

# 作业答案

王睿

2023 年 3 月 15 日

## 目录

<b>1 第一周作业</b>	<b>2</b>
1.1 3 月 7 日布置的作业 . . . . .	2
1.1.1 习题 1: Cauchy 不等式的证明 . . . . .	2
1.1.2 习题 2 . . . . .	4
1.2 3 月 9 日布置的作业 . . . . .	4
1.2.1 教材习题 1.(1/2)(4) . . . . .	4
1.2.2 软件计算 . . . . .	6
<b>A Cauchy-Schwarz 不等式的证明</b>	<b>7</b>

## 一点说明

1. 作业讲义部分题过程可能有省略。如对作业仍有疑问可以在群里或答疑课上讨论。
2. 作业讲义会随时间更新。
3. 请及时核对自己在 BB 系统里的分数，如有问题请向对应的助教反馈。
4. 附录里的内容仅供有兴趣的同学参考，有可能涉及之后才会学习或课外的知识，不要求在现阶段掌握。
5. 讲义最好用电脑打开，文档内置了链接功能，复习或查看指定的作业很方便。

# 1 第一周作业

成绩说明：成绩公式为

$$\text{score} = \begin{cases} 10 - k \cdot \max\{n - n_0, 0\} & \text{未迟交} \\ 5 & \text{迟交} \end{cases}$$

其中  $n$  为错题数,  $n_0$  为容忍度;  $k$  为系数, 取决于当周作业的题量。第一周作业较少,  $n = 5$ , 考虑到一些同学出现了计算失误、笔误、抄错题目等情况,  $n_0 = 1$ ;  $k = 0.5$ 。对于一些不严格的证明, 助教也会酌情给分。也意味着作业得到满分不代表作业没有问题, 请认真查看自己的作业。

上述评分标准对每个助教都成立。

## 1.1 3月7日布置的作业

### 1.1.1 习题 1: Cauchy 不等式的证明

证明如下形式的 Cauchy 不等式: 若  $a_1, \dots, a_n, b_1, \dots, b_n \in \mathbb{R}$ , 则必有

$$(a_1b_1 + a_2b_2 + \dots + a_nb_n)^2 \leq (a_1^2 + a_2^2 + \dots + a_n^2)(b_1^2 + b_2^2 + \dots + b_n^2)$$

解答: Cauchy 不等式有许多证明方法, 这里只给出一种。

$$\begin{aligned} & \left( \sum_{i=1}^n a_i^2 \right) \left( \sum_{i=1}^n b_i^2 \right) - \left( \sum_{i=1}^n a_i b_i \right)^2 \\ &= \sum_{i=1}^n a_i^2 \sum_{j=1}^n b_j^2 - \sum_{i=1}^n a_i b_i \sum_{j=1}^n a_j b_j \\ &= \sum_{i=1}^n \sum_{j=1}^n a_i^2 b_j^2 - \sum_{i=1}^n \sum_{j=1}^n a_i b_i a_j b_j \\ &= \sum_{i=1}^n \sum_{j=1}^n (a_i^2 b_j^2 - a_i b_i a_j b_j) \\ &= \frac{1}{2} \sum_{i=1}^n \sum_{j=1}^n (a_i^2 b_j^2 - 2a_i b_i a_j b_j + a_j^2 b_i^2) \\ &= \frac{1}{2} \sum_{i=1}^n \sum_{j=1}^n (a_i b_j - a_j b_i)^2 \geq 0 \end{aligned}$$

其中  $\sum$  符号为求和符号,  $\sum_{i=1}^n a_i^2$  代表从  $i$  从 1 取到  $n$ , 对  $a_i^2$  的求和, 即

$$\begin{aligned} \sum_{i=1}^n a_i^2 &= a_1^2 + a_2^2 + \dots + a_n^2 \\ \sum_{i=1}^n a_i b_i &= a_1 b_1 + a_2 b_2 + \dots + a_n b_n \end{aligned}$$

求和符号参考教材 1.9 节第 27 页。

有一些同学使用的是构造函数的方法：构造

$$\left(\sum_{i=1}^n a_i^2\right) x^2 + 2 \sum_{i=1}^n a_i b_i x + \sum_{i=1}^n b_i^2 = \sum_{i=1}^n (a_i x + b_i)^2 \geq 0$$

