

行列輪講: 第 2 回 行列式, トレース

杉浦 圭祐

慶應義塾大学理工学部情報工学科 松谷研究室

August 12, 2023

目次

① 概要

② 行列式

③ トレース

目次

① 概要

② 行列式

③ トレース

このスライドの概要

- 行列式, トレースについて確認する
 - 行列式に関する公式 (転置, 行列積, 逆行列, 固有値, ブロック行列)
 - 行列式と余因子展開
 - トレースに関する公式

目次

① 概要

② 行列式

③ トレース

行列式 (Determinant)

- 行列式は, 行列の大きさのようなもの
- $\{1, 2, \dots, n\}$ を適当に入れ替えて, $\{\sigma(1), \sigma(2), \dots, \sigma(n)\}$ を作る.
- このような置換 σ は, 全部で $n!$ 通りあって, まとめて S_n で表す.

$$S_3 = \{\{1, 2, 3\} \rightarrow \{1, 2, 3\}, \{1, 2, 3\} \rightarrow \{1, 3, 2\}, \{1, 2, 3\} \rightarrow \{2, 1, 3\}, \\ \{1, 2, 3\} \rightarrow \{2, 3, 1\}, \{1, 2, 3\} \rightarrow \{3, 1, 2\}, \{1, 2, 3\} \rightarrow \{3, 2, 1\}\}$$

- $\{\sigma(1), \sigma(2), \dots, \sigma(n)\}$ は, 何度か入れ替えれば, 元の $\{1, 2, \dots, n\}$ に戻せる. 入れ替える回数の偶奇は, 一意に定まる.
- 即ち, σ に対して, 以下の $\text{sgn}(\sigma)$ は一意に定まる.

$$\text{sgn}(\sigma) = \begin{cases} 1 & \text{偶数回の入れ替えで元に戻る} \\ 0 & \text{奇数回の入れ替えで元に戻る} \end{cases}$$

行列式 (Determinant)

- $\sigma = \{1, 2, 3\} \rightarrow \{2, 3, 1\}$ とすると, $\text{sgn}(\sigma) = 1$.
 - $\{2, 3, 1\} \rightarrow \{2, 1, 3\} \rightarrow \{1, 2, 3\}$.
- $\sigma = \{1, 2, 3\} \rightarrow \{3, 2, 1\}$ とすると, $\text{sgn}(\sigma) = -1$.
 - $\{3, 2, 1\} \rightarrow \{2, 3, 1\} \rightarrow \{2, 1, 3\} \rightarrow \{1, 2, 3\}$.
- \mathbf{A} を n 次正方行列とする.
- S_n と σ を使って, \mathbf{A} の行列式は次のようにかける.

$$\det(\mathbf{A}) = \sum_{\sigma \in S_n} \text{sgn}(\sigma) a_{1\sigma(1)} a_{2\sigma(2)} \cdots a_{n\sigma(n)}$$

- $n = 2$ とすると, $S_n = \{\{1, 2\}, \{2, 1\}\}$, $\text{sgn} = (1, -1)$.
- $\det(\mathbf{A}) = a_{11}a_{22} - a_{12}a_{21}$.
- 全部で, $n!$ 個の項が現れる.

3 次行列の行列式

- \mathbf{A} を n 次正方行列とする.
- S_n と σ を使って, \mathbf{A} の行列式は次のようにかける.

$$\det(\mathbf{A}) = \sum_{\sigma \in S_n} \operatorname{sgn}(\sigma) a_{1\sigma(1)} a_{2\sigma(2)} \cdots a_{n\sigma(n)}$$

- $n = 3$ とすると,

$$S_3 = \{\{1, 2, 3\}, \{1, 3, 2\}, \{2, 1, 3\}, \{2, 3, 1\}, \{3, 1, 2\}, \{3, 2, 1\}\}$$

$$\operatorname{sgn} = (1, -1, -1, 1, 1, -1)$$

$$\begin{aligned} \det(\mathbf{A}) = & a_{11} (a_{22}a_{33} - a_{23}a_{32}) + a_{12} (a_{23}a_{31} - a_{21}a_{33}) \\ & + a_{13} (a_{21}a_{32} - a_{22}a_{31}) \end{aligned}$$

- これはサラスの公式とよばれる.

