

群聊: 23矩阵



该二维码7天内(9月12日前)有效, 重新进入将更新



矩阵理论

刘克新

自动化科学与电气工程学院

邮箱: skxliu@163.com

教材与参考书

参考教材:

《矩阵基本理论与应用》王磊编著 北京航天航天大学出版社 参考书:

《矩阵论教程》张绍飞、赵迪编著 机械工业出版社《矩阵论》 戴华编著 科学出版社

经典教材: Matrix Analysis 2nd Edition, R.A. Horn, C.R. Johnson, Cambridge University Press, 2013.

扩展教材:矩阵分析与应用(第二版)张贤达编著,清华 大学出版社,2013.



考试成绩

MOOC+课堂随机测试

15%

要求:1. 研究生智慧教育平台,选课;

- 2. 视频+每章习题;
- 3. 请大家积极反馈视频、习题、课本中的错误

矩阵论在XX中的应用/介绍报告1篇 15%

要求:1. 中文, 可理论分析、数值计算、或算法等;

- 2. 字数不超过800字或不超过2页A4纸;
- 3. 格式可参考科技论文;

注意:1. 期末考试前提交纸质版和电子版;

2. 抄袭和雷同者0分。

期末考试

70%



研究生智慧教育平台



1



- ·思政课 ·<u>课程 ·体育</u> ·美育 ·劳动教育 ·教材
- ·虚仿实验·研究生教育·教师教研·课外成长·院士讲堂

https://www.gradsmartedu.cn/



🧼 研究生教育

矩阵理论 × Q

课程筛选

首页



搜索到 9 门 "矩阵理论"相关课程



矩阵理论

王磊 刘克新 等 | 血北京航空航天大学 🛭 248 人

通过学习本课程,理解并掌握数学与自然科学的基本概念和方法,加深对数学与理论创新、工程实际需求紧密结合的认识,提高工科学生利用数学工具解决科学与工程问题的能力。



课程介绍

通过学习本連程、理解并華麗數学与自然科学的基本概念和方法。加度对数学与理论创 新、工程实际需求紧密结合的认识。提高工科学生利用数学工具解决科学与工程问题的能力。





其 它

1, 讲课本上有的, 也会适当讲一些课本上没有的

2,答疑,可反馈给课代表,也可反馈到群里

3, 上课口误, 大家随时纠正

4, 正确看待"显然"、"易得"等



第一章 线性空间引论

- □ 线性空间
- □ 线性子空间
- □ 基与坐标
- □ 内积空间
- □ 直和与投影
- □ 应用:多项式插值

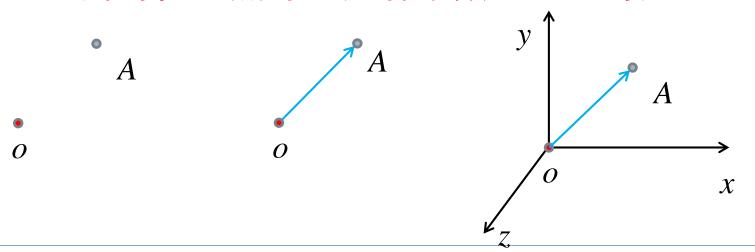
第一章 线性空间引论

1.1 线性空间

线性空间所涵盖的范围,远超大家的想象 从向量空间到线性空间(回顾)

以三维空间为例:

- 空间的任一点与向量一一对应关系;
- 空间的任一点与三元有序数组一一对应.



定义1.1.1 (n维向量) 若n维向量写成

$$\begin{bmatrix} \alpha_1 \\ \alpha_2 \\ \vdots \\ \alpha_n \end{bmatrix}$$

的形式, 称为n维列向量; 若n维向量写成

$$[\alpha_1, \alpha_2, \cdots, \alpha_n]$$

的形式, 称为n维行向量. 这n个数称为该向量的n个分量, 其中 α_i 称为第i个分量.



