''}^{i'})$, $C_{e \rightarrow e''} = (c_{i''}^i)$. Тогда

$$c_{i''}^i e_i = e_{i''} = c_{i''}^{i'} e_{i'} = c_{i''}^{i'} c_{i'}^i e_i = c_{i''}^i c_{i''}^{i'} e_i \Rightarrow c_{i''}^i = c_{i''}^{i'} \cdot c_{i'}^i.$$

■

Примечание. Важное практическое следствие. Заметим, что в \mathbb{R}^n писать матрицу перехода от стандартного базиса к любому другому очень легко — достаточно написать базисные векторы, в которые мы хотим перейти, по столбцам матрицы. Пусть мы хотим написать матрицу перехода от базиса $a = \{a_1, a_2, \dots, a_n\}$ к базису $b = \{b_1, b_2, \dots, b_n\}$. Для этого можно написать матрицу A перехода от стандартного к a , потом матрицу B перехода от стандартного к b , а потом выдать ответ — $A^{-1}B$.

Примечание. Трюк от Александра Александровича (и в Винберге находил). Чтобы найти матрицу $X = A^{-1}B$ при известных A и B , не надо искать A^{-1} , а потом умножать её на B . Домножим на A слева, получим $AX = B$. Это n систем линейных уравнений с одной и той же матрицей A (решив i -ую систему, найдём i -ый столбец X). Эти системы можно решать одновременно, записав матрицу A в правой части и приписав к ней каждый столбец B по очереди. Выглядеть будет как $(A \mid B)$. Решить системы — значит привести эту матрицу $n \times 2n$ к улучшенному ступенчатому виду: $(E \mid X)$. В правой части теперь будут стоять столбцы матрицы X .

Теорема 1 (Закон изменения координат). Пусть x^1, \dots, x^n — координаты вектора x в базисе e_1, \dots, e_n , а $x^{1'}, \dots, x^{n'}$ — в базисе $e_{1'}, \dots, e_{n'}$. Тогда два набора координат связаны формулой

$$\begin{pmatrix} x^1 \\ \vdots \\ x^n \end{pmatrix} = C \cdot \begin{pmatrix} x^{1'} \\ \vdots \\ x^{n'} \end{pmatrix}.$$

Доказательство. В обозначениях Эйнштейна утверждение равносильно $x^i = c_{i'}^i x^{i'}$, $i = 1, \dots, n$. Оно верно, потому что

$$x^i e_i = x = x^{i'} e_{i'} = x^{i'} c_{i'}^i e_i \Rightarrow x^i = x^{i'} c_{i'}^i = c_{i'}^i x^{i'}.$$

■

3. ИЗОМОРФИЗМ ВЕКТОРНЫХ ПРОСТРАНСТВ ОДИНАКОВОЙ РАЗМЕРНОСТИ

Определение 1. Пусть V и W — линейные пространства над полем \mathbb{F} . Отображение $\mathcal{A} : V \rightarrow W$ называется *линейным*, если $\forall u, v \in V, \forall \lambda \in \mathbb{F}$ выполнено $\mathcal{A}(u + v) = \mathcal{A}u + \mathcal{A}v$, $\mathcal{A}(\lambda v) = \lambda \mathcal{A}v$.

Определение 2. Биективное линейное отображение $\mathcal{A} : V \rightarrow W$ называется *изоморфизмом*, а пространства V и W , между которыми есть изоморфизм, называются *изоморфными*.

Теорема 1. Два конечномерных пространства V и W над полем \mathbb{F} изоморфны тогда и только тогда, когда они имеют одинаковые размерности.

Доказательство. Из определения изоморфизма вытекает, что свойство системы векторов быть линейно независимой и порождать всё пространство сохраняются при изоморфизмах, т.е. при изоморфизме базис переходит в базис¹. Следовательно, если $\mathcal{A} : V \rightarrow W$ — изоморфизм, то $\dim V = \dim W$. Пусть теперь $\dim V = \dim W = n$. Выберем базисы e_1, \dots, e_n и f_1, \dots, f_n соответственно. Тогда формула $\mathcal{A}(x^i e_i) = x^i f_i$ определяет линейное отображение $\mathcal{A} : V \rightarrow W$. Оно является биекцией, т.к. формула $\mathcal{A}^{-1}(x^i f_i) = x^i e_i$ определяет обратное отображение. ■

4. ВЕКТОРНЫЕ ПОДПРОСТРАНСТВА, РАВНОСИЛЬНОСТЬ ДВУХ СПОСОБОВ ИХ ЗАДАНИЯ. СУММА И ПЕРЕСЕЧЕНИЕ ПОДПРОСТРАНСТВ. ФОРМУЛА ГРАССМАНА

Определение 1. Непустое подмножество $W \subseteq V$ линейного пространства V называется *подпространством*, если $\forall u, v \in W, \forall \lambda \in \mathbb{F}$ выполнено $(u + v) \in W$ и $\lambda u \in W$.

¹Это частный случай того, что «образ базиса является базисом образа» при $\text{Im } \mathcal{A} = W$.

Предложение 1. Множество всех решений системы однородных линейных уравнений с n неизвестными является подпространством координатного пространства \mathbb{F}^n .

Доказательство. Рассмотрим произвольную систему однородных линейных уравнений:

$$\begin{cases} a_{11}x_1 + a_{12}x_2 + \dots + a_{1n}x_n = 0, \\ a_{21}x_1 + a_{22}x_2 + \dots + a_{2n}x_n = 0, \\ \dots \\ a_{m1}x_1 + a_{m2}x_2 + \dots + a_{mn}x_n = 0. \end{cases}$$

Очевидно, что нулевой столбец является её решением и что произведение любого решения на число также является решением. Докажем, что сумма решений $(u_1, \dots, u_n)^t$ и $(v_1, \dots, v_n)^t$ является решением. Подставляя её компоненты в i -ое уравнение системы, получаем

$$a_{i1}(u_1 + v_1) + \dots + a_{in}(u_n + v_n) = \underbrace{a_{i1}u_1 + \dots + a_{in}u_n}_{=0} + \underbrace{a_{i1}v_1 + \dots + a_{in}v_n}_{=0} = 0.$$

■

Определение 2. *Фундаментальная система решений* — это базис подпространства решений однородной СЛУ.

Предложение 2. Линейная оболочка $\langle v_i : i \in I \rangle$ является линейным подпространством в V . Более того, она является наименьшим по включению линейным подпространством, содержащим все векторы системы $\{v_i : i \in I\}$.

Доказательство. Сумма векторов системы и результат умножения вектора системы на скаляр представляются линейными комбинациями и потому принадлежат линейной оболочке. Следовательно, $\langle v_i : i \in I \rangle$ — подпространство. Если W — подпространство, содержащее все векторы из системы $\{v_i : i \in I\}$, то W также содержит все векторы, представляющиеся их линейными комбинациями, а значит, $W \supseteq \langle v_i : i \in I \rangle$. ■

Теорема 1. Способы задания подпространства с помощью однородной системы линейных уравнений и линейной оболочки равносильны.

Нам понадобится следующая лемма.

Лемма 1. Пусть матрица B состоит из столбцов фундаментальной системы решений системы $Ax = 0$ (где x — вектор). Тогда линейная система $B^t y = 0$ задаёт линейную оболочку строк матрицы A .

Доказательство. Поскольку каждый столбец матрицы B является решением системы $Ax = 0$, имеет место матричное равенство $AB = 0$, которое эквивалентно $B^t A^t = 0$. Таким образом, если матрицу B^t интерпретировать как матрицу коэффициентов некоторой линейной системы, все столбцы матрицы A^t (строки A) будут ей удовлетворять.

Допустим, что некоторый столбец, не принадлежащий линейной оболочке столбцов матрицы A^t , тоже удовлетворяет системе $B^t y = 0$. Тогда рассмотрим матрицу C^t , которая получается дописыванием к матрице A этого столбца справа; полученная матрица будет удовлетворять соотношению $B^t C^t = 0$, а следовательно, и соотношению $CB = 0$. Это означает, что столбцы матрицы B являются решениями не только линейной системы $Ax = 0$, но и системы $Cx = 0$, отличающейся от системы $Ax = 0$ одним добавленным уравнением, которое по предположению линейно не выражается через исходные уравнения. Это означает, что ранг матрицы C на единицу больше ранга матрицы A , т. е. количество свободных неизвестных у системы $Cx = 0$ на единицу меньше, чем у системы $Ax = 0$. Значит, все столбцы матрицы B не могут быть решениями системы $Cx = 0$ — противоречие. Таким образом, системе $B^t y = 0$ удовлетворяют все строки матрицы A , и притом только они. ■

Доказательство. Пусть подпространство задано однородной системой линейных уравнений

$$\begin{cases} a_{11}x_1 + a_{12}x_2 + \dots + a_{1n}x_n = 0, \\ a_{21}x_1 + a_{22}x_2 + \dots + a_{2n}x_n = 0, \\ \dots \\ a_{m1}x_1 + a_{m2}x_2 + \dots + a_{mn}x_n = 0. \end{cases}$$

Тогда задать его линейной оболочкой можно, найдя ФСР. С помощью элементарных преобразований приведём её к ступенчатому виду. Число ненулевых уравнений в этом ступенчатом виде равно $r = \text{rk } A$. Поэтому общее решение будет содержать r главных неизвестных и с точностью до перенумерации неизвестных будет иметь вид

$$\begin{cases} x_1 = c_{11}x_{r+1} + c_{12}x_{r+2} + \dots + c_{1,n-r}x_n, \\ x_2 = c_{21}x_{r+1} + c_{22}x_{r+2} + \dots + c_{2,n-r}x_n, \\ \dots \\ x_r = c_{r1}x_{r+1} + c_{r2}x_{r+2} + \dots + c_{r,n-r}x_n. \end{cases}$$

Придавая поочерёдно одному из свободных неизвестных $x_{r+1}, x_{r+2}, \dots, x_n$ значение 1, а остальным — 0, получим следующие решения системы:

$$u_1 = \begin{pmatrix} c_{11} \\ \vdots \\ c_{r1} \\ 1 \\ 0 \\ \vdots \\ 0 \end{pmatrix}, \quad u_2 = \begin{pmatrix} c_{12} \\ \vdots \\ c_{r2} \\ 0 \\ 1 \\ \vdots \\ 0 \end{pmatrix}, \quad \dots, \quad u_{n-r} = \begin{pmatrix} c_{1,n-r} \\ \vdots \\ c_{r,n-r} \\ 0 \\ 0 \\ \vdots \\ 1 \end{pmatrix}.$$

Ранг системы векторов $\{u_1, u_2, \dots, u_{n-r}\}$ равен рангу матрицы

$$\left(\begin{array}{cccc|cccc} c_{11} & c_{21} & \dots & c_{r1} & 1 & 0 & \dots & 0 \\ c_{12} & c_{22} & \dots & c_{r2} & 0 & 1 & \dots & 0 \\ \vdots & \vdots & \ddots & \vdots & \vdots & \vdots & \ddots & \vdots \\ c_{1,n-r} & c_{2,n-r} & \dots & c_{r,n-r} & 0 & 0 & \dots & 1 \end{array} \right)$$

Если поменять местами блоки, отделённые чертой, то получится улучшенный ступенчатый вид с количеством ступенек, равным $n - r$. Так что ранг системы векторов $\{u_1, u_2, \dots, u_{n-r}\}$ равен количеству векторов в этой системе, поэтому она линейно независима. Эта система также порождает всё подпространство решений, т. к. любая линейная комбинация вида

$$\lambda_1 u_1 + \dots + \lambda_{n-r} u_{n-r}$$

является решением, в котором свободные неизвестные имеют значения $\lambda_1, \dots, \lambda_{n-r}$.

Теперь пусть подпространство задано линейной оболочкой

$$\left\langle u_1 = \begin{pmatrix} u_{11} \\ \vdots \\ u_{1n} \end{pmatrix}, \quad u_2 = \begin{pmatrix} u_{21} \\ \vdots \\ u_{2n} \end{pmatrix}, \quad \dots, \quad u_m = \begin{pmatrix} u_{m1} \\ \vdots \\ u_{mn} \end{pmatrix} \right\rangle$$

Составим матрицу

$$U = \begin{pmatrix} u_{11} & u_{12} & \dots & u_{1n} \\ \vdots & \vdots & \ddots & \vdots \\ u_{m1} & u_{m2} & \dots & u_{mn} \end{pmatrix}$$

из строк u_1, u_2, \dots, u_n . Найдём ФСР системы $Ux = 0$ (указанным выше способом), и запишем её векторы по строкам в матрицу U' . По лемме 1 пространство решений однородной системы линейных уравнений $U'y = 0$ есть линейная оболочка строк матрицы U , а это и есть данные нам векторы. ■

Предложение 3. Пересечение $V_1 \cap V_2$ подпространств в V является подпространством в V .

Доказательство. Во-первых, $\mathbf{0} \in V_1$ и $\mathbf{0} \in V_2$, поэтому $\mathbf{0} \in V_1 \cap V_2 \neq \emptyset$. Во-вторых, $\forall u, v \in V_1 \cap V_2$, $\forall \lambda \in \mathbb{F}$ сумма $u + v$ и произведение λv также лежат в V_1 и в V_2 , а значит, и в $V_1 \cap V_2$. ■

Примечание. Аналогично доказывается, что для любого семейства подпространств $\{U_i : i \in I\}$ их пересечение $\bigcap_{i \in I} U_i$ тоже подпространство.

Определение 3 (Сумма подпространств). $V_1 + V_2 := \{v_1 + v_2 : v_1 \in V_1, v_2 \in V_2\}$.

Предложение 4. $V_1 + V_2 = \langle V_1 \cup V_2 \rangle$.

Доказательство. Включение $V_1 + V_2 \subseteq \langle V_1 \cup V_2 \rangle$ следует из того, что вектор $v_1 + v_2$ является линейной комбинацией векторов $v_1, v_2 \in V_1 \cup V_2$. Докажем обратное включение. Для этого рассмотрим линейную комбинацию $v = \lambda_1 u_1 + \dots + \lambda_n u_n$ векторов $u_1, \dots, u_n \in V_1 \cup V_2$. Можно считать, что $u_1, \dots, u_k \in V_1$ и $u_{k+1}, \dots, u_n \in V_2$. Тогда мы имеем $v = v_1 + v_2$, где $v_1 = \lambda_1 u_1 + \dots + \lambda_k u_k \in V_1$ и $v_2 = \lambda_{k+1} u_{k+1} + \dots + \lambda_n u_n \in V_2$. Следовательно, $v \in V_1 + V_2$. ■

Примечание. Само объединение $V_1 \cup V_2$ подпространств в общем случае не является подпространством. Примером служит объединение двух прямых на плоскости.

Теорема 2 (Формула Грассмана). $\dim V_1 + \dim V_2 = \dim(V_1 + V_2) + \dim(V_1 \cap V_2)$.

Доказательство. Выберем базис e_1, \dots, e_k пространства $V_1 \cap V_2$. Воспользовавшись леммой 3 из первого вопроса, можем дополнить его до базиса $e_1, \dots, e_k, f_1, \dots, f_\ell$ пространства V_1 и до базиса $e_1, \dots, e_k, g_1, \dots, g_m$ пространства V_2 . Тогда мы имеем $\dim(V_1 \cap V_2) = k$, $\dim V_1 = k + \ell$, $\dim V_2 = k + m$. Докажем, что $e_1, \dots, e_k, f_1, \dots, f_\ell, g_1, \dots, g_m$ — базис пространства $V_1 + V_2$. Заметим, что т.к. $V_1 + V_2 = \langle V_1 \cup V_2 \rangle$, то любой вектор из $V_1 + V_2$ выражается через эту систему векторов. Остаётся проверить, что эта система линейно независима. Пусть имеет место равенство

$$\lambda_1 e_1 + \dots + \lambda_k e_k + \mu_1 f_1 + \dots + \mu_\ell f_\ell + \nu_1 g_1 + \dots + \nu_m g_m = \mathbf{0}.$$

Перепишем его в виде

$$\lambda_1 e_1 + \dots + \lambda_k e_k + \mu_1 f_1 + \dots + \mu_\ell f_\ell = -\nu_1 g_1 - \dots - \nu_m g_m.$$

Вектор, стоящий в обеих частях этого равенства, лежит в $V_1 \cap V_2$ и линейно выражается через e_1, \dots, e_k . Т.к. векторы $e_1, \dots, e_k, f_1, \dots, f_\ell$ линейно независимы по построению, получаем $\mu_1 = \dots = \mu_\ell = 0$. Аналогично, $\nu_1 = \dots = \nu_m = 0$. Тогда из линейной независимости e_1, \dots, e_k следует $\lambda_1 = \dots = \lambda_k = 0$. Итак, $\dim(V_1 + V_2) = k + \ell + m$, откуда вытекает требуемое. ■

Алгоритм вычисления базисов в $U_1 + U_2$ и $U_1 \cap U_2$ (U_1 и U_2 — подпространства конечномерного пространства V). При доказательстве формулы Грассмана мы попутно показали, что базис $U_1 + U_2$ есть объединение базисов U_1 и U_2 . Отметим, что в случае, когда сумма $U_1 + U_2$ прямая, пересечение этих базисов пустое.

