# 线性代数-8

主讲: 吴利苏

wulisu@sdust.edu.cn

山东科技大学, 数学学院

• 矩阵的初等变换:

$$r_i \leftrightarrow r_j \cdot r_i \times k, r_i + kr_j, c_i \leftrightarrow c_j, c_i \times k, c_i + kc_j$$

• 矩阵的初等变换:

$$r_i \leftrightarrow r_j \cdot r_i \times k, r_i + kr_j, c_i \leftrightarrow c_j, c_i \times k, c_i + kc_j$$

• 矩阵的等价:

$$A \stackrel{r}{\sim} B, A \stackrel{c}{\sim} B, A \sim B;$$

• 矩阵的初等变换:

$$r_i \leftrightarrow r_j.r_i \times k, r_i + kr_j, c_i \leftrightarrow c_j, c_i \times k, c_i + kc_j$$

• 矩阵的等价:

$$A \stackrel{r}{\sim} B, A \stackrel{c}{\sim} B, A \sim B;$$

• 矩阵的等价化简:

 $A \xrightarrow{\text{有限次初等行变换}}$  行阶梯形  $\xrightarrow{\text{有限次初等行变换}}$  行最简形  $\xrightarrow{\text{有限次初等列变换}}$  标准形

• 矩阵的初等变换:

$$r_i \leftrightarrow r_j \cdot r_i \times k, r_i + kr_j, c_i \leftrightarrow c_j, c_i \times k, c_i + kc_j$$

• 矩阵的等价:

$$A \stackrel{r}{\sim} B, A \stackrel{c}{\sim} B, A \sim B;$$

• 矩阵的等价化简:

 $A \xrightarrow{\text{有限次初等行变换}}$  行阶梯形  $\xrightarrow{\text{有限次初等行变换}}$  行最简形  $\xrightarrow{\text{有限次初等列变换}}$  标准形

• 初等矩阵:

• 初等变换和初等矩阵联系: 左行右列;

- 初等变换和初等矩阵联系: 左行右列;
- 可逆矩阵可表示为初等矩阵乘积;

 $A \xrightarrow{\text{fll} \times \text{inff} \neq \text{fll}} PA \xrightarrow{\text{fll} \times \text{inff} \neq \text{fll}} PPA \xrightarrow{\text{fll} \times \text{inff} \neq \text{fll}} PPAQ$ 

- 初等变换和初等矩阵联系: 左行右列;
- 可逆矩阵可表示为初等矩阵乘积;

 $A \xrightarrow{\text{fR} \times \text{in} \text{ if } T \text{ is } P} PA \xrightarrow{\text{fR} \times \text{in} \text{ if } T \text{ is } P} PA \xrightarrow{\text{fR} \times \text{in} \text{ if } T \text{ is } P} PAQ$ 

• 方阵 A 可逆  $\Leftrightarrow$   $A \stackrel{r}{\sim} E \Leftrightarrow A \stackrel{c}{\sim} E \Leftrightarrow A \sim E \Leftrightarrow |A| \neq 0$ ;

- 初等变换和初等矩阵联系: 左行右列;
- 可逆矩阵可表示为初等矩阵乘积;

- 方阵 A 可逆  $\Leftrightarrow A \stackrel{r}{\sim} E \Leftrightarrow A \stackrel{c}{\sim} E \Leftrightarrow A \sim E \Leftrightarrow |A| \neq 0$ ;
- 初等变换的应用:

- 初等变换和初等矩阵联系: 左行右列;
- 可逆矩阵可表示为初等矩阵乘积;

 $A \xrightarrow{\text{flk/n} \text{ if } f \text{ cyn}} PA \xrightarrow{\text{flk/n} \text{ if } f \text{ cyn}} PA \xrightarrow{\text{flk/n} \text{ if } f \text{ cyn}} PAQ$ 

- 方阵 A 可逆  $\Leftrightarrow A \stackrel{\tau}{\sim} E \Leftrightarrow A \stackrel{c}{\sim} E \Leftrightarrow A \sim E \Leftrightarrow |A| \neq 0$ ;
- 初等变换的应用:
  - 求可逆 P, 使得  $PA = B :\Rightarrow (A E) \xrightarrow{f \in \mathcal{P}} (B P)$ ;

