

第二次习题课

胡铁宁

2023 年 4 月 10 日

目录

1 作业与补充题	1
2 预备知识——复数、映射、多项式	6
3 有关行列式与迹的注记	8

1 作业与补充题

作业解答可见群文件, 此讲义仅展示部分与参考解答不同的解答.

习题 1 (第三周习题 1(3)). 在这道题中, 我们得到了方程组

$$\begin{cases} a^3 + 2abc + bcd = 1, \\ b(a^2 + ad + bc + d^2) = 0, \\ c(a^2 + ad + bc + d^2) = 0, \\ abc + 2bcd + d^3 = 1. \end{cases}$$

我们在这里把详细的过程写出来.

解. 若 $a^2 + ad + bc + d^2 \neq 0$, 则容易解得 $A = I$.

若 $a^2 + ad + bc + d^2 = 0$, 则我们把方程组化简为

$$\begin{cases} a^2 + ad + bc + d^2 = 0, \\ a^3 + 2abc + bcd = 1, \\ abc + 2bcd + d^3 = 1. \end{cases} \quad \text{将}$$

上式的后两项相减, 则不难将方程组等价地化为

$$\begin{cases} a^2 + ad + bc + d^2 = 0, \\ a^3 + 2abc + bcd = 1, \\ (a - d)(a^2 + d^2 + ad + bc) = 0, \end{cases} \quad \text{即}$$

$$\begin{cases} a^2 + ad + bc + d^2 = 0, \\ a^3 + 2abc + bcd = 1, \end{cases}$$
 上式中由第一行反解出 bc , 再代入第二行, 则可继续化简为

$$\begin{cases} a^2 + ad + bc + d^2 = 0, \\ (a + d)^3 = -1. \end{cases} \quad \text{注意到上面的转化均等价, 从而容易得到 } \mathbf{A} = \begin{pmatrix} a & b \\ -\frac{a^2+a+1}{b} & -1-a \end{pmatrix}.$$

□

习题 2 (第三周习题 2). 计算方阵 $\mathbf{A} = \begin{pmatrix} 1 & a & 1 & 0 \\ 0 & 1 & 0 & 1 \\ 0 & 0 & 1 & a \\ 0 & 0 & 0 & 1 \end{pmatrix}$ 的 k 次方幂 ($k \geq 1$).

解. 这个方阵的元素含有比较多的 0, 所以我们可以尝试算几项找规律, 猜出答案再进行归纳证明. 我们不难计算得到

$$\mathbf{A}^2 = \begin{pmatrix} 1 & 2a & 2 & 2a \\ 0 & 1 & 0 & 2 \\ 0 & 0 & 1 & 2a \\ 0 & 0 & 0 & 1 \end{pmatrix}, \quad \mathbf{A}^3 = \begin{pmatrix} 1 & 3a & 3 & 6a \\ 0 & 1 & 0 & 3 \\ 0 & 0 & 1 & 3a \\ 0 & 0 & 0 & 1 \end{pmatrix}.$$

至此, 我们可以猜测

$$\mathbf{A}^k = \begin{pmatrix} 1 & ka & k & k(k-1)a \\ 0 & 1 & 0 & k \\ 0 & 0 & 1 & ka \\ 0 & 0 & 0 & 1 \end{pmatrix}.$$

下面用数学归纳法证明这个结论. 当 $k = 1$ 时, 结论平凡. 下面设 k 时结论成立, 考虑 $k + 1$ 时的情形. 我们可以直接计算得

$$\mathbf{A}^{k+1} = \mathbf{A}^k \mathbf{A} = \begin{pmatrix} 1 & ka & k & k(k-1)a \\ 0 & 1 & 0 & k \\ 0 & 0 & 1 & ka \\ 0 & 0 & 0 & 1 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} 1 & 2a & 2 & 2a \\ 0 & 1 & 0 & 2 \\ 0 & 0 & 1 & 2a \\ 0 & 0 & 0 & 1 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 1 & (k+1)a & k+1 & k(k+1)a \\ 0 & 1 & 0 & k+1 \\ 0 & 0 & 1 & (k+1)a \\ 0 & 0 & 0 & 1 \end{pmatrix}.$$

故结论成立, 即 $\mathbf{A}^k = \begin{pmatrix} 1 & ka & k & k(k-1)a \\ 0 & 1 & 0 & k \\ 0 & 0 & 1 & ka \\ 0 & 0 & 0 & 1 \end{pmatrix}$. □

习题 3 (第三周习题 5). 设 $\mathbf{J} = \begin{pmatrix} 0 & 1 & & \\ & 0 & \ddots & \\ & & \ddots & 1 \\ & & & 0 \end{pmatrix} \in F^{n \times n}$, 找出与 \mathbf{J} 乘法可交换的所有矩阵.

