

矩阵论笔记

(持续更新)

匿了个名

2021 年 10 月 15 日

目录

关于	4
0.1 动机	4
0.2 目标	4
0.3 感谢	4
0.4 记号	4
第一章 基础知识	6
1.1 向量空间	6
线性空间的定义及例子	6
子空间	8
线性相关性	9
线性空间的基	10
第二章 矩阵的相似变换	12
2.1 特征值与特征向量	12
2.2 相似对角化	13
2.3 Jordan 标准形介绍	14
用 λ 矩阵的理论求解 Jordan 标准形.	15
2.4 Hamilton-Cayley 定理	17
2.5 向量的内积	18
2.6 酉相似下的标准形	20
第三章 范数理论	23
3.1 向量范数	23
3.2 广义矩阵范数	25

3.3	矩阵范数	26
3.4	范数应用举例	27
	方阵的谱半径	27
3.5	条件数：矩阵逆和线性方程的解	28
第四章	矩阵分析	30
4.1	矩阵序列	30
4.2	矩阵函数	30
4.3	矩阵的微积分	33
第五章	矩阵分解	34
5.1	QR 分解	34
第六章	矩阵的特殊乘积	35
6.1	Kronecker 积	35
6.2	一些基础	35
第七章	附录	38
7.1	其它知识补充	38
7.2	集合运算	38
	映射的定义	39
	集函数	40
	关系	41
	代数基本定理	43
7.3	拓扑知识介绍	43
	距离空间	43
	拓扑空间	45
	习题	49
7.4	极限	49
	序列极限	49
	级数	53
	函数极限	55
	习题	59
	参考文献	60

关于

课程名称：矩阵论

学时：40

描述：

教材 [1] 及参考资料：[2, 1, 3, 4].

0.1 动机

TODO.

0.2 目标

1. todo
2. todo..

0.3 感谢

感谢认真听课的同学们，没有他们此文稿不会存在.

0.4 记号

有些记号不一定能用上，但我们先列出来.

- $A := B$ 或者 $A \stackrel{\text{def}}{=} B$ ，表示 A 定义为 B .

- “命题 A 是真的, 由定义, 如果命题 B 是真的.” 可以用 $A : \Longleftrightarrow B$ 表示. 例如, $A \subseteq B$ 是指 $\forall x \in A$ 有 $x \in B$, 可以写成 $A \subseteq B : \Longleftrightarrow \forall x \in A, x \in B$.

设 E 是某个性质, $E(x)$, 表示 x 具有性质 E .

- 记号 $\{x \in X; E(x)\}$ 或者 $\{x \in X | E(x)\}$ 表示集合 X 中具有性质 E 的元素 x 构成的集合. 我们习惯用竖线这种表示方式 $\{x \in X | E(x)\}$.
- $\exists x \in X : E(x)$ 或者 $\exists x \in X, E(x)$, 表示存在 $x \in X$ 使得 x 有性质 E .
- $\forall x \in X : E(x)$ 或者 $\forall x \in X, E(x)$, 表示对于任意 $x \in X$, x 都有性质 E , $E(x)$ 是真.
- “对于所有的 $x \in X$, $E(x)$ 成立”, 这句话, 也可以用 “ $E(x), x \in X$ ” 表示.
- $\mathbb{N} := \{1, 2, \dots\}$ 自然数集.
- $\mathbb{Z}, \mathbb{Q}, \mathbb{R}, \mathbb{C}$ 分别是整数集、有理数集、实数集、复数集.
- $\mathbb{Z}_{\geq 0} := \{0, 1, 2, \dots\}$ 非负整数集.
- \mathbb{F} 表示实数域 \mathbb{R} 或者复数域 \mathbb{C} .
- \mathbb{F}^n 表示域 \mathbb{F} 上的 n 维列向量全体. 例如当 $\mathbb{F} = \mathbb{R}$ 时, 做为集合它表示 $\left\{ \begin{pmatrix} x_1 \\ x_2 \\ \vdots \\ x_n \end{pmatrix} \middle| x_1, x_2, \dots, x_n \in \mathbb{R} \right\}$.
- $\mathbb{F}^{m \times n}$ 表示域 \mathbb{F} 上 $m \times n$ 矩阵全体. 那么 $A = (a_{ij})_{m \times n}$ (其中 $a_{ij} \in \mathbb{F}$) 就是 $\mathbb{F}^{m \times n}$ 中的一个矩阵.
- $\mathbb{F}[t]$ 表示的是以 t 为不定元的系数属于 \mathbb{F} 的一元多项式全体构成的集合.

第一章 基础知识

1.1 向量空间

线性空间的定义及例子

定义 1.1. 本书中域 \mathbb{F} 指的是实数域 \mathbb{R} 或者复数域 \mathbb{C} . 通常情况下, 我们会直接在复数域 \mathbb{C} 下工作. 关于“域”的严格定义需要参考近世代数/抽象代数的相关知识.

定义 1.2. (向量空间/线性空间) 设 V 是一个非空集合, 域 \mathbb{F} 为实数域 \mathbb{R} 或者复数域 \mathbb{C} . 集合 V 上赋予一种运算, 称为加法, $+: V \times V \rightarrow V, (x, y) \mapsto x+y$. 集合 V 与域 \mathbb{F} 之间赋予了一种运算, 称为数乘, $\bullet: \mathbb{F} \times V \rightarrow V, (a, x) \mapsto ax$.

• 加法运算满足:

1. 结合律: $\forall x, y, z \in V$, 有 $(x+y)+z = x+(y+z)$.
2. 交换律: $\forall x, y \in V$, 有 $x+y = y+x$.
3. 有零元: $\exists \theta \in V, \forall x \in V$, 有 $\theta+x = x+\theta = x$.
(可以证明上述 θ 是唯一的, 通常将 θ 记为 0.)
4. 有负元: $\forall x \in V, \exists y \in V$ 使得 $x+y = y+x = 0$.
(可以证明 y 是唯一的, 记为 $-x$.)

• 数乘运算满足: $\forall a, b \in \mathbb{F}, \forall x \in V$ 有

5. “结合律” $(ab)x = a(bx)$, .
6. “分配律” $a(x+y) = ax+ay$
7. “分配律” $(a+b)x = ax+bx$
8. “酉性”: $1x = x$.

$(V, \mathbb{F}, +, \cdot)$ 一起考虑, 称 V 为 \mathbb{F} 上的一个线性空间, V 中的元素称为向量. 当 $\mathbb{F} = \mathbb{R}$ 时, 称为实线性空间. 当 $\mathbb{F} = \mathbb{C}$ 时, 称为复线性空间.

例 1.1. \mathbb{F}^n 是 \mathbb{F} 上的线性空间, 其中

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

$$a \begin{pmatrix} x_1 \\ x_2 \\ \vdots \\ x_n \end{pmatrix} := \begin{pmatrix} ax_1 \\ ax_2 \\ \vdots \\ ax_n \end{pmatrix}.$$

例 1.2. $\mathbb{F}^{m \times n}$ 按照矩阵的加法, 按照数与矩阵的乘法, 构成 \mathbb{F} 上的一个线性空间. $\mathbb{R}^{m \times n}$ 称为 $m \times n$ 实矩阵空间. $\mathbb{C}^{m \times n}$ 称为 $m \times n$ 复矩阵空间.

例 1.3. $\mathbb{F}[x]$ 表示以 x 为不定元的系数在域 \mathbb{F} 上多项式全体, 按照多项式的加法, 数与多项式的乘法, 构成线性空间.

例 1.4. $\mathbb{F}[x]_n = \{f(x) \mid f(x) = a_0 + a_1x + \cdots + a_nx^n, a_i \in \mathbb{F}\}$ 按照多项式的加法, 数与多项式的乘法, 构成线性空间.

例 1.5. $C[a, b]$ 表示闭区间 $[a, b]$ 上的所有实值连续函数的集合, 按函数乘法, 按数与函数的数量乘法, 构成线性空间.

例 1.6. (重要例子) 设 $A \in \mathbb{F}^{m \times n}$, 齐次线性方程组的解集:

$$W = \{x \in \mathbb{F}^n \mid Ax = 0\}$$

按照 \mathbb{F}^n 中的加法和数量乘法, W 构成 \mathbb{F} 上的线性空间, 称 W 为齐次线性方程组 $Ax = 0$ 的解空间. 也称为矩阵 A 的零空间 (Nullspace) 或核空间 (Kernel), 记为 $\mathcal{N}(A)$ 或者 $\text{Ker}(A)$.

例 1.7. (重要例子) 设 $A \in \mathbb{F}^{m \times n}$,

$$V = \{y \in \mathbb{F}^m \mid y = Ax, x \in \mathbb{F}^n\}$$

按照 \mathbb{F}^m 中的加法和数量乘法, V 构成 \mathbb{F} 上的线性空间. V 称为 A 的列空间或像空间, 记为 $\mathcal{R}(A), \text{Im}(A)$.

线性空间有以下基本性质:

1. 零元唯一, 负元唯一.
2. $a0 = 0, 0x = 0, (-1)x = -x$.
3. 如果 $ax = 0$, 那么或者 $a = 0$ 或者 $x = 0$.

子空间

定义 1.3. (子空间) 域 \mathbb{F} 上的一个线性空间 V 的一个非空子集 W , 如果 W 对于 V 的两种运算也构成域 \mathbb{F} 上的线性空间, 则称 W 是 V 的一个线性子空间.

定理 1.1. 设 V 为域 \mathbb{F} 上的一个线性空间, W 是 V 的非空子集. 那么 W 能成为子空间当且仅当 W 关于 V 的两种运算是封闭的, 即

1. $\forall x, y \in W$, 有 $x + y \in W$.
2. $\forall x \in W, \forall a \in \mathbb{F}$, 有 $ax \in W$.

例 1.8. 线性空间 V 中, 由单个零向量构成的子集是一个线性子空间, 叫做零子空间. 线性空间 V 本身也是 V 的一个子空间. 这两个子空间通常称为 V 的平凡子空间, 其它子空间叫做非平凡子空间.

例 1.9. 子空间的交是子空间. 假设 $W_j (j \in J)$ 都是线性空间 V 的子空间, 那么 $\cap_{j \in J} W_j$ 也是 V 的子空间.

定义 1.4. 设 V 是域 \mathbb{F} 上的线性空间, S 是 V 的子集合. 由 S 张成/生成的子空间, 记号为 $\text{span}(S)$, 是指 V 中包含集合 S 的所有子空间的交. 那么 $\text{span}(S)$ 恰好是包含 S 的 V 的最小子空间. 如果 $S = \emptyset$, 那么 $\text{span}(S) = \{0\}$. 如果 $S \neq \emptyset$, 那么

$$\text{span}(S) = \{a_1x_1 + \cdots + a_kx_k \mid x_1, \dots, x_k \in S, a_1, \dots, a_k \in \mathbb{F}, k = 1, 2, \dots\}.$$

最后, 我们说 V 由 S 张成, 如果 $\text{span}(S) = V$, 此时也说 S 是 V 的生成集.

例 1.10. 设 $A \in \mathbb{R}^{m \times n}$, 那么 A 的所有列向量生成的空间恰好就是 A 的像空间 $\mathcal{R}(A)$.

定义 1.5. 设 V 是域 \mathbb{F} 上的线性空间, k 为正整数, $a_1, \dots, a_k \in \mathbb{F}$, 而 $v_1, \dots, v_k \in V$, 那么表达式 $a_1v_1 + a_2v_2 + \dots + a_kv_k$ 称为 v_1, \dots, v_k 的一个线性组合. 因此由非空子集 S 张成的子空间 $\text{span}(S)$ 中的每个向量恰好就是 S 中有限多个向量构成的线性组合. 我们说线性组合 $a_1v_1 + a_2v_2 + \dots + a_kv_k$ 是平凡的, 如果 $a_1 = a_2 = \dots = a_k = 0$; 否则称为非平凡的.

定义 1.6. 设 V 是域 \mathbb{F} 上的线性空间, V_1, V_2 是 V 的子空间.

$$V_1 + V_2 := \{x + y \mid x \in V_1, y \in V_2\}$$

称为 V_1, V_2 的和空间. 显然有 $V_1 + V_2 = \text{span}(V_1 \cup V_2)$. 如果和空间 $V_1 + V_2$ 每个元素 z 的分解式

$$z = x + y \quad (x \in V_1, y \in V_2)$$

是唯一的, 那么称和 $V_1 + V_2$ 是直和, 此时记为 $V_1 \oplus V_2$. 进一步, 如果 $V = V_1 \oplus V_2$, 称 V_1 是 V_2 在 V 中的一个直和补空间, 称 V_2 是 V_1 在 V 中的一个直和补空间, 简单称 V_1, V_2 为在 V 中的直和互补空间.

类似地可以给出有限个子空间的和 $\sum_{i=1}^k V_i$ 的定义, 以及和 $\sum_{i=1}^k V_i$ 为直和 $\oplus_{i=1}^k V_i$ 的定义.

注 1.1. 注意! “子空间的交”与“集合之间的交”是一致的, 但是“子空间的和”与“集合的并”的概念是不一致的.

定理 1.2. 设 V 是域 \mathbb{F} 上的线性空间, V_1, V_2 是 V 的子空间. 那么 $V_1 + V_2$ 是直和当且仅当 $V_1 \cap V_2 = \{0\}$.

线性相关性

定义 1.7. 设 V 是域 \mathbb{F} 上的线性空间, $v_1, v_2, \dots, v_k \in V$. 如果存在不全为零的数 $a_1, a_2, \dots, a_k \in \mathbb{F}$ 使得 $a_1v_1 + a_2v_2 + \dots + a_kv_k = 0$, 就称 v_1, v_2, \dots, v_k 是线性相关的. 如果只有平凡的线性组合才能是零向量, 就称 v_1, v_2, \dots, v_k 是线性无关的.

设 $S \subseteq V$, 说 S 是线性相关集, 如果 S 中有有限个向量是线性相关的. 说 S 是线性无关集, 如果 S 中任意有限个向量线性无关. 空集 \emptyset 是线性无关集.

定义 1.8. 设 V 是域 \mathbb{F} 上的线性空间, $x_1, x_2, \dots, x_s \in V$, $y_1, y_2, \dots, y_t \in V$ 称 x_1, x_2, \dots, x_s 能被 y_1, y_2, \dots, y_t 线性表示/线性表出, 如果每个 x_k 都是 y_1, y_2, \dots, y_t 的线性组合. 称 x_1, x_2, \dots, x_s 和 y_1, y_2, \dots, y_t 是线性等价的, 如果它们能相互线性表出.

更一般的, 假设 $S \subseteq V, T \subseteq V$, 我们说 S 可由 T 线性表示, 如果 $S \subseteq \text{span}(T)$; 称 S 和 T 是线性等价的, 如果 $\text{span}(S) = \text{span}(T)$.

常用结论:

1. 单个向量 x 线性相关当且仅当 $x = 0$. 两个以上的向量线性相关当且仅当其中有一个向量能被其余向量线性表出.
2. 设 x_1, \dots, x_r 线性无关, 且 x_1, \dots, x_r 可以由 y_1, \dots, y_s 线性表出, 那么 $r \leq t$.
3. 设 x_1, \dots, x_r 线性无关, 且 x_1, \dots, x_r, y 线性相关, 那么 y 可以由 x_1, \dots, x_r 线性表示且表法唯一.

例 1.11. 实多项式 $\mathbb{R}[t]$ 空间, $\{1, t, t^2, \dots\}$ 构成线性无关集.

线性空间的基

定义 1.9. 设 V 是域 \mathbb{F} 上的线性空间. 若 S 是 V 中的线性无关子集且 $\text{span}(S) = V$, 那么称 S 是 V 的基.

关于线性空间的基有以下性质.

定理 1.3. 设 V 是域 \mathbb{F} 上的线性空间.

1. S 是基当且仅当它是极大线性无关集. 子集 A 是极大线性无关集是指满足以下性质的集合:
 - A 是线性无关的.
 - 如果 $A \subseteq B \subseteq V$ 且 B 是线性无关集, 则必有 $B = A$.
2. S 是基当且仅当它是极小生成集. 子集 A 是极小生成集是指满足以下性质的集合:
 - A 是生成集, 即 $\text{span}(A) = V$.
 - 如果 $B \subseteq A$ 且 $\text{span}(B) = V$, 则必有 $B = A$.

3. (基存在定理) 线性空间必存在基.
4. 如果 V 存在一个基由 n (这里 n 是一个非负整数) 个元素构成, 那么 V 的任意一个基都是由 n 个元素构成. 此时我们说 V 是有限维的且维数是 n , 记为 $\dim V = n$, 简称 V 是 n 维线性空间. 如果 V 不是有限维的, 就称 V 是无限维的.
5. (基扩充定理) 假设 A 是 V 的一个线性无关集, 那么存在基 B 使得 $A \subseteq B$. 也就是说从一个线性无关集出发, 可以将其扩充为 V 的一个基, 特别的, 由于空集是线性无关集, 从空集出发扩充成 V 的一个基, 这就得到了基存在定理.
6. $\dim V = 0$ 当且仅当 $V = \{0\}$. 此时 V 只有一个基: \emptyset .
7. 如果 $\dim V = n$, 设 W 是 V 的任意一个子空间, 则 W 都是有限维的且 $\dim W \leq \dim V$.

第二章 矩阵的相似变换

2.1 特征值与特征向量

本节给出特征值和特征向量的一些基本性质.

本节记号约定: A 总是指 n 阶复方阵. $f(t), f$ 总是指多项式.

定义 2.1. 特征值与特征向量的定义. 设 $\lambda \in \mathbb{C}$, $x \in \mathbb{C}^n$ 且 $x \neq 0$ 满足 $Ax = \lambda x$. 称 λ 为 A 的一个特征值, x 为对应于特征值 λ 的特征向量, 称 (λ, x) 为特征对 eigenpair. 记号 $\sigma(A)$ 表示 A 的全部特征值全体的集合, 称为 A 的谱.