对任意  $x \in \mathbb{R}$  有

$$f(x) = \sum_{i=1}^n (a_i x + b_i)^2 \geq 0$$

因此有关  $x$  的二次方程判别式小于或等于 0，可得

$$4 \left(\sum_{i=1}^n a_i b_i\right)^2 - 4 \sum_{i=1}^n a_i^2 \sum_{i=1}^n b_i^2 \leq 0$$

总体来讲，上述证明没有什么大问题；但应注意的是要分  $\sum_{i=1}^n a_i^2 = 0$  or  $\neq 0$  的两种情况。不等于 0 的情

况上面已经讨论过； $\sum_{i=1}^n a_i^2 = 0$  时，有

$$\sum_{i=1}^n a_i^2 = 0 \Rightarrow a_i = 0 \Rightarrow \left(\sum_{i=1}^n a_i b_i\right)^2 = 0 \leq \left(\sum_{i=1}^n a_i^2\right) \left(\sum_{i=1}^n b_i^2\right) = 0$$

可知 Cauchy 不等式成立。这样证明才是比较严谨的。

Cauchy 不等式的其他证明方法可以参考<https://www.zhihu.com/question/449533105>。

个人而言，不是很推荐使用向量的夹角作为证明方法，主要基于以下原因：在一般的线性空间理论中，内积不是必要的定义。事实上，在教材中直到第七章欧几里得空间才定义了线性空间中的内积和“夹角”。夹角的性质

$$-1 \leq \frac{\alpha \cdot \beta}{|\alpha||\beta|} \leq 1$$

需要通过 Cauchy-Schwarz 不等式来证明，而 Cauchy-Schwarz 不等式的证明依赖线性空间上内积的定义。而迄今为止，还不能说严格地定义了线性空间中的内积。没有严格内积的定义、却使用依赖内积定义的“夹角”性质来证明 Cauchy 不等式，有点本末倒置的意味。当然，对几何空间的直观理解——两个向量之间有夹角，余弦值在  $[-1, 1]$  之间也不能说错；但应注意，在很多线性空间中“夹角”是相当难理解（且没啥用）的概念，比如傅里叶级数也是一种定义内积的线性空间（例 7.1.3）。有关 Cauchy-Schwarz 不等式的证明详见附录，傅里叶级数的线性空间理解会在讲到线性空间时再介绍。

## 1.1.2 习题 2

设三维空间中有向量  $\mathbf{a}, \mathbf{b}, \mathbf{c}$ , 它们的长度相同, 两两之间的夹角相等. 若  $\mathbf{a} = (1, 1, 0), \mathbf{b} = (0, 1, 1)$ , 求出  $\mathbf{c}$ .

**解答:** 长度相同意味着  $|\mathbf{a}| = \mathbf{a} \cdot \mathbf{a} = |\mathbf{b}| = \mathbf{b} \cdot \mathbf{b} = |\mathbf{c}| = \mathbf{c} \cdot \mathbf{c}$ , 夹角相等意味着  $\frac{\mathbf{a} \cdot \mathbf{b}}{|\mathbf{a}||\mathbf{b}|} = \frac{\mathbf{b} \cdot \mathbf{c}}{|\mathbf{b}||\mathbf{c}|} = \frac{\mathbf{c} \cdot \mathbf{a}}{|\mathbf{c}||\mathbf{a}|}$ . 设  $\mathbf{c} = (c_1, c_2, c_3)$ , 代入计算得

$$\begin{cases} c_1^2 + c_2^2 + c_3^2 = 0^2 + 1^2 + 1^2 = 2 \\ \mathbf{c} \cdot \mathbf{a} = c_1 + c_2 = \mathbf{b} \cdot \mathbf{c} = c_2 + c_3 = \mathbf{a} \cdot \mathbf{b} = 1 \end{cases} \Rightarrow \mathbf{c} = (c_1, c_2, c_3) = (1, 0, 1) \text{ or } (-\frac{1}{3}, \frac{4}{3}, -\frac{1}{3})$$

## 1.2 3月9日布置的作业

## 1.2.1 教材习题 1.(1/2)(4)

## 1.(1)

$$(1) \begin{cases} x_1 + x_2 - 3x_3 = -1 \\ 2x_1 + x_2 - 2x_3 = 1 \\ x_1 + x_2 + x_3 = 3 \\ x_1 + 2x_2 - 3x_3 = 1 \end{cases}$$