- 初等变换和初等矩阵联系: 左行右列;
- 可逆矩阵可表示为初等矩阵乘积;

 $A \xrightarrow{\text{flk/n} \text{ if } f \text{ cyn}} PA \xrightarrow{\text{flk/n} \text{ if } f \text{ cyn}} PA \xrightarrow{\text{flk/n} \text{ if } f \text{ cyn}} PAQ$ 

- 方阵 A 可逆  $\Leftrightarrow A \stackrel{\tau}{\sim} E \Leftrightarrow A \stackrel{c}{\sim} E \Leftrightarrow A \sim E \Leftrightarrow |A| \neq 0$ ;
- 初等变换的应用:
  - 求可逆 P, 使得  $PA = B :\Rightarrow (A E) \xrightarrow{f \circ f} (B P)$ ;
  - $\rlap{$\rlap{$\rlap{$\rlap{$\rlap{$}}$}}$} A^{-1} :\Rightarrow (A \ E) \xrightarrow{\it ftg} (E \ A^{-1});$

- 初等变换和初等矩阵联系: 左行右列;
- 可逆矩阵可表示为初等矩阵乘积;

 $A \xrightarrow{\text{flk/n} \text{ if } f \text{ cyn}} PA \xrightarrow{\text{flk/n} \text{ if } f \text{ cyn}} PA \xrightarrow{\text{flk/n} \text{ if } f \text{ cyn}} PAQ$ 

- 方阵 A 可逆  $\Leftrightarrow A \stackrel{r}{\sim} E \Leftrightarrow A \stackrel{c}{\sim} E \Leftrightarrow A \sim E \Leftrightarrow |A| \neq 0$ ;
- 初等变换的应用:
  - 求可逆 P, 使得  $PA = B :\Rightarrow (A E) \xrightarrow{f \circ f} (B P)$ ;
  - $\not x A^{-1} :\Rightarrow (A E) \xrightarrow{f \not x \not y} (E A^{-1});$

- 初等变换和初等矩阵联系: 左行右列;
- 可逆矩阵可表示为初等矩阵乘积;

 $A \xrightarrow{\text{flk/n} \text{$\%$ff} \text{$\%$}} PA \xrightarrow{\text{flk/n} \text{$\%$} \text{$\%$}} PPA \xrightarrow{\text{flk/n} \text{$\%$} \text{$\%$}} PPAQ$ 

- 方阵 A 可逆  $\Leftrightarrow$   $A \stackrel{r}{\sim} E \Leftrightarrow A \stackrel{c}{\sim} E \Leftrightarrow A \sim E \Leftrightarrow |A| \neq 0$ ;
- 初等变换的应用:
  - 求可逆 P, 使得  $PA = B :\Rightarrow (A E) \xrightarrow{f \circ f} (B P)$ ;
  - $\not x A^{-1} :\Rightarrow (A E) \xrightarrow{f \not y \not y} (E A^{-1});$
  - $\not \stackrel{\cdot}{x} A^{-1}B :\Rightarrow (A B) \xrightarrow{f \uparrow g \not h} (E A^{-1}B);$
  - $AX = \beta$  :  $(A \beta) \xrightarrow{free \#} f \downarrow f | f | f | f |$

- 初等变换和初等矩阵联系: 左行右列;
- 可逆矩阵可表示为初等矩阵乘积;

 $A \xrightarrow{\text{flk}, \text{institute}} PA \xrightarrow{\text{flk}, \text{institute}} PPA \xrightarrow{\text{flk}, \text{institute}} PPA \xrightarrow{\text{flk}, \text{institute}} PPAQ$ 