置換に関する性質

- 置換は全単射 (1 対 1 で対応する).
- 置換 σ の逆写像を, σ^{-1} とかく.

$$\sigma = \{1, 2, 3\} \rightarrow \{3, 1, 2\}, \sigma^{-1} = \{1, 2, 3\} \rightarrow \{2, 3, 1\}$$

- 以下の 6 つの置換 $\sigma_1, \dots, \sigma_6$ は, 同じものを指すことに注意.

$$\sigma_1 = \{1, 2, 3\} \rightarrow \{2, 3, 1\}, \sigma_2 = \{1, 3, 2\} \rightarrow \{2, 1, 3\}$$

$$\sigma_3 = \{2, 1, 3\} \rightarrow \{3, 2, 1\}, \sigma_4 = \{2, 3, 1\} \rightarrow \{3, 1, 2\},$$

$$\sigma_5 = \{3, 1, 2\} \rightarrow \{1, 2, 3\}, \sigma_6 = \{3, 2, 1\} \rightarrow \{1, 3, 2\}$$

- 2 つの置換の合成 $\tau \circ \sigma$ も, 新たな置換となる.

$$\sigma = \{1, 2, 3\} \rightarrow \{3, 1, 2\}, \tau = \{1, 2, 3\} \rightarrow \{2, 1, 3\}$$

$$\tau \circ \sigma = \{1, 2, 3\} \rightarrow \{3, 2, 1\}$$

置換に関する性質

- 恒等置換を, ι とかく.

$$\iota = \{1, 2, 3\} \rightarrow \{1, 2, 3\}$$

- $\sigma^{-1}\sigma = \sigma\sigma^{-1} = \iota$, $\operatorname{sgn}(\tau\sigma) = \operatorname{sgn}(\tau)\operatorname{sgn}(\sigma)$
- $\operatorname{sgn}(\iota) = 1$, $\operatorname{sgn}(\sigma^{-1}) = \operatorname{sgn}(\sigma)$
- $\mathbf{A} = (a_{ij})$ を行列, σ を置換としたとき,

$$a_{\sigma^{-1}(1)1}a_{\sigma^{-1}(2)2} \cdots a_{\sigma^{-1}(n)n} = a_{1\sigma(1)}a_{2\sigma(2)} \cdots a_{n\sigma(n)}$$

- $\sigma = \{1, 2, 3\} \rightarrow \{2, 3, 1\}$ とする. $\sigma^{-1} = \{2, 3, 1\} \rightarrow \{1, 2, 3\}$ となる.

$$\begin{aligned} a_{\sigma^{-1}(1)1}a_{\sigma^{-1}(2)2}a_{\sigma^{-1}(3)3} &= a_{31}a_{12}a_{23} = a_{12}a_{23}a_{31} \\ &= a_{1\sigma(1)}a_{2\sigma(2)}a_{3\sigma(3)} \end{aligned}$$

転置の行列式

$$\det(\mathbf{A}^\top) = \det(\mathbf{A})$$

- 行列式の定義から,

$$\begin{aligned}\det(\mathbf{A}) &= \sum_{\sigma \in S_n} \operatorname{sgn}(\sigma) a_{1\sigma(1)} a_{2\sigma(2)} \cdots a_{n\sigma(n)} \\ \det(\mathbf{A}^\top) &= \sum_{\tau \in S_n} \operatorname{sgn}(\tau) (\mathbf{A}^\top)_{1\tau(1)} (\mathbf{A}^\top)_{2\tau(2)} \cdots (\mathbf{A}^\top)_{n\tau(n)} \\ &= \sum_{\tau \in S_n} \operatorname{sgn}(\tau) a_{\tau(1)1} a_{\tau(2)2} \cdots a_{\tau(n)n}\end{aligned}$$

転置の行列式

- 行列式の定義から,

$$\det(\mathbf{A}) = \sum_{\sigma \in S_n} \operatorname{sgn}(\sigma) a_{1\sigma(1)} a_{2\sigma(2)} \cdots a_{n\sigma(n)}$$

$$\det(\mathbf{A}^\top) = \sum_{\tau \in S_n} \operatorname{sgn}(\tau) a_{\tau(1)1} a_{\tau(2)2} \cdots a_{\tau(n)n}$$

