



北京航空航天大学
BEIHANG UNIVERSITY

矩阵理论

谷海波

guhaibo@buaa.edu.cn

自动化科学与电气工程学院

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

1.3 基与坐标



第一章 线性空间引论——基与坐标

定义1.3.1（线性相关与线性无关） 设 V 是 F 上的线性空间, $\alpha_1, \dots, \alpha_n$ 是 V 的一组向量. 若向量方程

$$k_1\alpha_1 + \dots + k_n\alpha_n = \theta, k_1, \dots, k_n \in F$$

只有平凡解, 即 $k_1 = k_2 = \dots = k_n = 0$, 则称向量组 $\alpha_1, \dots, \alpha_n$ 是**线性无关**; 否则称向量组 $\alpha_1, \dots, \alpha_n$ 是**线性相关**.



第一章 线性空间引论——基与坐标

注1: 单个零向量线性相关;
单个非零向量线性无关.

注2: 线性无关向量组的任一子集是线性无关的;
线性相关向量组的任一扩集仍是线性相关的.

第一章 线性空间引论——基与坐标

例1.3.1 考查定义在 \mathbb{C} 上的线性空间 \mathbb{C} , 讨论空间中向量 i 和向量 1 的线性相关性.

分析: 考查方程

$$k_1 \cdot i + k_2 \cdot 1 = \theta, \quad k_1, k_2 \in \mathbb{C}$$

显然, $k_1 = -1, k_2 = i$ 是方程的一组解.

即向量 i 和向量 1 线性相关.

思考: 若定义在 \mathbb{R} 上的线性空间 \mathbb{C} 呢?

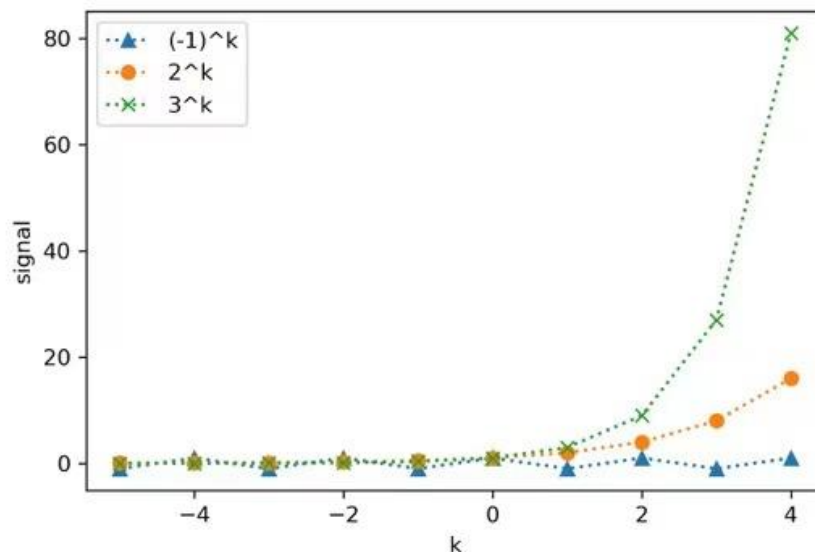
此时 $k_1 \cdot i + k_2 \cdot 1 = \theta$ 在实数域无解. 即向量 i 和向量 1 线性无关.

第一章 线性空间引论——基与坐标

例1.3.2 设信号子空间

$$\tilde{S} = \text{span}(\{x_k\}, \{y_k\}, \{z_k\})$$

其中 $x_k = (-1)^k$, $y_k = 2^k$, $z_k = 3^k$. 试判断信号 $\{x_k\}, \{y_k\}, \{z_k\}$ 是否线性无关.