显然, λ_0 为 A 的特征值.

$$\iff \exists x_0 \neq 0, \text{ 使得 } x_0 \text{ 满足 } x \text{ 的方程 } Ax = \lambda_0 x.$$

$$\iff (\lambda_0 I - A)x = 0 \text{ 有非零解.}$$

$$\iff \det(\lambda_0 I - A) = 0.$$

$$\iff \lambda_0 \text{ 为 } n \text{ 次多项式 } \varphi(\lambda) = \det(\lambda I - A) \text{ 的一个零点.}$$

于是我们推广 A 的特征值的定义如下:

定义 2.2. 关于不定元 λ 的 n 次多项式 $\varphi(\lambda) = \det(\lambda I - A)$ 的 n 个零点 $\lambda_1, \dots, \lambda_n$ (连同重数计算在内) 为 A 的 n 个特征值, 即 $\varphi(\lambda)$ 有分解式 $\varphi(\lambda) = (\lambda - \lambda_1) \cdots (\lambda - \lambda_n)$, 而 $\varphi(\lambda)$ 称为 A 的特征多项式, 带有不定元 λ 的矩阵 $\lambda I - A$ 称为 A 的特征矩阵.

练习. 方阵 $A = \text{diag}(d_1, d_2, \dots, d_n)$ 的特征值和特征向量?

定义 2.3. 设 λ_i 是 $A_{n \times n}$ 的特征值, 那么 λ_i 做为 A 的特征多项式的根, 其根的重数 $\mu_A(\lambda_i)$ 称为特征值 λ_i 的代数重数. 而齐次线性方程 $(A - \lambda_i I)x = 0$ 的解空间维数 $\gamma_A(\lambda_i)$ 称为 λ_i 的几何重数, 即任一个基础解系所含向量元素个数, 也等于 $n - \text{rank}(A - \lambda_i I)$.

定理 2.1. 几何重数 \leq 代数重数.

定义 2.4. 设 $f(\lambda) = a_m \lambda^m + a_{m-1} \lambda^{m-1} + \cdots + a_0 \in \mathbb{C}[\lambda]$, $A \in \mathbb{C}^{n \times n}$, 规定 $f(A) = a_m A^m + a_{m-1} A^{m-1} + \cdots + a_1 A + a_0 I$ 称为 A 的一个多项式. 也可以记为 $f(A) = \sum_{i=0}^m a_i A^i$, 此时我们约定 $A^0 = I$.

定理 2.2. 设 $A \in \mathbb{C}^{n \times n}$, (λ, x) 为 A 的一个特征对, $f(t) \in \mathbb{C}[t]$.
 $\implies (f(\lambda), x)$ 为 $f(A)$ 的一个特征对.

注 2.1. 以后我们会得到一个更强的结论: $A \in \mathbb{C}^{n \times n}$ 的 n 个特征值为 $\lambda_1, \dots, \lambda_n$, $f(t) \in \mathbb{C}[t]$. 那么 $f(A)$ 的 n 个特征值为 $f(\lambda_1), \dots, f(\lambda_n)$.

定理 2.3. 方阵的不同特征值对应的特征向量线性无关.

证明. 设 $A, v_1, \dots, v_s, \lambda_1, \dots, \lambda_s$, 设 $a_1 v_1 + \cdots + a_s v_s = 0$. 对于任何一个多项式 $g(t) \in \mathbb{C}[t]$, 有 $g(A)(\sum_k a_k v_k) = \sum_k a_k g(\lambda_k) v_k$. 对于任意取定的 k , 我们找一个多项式 g_k 使得 $g_k(\lambda_k) \neq 0, g_k(\lambda_j) = 0$, 则说明 $a_k = 0$. \square

定理 2.4. 由不同特征值对应的线性无关特征向量组并起来的向量组也是线性无关的.

定理 2.5. 设 A 为 n 阶方阵, 其 n 个特征值为 $\lambda_1, \dots, \lambda_n$, 那么 A^T 的 n 个特征值为 $\lambda_1, \dots, \lambda_n$, 而 A^H 的 n 个特征值为 $\bar{\lambda}_1, \dots, \bar{\lambda}_n$.

定理 2.6. $Tr(AB) = Tr(BA)$.

定理 2.7. A 为 n 阶复方阵, $\lambda_1, \dots, \lambda_n$ 为 n 个特征值, 那么 $tr(A) = \lambda_1 + \cdots + \lambda_n$, $det(A) = \lambda_1 \cdots \lambda_n$.

2.2 相似对角化

定义 2.5. 设 $A, B \in \mathbb{C}^{n \times n}$. 若存在可逆阵 $P \in \mathbb{C}^{n \times n}$ 使得 $P^{-1}AP = B$, 称 A 相似于 B .

简单性质:

1. 矩阵的相似关系是一个等价关系.
 从而 A 相似于 B , 我们也称 A 与 B 相似.
2. 相似的矩阵具有相同的特征多项式.

3. 若 A 与 B 相似, 则矩阵多项式 $f(A)$ 与 $f(B)$ 相似.

定义 2.6. 如果一个矩阵相似于一个对角矩阵, 就称矩阵**可对角化**.

定理 2.8. n 阶方阵可对角化的充要条件是具有 n 个线性无关的特征向量.

推论 2.1. 如果 n 阶方阵有 n 个不同特征值, 那么可以对角化.

定理 2.9. 一个方阵可以对角化, 当且仅当对于它的每个特征值其代数重数与几何重数相等.

2.3 Jordan 标准形介绍

The Jordan normal form is named after Camille Jordan, who first stated the Jordan decomposition theorem in 1870.

定义 2.7. 形如

$$J_i = \begin{bmatrix} \lambda_i & 1 & & \\ & \lambda_i & \ddots & \\ & & \ddots & 1 \\ & & & \lambda_i \end{bmatrix}_{r_i \times r_i}$$

的矩阵称为 r_i 阶 **Jordan 块**, 由若干个 Jordan 块构成的分块对角矩阵

$$J = \begin{bmatrix} J_1 & & \\ & J_2 & \\ & & \ddots \\ & & & J_s \end{bmatrix}$$

称为 **Jordan 矩阵**.

定理 2.10. (*Jordan*) 任何一个 n 阶复方阵 A 都可以相似于一个 *Jordan* 矩阵 J . 这个矩阵 J 在除 *Jordan* 块的排列次序外由 A 唯一确定, 称 J 为 A 的 *Jordan* 标准形.

从这个大定理我们可以得到以下结果.

1. 重数计算在内, J 的所有特征值, 从而是 A 的所有特征值, 就是 J 的对角元素.

2. 对于给定的特征值 λ , 它的几何重数等于 $n - \text{rank}(A - \lambda I)$, 等于对应于特征值 λ 的 Jordan 块的块数.
3. 对于给定的特征值 λ , 所有对应于特征值 λ 的 Jordan 块的阶数之和等于特征值 λ 的代数重数.
4. 方阵 A 可以对角化当且仅当对于 A 的每个特征值 λ 其代数重数等于其几何重数.
5. 对应于特征值 λ 的 Jordan 块中的阶数至少是 j 的块数有 $\text{Rank}(A - \lambda I)^{j-1} - \text{Rank}(A - \lambda I)^j$, 因此阶数刚好为 j 的块有

$$\text{Rank}(A - \lambda I)^{j-1} + \text{Rank}(A - \lambda I)^{j+1} - 2\text{Rank}(A - \lambda I)^j.$$

6. 对于特征值 λ , 它在极小多项式中的根的重数等于其对应的 Jordan 块中最大的一个的阶数.

我们证明其中一条, 记 $N = J_n(0)$, 那么 $\text{rank}(N^k) = \begin{cases} n - k, & k \leq n \\ 0, & k \geq n \end{cases}$. 那么

$$\text{rank}(N^{k-1}) - \text{rank}(N^k) = \begin{cases} 1, & 1 \leq k \leq n \\ 0, & k > n \end{cases}.$$

考虑 $\text{rank}(A - \lambda I)^{j-1} - \text{rank}(A - \lambda I)^j$, 则

$$\mu_j(\lambda) = \text{rank}(A - \lambda I)^{j-1} - \text{rank}(A - \lambda I)^j = \sum (\text{rank}(J_{r_i}^{j-1}(\lambda_i - \lambda)) - \text{rank}(J_{r_i}^j(\lambda_i - \lambda)))$$

$$\text{rank}(J_{r_i}^{j-1}(\lambda_i - \lambda)) - \text{rank}(J_{r_i}^j(\lambda_i - \lambda)) = \begin{cases} 0, & \lambda \neq \lambda_i \\ 1, & \lambda = \lambda_i \text{ 且 } 1 \leq j \leq r_i \\ 0, & \lambda = \lambda_i \text{ 且 } j > r_i \end{cases}$$

于是 $\mu_j(\lambda) = \#\{i | \lambda = \lambda_i \text{ 且 } 1 \leq j \leq r_i\}$ 即 A 中 Jordan 块里面以 λ 为特征值的且块的阶数大于等于 j 的那些 Jordan 块的块数. 最后我们得到 A 中 $J_j(\lambda)$ 的块数为 $\mu_j(\lambda) - \mu_{j+1}(\lambda)$.

用 λ 矩阵的理论求解 Jordan 标准形.

定义 2.8. 设 $A(\lambda) = (a_{ij}(\lambda))_{m \times n}$, 其中 $a_{ij}(\lambda)$ 都是 λ 的多项式, 称 $A(\lambda)$ 是 λ 矩阵.

λ 矩阵经过初等变换可以化为 Smith 标准形.

定理 2.11. 秩为 r 的 λ 矩阵 $A(\lambda)$ 可通过初等变换化为如下形式的矩阵

$$S(\lambda) = \begin{bmatrix} d_1(\lambda) & & & \\ & d_2(\lambda) & & \\ & & \ddots & \\ & & & d_r(\lambda) \\ & & & & 0 \end{bmatrix}$$

其中 $d_i(\lambda)$, $i = 1, 2, \dots, r$ 都是首一多项式, 且 $d_i | d_{i+1}$. 这个 $S(\lambda)$ 是由 $A(\lambda)$ 唯一确定的, 称为 *Smith 标准形*, d_i 称为 $A(\lambda)$ 的不变因子.

按以下步骤可以求出复方阵 A 的 Jordan 标准形.

1. 将 $\lambda I - A$ 化为 Smith 标准形, 求出 d_1, d_2, \dots, d_n , 称为 A 的不变因子.
2. 将 A 中每个次数大于零的不变因子进行分解因式分解成一次因式方幂的乘积, 全部这些一次方幂合在一起称为 A 的初等因子 (组), 设 A 的初等因子 (组) 为

$$(\lambda - \lambda_1)^{r_1}, (\lambda - \lambda_2)^{r_2}, \dots, (\lambda - \lambda_s)^{r_s}$$

其中 $\lambda_1, \lambda_2, \dots, \lambda_s$ 可能相同, $r_1 + r_2 + \dots + r_s = n$.

3. 对于每个初等因子 $(\lambda - \lambda_i)^{r_i}$ 写出对应的 Jordan 块 $J_{r_i}(\lambda_i)$
4. A 的 Jordan 标准形就是 $J_{r_1}(\lambda_1) \oplus J_{r_2}(\lambda_2) \oplus \dots \oplus J_{r_s}(\lambda_s)$

行列式因子法

定义 2.9. 设 λ 矩阵 $A(\lambda)$ 的秩为 r , 对于正整数 $k(1 \leq k \leq r)$, $A(\lambda)$ 的全部 k 阶行列式的首一的最大公因式 $D_k(\lambda)$ 称为 $A(\lambda)$ 的 k 阶行列式因子.

定理 2.12. 设 $A(\lambda)$ 是秩为 r 的 $m \times n$ 矩阵, 则 $A(\lambda)$ 的行列式因子 $D_k(\lambda)$ 为

$$D_k = d_1 d_2 \cdots d_k$$

其中 d_i 是 $A(\lambda)$ 的第 i 个不变因子.

对于一个 n 阶复方阵 A , 我们称 $\lambda I - A$ 的不变因子为 A 的不变因子, $\lambda I - A$ 的行列式因子为 A 的行列式因子. 注意到这个时候 $\lambda I - A$ 的秩是 n , $\lambda I - A$ 的 n 个行列式因子 D_1, D_2, \dots, D_n 就决定了 A 的 n 个不变因子, 从而确定了 A 的初等因子, 确定出它的 Jordan 标准形.

λ 矩阵的理论是很强的理论, 对于域 F 上的方阵 A 和 B 有下面定理

定理 2.13. 设 A, B 为域 F 上的两个 n 阶方阵, 则 A 与 B 相似 (即存在 F 上的 n 阶可逆矩阵 P 使得 $P^{-1}AP = B$) 当且仅当 A, B 具有相同的不变因子或者具有相同的行列式因子.

定理 2.14. $J = \begin{pmatrix} \lambda_0 & 1 & & \\ & \lambda_0 & \ddots & \\ & & \ddots & 1 \\ & & & \lambda_0 \end{pmatrix}_{n \times n}$, 则

$$J^k = \sum_{i=0}^{\infty} \frac{k(k-1)\cdots(k-i+1)}{i!} \lambda_0^{k-i} N^i = \sum_{i=0}^{\infty} \frac{1}{i!} (\lambda^k)^{(i)} N^i \Big|_{\lambda=\lambda_0}$$

于是对于一个多项式 $f(\lambda)$ 而言, $f(J) = \sum_{i=0}^{\infty} \frac{f^{(i)}(\lambda_0)}{i!} N^i$, 其中 $N = J_n(0)$.

定理 2.15. 设 A, B 是 n 阶方阵, 并且是上三角矩阵, 则 AB 也是上三角矩阵, 且 AB 对角线元素为 A, B 对角线元素之积.

定理 2.16. 设 A 的 n 个特征值为 $\lambda_1, \dots, \lambda_n$, $f(t)$ 为一个多项式, 则 $f(A)$ 的 n 个特征值为 $f(\lambda_1), \dots, f(\lambda_n)$.

2.4 Hamilton-Cayley 定理

定理 2.17. 设 $A \in \mathbb{C}^{n \times n}$, 特征多项式 $\varphi(\lambda) = \det(\lambda I - A)$, 则 $\varphi(A) = 0$.

例 2.1. 已知矩阵 $A = \begin{pmatrix} -1 & 1 & 0 \\ -4 & 3 & 0 \\ 1 & 0 & 2 \end{pmatrix}$, 计算 $A^7 - A^5 - 19A^4 + 28A^3 + 6A - I$,

A^{-1}, A^{100} .

定义 2.10. 设 $A \in \mathbb{C}^{n \times n}$, $f(\lambda)$ 是一个多项式. 如果有 $f(A) = 0$, 则称 f 为零化 A 的一个多项式.

定义 2.11. 设 $A \in \mathbb{C}^{n \times n}$, 在零化 A 的多项式中, 次数最低且首一的多项式称为 A 的极小多项式, 记为 $m_A(\lambda)$.

定理 2.18. 方阵 A 的极小多项式 $m_A(\lambda)$ 整除任何一个零化 A 的多项式, 且极小多项式是唯一的.

定理 2.19. 方阵 A 的极小多项式 $m_A(\lambda) = d_n(\lambda)$, 其中 d_n 为 A 的第 n 个不变因子.

定理 2.20. 方阵 A 的特征值都是其极小多项式 $m_A(\lambda)$ 的零点, 即若 λ_0 是 A 的特征值, 那么 $m_A(\lambda_0) = 0$.

定理 2.21. 相似的矩阵具有相同的极小多项式.

定理 2.22. 复方阵可相似对角化当且仅当它的极小多项式没有重根.

例 2.2. 例如 n 阶幂等阵 A , 满足 $A^2 = A$, 那么 A 必然相似于 $\begin{pmatrix} I_r & 0 \\ 0 & -I_s \end{pmatrix}$, 其中 r 为 A 的特征值 $\lambda = 1$ 的代数重数, $s = n - r$.

2.5 向量的内积

定义 2.12. 在 \mathbb{R}^n 中, 我们定义两个向量的通常内积如下: 对于任意 $x = \begin{pmatrix} x_1 \\ x_2 \\ \vdots \\ x_n \end{pmatrix}$, $y = \begin{pmatrix} y_1 \\ y_2 \\ \vdots \\ y_n \end{pmatrix}$, 令 $(x, y) = \sum_{i=1}^n x_i y_i = y^T x$.

那么实空间 \mathbb{R}^n 的通常内积满足以下三条公理:

1. 正定性:
2. 对称性
3. 第一变元线性性

定义 2.13. 在 \mathbb{C}^n 中, 我们定义两个向量的通常内积如下: 对于任意 $x = \begin{pmatrix} x_1 \\ x_2 \\ \vdots \\ x_n \end{pmatrix}$, $y = \begin{pmatrix} y_1 \\ y_2 \\ \vdots \\ y_n \end{pmatrix}$, 令 $(x, y) = \sum_{i=1}^n x_i \overline{y_i} = y^H x$.

那么复空间 \mathbb{C}^n 的通常内积满足以下三条公理:

1. 正定性:
2. 共轭对称性
3. 第一变元线性性

定义 2.14. \mathbb{C}^n 中向量的范数 (长度), $\|x\| = \sqrt{(x, x)}$, 也称为 2- 范数.

单位向量, 向量的单位化. 向量与向量正交.

范数满足范数公理:

1. 正定性
2. 绝对齐次性
3. 三角不等式

定理 2.23. 正交的向量组线性无关.

定理 2.24. 勾股定理.

Cauchy-Schwarz 不等式

$$|(x, y)| \leq \|x\| \|y\|$$

三角不等式.

Gram-Schmidt 正交化过程.

向量空间 \mathbb{C}^n 中任意 n 个线性无关的向量, 能构成它的一个基. 如果它们两两正交, 就称为正交基, 如果进一步, 它们每一个还是单位向量, 就称为标准正交基.

定义 2.15. 酉矩阵 $U \in \mathbb{C}^{n \times n}$ 满足 $U^H U = I$ 则称 U 为酉矩阵.

性质:

1. 若 A 为酉阵, 则 A^{-1} 也是酉阵.
2. 若 A, B 为酉阵, 则 AB 也是酉阵.
3. 若 A 为酉阵, 则 $|\det(A)| = 1$.
4. A 为酉阵当且仅当它的 n 个列 (行) 是两两正交的单位向量.