- σ^{-1} について総和を取ることは, σ について総和を取ることに同じだから, $\tau = \sigma^{-1}$ とする.
- $\tau = \sigma^{-1}$ とおくと, $\operatorname{sgn}(\tau) = \operatorname{sgn}(\sigma^{-1}) = \operatorname{sgn}(\sigma)$ であり, 以下が成り立つので, $\det(\mathbf{A}) = \det(\mathbf{A}^\top)$.

$$\begin{aligned} a_{\tau(1)1} a_{\tau(2)2} \cdots a_{\tau(n)n} &= a_{\sigma^{-1}(1)1} a_{\sigma^{-1}(2)2} \cdots a_{\sigma^{-1}(n)n} \\ &= a_{1\sigma(1)} a_{2\sigma(2)} \cdots a_{n\sigma(n)} \end{aligned}$$

対角行列の行列式

対角行列の行列式

n 次の対角行列があるとする. 行列式は, 対角成分 $\lambda_1, \dots, \lambda_n$ の積となる.

$$\det \begin{pmatrix} \lambda_1 & & \\ & \lambda_2 & \\ & & \ddots \\ & & & \lambda_n \end{pmatrix} = \prod_i \lambda_i$$

上三角行列, 下三角行列の行列式

上三角行列, 下三角行列の行列式

$n \times n$ の上三角, 下三角行列があるとする. 行列式は, 対角成分 $\lambda_1, \dots, \lambda_n$ の積となる.

$$\det \begin{pmatrix} \begin{pmatrix} \lambda_1 & * & \cdots & * \\ & \lambda_2 & \ddots & \vdots \\ & & \ddots & * \\ & & & \lambda_n \end{pmatrix} \end{pmatrix} = \prod_i \lambda_i$$
$$\det \begin{pmatrix} \begin{pmatrix} \lambda_1 & & & \\ * & \lambda_2 & & \\ \vdots & \ddots & \ddots & \\ * & \cdots & * & \lambda_n \end{pmatrix} \end{pmatrix} = \prod_i \lambda_i$$

上三角行列, 下三角行列の逆行列の行列式

上三角行列, 下三角行列の逆行列の行列式

元の対角成分の逆数 $\lambda_1^{-1}, \dots, \lambda_n^{-1}$ の積となる.

$$\det \left(\begin{pmatrix} \lambda_1 & * & \cdots & * \\ & \lambda_2 & \ddots & \vdots \\ & & \ddots & * \\ & & & \lambda_n \end{pmatrix}^{-1} \right) = \prod_i \lambda_i^{-1}$$

$$\det \left(\begin{pmatrix} \lambda_1 & & & \\ * & \lambda_2 & & \\ \vdots & \ddots & \ddots & \\ * & \cdots & * & \lambda_n \end{pmatrix}^{-1} \right) = \prod_i \lambda_i^{-1}$$

列の線形変換, 列の入れ替え, 行列のスカラー倍

列の線形変換, 列の入れ替え

列を入れ替えると, 行列式の符号が反転する.

$$\begin{aligned}\det\left(\left(\mathbf{a}_1, \dots, \lambda\mathbf{a}_i + \mu\mathbf{b}_i, \dots, \mathbf{a}_n\right)\right) &= \lambda \det\left(\left(\mathbf{a}_1, \dots, \mathbf{a}_i, \dots, \mathbf{a}_n\right)\right) \\ &\quad + \mu \det\left(\left(\mathbf{a}_1, \dots, \mathbf{b}_i, \dots, \mathbf{a}_n\right)\right) \\ \det\left(\left(\mathbf{a}_1, \dots, \mathbf{a}_i, \dots, \mathbf{a}_j, \dots, \mathbf{a}_n\right)\right) &= -\det\left(\left(\mathbf{a}_1, \dots, \mathbf{a}_j, \dots, \mathbf{a}_i, \dots, \mathbf{a}_n\right)\right)\end{aligned}$$

行列のスカラー倍

行列を c 倍すると, 行列式は c^n 倍になる.

$$\det(c\mathbf{A}) = c^n \det(\mathbf{A})$$

- $\det(\mathbf{A}^\top) = \det(\mathbf{A})$ であるから, 列だけでなく, 行についても同様のことがいえる.