设 $\boldsymbol{\alpha} = [\alpha_1, \alpha_2, \cdots, \alpha_n]^T$ 和 $\boldsymbol{\beta} = [\beta_1, \beta_2, \cdots, \beta_n]^T, k \in \mathbb{R}$,则有加法运算和数乘运算

$$\boldsymbol{\alpha} + \boldsymbol{\beta} = \begin{bmatrix} \alpha_1 + \beta_1 \\ \alpha_2 + \beta_2 \\ \vdots \\ \alpha_n + \beta_n \end{bmatrix}, k\boldsymbol{\alpha} = \begin{bmatrix} k\alpha_1 \\ k\alpha_2 \\ \vdots \\ k\alpha_n \end{bmatrix}$$

设 $\alpha = [a_1, a_2, \dots, a_n]^T, \beta = [b_1, b_2, \dots, b_n]^T, k \in \mathbb{R},$ 则有加法运算和数乘运算

$$\alpha + \beta = \begin{bmatrix} a_1 + b_1 \\ a_2 + b_2 \\ \vdots \\ a_n + b_n \end{bmatrix},$$

$$k\alpha = \begin{bmatrix} ka_1 \\ ka_2 \\ \vdots \\ ka_n \end{bmatrix}$$

设 $\boldsymbol{\alpha} = [\alpha_1, \alpha_2, \cdots, \alpha_n]^T$ 和 $\boldsymbol{\beta} = [\beta_1, \beta_2, \cdots, \beta_n]^T, k \in \mathbb{R}$,则有加法运算和数乘运算

$$\boldsymbol{\alpha} + \boldsymbol{\beta} = \begin{bmatrix} \alpha_1 + \beta_1 \\ \alpha_2 + \beta_2 \\ \vdots \\ \alpha_n + \beta_n \end{bmatrix}, k\boldsymbol{\alpha} = \begin{bmatrix} k\alpha_1 \\ k\alpha_2 \\ \vdots \\ k\alpha_n \end{bmatrix}$$

定义1.1.2(向量空间)设V是n维实向量的非空集合,若V对向量的加法和数乘两种运算都封闭,即对于任意向量 α , $\beta \in V$ 和 $k \in \mathbb{R}$,都有 $\alpha + \beta \in V$ 和 $k\alpha \in V$ 则称集合V为向量空间.



例1.1.1 定义集合 $V_1 = \{[0, \alpha_2, \cdots, \alpha_n]^T | \alpha_2, \cdots, \alpha_n \in \mathbb{R}\}$

例1.1.1 定义集合 $V_1 = \{[0, \alpha_2, \cdots, \alpha_n]^T | \alpha_2, \cdots, \alpha_n \in \mathbb{R}\}$, 对集合 V_1 中的任意向量 $\alpha = [0, \alpha_2, \cdots, \alpha_n]^T$ 和 $\beta = [0, \beta_2, \cdots, \beta_n]^T$,以及任意 $k \in \mathbb{R}$,有

$$\boldsymbol{\alpha} + \boldsymbol{\beta} = \begin{bmatrix} 0 \\ \alpha_2 + \beta_2 \\ \vdots \\ \alpha_n + \beta_n \end{bmatrix} \in V_1, k\boldsymbol{\alpha} = \begin{bmatrix} 0 \\ k\alpha_2 \\ \vdots \\ k\alpha_n \end{bmatrix} \in V_1$$

所以 V_1 对向量的加法和数乘运算封闭. 由向量空间 定义知, V_1 是向量空间.

例1.1.2 集合 $V_2 = \{[1, \alpha_2, \cdots, \alpha_n]^T | \alpha_2, \cdots, \alpha_n \in \mathbb{R}\},$ 对集合 V_2 中的任意向量 $\alpha = [1, \alpha_2, \cdots, \alpha_n]^T$ 和 $\beta = [1, \beta_2, \cdots, \beta_n]^T$,以及任意 $k \in \mathbb{R}$,有

$$\boldsymbol{\alpha} + \boldsymbol{\beta} = \begin{bmatrix} 2 \\ \alpha_2 + \beta_2 \\ \vdots \\ \alpha_n + \beta_n \end{bmatrix} \notin V_2, k\boldsymbol{\alpha} = \begin{bmatrix} k \\ k\alpha_2 \\ \vdots \\ k\alpha_n \end{bmatrix} \notin V_2$$

所以集合 V_2 对向量的加法和数乘运算不封闭. 由向量空间定义知, V_2 不是向量空间.



从向量空间到线性空间

向量空间中的实数域扩展为一般的数域 向量集合扩展为一般的非空集合 向量加法和数乘扩展为一般的"加法"和"数乘"

定义1.1.3(数域)设F是非空数集, 若F中任意两个数的和、差、积、商(除数不为0)仍在该数集, 即对四则运算封闭, 称该数集F为一个数域.