- 方阵 A 可逆  $\Leftrightarrow A \stackrel{r}{\sim} E \Leftrightarrow A \stackrel{c}{\sim} E \Leftrightarrow A \sim E \Leftrightarrow |A| \neq 0$ ;
- 初等变换的应用:
  - 求可逆 P, 使得  $PA = B : \Rightarrow (A E) \xrightarrow{f \in \mathcal{P}} (B P)$ ;
  - $\not x A^{-1} :\Rightarrow (A E) \xrightarrow{f \not x \not y} (E A^{-1});$
  - $\not x A^{-1}B :\Rightarrow (A B) \xrightarrow{f \not x} (E A^{-1}B);$
  - 解  $AX = \beta$  :  $\Rightarrow$   $(A \beta) \xrightarrow{f \notin \mathcal{H}}$  行最简形;
  - 注: 求可逆 Q, 使得 AQ = B;  $A^{-1}$ ;  $BA^{-1}$ ;  $X^TA = \beta^T$  用列分块, 初等 列变换.

# 本次课内容

矩阵的秩和线性方程组解的存在性

• 如何判断  $A \sim B$ ?

- 如何判断 *A* ∼ *B*?
  - 根据定义,如果经过有限次初等行变换和初等列变换可以把 A 变为 B,则  $A \sim B$ , 否则  $A \sim B$ .

- 如何判断 A ~ B?
  - 根据定义,如果经过有限次初等行变换和初等列变换可以把 A 变为 B,则  $A \sim B$ , 否则  $A \propto B$ .
  - 根据初等变换和初等矩阵的联系,如果存在可逆 P 和可逆 Q,使得 PAQ = B,则  $A \sim B$ , 否则  $A \sim B$ .

- 如何判断 A ~ B?
  - 根据定义,如果经过有限次初等行变换和初等列变换可以把 A 变为 B,则  $A \sim B$ ,否则  $A \sim B$ .
  - 根据初等变换和初等矩阵的联系,如果存在可逆 P和可逆 Q,使得 PAQ=B,则  $A\sim B$ , 否则  $A\sim B$ .
- 有更简单的方法判断 A~B或 A~B吗?

- 如何判断 A ~ B?
  - 根据定义,如果经过有限次初等行变换和初等列变换可以把 A 变为 B,则  $A \sim B$ ,否则  $A \sim B$ .
  - 根据初等变换和初等矩阵的联系,如果存在可逆 P和可逆 Q,使得 PAQ=B,则  $A\sim B$ , 否则  $A\sim B$ .
- 有更简单的方法判断 A ~ B 或 A ~ B 吗?
- 有!研究等价矩阵 A 和 B 的共性 (不变性/不变量: 在有限初等变换下保持不变的性质和数量):

- 如何判断 A ~ B?
  - 根据定义,如果经过有限次初等行变换和初等列变换可以把 A 变为 B,则  $A \sim B$ ,否则  $A \sim B$ .
  - 根据初等变换和初等矩阵的联系,如果存在可逆 P和可逆 Q,使得 PAQ=B,则  $A\sim B$ , 否则  $A\sim B$ .
- 有更简单的方法判断 A~B或 A~B吗?
- 有!研究等价矩阵 A 和 B 的共性 (不变性/不变量: 在有限初等变换下保持不变的性质和数量):
  - 例如等价的方阵具有相同的可逆性, 若 A 可逆, B 不可逆, 则必有  $A \sim B$ .

- 如何判断 A ~ B?
  - 根据定义,如果经过有限次初等行变换和初等列变换可以把 A 变为 B,则  $A \sim B$ ,否则  $A \sim B$ .
  - 根据初等变换和初等矩阵的联系,如果存在可逆 P和可逆 Q,使得 PAQ=B,则  $A\sim B$ , 否则  $A\sim B$ .
- 有更简单的方法判断 A~B或 A~B吗?
- 有!研究等价矩阵 A 和 B 的共性 (不变性/不变量: 在有限初等变换下保持不变的性质和数量):
  - 例如等价的方阵具有相同的可逆性, 若 A 可逆, B 不可逆, 则必有  $A \sim B$ .
- 矩阵的秩,一个等价完全不变量: 两个同型矩阵  $A \sim B$  当且仅当 A, B 的秩相同.