列の線形変換, 列のスカラー倍

同じ列を含むとき

同じ列ベクトルを 2 箇所に含むとき, 行列式は 0 となる.

$$\det\left(\left(\mathbf{a}_1, \dots, \mathbf{a}_i, \dots, \mathbf{a}_i, \dots, \mathbf{a}_n\right)\right) = 0$$

列のスカラー倍

列を c 倍すると, 行列式は c 倍になる.

$$\det\left(\left(\mathbf{a}_1, \dots, c\mathbf{a}_i, \dots, \mathbf{a}_n\right)\right) = c \det\left(\left(\mathbf{a}_1, \dots, \mathbf{a}_i, \dots, \mathbf{a}_n\right)\right)$$

i 列目に, j 列目の c 倍を足しても ($i \neq j$), 行列式は変わらない.

$$\det\left(\left(\mathbf{a}_1, \dots, \mathbf{a}_i + c\mathbf{a}_j, \dots, \mathbf{a}_j, \dots, \mathbf{a}_n\right)\right) = \det\left(\left(\mathbf{a}_1, \dots, \mathbf{a}_i, \dots, \mathbf{a}_j, \dots, \mathbf{a}_n\right)\right)$$

- $\det(\mathbf{A}^\top) = \det(\mathbf{A})$ であるから, 列だけでなく, 行についても同様のことがいえる.

行列積, 行列の累乗, 逆行列

行列積, 行列の累乗の行列式

$$\det(\mathbf{AB}) = \det(\mathbf{A}) \det(\mathbf{B})$$

$$\det(\mathbf{A}^n) = \det(\mathbf{A})^n$$

逆行列の行列式

$$\det(\mathbf{A}^{-1}) = \frac{1}{\det(\mathbf{A})}$$

- 以下の2つの式から分かる.

$$\det(\mathbf{AA}^{-1}) = \det(\mathbf{A}) \det(\mathbf{A}^{-1})$$

$$\det(\mathbf{AA}^{-1}) = \det(\mathbf{I}) = 1$$

固有値と固有ベクトル

- A を, n 次正方行列とする.
- 以下を満たすような λ を, A の固有値という.
- また x を, 固有値 λ に対する固有ベクトルという.

$$Ax = \lambda x$$

- 上式は, $\det(\lambda I - A) = 0$ と同値である (詳細は省略).
- $\det(\lambda I - A) = 0$ の左辺を展開すれば, λ に関する n 次式となる:

$$(\lambda - \lambda_1)(\lambda - \lambda_2) \cdots (\lambda - \lambda_n) = 0$$

- 上式は, 固有多項式という. 重複を許せば, 固有値は n 個ある.
- A が正則であれば (逆行列があれば), $\lambda_i \neq 0$.

固有値と固有ベクトル

- A の逆行列の固有値は, A の固有値の逆数 $\lambda_1^{-1}, \dots, \lambda_n^{-1}$ である.
- また, A の逆行列は, A と共通の固有ベクトルをもつ.
- A の固有値は以下を満たす.

$$A\mathbf{x} = \lambda\mathbf{x}$$

- これを式変形すればよい (A は正則なので, $\lambda \neq 0$).

$$\mathbf{x} = \lambda A^{-1}\mathbf{x} \quad \rightarrow \quad \lambda^{-1}\mathbf{x} = A^{-1}\mathbf{x}$$

固有値と行列式

\mathbf{A} を, n 次正方行列とする. \mathbf{A} の固有値 $\lambda_1, \dots, \lambda_n$ の積は, \mathbf{A} の行列式となる.

$$\det(\mathbf{A}) = \prod_{i=1}^n \lambda_i$$

- 以下の固有多項式について, $\lambda = 0$ とする.

$$\det(\lambda \mathbf{I} - \mathbf{A}) = (\lambda - \lambda_1)(\lambda - \lambda_2) \cdots (\lambda - \lambda_n)$$

- 左辺は, $\det(-\mathbf{A}) = (-1)^n \det(\mathbf{A})$.
- 右辺は, $\prod_i (-\lambda_i) = (-1)^n \prod_i \lambda_i$.