例如: 实数集:ℝ、复数集:ℂ、有理数集ℚ; 自然数集Ν、整数集ℤ.

思考1: 一个数域一定包含 0 和 1, 有理数集是最小的数域

思考2: 无理数集不构成数域



定义1.1.3(数域)设F是非空数集,若F中包含 0 和 1,并且任意两个数的和、差、积、商(除数不为0)仍在该数集,即对四则运算封闭,称该数集F为一个数域.

思考3:集合 $\mathbb{Q}(\sqrt{2}) = \{a + b\sqrt{2} | a, b \in \mathbb{Q}\}$ 是数域?



定义1.1.4(加群) 在非空集合V上定义一种代数运算, 称之为加法(记为"+"), 使得 $\forall \alpha, \beta \in V$ 都有V中唯一元素 $\alpha + \beta$ 与之对应, 该元素称为 与 β 的和, 且满足如下性质:

- (1) 交换律: $\alpha + \beta = \beta + \alpha$;
- (2) 结合律: $(\alpha + \beta) + \gamma = \alpha + (\beta + \gamma)$;
- (3) 存在零元素 $\theta \in V$ 使得 $\forall \alpha \in V, \alpha + \theta = \alpha$;
- (4) $\forall \alpha \in V$, 存在负元素 $-\alpha$ 使得 $\alpha + (-\alpha) = \theta$; $\alpha \in V$, 存在负元素 $-\alpha$ 使得 $\alpha + (-\alpha) = \theta$; $\alpha \in V$, 不加法运算下构成一个加群, 记为(V, +).

定义1.1.5(线性空间)设(V, +)是一个加群, F是一个数域. 若有F对V的数乘规则, 使得 $\forall \lambda \in F$, $u \in V$, 有V中唯一元素与之对应, 记为 $\lambda \cdot u$, 且此规则满足以下性质:

- (1) $\lambda(u+v) = \lambda u + \lambda v$, 数乘对加法分配律; $\rightarrow V$
- (2) $(\lambda + \mu)\mathbf{u} = \lambda \mathbf{u} + \mu \mathbf{u}$, 数乘对数的加法分配律;
- (3) $\lambda(\mu \mathbf{u}) = (\lambda \mu)\mathbf{u}$, 数乘的结合律;
- (4) $1 \cdot u = u$; 数乘的初始条件;

此时, V称为数域F上的线性空间, V中元素称为向量, F中元素称为标量.



当 $F = \mathbb{R}$ 时,称为实线性空间;当 $F = \mathbb{C}$ 时,称为复线性空间。

例1.1.3 设 $V = \mathbb{R}^+$, $F = \mathbb{R}$, 定义V中加法运算为 $x \oplus y = xy$

定义V中元素与F中数的数乘为

$$k \cdot x = x^k$$

突破传统"线性"的印象

其中, $x, y \in V$, $k \in F$. 证明(V, \bigoplus, \cdot)是实线性主问.

若 $V = \mathbb{R}$, $F = \mathbb{R}$, $x \oplus y = xy$, $k \cdot x = |x|^k$,

(V,⊕,·)是否实线性空间



例1.1.4 常见的线性空间包括以下例子.

- (1) 向量空间 $\mathbb{R}^n (n \geq 1)$ 是线性空间的首个例子.
- (2) 矩阵空间: 设V为 \mathbb{C} 上所有 $m \times n$ 矩阵构成的集合, 即 $V = \{(a_{ij})_{m \times n} | a_{ij} \in \mathbb{C}\}$. 在矩阵加法和数乘运算下, 集合V构成 \mathbb{C} 上的线性空间, 记为 $\mathbb{C}^{m \times n}$. 类似的可定义 $\mathbb{R}^{m \times n}$.

澄清一个概念:数域F中的数,与构成V中元素的"数",不是必然一致的。



例1.1.4 常见的线性空间包括以下例子.

(3) 正弦函数集合 (提示:三角函数和差公式)

$$S_{[x]} = \{a \sin(x+b), a, b \in \mathbb{R}\}\$$

在函数加法和乘法运算下 $S_{[x]}$ 构成 \mathbb{R} 上的线性空间.

留作作业



例1.1.4 常见的线性空间包括以下例子.