• k 阶子式: 任取矩阵  $A_{m \times n}$  的 k 行 k 列,  $k \le \min\{m, n\}$ ,其行列 交叉处的  $k^2$  个元素构成的 k 阶行列式,称为 A 的一个 k 阶子式.

$$\left(\begin{array}{cccccc}
1 & 1 & -2 & 1 & 4 \\
0 & 1 & -1 & 1 & 0 \\
0 & 0 & 0 & 1 & -3 \\
0 & 0 & 0 & 0 & 0
\end{array}\right)$$

• k 阶子式: 任取矩阵  $A_{m \times n}$  的 k 行 k 列,  $k \le \min\{m, n\}$ ,其行列 交叉处的  $k^2$  个元素构成的 k 阶行列式,称为 A 的一个 k 阶子式.

• k 阶子式: 任取矩阵  $A_{m \times n}$  的 k 行 k 列,  $k \le \min\{m, n\}$ ,其行列 交叉处的  $k^2$  个元素构成的 k 阶行列式,称为 A 的一个 k 阶子 式.

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

$$\begin{vmatrix}
1 & 1 & 1 \\
0 & 1 & 1 \\
0 & 0 & 1
\end{vmatrix}$$

• k 阶子式: 任取矩阵  $A_{m \times n}$  的 k 行 k 列,  $k \le \min\{m, n\}$ ,其行列 交叉处的  $k^2$  个元素构成的 k 阶行列式,称为 A 的一个 k 阶子 式.

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

$$\begin{vmatrix}
1 & 1 & 1 \\
0 & 1 & 1 \\
0 & 0 & 1
\end{vmatrix}$$

■ 区分 k 阶子式、子块、余子式、代数余子式.

定义

若 A 存在一个非零 r 阶子式 D, 而所有的 r+1 阶子式都为零 (如果存在), 则称 D 为 A 的最高阶非零子式, 数 r 称为 A 的秩, 记为 R(A) 或 r(A).

定义

若 A 存在一个非零 r 阶子式 D, 而所有的 r+1 阶子式都为零 (如果存在), 则称 D 为 A 的最高阶非零子式, 数 r 称为 A 的秩, 记为 R(A) 或 r(A).

• 
$$R(O) := 0$$
,  $R(E_n) = n$ ,  $R\begin{pmatrix} E_r & O \\ O & O \end{pmatrix} = r$ .

#### 定义

若 A 存在一个非零 r 阶子式 D, 而所有的 r+1 阶子式都为零 (如果存在), 则称 D 为 A 的最高阶非零子式, 数 r 称为 A 的秩, 记为 R(A) 或 r(A).

• 
$$R(O) := 0$$
,  $R(E_n) = n$ ,  $R\begin{pmatrix} E_r & O \\ O & O \end{pmatrix} = r$ .

• 行阶梯形矩阵的秩为非零行的行数.

#### 定义

若 A 存在一个非零 r 阶子式 D, 而所有的 r+1 阶子式都为零 (如果存在), 则称 D 为 A 的最高阶非零子式, 数 r 称为 A 的秩, 记为 R(A) 或 r(A).

• 
$$R(O) := 0$$
,  $R(E_n) = n$ ,  $R\begin{pmatrix} E_r & O \\ O & O \end{pmatrix} = r$ .

• 行阶梯形矩阵的秩为非零行的行数.

$$R \begin{pmatrix} 1 & 1 & -2 & 1 & 4 \\ 0 & 1 & -1 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 1 & -3 \\ 0 & 0 & 0 & 0 & 0 \end{pmatrix} = 3.$$

定理

若  $A \sim B$ , 则 R(A) = R(B).

定理

若  $A \sim B$ , 则 R(A) = R(B).

证明思路:有限次初等变换不改变方阵的行列式是否为零这一 结论.

定理

若  $A \sim B$ , 则 R(A) = R(B).

- 证明思路:有限次初等变换不改变方阵的行列式是否为零这一 结论.
- $A \sim B \Leftrightarrow$  存在可逆 P, Q 使得 PAQ = B.

#### 定理

若  $A \sim B$ , 则 R(A) = R(B).