解. 设 $A = (a_{ij})_{n \times n}$ 与 J 乘法可交换, 则我们不难计算得到

$$JA = \begin{pmatrix} a_{21} & a_{22} & \cdots & a_{2n} \\ a_{31} & a_{32} & \cdots & a_{3n} \\ \vdots & \vdots & & \vdots \\ a_{n1} & a_{n2} & \cdots & a_{nn} \\ 0 & 0 & \cdots & 0 \end{pmatrix}, \quad AJ = \begin{pmatrix} 0 & a_{11} & \cdots & a_{1,n-1} \\ 0 & a_{21} & \cdots & a_{2,n-1} \\ \vdots & \vdots & & \vdots \\ 0 & a_{n-1,1} & \cdots & a_{n-1,n-1} \\ 0 & a_{n1} & \cdots & a_{n,n-1} \end{pmatrix}.$$

于是 $AJ = JA$ 等价于

$$a_{21} = a_{31} = \cdots = a_{n1} = 0, \quad a_{n1} = a_{n2} = \cdots = a_{n,n-1} = 0, \\ a_{ij} = a_{i+1,j+1}, \quad i, j = 1, 2, \cdots, n-1.$$

由此, 不难得到¹与 J 乘法可交换的所有矩阵为 $\sum_{k=0}^{n-1} c_k J^k, c_k \in F$. □

习题 4 (第四周习题 1). 证明: 与任意 n 阶方阵都乘法可交换的方阵一定是数量矩阵.

证明. 设方阵 $A = (a_{ij})_{n \times n}$ 与任意 n 阶方阵都乘法可交换. 我们只需取一些特殊的方阵 E_{ij} , 利用 E_{ij} 与 $A = (a_{ij})_{n \times n}$ 乘法可交换就可以得出结论. 具体地, 我们取 E_{ij} 为 (i, j) 元为 1, 其余元素均为 0 的 n 阶方阵, 即

$$E_{ij} = \begin{matrix} & \text{第 } j \text{ 列} \\ \text{第 } i \text{ 行} & \begin{pmatrix} & & & \\ & & & \\ & & 1 & \\ & & & \\ & & & \end{pmatrix} \end{matrix}, \quad i, j = 1, \cdots, n.$$

于是我们不难计算得

$$AE_{ij} = \begin{matrix} & \text{第 } j \text{ 列} \\ \begin{pmatrix} a_{i1} \\ \vdots \\ a_{in} \end{pmatrix} \end{matrix}, \quad E_{ij}A = \begin{pmatrix} a_{1j} & \cdots & a_{nj} \end{pmatrix} \begin{matrix} \text{第 } i \text{ 行.} \end{matrix}$$

于是我们可以由 $AE_{ij} = E_{ij}A$ 得到 $a_{ik} = a_{mj} = 0, a_{ii} = a_{jj}, i, j, k, m = 1, \cdots, n, i \neq k, j \neq m$. 因此 A 是数量矩阵. □

事实上, 当我们后面学习线性空间时, 我们会意识到, 所有的 E_{ij} 就是 $F^{n \times n}$ 的一组基. 我们只取 E_{ij} 就能得证, 这并非巧合. 后面的一道补充题也是如此.

¹ “不难得到” 究竟难不难, 还须亲自动手实践方知.

习题 5 (第四周习题 2(4)(7)). 计算行列式

$$|\mathbf{A}| = \begin{vmatrix} & & & \mathbf{A}_1 \\ & & \mathbf{A}_2 & \\ & \ddots & & \\ \mathbf{A}_n & & & \end{vmatrix}, \quad |\mathbf{B}| = \begin{vmatrix} a_1 & & & b_1 \\ & \ddots & & \\ & & a_n & b_n \\ & & c_n & d_n \\ & \ddots & & \\ c_1 & & & d_1 \end{vmatrix}.$$

解. 这两道题我们都可以使用 Laplace 展开的方法.