固有値と行列式

\mathbf{A} を, n 次正方行列とする. \mathbf{A} の固有値の逆数 $\lambda_1^{-1}, \dots, \lambda_n^{-1}$ の積は, \mathbf{A}^{-1} の行列式となる.

$$\det(\mathbf{A}^{-1}) = \prod_{i=1}^n \lambda_i^{-1}$$

- $\det(\mathbf{A}^{-1}) = \det(\mathbf{A})^{-1}$ と, $\det(\mathbf{A}) = \prod_i \lambda_i$ から分かる.

ブロック上三角行列, 下三角行列の行列式

ブロック上三角行列, 下三角行列の行列式

$$\det \left(\begin{pmatrix} \mathbf{I} & \mathbf{X} \\ \mathbf{0} & \mathbf{I} \end{pmatrix} \right) = 1, \quad \det \left(\begin{pmatrix} \mathbf{I} & \mathbf{0} \\ \mathbf{X} & \mathbf{I} \end{pmatrix} \right) = 1$$

$$\det \left(\begin{pmatrix} \mathbf{A} & \mathbf{B} \\ \mathbf{0} & \mathbf{D} \end{pmatrix} \right) = \det(\mathbf{A}) \det(\mathbf{D})$$

$$\det \left(\begin{pmatrix} \mathbf{A} & \mathbf{0} \\ \mathbf{C} & \mathbf{D} \end{pmatrix} \right) = \det(\mathbf{A}) \det(\mathbf{D})$$

$$\det \left(\begin{pmatrix} \mathbf{A} & \mathbf{B} \\ \mathbf{B} & \mathbf{A} \end{pmatrix} \right) = \det(\mathbf{A} + \mathbf{B}) \det(\mathbf{A} - \mathbf{B})$$

- 証明は省略.

ブロック対角行列の行列式

ブロック対角行列の行列式

$$\det \left(\begin{pmatrix} \mathbf{A}_1 & & \\ & \mathbf{A}_2 & \\ & & \ddots \\ & & & \mathbf{A}_n \end{pmatrix} \right) = \det(\mathbf{A}_1) \det(\mathbf{A}_2) \cdots \det(\mathbf{A}_n)$$

$$\det \left(\begin{pmatrix} \mathbf{A}_1 & & \\ & \mathbf{A}_2 & \\ & & \ddots \\ & & & \mathbf{A}_n \end{pmatrix}^{-1} \right) = \det(\mathbf{A}_1)^{-1} \det(\mathbf{A}_2)^{-1} \cdots \det(\mathbf{A}_n)^{-1}$$

ブロック行列の行列式

ブロック行列の行列式

$$\det \left(\begin{pmatrix} \mathbf{A} & \mathbf{B} \\ \mathbf{C} & \mathbf{D} \end{pmatrix} \right) = \det(\mathbf{A}) \det(\mathbf{D} - \mathbf{C}\mathbf{A}^{-1}\mathbf{B}) \quad \mathbf{A} \text{ が正則}$$

$$\det \left(\begin{pmatrix} \mathbf{A} & \mathbf{B} \\ \mathbf{C} & \mathbf{D} \end{pmatrix} \right) = \det(\mathbf{D}) \det(\mathbf{A} - \mathbf{B}\mathbf{D}^{-1}\mathbf{C}) \quad \mathbf{D} \text{ が正則}$$

- シューア補行列による表現から導出できる (上側).

$$\begin{pmatrix} \mathbf{A} & \mathbf{B} \\ \mathbf{C} & \mathbf{D} \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} \mathbf{I} & \mathbf{0} \\ \mathbf{C}\mathbf{A}^{-1} & \mathbf{I} \end{pmatrix} \begin{pmatrix} \mathbf{A} & \mathbf{0} \\ \mathbf{0} & \mathbf{D} - \mathbf{C}\mathbf{A}^{-1}\mathbf{B} \end{pmatrix} \begin{pmatrix} \mathbf{I} & \mathbf{A}^{-1}\mathbf{B} \\ \mathbf{0} & \mathbf{I} \end{pmatrix}$$

- 3つの行列の行列式の積を求める.
- 最初と最後の行列の行列式は1である.