Чтобы найти базис пересечения, зададим оба подпространства в виде системы линейных уравнений. Система, состоящая из всех уравнений обеих систем, будет задавать пересечение этих подпространств. Для нахождения базиса ищем ФСР.

5. ПРЯМАЯ СУММА ПОДПРОСТРАНСТВ. ВНЕШНЯЯ ПРЯМАЯ СУММА ВЕКТОРНЫХ ПРОСТРАНСТВ

Определение 1. Сумма $V_1 + V_2$ подпространств пространства V называется *прямой* (обозначается $V_1 \oplus V_2$), если $\forall v \in V_1 + V_2$ представление $v = v_1 + v_2$, где $v_1 \in V_1$, $v_2 \in V_2$, единственно.

Теорема 1. Следующие условия эквивалентны для подпространств V_1 и V_2 :

1. сумма $V_1 + V_2$ прямая;
2. $V_1 \cap V_2 = \{0\}$;
3. если $0 = v_1 + v_2$, где $v_1 \in V_1$ и $v_2 \in V_2$, то $v_1 = v_2 = 0$;
4. $\dim(V_1 + V_2) = \dim V_1 + \dim V_2$.

Доказательство. $1 \Rightarrow 2$. Пусть найдётся $v \in V_1 + V_2$, $v \neq 0$. Тогда $0 = 0 + 0 = v + (-v)$. Получаем, что представление вектора 0 не единственно, и сумма $V_1 + V_2$ не прямая.

$2 \Rightarrow 3$. Если существует представление $0 = v_1 + v_2$, где $v_1 \in V_1$ и $v_2 = (-v_1) \in V_2$ и $v_1 \neq 0$, т. е. $v_1 \in V_1 \cap V_2 \neq \{0\}$ — противоречие.

$3 \Rightarrow 1$. Пусть у вектора $v \in V$ есть два разложения $v = u_1 + u_2 = v_1 + v_2$, где $u_1, v_1 \in V_1$ и $u_2, v_2 \in V_2$. Тогда $0 = (u_1 - v_1) + (u_2 - v_2)$, где $u_1 - v_1 \in V_1$ и $u_2 - v_2 \in V_2$. Следовательно, $u_1 - v_1 = u_2 - v_2 = 0$, т. е. два разложения совпадают.

$2 \Leftrightarrow 4$. Следствие формулы Грассмана. ■

Определение 2. Сумма $V_1 + \dots + V_n$ подпространств пространства V называется *прямой* (обозначается $V_1 \oplus \dots \oplus V_n$), если $\forall v \in V_1 + \dots + V_n$ представление $v = v_1 + v_2 + \dots + v_n$, где $v_i \in V_i$, единственно.

Теорема 2. Для подпространств V_1, \dots, V_n пространства V следующие условия эквивалентны:

1. сумма $V_1 + \dots + V_n$ прямая;
2. $V_i \cap \sum_{j \neq i} V_j = \{0\}$;
3. если $0 = v_1 + \dots + v_n$, где $v_i \in V_i$, то $v_1 = \dots = v_n = 0$;
4. $\dim \left(\sum_i V_k \right) = \sum_i \dim V_i$.

Доказательство. Индукция по n с помощью предыдущей теоремы. ■

Примечание. При $n \geq 3$ условие 2 в предыдущей теореме сильнее, чем условие $V_i \cap V_j = \{0\} \forall i \neq j$. Это последнее условие не гарантирует, что сумма подпространств прямая. Действительно, рассмотрим следующие три подпространства в \mathbb{R}^2 со стандартным базисом e_1, e_2 : $V_1 = \langle e_1 \rangle$, $V_2 = \langle e_2 \rangle$ и $V_3 = \langle e_1 + e_2 \rangle$. Тогда $V_i \cap V_j = \{0\} \forall i \neq j$, но сумма данных подпространств не прямая, т. к.

$$e_1 + e_2 = e_1 + e_2 + 0 = 0 + 0 + (e_1 + e_2).$$

Определение 3. Пусть V_1, \dots, V_n — линейные пространства над одним полем \mathbb{F} . Их *внешней прямой суммой* (обозначается как $V_1 \oplus \dots \oplus V_n$) называется линейное пространство $V_1 \times \dots \times V_n$ с операциями, определёнными покомпонентно:

$$(u_1, \dots, u_n) + (v_1, \dots, v_n) = (u_1 + v_1, \dots, u_n + v_n), \quad \lambda \cdot (v_1, \dots, v_n) = (\lambda v_1, \dots, \lambda v_n).$$

Предложение 1. Для любого пространства $U \subset V$ найдётся подпространство $W \subset V$ такое, что $V = U \oplus W$.

Определение 4. Такое подпространство W называется *прямым дополнением* к U .

Доказательство. Пусть e_1, \dots, e_k — базис в U . Его можно дополнить до базиса V векторами e_{k+1}, \dots, e_n (где $n = \dim V$), тогда искомое $W := \langle e_{k+1}, \dots, e_n \rangle$. ■

Примечание. Пространство $V = V_1 + \dots + V_m$ можно превратить в прямую сумму пространств. Рассмотрим $U_i = \{(\mathbf{0}, \dots, \mathbf{0}, v_i, \mathbf{0}, \dots, \mathbf{0}) : v_i \in V_i\} \subset V$. Тогда

$$(v_1, \dots, v_m) = (v_1, \mathbf{0}, \dots, \mathbf{0}) + (\mathbf{0}, v_2, \dots, \mathbf{0}) + \dots + (\mathbf{0}, \dots, \mathbf{0}, v_m),$$

а отсюда $V = U_1 \oplus \dots \oplus U_m$.

6. ФАКТОРПРОСТРАНСТВО, ЕГО РАЗМЕРНОСТЬ. КОРАЗМЕРНОСТЬ. СВЯЗЬ С РЕШЕНИЯМИ НЕОДНОРОДНОЙ СИСТЕМЫ ЛИНЕЙНЫХ УРАВНЕНИЙ

Пусть V — линейное пространство, а $W \subseteq V$ — его подпространство.

Определение 1. Классом смежности вектора $v \in V$ по подпространству W называется множество $v + W := \{v + w : w \in W\}$.

Лемма 1. Равенство $v_1 + W = v_2 + W$ имеет место тогда и только тогда, когда $v_1 - v_2 \in W$.

Доказательство. Пусть $v_1 + W = v_2 + W$. Тогда $v_1 \in v_1 + W = v_2 + W$, значит $\exists w \in W : v_1 = v_2 + w$. Следовательно, $v_1 - v_2 = w \in W$. Обратно, пусть $v := v_1 - v_2 \in W$. Докажем, что $v_1 + W \subseteq v_2 + W$. Возьмём произвольный вектор $u \in v_1 + W$. Тогда $u = v_1 + w$ для некоторого $w \in W$. Мы имеем $u = v_1 + w = v_2 + (v + w)$, где $v + w \in W$. Следовательно, $u \in v_2 + W$ и $v_1 + W \subseteq v_2 + W$. Обратное включение доказывается аналогично. ■

Предложение 1. Отношение $v_1 \sim v_2 \stackrel{\text{def}}{\iff} u_1 - u_2 \in U$ задаёт отношение эквивалентности на V .

Доказательство. Совсем несложно проверяются все аксиомы. ■

Определение 2. Факторпространством линейного пространства V по подпространству W называется множество $V/W := \{v + W : v \in V\}$ с операциями сложения и умножения на скаляры:

$$(u + W) + (v + W) := (u + v) + W, \quad \lambda \cdot (v + W) := \lambda v + W.$$

Предложение 2. Приведённые выше операции определены на классах смежности корректно и задают на V/W структуру линейного пространства.

Доказательство. Проверим корректность определения операций, т.е. независимость результата операции от выбора вектора v в смежном классе $v + W$. Докажем для сложения. Если $u_1 + W = u_2 + W$ и $v_1 + W = v_2 + W$, то $u := u_1 - u_2 \in W$ и $v := v_1 - v_2 \in W$ в силу предыдущей леммы. Следовательно,

$$\begin{aligned} (u_1 + W) + (v_1 + W) &= (u_1 + v_1) + W = (u_2 + v_2) + (u + v) + W = \\ &= (u_2 + v_2) + W = (u_2 + W) + (v_2 + W). \end{aligned}$$

Корректность определения умножения на скаляры проверяется аналогично. Теперь докажем, что V/W — линейное пространство. Свойства 1 и 2 сразу следуют из определения. Нулём является $\mathbf{0} + W = W$, а противоположным к $v + W$ является $(-v) + W$. Проверим свойство 5:

$$\begin{aligned} \lambda \cdot ((u + W) + (v + W)) &= \lambda \cdot ((u + v) + W) = (\lambda u + \lambda v) + W = \\ &= (\lambda u + W) + (\lambda v + W) = \lambda(u + W) + \lambda(v + W). \end{aligned}$$

Оставшиеся свойства 6-8 проверяются аналогично. ■

Определение 3. Коразмерностью подпространства W линейного пространства V (обозначается через $\text{codim } W$) называется $\dim V/W$.

Теорема 1. $\text{codim } W = \dim V - \dim W$.

Доказательство. Пусть $\dim V = n$, $\dim W = k$ и e_1, \dots, e_k — базис в W . Дополним его до базиса $e_1, \dots, e_k, e_{k+1}, \dots, e_n$ в V . Докажем, что классы $e_{k+1} + W, \dots, e_n + W$ образуют базис в V/W . Вначале покажем, что они линейно независимы. Пусть $\lambda_{k+1}(e_{k+1} + W) + \dots + \lambda_n(e_n + W) = \mathbf{0} + W$. Тогда $(\lambda_{k+1}e_{k+1} + \dots + \lambda_n e_n) + W = \mathbf{0} + W$, т.е. $v := \lambda_{k+1}e_{k+1} + \dots + \lambda_n e_n \in W$. Т.к. e_1, \dots, e_k — базис в W , то можем записать $v = \lambda_1 e_1 + \dots + \lambda_k e_k$. Тогда получаем

$$\lambda_1 e_1 + \dots + \lambda_k e_k - \lambda_{k+1} e_{k+1} - \dots - \lambda_n e_n = \mathbf{0}.$$

Т.к. e_1, \dots, e_n — базис в V , то $\lambda_1 = \dots = \lambda_{k+1} = \dots = \lambda_n = 0$. Значит, классы $e_{k+1} + W, \dots, e_n + W$ линейно независимы. Осталось доказать, что эти классы порождают всё пространство. Возьмём произвольный вектор $v + W \in V/W$. Разложим вектор v по базису в V : $v = \lambda_1 e_1 + \dots + \lambda_k e_k + \lambda_{k+1} e_{k+1} + \dots + \lambda_n e_n$. Тогда

$$\begin{aligned} v + W &= (\lambda_{k+1} e_{k+1} + \dots + \lambda_n e_n) + (\lambda_1 e_1 + \dots + \lambda_k e_k) + W = \\ &= (\lambda_{k+1} e_{k+1} + \dots + \lambda_n e_n) + W = \lambda_{k+1}(e_{k+1} + W) + \dots + \lambda_n(e_n + W). \end{aligned}$$

Итак, в базисе V/W ровно $n - k$ векторов. ■

Предложение 3. Совокупность всех решений произвольной совместной системы линейных уравнений есть сумма какого-либо одного её решения и подпространства решений однородной системы линейных уравнений с той же матрицей коэффициентов.

Доказательство. Пусть $u = (u_1, u_2, \dots, u_n)^t \in \mathbb{F}^n$ — частное решение неоднородной СЛУ

$$\begin{cases} a_{11}x_1 + a_{12}x_2 + \dots + a_{1n}x_n = b_1, \\ a_{21}x_1 + a_{22}x_2 + \dots + a_{2n}x_n = b_2, \\ \dots \\ a_{m1}x_1 + a_{m2}x_2 + \dots + a_{mn}x_n = b_m. \end{cases}$$

Пусть также $v = (v_1, v_2, \dots, v_n)^t \in \mathbb{F}^n$ — произвольное решение ассоциированной однородной системы

$$\begin{cases} a_{11}x_1 + a_{12}x_2 + \dots + a_{1n}x_n = 0, \\ a_{21}x_1 + a_{22}x_2 + \dots + a_{2n}x_n = 0, \\ \dots \\ a_{m1}x_1 + a_{m2}x_2 + \dots + a_{mn}x_n = 0. \end{cases}$$

Тогда сумма $u + v$ является решением первой системы. Действительно,

$$\begin{aligned} a_{i1}(u_1 + v_1) + a_{i2}(u_2 + v_2) + \dots + a_{in}(u_n + v_n) &= \\ &= \underbrace{a_{i1}u_1 + a_{i2}u_2 + \dots + a_{in}u_n}_{=b_i} + \underbrace{a_{i1}v_1 + a_{i2}v_2 + \dots + a_{in}v_n}_{=0} = b_i. \end{aligned}$$

Обратно, если u' — произвольное решение неоднородной СЛУ, то $v = u' - u$ является решением ассоциированной однородной системы (проверяется так же). ■

Связь определения факторпространства со структурой решений неоднородной СЛУ заключается в том, что они «похожи». Я уточню это позже у Игоря Андреевича.

7. ЛИНЕЙНЫЕ ФУНКЦИИ НА ВЕКТОРНОМ ПРОСТРАНСТВЕ, ИХ ЯДРА. ИЗМЕНЕНИЕ КОЭФФИЦИЕНТОВ ЛИНЕЙНОЙ ФОРМЫ ПРИ ЗАМЕНЕ БАЗИСА. СОПРЯЖЁННОЕ ПРОСТРАНСТВО V^* , ДУАЛЬНЫЙ БАЗИС. КАНОНИЧЕСКИЙ ИЗОМОРФИЗМ $V \simeq V^{**}$

Сначала см. вопрос 8.

Определение 1. Линейное отображение $f : V \rightarrow \mathbb{F}$ из пространства V над полем \mathbb{F} в поле \mathbb{F} (одномерное векторное пространство) называется *линейной функцией* (функционалом).

Определение 2. $V^* := \text{Hom}_{\mathbb{F}}(V, \mathbb{F})$ — двойственное (сопряжённое, дуальное) пространство к V .

Пусть e_1, \dots, e_n — базис в V . Значение линейной функции $\xi \in V^*$ на любом векторе $x = x^i e_i \in V$ определяется её значениями на базисных векторах, т. к. $\xi(x) = \xi(x^i e_i) = x^i \xi(e_i)$. Определим линейные функции $\varepsilon^1, \dots, \varepsilon^n \in V^*$ по правилу $\varepsilon^i(e_j) = \delta_j^i$. Тогда для любого вектора $x = x^j e_j$ мы имеем

$$\varepsilon^i(x) = \varepsilon^i(x^j e_j) = x^j \varepsilon^i(e_j) = x^j \delta_j^i = x^i.$$

Определение 3. В связи с этим функции $\varepsilon^1, \dots, \varepsilon^n$ часто называют *координатными функциями*.

Предложение 1. Линейные функции $\varepsilon^1, \dots, \varepsilon^n$ образуют базис в V^* .

Доказательство. Линейная независимость: пусть $x_1 \varepsilon^1 + \dots + x_n \varepsilon^n = \mathbf{0}$. Это равенство означает, что линейная функция $\xi : x_i \varepsilon^i$ равна нулю на любом векторе из V . Вычислим её на векторе e_j :

$$\mathbf{0} = \xi(e_j) = x_i \varepsilon^i(e_j) = x_i \delta_j^i = x_j.$$

Итак, $x_1 = \dots = x_n = 0$, а значит, $\varepsilon^1, \dots, \varepsilon^n$ линейно независимы.