设 \mathbf{A}_k 的阶数为 m_k . 在计算 $|\mathbf{A}|$ 之前, 我们先来看看 $n = 2$ 的情形. 对于行列式 $\begin{vmatrix} \mathbf{O} & \mathbf{A}_1 \\ \mathbf{A}_2 & \mathbf{O} \end{vmatrix}$, 按照前 m_1 行展开²可得

$$\begin{vmatrix} \mathbf{O} & \mathbf{A}_1 \\ \mathbf{A}_2 & \mathbf{O} \end{vmatrix} = (-1)^{[1+2+\cdots+m_1]+[(m_2+1)+(m_2+2)+\cdots+(m_2+m_1)]} |\mathbf{A}_1| |\mathbf{A}_2| = (-1)^{n_1 n_2} |\mathbf{A}_1| |\mathbf{A}_2|.$$

这样, 我们就能计算 \mathbf{A} 的行列式了. 我们把 \mathbf{A} 看成 2×2 的分块, 即把最后的 \mathbf{A}_n 单独看成一块, 并依次这样进行下去, 就能计算出

$$\begin{aligned} |\mathbf{A}| &= (-1)^{(m_1+\cdots+m_{n-1})m_n} |\mathbf{A}_n| \begin{vmatrix} & & \mathbf{A}_1 \\ & \mathbf{A}_2 & \\ & \ddots & \\ \mathbf{A}_{n-1} & & \end{vmatrix} \\ &= (-1)^{(m_1+\cdots+m_{n-1})m_n+(m_1+\cdots+m_{n-2})m_{n-1}} |\mathbf{A}_n| |\mathbf{A}_{n-1}| \begin{vmatrix} & & \mathbf{A}_1 \\ & \mathbf{A}_2 & \\ & \ddots & \\ \mathbf{A}_{n-2} & & \end{vmatrix} \\ &= \cdots \\ &= (-1)^{\sum_{i < j} m_i m_j} |\mathbf{A}_1| |\mathbf{A}_2| \cdots |\mathbf{A}_n|. \end{aligned}$$

²由于前面的 m_1 行所包含的 m_1 阶子式中仅有 $|\mathbf{A}_1|$ 可能非零, 所以在众多求和中我们只写出了一项.

计算 $|\mathbf{B}|$ 时, 我们可以直接按第 $n, n+1$ 行展开并依次按中间两行展开下去:

$$\begin{aligned}
& \begin{vmatrix} a_1 & & & & b_1 \\ & \ddots & & & \\ & & a_n & b_n & \\ & & c_n & d_n & \\ & \ddots & & & \\ c_1 & & & & d_1 \end{vmatrix} \\
&= (-1)^{[n+(n+1)]+[n+(n+1)]} \begin{vmatrix} a_n & b_n \\ c_n & d_n \end{vmatrix} \begin{vmatrix} a_1 & & & & b_1 \\ & \ddots & & & \\ & & a_{n-1} & b_{n-1} & \\ & & c_{n-1} & d_{n-1} & \\ & \ddots & & & \\ c_1 & & & & d_1 \end{vmatrix} \\
&= \begin{vmatrix} a_n & b_n \\ c_n & d_n \end{vmatrix} \begin{vmatrix} a_1 & & & & b_1 \\ & \ddots & & & \\ & & a_{n-1} & b_{n-1} & \\ & & c_{n-1} & d_{n-1} & \\ & \ddots & & & \\ c_1 & & & & d_1 \end{vmatrix} \\
&= \dots \\
&= \begin{vmatrix} a_n & b_n \\ c_n & d_n \end{vmatrix} \dots \begin{vmatrix} a_1 & b_1 \\ c_1 & d_1 \end{vmatrix} \\
&= \prod_{j=1}^n (a_j d_j - c_j b_j).
\end{aligned}$$

□

习题 6 (第四周习题 3). 对于 n 阶实方阵 \mathbf{A} , 我们可以定义函数 $\psi_{\mathbf{A}} : \mathbb{R}^{n \times n} \rightarrow \mathbb{R}, \mathbf{X} \mapsto \text{tr}(\mathbf{A}\mathbf{X})$. 若 n 阶实方阵 \mathbf{A}, \mathbf{B} 满足 $\psi_{\mathbf{A}} = \psi_{\mathbf{B}}$, 证明 $\mathbf{A} = \mathbf{B}$.