ブロック行列の行列式

Weinstein-Aronszajn Identity

\mathbf{A} を $m \times n$, \mathbf{B} を $n \times m$ の行列とする.

$$\det(\mathbf{I}_m + \mathbf{A}\mathbf{B}) = \det(\mathbf{I}_n + \mathbf{B}\mathbf{A})$$

\mathbf{a}, \mathbf{b} が m 次ベクトルであるとき,

$$\det(\mathbf{I}_m + \mathbf{a}\mathbf{b}^\top) = 1 + \mathbf{b}^\top \mathbf{a}$$

- 先ほどの式において ($\mathbf{I}_m, \mathbf{I}_n$ は正則であるので),

$$\det \left(\begin{pmatrix} \mathbf{I}_m & -\mathbf{A} \\ \mathbf{B} & \mathbf{I}_n \end{pmatrix} \right) = (\text{自分で導出してみましょう})$$

余因子展開

余因子展開

\mathbf{A} を, n 次正方行列とする. 各 i 行目と j 列目について,

$$\det(\mathbf{A}) = a_{i1}\Delta_{i1} + a_{i2}\Delta_{i2} + \cdots + a_{in}\Delta_{in} = \sum_j a_{ij}\Delta_{ij}$$

$$\det(\mathbf{A}) = a_{1j}\Delta_{1j} + a_{2j}\Delta_{2j} + \cdots + a_{nj}\Delta_{nj} = \sum_i a_{ij}\Delta_{ij}$$

- 上式の Δ_{ij} は, \mathbf{A} の (i, j) 余因子 (Cofactor) とよぶ.

$$\Delta_{ij} = (-1)^{i+j} \det(\tilde{\mathbf{A}}_{ij})$$

- $\tilde{\mathbf{A}}_{ij}$ は, \mathbf{A} から i 行目と j 列目を取り除いた, $n-1$ 次行列である.
- Δ_{ij} は, i 行目と j 行目の成分には依存しない.

余因子展開

余因子展開

\mathbf{A} を, n 次正方行列とする. Δ_{ij} を \mathbf{A} の (i, j) 余因子とする.

$$a_{i1}\Delta_{k1} + a_{i2}\Delta_{k2} + \cdots + a_{in}\Delta_{kn} = \begin{cases} \det(\mathbf{A}) & i = k \\ 0 & \text{Otherwise} \end{cases}$$

$$a_{1j}\Delta_{1k} + a_{2j}\Delta_{2k} + \cdots + a_{nj}\Delta_{nk} = \begin{cases} \det(\mathbf{A}) & j = k \\ 0 & \text{Otherwise} \end{cases}$$

余因子行列

余因子行列

\mathbf{A} を, n 次行列とする. \mathbf{A} の (i, j) 余因子 Δ_{ij} を並べた行列 $\text{adj } \mathbf{A}$ を, \mathbf{A} の余因子行列という.

$$\text{adj } \mathbf{A} = \begin{pmatrix} \Delta_{11} & \Delta_{21} & \cdots & \Delta_{n1} \\ \Delta_{12} & \Delta_{22} & \cdots & \Delta_{n2} \\ \vdots & \vdots & \ddots & \vdots \\ \Delta_{1n} & \Delta_{2n} & \cdots & \Delta_{nn} \end{pmatrix}$$

- $\text{adj } \mathbf{A}$ の (i, j) 成分は, (j, i) 余因子 Δ_{ji} となる.

余因子行列, 行列式, 逆行列

余因子行列, 行列式, 逆行列

\mathbf{A} の余因子行列 $\text{adj } \mathbf{A}$, 行列式 $\det(\mathbf{A})$, 逆行列 \mathbf{A}^{-1} について,

$$(\text{adj } \mathbf{A}) \mathbf{A} = \mathbf{A} (\text{adj } \mathbf{A}) = (\det(\mathbf{A})) \mathbf{I}$$

$$\mathbf{A}^{-1} = \frac{1}{\det(\mathbf{A})} \text{adj } \mathbf{A}$$

目次

① 概要

② 行列式

③ トレース

行列のトレース

- \mathbf{A} を, n 次正方行列とする.
- \mathbf{A} の対角成分 a_{ii} の和を, \mathbf{A} のトレースとよぶ.
- トレースを, $\text{tr}(\mathbf{A})$ とかく.

$$\text{tr}(\mathbf{A}) = \sum_i a_{ii}$$

- 歪対称行列 ($\mathbf{A}^\top = -\mathbf{A}$) の対角成分は 0 なので, トレースは 0.
- 単位行列 \mathbf{I}_n のトレースは n .