第一章 线性空间引论——基与坐标

例1.3.2 设信号子空间

$$\tilde{S} = \text{span}(\{x_k\}, \{y_k\}, \{z_k\})$$

其中 $x_k = (-1)^k$, $y_k = 2^k$, $z_k = 3^k$. 试判断信号 $\{x_k\}, \{y_k\}, \{z_k\}$ 是否线性无关.

$$\begin{bmatrix} x_k & y_k & z_k \\ x_{k+1} & y_{k+1} & z_{k+1} \\ x_{k+2} & y_{k+2} & z_{k+2} \end{bmatrix} \begin{bmatrix} l_1 \\ l_2 \\ l_3 \end{bmatrix} = 0, \forall k$$

其中, 系数矩阵称为信号的Casorati矩阵, 行列式称为 $\{x_k\}, \{y_k\}, \{z_k\}$ 的Casorati行列式.

第一章 线性空间引论——基与坐标

例1.3.2 设信号子空间

$$\tilde{S} = \text{span}(\{x_k\}, \{y_k\}, \{z_k\})$$

其中 $x_k = (-1)^k$, $y_k = 2^k$, $z_k = 3^k$. 试判断信号 $\{x_k\}, \{y_k\}, \{z_k\}$ 是否线性无关.

取 $k = 0$ 时, Casorati 矩阵为

$$C = \begin{bmatrix} 1 & 1 & 1 \\ -1 & 2 & 3 \\ 1 & 4 & 9 \end{bmatrix}$$

该矩阵可逆. 因此, 信号 $\{x_k\}, \{y_k\}, \{z_k\}$ 线性无关.

第一章 线性空间引论——基与坐标

定理1.3.1 设线性空间 V 中向量组 $\alpha_1, \dots, \alpha_n$ 线性无关, 而向量组 $\alpha_1, \dots, \alpha_n, \beta$ 线性相关($\beta \neq \theta$), 则 β 可由向量组 $\alpha_1, \dots, \alpha_n$ 线性表示且表示法唯一.

分析: 由线性相关知, 必存在不全为零的数 k_1, \dots, k_n, k_{n+1} 使得

$$k_1\alpha_1 + \dots + k_n\alpha_n + k_{n+1}\beta = \theta$$

其中 $k_{n+1} \neq 0$, 故

$$\beta = -\frac{k_1}{k_{n+1}}\alpha_1 - \dots - \frac{k_n}{k_{n+1}}\alpha_n$$



第一章 线性空间引论——基与坐标

定理1.3.1 设线性空间 V 中向量组 $\alpha_1, \dots, \alpha_n$ 线性无关, 而向量组 $\alpha_1, \dots, \alpha_n, \beta$ 线性相关($\beta \neq \theta$), 则 β 可由向量组 $\alpha_1, \dots, \alpha_n$ 线性表示且表示法唯一.

分析: 证明唯一性通常采用反证法.

假设 β 的表法不唯一, 不妨设有两种不同表示:

$$\beta = a_1\alpha_1 + \dots + a_n\alpha_n = b_1\alpha_1 + \dots + b_n\alpha_n$$

其中 a_i 和 b_i ($i = 1, \dots, n$) 不同时为零.

$$a_1\alpha_1 + \dots + a_n\alpha_n + (-(b_1\alpha_1 + \dots + b_n\alpha_n)) = \theta$$

$$(a_1 - b_1)\alpha_1 + \dots + (a_n - b_n)\alpha_n = \theta$$

第一章 线性空间引论——基与坐标

定义1.3.2（极大线性无关组与秩） 设 $\alpha_1, \dots, \alpha_n$ 是线性空间 V 的一组向量. 若 $\alpha_1, \dots, \alpha_n$ 中存在 r 个线性无关的向量 $\alpha_{i_1}, \dots, \alpha_{i_r}$, 并且 $\alpha_1, \dots, \alpha_n$ 中任一向量均可由向量组 $\alpha_{i_1}, \dots, \alpha_{i_r}$ 线性表示, 则称向量组 $\alpha_{i_1}, \dots, \alpha_{i_r}$ 为向量组 $\alpha_1, \dots, \alpha_n$ 的**极大线性无关组**, 数 r 称为向量组 $\alpha_1, \dots, \alpha_n$ 的**秩**, 记为

$$\text{rank}[\alpha_1, \dots, \alpha_n] = r$$

小结: 向量组中的任一向量都可由极大线性无关组性唯一表示.