QR 分解, 由 Schmidt 正交化过程, 我们可以得到下面定理:

定理 2.25. 设 $A_{m \times n}$ 是列满秩矩阵, 那么存在 $Q_{m \times n}$ 以及上三角阵 $R_{n \times n}$ 使得

$$A = QR$$

其中, $Q^H Q = I_n$, 即 Q 是由 n 个两两正交的单位向量构成的矩阵. 设有两

个这样的分解 $A = Q_1 R_1 = Q_2 R_2$, 那么存在 $D = \begin{bmatrix} d_1 & & & \\ & d_2 & & \\ & & \ddots & \\ & & & d_n \end{bmatrix}$, 其

中 $|d_i| = 1, i = 1, \dots, n$, 使得 $R_1 = D R_2$, $Q_1 = Q_2 D^{-1}$. 特别的, QR 分解中, 可以要求上三角阵 R 的对角元全为正数, 那么在此意义下 QR 分解是唯一的.

注 2.2.

1. 通常我们会要求 A 是可逆方阵, 这时候, QR 分解中的 Q 就是我们通常意义下的酉阵.
2. A 是实矩阵的情况也有类似的版本.

2.6 酉相似下的标准形

定理 2.26. 设 A 为 n 阶复方阵, $x, y \in \mathbb{C}^n$, 则 $(Ax, y) = (x, A^H y)$.

定理 2.27. 设 A 为 n 阶复方阵, 若 $(Ax, y) = 0$ 对任意 x, y 成立, 则 $A = 0$.

定理 2.28. 设 A 为 n 阶复方阵, $(Ax, x) = 0$ 对所有 $x \in \mathbb{C}^n$ 成立, 则 $A = 0$.

考虑 $(A(x + ky), x + ky)$.

定理 2.29. 设 A 为 n 阶复方阵, 则 A 是 Hermite 的当且仅当对任意 x , $(Ax, x) \in \mathbb{R}$

定理 2.30. (Schur) 设 A 为 n 阶复方阵, 则 A 可以酉相似于上三角矩阵.

定义 2.16. 设 $A \in \mathbb{C}^{n \times n}$, 若 A 满足

$$AA^H = A^H A$$

则称 A 为正规矩阵.

例 2.3. 酉阵, 实正交阵, Hermite 矩阵, 反 Hermite 矩阵 ($A^H = -A$), 对角阵都是正规阵. 设 A 是正规阵, 那么 A 的多项式也正规阵.

例 2.4. 根据正规阵的定义, 只要 A^H 是和 A 可以交换的矩阵, 那么 A 就是正规阵, 例如 A^H 是 A 的多项式时, A 是正规阵. 另外 A 是正规阵时, A^H 也是正规阵.

以下定理是正规阵的刻画定理.

定理 2.31. 设 $A \in \mathbb{C}^{n \times n}$, 那么 A 可以酉相似于对角阵当且仅当 A 是正规阵.

定理 2.32. 显然, 对于正规阵 A 而言, $A = 0$ 当且仅当 A 的所有特征值都是零.

定理 2.33. 设 $A \in \mathbb{C}^{n \times n}$, 则 A 为正规阵 \Leftrightarrow 对于 $\forall x \in \mathbb{C}^n$, 有 $\|Ax\| = \|A^H x\|$.

定理 2.34. A 正规, 则对任何数 k , $kI - A$ 是正规阵, A^H 也是正规阵.

定理 2.35. 设 A 正规, $Ax_0 = \lambda x_0$, $x_0 \neq 0$, 则有 $A^H x_0 = \bar{\lambda} x_0$.

推论 2.2. Hermite 矩阵的特征值都是实数, 反 Hermite 矩阵的特征值为零或者是纯虚数.

推论 2.3. 设 A 正规, 则不同特征值对应的特征向量是正交的.

证明. $\lambda_1(x_1, x_2) = (Ax_1, x_2) = (x_1, A^H x_2) = (x_1, \bar{\lambda}_2 x_2) = \lambda_2(x_1, x_2)$. \square

定义 2.17. 设 $A \in \mathbb{C}^{n \times n}$ 是 Hermite 矩阵. 如果对于任意 $0 \neq x \in \mathbb{C}^n$ 都有

$$x^H A x > 0 (\geq 0)$$

就称 A 是 Hermite 正定矩阵 (半正定矩阵)

需要 (Ax, x) 是实数, 所以需要 A 是 Hermite 的.

定理 2.36. 设 $A \in \mathbb{C}^{n \times n}$ 是 *Hermite* 矩阵. 则以下条件等价:

1. A 为 *Hermite* 正定矩阵
2. A 的特征值全都是正实数
3. 存在可逆阵 P 使得 $A = P^H P$

推论 2.4. *Hermite* 正定矩阵的行列式大于零.

定理 2.37. 设 $A \in \mathbb{C}^{n \times n}$ 是 *Hermite* 矩阵. 则以下条件等价:

1. A 为 *Hermite* 半正定矩阵
2. A 的特征值全都是非负实数
3. 存在 $P \in \mathbb{C}^{n \times n}$ 使得 $A = P^H P$

定理 2.38. 设 $A \in \mathbb{C}^{m \times n}$, 则

1. $A^H A$ 和 AA^H 的特征值全为非负实数. 它们是半正定矩阵.
2. $A^H A$ 和 AA^H 的非零特征值相同.
3. $\text{rank}(A^H A) = \text{rank}(AA^H) = \text{rank}(A)$.

定理 2.39. *Sylvester* 设 $A_{m \times n}, B_{n \times m}$, 则

$$\lambda^n |\lambda I_m - AB| = \lambda^m |\lambda I_n - BA|$$

证明. 考虑 $\begin{bmatrix} \lambda I_n & B_{n \times m} \\ \lambda A_{m \times n} & \lambda I_m \end{bmatrix}$.

□

定理 2.40. 设 $A \in \mathbb{C}^{n \times n}$, A 为 *Hermite* 矩阵. 则 A 正定当且仅当它的所有顺序主子式都大于零.

第三章 范数理论

3.1 向量范数

\mathbb{C}^n 上的向量范数.

定义 3.1. 设 V 是域 \mathbb{F} 上的线性空间, 这里 \mathbb{F} 是实数域 \mathbb{R} 或者是复数域 \mathbb{C} . 函数 $\|\cdot\|: V \rightarrow \mathbb{R}$ 称为 V 上的一个范数, 如果函数 $\|\cdot\|$ 满足以下三条公理:

1. 正定性
2. 绝对齐次性
3. 三角不等式.

此时称 V 为赋范线性空间.

例 3.1. \mathbb{C}^n 中, 对于任意 x , 取 $\|x\|_2 = \sqrt{\sum_{k=1}^n |x_k|^2}$, 是范数, 称为 2-范数. 2-范数是酉不变范数: 即对于任意酉阵 U , $\|Ux\|_2 = \|x\|_2$.

例 3.2. \mathbb{C}^n 中, 对于任意 x , 取 $\|x\|_1 = \sum_{k=1}^n |x_k|$, 是范数, 称为 1 范数.

例 3.3. \mathbb{C}^n 中, 对于任意 x , 取 $\|x\|_\infty = \max_k |x_k|$, 是范数, 称为 ∞ 范数.

定义 3.2. \mathbb{C}^n 中 p -范数的定义. 设 $p > 1$, $x \in \mathbb{C}^n$, 由等式 $\|x\|_p = (\sum_{i=1}^n |x_i|^p)^{\frac{1}{p}}$ 定义出的范数称为 p 范数.

为证明上述定义中的 p 范数确实是范数, 验证 p 范数确实是范数, 难点是在于解决三角不等式的证明, 该三角不等式也称为 Minkowski 不等式. 通常分析教材会在此处额外介绍两个不等式, Young 不等式与 Holder 不等式, 利用 Holder 不等式得到 Minkowski 不等式.

另外一方面, 显然, 之前定义的 2 范数是 $p = 2$ 时的 p 范数. 而 $\lim_{p \rightarrow 1} \|x\|_p = \|x\|_1$ 且 $\lim_{p \rightarrow \infty} \|x\|_p = \|x\|_\infty$.

引理 3.1. (Young's Inequality) 对于任意实数 $\alpha \geq 0$ 和 $\beta \geq 0$, 都有

$$\alpha\beta \leq \frac{\alpha^p}{p} + \frac{\beta^q}{q}$$

其中 $p > 1, q > 1$ 且 $\frac{1}{p} + \frac{1}{q} = 1$.

证明. 利用对数函数的凹凸性, 立即可以得到结论. \square

定理 3.1. (Hölder) 设 $x, y \in \mathbb{C}^n$, 有

$$\sum_{i=1}^n |x_i y_i| \leq \left(\sum_{i=1}^n |x_i|^p \right)^{\frac{1}{p}} \left(\sum_{i=1}^n |y_i|^q \right)^{\frac{1}{q}}$$

其中 $p > 1, q > 1$ 且 $\frac{1}{p} + \frac{1}{q} = 1$.

Minkowski 不等式的证明.

我们此处给出另外一种证明.

证明. 欲证 $\|a + b\|_p \leq \|a\|_p + \|b\|_p$, 不妨设 $\|a\|_p \neq 0, \|b\|_p \neq 0$. 于是等价于

证 $\left\| \frac{a}{\|a\|_p + \|b\|_p} + \frac{b}{\|a\|_p + \|b\|_p} \right\|_p \leq 1$, 不等式变形为 $\left\| \frac{\|a\|_p}{\|a\|_p + \|b\|_p} \cdot \frac{a}{\|a\|_p} + \frac{\|b\|_p}{\|a\|_p + \|b\|_p} \cdot \frac{b}{\|b\|_p} \right\|_p \leq$

1. 只需要证明, $\|\lambda x + \mu y\|_p \leq 1$ 其中 $0 \leq \lambda, \mu \leq 1, \lambda + \mu = 1, \|x\|_p = \|y\|_p =$

1. 直接写开,

$$\begin{aligned} \|\lambda x + \mu y\|_p &= \left(\sum_{k=1}^n |\lambda x_k + \mu y_k|^p \right)^{\frac{1}{p}} \leq \left(\sum_{k=1}^n (\lambda |x_k| + \mu |y_k|)^p \right)^{\frac{1}{p}} \\ &\leq \left(\sum_{k=1}^n (\lambda |x_k|^p + \mu |y_k|^p) \right)^{\frac{1}{p}} = 1. \end{aligned}$$

\square

定理 3.2. 设 $A \in \mathbb{C}_n^{m \times n}$, $\|\cdot\|_a$ 是 \mathbb{C}^m 上的一个向量范数. 对于任意 $x \in \mathbb{C}^n$, 我们规定

$$\|x\|_b = \|Ax\|_a$$

则 $\|x\|_b$ 是 \mathbb{C}^n 中的向量范数.

定义 3.3. 距离空间.

依范数收敛.

有限维赋范线性空间范数等价定理.

3.2 广义矩阵范数

定义 3.4. $\mathbb{C}^{m \times n}$ 上的广义矩阵范数 $\|\cdot\|$ 就是指通常的满足范数公理的范数.

有了范数, 我们可以谈收敛. 应用有限维空间上的范数等价定理, 可以知道 $\mathbb{C}^{m \times n}$ 上的任意两个广义的矩阵范数是等价的.

设 $A^{(k)} = [a_{ij}^{(k)}] \in \mathbb{C}^{m \times n}, k = 1, 2, \dots$. 如果

$$\lim_{k \rightarrow \infty} a_{ij}^{(k)} = a_{ij}, \forall i, j$$

则称矩阵序列 $\{A^{(k)}\}$ 收敛于 $A = [a_{ij}]$, 或者它有极限 A , 记做 $\lim_{k \rightarrow \infty} A^{(k)} = A$.

显然对于任意一个广义矩阵范数 $\|\cdot\|$, 我们有 $\lim_{k \rightarrow \infty} A^{(k)} = A$ 当且仅当 $\lim_{k \rightarrow \infty} \|A^{(k)} - A\| = 0$

若 $\lim_{k \rightarrow \infty} A^{(k)} = A$, 则有 $\lim_{k \rightarrow \infty} \|A^{(k)}\| = \|A\|$.

定义 3.5. 设 $\|\cdot\|_\alpha, \|\cdot\|_\beta, \|\cdot\|_\gamma$ 分别是 $\mathbb{C}^{m \times n}, \mathbb{C}^{n \times p}, \mathbb{C}^{m \times p}$ 上的广义矩阵范数. 若对任意的 $A \in \mathbb{C}^{m \times n}, B \in \mathbb{C}^{n \times p}$ 有

$$\|AB\|_\gamma \leq \|A\|_\alpha \|B\|_\beta$$

我们称 $\|\cdot\|_\alpha, \|\cdot\|_\beta, \|\cdot\|_\gamma$ 是相容的.

这个定义包含了广义矩阵范数与向量范数的相容性定义.

例 3.4. $\mathbb{C}^{m \times n}$ 上的 Frobenius 范数: $\|A\|_F = (\sum |a_{ij}|^2)^{\frac{1}{2}} = \sqrt{\text{tr}(A^H A)} = \sqrt{\text{tr}(A A^H)}$.

F 范数是酉不变的, 且具有相容性.

例 3.5. $\mathbb{C}^{m \times n}$ 上的 $\|A\|_{m_1} = \sum_{i,j} |a_{ij}|$ 与向量的 p 范数是相容的.

定义 3.6. 设 $\|\cdot\|_\delta$ 与 $\|\cdot\|_\tau$ 分别为 \mathbb{C}^n 与 \mathbb{C}^m 上的向量范数. 由下式定义的非负实值函数 $\|\cdot\|_{\tau\delta} : \mathbb{C}^{m \times n} \rightarrow \mathbb{R}$

$$\|A\|_{\tau\delta} = \max_{0 \neq x \in \mathbb{C}^n} \frac{\|Ax\|_\tau}{\|x\|_\delta} = \max_{\|x\|_\delta=1} \|Ax\|_\tau = \max_{\|x\|_\delta \leq 1} \|Ax\|_\tau$$

叫做由向量范数 $\|\cdot\|_\delta$ 与 $\|\cdot\|_\tau$ 导出的广义矩阵范数或算子范数.

注 3.1. 算子范数有相容性.

定理 3.3. 设 $A = (a_{ij}) \in \mathbb{C}^{m \times n}$, 则

1. 若 $\|\cdot\|_1$ 为 \mathbb{C}^n 与 \mathbb{C}^m 上的 1 范数 (l_1 范数), 那么它们导出的广义矩阵范数为:

$$\|A\|_1 = \max_j \sum_i |a_{ij}|$$

也称为列和范数.

2. 若 $\|\cdot\|_2$ 为 \mathbb{C}^n 与 \mathbb{C}^m 上的 2 范数 (l_2 范数), 那么它们导出的广义矩阵范数为:

$$\|A\|_2 = \sqrt{\lambda_1}, \quad \text{其中 } \lambda_1 \text{ 为 } A^H A \text{ 的最大特征值}$$

3. 若 $\|\cdot\|_\infty$ 为 \mathbb{C}^n 与 \mathbb{C}^m 上的 ∞ 范数 (l_∞ 范数), 那么它们导出的广义矩阵范数为:

$$\|A\|_\infty = \max_i \sum_j |a_{ij}|$$

也称为行和范数.

3.3 矩阵范数

定义 3.7. 对于 $\mathbb{C}^{n \times n}$ 上的广义矩阵范数 (即满足范数的三个公理), 然后再加上一条相容性条件 (或者叫次可乘条件): $\|AB\| \leq \|A\| \|B\|$, 则称 $\|\cdot\|$ 是 $\mathbb{C}^{n \times n}$ 上的矩阵范数.

注 3.2. 当我们看到矩阵范数这四个字, 通常我们是要要求有相容性条件的. 我们这里说的是方阵的矩阵范数, 相容性条件可以没有含糊的要求给出.

对于由向量范数导出的矩阵范数 $\|\cdot\|$ 而言, 单位矩阵 I 的范数 $\|I\| = 1$, 但是当 $n > 1$ 时, Frobenius 范数 $\|I\|_F = \sqrt{n}$, 从而不是导出的矩阵范数.

定理 3.4. 若 $\|\cdot\|$ 为 $\mathbb{C}^{n \times n}$ 上的矩阵范数, $S \in \mathbb{C}^{n \times n}$ 非奇异, 则如下定义的实值函数

$$\|A\|_S = \|S^{-1}AS\|, \forall A \in \mathbb{C}^{n \times n}$$

是 $\mathbb{C}^{n \times n}$ 上的矩阵范数.

定理 3.5. 若 $\|\cdot\|$ 为 $\mathbb{C}^{n \times n}$ 上的矩阵范数, 则存在 \mathbb{C}^n 上的向量范数 $\|\cdot\|_v$ 满足:

$$\|Ax\| \leq \|A\| \|x\|_v$$

定理 3.6. 设 $A \in \mathbb{C}^{n \times n}$, U, V 为 n 阶酉矩阵, 则 $\|A^H\|_2 = \|A\|_2$, $\|UAV\|_2 = \|A\|_2$

例 3.6. 设 $A = (a_{ij}) \in \mathbb{C}^{n \times n}$, 规定 $\|A\|_{m_1} = \sum_{i,j} |a_{ij}|$, 则 $\|A\|_{m_1}$ 是矩阵范数.

例 3.7. 设 $A = (a_{ij}) \in \mathbb{C}^{n \times n}$, 规定 $\|A\|_{m_\infty} = n \max_{i,j} |a_{ij}|$, 则 $\|\cdot\|_{m_\infty}$ 是矩阵范数.

例 3.8. $\mathbb{C}^{m \times n}$ 上, 常用的矩阵范数有:

1. $\|A\|_{m_1} = \sum |a_{ij}|$, m_1 范数.
2. $\|A\|_F = \sqrt{\text{tr}(A^H A)}$, F 范数.
3. $\|A\|_M = \max\{m, n\} \max |a_{ij}|$, 最大范数.
4. $\|A\|_G = \sqrt{mn} \max |a_{ij}|$, 几何平均范数.
5. $\|A\|_1 = \max_j \sum_{i=1}^m |a_{ij}|$, 列和范数.
6. $\|A\|_2 = \sqrt{\lambda_1(A^H A)}$, 谱范数.
7. $\|A\|_\infty = \max_i \sum_{j=1}^n |a_{ij}|$, 行和范数.

3.4 范数应用举例

方阵的谱半径

定义 3.8. 设 $A \in \mathbb{C}^{n \times n}$, $\lambda_1, \dots, \lambda_n$ 为 A 的 n 个特征值, 称

$$\rho(A) = \max_j |\lambda_j|$$

为 A 的谱半径.