Теперь проверим, что $\varepsilon^1, \dots, \varepsilon^n$ порождают всё пространство V^* . Мы утверждаем, что любая линейная функция ξ представляется в виде линейной комбинации $\xi = \xi_i \varepsilon^i$, где $\xi_i = \xi(e_i)$. Действительно, для любого вектора $x = x^j e_j \in V$ мы имеем

$$\xi_i \varepsilon^i(x) = \xi_i x^i = \xi(e_i) x^i = \xi(x^i e_i) = \xi(x).$$

Таким образом, $\varepsilon^1, \dots, \varepsilon^n$ — базис в V^* . ■

Определение 4. Базис $\varepsilon^1, \dots, \varepsilon^n$ пространства V^* называется *двойственным* (сопряжённым, дуальным) базисом к e_1, \dots, e_n .

Следствие 1. $\dim V = \dim V^* \Rightarrow V \simeq V^*$.

Пусть теперь $e_{1'}, \dots, e_{n'}$ — другой базис пространства V и $C = (c_{ij}^i)$ — матрица перехода от $e_{i'} = c_{ij}^i e_i$. Рассмотрим двойственные базисы $\varepsilon^1, \dots, \varepsilon^n$ и $\varepsilon^{1'}, \dots, \varepsilon^{n'}$.

Предложение 2. Матрица перехода от $\varepsilon^1, \dots, \varepsilon^n$ к $\varepsilon^{1'}, \dots, \varepsilon^{n'}$ есть $(C^{-1})^t$

Доказательство. Для любого вектора $x = x^i e_i = x^{i'} e_{i'}$ мы имеем $\varepsilon^i(x) = x^i = c_{ij}^i x^{i'} = c_{ij}^i \varepsilon^{i'}(x)$. Следовательно, $\varepsilon^i = c_{ij}^i \varepsilon^{i'}$, что эквивалентно матричному соотношению

$$\begin{pmatrix} \varepsilon^1 \\ \vdots \\ \varepsilon^n \end{pmatrix} = C \cdot \begin{pmatrix} \varepsilon^{1'} \\ \vdots \\ \varepsilon^{n'} \end{pmatrix}$$

или $(\varepsilon^{1'}, \dots, \varepsilon^{n'}) = (\varepsilon^1, \dots, \varepsilon^n) \cdot (C^{-1})^t$. ■

Для построения изоморфизма между пространствами V и V^* нам необходимо выбрать базис в V (и двойственный ему базис в V^*). Разные базисы дают разные изоморфизмы. Для бесконечномерных пространств ситуация иная: пространства V и V^* **никогда не изоморфны**, пространство

V^* всегда «больше». Проиллюстрируем это на примере. Обозначим через \mathbb{F}^∞ пространство финитных последовательностей из элементов поля \mathbb{F} , а через $\widehat{\mathbb{F}}^\infty$ — пространство всех бесконечных последовательностей элементов поля \mathbb{F} .

Предложение 3. $(\mathbb{F}^\infty)^* \simeq \widehat{\mathbb{F}}^\infty$.

Доказательство. Возьмём в пространстве \mathbb{F}^∞ базис $\{e_i\}_{i=1}^\infty$, $e_i = (\overbrace{0, \dots, 0}^{i-1}, 1, 0, \dots)$. Рассмотрим отображение $\mathcal{A} : (\mathbb{F}^\infty)^* \rightarrow \widehat{\mathbb{F}}^\infty$, $f \mapsto (f(e_1), f(e_2), \dots)$, которое линейной функции $f \in (\mathbb{F}^\infty)^*$ ставит в соответствие последовательность её значений на базисных векторах. Это отображение очевидно линейно. Кроме того, оно биективно: обратное отображение задаётся формулой $\mathcal{A}^{-1}(x_1, x_2, \dots) = f \in (\mathbb{F}^\infty)^*$, где $f(e_i) = x_i$. Т.к. любой элемент $y \in \mathbb{F}^\infty$ есть (конечная) линейная комбинация элементов e_i , то линейная функция f однозначно восстанавливается по её значениям на базисных векторах ■

Предложение 4. $\mathbb{Z}_2^\infty \not\simeq \widehat{\mathbb{Z}}_2^\infty$.

Доказательство. \mathbb{Z}_2^∞ можно отождествить с множеством рациональных чисел на отрезке $[0; 1]$ в двоичной записи, а $\widehat{\mathbb{Z}}_2^\infty$ — с множеством вещественных чисел на $[0; 1]$ в двоичной записи. Поэтому биекции между этими множествами быть не может. ■

Следствие 2. $\mathbb{Z}_2^\infty \not\simeq (\mathbb{Z}_2^\infty)^*$.

Определение 5. $V^{**} := (V^*)^*$ — второе сопряжённое пространство.

Теорема 1. Пусть V — конечномерное линейное пространство. Отображение $\varphi : x \in V \mapsto \varphi_x \in V^{**}$, где $\varphi_x(\xi) := \xi(x)$ для $\xi \in V^*$, является изоморфизмом.

Доказательство. Из определения линейных функций следует, что $\varphi_{x+y} = \varphi_x + \varphi_y$ и $\varphi_{\lambda x} = \lambda \varphi_x$. Остаётся проверить, что отображение $x \mapsto \varphi_x$ биективно. Пусть e_1, \dots, e_n — базис пространства V и $\varepsilon^1, \dots, \varepsilon^n$ — сопряжённый базис пространства V^* . Тогда

$$\omega_i(\varepsilon^j) = \varepsilon^j(e_i) = \delta_j^i,$$

так что $\omega_1, \dots, \omega_n$ — базис пространства V^{**} , сопряжённый $\varepsilon^1, \dots, \varepsilon^n$. Отображение $x \mapsto \varphi_x$ переводит вектор с координатами x_1, \dots, x_n в базисе e_1, \dots, e_n пространства V в вектор с такими же координатами в базисе $\omega_1, \dots, \omega_n$ пространства V^{**} . Следовательно, оно биективно. ■

Отметим, что этот изоморфизм не зависит от выбора базисов в V и V^{**} , поэтому его часто называют *каноническим*.

Следствие 1. Всякий базис пространства V^* сопряжён некоторому базису пространства V .

Задача 1 (Из Винберга). Доказать, что линейные функции f_1, \dots, f_n (где $n = \dim V$) составляют базис пространства V^* тогда и только тогда, когда не существует ненулевого вектора $x \in V$, для которого $f_1(x) = \dots = f_n(x) = 0$.

▷ ⇒. Пусть f_1, \dots, f_n — базис и нашёлся такой вектор $v \in V$, $v \neq 0$, для которого $f_1(v) = \dots = f_n(v) = 0$. Этот базис сопряжён некоторому базису e_1, \dots, e_n пространства V . А это значит, что вектор v ненулевой, но все координаты у него нулевые. Так не бывает.

⇐. Выберем базис $\varepsilon^1, \dots, \varepsilon^n$ в V^* . Тогда $f_i = a_j^i \varepsilon^j$. Рассмотрим систему уравнений (верхними индексами обозначены координаты, а не степени)

$$\begin{cases} f_1(x) = 0, \\ f_2(x) = 0, \\ \dots \\ f_n(x) = 0 \end{cases} \Leftrightarrow \begin{cases} a_1^1 x^1 + a_2^1 x^2 + \dots + a_n^1 x^n = 0, \\ a_1^2 x^1 + a_2^2 x^2 + \dots + a_n^2 x^n = 0, \\ \dots \\ a_1^n x^1 + a_2^n x^2 + \dots + a_n^n x^n = 0, \end{cases}$$

По условию не существует ненулевого вектора x такого, что $f_1(x) = f_2(x) = \dots = f_n(x) = 0$, поэтому выписанная система не имеет решений кроме нулевого. Поэтому она определена, а значит, по правилу Крамера матрица коэффициентов невырождена, отсюда следует линейная независимость строк. А полноту можно не доказывать, потому что количество векторов уже правильное. ◀

8. ЛИНЕЙНЫЕ ОТОБРАЖЕНИЯ И ОПЕРАТОРЫ. ЯДРО И ОБРАЗ, СВЯЗЬ ИХ РАЗМЕРНОСТЕЙ. КРИТЕРИЙ ИНЪЕКТИВНОСТИ

Определение 1. Пусть V и W — линейные пространства над полем \mathbb{F} . Отображение $\mathcal{A} : V \rightarrow W$ называется *линейным*, если $\forall u, v \in V, \forall \lambda \in \mathbb{F}$ выполнено $\mathcal{A}(u + v) = \mathcal{A}u + \mathcal{A}v$ и $\mathcal{A}(\lambda v) = \lambda \mathcal{A}v$.

Определение 2. Линейное отображение $\mathcal{A} : V \rightarrow V$ из пространства V в себя называется *линейным оператором*.

Определение 3. Пусть $\mathcal{A} : V \rightarrow W$ — линейное отображение. *Ядром* \mathcal{A} называется множество $\text{Ker } \mathcal{A} := \{v \in V : \mathcal{A}v = \mathbf{0}\}$. *Образом* \mathcal{A} называется множество $\text{Im } \mathcal{A} := \{\mathcal{A}v : v \in V\}$.

Предложение 1. Пусть $\mathcal{A} : V \rightarrow W$ — линейное отображение. Тогда $\text{Ker } \mathcal{A}$ — подпространство в V , а $\text{Im } \mathcal{A}$ — подпространство в W .

Доказательство. Пусть $u, v \in \text{Ker } \mathcal{A}$. Т.е. $\mathcal{A}u = \mathcal{A}v = \mathbf{0}$. Тогда $\mathcal{A}(u + v) = \mathcal{A}u + \mathcal{A}v = \mathbf{0}$ и $\mathcal{A}(\lambda u) = \lambda \mathcal{A}u = \mathbf{0}$. Следовательно, $u + v \in \text{Ker } \mathcal{A}$ и $\lambda u \in \text{Ker } \mathcal{A} \forall \lambda \in \mathbb{F}$, а значит, $\text{Ker } \mathcal{A}$ — подпространство в V .

Пусть теперь $x, y \in \text{Im } \mathcal{A}$, т.е. $\exists u, v \in V : \mathcal{A}u = x, \mathcal{A}v = y$. Тогда $\mathcal{A}(u + v) = x + y$ и $\mathcal{A}(\lambda u) = \lambda x$. Следовательно, $x + y \in \text{Im } \mathcal{A}$ и $\lambda x \in \text{Im } \mathcal{A} \forall \lambda \in \mathbb{F}$, а значит, $\text{Im } \mathcal{A}$ — подпространство в W . ■

Лемма 1 (Критерий инъективности). Линейное отображение $\mathcal{A} : V \rightarrow W$ инъективно тогда и только тогда, когда $\text{Ker } \mathcal{A} = \{\mathbf{0}\}$.

Доказательство. \Rightarrow . Мы знаем, что $\mathcal{A}\mathbf{0} = \mathbf{0}$, а т.к. \mathcal{A} инъективно, то $\mathbf{0}$ — единственный вектор из V , переходящий в $\mathbf{0}$, отсюда $\text{Ker } \mathcal{A} = \{\mathbf{0}\}$.

\Leftarrow . Пусть $\mathcal{A}u = \mathcal{A}v \Rightarrow \mathcal{A}(u - v) = \mathbf{0}$, значит, $u - v \in \text{Ker } \mathcal{A} = \{\mathbf{0}\}$, отсюда $u = v$. ■

Теорема 1. Пусть $\mathcal{A} : V \rightarrow W$ — линейное отображение. Тогда соответствие $v + \text{Ker } \mathcal{A} \mapsto \mathcal{A}v$ задаёт изоморфизм между факторпространством $V / \text{Ker } \mathcal{A}$ и подпространством $\text{Im } \mathcal{A}$.

Доказательство. Сначала проверим, что $v + \text{Ker } \mathcal{A} \mapsto \mathcal{A}v$ действительно корректно определяет отображение $\tilde{\mathcal{A}} : V / \text{Ker } \mathcal{A} \rightarrow \text{Im } \mathcal{A}$. Для этого нужно проверить, что если $u + \text{Ker } \mathcal{A} = v + \text{Ker } \mathcal{A}$, то $\mathcal{A}u = \mathcal{A}v$. Из равенства классов смежности следует $u - v \in \text{Ker } \mathcal{A}$, а отсюда $\mathcal{A}(u - v) = \mathbf{0}$, т.е. $\mathcal{A}u = \mathcal{A}v$. Итак, отображение $\tilde{\mathcal{A}}$ определено корректно.

Линейность и сюръективность $\tilde{\mathcal{A}}$ очевидны. Инъективность проверяется по критерию:

$$\text{Ker } \tilde{\mathcal{A}} = \{(v + \text{Ker } \mathcal{A}) \in V / \text{Ker } \mathcal{A} : \tilde{\mathcal{A}}(v + \text{Ker } \mathcal{A}) = \mathcal{A}v = \mathbf{0}\} = \text{Ker } \mathcal{A} = \mathbf{0} + \text{Ker } \mathcal{A}.$$

Итак, $\tilde{\mathcal{A}}$ задаёт изоморфизм $V / \text{Ker } \mathcal{A} \simeq \text{Im } \mathcal{A}$. ■

Следствие 1. Для всякого линейного отображения $\mathcal{A} : V \rightarrow W$ мы имеем

$$\dim V = \dim \text{Ker } \mathcal{A} + \dim \text{Im } \mathcal{A}.$$

Предложение 2. Если в каких-то базисах пространств V и W линейное отображение $\mathcal{A} : V \rightarrow W$ имеет матрицу A , то

$$\dim \text{Im } \mathcal{A} = \text{rk } A.$$

Доказательство. Очевидно, что $\text{Im } \mathcal{A}$ есть линейная оболочка образов базисных векторов e_1, \dots, e_n пространства V и, значит, $\dim \text{Im } \mathcal{A}$ есть ранг системы векторов $\mathcal{A}(e_1), \dots, \mathcal{A}(e_n)$. Но в столбцах матрицы A как раз и записаны координаты этих векторов в каком-то базисе пространства W . Следовательно, ранг этой системы векторов равен рангу матрицы A . ■

Определение 4. Множество всех линейных отображений $\mathcal{A} : V \rightarrow W$ с операциями сложения и умножения на скаляры

$$(\mathcal{A}_1 + \mathcal{A}_2)(v) := \mathcal{A}_1 v + \mathcal{A}_2 v, \quad (\lambda \mathcal{A})(v) := \lambda(\mathcal{A}v)$$

является линейным пространством. Оно называется *пространством линейных отображений* из V в W и обозначается $\text{Hom}_{\mathbb{F}}(V, W)$.

9. ЗАДАНИЕ ЛИНЕЙНЫХ ОТОБРАЖЕНИЙ (ОПЕРАТОРОВ) МАТРИЦАМИ. ИЗМЕНЕНИЕ МАТРИЦЫ ЛИНЕЙНОГО ОТОБРАЖЕНИЯ ПРИ ПЕРЕХОДЕ К ДРУГИМ БАЗИСАМ. НАХОЖДЕНИЕ ЯДРА И ОБРАЗА ПРИ ПОМОЩИ МАТРИЦЫ

Пусть $\mathcal{A} : V \rightarrow W$ — линейное отображение, e_1, \dots, e_m — базис в V , а f_1, \dots, f_n — базис в W .

Определение 1. Матрицей линейного отображения $\mathcal{A} : V \rightarrow W$ по отношению к базисам e_1, \dots, e_m и f_1, \dots, f_n называется матрица $A = \begin{pmatrix} a_1^1 & \cdots & a_m^1 \\ \vdots & \ddots & \vdots \\ a_1^n & \cdots & a_m^n \end{pmatrix}$ размера $n \times m$, в которой i -ый столбец состоит из координат вектора $\mathcal{A}(e_i)$ в базисе f_1, \dots, f_n : $\mathcal{A}e_i = a_i^j f_j$.

Предложение 1. Пусть $x = x^j e_j$ — произвольный вектор из V , а $y = y^i f_i$ — его образ в W , т. е. $y = \mathcal{A}x$. Тогда $y^i = a_i^j x^j$.

Доказательство. Действительно, $y^i f_i = y = \mathcal{A}x = \mathcal{A}(x^j e_j) = x^j \mathcal{A}e_j = x^j a_j^i f_i$. Т. к. $\{f_i\}_{i=1}^n$ — базис, отсюда следует, что $y^i = a_i^j x^j$. ■

Предложение 2. Пусть $\dim V = m$, $\dim W = n$. Тогда $\text{Hom}_{\mathbb{F}}(V, W) \simeq \text{Mat}_{\mathbb{F}}(n, m)$.