证明. 设 $\mathbf{A} = (a_{ij}), \mathbf{B} = (b_{ij})$, 记号 \mathbf{E}_{ij} 同本讲义习题 4. 经计算可得

$$\psi_{\mathbf{A}}(\mathbf{E}_{ij}) = \text{tr}(\mathbf{A}\mathbf{E}_{ij}) = a_{ij}, \quad \psi_{\mathbf{B}}(\mathbf{E}_{ij}) = \text{tr}(\mathbf{B}\mathbf{E}_{ij}) = b_{ij}.$$

因此若 $\psi_{\mathbf{A}} = \psi_{\mathbf{B}}$, 则 $a_{ij} = b_{ij}, i, j = 1, \dots, n$, 即 $\mathbf{A} = \mathbf{B}$.

□

在本节的最后, 我们对一些习题作评注.

当时大家做作业的时候, 我们并没有学习行列式、初等矩阵等内容. 现在, 我们完全可以以更高的视角去审视部分习题. 在证明分块对角矩阵的逆矩阵仍然是分块

对角矩阵时, 我们可以直接利用行列式证明每个对角块可逆, 从而直接写出答案, 即 $\text{diag}(\mathbf{A}_1, \dots, \mathbf{A}_n)^{-1} = \text{diag}(\mathbf{A}_1^{-1}, \dots, \mathbf{A}_n^{-1})$. 但是, 作业答案中的证法还是具有启发意义的, 同学们可以思考准上三角矩阵的逆是否仍为准上三角形. 此外, 对于可逆上三角形方阵, 我们可以写成一系列上三角形初等方阵的乘积 (想想为什么), 可以从这个角度对一些关于上三角形矩阵的题目进行一些思考.

再简要谈一下微扰法. 事实上, 我们所遇到的习题中, 大部分行列式都关于参数连续, 所以有时我们计算出参数不为零时的行列式, 就可以直接利用行列式的连续性补全 bug. 另外, 数学分析也可以在线性代数中有其他奇妙的应用, 具体可以参考丘维声编著的《高等代数 (上册) 第一版》第 76 页, 然后看看第四周最后一道补充习题的第二小问能不能有全新的做法.

2 预备知识——复数、映射、多项式

定义 1 (复数). 定义复数的全体 $\mathbb{C} = \{a + bi : a, b \in \mathbb{R}\}$, 其中 i 为虚数单位, 满足 $i^2 = -1$.

关于复数的四则运算、共轭及模长的定义不在此赘述. 复数也满足三角不等式.

定义 2. 定义复数 z 的实部为 $\text{Re } z = \text{Re}(z) := \frac{1}{2}(z + \bar{z})$, 虚部为 $\text{Im } z = \text{Im}(z) := \frac{1}{2i}(z - \bar{z})$.

命题 3. 设 z 和 w 是两个复数, 则

$$(i) \quad z\bar{z} = |z|^2;$$

$$(ii) \quad \overline{z + w} = \bar{z} + \bar{w}, \overline{zw} = \bar{z}\bar{w};$$

$$(iii) \quad |zw| = |z||w|, \left| \frac{z}{w} \right| = \frac{|z|}{|w|} (w \neq 0);$$

$$(iv) \quad |z| = |\bar{z}|.$$

下面, 我们介绍复数的几何表示. 对于复数 $z = a + bi, a, b \in \mathbb{R}$, 令 $r = |z|$ 则可设 $a = r \cos \theta, b = r \sin \theta$. 我们称 θ 为 z 的辐角, 这时, $z = r(\cos \theta + i \sin \theta)$ 也可以形式地定义 $z = e^{i\theta}$. 若设两个复数有几何表示 $z_1 = r_1(\cos \theta_1 + i \sin \theta_1), z_2 = r_2(\cos \theta_2 + i \sin \theta_2)$, 则容易证明 $z_1 z_2 = r_1 r_2 (\cos(\theta_1 + \theta_2) + i \sin(\theta_1 + \theta_2))$, 即 $(r_1 e^{i\theta_1})(r_2 e^{i\theta_2}) = (r_1 r_2) e^{i(\theta_1 + \theta_2)}$. 对应到复平面上的几何直观就是, 直角坐标 (a, b) 与极坐标 (r, θ) 的转化, 加法对应向量加法, 乘法对应伸缩 r 倍及旋转 θ 角度. 下面, 我们通过一个例子来熟悉它们.