定理 3.7. 设 $A \in \mathbb{C}^{n \times n}$, 则有

1. $\rho(A^k) = \rho^k(A)$
2. $\rho(A^H A) = \rho(A^H A) = \|A\|_2^2$
3. 当 A 是正规阵时, $\rho(A) = \|A\|_2$

定理 3.8. 设 $A \in \mathbb{C}^{n \times n}$, 则对 $\mathbb{C}^{n \times n}$ 上的任意矩阵范数 $\|\cdot\|$, 有

$$\rho(A) \leq \|A\|$$

定理 3.9. 设 $A \in \mathbb{C}^{n \times n}$, 对于任意给定的正数 ϵ , 存在有一个自相容的矩阵范数 $\|\cdot\|$, 使得

$$\|A\| \leq \rho(A) + \epsilon$$

例 3.9. 设 A 是幂零阵, 但是 $A \neq 0$, 那么 $\rho(A) = 0$, 而不管什么矩阵范数都有 $\|A\| > 0$.

定理3.8和3.9说明

$$\rho(A) = \inf \{ \|A\| : \|\cdot\| \text{跑遍 } \mathbb{C}^{n \times n} \text{ 上的任意矩阵范数} \}$$

3.5 条件数：矩阵逆和线性方程的解

作为矩阵范数和向量范数的应用, 我们考虑计算矩阵逆和方程解的误差估计.

假设线性方程 $Ax = b$ 中 A 是可逆的, 但是由于机器计算或者观测误差什么我们可能对于真实的 A 以及真实的 b 会有一点点小的扰动 ΔA 和 Δb , 现在需要考虑这些扰动会对计算带来什么影响.

具体的, 让 $\|\cdot\|$ 是 $\mathbb{C}^{n \times n}$ 上的一个矩阵范数, $B = A + \Delta A$, 我们假设 $\|A^{-1}\Delta A\| < 1$, 这个假设是用来保证 B 也是可逆的.

我们需要估计 $\frac{\|A^{-1} - B^{-1}\|}{\|A^{-1}\|}$. 推导细节需要注意一个式子 $A^{-1} - B^{-1} = A^{-1}(B - A)B^{-1}$.

引理 3.2. 设 $P \in \mathbb{C}^{n \times n}$, 若对于某个矩阵范数 $\|\cdot\|$ 有 $\|P\| < 1$, 那么 $I - P$ 是可逆的.

定理 3.10. 设 $A, \Delta A \in \mathbb{C}^{n \times n}$, $\|A^{-1}\Delta A\| < 1$ 对某个矩阵范数成立. 那么

1. $B = A + \Delta A$ 是可逆的.

$$2. \|B^{-1}\| \leq \frac{\|A^{-1}\|}{1 - \|A^{-1}\Delta A\|}$$

$$3. \frac{\|A^{-1} - B^{-1}\|}{\|A^{-1}\|} \leq \frac{\|A^{-1}\Delta A\|}{1 - \|A^{-1}\Delta A\|} \leq \frac{\|A^{-1}\| \|A\|}{1 - \|A^{-1}\Delta A\|} \frac{\|\Delta A\|}{\|A\|}$$

令 $\kappa(A) = \begin{cases} \|A^{-1}\| \|A\| & \text{若 } A \text{ 是可逆的} \\ \infty & \text{若 } A \text{ 是不可逆的} \end{cases}$, 称为 A 对于矩阵范数 $\|\cdot\|$ 的条件数. 注意有 $\kappa(A) \geq \|A^{-1}A\| \geq 1$. 我们有

$$\frac{\|A^{-1} - (A + \Delta A)^{-1}\|}{\|A^{-1}\|} \leq \frac{\kappa(A)}{1 - \|A^{-1}\Delta A\|} \frac{\|\Delta A\|}{\|A\|}$$

如果我们加强假设为 $\|A^{-1}\| \|\Delta A\| < 1$, 则有

$$\frac{\|A^{-1} - (A + \Delta A)^{-1}\|}{\|A^{-1}\|} \leq \frac{\kappa(A)}{1 - \kappa(A) \frac{\|\Delta A\|}{\|A\|}} \frac{\|\Delta A\|}{\|A\|}$$

后面的这个上界我们成为对于计算 A 的逆的相对误差的一个先验上界 (*priori bound*).

如果 $\|A^{-1}\| \|\Delta A\|$ 不仅仅小于 1, 而是比 1 小很多, 那么那个上界可以约等于 $\kappa(A) \frac{\|\Delta A\|}{\|A\|}$, 只要 $\kappa(A)$ 不是很大, 在这个前提下, 这个使我们相信逆的相对误差和原来的相对误差是同阶的. 基于这个原因, 我们称呼 A 是病态的 ill conditioned, 如果条件数很大. 如果条件数很小就称良好的 well conditioned. 如果 $\kappa(A) = 1$, 我们说是完美 perfectly conditioned 的. 当然这些称呼都是相对具体给定的矩阵范数 $\|\cdot\|$ 而言的.

类似的我们考虑 $Ax = b$, $b \neq 0$, 其中 b 做一个小扰动 Δb , 考虑

$$(A + \Delta A)(x + \Delta x) = b + \Delta b$$

对 $\frac{\|\Delta x\|_v}{\|x\|_v}$ 的估计问题, 这里设 $\|\cdot\|_v$ 和矩阵范数 $\|\cdot\|$ 是相容的.

那么经过一番操作之后我们得到这么一个结论:

$$\frac{\|\Delta x\|_v}{\|x\|_v} \leq \frac{\kappa(A)}{1 - \kappa(A) \frac{\|\Delta A\|}{\|A\|}} \left(\frac{\|\Delta b\|_v}{\|b\|_v} + \frac{\|\Delta A\|}{\|A\|} \right)$$

第四章 矩阵分析

4.1 矩阵序列

定义 4.1. 设有 $\mathbb{C}^{m \times n}$ 中的矩阵序列 $\{A^{(k)}\}_{k=1}^{\infty}$, 其中 $A^{(k)} = (a_{ij}^{(k)})_{m \times n}$. 若存在 $A = (a_{ij})_{m \times n}$, 使得对于每个 (i, j) , 有 $\lim_{k \rightarrow \infty} a_{ij}^{(k)} = a_{ij}$, 就称矩阵序列 $\{A^{(k)}\}_{k=1}^{\infty}$ 收敛于 A , 记为 $\lim_{k \rightarrow \infty} A^{(k)} = A$. 不收连的矩阵序列称为发散的序列.

根据范数等价定理, 有以下定理.

定理 4.1. 设 $\|\cdot\|$ 为任何一个给定的矩阵范数. 则 $\lim_{k \rightarrow \infty} A^{(k)} = A \iff \lim_{k \rightarrow \infty} \|A^{(k)} - A\| = 0$.

定理 4.2. 设 $\lim_{k \rightarrow \infty} A^{(k)} = A$, $\lim_{k \rightarrow \infty} B^{(k)} = B$, $\lambda, \mu \in \mathbb{C}$, 那么有

- $\lim_{k \rightarrow \infty} (\lambda A^{(k)} + \mu B^{(k)}) = \lambda A + \mu B$
- $\lim_{k \rightarrow \infty} A^{(k)} B^{(k)} = AB$
- 当所有 $A^{(k)}$ 与 A 都可逆时, $\lim_{k \rightarrow \infty} (A^{(k)})^{-1} = A^{-1}$.

定义 4.2. 若 $\lim_{k \rightarrow \infty} A^k = 0$, 则称 A 为收敛矩阵.

定理 4.3. A 为收敛阵, 当且仅当 $\rho(A) < 1$.

推论 4.1. 若有某矩阵范数 $\|\cdot\|$, 使得 $\|A\| < 1$, 则 A 为收敛阵.

4.2 矩阵函数

定义 4.3. 设方阵 $A \in \mathbb{C}^{n \times n}$, 其极小多项式为

$$m_A(\lambda) = (\lambda - \lambda_1)^{l_1} \cdots (\lambda - \lambda_s)^{l_s}$$

其中 $\lambda_1, \dots, \lambda_s$ 各不相同. 称集合 $\{(\lambda_i, l_i) | i = 1, 2, \dots, s\}$ 为 A 的简谱, 记为用 Λ_A .

定义 4.4. 设 $A \in \mathbb{C}^{n \times n}$, 称复值函数 $f(\lambda)$ 在 A 的谱 Λ_A 上有定义, 是指:

$$\begin{cases} f(\lambda_1), f'(\lambda_1), \dots, f^{(l_1-1)}(\lambda_1) \\ \dots \\ f(\lambda_s), f'(\lambda_s), \dots, f^{(l_s-1)}(\lambda_s) \end{cases}$$

均存在. 若函数 $f(\lambda)$ 在 Λ_A 上有定义, 则记上述数组为 $f(\Lambda_A)$.

定理 4.4. 设 $A \in \mathbb{C}^{n \times n}$, $f(\lambda), g(\lambda)$ 为复系数多项式, 则有 $f(A) = g(A) \iff f(\Lambda_A) = g(\Lambda_A)$

定义 4.5. 设 $A \in \mathbb{C}^{n \times n}$, $f(\lambda)$ 为一个在 Λ_A 上有定义的复函数. 若存在多项式 $p(A)$, 使得 $p(\Lambda_A) = f(\Lambda_A)$, 则定义 $f(A) = p(A)$, 并称 p 为 $f(A)$ 的一个定义多项式, 我们称 f 在 A 上有定义.

尽管 p 的选择有很多个但是 $f(A)$ 的值是和 p 的选择无关的. 而在约定次数小于 $\deg m_A$ 的多项式中选择, 那么 p 是唯一的.

多项式 p 的存在性是与所谓的 Hermite 多项式差值问题紧密相关的. 我们这里就不打算证明了.

根据这种定义方式, 我们容易得到一些很好的结果.

定理 4.5. 若 $A = P^{-1}BP$, 则任意在 Λ_A 上有定义的函数 $f(\lambda)$ 在 Λ_B 上也有定义, 因为 $\Lambda_A = \Lambda_B$. 而且 $f(A) = P^{-1}f(B)P$.

定理 4.6. $f(A_1 \oplus \dots \oplus A_k) = f(A_1) \oplus \dots \oplus f(A_k)$.

现在, 对于给定方阵 A , 让 A 的 Jordan 分解为 $S(J_1 \oplus \dots \oplus J_m)S^{-1}$, 其中

$$J_i = \begin{bmatrix} \lambda_i & 1 & & \\ & \ddots & \ddots & \\ & & \ddots & 1 \\ & & & \lambda_i \end{bmatrix}_{l_i \times l_i}$$

若 f 在 Λ_A 上有定义, 则 $f(A) = S(f(J_1) \oplus \dots \oplus f(J_m))S^{-1}$. 现在考察 J_i 的最小多项式 $(\lambda - \lambda_i)^{l_i}$, 令

$$p(\lambda) = f(\lambda_i) + \frac{f'(\lambda_i)}{1!}(\lambda - \lambda_i) + \dots + \frac{f^{(l_i-1)}(\lambda_i)}{(l_i-1)!}(\lambda - \lambda_i)^{l_i-1}$$

, 那么显然 $p(\Lambda_{J_i}) = f(\Lambda_{J_i})$, 则有

$$f(J_i) = p(J_i) = \sum_{k=0}^{l_i-1} \frac{f^{(k)}(\lambda_i)}{k!} N_{l_i}^k$$

$$\text{其中 } N_{l_i} = \begin{bmatrix} 0 & 1 & & \\ & 0 & \ddots & \\ & & \ddots & 1 \\ & & & 0 \end{bmatrix}_{l_i \times l_i}$$

对于形态较好的在某个开圆域上的解析函数, 按照收敛的定义得到的矩阵和上述定义是一致的.

定理 4.7. 设复变函数 $f(z)$ 在开圆域 $|z - z_0| < r$ 内有幂级数展开式: $f(z) = \sum_{k=0}^{\infty} a_k(z - z_0)^k$, 若方阵 A 的所有特征值都在此开圆域内, 则有 $f(A) = \sum_{k=0}^{\infty} (A - z_0 I)^k$.

定理 4.8. 设 $G(y_1, \dots, y_l)$ 是 l 元多项式, 函数 $f_1(\lambda), \dots, f_l(\lambda)$ 都在 Λ_A 上有定义. 记 $g(\lambda) = G(f_1(\lambda), \dots, f_l(\lambda))$, 则有 $g(A) = G(f_1(A), \dots, f_l(A))$. 特别地, 若 $g(\Lambda_A) = 0$, 则有 $G(f_1(A), \dots, f_l(A)) = 0$

定理 4.9. 设复合函数 $h(\lambda) = g(f(\lambda))$, A 为 n 阶阵, 为方便描述, 我们直接假设 f 在 A 的每个特征值 λ_i 处有 $n-1$ 阶导, g 在每个 $\mu_i = f(\lambda_i)$ 处有 $n-1$ 阶导, 那么显然 f 在 A 上有定义, $B = f(A)$, 且 g 在 B 上也有定义, h 在 A 上有定义. 最终有 $h(A) = g(B) = g(f(A))$.

例 4.1. 由 $\cos^2 x + \sin^2 x = 1$ 知 $\cos^2 A + \sin^2 A = I$.

例 4.2. 给定任意可逆方阵 A , 对于任何非零复数 p , 总存在矩阵 B 使得 $B^p = A$.

弄点简化的版本吧.

定义 4.6. 设 $A \in \mathbb{C}^{n \times n}$, 其特征值为 $\lambda_1, \dots, \lambda_n$, 复变函数 $f(\lambda)$ 在 $\lambda_1, \dots, \lambda_n$ 处解析, 那么 $f(A)$ 有定义. 找一个多项式 $p(\lambda)$ 使得 $p^{(k)}(\lambda_i) = f^{(k)}(\lambda_i), k = 0, 1, \dots, n-1$ 对任意 i 成立. 则可以定义 $f(A) = p(A)$.

上面的定义, 是一个简单的版本.

定理 4.10. 设 $A \in \mathbb{C}^{n \times n}$, 其特征值为 $\lambda_1, \dots, \lambda_n$, 复变函数 $f(\lambda)$ 在 $\lambda_1, \dots, \lambda_n$ 处解析, 复变函数 $g(\lambda)$ 在 $f(\lambda_1), \dots, f(\lambda_n)$ 处解析, 那么复合函数 $h(\lambda) = g(f(\lambda))$ 在 $\lambda_1, \dots, \lambda_n$ 处解析, 且有 $h(A) = g(f(A))$.

定理 4.11. 设 $A \in \mathbb{C}^{n \times n}$, 其特征值为 $\lambda_1, \dots, \lambda_n$, 复变函数 $f_1(\lambda), \dots, f_s(\lambda)$ 在 $\lambda_1, \dots, \lambda_n$ 处解析, $q(u_1, \dots, u_s)$ 为一个多项式, 那么复合函数 $h(\lambda) = q(f_1(\lambda), \dots, f_s(\lambda))$ 在 $\lambda_1, \dots, \lambda_n$ 处解析, 且有 $h(A) = q(f_1(A), \dots, f_s(A))$.

4.3 矩阵的微积分

这一节的记号我们重新定义. 以至于能够和微积分有一定的相容性. 采取的是 Numerator layout convention.

$$\text{即: } \frac{\partial \vec{y}}{\partial \vec{x}} = \left[\frac{\partial y}{\partial x_1}, \frac{\partial y}{\partial x_2}, \dots, \frac{\partial y}{\partial x_n} \right], \frac{\partial \vec{y}}{\partial x} = \begin{bmatrix} \frac{\partial y_1}{\partial x} \\ \frac{\partial y_2}{\partial x} \\ \vdots \\ \frac{\partial y_m}{\partial x} \end{bmatrix}, \frac{\partial \vec{y}}{\partial \vec{x}} = \begin{bmatrix} \frac{\partial y_1}{\partial x_1} & \frac{\partial y_1}{\partial x_2} & \dots & \frac{\partial y_1}{\partial x_n} \\ \frac{\partial y_2}{\partial x_1} & \frac{\partial y_2}{\partial x_2} & & \frac{\partial y_2}{\partial x_n} \\ \vdots & \vdots & & \vdots \\ \frac{\partial y_m}{\partial x_1} & \frac{\partial y_m}{\partial x_2} & & \frac{\partial y_m}{\partial x_n} \end{bmatrix},$$

$$\frac{\partial y}{\partial X} = \begin{bmatrix} \frac{\partial y}{\partial x_{11}} & \frac{\partial y}{\partial x_{12}} & \dots & \frac{\partial y}{\partial x_{1q}} \\ \frac{\partial y}{\partial x_{21}} & \frac{\partial y}{\partial x_{22}} & \dots & \frac{\partial y}{\partial x_{2q}} \\ \vdots & \vdots & \vdots & \vdots \\ \frac{\partial y}{\partial x_{p1}} & \frac{\partial y}{\partial x_{p2}} & \dots & \frac{\partial y}{\partial x_{pq}} \end{bmatrix}, \frac{\partial Y}{\partial x} = \begin{bmatrix} \frac{\partial y}{\partial x_{11}} & \frac{\partial y}{\partial x_{12}} & \dots & \frac{\partial y}{\partial x_{1q}} \\ \frac{\partial y}{\partial x_{21}} & \frac{\partial y}{\partial x_{22}} & \dots & \frac{\partial y}{\partial x_{2q}} \\ \vdots & \vdots & \vdots & \vdots \\ \frac{\partial y}{\partial x_{p1}} & \frac{\partial y}{\partial x_{p2}} & \dots & \frac{\partial y}{\partial x_{pq}} \end{bmatrix}$$

第五章 矩阵分解

5.1 QR 分解

定义 5.1. 设 $u \in \mathbb{C}^n$ 是单位向量, 即 $\|u\|_2 = 1$, 称

$$H = I - 2uu^H$$

为 Householder 矩阵或初等反射阵.

定理 5.1. 设 H 为 n 阶 Householder 矩阵, 则有以下性质:

1. $H^H = H$ (Hermite)
2. $H^H H = I$ (酉阵)
3. $H^2 = I$ (对合阵)
4. $H^{-1} = H$ (自逆阵)
5. $\begin{bmatrix} I_r & \\ & H \end{bmatrix}$ 是 $n+r$ 阶 Householder 阵.
6. $\det H = -1$.