行列の和, 転置とトレース

$$\mathrm{tr}(\mathbf{A} + \mathbf{B}) = \mathrm{tr}(\mathbf{A}) + \mathrm{tr}(\mathbf{B})$$

$$\mathrm{tr}(\mathbf{A}^\top) = \mathrm{tr}(\mathbf{A})$$

- トレースの定義から, 以下のように確認できる.

$$\begin{aligned}\mathrm{tr}(\mathbf{A} + \mathbf{B}) &= \sum_i (\mathbf{A} + \mathbf{B})_{ii} = \sum_i (a_{ii} + b_{ii}) = \sum_i a_{ii} + \sum_i b_{ii} \\ &= \mathrm{tr}(\mathbf{A}) + \mathrm{tr}(\mathbf{B})\end{aligned}$$

$$\mathrm{tr}(\mathbf{A}^\top) = \sum_i (\mathbf{A}^\top)_{ii} = \sum_i a_{ii} = \mathrm{tr}(\mathbf{A})$$

行列の積とトレース

$$\mathrm{tr}(\mathbf{AB}) = \mathrm{tr}(\mathbf{BA})$$

- トレースの定義から, 以下のように確認できる.

$$\mathrm{tr}(\mathbf{AB}) = \sum_i (\mathbf{AB})_{ii} = (\text{自分で導出してみましょう})$$

トレースの循環性

トレースの循環性

$$\mathrm{tr}(\mathbf{ABC}) = \mathrm{tr}(\mathbf{BCA}) = \mathrm{tr}(\mathbf{CAB})$$

$$\mathrm{tr}(\mathbf{X}^{-1}\mathbf{AX}) = \mathrm{tr}(\mathbf{A})$$

- トレースの定義から、以下のように確認できる.

$$\mathrm{tr}(\mathbf{ABC}) = \sum_i (\mathbf{ABC})_{ii} = (\text{自分で導出してみましょう})$$

- たらい回しのような公式である.

行列, ベクトル積とトレース

行列, ベクトル積とトレース

A を, n 次正方行列, b, c を n 次ベクトルとする.

$$\mathrm{tr}(Abc^{\top}) = c^{\top}Ab$$

$$\mathrm{tr}(bc^{\top}) = c^{\top}b$$

- b, c がベクトルで, 上のような形であれば, 順序を入れ替えることでトレース tr を除去できる.

固有値とトレース

固有値とトレース

\mathbf{A} を, n 次正方行列とする. \mathbf{A} の固有値 $\lambda_1, \dots, \lambda_n$ の和は, \mathbf{A} のトレースとなる.

$$\mathrm{tr}(\mathbf{A}) = \sum_i \lambda_i$$

- 以下の固有多項式について, λ^{n-1} の係数を考える.

$$\det(\lambda \mathbf{I} - \mathbf{A}) = (\lambda - \lambda_1)(\lambda - \lambda_2) \cdots (\lambda - \lambda_n)$$

- 左辺は, $-\mathrm{tr}(\mathbf{A})$.
 - $\det(\lambda \mathbf{I} - \mathbf{A})$ には, $(\lambda - a_{11})(\lambda - a_{22}) \cdots (\lambda - a_{nn})$ という項が現れる.
 - λ^{n-1} の係数は, $-(a_{11} + a_{22} + \cdots + a_{nn})$ となる.
- 右辺は, $-\sum_i \lambda_i$.