Доказательство. Выберем базисы e_1, \dots, e_m и f_1, \dots, f_n в V и W соответственно. Определим отображение $\text{Hom}_{\mathbb{F}}(V, W) \rightarrow \text{Mat}_{\mathbb{F}}(n, m)$, которое сопоставляет линейному отображению его матрицу в выбранных базисах. Непосредственно проверяется, что это отображение линейно. Кроме того, оно биективно: обратное отображение сопоставляет матрице $A = (a_j^i)$ линейного отображения, определяется в координатах формулой из предыдущего предложения. Следовательно, такое отображение $\text{Hom}_{\mathbb{F}}(V, W) \rightarrow \text{Mat}_{\mathbb{F}}(n, m)$ является изоморфизмом. ■

Теорема 1 (Закон изменения матрицы линейного отображения). Имеет место соотношение $A' = D^{-1}AC$, где A — матрица линейного отображения $\mathcal{A} : V \rightarrow W$ по отношению к базисам e_1, \dots, e_m и f_1, \dots, f_n ; A' — матрица линейного отображения \mathcal{A} по отношению к базисам $e_{1'}, \dots, e_{m'}$ и $f_{1'}, \dots, f_{n'}$; $C = C_{e \rightarrow e'}$ — матрица перехода от e_1, \dots, e_m к $e_{1'}, \dots, e_{m'}$; $D = D_{f \rightarrow f'}$ — матрица перехода от f_1, \dots, f_n к $f_{1'}, \dots, f_{n'}$.

Доказательство. Пусть $C = (c_{i'}^i)$, $A = (a_j^i)$, тогда $\mathcal{A}e_{i'} = \mathcal{A}(c_{i'}^j e_j) = c_{i'}^j \mathcal{A}e_j = c_{i'}^j a_j^i f_i$. С другой стороны, если $A' = (a_{j'}^{i'})$ и $D = (d_{j'}^j)$, то $a_{i'}^{j'} f_{j'} = a_{i'}^{j'} d_{j'}^j f_j$. Сравнивая два последних соотношения с учётом того, что $f_{j=1}^n$ — базис, получаем $a_{i'}^{j'} c_{i'}^i = d_{j'}^j a_j^i$. В матричном виде это эквивалентно $AC = DA' \Rightarrow A' = D^{-1}AC$. ■

Поиск ядра и образа линейного оператора по его матрице. Пусть имеем матрицу A оператора \mathcal{A} в каком-то базисе. Приведя её к ступенчатому виду, сможем найти базис системы столбцов матрицы A (его будут составлять столбцы, в которых есть лидеры). Вспомним, что по

столбцам A написаны образы базисных векторов при отображении A , а мы нашли базис этой системы. Это значит, что найденные нами столбцы есть базис $\text{Im } A$.

$\text{Ker } A$ — это просто пространство решений СЛУ $Ax = 0$. Чтобы найти базис ядра, нам нужно просто найти её ФСР.

10. ЛИНЕЙНЫЕ ОПЕРАТОРЫ. ИЗМЕНЕНИЕ МАТРИЦЫ ЛИНЕЙНОГО ОПЕРАТОРА ПРИ ПЕРЕХОДЕ К НОВОМУ БАЗИСУ. ПОДОБНЫЕ МАТРИЦЫ

Определение 1. Линейное отображение $A : V \rightarrow V$ пространства V в себя называется *линейным оператором*.

Базис в V выбирается только один, поэтому изменение матрицы линейного оператора при переходе к новому базису выглядит так, как и в теореме 1 из 9 вопроса при $C = D$.

Определение 2. Матрицы A и B называются *подобными* тогда и только тогда, когда существует $C \in \text{GL}(n)$ такая, что

$$B = C^{-1}AC.$$

Предложение 1. Если A и B подобны, то $\det A = \det B$, $\text{rk } A = \text{rk } B$, $\text{tr } A = \text{tr } B$.

Доказательство. В обозначениях из определения подобия матриц $\det B = \det(C^{-1}AC) = \det(C^{-1}C) \cdot \det A = \det A$. Второе утверждение следует из того, что ранг не меняется при домножении на невырожденную матрицу.

Непосредственным вычислением доказывается, что $\text{tr}(AC) = \text{tr}(CA)$ (теорема из первого семестра). Как следствие, $\text{tr}(C^{-1}AC) = \text{tr } A$. ■

Это значит, что определитель матрицы линейного оператора не меняется при любой замене базиса, таким образом, можно говорить об *определителе, следе и ранге линейного оператора*.

11. ВЕКТОРНОЕ ПРОСТРАНСТВО ЛИНЕЙНЫХ ОТОБРАЖЕНИЙ. АЛГЕБРА ЛИНЕЙНЫХ ОПЕРАТОРОВ. ИЗОМОРФИЗМ АЛГЕБРЫ МАТРИЦ И АЛГЕБРЫ ЛИНЕЙНЫХ ОПЕРАТОРОВ

Утверждение, которое доказывалось в первом семестре:

Предложение 1. Пусть $U \xrightarrow{\psi} V \xrightarrow{\varphi} W$. Если φ, ψ — линейные, то $\varphi \circ \psi$ линейное.

Определение 1. Множество A с операциями сложения, умножения на скаляры и умножения элементов A , удовлетворяющее аксиомам:

1. $(A, +)$ — ассоциативное кольцо;
2. A — векторное пространство (относительно операций сложения и умножения на скаляры);
3. $\lambda(ab) = (\lambda a)b \ \forall \lambda \in \mathbb{F}, \forall a, b \in A$

называется *линейной алгеброй*.

Теорема 1. Множество всех линейных операторов на V с операциями сложения и умножения на скаляры и композиции является линейной алгеброй. Причём, это алгебра изоморфна алгебре матриц над тем же полем.

Доказательство. Первые две аксиомы уже проверены. Третья проверяется непосредственно:

$$(\lambda(ab))(v) = \lambda((ab)(v)) = \lambda a(b(v)) \Rightarrow \lambda(ab) = (\lambda a)b.$$

Вторая часть утверждения очевидна — мотивировкой именно такого определения произведения матриц было как раз то, что это будет матрица композиции линейных отображений. ■

12. ИНВАРИАНТНЫЕ ПОДПРОСТРАНСТВА ЛИНЕЙНОГО ОПЕРАТОРА. ОГРАНИЧЕНИЕ ЛИНЕЙНОГО ОПЕРАТОРА НА ИНВАРИАНТНОЕ ПОДПРОСТРАНСТВО. ВИД МАТРИЦЫ ЛИНЕЙНОГО ОПЕРАТОРА ПРИ НАЛИЧИИ ИНВАРИАНТНЫХ ПОДПРОСТРАНСТВ

Определение 1. Подпространство $W \subset V$ называется *инвариантным* относительно оператора $A : V \rightarrow V$, если $A(W) \subseteq W$.

Пример 1. $\text{Ker } A$ и $\text{Im } A$ являются инвариантными подпространствами. Пусть $W \subset V$ — инвариантное подпространство для оператора $A : V \rightarrow V$. Выберем базис e_1, \dots, e_k в W и дополним его до базиса $e_1, \dots, e_k, e_{k+1}, \dots, e_n$ в V . Пусть $A = (a_j^i)$ — матрица оператора A в этом базисе.

Тогда $Ae_j = a_j^1 e_1 + \dots + a_j^k e_k$ при $j = 1, \dots, k$. Это означает, что матрица A имеет вид $A = \left(\begin{array}{c|c} * & * \\ \hline 0 & * \end{array} \right)$,

где в левом нижнем углу стоит матрица размера $(n - k) \times k$ из нулей. Аналогично, если имеет место разложение $V = W_1 \oplus W_2$ в прямую сумму инвариантных подпространств, $A(W_1) \subset W_1$, $A(W_2) \subset W_2$, то в подходящем базисе матрица оператора A будет иметь блочно-диагональный вид:

$$A = \left(\begin{array}{c|c} * & 0 \\ \hline 0 & * \end{array} \right).$$

Определение 2. Пусть $W \subset V$ — инвариантное подпространство для оператора $A : V \rightarrow V$. Тогда оператор $\hat{A} : W \rightarrow W$, определённый равенством $\hat{A}w : Aw$ для $w \in W$, называется *ограничением* оператора A на подпространство W и часть обозначается как $A|_W$.

Определение 3. Линейный оператор $\tilde{A} : V/W \rightarrow V/W$, определённый на классах смежности по правилу $\tilde{A}(v + W) = Av + W$, называется *фактор-оператором*.

Определение фактор-оператора корректно. Действительно, если $v + W = u + W$, то $v - u \in W$, $A(v - u) \in W$, и мы имеем $\tilde{A}(v + W) = A(u + v = u) + W = Au + A(v - u) + W = Au + W = \tilde{A}(u + W)$.

Предложение 1. Пусть $W \subset V$ — инвариантное подпространство для оператора $A : V \rightarrow V$. Пусть e_1, \dots, e_k — базис в W и $e_1, \dots, e_k, e_{k+1}, \dots, e_n$ — базис в V . Тогда матрица оператора A в этом базисе имеет вид $A = \left(\begin{array}{c|c} \hat{A} & * \\ \hline 0 & \tilde{A} \end{array} \right)$, где \hat{A} — матрица ограничения $A|_W$ в базисе e_1, \dots, e_k , а \tilde{A} — матрица фактор-оператора в базисе $e_{k+1} + W, \dots, e_n + W$ факторпространства V/W .

Доказательство. Пусть $A = \begin{pmatrix} a_1^1 & a_2^1 & \dots & a_n^1 \\ a_1^2 & a_2^2 & \dots & a_n^2 \\ \vdots & \vdots & \ddots & \vdots \\ a_1^n & a_2^n & \dots & a_n^n \end{pmatrix}$. Тогда $\hat{A} = \begin{pmatrix} a_1^1 & \dots & a_k^1 \\ \vdots & \ddots & \vdots \\ a_1^k & \dots & a_k^k \end{pmatrix}$ и $\tilde{A} = \begin{pmatrix} a_{k+1}^{k+1} & \dots & a_n^{k+1} \\ \vdots & \ddots & \vdots \\ a_{k+1}^n & \dots & a_n^n \end{pmatrix}$.

Разложим вектор по базису: $v = v_1 e_1 + \dots + v_k e_k + \dots + v_{k+1} e_{k+1} + \dots + v_n e_n$. Отметим, что в силу инвариантности подпространства W имеет место $A \cdot (v_1, \dots, v_k, 0, \dots, 0)^t = \underbrace{(*, \dots, *)}_k, 0, \dots, 0)^t$. Итак,

$$\begin{aligned} Av = A \cdot v &= \begin{pmatrix} a_1^1 & a_2^1 & \dots & a_n^1 \\ a_1^2 & a_2^2 & \dots & a_n^2 \\ \vdots & \vdots & \ddots & \vdots \\ a_1^n & a_2^n & \dots & a_n^n \end{pmatrix} \cdot \begin{pmatrix} v_1 \\ \vdots \\ v_k \\ v_{k+1} \\ \vdots \\ v_n \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} a_1^1 & a_2^1 & \dots & a_n^1 \\ a_1^2 & a_2^2 & \dots & a_n^2 \\ \vdots & \vdots & \ddots & \vdots \\ a_1^n & a_2^n & \dots & a_n^n \end{pmatrix} \cdot \left(\begin{pmatrix} v_1 \\ \vdots \\ v_k \\ 0 \\ \vdots \\ 0 \end{pmatrix} + \begin{pmatrix} 0 \\ \vdots \\ 0 \\ v_{k+1} \\ \vdots \\ v_n \end{pmatrix} \right) = \\ &= \left(\begin{array}{c|c} \hat{A} & 0 \\ \hline 0 & \tilde{A} \end{array} \right) \cdot v + \left(\begin{array}{c|c} 0 & * \\ \hline 0 & \tilde{A} \end{array} \right) \cdot v = \left(\begin{array}{c|c} \hat{A} & * \\ \hline 0 & \tilde{A} \end{array} \right) \cdot v. \end{aligned}$$

Отсюда и следует, что в выбранном базисе матрица A имеет указанный вид. ■

Примечание. В конспектах Т.Е. Панова написано, что это утверждение примерно очевидно и доказывать мы его не будем. Поэтому изложенное выше доказательство я проделал сам, оно может содержать ошибки.

Следствие 1. Если пространство V представлено в виде прямой суммы ненулевых инвариантных относительно преобразования \mathcal{A} подпространств $V = W_1 \oplus \dots \oplus W_k$, то существует базис, в котором матрица преобразования имеет блочно-диагональный вид $A = \text{diag}(A_1, \dots, A_k) = \begin{pmatrix} A_1 & \dots & 0 \\ \vdots & \ddots & \vdots \\ 0 & \dots & A_k \end{pmatrix}$, где A_i — матрица ограничения $\mathcal{A}|_{W_i}$ преобразования \mathcal{A} на подпространство W_i , $i = 1, \dots, k$.

13. СОБСТВЕННЫЕ ВЕКТОРЫ И СОБСТВЕННЫЕ ЗНАЧЕНИЯ ЛИНЕЙНОГО ОПЕРАТОРА.

ЛИНЕЙНАЯ НЕЗАВИСИМОСТЬ СОБСТВЕННЫХ ВЕКТОРОВ ЛИНЕЙНОГО ОПЕРАТОРА, ОТВЕЧАЮЩИХ ПОПАРНО РАЗЛИЧНЫМ СОБСТВЕННЫМ ЗНАЧЕНИЯМ

Определение 1. Ненулевой вектор $v \in V$ называется *собственным* для оператора \mathcal{A} , если $\mathcal{A}v = \lambda v$ для некоторого $\lambda \in \mathbb{F}$. Число $\lambda \in \mathbb{F}$ называется *собственным значением*, если существует собственный вектор v , для которого $\mathcal{A}v = \lambda v$.

Предложение 1. Собственные векторы, отвечающие попарно различным собственным значениям $\lambda_1, \dots, \lambda_k$ оператора \mathcal{A} , линейно независимы.

Доказательство. Докажем утверждение теоремы индукцией по k . При $k = 1$ доказывать нечего. Пусть $k > 1$ и

$$\mu_1 v_1 + \dots + \mu_{k-1} v_{k-1} + \mu_k v_k = \mathbf{0} \quad (v_i \in V_{\lambda_i}, (\mu_1, \dots, \mu_k) \neq (0, \dots, 0))$$

Применяя оператор \mathcal{A} , получаем

$$\lambda_1 \mu_1 v_1 + \dots + \lambda_{k-1} \mu_{k-1} v_{k-1} + \lambda_k \mu_k v_k = \mathbf{0}.$$

Вычитая отсюда исходное неравенство, умноженное на λ_k , получаем

$$\mu_1 (\lambda_1 - \lambda_k) v_1 + \dots + (\lambda_{k-1} - \lambda_k) v_{k-1} = \mathbf{0},$$

откуда в силу предположения индукции следует равенство нулю всех коэффициентов. Если найдётся $\mu_j \neq 0$, то $\lambda_j - \lambda_{k-1} = 0$, однако из условия собственные значения попарно различны. Противоречие. Значит, все μ_j равны нулю, и система v_1, \dots, v_k линейно независима. ■

Следствие 1. Собственные подпространства $V_{\lambda_1}, \dots, V_{\lambda_k}$, соответствующие попарно различным собственным значениям $\lambda_1, \dots, \lambda_k$ оператора \mathcal{A} , образуют прямую сумму $V_{\lambda_1} \oplus \dots \oplus V_{\lambda_k}$.

14. ВЫЧИСЛЕНИЕ СОБСТВЕННЫХ ЗНАЧЕНИЙ И СОБСТВЕННЫХ ВЕКТОРОВ С ПОМОЩЬЮ МАТРИЦЫ. ХАРАКТЕРИСТИЧЕСКИЙ МНОГОЧЛЕН

Определение 1. Многочлен $\chi_{\mathcal{A}}(t) := \det(\mathcal{A} - t \cdot \text{id})$ называется *характеристическим многочленом* оператора \mathcal{A} .

Так как характеристический многочлен определяется как детерминант оператора, его можно вычислять как определитель матрицы этого оператора в любом базисе:

$$\chi_{\mathcal{A}}(t) = \det(A - t \cdot E) = \det \begin{pmatrix} a_1^1 - t & a_2^1 & \dots & a_n^1 \\ a_1^2 & a_2^2 - t & \dots & a_n^2 \\ \vdots & \vdots & \ddots & \vdots \\ a_1^n & a_2^n & \dots & a_n^n - t \end{pmatrix}.$$

Из этой формулы ясно, что $\deg \chi_{\mathcal{A}}(t) = \dim V$, кроме того, при $\chi_{\mathcal{A}}(t) = p_n t^n + p_{n-1} t^{n-1} + \dots + p_0$, имеем $p_n = (-1)^n$, $p_{n-1} = (-1)^{n-1} \operatorname{tr} \mathcal{A}$, $p_0 = \det \mathcal{A}$.