定理 5.2. 设 $z \in \mathbb{C}^n (n \geq 2)$ 是单位向量, 则对任意 $x \in \mathbb{C}^n$, 对满足 $\alpha x^H z \in \mathbb{R}$ 且 $|\alpha| = \|x\|_2$ 的复数 α , 存在 Householder 阵 H 使得 $Hx = \alpha z$. (其中条件 $\alpha x^H z \in \mathbb{R}$ 且 $|\alpha| = \|x\|_2$ 是为了保证 $x = \frac{1}{2}(x + \alpha z) + \frac{1}{2}(x - \alpha z)$ 是直和分解)

第六章 矩阵的特殊乘积

6.1 Kronecker 积

定义 6.1. 设 $A = (a_{ij})_{m \times n}$, $B = (b_{ij})_{p \times q}$, 称如下的分块矩阵

$$A \otimes B = \begin{bmatrix} a_{11}B & a_{12}B & \cdots & a_{1n}B \\ a_{21}B & a_{22}B & \cdots & a_{2n}B \\ \vdots & \vdots & & \vdots \\ a_{m1}B & a_{m2}B & \cdots & a_{mn}B \end{bmatrix}$$

为 A 与 B 的直积或 Kronecker 积. 它是 $mp \times nq$ 矩阵, 以 $a_{ij}B$ 为子块构成的分块矩阵.

6.2 一些基础

为了简单起见, 我们临时使用以下的定义. 抽象版本的定义需要自行参考书籍.

定义 6.2. 设 $\emptyset \neq V \subseteq \mathbb{C}^n$, 如果 $\forall v_1, v_2 \in V$ 有 $v_1 + v_2 \in V$. 如果 $\forall v \in V, k \in \mathbb{C}$ 有 $kv \in V$. 则称 V 为一个复线性空间.

定义 6.3. 设 V 为一个线性空间, 如果 $W \subseteq V$ 也是线性空间, 则称 W 为 V 的子空间.

定义 6.4. 设 V 为一个线性空间, V_1, V_2 为 V 的两个子空间, 如果 $\forall v \in V$, 存在唯一的 $v_1 \in V_1, v_2 \in V_2$ 使得 $v = v_1 + v_2$. 称 V 为 V_1 和 V_2 的直和, 记为 $V = V_1 \oplus V_2$.

定理 6.1. 设 V 为一个线性空间, V_1, V_2 为 V 的两个子空间, 如果 $\forall v \in V$, 存在 $v_1 \in V_1, v_2 \in V_2$ 使得 $v = v_1 + v_2$, 则称 V_1 与 V_2 的和为 V , 记号 $V = V_1 + V_2$. 现在设 $V = V_1 + V_2$, 那么 $V = V_1 \oplus V_2$ 当且仅当 $V_1 \cap V_2 = \{0\}$.

定义 6.5. 设 V_1, V_2 为 V 的两个子空间, 如果对于任意 $v_1 \in V_1, v_2 \in V_2$ 有 $v_1 \perp v_2$, 则称 V_1 与 V_2 正交.

定义 6.6. 设 W 为 V 的一个子空间, $W^\perp = \{y \in V | \forall w \in W, y \perp w\}$, 称为 W 的正交补空间. 那么有 $V = W \oplus W^\perp$.

定义 6.7. 设 V 和 W 为两个线性空间, 映射 $T: V \rightarrow W$ 满足

1. 保加: 对于任意 $v_1, v_2 \in V$, 有 $T(v_1 + v_2) = Tv_1 + Tv_2$.
2. 保数乘: $\forall k \in \mathbb{C}, \forall v \in V$, 有 $T(kv) = k(Tv)$

称 T 为 V 到 W 的一个线性映射.

现在来考虑 Moore-Penrose 方程的几何意义.

我们设 $A_{m \times n}$, 记 $U = \mathbb{C}^n, V = \mathbb{C}^m, V_1 = \text{Im}(A), U_0 = \text{Ker}(A)$.

定理 6.2. 设 $G \in A\{1\} \iff \forall y \in V_1$, 有 $AGy = y$. 通俗的说, 1-逆 G 相当于一个挑原像的作用. 设 $G \in A\{1\}$, 那么 G 限制在 V_1 上是单射, 且 $G(V_1)$ 是 U_0 在 U 中的直和补.

定理 6.3. 设 $G \in A\{1\}$, 则有以下性质:

1. AG 和 GA 都是幂等阵.
2. $\text{Im}(AG) = \text{Im}(A), \text{Ker}(GA) = \text{Ker}(A)$. 那么 $U = \text{Im}(GA) \oplus U_0, V = V_1 \oplus \text{Ker}(AG)$. 且限制映射 $G|_{V_1}: V_1 \rightarrow G(V_1)$ 与 $A|_{G(V_1)}: G(V_1) \rightarrow V_1$ 互为逆, 而 $A|_{U_0} = 0, \text{Ker}(AG) = G^{-1}(U_0)$.
3. 若还有 $G \in A\{1, 2\}$, 那么 $A \in G\{1\}$, 从而还有 $\text{Im}(GA) = \text{Im}(G), \text{Ker}(AG) = \text{Ker}(G)$.

定理 6.4. 集合 $A\{1\}$ 与集合 $\Sigma_1 = \{(U_1, \text{LinearMap}(V_0, U_0)) | U_1 \oplus U_0 = U, V_0 \oplus V_1 = V\}$ 有一一对应关系. 对应关系可以为 $\varphi_1: G \mapsto (G(V_1), G|_{\text{Ker}(AG)}: \text{Ker}(AG) \rightarrow U_0)$.

定理 6.5. 集合 $A\{1, 2\}$ 与集合 $\Sigma_{12} = \{(U_1, V_0) | U_1 \oplus U_0 = U, V_0 \oplus V_1 = V\}$ 一一对应. 对应关系可以为 $\varphi_{12}: G \mapsto (G(V_1), \text{Ker}(G))$.

定理 6.6. $A\{1, 3\}$ 与 $\Sigma_{13} = \{(U_1, \text{LinearMap}(V_1^\perp, U_0) | U_1 \oplus U_0 = U)\}$ 一一对应, 对应关系为 $\varphi_1|_{A\{1,3\}}$.

定理 6.7. $A\{1, 4\}$ 与 $\Sigma_{14} = \{\text{LinearMap}(V_0, U_0) | V_0 \oplus V_1 = V\}$ 一一对应, 对应关系为 $\varphi_{14} : G \mapsto (G|_{\text{Ker}(AG)} : \text{Ker}(AG) \rightarrow U_0)$.

现在容易看出, A^+ 实际上是唯一的映射满足 $A^+|_{V_1^\perp} = 0$ 和 $A^+|_{V_1}$ 为 $A|_{U_0^\perp}$ 的逆.

第七章 附录

7.1 其它知识补充

7.2 集合运算

关于集合的一些直观的基础概念我们是已知的. 我们仅对一部分知识进行复习或学习.

定义 7.1. 设 A, B, X, Y, \dots 等等都是集合.

- 集合的差 $A \setminus B := \{a \in A | a \notin B\}$. 称 B 在 A 中的补集. 当我们总是考虑集合 X 的子集时, 我们也称 X 为全集, 子集 E 在 X 的补集 $X \setminus E$ 也记为 E^c .
- 幂集 $\mathcal{P}(X) := \{S | S \subseteq X\}$.
- 卡氏积集 $X \times Y := \{(x, y) | x \in X, y \in Y\}$ 是由所有的有序二元对 (x, y) 其中 $x \in X, y \in Y$ 构成的集合. 类似地, 可以 (归纳地) 定义 n 个集合的卡氏积 $X_1 \times X_2 \times \dots \times X_n := (X_1 \times \dots \times X_{n-1}) \times X_n$. 而 $X \times X$ 可以简记为 X^2 .
- 一族集合的交: 设 $\{X_i\}_{i \in I}$ 为集合 X 的一族子集合, 这里下标集 I 不为空集, 则 $\bigcap_{i \in I} X_i := \{x \in X | \forall i \in I : x \in X_i\}$.
- 一族集合的并: 设 $\{Y_j\}_{j \in J}$ 为集合 Y 的一族子集合, 则 $\bigcup_{j \in J} Y_j := \{y | \exists j \in J : y \in Y_j\}$. 注意: 如果此时下标集 J 为空集, 则并集也为 (约定为) 空集.

注 7.1. “空真”, “空集拥有一切性质”. 逻辑上, 设 E 是某个性质, $E(x)$ 表示 x 有性质 E . 那么我们认为, 命题 $[x \in \emptyset \implies E(x)]$ 对于所有 $x \in X$ 总

是真的.

例 7.1. 让 $A_x = (x, x+1] \subseteq \mathbb{R}$ 其中 $x \in \mathbb{R}$, 那么我们得到一族集合 $\{A_x\}_{x \in \mathbb{R}}$, 那么

$$\bigcup_{x \in \mathbb{R}} A_x = \mathbb{R}, \bigcap_{x \in \mathbb{R}} A_x = \emptyset.$$

命题 7.1. $X \times Y = \emptyset \iff X = \emptyset$ 或 $Y = \emptyset$.

命题 7.2. 让 $A_i (i \in I)$ 和 $B_j (j \in J)$ 都是 X 的子集. 那么

1. $(\bigcap_{i \in I} A_i) \cap (\bigcap_{j \in J} B_j) = \bigcap_{(i,j) \in I \times J} (A_i \cap B_j).$
 $(\bigcup_{i \in I} A_i) \cup (\bigcup_{j \in J} B_j) = \bigcup_{(i,j) \in I \times J} (A_i \cup B_j).$ (结合律)
2. $(\bigcap_{i \in I} A_i) \cup (\bigcap_{j \in J} B_j) = \bigcap_{(i,j) \in I \times J} (A_i \cup B_j).$
 $(\bigcup_{i \in I} A_i) \cap (\bigcup_{j \in J} B_j) = \bigcup_{(i,j) \in I \times J} (A_i \cap B_j).$ (分配律)
3. $(\bigcap_{i \in I} A_i)^c = \bigcup_i A_i^c.$
 $(\bigcup_{i \in I} A_i)^c = \bigcap_{i \in I} A_i^c.$ (de Morgan 律)

映射的定义

定义 7.2. 设 X 和 Y 是两个集合, 如果集合 X 中的每个元素 x 按照某种规则 f 与集合 Y 中的唯一一个元素 y 相对应, 我们就说有一个从 X 到 Y 的映射 f . 集合 X 称为映射的定义域 (映射的出发域), 而 Y 称为映射的靶域 (也叫作映射的到达域), X, f, Y 三者一起考虑才构成映射的定义. 用记号 $f: X \rightarrow Y, x \mapsto f(x)$ 表示之.

映射, 函数, 映照等词语经常是表示同一个意思. 我们也不做区分.

注 7.2. 上述定义严格来说并不能称为定义, 因为“按照某种规则”这几个字的含义是不清晰的. 事实上, 可以先定义关系, 再定义函数关系/函数. 若 $R \subseteq X \times Y$, 则称 R 是 X 到 Y 的一个关系. 而 $(x, y) \in R$ 就称为 x 对 y 有关系 R , 记为 xRy . 如果关系 R 具有性质: 对于每个 $x \in X$, 有且只有一个 $y \in Y$, 使得 xRy . 那么称 R 为 X 到 Y 的一个函数关系. 通常用 $f: X \rightarrow Y$ 来表示函数关系, 而 $y = f(x)$ 则代替 xfy .

例 7.2. 记号 1_A 表示集 A 上的恒等映射, $1_A: A \rightarrow A, a \mapsto a$.

例 7.3. 设 X, Y 为非空集, $b \in Y$, 那么 $X \rightarrow Y, x \mapsto b$ 称为常值映射.

例 7.4. 设 $f: X \rightarrow Y$, $A \subseteq X$. 那么 $f|_A: A \rightarrow Y, x \mapsto f(x)$ 称为 f 在子集 A 上的限制映射.

例 7.5. 设 $A \subseteq X$, $g: A \rightarrow Y$, $f: X \rightarrow Y$. 如果 $f|_A = g$, 称 f 是 g 的一个扩张/延拓.

例 7.6. 集合 X , $A \subseteq X$. 映射 $\chi_A: X \rightarrow \{0, 1\}, x \mapsto \begin{cases} 1, & x \in A \\ 0, & x \notin A \end{cases}$ 称为 A 的示性函数.

定义 7.3. 映射的合成/复合. 设 $f: X \rightarrow Y$, $g: Y \rightarrow Z$. 那么 $h: X \rightarrow Z, x \mapsto g(f(x))$ 称为 g 与 f 的复合映射, 记为 $g \circ f$.

定理 7.1. (复合有结合律) $f: X \rightarrow Y, g: Y \rightarrow Z, h: Z \rightarrow W$, 那么 $(h \circ g) \circ f = h \circ (g \circ f)$.

定义 7.4. 映射 $f: X \rightarrow Y$. 称 f 为

- 单射, 如果: $x_1 \neq x_2 \implies f(x_1) \neq f(x_2)$. 即不同的元素映成不同的像.
- 满射, 如果每个 $y \in Y$ 都能被映上: 即 $\forall y \in Y, \exists x \in X$, 使得 $y = f(x)$.
- 双射, 如果 f 是既单且满的.

定理 7.2. 映射 $f: A \rightarrow B$ 为双射 \iff 存在映射 $g: B \rightarrow A$ 使得 $f \circ g = 1_B, g \circ f = 1_A$.

上述引理中的 g 是存在且唯一的, 称为 f 的逆, 记为 f^{-1} .

定理 7.3. 设 $f: X \rightarrow Y, g: Y \rightarrow Z$ 都是双射. 那么 $g \circ f: X \rightarrow Z$ 也是双射并且 $(g \circ f)^{-1} = f^{-1} \circ g^{-1}$.

集函数

定义 7.5. 设 $f: X \rightarrow Y$ 为映射, $A \subseteq X$, 记号 $f(A) := \{f(x) | x \in A\}$ 称为 A 在映射 f 下的像集. 设 $B \subseteq Y$, 集合 $f^{-1}(B) := \{x \in X | f(x) \in B\}$ 称为集 B 在映射 f 下的原像集.

而集合 $f(X)$ 就直接称为 f 的像集, 一般使用记号 $\text{im}(f)$ 表示, 不过在复数中 im 有特殊的别的含义, 我们就不使用 $\text{im}(f)$ 这个记号来表示 f 的像集了.

定义 7.6. 设 $f: X \rightarrow Y$ 是映射. 那么我们可以诱导出以下两个映射:

$$f: \mathcal{P}(X) \rightarrow \mathcal{P}(Y), A \mapsto f(A) \text{ 和 } f^{-1}: \mathcal{P}(Y) \rightarrow \mathcal{P}(X), B \mapsto f^{-1}(B).$$

注 7.3. 以上用了似乎不该使用的符号 f, f^{-1} 来表示诱导出来的映射, 但是这个上下文清晰的, 所以不会产生歧义. 当然, 使用别的记号是逻辑上更清晰的, 例如, 用 $\text{Preim}_f(B) := f^{-1}(B), \text{Im}_f(A) := f(A)$ 等.

当 f 是双射时, $\{f^{-1}(y)\} = f^{-1}(\{y\})$ 对所有 y 成立, 在这个等式中, 显然我们是清楚左右两边中的 f^{-1} 到底是指哪一个.

定理 7.4. 设 $f: X \rightarrow Y$. 考虑诱导的集函数 f 和 f^{-1} . 有以下性质:

1. 若 $A \subseteq B \subseteq X$, 则 $f(A) \subseteq f(B)$.
2. 设 $\forall i \in I$ 都有 $A_i \subseteq X$, 则 $f(\cup_i A_i) = \cup_i f(A_i)$.
3. 设 $\forall i \in I$ 都有 $A_i \subseteq X$, 则 $f(\cap_i A_i) \subseteq \cap_i f(A_i)$.
4. 设 $A \subseteq X$, 则 $f(A^c) \supseteq f(X) \setminus f(A)$.
5. 若 $A \subseteq B \subseteq X$, 则 $f^{-1}(A) \subseteq f^{-1}(B)$.
6. 设 $\forall i \in I$ 都有 $A_i \subseteq X$, 则 $f^{-1}(\cup_i A_i) = \cup_i f^{-1}(A_i)$.
7. 设 $\forall i \in I$ 都有 $A_i \subseteq X$, 则 $f^{-1}(\cap_i A_i) = \cap_i f^{-1}(A_i)$.
8. 设 $A \subseteq X$, 则 $f^{-1}(A^c) = (f^{-1}(A))^c$.

如果 $g: Y \rightarrow Z$, 那么 $(g \circ f)^{-1} = f^{-1} \circ g^{-1}$.

证明. 留给读者. 容易记忆的是: 取原像集函数 f^{-1} 具有良好的性质, 它可以和交、并、补都交换. \square

定义 7.7. 从集合 X 到集合 Y 的映射的全体构成的集合, 我们记为 Y^X . 而 \mathbb{R}^2 可以理解为由从 $\{1, 2\}$ 到 \mathbb{R} 的所有的函数构成的集合.

关系

定义 7.8. (关系) 集合 X 上的一个关系是指 $X \times X$ 的一个子集 R . 当 $(x, y) \in R$ 时, 我们称 x 与/对 y 有关系 R , 记 xRy 或者 $x \sim_R y$.

1. 关系 R 称为自反的, 如果 $\Delta_X = \{(x, x) | x \in X\} \subseteq R$, 即 $\forall x \in X, xRx$.

2. 关系 R 称为传递的, 如果 $xRy \wedge yRz \implies xRz$.

3. 关系 R 称为对称的, 如果 $xRy \implies yRx$.

定义 7.9. (等价关系) 集合 X 上的一个关系 \sim , 如果满足以下三条:

1. 自反性: $\forall x \in X, x \sim x$.
2. 对称性: 若 $x \sim y$, 则 $y \sim x$.
3. 传递性: 若 $x \sim y, y \sim z$, 则 $x \sim z$.

那么称关系 \sim 是 X 上的一个等价关系. 对于每个 $x \in X$, 子集 $[x] := \{y \in X | y \sim x\}$ 称为 x 所在的等价类, 每一个 $y \in [x]$ 都是该等价类的代表元, 即, $\forall y \in [x]$ 都有 $[y] = [x]$. 商集

$$X/\sim := \{[x] | x \in X\}$$

称为 X 模掉等价关系 \sim 后得到的商集, 它是由所有等价类构成的集合, 显然 X/\sim 是幂集 $\mathcal{P}(X)$ 的一个子集.