(4) 一元多项式集合

$$P_n(x) = \left\{ \sum_{i=0}^n a_i x^i | a_i \in \mathbb{C} \right\}$$

集合 $P_n(x)$ 构成 \mathbb{C} 上的线性空间, 称为多项式空间.

(5) 分别定义在区间[a,b]上全体多项式集合 S_1 , 全体可微函数集合 S_2 , 全体连续函数集合 S_3 , 全体可积函数集合 S_4 , 全体实函数集合 S_5 , 则

$$S_1 \subset S_2 \subset S_3 \subset S_4 \subset S_5$$

且这五个集合均为配上的线性空间.



例1.1.4 常见的线性空间包括以下例子.

- (6) 设 $A \in \mathbb{C}^{m \times n}$, $x \in \mathbb{C}^n$, 齐次线性方程组Ax = 0的解集构成 \mathbb{C} 上的线性空间, 而非齐次线性方程组Ax = b的解集则不构成 \mathbb{C} 上的线性空间.
 - (7) 设S是所有双边序列集合, 其中双边序列 $\{x_k | x_k \in \mathbb{R}, k = 0, \pm 1, \pm 2, \cdots\}$

若序列 $\{y_k\}$ 是集合S中的元素, 定义 $\{x_k\}$ 与 $\{y_k\}$ 的和为 $\{x_k + y_k\}$, 数乘 $c\{x_k\}$ 为 $\{cx_k\}$, 则S是 \mathbb{R} 上的线性空间, 我们称为离散时间信号空间.

注4: 设V 是数域F上的线性空间, 有

- (1) 零向量是唯一的;
- (2) 任一向量的负向量是唯一的;
- (3) 对任意 $k \in F$ 和 $\alpha \in V$,

$$0\alpha = \theta$$
, $(-1)\alpha = -\alpha$, $k\theta = \theta$;

(4) 若 $k\alpha = \theta$, 则k = 0或 $\alpha = \theta$.

留作作业



注5:线性空间中的两种运算—加法和数乘—合称 为**线性运算**.

线性组合和线性表示: 若线性空间V中的向量 α 可由V中一组向量 $\alpha_1, \dots, \alpha_n$ 通过线性运算获得, 即存在 $k_i \in F$, $i = 1, \dots, n$ 满足

$$\boldsymbol{\alpha} = k_1 \boldsymbol{\alpha}_1 + \dots + k_n \boldsymbol{\alpha}_n,$$

则称向量 α 是向量组 $\alpha_1, \dots, \alpha_n$ 的一个**线性组合**,或者说 α 可由向量组 $\alpha_1, \dots, \alpha_n$ **线性表示**.

注: n是有限的



例1.1.5 试判断矩阵 A^2 是否可以由A和I线性表示, 其中

$$A = \begin{bmatrix} 1 & 1 \\ 0 & 1 \end{bmatrix}$$

例1.1.5 试判断矩阵 A^2 是否可以由A和I线性表示, 其中

$$A = \begin{bmatrix} 1 & 1 \\ 0 & 1 \end{bmatrix}$$

解:由于

$$A^2 = \begin{bmatrix} 1 & 2 \\ 0 & 1 \end{bmatrix} = 2A - I$$

因此, 矩阵 A^2 可以由A和I线性表示.

思考:对于一般的n阶复方阵A, A^n 是否可以写成 $I(A^0)$, A^2 , ..., A^{n-1} 的线性组合呢?

第一章 线性空间引论

线性子空间



定义1.2.1(子空间) 设V是F上的线性空间, W是V的非空子集. 若W的向量关于V的加法和数乘运算也构成F上的线性空间, 则称W是V的子空间.

例1.2.1 取定矩阵 $A \in \mathbb{C}^{m \times n}$, 定义集合 $W = \{x \in \mathbb{C}^n | Ax = \mathbf{0}\}$

定义1.2.1(子空间) 设V是F上的线性空间, W是V的非空子集. 若W的向量关于V的加法和数乘运算也构成F上的线性空间, 则称W是V的子空间.

例1.2.1 取定矩阵 $A \in \mathbb{C}^{m \times n}$, 定义集合

$$W = \{ \boldsymbol{x} \in \mathbb{C}^n | A\boldsymbol{x} = \boldsymbol{0} \}$$

则集合W是C上的线性空间.

又知W是向量空间 \mathbb{C}^n 的子集,故W是 \mathbb{C}^n 的子空间.



例1.2.2 在线性空间V中,仅包含单个零向量的集合是线性空间吗?