Предложение 1. Собственные значения оператора \mathcal{A} — это в точности корни его характеристического многочлена.

Доказательство. Если λ — собственное значение, то оператор $\mathcal{A} - \lambda \cdot \operatorname{id}$ вырожден, т. е. $\det(\mathcal{A} - \lambda \cdot \operatorname{id}) = 0$, а значит, λ — корень многочлена $\chi_{\mathcal{A}}(t)$. Обратно, если $\chi_{\mathcal{A}}(\lambda) = 0$, то $\det(\mathcal{A} - \lambda \cdot \operatorname{id}) = 0$. Поэтому $\operatorname{Ker}(\mathcal{A} - \lambda \cdot \operatorname{id}) \neq \{0\}$, а значит, λ — собственное значение. ■

Поиск собственных векторов. Сначала находим корни характеристического многочлена, т. е. собственные значения. Теперь найдём подпространство V_λ для собственного значения λ . Иными словами, хотим найти все такие векторы, что $\mathcal{A}v = \lambda v$. Это равносильно системе уравнений с матрицей $(A - \lambda E)$. Она и задаёт искомое подпространство.

15. СОБСТВЕННЫЕ ПОДПРОСТРАНСТВА. НЕРАВЕНСТВО МЕЖДУ РАЗМЕРНОСТЬЮ СОБСТВЕННОГО ПОДПРОСТРАНСТВА И КРАТНОСТЬЮ КОРНЯ ХАРАКТЕРИСТИЧЕСКОГО МНОГОЧЛЕНА

Предложение 1. Все собственные векторы, отвечающие собственным значениям λ , и вектор 0 образуют подпространство, которое совпадает с $\operatorname{Ker}(\mathcal{A} - \lambda \cdot \operatorname{id})$.

Доказательство. По определению ядра, равенство $\mathcal{A}v = \lambda v$ имеет место тогда и только тогда, когда $v \in \operatorname{Ker}(\mathcal{A} - \lambda \cdot \operatorname{id})$. ■

Определение 1. Пусть λ — собственное значение для оператора \mathcal{A} . Подпространство $V_\lambda := \operatorname{Ker}(\mathcal{A} - \lambda \cdot \operatorname{id})$ называется *собственным подпространством*, соответствующим λ .

Доказательство. Действительно, если $v \in V_\lambda$, то $\mathcal{A}v = \lambda v \in V_\lambda$. ■

Предложение 2. Размерность собственного подпространства V_λ не превосходит кратности λ как корня характеристического многочлена.

Доказательство. Пусть $\dim V_\lambda = k$. Выберем базис e_1, \dots, e_k в пространстве V_λ и дополним его до базиса в V . Т. к. $\mathcal{A}e_i = \lambda e_i$ при $i = 1, \dots, k$, матрица оператора \mathcal{A} в выбранном базисе имеет вид

$$A = \left(\begin{array}{ccc|ccc} \lambda & & & & & \\ & \ddots & & & & \\ 0 & & \lambda & & & \\ \hline & & & & & \\ & & & & & \\ & & & & & \end{array} \right). \text{ Тогда } \chi_{\mathcal{A}}(t) = \det(A - t \cdot E) = (\lambda - t)^k \det(\tilde{A} - t \cdot E) = (\lambda - t)^k \chi_{\tilde{\mathcal{A}}}(t), \text{ где } \tilde{\mathcal{A}}$$

— фактор-оператор. Отсюда вытекает, что кратность корня λ не меньше $k = \dim V_\lambda$. ■

16. ДИАГОНАЛИЗИРУЕМОСТЬ (МАТРИЦЫ) ЛИНЕЙНОГО ОПЕРАТОРА. КРИТЕРИИ ДИАГОНАЛИЗИРУЕМОСТИ И ДОСТАТОЧНОЕ УСЛОВИЕ

Определение 1. Оператор \mathcal{A} называется *диагонализируемым*, если существует базис, в котором матрица этого оператора диагональна.

По определению матрицы оператора, базис, в котором матрица оператора диагональна, состоит из собственных векторов. Поэтому оператор диагонализируем тогда и только тогда, когда для него существует базис из собственных векторов.

Теорема 1 (Критерий диагонализируемости). Оператор \mathcal{A} в n -мерном пространстве V диагонализируем тогда и только тогда, когда его характеристический многочлен имеет в точности n корней (с учётом кратностей) и размерность каждого собственного подпространства V_λ равна кратности корня λ .

Доказательство. Предположим, что оператор \mathcal{A} диагоналируем. Пусть на диагонали матрицы D оператора \mathcal{A} стоят числа $\lambda_1, \dots, \lambda_k$, причём число λ_i присутствует ровно r_i раз. Тогда мы имеем $\chi_{\mathcal{A}}(t) = \det(D - t \cdot E) = \prod_{i=1}^k (\lambda_i - t)^{r_i}$. Следовательно, многочлен $\chi_{\mathcal{A}}(t)$ имеет $\sum_{i=1}^k r_i = n$ корней, и каждому корню λ_i соответствует ровно r_i линейно независимых собственных векторов, т. е. $\dim V_{\lambda_i} = r_i$.

Предположим теперь, что многочлен $\chi_{\mathcal{A}}(t)$ имеет различные корни $\lambda_1, \dots, \lambda_k$, причём кратность корня λ_i равна r_i , $\sum_{i=1}^k r_i = n$ и $\dim V_{\lambda_i} = r_i$. Согласно следствию 1 из вопроса 13, пространства $V_{\lambda_1}, \dots, V_{\lambda_k}$ образуют прямую сумму, а по условию сумма их размерностей равна $n = \dim V$. Следовательно, $V = V_{\lambda_1} \oplus \dots \oplus V_{\lambda_k}$. Выбрав базис в каждом из подпространств $\{V_{\lambda_i}\}_{i=1}^k$ и взяв объединение этих базисов, мы получим базис пространства V , состоящий из собственных векторов. Итак, оператор \mathcal{A} диагоналируем. ■

Следствие 1 (Достаточное условие диагоналируемости). Если характеристический многочлен $\chi_{\mathcal{A}}(t)$ имеет $n = \dim V$ различных корней, то оператор \mathcal{A} диагоналируем.

Примечание. Панов пишет, что набор собственных значений оператора \mathcal{A} часто называют его *спектром* (будет в курсе функционального анализа). Если все собственные значения имеют кратность 1 как корни характеристического многочлена, то говорят о *простом спектре*. Таким образом, операторы с простым спектром диагоналируемы. Появление кратных корней является «особенностью», которая устраняется произвольно малым возмущением коэффициентов матрицы оператора. Поэтому над полем \mathbb{C} «почти все операторы диагоналируемы».

К последней фразе лично я отношусь скептически, ведь (как заметил Рамиль Хакамов) любое действительное число можно произвольно малым возмущением сделать рациональным, хотя язык не повернётся сказать, что «почти все действительные числа рациональные».

UPD. Почитал, оказалось, что подмножество матриц, не являющихся диагоналируемыми над $\mathbb{C}^{n \times n}$, имеет нулевую меру Лебега. То есть, по факту это «почти никакие». Можно ещё сказать, что диагоналируемые матрицы образуют всюду плотное подмножество в топологии Зарисского (замкнутыми называются множества нулей многочленов из некоторого выделенного множества), ведь дополнение к этому подмножеству лежит в множестве, в котором дискриминант характеристического уравнения обнуляется, т. е. на гиперповерхности. Над \mathbb{R} это не выполняется.

Если интересно почитать про геометрию дискриминанта, можно это сделать [ЗДЕСЬ](#).

Пример 1.

1. Оператор, заданный матрицей $\begin{pmatrix} 0 & -1 \\ 1 & 0 \end{pmatrix}$ в стандартном базисе в \mathbb{R}^2 не диагоналируем, т. к. его характеристический многочлен $t^2 + 1$ не имеет вещественных корней. Однако тот же оператор над \mathbb{C} диагоналируем: в базисе $f_1 = (1, i)$, $f_2 = (1, -i)$ его матрица $\begin{pmatrix} -i & 0 \\ 0 & i \end{pmatrix}$ диагональна.
2. Оператор, заданный матрицей $\begin{pmatrix} 1 & 1 \\ 0 & 1 \end{pmatrix}$ не диагоналируем ни над каким полем по другой причине: его характеристический многочлен $(t - 1)^2$ имеет корень 1 кратности 2, но при этом размерность соответствующего собственного подпространства равна 1 (вектор $e_2 = (0, 1)$ не является собственным).

17. АННУЛИРУЮЩИЕ МНОГОЧЛЕНЫ ЛИНЕЙНОГО ОПЕРАТОРА (МАТРИЦЫ).

МИНИМАЛЬНЫЙ МНОГОЧЛЕН. КРИТЕРИЙ ДИАГОНАЛИЗУЕМОСТИ В ТЕРМИНАХ МИНИМАЛЬНОГО МНОГОЧЛЕНА

Пусть $\mathcal{A} : V \rightarrow V$ — оператор. Каждому многочлену $P(t) = p_0 + p_1 t + \dots + p_n t^n \in \mathbb{F}[t]$ можно сопоставить оператор $P(\mathcal{A}) := p_0 \cdot \text{id} + p_1 \cdot \mathcal{A} + \dots + p_n \mathcal{A}^n$.

Определение 1. Такой оператор называется *многочленом от оператора* \mathcal{A} .

Определение 2. Многочлен $P(t)$ называют *аннулирующим* оператор \mathcal{A} , если $P(\mathcal{A}) = 0$ (нулевой оператор).

Пример 1.

1. Многочлен $t - 1$ аннулирует оператор id .
2. Многочлен $t^2 - t$ аннулирует любой проектор (потом будет написано, почему).

Предложение 1. У любого оператора существует ненулевой аннулирующий многочлен.

Доказательство. Пусть $\dim V = n$. Рассмотрим $n^2 + 1$ операторов: $\mathcal{A}^0 = \text{id}, \mathcal{A}^1 = \mathcal{A}, \mathcal{A}^2, \dots, \mathcal{A}^{n^2}$. Т. к. размерность пространства операторов равна n^2 , эти операторы линейно зависимы, т. е. существуют числа $p_0, p_1, p_2, \dots, p_{n^2}$, не все равные нулю, такие, что $p_0 \cdot \text{id} + p_1 \cdot \mathcal{A} + p_2 \cdot \mathcal{A}^2 + \dots + p_{n^2} \cdot \mathcal{A}^{n^2} = 0$. Тогда ненулевой многочлен $P(t) = p_0 + p_1 t + \dots + p_{n^2} t^{n^2}$ аннулирует \mathcal{A} . ■

Определение 3. Ненулевой многочлен со старшим коэффициентом 1 минимальной возможной степени среди аннулирующих многочленов оператора \mathcal{A} называется *минимальным многочленом* для оператора \mathcal{A} .

Лемма 1. Пусть $\mathcal{A} : V \rightarrow V$ — линейный оператор конечномерного векторного пространства V . Тогда

1. минимальный многочлен линейного оператора равен минимальному многочлену его матрицы в любом базисе;
2. минимальный многочлен является делителем любого аннулирующего многочлена;
3. минимальный многочлен единственный;
4. наборы корней у минимального многочлена и характеристического многочлена совпадают.

Доказательство.

1. Из доказательства теоремы 1 из вопроса 11 следует, что если $f(t) \in \mathbb{F}[t]$ — произвольный многочлен с коэффициентами из \mathbb{F} , то для матрицы A линейного оператора \mathcal{A} в произвольном базисе выполняется $f(A) = 0 \Leftrightarrow f(\mathcal{A}) = 0$. Откуда и получаем первое утверждение.
2. Пусть $f(t)$ — произвольный аннулирующий многочлен для \mathcal{A} . Поделим многочлен $f(t)$ на минимальный многочлен $\mu_{\mathcal{A}}(t)$ линейного оператора \mathcal{A} с остатком: $f(t) = \mu_{\mathcal{A}}(t)q(t) + r(t)$, при этом для остатка $r(t)$ должно выполняться $\deg r < \deg \mu_{\mathcal{A}}$. Подставляя \mathcal{A} вместо t , получаем

$$r(\mathcal{A}) = f(\mathcal{A}) - \mu_{\mathcal{A}}(\mathcal{A})q(\mathcal{A}) = 0 - 0 \cdot q(\mathcal{A}) = 0,$$

т. е. $r(t)$ аннулирует \mathcal{A} и $\deg r < \deg \mu_{\mathcal{A}}$, поэтому $r(t) = 0$, т. е. деление происходит нацело.

3. Любой из двух минимальных многочленов делит другой, а их старшие коэффициенты совпадают.
4. Т. к. характеристический многочлен $\chi_{\mathcal{A}}(t)$ линейного оператора \mathcal{A} является его аннулирующим многочленом (по теореме Гамильтона — Кэли, будет позднее), из п. 1 получаем, что $\mu_{\mathcal{A}}$ делит $\chi_{\mathcal{A}}$. Значит, корни минимального многочлена являются корнями характеристического многочлена. Обратно, пусть λ — корень характеристического многочлена. Тогда у \mathcal{A} есть собственный вектор v с собственным значением λ . Применим к вектору v оператор $\mu_{\mathcal{A}}$. С одной стороны, расписав минимальный многочлен явно:

$$\mu_{\mathcal{A}} = t^k + b_{k-1}t^{k-1} + \dots + b_1t + b_0$$

и подставив линейный оператор \mathcal{A} вместо переменной t , получаем

$$\begin{aligned} \mu_{\mathcal{A}}(\mathcal{A})v &= (\mathcal{A}^k + b_{k-1}\mathcal{A}^{k-1} + \dots + b_1\mathcal{A} + b_0 \text{id})v = \\ &= \mathcal{A}^k v + b_{k-1}\mathcal{A}^{k-1}v + \dots + b_1\mathcal{A}v + b_0 \text{id} v = \lambda^k v + b_{k-1}\lambda^{k-1}v + \dots + b_1\lambda v + b_0v = \\ &= (\lambda^k + b_{k-1}\lambda^{k-1} + \dots + b_1\lambda + b_0)v = \mu_{\mathcal{A}}(\lambda)v. \end{aligned}$$

С другой стороны, т. к. $\mu_A(\mathcal{A}) = 0$, имеем $\mu_A(\mathcal{A})v = 0v = 0$. Откуда $\mu_A(\lambda)v = 0$. Т. к. $v \neq 0$, то число $\mu_A(\lambda)$ равно нулю, т. е. λ — корень минимального многочлена. ■

Теорема 1 (Критерий диагонализуемости в терминах минимального многочлена). Линейный оператор $\mathcal{A} : V \rightarrow V$ конечномерного векторного пространства V над алгебраически замкнутым полем \mathbb{F} диагонализуем тогда и только тогда, когда его минимальный многочлен не имеет кратных корней.

Доказательство. Пусть сначала e_1, \dots, e_n — базис из собственных векторов для \mathcal{A} , причём $\mathcal{A}(e_i) = \lambda_i e_i$, т. е. матрица оператора \mathcal{A} в выбранном базисе диагональна:

$$A = \begin{pmatrix} \lambda_1 & & & \\ & \lambda_2 & & \\ & & \ddots & \\ & & & \lambda_n \end{pmatrix}.$$

Т. к. минимальный многочлен линейного оператора равен минимальному многочлену его матрицы в произвольном базисе, то $\mu_A(t) = (t - \alpha_1) \dots (t - \alpha_p)$, где $\alpha_1, \dots, \alpha_p$ — все попарно различные числа $\lambda_1, \dots, \lambda_n$. Это следует из того, что выписанный многочлен является аннулирующим для матрицы A , а минимальный многочлен делит любой аннулирующий многочлен и наборы корней у минимального и характеристического многочлена совпадают.