使用增广矩阵以使表达简洁明了. 方程可以记为

$$\left( \begin{array}{ccc|c} 1 & 1 & -3 & -1 \\ 2 & 1 & -2 & 1 \\ 1 & 1 & 1 & 3 \\ 1 & 2 & -3 & 1 \end{array} \right)$$

使用三个初等行变换: 对换行、倍乘行、倍加行进行运算, 将矩阵转换为标准形式, 计算过程不唯一, 下面只展示一种计算方法.

$$\begin{aligned} & \left( \begin{array}{ccc|c} 1 & 1 & -3 & -1 \\ 2 & 1 & -2 & 1 \\ 1 & 1 & 1 & 3 \\ 1 & 2 & -3 & 1 \end{array} \right) \xrightarrow{-2r_1 \rightarrow r_2, -r_1 \rightarrow r_3, -r_1 \rightarrow r_4} \left( \begin{array}{ccc|c} 1 & 1 & -3 & -1 \\ 0 & -1 & 4 & 3 \\ 0 & 0 & 4 & 4 \\ 0 & 1 & 0 & 2 \end{array} \right) \xrightarrow{r_2 \leftrightarrow r_4, \frac{1}{4}r_3} \\ & \left( \begin{array}{ccc|c} 1 & 1 & -3 & -1 \\ 0 & 1 & 0 & 2 \\ 0 & 0 & 1 & 1 \\ 0 & -1 & 4 & 3 \end{array} \right) \xrightarrow{r_2 \rightarrow r_4} \left( \begin{array}{ccc|c} 1 & 1 & -3 & -1 \\ 0 & 1 & 0 & 2 \\ 0 & 0 & 1 & 1 \\ 0 & 0 & 4 & 5 \end{array} \right) \xrightarrow{-4r_3 \rightarrow r_4} \left( \begin{array}{ccc|c} 1 & 1 & -3 & -1 \\ 0 & 1 & 0 & 2 \\ 0 & 0 & 1 & 1 \\ 0 & 0 & 0 & 1 \end{array} \right) \end{aligned}$$

说明此方程无解.

## 1.(2)

$$(2) \begin{cases} x_1 - 2x_2 + 3x_3 - 4x_4 = 4 \\ \quad \quad x_2 - x_3 + x_4 = -3 \\ x_1 + 3x_2 \quad \quad - 3x_4 = 1 \\ \quad -7x_2 + 3x_3 + x_4 = -3 \end{cases}$$

使用增广矩阵以使表达简洁明了。方程可以记为

$$\left( \begin{array}{cccc|c} 1 & -2 & 3 & -4 & 4 \\ 0 & 1 & -1 & 1 & -3 \\ 1 & 3 & 0 & -3 & 1 \\ 0 & -7 & 3 & 1 & -3 \end{array} \right)$$