例1.2.2 在线性空间V中,仅包含单个零向量的集合是线性空间吗?

该集合是线性空间,我们称之为零子空间,记为{ θ } (注意与零元素 θ 的区别).

空间V本身也是V的一个子空间. 子空间V和{ θ }称为V的平凡子空间.

$\{\theta\}$ 为元素最少的空间



例1.2.3 向量空间 \mathbb{R}^2 是 \mathbb{R}^3 的子空间吗?

因为 \mathbb{R}^3 中的向量是3元有序数组,而 \mathbb{R}^2 中的向量为2元有序数组,故 \mathbb{R}^2 不是 \mathbb{R}^3 的子集.



例1.2.3 向量空间 \mathbb{R}^2 是 \mathbb{R}^3 的子空间吗?

因为 \mathbb{R}^3 中的向量是3元有序数组,而 \mathbb{R}^2 中的向量为2元有序数组,故 \mathbb{R}^2 不是 \mathbb{R}^3 的子集.

例1.2.4注意集合 $W = \{ [\alpha_1, \alpha_2, 0]^T, \alpha_1, \alpha_2 \in \mathbb{R} \}$ 是 \mathbb{R}^3 的一个子集,尽管它很像 \mathbb{R}^2 ,但W是 \mathbb{R}^3 的一个子空间.

思考: $W' = \{ [\alpha_1, \alpha_2, \alpha_3]^T, \alpha_1, \alpha_2, \alpha_3 \in \mathbb{R} \, \text{且} \, \alpha_3 \neq 0 \}$ 是 \mathbb{R}^3 的子空间吗?

回答: W'不是线性空间.



例1.2.2 线性空间V的仅由零向量组成的集合是V的一个子空间, 称为零子空间, 记为{ θ }(注意与零元素 θ 的区别); 线性空间V本身也是V的一个子空间. 子空间V和{ θ }称为V的平凡子空间.

思考: 子空间一定包含零元素. $\{\theta\}$ 是最小的子空间. 区分零子空间和空集、平凡子集与平凡子空间.

例1.2.3 向量空间 \mathbb{R}^2 是 \mathbb{R}^3 的子空间吗?

例1.2.4 \mathbb{R}^3 中不通过原点的平面是 \mathbb{R}^3 的子空间吗?



定理1.2.1(子空间判别法)设V是F上的线性空间,W是V的一个非空子集. 以下命题等价:

- (1) W是V的子空间.
- (2) a $\forall k \in F, \alpha \in W,$ 有 $k\alpha \in W;$ b $\forall \alpha, \beta \in W,$ 有 $\alpha + \beta \in W.$
- (3) $\forall k, l \in F$ 和 $\alpha, \beta \in W$, 有 $k\alpha + l\beta \in W$.
- 注1: 检验子空间首先观察零向量是否存在于W中.
- 注2: 子空间是凸集



定理1.2.1(子**空间判别法**)设V是F上的线性空间, W是V的一个非空子集. 以下命题等价:

- (1) W是V的子空间.
- (2) a $\forall k \in F, \alpha \in W$, 有 $k\alpha \in W$; b $\forall \alpha, \beta \in W$, 有 $\alpha + \beta \in W$.

证明: W是V的一个非空子集,则W中的加法和数乘满足加法的交换律、结合律,数乘的结合律、数乘对加法的分配率、数乘对数的加法的分配率以及数乘的初始条件.

W存在零元和负元.



例1.2.5 线性滤波器常用n阶线性差分方程描述. 考查齐次线性差分方程

$$u_{k+n} + a_{n-1}u_{k+n-1} + \dots + a_1u_{k+1} + a_0u_k = 0$$

解集非空

该差分方程的解集 \tilde{S} 是线性空间吗?

 \tilde{S} 信号空间S的子空间.

例1.2.6 设 W_1 和 W_2 是V的子空间, 定义三个集合

$$W_1 \cap W_2 = \{x \in V | x \in W_1 \exists x \in W_2\}$$
 $W_1 \cup W_2 = \{x \in V | x \in W_1 \vec{\exists} x \in W_2\}$
 $W_1 + W_2 = \{x_1 + x_2 | x_1 \in W_1, x_2 \in W_2\}$
试判断它们是否是 V 的子空间.