Пусть теперь минимальный многочлен не имеет кратных корней. И пусть J — жорданова нормальная форма оператора \mathcal{A} , которая существует в силу алгебраической замкнутости поля \mathbb{F} . Позже будет написано, как искать минимальный многочлен для жордановой матрицы, а сейчас воспользуемся этим результатом:

$$\mu_A(t) = \mu_J(t) = (t - \alpha_1)^{m_1} \dots (t - \alpha_p)^{m_p},$$

где $\alpha_1, \dots, \alpha_p$ — все попарно различные собственные значения линейного оператора \mathcal{A} , m_i — максимальный порядок жордановой клетки с α_i на диагонали в жордановой нормальной форме J . Т. к. минимальный многочлен не имеет кратных корней, получаем, что $m_i = 1$ для всех i , т. е. в J все клетки имеют порядок 1. Это и означает, что жорданова нормальная форма диагональна. ■

Задача 2 (MATH.STASCHEXCHANGE). Пусть \mathbb{K} — поле и $\mathbb{F} \supseteq \mathbb{K}$ — его расширение. Пусть также $A \in \text{Mat}_{n \times n}(\mathbb{K})$ и $\mu_{A, \mathbb{K}}$ — минимальный многочлен A . Заметим, что эту матрицу A можно также рассмотреть как матрицу из $\text{Mat}_{n \times n}(\mathbb{F})$, и пусть в этом случае её минимальный многочлен есть $\mu_{A, \mathbb{F}}$. Доказать, что $\mu_{A, \mathbb{K}} = \mu_{A, \mathbb{F}}$.

Нам понадобится две леммы.

Лемма 2. Если $A \in \text{Mat}_{n \times n}(\mathbb{K})$, то $\deg \mu_{A, \mathbb{K}} = d$ тогда и только тогда, когда выполнены следующие два условия:

1. матрицы $E, A, A^2, \dots, A^{d-1}$ линейно независимы над полем \mathbb{K} ;
2. матрицы $E, A, A^2, \dots, A^{d-1}, A^d$ линейно зависимы над полем \mathbb{K} ;

Доказательство. \Rightarrow . Пусть $\mu_{A, \mathbb{K}}(t) = a_0 + a_1 t + a_2 t^2 + \dots + a_d t^d$. Тогда $\mu_{A, \mathbb{K}}(A) = 0$, т. е.

$$a_0 E + a_1 A + a_2 A^2 + \dots + a_d A^d = 0.$$

Причём, не все a_i равны нулю. Значит, выполнено условие 2. А условие 1 выполнено в силу минимальности $\mu_{A, \mathbb{K}}$. Действительно, если $E, A, A^2, \dots, A^{d-1}$ линейно зависимы, то коэффициенты линейной зависимости можно выбрать в качестве коэффициентов аннулирующего многочлена степени $d - 1$, а такого нет, потому что $\deg \mu_{A, \mathbb{K}}$ минимальна для аннулирующих многочленов.

\Rightarrow . Эти условия ровно то и означают: существует аннулирующий многочлен степени d , но не существует аннулирующего многочлена степени $d - 1$. ■

Лемма 3. Есть $\mathbb{F} \supseteq \mathbb{K}$ — расширение поля и $v_1, \dots, v_r \in \mathbb{K}^N \subseteq \mathbb{F}^N$. Тогда v_1, \dots, v_r линейно зависимы над полем \mathbb{K} тогда и только тогда, когда они линейно зависимы над полем \mathbb{F} .

Доказательство. \Rightarrow . Очевидно, т. к. коэффициенты этой линейной зависимости лежат как в \mathbb{K} , так и в \mathbb{F} в силу $\mathbb{K} \subseteq \mathbb{F}$.

\Leftarrow . Пусть $v_i = (v_1^i, v_1^i, \dots, v_N^i)^t$ и пусть $x_1, \dots, x_r \in \mathbb{F}^N$ — коэффициенты линейной зависимости v_1, \dots, v_r . Тогда

$$x_1 \begin{pmatrix} v_1^1 \\ \vdots \\ v_N^1 \end{pmatrix} + x_2 \begin{pmatrix} v_1^2 \\ \vdots \\ v_N^2 \end{pmatrix} + \dots + x_r \begin{pmatrix} v_1^r \\ \vdots \\ v_N^r \end{pmatrix} = \mathbf{0}.$$

Получили систему уравнений с матрицей коэффициентов $V = (v_j^i)_{j=1, \dots, N}^{i=1, \dots, r}$. Система имеет ненулевое решение, значит, $\det V \neq 0$ над \mathbb{F} . Причём, $V \in \text{Mat}_{N \times r}(\mathbb{K})$, поэтому $\det V \neq 0$ и над \mathbb{K} . А значит, у неё есть ненулевое решение из \mathbb{K} . ■

Теперь можно и задачу решить.

▷ Очевидно, что $\mu_{A, \mathbb{F}}$ делит $\mu_{A, \mathbb{K}}$. Так как их старшие коэффициенты равны, достаточно показать, что их степени равны. А это очевидное следствие из двух предыдущих лемм. ◀

18. ТЕОРЕМА ГАМИЛЬТОНА — КЭЛИ

Теорема 1 (Гамильтон, Кэли). Характеристический многочлен χ_A оператора $A : V \rightarrow V$ аннулирует этот оператор, т. е. $\chi_A(A) = 0$.

Доказательство. Для квадратно матрицы M обозначим через \widehat{M} транспонированную матрицу алгебраических дополнений. Из курса алгебры, $M \cdot \widehat{M} = \det M \cdot E$. Теперь возьмём в качестве M матрицу $A - t \cdot E$, где A — матрица оператора A в произвольном базисе. Тогда $(A - t \cdot E)(\widehat{A - t \cdot E}) = \det(A - t \cdot E) \cdot E = \chi_A(t) \cdot E$. По определению, элементы матрицы $\widehat{A - t \cdot E}$ являются многочленами степени не выше $n - 1$ ($n = \dim V$). Следовательно, эту матрицу можно записать в виде $\widehat{A - t \cdot E} = B_0 + t \cdot B_1 + t^2 \cdot B_2 + \dots + t^{n-1} B_{n-1}$, где B_i — числовые матрицы. Подставив это разложение вместе с разложением $P_A(t) = a_0 + a_1 t + a_2 t^2 + \dots + a_n t^n$ в формулу выше, получим

$$(A - t \cdot E)(B_0 + t \cdot B_1 + t^2 \cdot B_2 + \dots + t^{n-1} \cdot B_{n-1}) = (a_0 + a_1 t + a_2 t^2 + \dots + a_n t^n) \cdot E.$$

Приравнявая коэффициенты при степенях t и складывая полученные уравнения, получим:

$$\begin{array}{l|l} AB_0 = a_0 E & \cdot A \\ -B_0 + AB_1 = a_1 E & \cdot A^2 \\ -B_1 + AB_2 = a_2 E & \cdot A^3 \\ \vdots & \vdots \\ -B_{n-2} + AB_{n-1} = a_{n-1} E & \cdot A^n \end{array} \Rightarrow 0 = \underbrace{a_0 E + a_1 A + a_2 A^2 + \dots + a_n A^n}_{\chi_A(A) = \chi_A(A)}$$

■

19. СУЩЕСТВОВАНИЕ ОДНОМЕРНОГО ИЛИ ДВУМЕРНОГО ИНВАРИАНТНОГО ПОДПРОСТРАНСТВА ДЛЯ ЛЮБОГО ЛИНЕЙНОГО ОПЕРАТОРА НАД ПОЛЕМ ДЕЙСТВИТЕЛЬНЫХ ЧИСЕЛ

Большая часть этого вопроса — рассказ про о веществе и комплексификацию линейных пространств (взято из Панова и Винберга). При работе с линейными операторами часто бывает

удобно изменить поле скаляров. Здесь рассмотрим две такие операции: переход от \mathbb{R} к \mathbb{C} (комплексификация) и переход от \mathbb{C} к \mathbb{R} (овеществление).

Определение 1. Пусть V — линейное пространство над полем \mathbb{C} . Рассмотрим множество $V_{\mathbb{R}}$, состоящее из тех же векторов, что и V . На \mathbb{R} имеется операция сложения (та же, что и на V), а вместо операции умножения на все комплексные числа оставим лишь умножение на все вещественные числа. Тогда $V_{\mathbb{R}}$ — линейное пространство над полем \mathbb{R} , которое называется *овеществлением пространства V* .

Предложение 1. Пусть e_1, \dots, e_n — базис пространства V . Тогда $e_1, \dots, e_n, ie_1, \dots, ie_n$ — базис пространства $V_{\mathbb{R}}$.

Доказательство. Проверим, что векторы $e_1, \dots, e_n, ie_1, \dots, ie_n$ линейно независимы в $V_{\mathbb{R}}$. Пусть $\lambda_1 e_1 + \dots + \lambda_n e_n + \mu_1 ie_1 + \dots + \mu_n ie_n = \mathbf{0}$ в пространстве $V_{\mathbb{R}}$, где $\lambda_k, \mu_k \in \mathbb{R}$, $k = 1, \dots, n$. Тогда в пространстве V мы имеем $(\lambda_1 + i\mu_1)e_1 + \dots + (\lambda_n + i\mu_n)e_n = \mathbf{0}$. Т.к. векторы e_1, \dots, e_n линейно независимы в V , то $\lambda_k + i\mu_k = 0 \Rightarrow \lambda_k = \mu_k = 0$, $k = 1, \dots, n$. Следовательно, векторы $e_1, \dots, e_n, ie_1, \dots, ie_n$ линейно независимы в $V_{\mathbb{R}}$. Теперь проверим, что эти векторы порождают всё пространство $V_{\mathbb{R}}$. Возьмём $v \in V_{\mathbb{R}}$ и рассмотрим его как вектор из V . Т.к. e_1, \dots, e_n — базис в V , то $v = \alpha_1 e_1 + \dots + \alpha_n e_n$, где $(\alpha_k = \lambda_k + i\mu_k) \in \mathbb{C}$ ($k = 1, \dots, n$), где $\lambda_k, \mu_k \in \mathbb{R}$. Тогда $v = \lambda_1 e_1 + \dots + \lambda_n e_n + \mu_1 ie_1 + \dots + \mu_n ie_n$. ■

Следствие 1. $\dim V_{\mathbb{R}} = 2 \dim V$.

Определение 2. Пусть V — комплексное пространство и $\mathcal{A} : V \rightarrow V$ — оператор. Тогда тот же оператор, рассматриваемый в пространстве $V_{\mathbb{R}}$ называется *овеществлением оператора \mathcal{A}* и обозначается $\mathcal{A}_{\mathbb{R}}$.

Предложение 2. Запишем матрицу оператора \mathcal{A} в базисе e_1, \dots, e_n пространства V в виде $A + iB$, где A и B — вещественные матрицы. Тогда

1. матрица оператора $\mathcal{A}_{\mathbb{R}}$ в базисе $e_1, \dots, e_n, ie_1, \dots, ie_n$ есть $\left(\begin{array}{c|c} A & -B \\ \hline B & A \end{array} \right)$;
2. $\det \mathcal{A}_{\mathbb{R}} = |\det \mathcal{A}|^2$.

Доказательство.

1. Пусть $A = (a_k^\ell)$ и $B = (b_k^\ell)$. Тогда $\mathcal{A}_{\mathbb{R}}(e_k) = \mathcal{A}(e_k) = (a_k^\ell + ib_k^\ell)e_\ell = a_k^\ell e_\ell + ib_k^\ell e_\ell$, $\mathcal{A}_{\mathbb{R}}(ie_k) = \mathcal{A}(ie_k) = i\mathcal{A}(e_k) = i(a_k^\ell + ib_k^\ell)e_\ell = -b_k^\ell e_\ell + a_k^\ell ie_\ell$.
2. Заметим, что

$$\left(\begin{array}{c|c} A & -B \\ \hline B & A \end{array} \right) \rightsquigarrow \left(\begin{array}{c|c} A - iB & -B - iA \\ \hline B & A \end{array} \right) \rightsquigarrow \left(\begin{array}{c|c} A - iB & -B - iA + i(A - iB) \\ \hline B & A + iB \end{array} \right) \rightsquigarrow \left(\begin{array}{c|c} A - iB & 0 \\ \hline B & A + iB \end{array} \right).$$

Отсюда получаем $\det \mathcal{A}_{\mathbb{R}} = \det(A - iB) \det(A + iB) = \overline{\det \mathcal{A}} \det \mathcal{A} = |\det \mathcal{A}|^2$. ■

Определение 3. Пусть V — вещественное пространство. *Комплексной структурой* на V называется такой оператор $\mathcal{J} : V \rightarrow V$, что $\mathcal{J}^2 = -\text{id}$.

Пусть V — вещественное пространство с комплексной структурой \mathcal{J} . Введём на V операцию умножения на комплексные числа по правилу $(\lambda + i\mu)v = \lambda v + \mu \mathcal{J}v$. Тогда V превращается в комплексное пространство \tilde{V} , для которого $\tilde{V}_{\mathbb{R}} = V$, а овеществление оператора умножения на i есть \mathcal{J} . Проверка выполняется непосредственно.

Предложение 3. Пусть \mathcal{J} — комплексная структура на V . Тогда:

1. размерность вещественного пространства V чётна;
2. в подходящем базисе матрица оператора \mathcal{J} имеет вид $\left(\begin{array}{c|c} 0 & -E \\ \hline E & 0 \end{array} \right)$.

Доказательство. Т.к. любой базис V порождает \tilde{V} , то это пространство конечномерно. А т.к. $V = \tilde{V}_{\mathbb{R}}$, то $\dim V = 2 \dim \tilde{V}$ — чётно. Далее, если e_1, \dots, e_n — базис комплексного пространства \tilde{V} , то $e_1, \dots, e_n, ie_1, \dots, ie_n$ — базис пространства $\tilde{V}_{\mathbb{R}} = V$. В этом базисе оператор \mathcal{J} (овеществление оператора умножения на i) имеет указанный вид. Это прямое следствия записей сверху. ■

Определение 4. Пусть V — линейное пространство над полем \mathbb{R} . Рассмотрим пространство $V \oplus V$, состоящее из пар (u, v) , где $u, v \in V$, и введём на нём комплексную структуру следующим образом: $\mathcal{J}(u, v) := (-v, u)$. Получаемое пространство $\widetilde{V \oplus V}$ над полем \mathbb{C} называется *комплексификацией* пространства V и обозначается $V_{\mathbb{C}}$.

Предложение 4. Пусть e_1, \dots, e_n — базис пространства V . Тогда векторы $(e_1, \mathbf{0}), \dots, (e_n, \mathbf{0})$ образуют базис пространства $V_{\mathbb{C}}$.

Доказательство. Проверим линейную независимость: пусть $\alpha_1(e_1, \mathbf{0}) + \dots + \alpha_n(e_n, \mathbf{0}) = (\mathbf{0}, \mathbf{0})$ для некоторых $\alpha_k = \lambda_k + i\mu_k \in \mathbb{C}$, $k = 1, \dots, n$. Выкладка:

$$(\lambda_k + i\mu_k)(e_k, \mathbf{0}) = \lambda_k(e_k, \mathbf{0}) + \mu_k \mathcal{J}(e_k, \mathbf{0}) = (\lambda_k e_k, \mu_k e_k).$$

Подставляя это в линейную комбинацию выше, получаем $(\lambda_1 e_1 + \dots + \lambda_n e_n, \mu_1 e_1, \dots, \mu_n e_n) = (\mathbf{0}, \mathbf{0})$. Из линейной независимости векторов e_1, \dots, e_n в V , получаем $\lambda_k = \mu_k = 0$ для всех k . А значит, $\alpha_1 = \dots = \alpha_n = 0$. Итак, $(e_1, \mathbf{0}), \dots, (e_n, \mathbf{0})$. То, что они порождают всё пространство, проверяется аналогично. ■

Следствие 2. $\dim V_{\mathbb{C}} = \dim V$.

Определение 5. Пусть V — пространство над \mathbb{R} и $\mathcal{A} : V \rightarrow V$ — оператор. Оператор $\mathcal{A}_{\mathbb{C}} : V_{\mathbb{C}} \rightarrow V_{\mathbb{C}}$, заданный формулой $\mathcal{A}_{\mathbb{C}}(u, v) := (\mathcal{A}u, \mathcal{A}v)$, называется *комплексификацией оператора \mathcal{A}* .

Предложение 5. Пусть A — матрица оператора \mathcal{A} в базисе e_1, \dots, e_n . Тогда оператор $\mathcal{A}_{\mathbb{C}}$ в базисе $(e_1, \mathbf{0}), \dots, (e_n, \mathbf{0})$ задаётся той же матрицей A .

Доказательство. $\mathcal{A}_{\mathbb{C}}(e_k, \mathbf{0}) = (\mathcal{A}e_k, \mathbf{0}) = (a_k^{\ell} e_{\ell}, \mathbf{0}) = a_k^{\ell} (e_{\ell}, \mathbf{0})$. ■

Отметим, что при работе с комплексифицированным пространством $V_{\mathbb{C}}$ удобно записывать векторы $(u, v) \in V_{\mathbb{C}}$ в виде $u + iv$. Тогда действие комплексифицированного оператора $\mathcal{A}_{\mathbb{C}}$ записывается как $\mathcal{A}_{\mathbb{C}}(u + iv) = \mathcal{A}u + i\mathcal{A}v$.