- 证明思路:有限次初等变换不改变方阵的行列式是否为零这一 结论.
- $A \sim B \Leftrightarrow$  存在可逆 P, Q 使得 PAQ = B. 所以矩阵与可逆矩阵相乘, 秩不变, i.e.

$$R(A) = R(PAQ) = R(PA) = R(AQ).$$

#### 定理

若  $A \sim B$ , 则 R(A) = R(B).

- 证明思路:有限次初等变换不改变方阵的行列式是否为零这一 结论.
- $A \sim B \Leftrightarrow$  存在可逆 P, Q 使得 PAQ = B. 所以矩阵与可逆矩阵相乘, 秩不变, i.e.

$$R(A) = R(PAQ) = R(PA) = R(AQ).$$

• 计算 R(A): 通过初等行变换把 A 化为行阶梯形,

$$R(A) = 行阶梯形的非零行数.$$

# 例题

$$A = \begin{pmatrix} 3 & 2 & 0 & 5 & 0 \\ 3 & -2 & 3 & 6 & -1 \\ 2 & 0 & 1 & 5 & -3 \\ 1 & 6 & -4 & -1 & 4 \end{pmatrix}$$

例

设

$$A = \begin{pmatrix} 1 & 2 & -1 & 1 \\ 3 & 2 & \lambda & -1 \\ 5 & 6 & 3 & \mu \end{pmatrix},$$

已知 
$$R(A) = 2$$
, 求  $\lambda$  和  $\mu$ .

性质

1)  $0 \le R(A_{m \times n}) \le \min\{m, n\};$ 

- 1)  $0 \leq R(A_{m \times n}) \leq \min\{m, n\};$
- 2)  $R(A^T) = R(A)$ ;

- 1)  $0 \leq R(A_{m \times n}) \leq \min\{m, n\};$
- 2)  $R(A^T) = R(A)$ ;
- 3) A, B 同型,则  $A \sim B \Leftrightarrow R(A) = R(B)$ ;

- 1)  $0 \leq R(A_{m \times n}) \leq \min\{m, n\};$
- 2)  $R(A^T) = R(A)$ ;
- 3) A, B 同型,则  $A \sim B \Leftrightarrow R(A) = R(B)$ ;
- 4) 若 P, Q 可逆, 则 R(PAQ) = R(A) = R(PA) = R(AQ);

- 1)  $0 \leq R(A_{m \times n}) \leq \min\{m, n\};$
- 2)  $R(A^T) = R(A)$ ;
- 3) A, B 同型,则  $A \sim B \Leftrightarrow R(A) = R(B)$ ;
- 4) 若 P, Q 可逆,则 R(PAQ) = R(A) = R(PA) = R(AQ);
- 5)  $\max\{R(A), R(B)\} \le R(A, B) \le R(A) + R(B)$ , 特别地,  $R(A) \le R(A, \beta) \le R(A) + 1$ ;

- 1)  $0 \le R(A_{m \times n}) \le \min\{m, n\};$
- 2)  $R(A^T) = R(A)$ ;
- 3) A, B 同型,则  $A \sim B \Leftrightarrow R(A) = R(B)$ ;
- 4) 若 P, Q 可逆,则 R(PAQ) = R(A) = R(PA) = R(AQ);
- 5)  $\max\{R(A), R(B)\} \le R(A, B) \le R(A) + R(B)$ , 特别地,  $R(A) \le R(A, \beta) \le R(A) + 1$ ;
- 6)  $R(A+B) \le R(A) + R(B)$ ;

- 1)  $0 \le R(A_{m \times n}) \le \min\{m, n\};$
- 2)  $R(A^T) = R(A)$ ;
- 3) A, B 同型,则  $A \sim B \Leftrightarrow R(A) = R(B)$ ;
- 4) 若 P, Q 可逆,则 R(PAQ) = R(A) = R(PA) = R(AQ);
- 5)  $\max\{R(A), R(B)\} \le R(A, B) \le R(A) + R(B)$ , 特别地,  $R(A) \le R(A, \beta) \le R(A) + 1$ ;
- 6)  $R(A + B) \le R(A) + R(B)$ ;
- 7)  $R(AB) \le \min\{R(A), R(B)\};$