在聚3空间中,

- (1) $W_1 = xoy$ 平面, $W_2 = yoz$ 平面;
- (2) $W_1 = x$ 轴, $W_2 = yoz$ 平面

考察集合 $W_1 \cap W_2$, $W_1 + W_2$, $W_1 \cup W_2$.

定理1.2.2(和空间与交空间)设 W_1 和 W_2 是数域F

上线性空间V的子空间,则集合

$$W_1 \cap W_2 \triangleq \left\{ \alpha \middle| \alpha \in W_1, \alpha \in W_2 \right\}$$
$$W_1 + W_2 \triangleq \left\{ \alpha_1 + \alpha_2 \middle| \alpha_1 \in W_1, \alpha_2 \in W_2 \right\}$$

是V的子空间,分别称为 W_1 与 W_2 的交(或交空间)与和(或和空间).

证明:显然两个集合非空.



例1.2.7 取
$$V = \mathbb{R}^{n \times n}$$
, 定义
$$W_1 = \{A \in V | A^T = A\}$$

$$W_2 = \{A \in V | A^T = -A\}$$

验证 W_1 和 W_2 是V的线性子空间, 且 $V = W_1 + W_2$. 证明:

$$V\supset W_1+W_2$$
; $V\subset W_1+W_2$

注4: 设V 是数域F上的线性空间, 有

(4) 若 $k \alpha = \theta$, 则k = 0或 $\alpha = \theta$.

W为V的子空间,则W中元素要么1个,要么无穷多个!

$$W = \{ \boldsymbol{x} \in \mathbb{C}^n | A\boldsymbol{x} = \boldsymbol{0} \}$$



子空间的表示方法:

设 $\alpha_1, \dots, \alpha_n$ 是F上线性空间V的一向量组,记 $W = \{k_1\alpha_1 + \dots + k_n\alpha_n | k_i \in F, i = 1, \dots, n\}$

定理1.2.3 若 α_1 ,…, α_n 是线性空间V的一组向量,由上式定义的集合W是V的一个线性子空间,并称W是由向量组 α_1 ,…, α_n 张成(或生成)的子空间,记为span(α_1 ,…, α_n).

上述方法解决了抽象空间中子集的描述.



定义1.2.2(矩阵零空间)设 $A \in \mathbb{C}^{m \times n}$,则矩阵A的零空间(或核空间)定义为齐次线性方程组Ax = 0的解集,记为

$$N(A) = \{ \boldsymbol{x} \in \mathbb{C}^n | A\boldsymbol{x} = \boldsymbol{0} \}$$

定义1.2.3(矩阵列空间)设 $A \in \mathbb{C}^{m \times n}$,则矩阵A的列空间(或值空间)是由A的列的所有线性组合组成的集合,即

$$R(A) = \{ \mathbf{y} \in \mathbb{C}^m | \mathbf{y} = A\mathbf{x}, \forall \mathbf{x} \in \mathbb{C}^n \}$$

若记 $A = [\alpha_1, \cdots, \alpha_n],$ 则 $R(A) = \text{span}(\alpha_1, \cdots, \alpha_n)$



例1.2.8 求矩阵
$$A = \begin{bmatrix} 1 & 1 & 2 \\ -2 & 3 & 1 \end{bmatrix}$$
的零空间和列空间.

例1.2.8 求矩阵
$$A = \begin{bmatrix} 1 & 1 & 2 \\ -2 & 3 & 1 \end{bmatrix}$$
的零空间和列空间.

解: $R(A) = \text{span}(\alpha_1, \alpha_2, \alpha_3)$, 其中 $\alpha_1 = [1, -2]^T$, $\alpha_2 = [1,3]^T$, $\alpha_3 = [2,1]^T$.

对矩阵A进行初等变换得

$$\begin{bmatrix} 1 & 1 & 2 \\ -2 & 3 & 1 \end{bmatrix} \rightarrow \begin{bmatrix} 1 & 0 & 1 \\ 0 & 1 & 1 \end{bmatrix}$$

由此,Ax = 0的一个基础解系为 $\beta = [1,1,-1]^T$,故 $N(A) = \text{span}(\beta)$.



思考1: $A \in \mathbb{C}^{n \times n}$,其零空间和列空间有可能相等吗? 若相同,矩阵A满足什么性质

留作作业

思考2: $R(A) = \operatorname{span}(\alpha_1, \dots, \alpha_n)$ 还可以再化简吗?