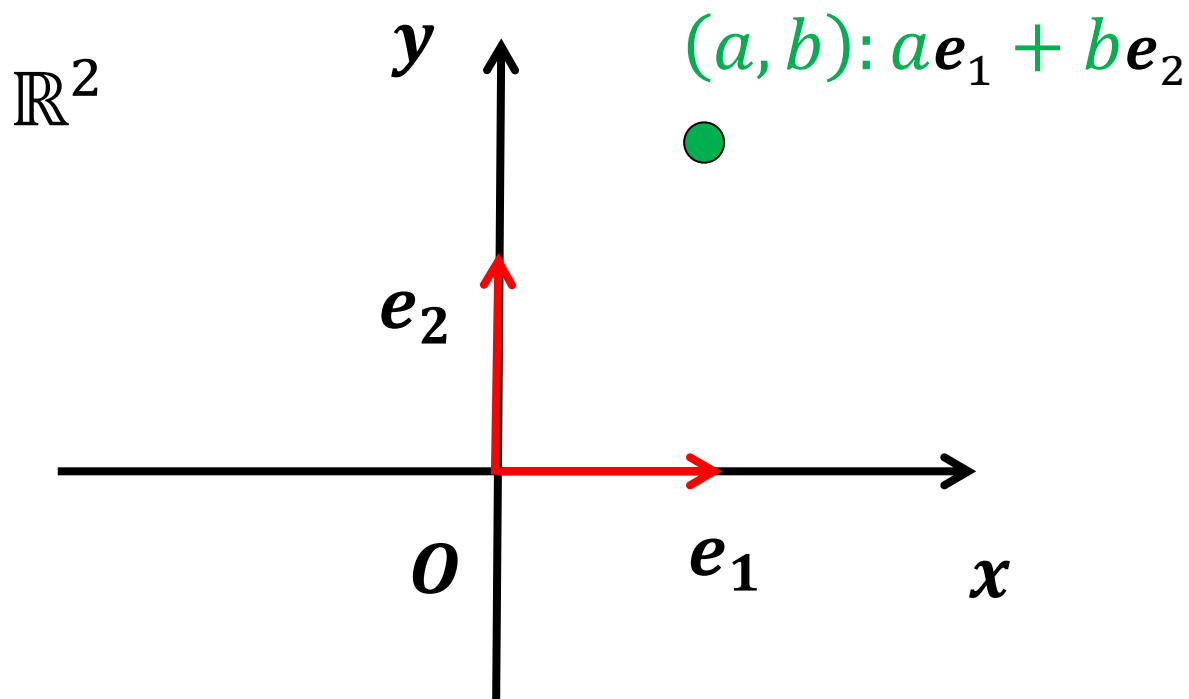
第一章 线性空间引论——基与坐标

例1.3.3 求向量组 $\alpha_1, \alpha_2, \alpha_3$ 的极大线性无关组, 其中

$$\alpha_1 = \begin{bmatrix} 1 \\ -1 \end{bmatrix}, \alpha_2 = \begin{bmatrix} i \\ 1 \end{bmatrix}, \alpha_3 = \begin{bmatrix} i & -1 \\ 0 & 1 \end{bmatrix}$$

注3: 向量组 $\alpha_1, \dots, \alpha_n$ 的极大线性无关组不唯一.

第一章 线性空间引论——基与坐标



小结: \mathbb{R}^2 中的任一向量都可由向量 e_1 和 e_2 唯一表示.
向量 e_1 和 e_2 给 \mathbb{R}^2 强加一个“坐标系”.