使用三个初等行变换：对换行、倍乘行、倍加行进行运算，将矩阵转换为标准形式，计算过程不唯一，下面只展示一种计算方法。

$$\begin{aligned} & \left( \begin{array}{cccc|c} 1 & -2 & 3 & -4 & 4 \\ 0 & 1 & -1 & 1 & -3 \\ 1 & 3 & 0 & -3 & 1 \\ 0 & -7 & 3 & 1 & -3 \end{array} \right) \xrightarrow{-r_1 \rightarrow r_3} \left( \begin{array}{cccc|c} 1 & -2 & 3 & -4 & 4 \\ 0 & 1 & -1 & 1 & -3 \\ 0 & 5 & -3 & 1 & -3 \\ 0 & -7 & 3 & 1 & -3 \end{array} \right) \xrightarrow[7r_2 \rightarrow r_4]{-5r_2 \rightarrow r_3} \left( \begin{array}{cccc|c} 1 & -2 & 3 & -4 & 4 \\ 0 & 1 & -1 & 1 & -3 \\ 0 & 0 & 2 & -4 & 12 \\ 0 & 0 & -4 & 8 & -24 \end{array} \right) \\ & \xrightarrow[-\frac{1}{4}r_4]{\frac{1}{2}r_3} \left( \begin{array}{cccc|c} 1 & -2 & 3 & -4 & 4 \\ 0 & 1 & -1 & 1 & -3 \\ 0 & 0 & 1 & -2 & 6 \\ 0 & 0 & 1 & -2 & 6 \end{array} \right) \xrightarrow{-r_3 \rightarrow r_4} \left( \begin{array}{cccc|c} 1 & -2 & 3 & -4 & 4 \\ 0 & 1 & -1 & 1 & -3 \\ 0 & 0 & 1 & -2 & 6 \\ 0 & 0 & 0 & 0 & 0 \end{array} \right) \xrightarrow{2r_2 \rightarrow r_1} \left( \begin{array}{cccc|c} 1 & 0 & 1 & -2 & -2 \\ 0 & 1 & -1 & 1 & -3 \\ 0 & 0 & 1 & -2 & 6 \\ 0 & 0 & 0 & 0 & 0 \end{array} \right) \\ & \xrightarrow[r_3 \rightarrow r_2]{-r_3 \rightarrow r_1} \left( \begin{array}{cccc|c} 1 & 0 & 0 & 0 & -8 \\ 0 & 1 & 0 & -1 & 3 \\ 0 & 0 & 1 & -2 & 6 \\ 0 & 0 & 0 & 0 & 0 \end{array} \right) \Leftrightarrow \begin{cases} x_1 = -8 \\ x_2 - x_4 = 3 \\ x_3 - 2x_4 = 6 \end{cases} \xrightarrow{\text{令 } x_4 \text{ 为自由变量 } t} \\ & \begin{cases} x_1 = -8 \\ x_2 = 3 + t \\ x_3 = 6 + 2t \\ x_4 = t \end{cases} \quad (\text{其中 } t \text{ 任意}) \Leftrightarrow \begin{pmatrix} x_1 \\ x_2 \\ x_3 \\ x_4 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} -8 \\ 3 \\ 6 \\ 0 \end{pmatrix} + t \begin{pmatrix} 0 \\ 1 \\ 2 \\ 1 \end{pmatrix} \end{aligned}$$

1.(4)

$$(4) \begin{cases} 2x_1 + 4x_2 - 6x_3 + x_4 = 2 \\ x_1 - x_2 + 4x_3 + x_4 = 1 \\ -x_1 + x_2 - x_3 + x_4 = 0 \end{cases}$$

这里使用增广矩阵以使表达简洁明了。方程可以记为

$$\left( \begin{array}{cccc|c} 2 & 4 & -6 & 1 & 2 \\ 1 & -1 & 4 & 1 & 1 \\ -1 & 1 & -1 & 1 & 0 \end{array} \right)$$