定义 7.10. 集合 X . 设 $\mathcal{A} \subseteq \mathcal{P}(X) \setminus \{\emptyset\}$ 满足以下性质: $\forall x \in X$, 存在唯一一个 $A \in \mathcal{A}$, 使得 $x \in A$. 也就是说 \mathcal{A} 是由两两不相交的 X 的非空子集构成并且这些子集的并恰好是 X . 那么我们称 \mathcal{A} 是 X 的一个分划/划分/分割/partition.

定理 7.5. 设 \sim 为 X 上的一个等价关系. 则 X/\sim 是 X 的一个划分.

定理 7.6 (* 等价关系与划分一一对应). 集合 X 上的等价关系全体与其上的划分有自然的一一对应关系.

证明. 只需要证明 $\sim \mapsto X/\sim$ 是从等价关系集到划分集之间的双射即可. 但需要一点点努力. \square

例 7.7. 让 X 是此刻在郑州市的人构成的集合. $x \sim y : \iff x, y$ 有相同的爸爸.

例 7.8. $n \times m$ 实矩阵上的矩阵等价? n 阶实方阵上的相似关系? n 阶实对称矩阵上的合同关系? 此例中, 哪些等价关系诱导出的商集是有限集?

代数基本定理

定理 7.7. (代数基本定理) 关于 t 的复系数多项式方程

$$t^n + c_{n-1}t^{n-1} + \cdots + c_0 = 0$$

在复数域中总有根.

推论 7.1. 设 $f(t) = t^n + c_{n-1}t^{n-1} + \cdots + c_0 \in \mathbb{C}[t]$, 那么存在 $t_1, \dots, t_n \in \mathbb{C}$ 使得 $f(t) = (t - t_1) \cdots (t - t_n)$.

7.3 拓扑知识介绍

距离空间

定义 7.11. 设 X 是集合. 函数 $d: X \times X \rightarrow \mathbb{R}$ 称为 X 上的一个距离/度量, 如果它满足:

1. 正定性 $d(x, y) \geq 0$, $x, y \in X$, 并且等号成立当且仅当 $x = y$.
2. 对称性 $d(x, y) = d(y, x)$, $x, y \in X$.
3. 三角不等式 $d(x, y) \leq d(x, z) + d(z, y)$, $x, y, z \in X$.

若 d 是 X 上的一个距离/度量, 则 (X, d) 称为距离/度量空间. 当距离 d 是上下文清晰时, 可以直接称 X 为距离空间. 最后, $d(x, y)$ 称为 x 和 y 的距离.

定理 7.8. (X, d) 是距离空间. 那么对于任意 $a, b, c \in X$ 有

$$d(a, b) \geq |d(a, c) - d(c, b)|.$$

定义 7.12. 设 (X, d) 是距离空间, $a \in X$, $r > 0$. 集合

$$\mathbb{B}(a, r) := \mathbb{B}_X(a, r) := \{x \in X | d(a, x) < r\}$$

称为以 a 为球心半径为 r 的开球. 而

$$\tilde{\mathbb{B}}(a, r) := \tilde{\mathbb{B}}_X(a, r) := \{x \in X | d(a, x) \leq r\}$$

称为以 a 为球心半径为 r 的闭球.¹

¹闭球 $\tilde{\mathbb{B}}(a, r)$ 我们采取了上方加波浪号表示, 大部分文献是使用 $\mathbb{B}(a, r)$ 的记号. 因为在更一般的拓扑的意义下集合上方加一杠通常表示闭包, 并不能完全和上述定义一致. 为此区分使用记号.

定义 7.13. 设 (X, d) 是距离空间. 集合 $E \subseteq X$, 函数 d 在 $E \times E$ 上的限制 d_E 自动是 E 上的一个距离. 距离空间 $(E, d|_E)$ 称为距离空间 X 的子空间. 通常我们也直接将 $d|_E$ 写成 d .

例 7.9. 实数集 \mathbb{R} 上可以通过绝对值函数 $|\cdot|$ 诱导出一个距离: $d(x, y) := |x - y|$ 使得 \mathbb{R} 是距离空间.

例 7.10. 同样的, 复数集 \mathbb{C} 也能自然的成为距离空间.

例 7.11. \mathbb{R}^n 上通常的欧式距离 $d(x, y) := \sqrt{\sum_{k=1}^n (x_k - y_k)^2}$, 注意验证三角不等式时需要利用 Cauchy 不等式.

例 7.12. (不重要的例子) 设 X 是非空集. 函数

$$d(x, y) = \begin{cases} 1, & x \neq y \\ 0, & x = y \end{cases}$$

是 X 上的距离.

定义 7.14. (X, d) 为距离空间, $x \in X$, $N \subseteq X$, 若存在 $r > 0$ 使得 $B(x, r) \subseteq N$ 就称 N 是 x 的一个邻域, 称 x 是 N 的一个内点. 开球 $B(x, r)$ 称为 x 的一个 (开的) r -邻域.

定义 7.15. (X, d) 距离空间, $E \subseteq X$, 若存在 $x_0 \in X$ 和 $r > 0$ 使得 $E \subseteq B(x_0, r)$, 则称 E 是有界集.

定义 7.16. (X, d) 距离空间. 子集合 $U \subseteq X$ 称为 X 中的一个开集, 如果 U 中的每个点 x , U 都是 x 的一个邻域. 特别的, \emptyset 和 X 都是开集.

子集合 $F \subseteq X$ 称为闭集, 如果 F^c 是开集.

定理 7.9. 开球 $\mathbb{B}(a, r)$ 是开集. 闭球 $\tilde{B}(a, r)$ 是闭集.

定理 7.10. (开集公理) 开集满足以下开集公理:

1. 空集和全集是开集.
2. 开集的有限交是开集.
3. 开集的任意并是开集.

于是, 距离空间 (X, d) 中 U 是开集当且仅当 U 是一些 (可以是无穷多个) 开球的并.

证明. 根据“开集公理”若 U 是一些开球的并, 由于开球是开集, 从而 U 是开集. 反之, 假设 U 是开集, 那么 $\forall x \in U$, 存在 $\delta = \delta(x) > 0$, 使得 $B_x = B(x, \delta) \subseteq U$, 那么 $U = \bigcup_{x \in U} B_x$. \square

相应地, 闭集满足以下性质.

定理 7.11. (闭集公理)

1. 空集和全集是闭集.
2. 闭集的有限并是闭集.
3. 闭集的任意交是闭集.

拓扑空间

定义 7.17. 设 X 为集合, $\mathcal{T} \subseteq \mathcal{P}(X)$, 如果 \mathcal{T} 满足:

1. $\emptyset, X \in \mathcal{T}$
2. $U_1, U_2 \in \mathcal{T} \implies U_1 \cap U_2 \in \mathcal{T}$
3. $U_\alpha \in \mathcal{T}, \alpha \in \Lambda \implies \bigcup_{\alpha \in \Lambda} U_\alpha \in \mathcal{T}$

则称 \mathcal{T} 为 X 上的一个拓扑, (X, \mathcal{T}) 称为拓扑空间, \mathcal{T} 中的元素称为开集.

定义 7.18. 设 (X, \mathcal{T}) 为拓扑空间.

1. 子集 F 称为**闭集**如果 F^c 是开集.
2. 设 $E \subseteq X, x \in E$. 若存在开集 U 使得 $x \in U \subseteq E$, 称 E 为 x 的一个**邻域**, x 是 E 的**内点**. 若 E 本身已经是开集, 就称为 x 的一个**开邻域**.

定义 7.19. 设 (X, d) 为距离空间, 那么在距离空间中定义的“开集”全体形成的集合构成 X 上的拓扑 \mathcal{T}_d , 拓扑空间 (X, \mathcal{T}_d) 称为由距离 d 诱导出来的拓扑空间.

定义 7.20. (内部, 闭包, 边界) 设 (X, \mathcal{T}) 为拓扑空间, $E \subseteq X$.

1. E 的**内部**, 记为 E° 或 $\text{Int}(E)$, 是指含于 E 的最大开子集. 即,

$$E^\circ = \bigcup_{U \subseteq E, \text{且 } U \text{ 是 } X \text{ 中的开集}} U$$

为含于 E 的所有开子集之并. 它是 E 中所有内点构成的子集合.

2. E 的**闭包**, 记为 $\bar{E}, E^-, \text{Cl}_X(E), \text{Cl}(E)$, 是指包含 E 的最小闭集. 即

$$E^- = \bigcap_{E \subseteq F \text{ 且 } F \text{ 是闭集}} F.$$

X 中的点 $x \in E^-$ 当且仅当 x 的任何一个 (开) 邻域 U 与 E 都有非空交.

3. E 的**边界**, 记为 $\partial E, \text{Bd}(E)$, 定义为 $\partial E := E^- \setminus E^\circ$. 一个点 $x \in \partial E$ 当且仅当: 对于 x 的任何一个 (开) 邻域 U 都有 $U \cap E \neq \emptyset$ 且 $U \cap E^c \neq \emptyset$.

证明. 我们来证明 E^- 中的点恰好是满足性质 (*): “点 x 的任何一个开邻域 U 与 E 都相交” 的点.

首先, $x \notin E^- \iff x \in E^c$, 且 E^c 是开集, 又 $E^c \cap E = \emptyset$, 所以 $x \notin E^- \implies x$ 没有性质 (*).

如果 x 没有性质 (*), 则存在 x 的开邻域 U 使得 $U \cap E = \emptyset$, 从而 $E \subseteq U^c$. 因为 U^c 是闭集, 所以 $E^- \subseteq U^c$, 这说明 $x \in U \subseteq E^c$, $x \notin E^-$.

综上, $x \notin E^- \iff x$ 不满足性质 (*). 所以 $x \in E^-$ 当且仅当 x 满足性质 (*). \square

定义 7.21. (子空间拓扑) 设 (X, \mathcal{T}) 是拓扑空间, $Y \subseteq X$. 那么我们可以自然的在 Y 上赋予一个拓扑

$$\mathcal{T}_Y := \mathcal{T} \cap Y := \{U \cap Y \mid U \in \mathcal{T}\}$$

称为子空间拓扑/限制拓扑. 拓扑空间 (Y, \mathcal{T}_Y) 称为 (X, \mathcal{T}) 的子空间. 上下文清晰时, 直接说 Y 是 X 的一个 (拓扑) 子空间.

定义 7.22. (连续映射) 设 X, Y 是拓扑空间. 映射 $f: X \rightarrow Y$ 称为**连续映射/连续函数**, 如果对于任意 Y 中的开集 V , 都有 $f^{-1}(V)$ 是 X 中的开集. 即, “开集反射开集”.

注 7.4. 一个映射成不成为连续映射必须是依赖于其上赋予拓扑的.

定理 7.12. 设 X, Y 为拓扑空间, 映射 $f: X \rightarrow Y$. 则以下等价

1. f 是连续的.
2. 对于 Y 中的任何闭子集 F , 有 $f^{-1}(F)$ 是 X 中的闭子集. 即, “闭集反射闭集”.
3. 对于每个 $x \in X$, $f(x)$ 的每个邻域 V 而言, $f^{-1}(V)$ 是 x 的邻域.

证明. 我们证明 1 和 3 是等价的.

$1 \implies 3$: 设 $x \in X$, V 是 $f(x)$ 的一个邻域, 那么存在 Y 中的开集 W 使得 $f(x) \in W \subseteq V$, 所以 $x \in f^{-1}(W) \subseteq f^{-1}(V)$. 而 f 是连续的, 所以 $f^{-1}(W)$ 是开的, 从而 $f^{-1}(V)$ 是 x 的一个邻域.

$3 \implies 1$: 设 V 是 Y 中的开集, 我们来证 $f^{-1}(V)$ 是 X 中的开集. 任取 $x \in f^{-1}(V)$, 有 $f(x) \in V$, 从而 V 是 $f(x)$ 的邻域, 故 $f^{-1}(V)$ 是 x 的邻域. 所以存在 x 的开邻域 U_x 使得 $U_x \subseteq f^{-1}(V)$. 那么 $f^{-1}(V) = \bigcup_{x \in f^{-1}(V)} U_x$ 是开集. \square

注 7.5. 上述定理中最后一条 3, 如果对某个特定的 $x_0 \in X$ 成立, 就说 f 在 x_0 处连续.

即, 设 $x_0 \in X$, 我们说 f 在 x_0 处连续是指: 对于 $f(x_0)$ 的任意一个邻域 V , 有 $f^{-1}(V)$ 是 x_0 的邻域.

那么该条说的是 f 是连续的当且仅当 f 在每一点处都是连续的.

例 7.13. (重要例子) 设 X, Y, Z 是拓扑空间.

1. (常值函数是连续函数) 设 $f: X \rightarrow Y, x \mapsto y_0$ 其中 y_0 是 Y 中的一个固定点. 那么 f 是连续映射.
2. (连续映射的复合是连续的) 设 $f: X \rightarrow Y$ 和 $g: Y \rightarrow Z$ 都是连续的, 那么 $g \circ f: X \rightarrow Z$ 是连续的.
3. 设 $f: X \rightarrow Y$ 是连续的. 设 $A \subseteq X, f(A) \subseteq B \subseteq Y$, 那么 $\tilde{f}: A \rightarrow B, a \mapsto f(a)$ 是连续的. (此时 A 和 B 分别是 X 和 Y 的子空间.)
4. 设 Y 是 Z 的子空间, $f: X \rightarrow Y$ 是连续的. 那么 $g: X \rightarrow Z, x \mapsto f(x)$ 也是连续的.

5. 设 $f: X \rightarrow Y$, 而 $X = \cup_{\alpha \in \Lambda} U_\alpha$ 且每个 U_α 都是 X 中的开集. 那么 f 是连续的当且仅当: 对所有 $\alpha \in \Lambda$, 限制映射 $f_\alpha: U_\alpha \rightarrow Y, x \mapsto f(x)$ 都是连续的.

证明. 我们证明第三条. 设 U 是 Y 中开集, 那么 $\tilde{f}^{-1}(U \cap B) = f^{-1}(U \cap B) \cap A = f^{-1}(U) \cap f^{-1}(B) \cap A = f^{-1}(U) \cap A$. 由于 $f: X \rightarrow Y$ 是连续的, 所以 $f^{-1}(U)$ 是 X 中的开集, $f^{-1}(U) \cap A$ 是 A 中的开集. 于是 $\tilde{f}: A \rightarrow B, a \mapsto f(a)$ 是连续的.

证明第五条的 (\Leftarrow) 部分. 任取 Y 中的开集 U , 注意到 $f^{-1}(U) \cap U_\alpha = f_\alpha^{-1}(U)$, 如果 f_α 是连续的, 则 $f_\alpha^{-1}(U)$ 是 U_α 中的开集. 由于 U_α 是 X 的开集, 从而 $f_\alpha^{-1}(U)$ 是 X 中的开集 (?). 而 $f^{-1}(U) = \cup_\alpha (f^{-1}(U) \cap U_\alpha)$, 因此 $f^{-1}(U)$ 是 X 中的开集. 这就证明了 f 是连续的.

我们经常的也使用同一个符号 f , 此时指明定义域和靶域来表达这个映射 $f: A \rightarrow B$. \square

现在我们回到距离空间.

定义 7.23. 让 (X, d_X) 和 (Y, d_Y) 是距离空间, $x_0 \in X$, $f: X \rightarrow Y$, 我们说 f 在 x_0 处连续, 如果: $\forall \epsilon > 0, \exists \delta > 0$, 当 $d_X(x, x_0) < \delta$ 时有 $d_Y(f(x), f(x_0)) < \epsilon$.

可以验证, 该定义与拓扑空间之间的映射在一点处连续的定义一致. 见注7.5.

证明. 让 $x_0 \in X$, 记 $y_0 = f(x_0)$.

设 f 在 x_0 处按 $\epsilon - \delta$ 定义是连续的. 那么对于任意 y_0 的一个邻域 V , 存在 $\epsilon > 0$, 使得 $B(y_0, \epsilon) \subseteq V$. 根据 $\epsilon - \delta$ 连续的定义, 存在 $\delta > 0$, 使得当 $x \in B(x_0, \delta)$ 时, 有 $f(x) \in B(y_0, \epsilon) \subseteq V$. 所以 $B(x_0, \delta) \subseteq f^{-1}(V)$, $f^{-1}(V)$ 是 x_0 的一个邻域.

反之, 假设 f 在 x_0 是按照“反射邻域的方式”定义连续的. 那么 $\forall \epsilon > 0$, 对于 y_0 的邻域 $V = B(y_0, \epsilon)$ 而言, $f^{-1}(V)$ 是 x_0 的一个邻域, 故存在 $\delta > 0$, 使得 $B(x_0, \delta) \subseteq f^{-1}(V)$. 这恰好就是当 $x \in B(x_0, \delta)$ 时, $f(x) \in B(y_0, \epsilon)$ 的意思. \square

对于距离空间之间的连续映射, 可以有 $\epsilon - \delta$ 的定义方式.

定理 7.13. 设 (X, d_X) 和 (Y, d_Y) 是距离空间, $f: X \rightarrow Y$. 那么 f 是连续的当且仅当 f 在每个点 x_0 处都是连续的. 即, $\forall x_0 \in X, \forall \epsilon > 0, \exists \delta > 0$ 使得当 $d_X(x, x_0) < \delta$ 时有 $d_Y(f(x), f(x_0)) < \epsilon$.

注意: 一般说来上述 δ 是与 x_0 以及 ϵ 有关.