第一章 线性空间引论——基与坐标

定义1.3.4 (基) 设 V 是数域 F 上的线性空间,
 $\alpha_1, \dots, \alpha_n$ 是 V 中一组向量. 若

(1) 向量组 $\alpha_1, \dots, \alpha_n$ 线性无关;

(2) V 中任一向量均可由 $\alpha_1, \dots, \alpha_n$ 线性表示;

则称 $\alpha_1, \dots, \alpha_n$ 是 V 的一个基底 (或一组基) .

小结: 在线性空间, 明确一组基的重要原因在于给线性空间强加一个“坐标系”.

第一章 线性空间引论——基与坐标

例1.3.4 单位矩阵 I 的 n 列可构成 \mathbb{R}^n （或 \mathbb{C}^n ）的一组基. 特别地, 令 e_1, \dots, e_n 是单位矩阵的 n 列, 则 e_1, \dots, e_n 称为 \mathbb{R}^n 的**标准基**.



第一章 线性空间引论——基与坐标

例1.3.4 单位矩阵 I 的 n 列可构成 \mathbb{R}^n （或 \mathbb{C}^n ）的一组基. 特别地, 令 e_1, \dots, e_n 是单位矩阵的 n 列, 则 e_1, \dots, e_n 称为 \mathbb{R}^n 的**标准基**.

例1.3.5 已知 $A = \begin{bmatrix} 1 & 0 & 1 \\ 1 & 1 & 1 \end{bmatrix}$, 求 $N(A)$ 的一组基.



第一章 线性空间引论——基与坐标

定理1.3.2（唯一表示定理） 设 x_1, \dots, x_n 是线性空间 V 的一组基, 则 V 中任一向量 x 都可由基 x_1, \dots, x_n 唯一表示.



第一章 线性空间引论——基与坐标

定理1.3.2（唯一表示定理） 设 x_1, \dots, x_n 是线性空间 V 的一组基, 则 V 中任一向量 x 都可由基 x_1, \dots, x_n 唯一表示.

定义1.3.5（坐标） 设 x_1, \dots, x_n 是数域 F 上线性空间 V 的一组基, 对任意向量 $x \in V$, 令

$$x = \sum_{i=1}^n \alpha_i x_i = [x_1, \dots, x_n] \begin{bmatrix} \alpha_1 \\ \vdots \\ \alpha_n \end{bmatrix}$$

称有序数组 $[\alpha_1, \dots, \alpha_n]^T \in F^n$ 是 x 在基 x_1, \dots, x_n 下的**坐标**, 它由 x 与基 x_1, \dots, x_n 唯一确定.



第一章 线性空间引论——基与坐标

例1.3.6 证明 $E_{ij} \in \mathbb{R}^{2 \times 2}$ ($i, j = 1, 2$) 是 $\mathbb{R}^{2 \times 2}$ 的一组基, 并求矩阵 $A = \begin{bmatrix} 1 & 2 \\ 1 & 1 \end{bmatrix}$ 在该组基下的坐标.

分析:

$$k_1 E_{11} + k_2 E_{12} + k_3 E_{21} + k_4 E_{22} = O$$

对任意的 $A \in \mathbb{R}^{2 \times 2}$, 有

$$A = a_{11} E_{11} + a_{12} E_{12} + a_{21} E_{21} + a_{22} E_{22}$$

$$A = E_{11} + 2E_{12} + E_{21} + E_{22}$$



第一章 线性空间引论——基与坐标

思考: 同一空间不同基所包含的向量个数一定相同?

分析: 设 x_1, \dots, x_n , y_1, \dots, y_m 分别是 V 的两组基, 不妨 $m > n$.

由于 y_1, \dots, y_m 可由基 x_1, \dots, x_n 表示, 即

$$\begin{cases} y_1 = a_{11}x_1 + a_{12}x_2 \dots + a_{1n}x_n \\ \vdots \\ y_m = a_{m1}x_1 + a_{m2}x_2 \dots + a_{mn}x_n \end{cases}$$

又知 y_1, \dots, y_m 线性无关, 故 $k_1y_1 + \dots + k_my_m = \theta$ 只有零解.