Предложение 6. Пространство $(V_{\mathbb{C}})_{\mathbb{R}}$ канонически изоморфно $V \oplus V$.

Доказательство. Действительно, $V_{\mathbb{C}} = \widetilde{V \oplus V}$, а $(\widetilde{V \oplus V})_{\mathbb{R}} = V \oplus V$ (мы просто сначала добавили, а потом убрали домножение на комплексные скаляры). ■

Предложение 7. $(V_{\mathbb{R}})_{\mathbb{C}}$ канонически изоморфно $V \oplus \bar{V}$, где \bar{V} — комплексно сопряжённое пространство, в котором сложение то же, что и в V , а умножение $*$ на скаляры определяется как $\lambda * v := \bar{\lambda}v$.

Доказательство. Так как \mathbb{C} — алгебраически замкнутое поле, комплексная структура \mathcal{J} должна иметь $n = \dim(V_{\mathbb{R}})_{\mathbb{C}}$ собственных значений, каждое из которых удовлетворяет $\lambda^2 = -1$, т.е. $\lambda = \pm i$. Значит, можем записать $(V_{\mathbb{R}})_{\mathbb{C}} = V^+ \oplus V^-$, где V^+ и V^- — собственные подпространства для $+i$ и $-i$ соответственно. Первое из них изоморфно V , а второе — \bar{V} . ■

Примечание. Предложение выше Панов оставил в качестве задачи. Я привёл здесь своё решение, оно может содержать ошибки.

Оператор $\mathcal{A} : V \rightarrow V$ в нетривиальном пространстве над полем \mathbb{C} имеет инвариантное подпространство размерности 1. Действительно, т. к. поле \mathbb{C} алгебраически замкнуто, характеристический многочлен $\chi_{\mathcal{A}}(t)$ имеет корень λ и собственный вектор $v \in V_{\lambda}$. Подпространство $\langle v \rangle$ собственное размерности 1.

Теорема 1. Оператор $\mathcal{A} : V \rightarrow V$ в нетривиальном пространстве над полем \mathbb{R} имеет инвариантное подпространство размерности 1 или 2.

Доказательство. Если характеристический многочлен $\chi_{\mathcal{A}}(t)$ имеет вещественный корень, то (аналогично) мы получаем одномерное инвариантное подпространство. Предположим, что $\chi_{\mathcal{A}}(t)$ не имеет вещественных корней. Пусть $\lambda + i\mu$ — комплексный корень, $\mu \neq 0$. Тогда $\lambda + i\mu$ — собственное значение комплексифицированного оператора $\mathcal{A}_{\mathbb{C}}$ (напомним, что в подходящих базисах матрицы операторов \mathcal{A} и $\mathcal{A}_{\mathbb{C}}$ совпадают). Возьмём соответствующий собственный вектор $u + iv \in V_{\mathbb{C}}$. Тогда $\mathcal{A}u + i\mathcal{A}v = \mathcal{A}_{\mathbb{C}}(u + iv) = (\lambda + i\mu)(u + iv) = (\lambda u - \mu v) + i(\mu u + \lambda v)$. Следовательно, $\mathcal{A}u = \lambda u - \mu v$, а $\mathcal{A}v = \mu u + \lambda v$, и линейная оболочка $\langle u, v \rangle$ является инвариантным подпространством для \mathcal{A} . ■

Следствие 1. Над полем \mathbb{R} любой линейный оператор приводим к блочно-диагональному виду, причём блоки имеют порядок не выше двух.

20. КОРНЕВЫЕ ПОДПРОСТРАНСТВА. РАЗЛОЖЕНИЕ ПРОСТРАНСТВА В ПРЯМУЮ СУММУ КОРНЕВЫХ ПОДПРОСТРАНСТВ

Определение 1. Вектор $v \in V$ называется *корневым вектором* оператора \mathcal{A} , отвечающим числу $\lambda \in \mathbb{F}$, если существует такое m , что $(\mathcal{A} - \lambda \cdot \text{id})^m v = \mathbf{0}$.

Обозначим через R_{λ} множество всех корневых векторов, отвечающих λ .

Предложение 1. R_{λ} является подпространством в V .

Доказательство. Пусть $u, v \in R_{\lambda}$, т. е. $(\mathcal{A} - \lambda \cdot \text{id})^{\ell} u = (\mathcal{A} - \lambda \cdot \text{id})^m v = \mathbf{0}$ для некоторых ℓ и m . Тогда $(\mathcal{A} - \lambda \cdot \text{id})^{\ell}(\mu u) = \mathbf{0} \forall \mu \in \mathbb{F}$ и $(\mathcal{A} - \lambda \cdot \text{id})^{\max\{\ell, m\}}(u + v) = \mathbf{0}$. ■

Определение 2. Подпространство $R_{\lambda} \subseteq V$ называется *корневым подпространством* для оператора \mathcal{A} , отвечающим λ .

Предложение 2. Подпространство R_{λ} нетривиально тогда и только тогда, когда λ — собственное значение оператора \mathcal{A} . При этом $V_{\lambda} \subseteq R_{\lambda}$.

Доказательство. Действительно, если λ — собственное значение, то существует $v \neq \mathbf{0}$ такой, что $(\mathcal{A} - \lambda \cdot \text{id})^1 v = \mathbf{0}$, т. е. $v \in R_{\lambda}$ и R_{λ} нетривиально. Отсюда же следует, что $V_{\lambda} \subseteq R_{\lambda}$.

Обратно, пусть R_{λ} содержит $u \neq \mathbf{0}$ такой, что $(\mathcal{A} - \lambda \cdot \text{id})^m u = \mathbf{0}$, причём m минимально, т. е. $v := (\mathcal{A} - \lambda \cdot \text{id})^{m-1} u \neq \mathbf{0}$. Тогда $(\mathcal{A} - \lambda \cdot \text{id})v = (\mathcal{A} - \lambda \cdot \text{id})^m u = \mathbf{0}$, т. е. v — собственный вектор, отвечающий λ . ■

Далее будем рассматривать только нетривиальные корневые подпространства.

Теорема 1. Пусть \mathcal{A} — оператор в пространстве V над алгебраически замкнутым полем, и пусть $\lambda_1, \dots, \lambda_k$ — все собственные значения оператора \mathcal{A} . Тогда $V = R_{\lambda_1} \oplus \dots \oplus R_{\lambda_k}$.

Доказательство будет опираться на три леммы.

Лемма 1. Подпространство R_{λ} инвариантно относительно любого оператора $\mathcal{A} - \mu \cdot \text{id}$ (в частности, относительно \mathcal{A}). Ограничение $(\mathcal{A} - \mu \cdot \text{id})|_{R_{\lambda}} : R_{\lambda} \rightarrow R_{\lambda}$ при $\lambda \neq \mu$ является обратимым, а при $\lambda = \mu$ нильпотентным оператором.

Доказательство. Пусть $v \in R_{\lambda}$, т. е. $(\mathcal{A} - \lambda \cdot \text{id})v = \mathbf{0}$. Тогда

$$(\mathcal{A} - \lambda \cdot \text{id})^m (\mathcal{A} - \mu \cdot \text{id})v = (\mathcal{A} - \mu \cdot \text{id}) \underbrace{(\mathcal{A} - \mu \cdot \text{id})^m v}_{\mathbf{0}} = \mathbf{0},$$

т. к. многочлены от оператора коммутируют. Итак, R_λ является $(\mathcal{A} - \mu \cdot \text{id})$ -инвариантным подпространством, и мы можем рассмотреть ограничение $(\mathcal{A} - \mu \cdot \text{id})|_{R_\lambda}$. Пусть $v \in \text{Ker}(\mathcal{A} - \mu \cdot \text{id})|_{R_\lambda}$, т. е. $v \in R_\lambda$ и $\mathcal{A}v = \mu v$. Тогда $(\mathcal{A} - \lambda \cdot \text{id})^m v = \mathbf{0}$ для некоторого m и $(\mathcal{A} - \lambda \cdot \text{id})v = (\mu - \lambda)v$, а значит, $(\mu - \lambda)^m v = (\mathcal{A} - \lambda \cdot \text{id})^m v = \mathbf{0}$. Следовательно, при $\mu \neq \lambda$ имеем $v = \mathbf{0}$. Тогда ядро $(\mathcal{A} - \mu \cdot \text{id})|_{R_\lambda}$ тривиально, и этот оператор инъективен, а значит, обратим.

Наконец, если e_1, \dots, e_r — базис в R_λ и $(\mathcal{A} - \lambda \cdot \text{id})^{m_i} e_i = \mathbf{0}$, то $(\mathcal{A} - \lambda \cdot \text{id})^m v = \mathbf{0}$, $\forall v \in V$, где $m = \max\{m_1, \dots, m_r\}$. ■

Лемма 2. Корневые подпространства $R_{\lambda_1}, \dots, R_{\lambda_k}$, соответствующие различным собственным значениям $\lambda_1, \dots, \lambda_k$ образуют прямую сумму.

Доказательство. Проведём индукцию по k . При $k = 1$ доказывать нечего. Предположим, что утверждение доказано для $k - 1$ подпространств. Докажем, что соотношение $(*)$: $v_1 + \dots + v_k = \mathbf{0}$, где $v_i \in R_{\lambda_i}$, влечёт $v_1 = \dots = v_k = \mathbf{0}$. Имеем $(\mathcal{A} - \lambda_k \cdot \text{id})^p v_k = \mathbf{0}$ для некоторого p . Применив к $(*)$ оператор $(\mathcal{A} - \lambda_k \cdot \text{id})^p$, получим (\star) : $(\mathcal{A} - \lambda_k \cdot \text{id})^p v_1 + \dots + (\mathcal{A} - \lambda_k \cdot \text{id})^p v_{k-1} = \mathbf{0}$. Т. к. подпространства $R_{\lambda_1}, \dots, R_{\lambda_{k-1}}$ инвариантны относительно $\mathcal{A} - \lambda_k \cdot \text{id}$, мы имеем $(\mathcal{A} - \lambda_k \cdot \text{id})^p v_i \in R_{\lambda_i}$, $i = 1, \dots, k - 1$. По предположению индукции, из (\star) следует $(\mathcal{A} - \lambda_k \cdot \text{id})^p v_i = \mathbf{0}$. А т. к. по предыдущей лемме оператор $\mathcal{A} - \lambda_k \cdot \text{id}$ в пространствах $R_{\lambda_1}, \dots, R_{\lambda_{k-1}}$ обратим, то $v_1 = \dots = v_{k-1} = \mathbf{0}$. Тогда из $(*)$ получаем $v_k = \mathbf{0}$. ■

Лемма 3. Размерность корневого подпространства R_λ равна кратности λ как корня характеристического многочлена оператора \mathcal{A} .

Доказательство. Обозначим через r_λ кратность корня λ . Пусть $\hat{\mathcal{A}} = \mathcal{A}|_{R_\lambda}$ — ограничение оператора \mathcal{A} на R_λ и $\tilde{\mathcal{A}}: V/R_\lambda \rightarrow V/R_\lambda$ — фактор-оператор. Тогда для характеристических многочленов мы имеем $(*)$: $\chi_{\mathcal{A}}(t) = \chi_{\hat{\mathcal{A}}}(t) \cdot \chi_{\tilde{\mathcal{A}}}(t) = (\lambda - t)^{\dim R_\lambda} \chi_{\tilde{\mathcal{A}}}(t)$, потому что $\mathcal{A} = \begin{pmatrix} \hat{\mathcal{A}} & * \\ 0 & \tilde{\mathcal{A}} \end{pmatrix}$ в некотором базисе (т. к. R_λ — инвариантное подпространство). Отсюда $\dim R_\lambda \leq r_\lambda$.

Предположим, что $\dim R_\lambda < r_\lambda$. Тогда из $(*)$ следует, что λ является корнем многочлена $\chi_{\tilde{\mathcal{A}}}(t)$, т. е. собственным значением оператора $\tilde{\mathcal{A}}$. Пусть $v + R_\lambda$ — соответствующий (ненулевой) собственный вектор, т. е. $\mathcal{A}(v + R_\lambda) = \lambda(v + R_\lambda)$ или $\mathcal{A}v + R_\lambda = \lambda v + R_\lambda$. Отсюда вытекает, что $\mathcal{A}v - \lambda v = (\mathcal{A} - \lambda \cdot \text{id})v \in R_\lambda$. По определению R_λ это значит, что $\mathbf{0} = (\mathcal{A} - \lambda \cdot \text{id})^m (\mathcal{A} - \lambda \cdot \text{id})v = (\mathcal{A} - \lambda \cdot \text{id})^{m+1} v$, т. е. $v \in R_\lambda$. Но тогда $v + R_\lambda$ — нулевой вектор пространства V/R_λ . Противоречие. ■

Теперь докажем основную теорему:

Доказательство. Пусть $\dim V = n$ и r_i — кратность корня λ_i , $i = 1, \dots, k$. Тогда $\sum_{i=1}^k r_i = n$ (здесь мы пользуемся алгебраической замкнутостью поля) и из двух предыдущих лемм вытекает, что $\dim(R_{\lambda_1} \oplus \dots \oplus R_{\lambda_k}) = \sum_{i=1}^k r_i = \dim V$. ■

Определение 3. Разложение $V = R_{\lambda_1} \oplus \dots \oplus R_{\lambda_k}$ называется *корневым*.

21. ЖОРДАНОВЫ КЛЕТКИ И МАТРИЦЫ, ИХ ХАРАКТЕРИСТИЧЕСКИЕ И МИНИМАЛЬНЫЕ МНОГОЧЛЕНЫ. ЖОРДАНОВ БАЗИС

Определение 1. Матрица вида $J_\lambda = \begin{pmatrix} \lambda & 1 & & \\ & \lambda & \ddots & \\ & & \ddots & 1 \\ & & & \lambda \end{pmatrix}$ называется *жордановой клеткой*. Если

матрица оператора \mathcal{A} в некотором базисе является блочно-диагональной с блоками вида J_λ (возможно, соответствующих различным λ), то такая матрица называется *жордановой нормальной*

формой оператора \mathcal{A} . Базис, в котором оператор имеет жорданову нормальную форму, называется *жордановым*.

Предложение 1. Минимальный аннулирующий многочлен оператора \mathcal{A} над полем \mathbb{C} есть $P(t) = \prod_{i=1}^k (t - \lambda_i)^{m_i}$, где $\lambda_1, \dots, \lambda_k$ — все собственные значения \mathcal{A} , а m_i — размер максимальной жордановой клетки, отвечающей λ_i .

Доказательство. Мы имеем $R_{\lambda_i} = \text{Ker}(\mathcal{A} - \lambda_i \cdot \text{id})^{m_i}$, поэтому многочлен $(t - \lambda_i)^{m_i}$ является минимальным аннулирующим для оператора $\mathcal{A}|_{R_{\lambda_i}}$. В силу теоремы о корневом разложении, $\forall v \in V$ представляется в виде $v = \sum_i v_i$, где $v_i \in R_{\lambda_i}$. Т.к. $P(\mathcal{A})$ содержит множитель $(\mathcal{A} - \lambda_i \cdot \text{id})^{m_i}$, мы имеем $P(\mathcal{A})v_i = 0$, т.е. $P(\mathcal{A})v = 0$, и многочлен $P(t)$ аннулирует оператор \mathcal{A} . С другой стороны, любой многочлен $Q(t)$, аннулирующий оператор \mathcal{A} , делится на минимальный аннулирующий многочлен для оператора $\mathcal{A}|_{R_{\lambda_i}}$, т.е. на $(t - \lambda_i)^{m_i}$, для каждого λ_i . Следовательно, $Q(t)$ делится на $P(t)$, и $P(t)$ — минимальный многочлен. ■

Про то, как искать жорданов базис, лучше всего НАПИСАЛ Антон Александрович Клячко. Однако там этот алгоритм описан очень непонятно, когда-нибудь он появится здесь со всеми обоснованиями и доказательствами. Также напишу, как всё-таки искать количество жордановых базисов над конечным полем. То, что Антон Александрович записывает клетки с единицами под собственными значениями, а не над, как это принято, **существенно**.

Как нетрудно заметить, у жордановой клетки минимальный многочлен совпадает с характеристическим. На самом деле, такие матрицы обладают особым свойством.

Задача 3 (А. А. Клячко). Докажите, что матрица коммутирует только с многочленами от себя тогда и только тогда, когда её минимальный многочлен совпадает с характеристическим.