使用三个初等行变换：对换行、倍乘行、倍加行进行运算，将矩阵转换为标准形式，计算过程不唯一，

下面只展示一种计算方法。

$$\begin{aligned}
 & \left( \begin{array}{cccc|c} 2 & 4 & -6 & 1 & 2 \\ 1 & -1 & 4 & 1 & 1 \\ -1 & 1 & -1 & 1 & 0 \end{array} \right) \xrightarrow{r_1 \leftrightarrow r_2} \left( \begin{array}{cccc|c} 1 & -1 & 4 & 1 & 1 \\ 2 & 4 & -6 & 1 & 2 \\ -1 & 1 & -1 & 1 & 0 \end{array} \right) \xrightarrow[-2r_1 \rightarrow r_2]{r_1 \rightarrow r_3} \left( \begin{array}{cccc|c} 1 & -1 & 4 & 1 & 1 \\ 0 & 6 & -14 & -1 & 0 \\ 0 & 0 & 3 & 2 & 1 \end{array} \right) \\
 & \xrightarrow[\frac{1}{6}r_2]{\frac{1}{3}r_3} \left( \begin{array}{cccc|c} 1 & -1 & 4 & 1 & 1 \\ 0 & 1 & -\frac{7}{3} & -\frac{1}{6} & 0 \\ 0 & 0 & 1 & \frac{2}{3} & \frac{1}{3} \end{array} \right) \xrightarrow{r_2 \rightarrow r_1} \left( \begin{array}{cccc|c} 1 & 0 & \frac{5}{3} & \frac{5}{6} & 1 \\ 0 & 1 & -\frac{7}{3} & -\frac{1}{6} & 0 \\ 0 & 0 & 1 & \frac{2}{3} & \frac{1}{3} \end{array} \right) \xrightarrow[-\frac{5}{3}r_3 \rightarrow r_1]{\frac{7}{3}r_3 \rightarrow r_2} \left( \begin{array}{cccc|c} 1 & 0 & 0 & -\frac{5}{18} & \frac{4}{9} \\ 0 & 1 & 0 & \frac{25}{18} & \frac{7}{9} \\ 0 & 0 & 1 & \frac{2}{3} & \frac{1}{3} \end{array} \right) \\
 & \xrightarrow{\text{令 } x_4 \text{ 为自由变量 } t} \begin{cases} x_1 = \frac{4}{9} + \frac{5}{18}t \\ x_2 = \frac{7}{9} - \frac{25}{18}t \\ x_3 = \frac{1}{3} - \frac{2}{3}t \\ x_4 = t \end{cases} \quad (\text{其中 } t \text{ 任意}) \Leftrightarrow \begin{pmatrix} x_1 \\ x_2 \\ x_3 \\ x_4 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} \frac{4}{9} \\ \frac{7}{9} \\ \frac{1}{3} \\ 0 \end{pmatrix} + t \begin{pmatrix} \frac{5}{18} \\ -\frac{25}{18} \\ -\frac{2}{3} \\ 1 \end{pmatrix}
 \end{aligned}$$

### 1.2.2 软件计算

1.(7)

$$\begin{cases} x_1 + x_2 - 3x_4 - x_5 = 0 \\ x_1 - x_2 - 2x_3 - x_4 = 0 \\ 4x_1 - 2x_2 + 6x_3 + 3x_4 - 4x_5 = 0 \\ 2x_1 + 4x_2 - 2x_3 + 4x_4 - 7x_5 = 0 \end{cases}$$

使用任何程序均可，只要结果正确即可。这里只展示结果。

$$\begin{pmatrix} x_1 \\ x_2 \\ x_3 \\ x_4 \\ x_5 \end{pmatrix} = t \begin{pmatrix} \frac{7}{6} \\ \frac{5}{6} \\ 0 \\ \frac{1}{3} \\ 1 \end{pmatrix}$$

## A Cauchy-Schwarz 不等式的证明

第一次作业第一题比较合适的方法（第七章内容，自行学习不要求掌握）是：先证明

$$(\alpha, \beta) = \alpha \cdot \beta = \sum_{i=1}^n a_i b_i = a_1 b_1 + a_2 b_2 + \cdots + a_n b_n \quad (\text{A.1})$$

是实线性空间  $V$  中的内积，为此需要满足

1. 对称性:  $\forall \alpha, \beta \in V, (\alpha, \beta) = \sum_{i=1}^n a_i b_i = (\beta, \alpha)$
2. 恒正性:  $\forall \alpha \in V, \alpha \neq 0, (\alpha, \alpha) = \sum_{i=1}^n a_i^2 > 0$
3. 双线性:  $\forall \alpha_1, \alpha_2, \alpha, \beta_1, \beta_2, \beta \in V, \lambda, \mu \in \mathbb{R}$ , 均有

$$\begin{aligned} (\alpha_1 + \alpha_2, \beta) &= (\alpha_1, \beta) + (\alpha_2, \beta) \\ (\lambda \alpha, \beta) &= \lambda (\alpha, \beta) \\ (\alpha, \beta_1 + \beta_2) &= (\alpha, \beta_1) + (\alpha, \beta_2) \\ (\alpha, \mu \beta) &= \mu (\alpha, \beta) \end{aligned} \quad (\text{A.2})$$

将方程 (A.1) 代入方程 (A.2) 验证即知满足。

因此方程 (A.1) 定义的是内积。从而有

$$(\alpha, \beta)^2 \leq (\alpha, \alpha)(\beta, \beta) \quad (\text{A.3})$$

这里展示一种与课本略微不同的证明，仅作为课本的补充。当  $\alpha = 0$  时,  $(0, \beta) = (0\alpha, \beta) = 0(\alpha, \beta) = 0, (0, 0) = 0$ , 因此式 (A.3) 成等式, 即当  $\alpha = 0$  时, 式 (A.3) 成立。