第一章 线性空间引论——基与坐标

思考: 同一空间不同基所包含的向量个数一定相同?

分析: 即

$$(k_1 a_{11} + \cdots + k_m a_{m1}) \mathbf{x}_1 + \cdots \\ + (k_1 a_{1n} + \cdots + k_m a_{mn}) \mathbf{x}_n = \mathbf{0}$$

又知 $\mathbf{x}_1, \cdots, \mathbf{x}_n$ 线性无关, 所以

$$\begin{bmatrix} a_{11} & a_{21} & \cdots & a_{m1} \\ a_{12} & a_{22} & \cdots & a_{m2} \\ \vdots & \vdots & \ddots & \vdots \\ a_{1n} & a_{2n} & \cdots & a_{mn} \end{bmatrix} \begin{bmatrix} k_1 \\ k_2 \\ \vdots \\ k_m \end{bmatrix} = \mathbf{0}$$

注意 $\text{rank}(A) \leq n < m$, 故上方程组必有非零解.

第一章 线性空间引论——基与坐标

思考: 同一空间不同基所包含的向量个数一定相同?

分析: 这与方程 $k_1\mathbf{y}_1 + \cdots + k_m\mathbf{y}_m = \mathbf{0}$ 只有零解矛盾. 故 $n = m$.

这表明同一空间不同基所包含的向量个数相同.

再思考: 同一空间不同基有何关系?

第一章 线性空间引论——基与坐标

定义1.3.6（过渡矩阵） 设 x_1, \dots, x_n 和 y_1, \dots, y_n 是数域 F 上线性空间 V 的两组基, 令

$$y_i = a_{1i}x_1 + \dots + a_{ni}x_n = [x_1, \dots, x_n] \begin{bmatrix} a_{1i} \\ \vdots \\ a_{ni} \end{bmatrix}$$

引入矩阵表示:

$$[y_1, \dots, y_n] = [x_1, \dots, x_n]A$$

其中 $A = (a_{ij}) \in F^{n \times n}$, 称 A 是由基 x_1, \dots, x_n 到基 y_1, \dots, y_n 的**过渡矩阵（或变换矩阵）**.



第一章 线性空间引论——基与坐标

命题1.3.1（过渡矩阵的性质） 设 V 是数域 F 上的线性空间, $A \in F^{n \times n}$ 是由基 x_1, \dots, x_n 到基 y_1, \dots, y_n 的过渡矩阵, 则以下命题成立

- (1) 过渡矩阵 A 可逆（为什么）；
- (2) 由基 y_1, \dots, y_n 到基 x_1, \dots, x_n 的过渡矩阵为 A^{-1} ；
- (3) 任取 $x \in V$, 设 $x = \sum_{i=1}^n \alpha_i x_i = \sum_{i=1}^n \beta_i y_i$, 则

$$\begin{bmatrix} \beta_1 \\ \vdots \\ \beta_n \end{bmatrix} = A^{-1} \begin{bmatrix} \alpha_1 \\ \vdots \\ \alpha_n \end{bmatrix} \text{ 或 } \begin{bmatrix} \alpha_1 \\ \vdots \\ \alpha_n \end{bmatrix} = A \begin{bmatrix} \beta_1 \\ \vdots \\ \beta_n \end{bmatrix}$$

第一章 线性空间引论——基与坐标

例1.3.7 设 $f(x) = f(0) + f'(0)x + \cdots + \frac{f^{(n)}(0)}{n!}x^n$,

在基 $1, x, \cdots, x^n$ 下的坐标:

$f(x) \in P_n[x]$, $1, x, \cdots, x^n$ 线性无关.