逆行列とトレース

逆行列とトレース

\mathbf{A} を, n 次正方行列とする. \mathbf{A} の逆行列のトレースは, \mathbf{A} の固有値 $\lambda_1, \dots, \lambda_n$ の逆数の和となる.

$$\mathrm{tr}(\mathbf{A}^{-1}) = \sum_i \lambda_i^{-1}$$

- \mathbf{A} は, ユニタリ行列 \mathbf{P} により, $\mathbf{P}^{-1}\mathbf{A}\mathbf{P}$ と三角化できる (後述).
- $\mathbf{P}^{-1}\mathbf{A}\mathbf{P}$ の対角成分は, \mathbf{A} の固有値 $\lambda_1, \dots, \lambda_n$ である.
- $\mathbf{P}^{-1}\mathbf{A}\mathbf{P}$ の逆行列も三角行列で, $\lambda_1^{-1}, \dots, \lambda_n^{-1}$ を対角成分にもつので,

$$\begin{aligned}\mathrm{tr}\left((\mathbf{P}^{-1}\mathbf{A}\mathbf{P})^{-1}\right) &= \sum_i \lambda_i^{-1} \\ &= \mathrm{tr}(\mathbf{P}^{-1}\mathbf{A}^{-1}\mathbf{P}) = \mathrm{tr}(\mathbf{A}^{-1}\mathbf{P}\mathbf{P}^{-1}) = \mathrm{tr}(\mathbf{A}^{-1})\end{aligned}$$

対角行列のトレース

対角行列のトレース

$\mathbf{A} = \text{diag}(a_1, a_2, \dots, a_n)$ を n 次対角行列とする. $\mathbf{A}, \mathbf{A}^{-1}$ のトレースは, 次のようになる.

$$\text{tr}(\mathbf{A}) = \text{tr} \left(\begin{pmatrix} a_1 & & \\ & \ddots & \\ & & a_n \end{pmatrix} \right) = \sum_i a_i$$

$$\text{tr}(\mathbf{A}^{-1}) = \text{tr} \left(\begin{pmatrix} a_1^{-1} & & \\ & \ddots & \\ & & a_n^{-1} \end{pmatrix} \right) = \sum_i a_i^{-1}$$

上三角行列, 下三角行列の逆行列のトレース

上三角行列, 下三角行列の逆行列のトレース

元の対角成分の逆数 $\lambda_1^{-1}, \dots, \lambda_n^{-1}$ の和となる.

$$\text{tr} \left(\begin{pmatrix} \lambda_1 & * & \cdots & * \\ & \lambda_2 & \ddots & \vdots \\ & & \ddots & * \\ & & & \lambda_n \end{pmatrix}^{-1} \right) = \sum_i \lambda_i^{-1}$$

$$\text{tr} \left(\begin{pmatrix} \lambda_1 & & & \\ * & \lambda_2 & & \\ \vdots & \ddots & \ddots & \\ * & \cdots & * & \lambda_n \end{pmatrix}^{-1} \right) = \sum_i \lambda_i^{-1}$$

ブロック行列のトレース

ブロック行列のトレース

$$\mathrm{tr} \left(\begin{pmatrix} \mathbf{A}_1 & * & \cdots & * \\ * & \mathbf{A}_2 & \ddots & \vdots \\ \vdots & \ddots & \ddots & \vdots \\ * & \cdots & * & \mathbf{A}_n \end{pmatrix} \right) = \sum_i \mathrm{tr}(\mathbf{A}_i)$$

固有値, 対角化, 三角化に関するまとめ

- A を, n 次正方行列とする.
- A に n 個の線形独立な固有ベクトルがあれば, それを並べた行列 P で, $P^{-1}AP$ と対角化できる (対角成分は A の固有値).
- 任意の A は, ユニタリ行列 P で, $P^{-1}AP$ と三角化できる (上三角行列, 対角成分は A の固有値).
- A が正規行列 ($AA^H = A^HA$) なら, ユニタリ行列で対角化できる.
 - A^H は, A の共役転置.
 - 正規行列: ユニタリ行列 ($AA^H = I$), エルミート行列 ($A^H = A$), 歪エルミート行列 ($A^H = -A$), 直交行列 ($AA^T = I$), 対称行列 ($A^T = A$), 歪対称行列 ($A^T = -A$).
- A が実対称行列なら, 直交行列で対角化できる.
- エルミート行列と直交行列の固有値は, 全て実数である.