例 4. 我们尝试推导正、余弦函数的 k 倍角公式. 注意到 $e^{ik\theta} = (e^{i\theta})^k$, 所以我们可以得到 $\cos k\theta + i \sin k\theta = (\cos \theta + i \sin \theta)^k$. 使用二项式定理展开并对比实部和虚部就能得到正、余弦函数的 k 倍角公式.

下面, 我们介绍映射的概念.

定义 5. 设 A, B 为两个集合, 如果对 A 中每个元素 a , 均有唯一元素 $b \in B$ 与之对应, 我们称此对应为 A 到 B 的映射, 记之为³

$$f: A \rightarrow B, \quad a \mapsto b.$$

其中, $b = f(a)$. 有时, 我们也记之为 $A \xrightarrow{f} B$. 集合 A 称为 f 的定义域⁴, $f(A) := \{f(a) : a \in A\} \subseteq B$ 称为 f 的值域或像集, b 称为 a 在 f 下的像, a 是 b 在 f 下的原像. 记 b 的原像集 $f^{-1}(b) := \{c : f(c) = b\}$. 类似地, 对 $A_0 \subseteq A, B_0 \subseteq B$, 我们可以定义 A_0 的像和 B_0 的原像: $f(A_0) := \{f(a) : a \in A_0\}, f^{-1}(B_0) := \{c : f(c) \in B_0\}$.

回顾一下, 我们定义两个矩阵相等, 是指行数、列数对应相等且元素对应相等. 当然, 我们也可以定义两个映射相等, 这个定义同矩阵相等的定义一样自然.

定义 6. 设 $f, g: A \rightarrow B$ 是两个映射, 我们称 $f = g$, 是指, 对任意 $a \in A$, 都有 $f(a) = g(a)$.

矩阵的乘法要求“衔接维数”相等, 这也可以类比于映射的复合:

定义 7. 设 $f: A \rightarrow B, g: B \rightarrow C$, 则可以定义二者的复合 $gf: A \rightarrow C, a \mapsto g(f(a))$.

映射的复合也可以视为一种“乘法”, 因为我们不难验证其结合律成立. 类比于矩阵, 我们还可以定义映射的“单位元”和“逆”:

定义 8. 在上面, 我们取 $B = A$, 则称映射 $f: A \rightarrow A$ 是一个集合 A 上的一个变换. 我们可以定义单位元 (恒等映射) 为 $\mathbb{1}_A: A \rightarrow A, a \mapsto a, \forall a \in A$.

不难验证, 对任意的变换 $f: A \rightarrow A$, 都有 $\mathbb{1}_A f = f \mathbb{1}_A = f$. 大家应该可以体会到, 在这些部分, 我们研究的对象不是集合 A, B , 而是函数本身. 下面再介绍变换的逆, 这与矩阵可逆的定义如出一辙.

定义 9. 考虑变换 $f: A \rightarrow A$, 如果存在变换 $g: A \rightarrow A$, 使得 $fg = gf = \mathbb{1}_A$, 则称 f 是 A 上的可逆映射, g 为 f 的逆映射.

我们可以验证若 f 可逆, 则逆唯一, 记作 f^{-1} . 下面, 我们给出一个判定变换可逆的方法, 在此之前, 还需要补充一些定义.

定义 10. 映射 $f: A \rightarrow B$ 称为一个满射, 若对 B 中的任意元素, 原像均非空, 亦即 $f(A) = B$. 映射 $f: A \rightarrow B$ 称为一个单射, 若对 B 中的任意元素, 原像至多含有一个元素, 直观地说就是不存在“一对多”. 若变换 $f: A \rightarrow B$ 既单又满, 则称 f 是一个一一映射或双射.

³注意这两个箭头是有区别的, 一个是集合间的, 另一个是元素之间的对应法则.