第一章 线性空间引论——基与坐标

例1.3.7 设 $f(x) = f(0) + f'(0)x + \cdots + \frac{f^{(n)}(0)}{n!}x^n$,
在基 $1, x, \cdots, x^n$ 下的坐标:

$$\left[f(0), f'(0), \cdots, \frac{f^{(n)}(0)}{n!} \right]^T$$



第一章 线性空间引论——基与坐标

例1.3.7 设 $f(x) = f(0) + f'(0)x + \cdots + \frac{f^{(n)}(0)}{n!}x^n$,
在基 $1, x, \cdots, x^n$ 下的坐标:

$$\left[f(0), f'(0), \cdots, \frac{f^{(n)}(0)}{n!} \right]^T$$

在基 $1, x - x_0, \cdots, (x - x_0)^n$ 下的坐标:

$$\left[f(x_0), f'(x_0), \cdots, \frac{f^{(n)}(x_0)}{n!} \right]^T$$

第一章 线性空间引论——基与坐标

例1.3.7 设 $f(x) = f(0) + f'(0)x + \cdots + \frac{f^{(n)}(0)}{n!}x^n$

$$(x - x_0)^k = \sum_{i=0}^k C_k^i x^i (-x_0)^{k-i}$$

$$[1, x - x_0, \cdots, (x - x_0)^n]$$

$$= [1, x, \cdots, x^n] \begin{bmatrix} 1 & -x_0 & \cdots & (-x_0)^n \\ 0 & 1 & \cdots & n(-x_0)^{n-1} \\ \vdots & \vdots & \ddots & \vdots \\ 0 & 0 & & 0 & 1 \end{bmatrix}$$



第一章 线性空间引论——基与坐标

定义1.3.7（维数） 在线性空间 V 中, 不同线性无关组中向量个数最大者叫作 V 的**维数**, 记为 $\dim V$. 当 $\dim V < \infty$, 称 V 为**有限维空间**, 否则称为**无限维空间**, 记 $\dim V = \infty$.



第一章 线性空间引论——基与坐标

定义1.3.7（维数） 在线性空间 V 中, 不同线性无关组中向量个数最大者叫作 V 的**维数**, 记为 $\dim V$. 当 $\dim V < \infty$, 称 V 为**有限维空间**, 否则称为**无限维空间**, 记 $\dim V = \infty$.

例1.3.8 离散时间信号空间

$$S = \{ \{x_k\} = [\cdots, x_{-2}, x_{-1}, x_0, x_1, x_2, \cdots] \mid x_i \in \mathbb{R} \}$$

是 \mathbb{R} 上的无限维线性空间.

思考: **单个零向量线性组成的空间的维数?**

第一章 线性空间引论——基与坐标

定理1.3.3(维数与基的关系) 设 V 是有限维线性空间, 则 $\dim V = n$ 当且仅当 V 的任一基底的向量个数为 n .

注4: 可直接用线性空间中基所包含的向量个数定义该空间的维数.

第一章 线性空间引论——基与坐标

例1.3.9 求空间 \mathbb{C} 在实数域 \mathbb{R} 和复数域 \mathbb{C} 上的维数.



第一章 线性空间引论——基与坐标

例1.3.9 求空间 \mathbb{C} 在实数域 \mathbb{R} 和复数域 \mathbb{C} 上的维数.

解: (1) 考查在实数域 \mathbb{R} 上的线性空间 \mathbb{C}

向量1和 i 线性无关, 且 \mathbb{C} 中任一复数均可由1和 i 线性表示. 故向量组1和 i 是 \mathbb{C} 的一组基, 即定义在 \mathbb{R} 上的线性空间 \mathbb{C} 的维数为2.

第一章 线性空间引论——基与坐标

例1.3.9 求空间 \mathbb{C} 在实数域 \mathbb{R} 和复数域 \mathbb{C} 上的维数.

解: (1) 考查在实数域 \mathbb{R} 上的线性空间 \mathbb{C}

向量1和 i 线性无关, 且 \mathbb{C} 中任一复数均可由1和 i 线性表示. 故向量组1和 i 是 \mathbb{C} 的一组基, 即定义在 \mathbb{R} 上的线性空间 \mathbb{C} 的维数为2.