- 1)  $0 \leq R(A_{m \times n}) \leq \min\{m, n\};$
- 2)  $R(A^T) = R(A)$ ;
- 3) A, B 同型,则  $A \sim B \Leftrightarrow R(A) = R(B)$ ;
- 4) 若 P, Q 可逆,则 R(PAQ) = R(A) = R(PA) = R(AQ);
- 5)  $\max\{R(A), R(B)\} \le R(A, B) \le R(A) + R(B)$ , 特别地,  $R(A) \le R(A, \beta) \le R(A) + 1$ ;
- 6)  $R(A+B) \le R(A) + R(B)$ ;
- 7)  $R(AB) \leq \min\{R(A), R(B)\};$
- 8) 若  $A_{m \times n} B_{n \times l} = O$ , 则  $R(A) + R(B) \le n$ .

例

证明: 若  $A_{m \times n} B_{n \times l} = C$ , 且 R(A) = n, 则 R(B) = R(C).

- $R(A_{m \times n}) = n$ , 则称 A 为列满秩矩阵;  $R(A_{m \times n}) = m$ , 则称 A 为 行满秩矩阵;  $R(A_{m \times n}) = n = m$ , 则称 A 为满秩矩阵.
- AB = O, A 列满秩, 则 B = O. 即 A 列满秩, 则有左消去律; 同理. B 行满秩. 则有右消去律。
- A 可逆 ⇔ A 满秩.

例

设 A 为 n 阶矩阵, 证明  $R(A+E)+R(A-E) \ge n$ .

# 线性方程组解的存在性

## 秩的应用: 判断 $AX = \beta$ 解的存在性.

#### 定理

设  $A_{m \times n} X = \beta$  为一个非齐次 n 元线性方程组,则方程组

- $\mathcal{L}$   $\mathbf{K} \Leftrightarrow R(A) < R(A, \beta)$ ;
- $f \bowtie R(A) = R(A, \beta);$ 
  - 有唯一解  $\Leftrightarrow$   $R(A) = R(A, \beta) = n$ ;
  - 有无穷解  $\Leftrightarrow R(A) = R(A, \beta) < n$ .

## 秩的应用: 判断 $AX = \beta$ 解的存在性.

### 定理

设  $A_{m \times n} X = \beta$  为一个非齐次 n 元线性方程组,则方程组

- $\mathcal{K}$  $R(A) < R(A, \beta)$ ;
- $f \bowtie R(A) = R(A, \beta);$ 
  - 有唯一解  $\Leftrightarrow$   $R(A) = R(A, \beta) = n$ ;
  - 有无穷解  $\Leftrightarrow R(A) = R(A, \beta) < n$ .

### 推论

齐次线性方程组 AX = 0 有非零解 ⇔ R(A) < n.

例

求解

$$\begin{cases} x_1 + x_2 - 3x_3 - x_4 &= 1\\ 3x_1 - x_2 - 3x_3 + 4x_4 &= 4\\ x_1 + 5x_2 - 9x_3 - 8x_4 &= 0 \end{cases}$$

例

设

$$\begin{cases} (1+\lambda)x_1 + x_2 + x_3 &= 0\\ x_1 + (1+\lambda)x_2 + x_3 &= 0\\ x_1 + x_2 + (1+\lambda)x_3 &= 0 \end{cases}$$

讨论  $\lambda$  取何值时,方程组有唯一解,无解,无穷解?并在有无穷解时求通解.

定理

矩阵方程 AX = B 有解  $\Leftrightarrow R(A) = R(A, B)$ .

定理

矩阵方程 AX = B 有解  $\Leftrightarrow R(A) = R(A, B)$ .

定理

 $R(AB) \leq \min\{R(A), R(B)\}.$ 

## 小结

- 1. R(A);
- 2、 求解  $A(X) = \beta$ .

## 练习

例

求解

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

## 作业

- P78-80. 10-(3)、12、14-(4)、17、20.
- 本次作业下周四之前提交电子版,下周四收发作业本.

## 欢迎提问和讨论

吴利苏 (http://wulisu.cn)

Email: wulisu@sdust.edu.cn

2022 年 9 月 28 日