设  $\alpha \neq 0$ , 记  $\beta_1 = \beta - \frac{(\alpha, \beta)}{(\alpha, \alpha)}\alpha$ , 由内积的恒正性  $0 \leq (\beta_1, \beta_1) = (\beta, \beta) - \frac{(\alpha, \beta)^2}{(\alpha, \alpha)} \leq (\alpha, \alpha)(\beta, \beta)$ , 等号成立当且仅当  $\beta_1 = 0$ , 即  $\beta = \frac{(\alpha, \beta)}{(\alpha, \alpha)}\alpha$  时成立, 此时  $\alpha$  与  $\beta$  线性相关。

将方程 (A.1) 代入式 (A.3), 有

$$(a_1 b_1 + a_2 b_2 + \cdots + a_n b_n)^2 \leq (a_1^2 + a_2^2 + \cdots + a_n^2)(b_1^2 + b_2^2 + \cdots + b_n^2). \quad (\text{A.4})$$

**一个例子:** 设  $\mathbb{R}^2$  是所有 2 维实向量  $(x_1, x_2)$  构成的 2 维实向量空间,  $\alpha = (x_1, x_2), \beta = (y_1, y_2) \in \mathbb{R}^2$ . 定义 2 维实向量空间  $\mathbb{R}^2$  上二元实函数  $(\alpha, \beta)$  为

$$(\alpha, \beta) = x_1 y_1 - x_2 y_1 - x_1 y_2 + 4x_2 y_2 \quad (\text{A.5})$$

容易验证, 二元实函数  $(\alpha, \beta)$  满足: 对称性、恒正性和双线性。所以二元实函数  $(\alpha, \beta)$  是 2 维实向量空间  $\mathbb{R}^2$  上的一个内积。2 维实向量空间  $\mathbb{R}^2$  连同内积  $(\alpha, \beta)$  便构成一个 Euclid 空间。代入式 (A.3) 一样可以得到一个不等式:

$$(x_1 y_1 - x_2 y_1 - x_1 y_2 + 4x_2 y_2)^2 \leq (x_1^2 - 2x_1 x_2 + 4x_2^2)(y_1^2 - 2y_1 y_2 + 4y_2^2) \quad (\text{A.6})$$

我这里使用 mathematica 验证上式的正确性, 如图A.1, 并且我们还可以发现等号成立当且仅当  $x_2 y_1 = x_1 y_2$ , 即  $\alpha$  与  $\beta$  线性相关。

```

In[4]:= f = (x1^2 - 2 x1 x2 + 4 x2^2) (y1^2 - 2 y1 y2 + 4 y2^2) -
          (x1 y1 - x2 y1 - x1 y2 + 4 x2 y2)^2

Out[4]= - (x1 y1 - x2 y1 - x1 y2 + 4 x2 y2)^2 +
          (x1^2 - 2 x1 x2 + 4 x2^2) (y1^2 - 2 y1 y2 + 4 y2^2)

(+ )
In[5]:= Simplify[f]
      |  |
      |  | 化简
      |  |
Out[5]= 3 (x2 y1 - x1 y2)^2

In[6]:= Reduce[f >= 0, Reals]
      |  |      |
      |  | 约化  | 实数域
      |  |
Out[6]= True

```

图 A.1: 使用软件可以辅助自己的计算。

当然我们也可以形式地定义“夹角”为

$$\begin{aligned}
 \theta &= \arccos \frac{(\alpha, \beta)}{\sqrt{(\alpha, \alpha)(\beta, \beta)}} \\
 &= \arccos \frac{(x_1 y_1 - x_2 y_1 - x_1 y_2 + 4 x_2 y_2)}{\sqrt{(x_1^2 - 2 x_1 x_2 + 4 x_2^2)(y_1^2 - 2 y_1 y_2 + 4 y_2^2)}}
 \end{aligned} \tag{A.7}$$

上式定义的夹角可以直接用来证明 Cauchy-Schwarz 不等式吗? 显然是不行的, 所以用夹角的性质直接推到 Cauchy 不等式也是有问题的。

## 致谢

感谢胡铁宁、贺维易同学对本文档的校对工作和内容补充, 感谢申伊堉老师以及同学对助教工作的支持。