(2) 考查在复数域 \mathbb{C} 上的线性空间 \mathbb{C}

向量1和 i 线性相关, 且 \mathbb{C} 中任一复数均可由1或 i 线性表示. 故向量组1和 i 分别构成 \mathbb{C} 的一组基, 即定义在 \mathbb{C} 上的线性空间 \mathbb{C} 的维数为1.

第一章 线性空间引论——基与坐标

推论1.3.1（基扩充定理） n 维线性空间中任意 n 个线性无关的向量均为 V 的一个基底, 且任一线性无关向量组 x_1, \dots, x_r ($1 \leq r < n$) 可扩充为 V 的一个基底.

注5: 在构造子空间的一组基时, 优先利用“加法”原则, 尽量避免“减法”原则.



第一章 线性空间引论——基与坐标

定理1.3.4（维数定理） 设 W_1 和 W_2 是线性空间 V 的两个子空间, 则

$$\dim(W_1 + W_2) = \dim W_1 + \dim W_2 - \dim(W_1 \cap W_2)$$



第一章 线性空间引论——基与坐标

例1.3.10 设 $W_1 = \text{span}(\alpha_1, \alpha_2, \alpha_3)$, $W_2 = \text{span}(\beta_1, \beta_2)$, 其中 $\alpha_1 = [1, 2, 1, 0]^T$, $\alpha_2 = [1, 1, 1, 0]^T$, $\alpha_3 = [1, 0, 1, 1]^T$, $\beta_1 = [2, 1, 0, 0]^T$, $\beta_2 = [0, 1, 0, 0]^T$, 求 $\dim(W_1 + W_2)$ 和 $\dim(W_1 \cap W_2)$.



第一章 线性空间引论——基与坐标

例1.3.10 设 $W_1 = \text{span}(\alpha_1, \alpha_2, \alpha_3)$, $W_2 = \text{span}(\beta_1, \beta_2)$, 其中 $\alpha_1 = [1, 2, 1, 0]^T$, $\alpha_2 = [1, 1, 1, 0]^T$, $\alpha_3 = [1, 0, 1, 1]^T$, $\beta_1 = [2, 1, 0, 0]^T$, $\beta_2 = [0, 1, 0, 0]^T$, 求 $\dim(W_1 + W_2)$ 和 $\dim(W_1 \cap W_2)$.

解: 观察知 $\alpha_1, \alpha_2, \alpha_3$ 线性无关, β_1, β_2 线性无关, 故有

$$\dim(W_1) = 3, \dim(W_2) = 2$$

再对如下矩阵进行初等变换, 得

$$[\alpha_1, \alpha_2, \alpha_3, \beta_1, \beta_2] \rightarrow \begin{bmatrix} 1 & 0 & 0 & 0 & 1 \\ 0 & 1 & 0 & 0 & -1 \\ 0 & 0 & 1 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 1 & 0 \end{bmatrix}$$

第一章 线性空间引论——基与坐标

例1.3.10 设 $W_1 = \text{span}(\alpha_1, \alpha_2, \alpha_3)$, $W_2 = \text{span}(\beta_1, \beta_2)$, 其中 $\alpha_1 = [1, 2, 1, 0]^T$, $\alpha_2 = [1, 1, 1, 0]^T$, $\alpha_3 = [1, 0, 1, 1]^T$, $\beta_1 = [2, 1, 0, 0]^T$, $\beta_2 = [0, 1, 0, 0]^T$, 求 $\dim(W_1 + W_2)$ 和 $\dim(W_1 \cap W_2)$.

解: 于是,

$$\dim(W_1 + W_2) = \text{rank}(\alpha_1, \alpha_2, \alpha_3, \beta_1, \beta_2) = 4$$

由维数定理可知 $\dim(W_1 \cap W_2) = 3 + 2 - 4 = 1$.

第一章 线性空间引论——基与坐标

思考： 设 $A \in \mathbb{C}^{n \times n}$ ，其零空间和列空间有可能相同吗？若这两个空间相同，则矩阵 A 具有何性质？
(课后作业)