习题

1. 设 (X, d) 是度量空间, 让 $\rho(x, y) = \frac{d(x, y)}{1+d(x, y)}$. 证明 ρ 是 X 上的距离.
2. (*) 如上题记号, 证明距离函数 d 和距离函数 ρ 诱导出相同的拓扑, 即 $\mathcal{T}_d = \mathcal{T}_\rho$. 换言之, U 在 (X, d) 是开集当且仅当 U 在 (X, ρ) 中也是开集.
3. \mathbb{R}^2 中上定义两个距离 d 和 σ 如下: d 是通常欧式距离, 即 $d(x, y) = \sqrt{(x_1 - y_1)^2 + (x_2 - y_2)^2}$, 而 $\sigma(x, y) = |x_1 - y_1| + |x_2 - y_2|$. 证明 d 和 σ 诱导出相同的拓扑, 即 $\mathcal{T}_d = \mathcal{T}_\sigma$, 换言之 U 在 (\mathbb{R}^2, d) 中是开集当且仅当 U 在 (\mathbb{R}^2, σ) 中是开即.
4. (粘贴引理) 设 X, Y 是拓扑空间, $X = A \cup B$ 且 A 和 B 都是 X 中的闭子集. 假设 $f: A \rightarrow Y$ 和 $g: B \rightarrow Y$ 是连续的, 并且对于任意 $x \in A \cap B$ 有 $f(x) = g(x)$. 考虑映射 $h: X \rightarrow Y$, $h(x) = \begin{cases} f(x), & x \in A \\ g(x), & x \in B \end{cases}$. 证明 h 是连续的.
5. 设 $f, g: \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ 是连续映射, 证明 $\{x | f(x) \leq g(x)\}$ 是闭集. (提示: 可以直接利用 $h(x) = f(x) - g(x), x \in \mathbb{R}$ 是连续的.
6. 设 $f, g: \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ 是连续的, 证明 $h(x) = \min\{f(x), g(x)\}$ 是连续函数. (提示: 可以利用前两个题目的结论)

7.4 极限

序列极限

定义 7.24. 假设 (X, d) 是距离空间, $a: \mathbb{N} \rightarrow X, n \mapsto a_n$ 称为 X 中的一个序列/点列. 序列 a 的第 n 项 (标号为 n) 的值是 a_n , 通常也直接说 a_n 是该序列的第 n 项. 序列的记号可以表示为 $\{a_n\}_{n=1}^\infty$. 我们说序列 $\{a_n\}_{n=1}^\infty$ 有极限 $a_0 \in X$, 如果 $\forall \epsilon > 0$, 存在 $N \in \mathbb{N}$, 当 $n \geq N$ 时, 有 $d(a_n, a_0) < \epsilon$. 记为 $\lim_{n \rightarrow \infty} a_n = a_0$. 有极限的序列称为收敛序列, 没有极限的序列称为发散序列.

显然, $\lim a_n = a_0 \iff \lim d(a_n, a_0) = 0$. (后者是实数列的收敛.)

显然, 极限如果存在, 那么必然唯一.

注 7.6. 序列也可以从某个整数开始, 用 $\mathbb{Z}_{\geq k}$ 表示大于等于 k 的整数, $a: \mathbb{Z}_{\geq k} \rightarrow X, n \mapsto a_n$ 也称为 X 中的序列, 记号当然可以用 $\{a_n\}_{n=k}^{\infty}$.

显然, 改变一个序列的有限多项的值并不影响该序列是否收敛以及不影响序列的极限值 (如果收敛的话). 所以当我们只关心收敛性或者极限值时, 可以直接省略的写序列记号 $\{a_n\}$.

注 7.7. 注意, 有没有极限不单和序列本身有关, 和序列所在的空间也有关. 另外, 序列的记号 $\{a_n\}_{n=1}^{\infty}$ 与 $\{a_n | n \in \mathbb{N}\}$ 所表示的内涵略有不同, 前者仅仅是“函数”的一种约定的简写而后者则表示函数 a 的像集, 例如对于常值序列后者则是一个单点集. 显然, 我们觉得这种记号多少是有点歧义的. 为了方便, 我们有时也用记号 $\{a_n\}_{n=1}^{\infty} \subseteq X$ 表示, a 是 X 中的一个序列, 这种写法, 一方面 $\{a_n\}_{n=1}^{\infty}$ 既理解为序列, 另一方面又理解为映射 a 的像集 (从而表示取值在 X 中). 不管怎样, 这只是记号上的“方便”.

例 7.14. $a_n = \frac{1}{n}, n \in \mathbb{N}$, 那么如果将 $\{a_n\}$ 看成是 \mathbb{R} 中的序列/数列, 则在 \mathbb{R} 中有极限 $a_0 = 0, \lim a_n = 0$. 如果将 $\{a_n\}$ 看成是空间 $(0, 2)$ 中的序列, 那么它没有极限, 因为 $0 \notin (0, 2)$.

定理 7.14. 设 $f: X \rightarrow Y$ 是距离空间之间的映射, $x_0 \in X$. 则以下等价:

1. f 在 x_0 处连续,
2. 对于任意的一个收敛于 x_0 的序列 $\{x_n\}$ 都有 $\lim f(x_n) = f(x_0)$.

证明. 我们证 $2 \implies 1$. 如果 f 在 x_0 处不连续, 那么存在 $\epsilon > 0$, 对于 $\forall n \in \mathbb{N}$, 考虑 $\delta_n = \frac{1}{n}$, 则存在 $x_n \in B(x_0, \delta_n)$ 使得 $f(x_n) \notin B(f(x_0), \epsilon)$. 此时 $\lim x_n = x_0$, 但是 $\{f(x_n)\}$ 不收敛于 $f(x_0)$. \square

现在我们考虑复数 \mathbb{C} 中的数列收敛问题, 此时, \mathbb{C} 中的两点 z, w 的距离为 $|z - w|$.

定理 7.15. 考虑复数列 $\{z_n = x_n + iy_n\}_{n=1}^{\infty}$, $z_0 = x_0 + iy_0 \in \mathbb{C}$, 那么 $\lim z_n = z_0$ 当且仅当 $\lim x_n = x_0$ 且 $\lim y_n = y_0$.

证明. 对于 $z = x + iy \in \mathbb{C}$, 我们有不等式

$$\frac{|x| + |y|}{\sqrt{2}} \leq |z| \leq |x| + |y|.$$

于是

$$\frac{|x_n - x_0| + |y_n - y_0|}{\sqrt{2}} \leq |z_n - z_0| \leq |x_n - x_0| + |y_n - y_0|,$$

从这个不等式, 容易得到结论. \square

类似于实数列中的 Cauchy 列, 我们也可以在一般的距离空间上定义 Cauchy 序列.

定义 7.25. 设 (X, d) 是距离空间, $\{a_n\}_{n=1}^{\infty}$ 是 X 中的序列, 如果它满足: $\forall \epsilon > 0$, 存在 $N \in \mathbb{N}$, 当 $n, m \geq N$ 时, 有 $d(a_n, a_m) < \epsilon$. 则称 $\{a_n\}_{n=1}^{\infty}$ 是 Cauchy 列.

类似于实数列, 我们也有复数列的 Cauchy 收敛定理.

定理 7.16. (Cauchy 收敛准则) 设有复数列 $\{z_n\}_{n=1}^{\infty}$, 那么 $\{z_n\}$ 在 \mathbb{C} 中收敛当且仅当它是 Cauchy 列.

证明. 显然, 任何距离空间中的收敛序列都是 Cauchy 列. 我们下面证明对于距离空间 \mathbb{C} 而言, Cauchy 列必然也收敛. 由不等式

$$|x_n - x_m| \leq |z_n - z_m|, |y_n - y_m| \leq |z_n - z_m|$$

知道如果 $\{z_n\}_{n=1}^{\infty}$ 是 Cauchy 列, 那么 $\{z_n\}_{n=1}^{\infty}$ 的实部数列 $\{x_n\}_{n=1}^{\infty}$ 和虚部数列 $\{y_n\}_{n=1}^{\infty}$ 是 \mathbb{R} 中的 Cauchy 列, 而 \mathbb{R} 中的 Cauchy 列是收敛的, 于是存在 $x_0 \in \mathbb{R}$ 和 $y_0 \in \mathbb{R}$, 使得 $\lim |x_n - x_0| = \lim |y_n - y_0| = 0$, 从而 $\{z_n\}_{n=1}^{\infty}$ 收敛且 $\lim z_n = x_0 + iy_0$. \square

和收敛实数列的运算类似, 收敛的复数列也有对应的性质.

定理 7.17. 设复数列 $\{z_n\}$ 收敛于 z_0 , $\{w_n\}$ 收敛于 w_0 . 那么

1. $\lim(z_n + w_n) = z_0 + w_0$
2. $\lim z_n w_n = z_0 w_0$
3. 若 $w_0 \neq 0$, 则 $\lim \frac{1}{w_n} = \frac{1}{w_0}$.
4. $\lim |z_n| = |z_0|$.

证明. 证明直接模仿实数列的情形即可. 我们这里指出当 $w_0 \neq 0$ 时, 需要说明对于充分大的 n , $w_n \neq 0$, 而 $\lim \frac{1}{w_n}$ 理解为从足够大的 n 以后构成的序列 $\{\frac{1}{w_n}\}$ 的极限.

(如果, 极限不是在复数集上考虑, 而是在扩充的复平面 $(\hat{\mathbb{C}}, \sigma)$ 上考虑的话, 分母不为零的要求可以去掉.) \square

经过一点点努力, 定理7.15与定理7.16 对于任意 k 维欧式空间 $X = \mathbb{R}^k$ 有类似的结论.

设 $X = \mathbb{R}^k$, 其上的距离函数 d 按照通常的约定: 即 $x = (x_1, \dots, x_k), y = (y_1, \dots, y_k) \in \mathbb{R}^k$, 距离 $d(x, y) = \sqrt{\sum_{j=1}^k (x_j - y_j)^2}$. 由于 \mathbb{R}^k 中的元素 x 按照通常约定其第 j 分量用 x_j 表示, 已经使用过了下标, 所以我们用上标形式 $\{x^{(n)}\}$ 来表示 X 中的序列, 其中 $x^{(n)} = (x_1^{(n)}, \dots, x_k^{(n)}) \in \mathbb{R}^k, n \in \mathbb{N}$. 当然如果有更好的记号也是可以的.

定理 7.18. 设 $\{p^{(n)}\}$ 为 $X = \mathbb{R}^n$ 中的一个序列, $p^{(0)} \in X$, 那么 $\lim p^{(n)} = p^{(0)}$ 当且仅当 $\lim p_j^{(n)} = p_j^{(0)}, j = 1, 2, \dots, k$. 即 \mathbb{R}^k 中的序列收敛于某个点当且仅当其分量序列收敛于该点对应的分量.

定理 7.19. 设 $\{p^{(n)}\}$ 为 $X = \mathbb{R}^n$ 中的一个序列, 那么 $\{p^{(n)}\}$ 收敛当且仅它是 *Cauchy* 列.

以上两个定理都可以通过以下不等式获得证明: 设 $x = (x_1, \dots, x_k) \in \mathbb{R}^k$, 那么

$$\frac{|x_1| + \dots + |x_k|}{\sqrt{k}} \leq \sqrt{x_1^2 + x_2^2 + \dots + x_k^2} \leq |x_1| + |x_2| + \dots + |x_k|.$$

其中 $\frac{|x_1| + \dots + |x_k|}{\sqrt{k}} \leq \sqrt{x_1^2 + x_2^2 + \dots + x_k^2}$ 可以通过 Cauchy-Schwartz 不等式得到. 当然不需要 $\frac{|x_1| + \dots + |x_k|}{\sqrt{k}} \leq \sqrt{x_1^2 + x_2^2 + \dots + x_k^2}$ 也可以, 只要利用 $|x_j| \leq \sqrt{x_1^2 + x_2^2 + \dots + x_k^2}, j = 1, 2, \dots, k$ 以及 $\sqrt{x_1^2 + x_2^2 + \dots + x_k^2} \leq |x_1| + |x_2| + \dots + |x_k|$ 即可模仿之前的证明得到相应的证明.

注 7.8. (小知识) 若距离空间 (X, d) 的任何 Cauchy 列都收敛, 那么称这个距离空间是**完备**的距离空间.

所以 \mathbb{R}^k 以及复数 \mathbb{C} 是完备的距离空间. 而 $(0, 1)$ 作为距离空间 \mathbb{R} 的子空间, $(0, 1)$ 不是完备的距离空间.

对于距离空间 (X, d) 中子集 E 的闭包 E^- 可以利用序列极限来刻画:

定理 7.20. 设 (X, d) 是距离空间, $E \subseteq X$, 那么 X 中的点 $a \in E^-$ 当且仅当存在 E 中的序列 $\{a_n\}$ 使得 $\lim a_n = a$.

证明. 假设 $\{a_n\} \subseteq E$ 且 $\lim a_n = a$, 根据极限的定义, a 的任何邻域总包含某 a_n , 于是 $a \in E^-$.

现在假设 $a \in E^-$, 那么 $\forall n \in \mathbb{N}$, $B(a, 1/n) \cap E \neq \emptyset$. 对于每个 n , 我们可以从 E 中选择一个元素 $a_n \in B(a, 1/n) \cap E$. 则 $\lim a_n = a$. \square

级数

定义 7.26. (级数) 设 $\{z_n\}_{n=0}^{\infty}$ 是复数列, 我们构造部分和数列 $S_n = \sum_{k=0}^n z_k, n \in \mathbb{Z}_{\geq 0}$. 如果 $\{S_n\}$ 收敛于 S , 我们说“级数 $\sum_{n=0}^{\infty} z_n$ ”是收敛的, 其和为 S , 记为 $\sum_{n=0}^{\infty} z_n = S$. 如果 $\{S_n\}$ 是发散的, 就说“级数 $\sum_{n=0}^{\infty} z_n$ ”是发散的.

和复数列收敛的定理类似, 级数也有对应的收敛定理.

定理 7.21. 复数项级数 $\sum_{n=0}^{\infty} z_n = a+bi$ 当且仅当 $\sum_{n=0}^{\infty} x_n = a$ 且 $\sum_{n=0}^{\infty} y_n = b$.

定理 7.22. (Cauchy 收敛原理) 复数项级数 $\sum z_n$ 收敛, 当且仅当它满足: $\forall \epsilon > 0, \exists N$, 当 $m > n \geq N$ 时, $|\sum_{k=n}^m z_k| < \epsilon$.

定义 7.27. (绝对收敛级数) 复数项级数 $\sum z_n$ 称为绝对收敛的, 如果 $\sum |z_n|$ 是收敛的.

定理 7.23. 绝对收敛的复数项级数是收敛的. 若 $\sum |z_n|$ 收敛, 那么 $\sum z_n$ 收敛, 且 $|\sum z_n| \leq \sum |z_n|$.

证明. (证明一) 考虑实部和虚部, 利用实数项级数的性质.

由于 $\sum |x_n| \leq \sum |z_n|$, $\sum |y_n| \leq \sum |z_n|$, 于是 $\sum x_n$ 与 $\sum y_n$ 都是绝对收敛的实数项级数, 从而它们是收敛的. 于是 $\sum z_n$ 收敛. 显然, $|\sum_{n=0}^m z_n| \leq \sum_{n=0}^m |z_n| \leq \sum_{n=0}^{\infty} |z_n|$, 故 $|\sum z_n| \leq \sum |z_n|$.

(证明二) 利用 Cauchy 收敛定理. 注意到 $|\sum_{k=n}^m z_k| \leq \sum_{k=n}^m |z_k|$ 对于任意 $m > n$ 成立. 由于 $\sum |z_n|$ 收敛, 所以 $\forall \epsilon > 0, \exists N$, 当 $m > n \geq N$ 时, $|\sum_{k=n}^m z_k| \leq \sum_{k=n}^m |z_k| < \epsilon$. 故 $\sum z_n$ 收敛. \square

定义 7.28. 设有级数 $\sum_{n=1}^{\infty} z_n$. 有一个双射 $k: \mathbb{N} \rightarrow \mathbb{N}, n \mapsto k_n$. 那么级数 $\sum_{n=1}^{\infty} z_n$ 按 k 得到的重排级数为 $\sum_{n=1}^{\infty} z_{k_n}$, 称级数 $\sum_{n=1}^{\infty} z_{k_n}$ 是级数 $\sum_{n=1}^{\infty} z_n$ 的一个重排. 通俗的说, 就是对级数的项按照一种新顺序重新排列而得到的新级数称为一个重排级数.

定理 7.24. (重排定理) 设复数项级数 $\sum_{n=1}^{\infty} z_n$ 绝对收敛其和为 s , 那么任一重排后的级数 $\sum_{n=1}^{\infty} z_{k_n}$ 也是绝对收敛的, 并且和也是 s .

证明. 对于任取定的 $m \in \mathbb{N}$, 我们取 $M \in \mathbb{N}$ 使得 $k_1, k_2, \dots, k_m \leq M$.

那么 $\sum_{n=1}^m |z_{k_n}| \leq \sum_{n=1}^M |z_n| \leq \sum_{n=1}^{\infty} |z_n|$, 所以 $\sum_{n=1}^{\infty} z_{k_n}$ 是绝对收敛的, 从而 $\sum_{n=1}^{\infty} z_{k_n}$ 也是收敛的.

任一取定的 $\epsilon > 0$, 由于 $\sum_{n=1}^{\infty} z_n$ 是绝对收敛的, 故存在 N , 使得 $\sum_{n=N}^{\infty} |z_n| \leq \epsilon$. 取 N' 使得 $j \geq N'$ 时有 $\{1, 2, \dots, N\} \subseteq \{k_1, k_2, \dots, k_j\}$, 并且 $N' \geq N$. 那么当 $j \geq N'$ 时, $|\sum_{n=1}^j z_n - \sum_{n=1}^j z_{k_n}| \leq \sum_{n=N}^{\infty} |z_n| \leq \epsilon$. 让 $j \rightarrow \infty$, 得到 $|s - \sum_{n=1}^{\infty} z_{k_n}| \leq \epsilon$, 该式对任意 $\epsilon > 0$ 成立, 于是 $\sum_{n=1}^{\infty} z_{k_n} = s$. \square

定理 7.25. (级数乘积定理) 设复数项 $\sum_{n=0}^{\infty} z_n$ 和 $\sum_{n=0}^{\infty} w_n$ 都是绝对收敛的, 其和分别为 A 和 B . 以任一种方式遍历 $(n, m) \in \{0, 1, 2, \dots\} \times \{0, 1, 2, \dots\}$ 得到的级数 $\sum z_n w_m$ 是绝对收敛的, 和为 AB . 特别的, 有 $\sum_{n=0}^{\infty} (\sum_{k=0}^n z_n w_{n-k}) = AB$.