Отметим, что, не ограничивая общности, можно рассматривать матрицы сразу над алгебраически замкнутым полем (см. задачу 2 в вопросе 17), тогда у них есть жордановы формы. И очевидно, что вопрос о коммутировании матриц равносильен вопросу о коммутировании их жордановых форм.

Нам понадобятся три очень технические леммы.

Лемма 1 (Костя Зюбин). Пусть у жордановой матрицы A минимальный многочлен совпадает с характеристическим. Тогда диагональ A является многочленом от неё.

Доказательство. Т.к. минимальный многочлен совпал с характеристическим, то каждому уникальному собственному значению λ_i соответствует ровно одна клетка (из предложения 1), т.е. матрица выглядит вот так:

$$A = \begin{pmatrix} J_1 & & \\ & \ddots & \\ & & J_m \end{pmatrix},$$

где J_i — жорданова клетка размером m_i с собственным значением λ_i , причём все такие λ_i попарно различны. Рассмотрим многочлен $g_i(t) := \frac{\chi_A(t)}{(t - \lambda_i)^{m_i}}$. Этот многочлен, как нетрудно заметить, будет аннулировать все клетки, кроме J_i . Это значит, что

$$g_i(A) = \begin{pmatrix} g_i(J_i) & \\ & 0 \end{pmatrix}$$

(условно будем рисовать клетку в верхнем левом углу). Пусть $\mu_{G_i}(t)$ — минимальный многочлен матрицы $G_i = g_i(J_i)$ и $\lambda_i \neq 0$ (мы потом отдельно рассмотрим случай вырожденных клеток). Тогда свободный член $\mu_{G_i}(t)$ не равен нулю. Действительно, в противном случае $\mu_{G_i}(t) = q_{G_i}(t) \cdot t \Rightarrow q_{G_i}(G_i)G_i = 0 \Rightarrow q_{G_i}(G_i) = 0G_i^{-1} = 0$, причём $\deg q_{G_i} < \deg \mu_{G_i}$ — противоречие. Теперь будем

строить искомый многочлен в несколько шагов:

$$\begin{aligned}\mu_{G_i}(g_i(A)) &= \left(\begin{array}{c|c} 0 & \\ \hline & \mu_{G_i}(0)E \end{array} \right) \\ \mu_{G_i}(g_i(A)) - \mu_{G_i}(0)E &= \left(\begin{array}{c|c} -\mu_{G_i}(0)E & \\ \hline & 0 \end{array} \right) \\ \lambda_i E - \frac{\lambda_i}{\mu_{G_i}(0)} \mu_{G_i}(g_i(A)) &= \left(\begin{array}{c|c} \lambda_i E & \\ \hline & 0 \end{array} \right).\end{aligned}$$

И вот отсюда

$$\left(\sum_i \lambda_i \right) E - \sum_{\lambda_i \neq 0} \frac{\lambda_i}{\mu_{G_i}(0)} \cdot \mu_{G_i}(g_i(A)) = \begin{pmatrix} \boxed{\lambda_1 E} & & & \\ & \boxed{\lambda_2 E} & & \\ & & \ddots & \\ & & & \boxed{\lambda_m E} \end{pmatrix}.$$

А теперь заметим, что при $\lambda_j = 0$ в получившейся матрице j -ый блок будет нулевой матрицей (там будет стоять пустая сумма), а ровно этого и хотелось. Так что найденный нами многочлен переводит A в её диагональ. ■

Лемма 2. С матрицей $D = \text{diag}(\overbrace{\lambda_1, \dots, \lambda_1}^{m_1}, \overbrace{\lambda_2, \dots, \lambda_2}^{m_2}, \dots, \overbrace{\lambda_k, \dots, \lambda_k}^{m_k})$ коммутируют такие и только такие матрицы:

$$\begin{pmatrix} B_1 & & \\ & \ddots & \\ & & B_k \end{pmatrix},$$

где B_i — блоки размера m_i .

Доказательство. То, что такие коммутируют, очевидно (проверяется непосредственно). Докажем, что коммутируют только такие. Пусть B коммутирует с D . Тогда умножив D на B слева, мы каждую строку B домножим на соответствующий коэффициент. А умножив D на B справа, мы каждый столбец умножим на соответствующий коэффициент. Итак, получаем:

$$\begin{pmatrix} \lambda_1 b_{11} & \dots & \lambda_1 b_{1m_1} & \lambda_1 b_{1,m_1+1} & \dots & \lambda_1 b_{1,m_1+m_2} & \dots & \lambda_1 b_{1n} \\ \vdots & \ddots & \vdots & \vdots & \ddots & \vdots & \ddots & \vdots \\ \lambda_1 b_{m_1+1} & \dots & \lambda_1 b_{m_1+1,m_1} & \lambda_1 b_{m_1+1,m_1+1} & \dots & \lambda_1 b_{m_1+1,m_1+m_2} & \dots & \lambda_1 b_{m_1+1,n} \\ \lambda_2 b_{m_1+1,1} & \dots & \lambda_2 b_{m_1+1,m_1} & \lambda_2 b_{m_1+1,m_1+1} & \dots & \lambda_2 b_{m_1+1,m_1+m_2} & \dots & \lambda_2 b_{m_1+1,n} \\ \vdots & \ddots & \vdots & \vdots & \ddots & \vdots & \ddots & \vdots \\ \lambda_2 b_{m_1+m_2,1} & \dots & \lambda_2 b_{m_1+m_2,m_1} & \lambda_2 b_{m_1+m_2,m_1+1} & \dots & \lambda_2 b_{m_1+m_2,m_1+m_2} & \dots & \lambda_2 b_{m_1+m_2,n} \\ \vdots & \ddots & \vdots & \vdots & \ddots & \vdots & \ddots & \vdots \\ \lambda_k b_{n1} & \dots & \lambda_k b_{nm_1} & \lambda_k b_{n,m_1+1} & \dots & \lambda_k b_{n,m_1+m_2} & \dots & \lambda_k b_{nn} \end{pmatrix} =$$

$$= \begin{pmatrix} \lambda_1 b_{11} & \dots & \lambda_1 b_{1m_1} & \lambda_2 b_{1,m_1+1} & \dots & \lambda_2 b_{1,m_1+m_2} & \dots & \lambda_k b_{1n} \\ \vdots & \ddots & \vdots & \vdots & \ddots & \vdots & \ddots & \vdots \\ \lambda_1 b_{m_1+1} & \dots & \lambda_1 b_{m_1+1,m_1} & \lambda_2 b_{m_1+1,m_1+1} & \dots & \lambda_2 b_{m_1+1,m_1+m_2} & \dots & \lambda_k b_{m_1+1,n} \\ \lambda_1 b_{m_1+1,1} & \dots & \lambda_1 b_{m_1+1,m_1} & \lambda_2 b_{m_1+1,m_1+1} & \dots & \lambda_2 b_{m_1+1,m_1+m_2} & \dots & \lambda_k b_{m_1+1,n} \\ \vdots & \ddots & \vdots & \vdots & \ddots & \vdots & \ddots & \vdots \\ \lambda_1 b_{m_1+m_2,1} & \dots & \lambda_1 b_{m_1+m_2,m_1} & \lambda_2 b_{m_1+m_2,m_1+1} & \dots & \lambda_2 b_{m_1+m_2,m_1+m_2} & \dots & \lambda_k b_{m_1+m_2,n} \\ \vdots & \ddots & \vdots & \vdots & \ddots & \vdots & \ddots & \vdots \\ \lambda_1 b_{n1} & \dots & \lambda_1 b_{nm_1} & \lambda_2 b_{n,m_1+1} & \dots & \lambda_2 b_{n,m_1+m_2} & \dots & \lambda_k b_{nn} \end{pmatrix}.$$

Осталось приравнять элементы на соответствующих местах. Взглянем на левые верхние подматрицы $m_1 \times m_1$. Они совпадают у обеих матриц. Затем взглянем на подматрицу $M_{j=m_1+1, \dots, m_1+m_2}^{i=m_1+1, \dots, m_1+m_2}$.

Они тоже совпадают! И так далее. Причём, как нетрудно увидеть, совпадают в этих матрицах только эти блоки. Получили то, что хотели. ■

Лемма 3. С жордановыми клетками коммутируют только многочлены от них².

Доказательство. Давайте проверим. Пусть $J_\lambda = \begin{pmatrix} \lambda & 1 & & \\ & \lambda & \ddots & \\ & & \ddots & 1 \\ & & & \lambda \end{pmatrix}$ коммутирует с матрицей $B = (b_{ij}^i)$. Перемножим их с обеих сторон:

$$\begin{pmatrix} \lambda & 1 & & \\ & \lambda & \ddots & \\ & & \ddots & 1 \\ & & & \lambda \end{pmatrix} \cdot \begin{pmatrix} b_{11} & b_{12} & \dots & b_{1n} \\ b_{21} & b_{22} & \dots & b_{2n} \\ \vdots & \vdots & \ddots & \vdots \\ b_{n1} & b_{n2} & \dots & b_{nn} \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} \lambda b_{11} + b_{21} & \lambda b_{12} + b_{22} & \dots & \lambda b_{1n} + b_{2n} \\ \lambda b_{21} + b_{31} & \lambda b_{22} + b_{32} & \dots & \lambda b_{2n} + b_{3n} \\ \vdots & \vdots & \ddots & \vdots \\ \lambda b_{n-1,1} + b_{n1} & \lambda b_{n-1,2} + b_{n2} & \dots & \lambda b_{n-1,n} + b_{nn} \\ \lambda b_{n1} & \lambda b_{n2} & \dots & \lambda b_{nn} \end{pmatrix}$$

$$\begin{pmatrix} b_{11} & b_{12} & \dots & b_{1n} \\ b_{21} & b_{22} & \dots & b_{2n} \\ \vdots & \vdots & \ddots & \vdots \\ b_{n1} & b_{n2} & \dots & b_{nn} \end{pmatrix} \cdot \begin{pmatrix} \lambda & 1 & & \\ & \lambda & \ddots & \\ & & \ddots & 1 \\ & & & \lambda \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} \lambda b_{11} & b_{11} + \lambda b_{12} & \dots & b_{1,n-1} + \lambda b_{1n} \\ \lambda b_{21} & b_{21} + \lambda b_{22} & \dots & b_{2,n-1} + \lambda b_{2n} \\ \vdots & \vdots & \ddots & \vdots \\ \lambda b_{n1} & b_{n1} + \lambda b_{n2} & \dots & b_{n,n-1} + \lambda b_{nn} \end{pmatrix}.$$

Теперь приравняем соответствующие элементы получившихся матриц. Из первого столбца, $b_{i1} = 0$, $i = 2, \dots, n$. Теперь, из второго столбца, $b_{i2} = 0$, $i = 3, \dots, n$. И так далее. Получаем, что матрица B верхнетреугольная. Но это не всё, что можно про неё сказать. Приравняем клетки с координатами $(1, 2)$, получим $b_{11} + \lambda b_{12} = \lambda b_{12} + b_{22} \Rightarrow b_{11} = b_{22}$. Теперь, приравняв клетки с координатами $(2, 3)$, аналогично получим $b_{22} = b_{33}$. И так далее. Получаем, что $b_{11} = \dots = b_{nn}$. Это мы приравняли диагональ на одну выше главной. Потом приравниваем диагонали ещё на одну выше, и ещё, и т. д. Получаем, что матрица B имеет вид:

$$B = \begin{pmatrix} b_0 & b_1 & \ddots & b_{n-2} & b_{n-1} \\ & b_0 & b_1 & \ddots & b_{n-2} \\ & & b_0 & \ddots & \ddots \\ & & & \ddots & b_1 \\ & & & & b_0 \end{pmatrix}.$$

Или же, $B = b_0 + b_1 N + b_2 N^2 + \dots + b_{n-1} N^{n-1}$, где $N = J_\lambda - \lambda E$ — нильпотентный оператор. А т. к. B — многочлен от $J_\lambda - \lambda E$, то это и многочлен от J_λ (подставить, раскрыть скобки). ■

Перейдём, наконец, к решению задачи.

▷ ⇐. Пусть $\chi_A(t) = \mu_A(t)$ и $BA = AB$. По лемме 1, диагональ A — это некоторый многочлен от A , поэтому B коммутирует и с диагональю A . А значит, по лемме 2, матрица B имеет блочно-диагональный вид с блоками, равными по размерам жордановым клеткам матрицы A . Коммутирование такой матрицы с жордановой матрицей A равносильно коммутированию соответствующих блоков матрицы B с жордановыми клетками A . Значит, матрица B имеет вид

$$B = \begin{pmatrix} g_1(J_1) & & \\ & \ddots & \\ & & g_m(J_m) \end{pmatrix},$$

²Имеется в виду «они и только они». Однако то, что матрица коммутирует с многочленами от себя, очевидно. Нам интересен именно тот случай, когда других коммутирующих нет.

где g_i — многочлены (по лемме 3). Осталось из этих многочленов, которые жордановы клетки A переводит в блоки B собрать единый многочлен f , который всю матрицу A переведёт во всю матрицу B . Для каждого i положим $p_i(t) = \prod_{j \neq i} (t - \lambda_j)^{m_j}$. Т. к. все λ_i различны, $\text{НОД}(p_i, (x - \lambda_i)^{m_i}) = 1$. Поэтому существуют такие многочлены a_i и b_i , что $a_i(t)p_i(t) + b_i(t)(t - \lambda_i)^{m_i} = 1$. Отсюда $(a_i p_i)(J_j)$ равняется $E_{m_i \times m_i}$ при $j = i$ и 0 при $j \neq i$. Отсюда

$$(a_i p_i g_i)(A) = \begin{pmatrix} (a_i p_i g_i)(J_1) & & \\ & \ddots & \\ & & (a_i p_i g_i)(J_m) \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 0 & & \\ & E \cdot g_i(J_i) & \\ & & 0 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 0 & & \\ & g_i(J_i) & \\ & & 0 \end{pmatrix}$$

где $g_i(J_i)$ стоит на месте i -го блока. Наконец, $B = \sum_{i=1}^r (a_i p_i g_i)(A)$.

\Rightarrow . Пусть у матрицы A характеристический многочлен не равен минимальному. Тогда у неё какому-то собственному значению λ соответствуют (хотя бы) две клетки. Понятно, что без ограничения общности можно рассматривать случай $J = \begin{pmatrix} J_1 & \\ & J_2 \end{pmatrix}$, где J — жорданова форма матрицы A , а J_1 и J_2 — жордановы клетки размера m_1 и m_2 соответственно с собственным значением λ на диагонали. Пусть $J = P^{-1}AP$ и $D = \text{diag}(\underbrace{1, \dots, 1}_{m_1}, \underbrace{0, \dots, 0}_{m_2})$. Тогда

$$PDP^{-1} \cdot A = PDJP^{-1}, \quad A \cdot PDP^{-1} = PJDP^{-1}.$$

А по лемме 2 матрицы J и D коммутируют, т. е. $DJ = JD$. Отсюда $PDP^{-1} \cdot A = A \cdot PDP^{-1}$, т. е. A и PDP^{-1} коммутируют. Предположим, что $PDP^{-1} = f(A)$, где f — многочлен. Тогда

$$\begin{pmatrix} 1 & & & & \\ & \ddots & & & \\ & & 1 & & \\ & & & & 0 \end{pmatrix} = D = P^{-1}f(A)P = f(P^{-1}AP) = f(J).$$

Теперь воспользуемся результатом задачи 1202 из «Сборника задач по аналитической геометрии и линейной алгебре» под ред. Смирнова. Утверждение этой задачи заключается в том, что

$$f(J_i) = \begin{pmatrix} f(\lambda) & \frac{f'(\lambda)}{1!} & \frac{f''(\lambda)}{2!} & \frac{f'''(\lambda)}{3!} & \dots & \frac{f^{(n-1)}(\lambda)}{(n-1)!} \\ 0 & f(\lambda) & \frac{f'(\lambda)}{1!} & \frac{f''(\lambda)}{2!} & \dots & \frac{f^{(n-2)}(\lambda)}{(n-2)!} \\ \vdots & \vdots & \vdots & \vdots & \vdots & \vdots \\ 0 & 0 & 0 & 0 & \dots & f(\lambda) \end{pmatrix}.$$

А т. к. на диагоналях J_1 и J_2 собственные значения одинаковые, то на диагонали матрицы $f(J) = \begin{pmatrix} f(J_1) & \\ & f(J_2) \end{pmatrix}$ должны стоять одинаковые числа, а для D это условие не выполняется. \blacktriangleleft