⁴在有些教材, B 称为陪域, 我们目前所考虑的映射更关心的是像集, 故不正式提及这个概念.

我们可以证明, 变换 $f: A \rightarrow A$ 可逆当且仅当 f 为双射.

在这一节的最后, 我们叙述一下多项式的定义, 大家可以自行思考“把一个数或方阵代入一个多项式”是什么意思, 不在本讲义中深究.

定义 11. 数域 F (如 \mathbb{C}, \mathbb{R} 等) 上的一元多项式是指形如下述的表达式:

$$a_n x^n + a_{n-1} x^{n-1} + \cdots + a_1 x + a_0,$$

其中 x 是一个符号 (它不属于 F), n 是非负整数, $a_i \in F$ 称为系数.

虽然上面的一系列内容几乎没有证明, 但是很多结论实际上都需要严格的证明, 学有余力的同学可以自行研究.

3 有关行列式与迹的注记

在丘维声编著的《高等代数 (上册) 第一版》第 53 页中归纳了行列式计算的一些技巧: (1) 化成上三角形行列式; (2) 拆成若干个行列式的和; (3) 把第 $2, 3, \cdots, n$ 列都加到第一列上 (适用于各行的元素和相同); (4) 按一行或一列展开; (5) 归纳法; (6) 递推关系法; (7) 加边法; (8) 利用范德蒙德行列式. 当然, 还有两个方法可以列出来, 即利用分析的手段和多项式性质计算行列式.

举一个例子. 不严谨地说, 一个范德蒙德行列式可以视为一个关于 x_1, \cdots, x_n 的 n 元多项式. 不难发现 $x_i - x_j, \forall i \neq j$ 均为它的因式⁵, 又注意到这个多项式至多 $n(n-1)/2$ 次, 最高次系数容易确定, 所以我们很容易直接写出结果.

笔者认为, 在许多行列式的计算中, 核心就是“打洞”, 即通过初等行列变换让矩阵产生尽可能多的 0, 然后再进行计算. 事实上, 我们在本课程中所接触的各类“标准形”对应的核心技巧也可以视为“打洞”, 大家将会在后续的学习中对此逐渐地建立起感觉.

再讲讲行列式展开的相关内容. 事实上, 完全展开式就是对所有“不在同一行、同一列的元素乘积”求和, 只不过在每一项都加了一个由逆序数决定的正负号. 而 Laplace 展开的本质就是对完全展开式进行了合并同类项. 为什么我们非得加上逆序数呢? 其实我们可以从 n 维平行多面体的有向体积受到启发: 互换两个向量的位置使有向体积变号 (如三维正方体的有向体积的正负号完全由手性所决定), 这才迫使我们引入逆序数的概念. 更多关于 Laplace 定理和 Binet-Cauchy 公式的叙述和例子可以参考丘维声编著的《高等代数 (上册) 第一版》的章节 2.6 和 4.3.

在本节的标题中, 我们甚至把行列式与迹放在并列的位置, 这是为了突出迹这个看似不起眼的概念的重要性. 迹的定义远比行列式简单, 但它所反映的信息不见得比行列式少 (从一个补充习题中也能看出), 甚至极其神秘. 在一个习题中, 我们使用了对方阵 A, B , 成立 $\text{tr}(AB) = \text{tr}(BA)$ 的结论. 但是值得注意的是, 在我们教材的定理 4.2.5 中, 并没有要求 A, B 均为方阵 (但是对于行列式, 这个结论就不成立了!). 事实上, 迹满足循环

⁵如在范德蒙德行列式中我们令 $x_2 = x_1$, 可以发现这是一个“根”, 故行列式有因式 $x_1 - x_2$. 当然, 这很不严谨.

不变性: $\text{tr}(\mathbf{A}_1 \mathbf{A}_2 \cdots \mathbf{A}_n) = \text{tr}(\mathbf{A}_n \mathbf{A}_1 \cdots \mathbf{A}_{n-1})$, 只要这个式子有意义. 但是乘积的顺序又不能随意交换, 可以尝试举反例使得 $\text{tr}(\mathbf{A}\mathbf{B}\mathbf{C}) \neq \text{tr}(\mathbf{A}\mathbf{C}\mathbf{B})$.