证明. 设 $\sigma: \mathbb{Z}_{\geq 0} \rightarrow \mathbb{Z}_{\geq 0} \times \mathbb{Z}_{\geq 0}, n \mapsto (\sigma_1(n), \sigma_2(n))$ 是双射. 我们需要证明 $\sum_{n=0}^{\infty} z_{\sigma_1(n)} w_{\sigma_2(n)}$ 是绝对收敛的并且收敛的和是 AB .

事实上对于 $\mathbb{Z}_{\geq 0} \times \mathbb{Z}_{\geq 0}$ 中的任何非空有限子集 F , 总可以找到 N , 使得 $F \subseteq \{0, 1, \dots, N\} \times \{0, 1, \dots, N\}$, 那么

$$\sum_{(n,m) \in F} |z_n w_m| \leq \left(\sum_0^N |z_n| \right) \left(\sum_0^N |w_m| \right) \leq \left(\sum_{n=0}^{\infty} |z_n| \right) \left(\sum_{m=0}^{\infty} |w_m| \right),$$

于是 $\sum_{n=0}^{\infty} z_{\sigma_1(n)} w_{\sigma_2(n)}$ 是绝对收敛的, 由重排定理, $\sum_{n=0}^{\infty} z_{\sigma_1(n)} w_{\sigma_2(n)}$ 的任和一个重排级数都是绝对收敛的且收敛于共同的极限.

现在考虑 $\sum_{n=0}^{\infty} z_{\sigma_1(n)} w_{\sigma_2(n)}$ 的一个特殊的重排级数:

$$\begin{aligned} & z_0 w_0 \\ & + z_0 w_1 + z_1 w_1 + z_1 w_0 \\ & \vdots \\ & + z_0 w_n + z_1 w_n + \cdots + z_n w_n + z_n w_{n-1} + \cdots + z_n w_0 \\ & + \cdots \end{aligned}$$

此级数的部分和序列存在一个子列 $z_0 w_0, (z_0 + z_1)(w_0 + w_1), \dots, (\sum_{n=0}^m z_n)(\sum_{n=0}^m w_n), \dots$ 该子列收敛于 AB . 那么级数 $\sum_{n=0}^{\infty} z_{\sigma_1(n)} w_{\sigma_2(n)} = AB$.

再考虑另外一种特殊的重排级数:

$$\begin{aligned}
 & z_0 w_0 \\
 & + z_0 w_1 + z_1 w_0 \\
 & + z_0 w_2 + z_1 w_1 + z_2 w_0 \\
 & \vdots \\
 & + z_0 w_n + z_1 w_{n-1} + \cdots + z_n w_0 \\
 & + \cdots
 \end{aligned}$$

那么该级数的和为 AB , 而 $\sum_{n=0}^{\infty} (\sum_{k=0}^n z_n w_{n-k})$ 是上述级数添加括号后得到的级数, 故也收敛于 AB . \square

注 7.9. 级数乘积定理的这个证明中, 想法是比较直接的, 只是书写起来略微会麻烦一些. 也有另外的处理方式, 我们这里不展示了.

函数极限

函数极限的一般理论深入思考稍微会有点复杂. 实际上有序列极限就足够了, 不过我们在高数中会学习到函数极限的概念, 其中又包含各种情形, 单边极限、二元函数沿某直线趋近于原点的极限等等的说法. 很有必要对这些概念进行统一的处理.

函数极限理论的一个显然的用处是用来描述连续性, 让我们尝试回忆一下连续的概念, 从而引入函数极限的概念. 假设 $f: X \rightarrow Y$ 是距离空间之间的映射, $x_0 \in X, y_0 = f(x_0)$, 我们说 f 在 x_0 处连续是指: 对于 y_0 的任何一个邻域 V , 可以找到 x_0 的一个邻域 U , 使得 $f(U) \subseteq V$.

如果 x_0 是所谓的孤立点, 即单点集 $\{x_0\}$ 本身就是一个开集, 那么 f 在 x_0 处自动连续. 例如, $X = \mathbb{Z}$ 是距离空间 \mathbb{R} 的子空间, 那么任何一个映射 $f: \mathbb{Z} \rightarrow Y$ 都是连续映射. 所以考虑连续性, 我们需要关心的是那种叫做“极限点/聚点”的点: 也就是单点集 $\{x_0\}$ 不是开集的点 x_0 , 换句话说, x_0 的任何一个邻域都含有异于 x_0 的点. 对于这样的点, 函数在这点处连续与否, 和函数在这点 x_0 的“不包括 x_0 点的附近”的函数值以及 y_0 的关系有关.

另外一方面, 有时候, 我们预先没有知道函数 f 在一点 x_0 处的定义, 需要补充在这一点处的函数值 $f(x_0)$ 使得新的函数是原来函数的“一个连续延拓”, 此时也需要我们关心函数在“不包括 x_0 点的附近”的性态.

为此, 我们需要给出“极限点”的概念.

定义 7.29. 假设 (X, d) 是一个距离空间, E 是 X 的子集, 点 $p \in X$ 称为 E 的一个**极限点/聚点**, 如果 p 的每个邻域 U 都包含 E 中异于 p 的点 (即 $(U \setminus \{p\}) \cap E = U \cap E \setminus \{p\} \neq \emptyset$).

例 7.15. 假设 G 是 \mathbb{C} 中的非空开集, $p \in G$. 那么 p 是 G 的极限点, p 是 $G \setminus \{p\}$ 的极限点.

定理 7.26. 设 (X, d) 是一个距离空间, E 是 X 的子集, 点 $p \in X$ 为 E 的极限点, 那么 p 点的任何一个邻域都包含 E 中的无穷多个点.

证明. 留做练习. □

定义 7.30. 设 (X, d) 是距离空间, $p \in X$, 如果单点集 $\{p\}$ 是开集, 那么称点 p 是**孤立点**.

注 7.10. 显然, 定义 7.29 和 7.30 可以在一般的拓扑空间上做定义, 但对于我们距离空间已经足够用了. 另外, 定理 7.26 只适用于距离空间而对于一般的拓扑空间显然不成立.

定义 7.31. (函数极限) 假设 X, Y 是距离空间, $E \subseteq X$, $f: E \rightarrow Y$, 并且 $p \in X$ 是 E 的极限点. 如果存在 $q \in Y$ 满足: 对于任意的 $\epsilon > 0$, 存在 $\delta > 0$, 使当 $x \in E$ 且 $0 < d_X(x, p) < \delta$ 时, 有 $d_Y(f(x), q) < \epsilon$. 称 q 是当 x 在 E 上趋近于 p 时 $f(x)$ 的极限. 记成

$$\lim_{x \rightarrow p} f(x) = q$$

或者更明确地写成

$$\lim_{x \rightarrow p, x \in E} f(x) = q.$$

注 7.11. 上述定义中“ $\epsilon - \delta$ 语言部分”可以等价的表述为: 对于 q 的任一给定邻域 V_q , $f^{-1}(V_q)$ 将包含 p 的一个去心邻域 (即存在 p 的邻域 U_p 使得 $f(U_p \setminus \{p\}) \subseteq V_q$).

推论 7.2. 沿用定义 7.31 的记号, 假设 $F \subseteq E$ 并且 p 是 F 的极限点, 假设 $\lim_{x \rightarrow p, x \in E} f(x) = q$ 存在, 那么 $\lim_{x \rightarrow p, x \in F} f(x)$ 也存在且极限值为 q . 极限 $\lim_{x \rightarrow p, x \in F} f(x)$ 称为 x 在 F 上趋近于 p 时 $f(x)$ 的极限.

定理 7.27. 假设 X, Y 是距离空间, $E \subseteq X$, $f: E \rightarrow Y$, 并且点 $p \in E$. 如果 p 是 E 的极限点, 那么 f 在 p 点处连续当且仅当 $\lim_{x \rightarrow p} f(x) = f(p)$.

证明. 显然. \square

例 7.16. 假设 $f: \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$, 那么 $\lim_{x \rightarrow 0} f(x)$ 的意思是通常的极限的意思. 而单侧极限 $\lim_{x \rightarrow 0^+} f(x)$ 的含义就是将 f 定义域限制在 $(0, +\infty)$ 后再看 x 趋近 0 这点的极限, 也就是

$$\lim_{x \rightarrow 0^+} f(x) = \lim_{x \rightarrow 0, x > 0} f(x).$$

例 7.17. 如果 $X = \hat{\mathbb{C}}$ 为 Riemann 球面, $E = \mathbb{N} \subseteq X$, 那么 ∞ 是 E 的极限点, 复数列 $\{x_n\}_{n=1}^{\infty}$ 的极限问题可以看成函数 $x: \mathbb{N} \rightarrow \mathbb{C}, n \mapsto x_n$ 在 $n \rightarrow \infty$ 时的极限问题.

例 7.18. 函数 $f: \mathbb{C} \rightarrow \mathbb{C}, z \mapsto z$ 是连续的.

定义 7.32. 假设 f, g 都是定义在某集合 E 上的复值函数, 那么函数的和 $f + g$ 定义为 $f + g: E \rightarrow \mathbb{C}, p \mapsto f(p) + g(p)$. 类似的, 可以定义函数的差 $f - g$, 函数乘积 fg . 而函数的商 f/g 可以定义在 $g \neq 0$ 的点集上. 也可以定义 $\operatorname{Re}(f): E \rightarrow \mathbb{R}, p \mapsto \operatorname{Re}(f(p))$ 等等.

定理 7.28. 设 (X, d) 是距离空间, $E \subseteq X$, $p_0 \in X$ 是 E 的极限点, $f: E \rightarrow \mathbb{C}, p \mapsto u(p) + iv(p)$, 设 $A = u_0 + iv_0 \in \mathbb{C}$. 那么

$$\lim_{p \rightarrow p_0} f(p) = A \iff \lim_{p \rightarrow p_0} u(p) = u_0 \text{ 且 } \lim_{p \rightarrow p_0} v(p) = v_0.$$

证明. 注意到 $|u(p) - u_0|, |v(p) - v_0| \leq |f(p) - A| \leq |u(p) - u_0| + |v(p) - v_0|$, 剩余证明是容易的. \square

定理 7.29. 设 (X, d) 是距离空间, $E \subseteq X$, $p \in X$ 是 E 的极限点, 而 f, g 都是 E 上的复值函数, 且

$$\lim_{x \rightarrow p} f(x) = A, \quad \lim_{x \rightarrow p} g(x) = B.$$

那么

$$1. \lim_{x \rightarrow p} (f + g)(x) = A + B$$

$$2. \lim_{x \rightarrow p} (fg)(x) = AB$$

3. $\lim_{x \rightarrow p} \left(\frac{f}{g}\right)(x) = \frac{A}{B}$, 如果 $B \neq 0$.

定理 7.30. 设 X 是距离空间, $f, g: X \rightarrow \mathbb{C}$, $p \in X$, 并且 f, g 在 p 点处连续, 那么 $f + g, f - g, fg$ 都在 p 点处连续. 如果 $g(p) \neq 0$, 那么 f/g 在 p 点处也连续. (其中 f/g 是定义在 $g \neq 0$ 上的函数).

证明. 可以利用函数极限来证明, 也可以直接根据连续性的定义来证明. 证明略. \square

所以复系数多项式函数 $w = P(z) = a_0 + a_1 z + \cdots + a_n z^n$ 是 \mathbb{C} 到 \mathbb{C} 上的连续函数. 而有理函数 $w = \frac{P(z)}{Q(z)}$, 其中 P, Q 是复系数多项式, 在复平面内分母不为零的点集上是连续的.

我们后面主要考虑的都是复变量复值函数, 所以后面我们考虑的距离空间主要是 \mathbb{C} 或者 $\hat{\mathbb{C}}$. 当考虑的距离空间是 $\hat{\mathbb{C}}$ 时, 有必要对 $\hat{\mathbb{C}}$ 的拓扑进行研究.

定理 7.31. 距离空间 $\hat{\mathbb{C}}$ 中 U 是 $\hat{\mathbb{C}}$ 的开子集当且仅当

1. 或者 $U \subseteq \mathbb{C}$, 此时 U 是 \mathbb{C} 中的开集.
2. 或者 $\infty \in U$, 此时 $\hat{\mathbb{C}} \setminus U$ 是 \mathbb{C} 中的有界闭集.

证明. 严格的证明并不难. 但是这里不给出了. 因为 $\hat{\mathbb{C}}$ 的拓扑是直接由 \mathbb{R}^3 中的单位球面上的拓扑通过球极投影搬运过来的, 从几何直观上可以得到直接的认识. 例如, $\{z \in \mathbb{C} \mid |z| > \delta\} \cup \{\infty\}$ 将会是 ∞ 的一个邻域, 而 $\{z \in \mathbb{C} \mid |z| > \delta\}$ 是 ∞ 的一个去心邻域. \square

这个定理也有另外一种等价的表述:

定理 7.32. 距离空间 $\hat{\mathbb{C}}$ 中 U 是 $\hat{\mathbb{C}}$ 的开子集当且仅当

1. $U \cap \mathbb{C}$ 是 \mathbb{C} 中的开集.
2. 若 $\infty \in U$, 则存在 $r > 0$ 使得 $\{z \in \mathbb{C} \mid |z| > r\} \subseteq U$.

于是复变函数的极限定义 $\lim_{z \rightarrow z_0} f(z) = A$ 可以涉及到 z_0 和 A 都是有限的复数、 z_0 和 A 之中至少有一个是 ∞ 的情况. 我们下面直接给出部分情况的定义.

定义 7.33. (复变函数的函数极限的 $\epsilon - \delta$ 语言定义) $\lim_{z \rightarrow z_0} f(z) = A$

1. 在 z_0 和 A 都是有限的复数时, 是指: $\forall \epsilon > 0, \exists \delta > 0$, 当 $0 < |z - z_0| < \delta$ 时, 有 $|f(z) - A| < \epsilon$.
2. $z_0 = \infty, A \in \mathbb{C}$ 时, 是指: $\forall \epsilon > 0, \exists \delta > 0$, 当 $|z| > \delta$ 时 (且 $z \neq \infty$), 有 $|f(z) - A| < \epsilon$.
3. $z_0 \in \mathbb{C}, A = \infty$ 时, 是指: $\forall \epsilon > 0, \exists \delta > 0$, 当 $0 < |z - z_0| < \delta$ 时, 有 $|f(z)| > \epsilon$.
此时, 也可以等价于 $\lim_{z \rightarrow z_0} |f(z)| = \infty$.
4. $z_0 = \infty, A = \infty$ 时, 是指: $\forall \epsilon > 0, \exists \delta > 0$, 当 $|z| > \delta$ 时 (且 $z \neq \infty$), $|f(z)| > \epsilon$.
此时, 也可以等价于 $\lim_{z \rightarrow \infty} |f(z)| = \infty$.

无论哪种情形, 都要求 z_0 是 f 定义域 E 的极限点.

注 7.12. 定义 7.33 是通常的复变量复值函数中函数极限的定义, 简单的说, $\lim_{z \rightarrow z_0} f(z) = A$, 是指 A 的任何一邻域 V , 总可以找到 z_0 的一个去心邻域 $U \setminus \{z_0\}$, 使得 $f^{-1}(V)$ 包含该去心邻域. 粗糙的说就是, 无论与 A 多接近的误差 V , 当自变量 z 与 z_0 足够接近 (但不取 z_0) 时, 函数值 $f(z)$ 与 A 的“接近度”会落在预先给定的误差 V . 而怎么定义“接近度”其抽象的公理性质恰好就是“拓扑”的实质内涵.

习题

1. 证明收敛复数列是有界的.
2. 证明定理 7.17.
3. 给定距离空间 (X, d) 中的一个序列 $\{p_n\}_{n=1}^{\infty}$. 假设 $k_1 < k_2 < \cdots < k_m < \cdots$ 为 \mathbb{N} 的一个严格递增的自然数列, 序列 $\{p_{k_m}\}_{m=1}^{\infty}$ 称为序列 $\{p_n\}_{n=1}^{\infty}$ 的一个子序列. 如果 $\{p_n\}$ 收敛于 p_0 , 请证明其子序列 $\{p_{k_m}\}_{m=1}^{\infty}$ 也收敛于 p_0 .
4. 若级数 $\sum_{n=1}^{\infty} z_n$ 收敛于 s , 则 $\lim_{n \rightarrow \infty} z_n = 0$.
5. 证明: 复数项级数 $\sum_{n=0}^{\infty} z^n$ 收敛当且仅当 $|z| < 1$. (记号约定: $z^0 = 1$)
6. 证明定理 7.26.

7. 假设 $\lim_{n \rightarrow \infty} z_n = A$, 证明

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \frac{z_1 + z_2 + \cdots + z_n}{n} = A.$$

参考文献

- [1] 徐仲等编著. 矩阵论简明教程 (第三版) [M]. 北京: 科学出版社, 2014.
- [2] 王鄂芳, 石生明. 高等代数 (第四版) [M]. 北京: 高等教育出版社, 2013.
- [3] Horn R A, Johnson C R. Matrix analysis [M]. 2nd ed. Cambridge university press, 2012.
- [4] 王松桂, 吴密霞, 贾忠贞. 矩阵不等式 (第二版) [M]. 北京: 科学出版社, 2006.

索引

- 像空间, 7
- 关系, 41
 - 代表元, 42
 - 等价关系, 42
- 函数极限, 56
- 划分, 42
- 定理
 - Cauchy 收敛定理, 51, 53
 - 一点处连续, 57
 - 级数乘积定理, 54
 - 级数重排定理, 54
- 序列
 - Cauchy 列, 51
 - 极限, 49
- 拓扑
 - 内部, 46
 - 子空间, 44, 46
 - 孤立点, 56
 - 完备的距离空间, 52
 - 开球, 闭球, 43
 - 开集, 闭集, 44
 - 拓扑空间, 45
- 有界集, 44
- 极限点, 56
- 距离空间, 43
- 边界, 46
- 连续映射, 46, 48
- 邻域, 内点, 44, 45
- 闭包, 46, 52
- 映射
 - 像集, 40
 - 单射, 满射, 双射, 40
 - 原像集, 40
 - 复合映射, 40
 - 定义域, 39
 - 逆, 40
 - 靶域, 39
- 核空间, 7
- 级数
 - 收敛, 53
 - 绝对收敛, 53
 - 重排, 53
- 线性空间, 6