## 1.2 向量与分块矩阵

代万基 数学科学学院 大连理工大学



### 1.2.1 向量

· 现在可看成是从向量的坐标出发来讲向量,并做了进一步的推广。

定义1-7 n个有次序的数 $a_1, a_2, \dots, a_n$  所组成的数组称为n元向量,这n个数称为该向量的n个分量,第i个数称为第i个分量.

分量全为实数的向量称为实向量;分量为 复数的向量称为复向量.

本课程主要讨论实向量,若不加说明,均指 实向量.

分量全为零的向量称为零向量,记作0或 $0_n$ .

## 行向量与列向量

(1) 向量可以写成一行的形式,也可写成一列的形式,分别称为行向量和列向量.

 $(a_1, a_2, \dots, a_n)$  称为行向量,也就是行矩阵.  $(a_1)$   $(a_2)$  注意: 分量相同的行向量与列和同的行向量,也就是列矩阵. 向量要看作不同的向量.  $(a_n)$   $(a_n)$  (3) 行向量和列向量均按矩阵的运算方式进行运算.

- (4) 一般用黑体小写字母  $a,b,\alpha,\beta$  等表示列向量. 用 $a^T,b^T,\alpha^T,\beta^T$  等表示行向量.
  - (5) 讲到向量时, 若不加说明, 均指列向量.
- (6) 所有n元实向量的集合记作  $\mathbb{R}^n$ .

专用 $e_i \in \mathbb{R}^n$ 表示第i个分量为1,其余分量都为0的n元列向量. (0)

注: e,可看作单位矩阵E的第i列.

分量个数相同的一组行向量称为一个行向量组. 分量个数相同的一组列向量称为一个列向量组.



#### 向量与矩阵的关系:

向量是特殊的矩阵, 一个向量组可组成一个矩阵。

反过来,一个矩阵又可看做是由它的行向量组或列向量组所组成的.

矩阵与向量组之间存在着一一对应的关系.

可将矩阵与向量组的问题进行相互转换.

### 1.2.2 分块矩阵

把矩阵进行分块是处理矩阵的有效方法。熟练 掌握矩阵分块的方法,可以给某些计算和证明带来 方便。

定义1-8 用若干条纵贯整个矩阵的横线和竖线把矩阵A分成许多小块(即子矩阵),以这些小块为元素的形式上的矩阵称为A的分块矩阵.

例如,设 
$$A = \begin{pmatrix} 1 & 0 & 1 & 2 \\ 0 & 1 & 3 & 4 \\ \hline 0 & 0 & 2 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 2 \end{pmatrix}$$
,

则
$$A = \begin{pmatrix} E & B \\ O & 2E \end{pmatrix}$$
 是上面矩阵的分块矩阵.

## 几种常用的分块方法

- (1) 把m×n型矩阵A整个作为一块,此时A是一个 1×1型分块矩阵。
- (2) 把 $m \times n$  型矩阵A按列分块为 $A = (a_1, a_2, \dots a_n)$ ,其中 $a_1, a_2, \dots a_n$  是矩阵A的n 个列向量。
- (3) 把 $m \times n$  型矩阵A按行分块为  $A = \begin{bmatrix} \alpha_2 \\ \vdots \\ \alpha_m \end{bmatrix}$  , 其中 $\alpha_1, \alpha_2, \cdots \alpha_m$ 是矩阵A的m个  $\alpha_m$
- (4) 把 $m \times n$  型矩阵A分块为 $A = \begin{pmatrix} A_{11} & A_{12} \\ A_{21} & A_{22} \end{pmatrix}$ ,其中 $A_{11}$ 是 矩阵A的左上角子方阵。
- (5)  $m \times n$ 型矩阵 $A = (a_{ij})_{m \times n}$  也可看作 $m \times n$ 型分块矩阵.

$$\begin{pmatrix} A_{11} & A_{12} & \cdots \\ O & A \end{pmatrix}$$

$$egin{pmatrix} A_{11} & A_{12} & \cdots & A_{1s} \ O & A_{22} & \cdots & A_{2s} \ dots & dots & dots \ O & O & \cdots & A_{ss} \ \end{pmatrix}$$

$$egin{pmatrix} A_{11} & O & \cdots & O \ A_{21} & A_{22} & \cdots & O \ dots & dots & dots \ A_{s1} & A_{s2} & \cdots & A_{ss} \ \end{pmatrix}$$

#### 分块上三角矩阵

#### 分块下三角矩阵

$$egin{pmatrix} A_{11} & O & \cdots & O \ O & A_{22} & \cdots & O \ dots & dots & dots \ O & O & \cdots & A_{ss} \end{pmatrix}$$

分块对角矩阵

## 分块的基本要求

- (1) 计算A+B 时,对A和B的分块方法应完全相同。
- (2) 计算AB 时,对A的列的分法应与对B的行的分法相同。

注意:对一个矩阵在什么地方加竖线,加几条竖线, 决定了这个矩阵的列的分法。

对一个矩阵在什么地方加横线,加几条横线,决定了这个矩阵的行的分法。

至于A的行和B的列怎样分,没有要求。

满足上面的分块要求以后,分块矩阵的运算方法与普通矩阵基本相同。

## 4

### 分块矩阵的计算中需注意的地方

(1) 设
$$A = \begin{pmatrix} A_{11} & A_{12} \\ A_{21} & A_{22} \end{pmatrix}$$
为分块矩阵,则 $A^T = \begin{pmatrix} A_{11}^T & A_{21}^T \\ A_{12}^T & A_{22}^T \end{pmatrix}$ 

(2) 设
$$A=(a_1,a_2,\cdots a_n)$$
为按列分块矩阵,则 $A^T=\begin{pmatrix} a_1^T\\ a_2^T\\ \vdots\\ a_n^T \end{pmatrix}$ 

$$\begin{pmatrix} A_{11} & A_{12} \\ A_{21} & A_{22} \end{pmatrix} \begin{pmatrix} B_{11} & B_{12} \\ B_{21} & B_{22} \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} A_{11}B_{11} + A_{12}B_{21} & A_{11}B_{12} + A_{12}B_{22} \\ A_{21}B_{11} + A_{22}B_{21} & A_{21}B_{12} + A_{22}B_{22} \end{pmatrix}$$

由于矩阵的乘法不满足交换律,子矩阵对应相乘时,一定要注意它们的位置。

设
$$(\boldsymbol{b}_1, \boldsymbol{b}_2, \cdots, \boldsymbol{b}_n)$$
为按列分块矩阵,

$$A(\boldsymbol{b}_1,\boldsymbol{b}_2,\dots,\boldsymbol{b}_n) = (A\boldsymbol{b}_1,A\boldsymbol{b}_2,\dots,A\boldsymbol{b}_n)$$

例如: 
$$\begin{pmatrix} 1 & 2 \\ 3 & 4 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} 1 & 2 \\ 1 & 1 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 3 & 4 \\ 7 & 10 \end{pmatrix}$$

$$\mathbf{A}\mathbf{b}_1 = \begin{pmatrix} 1 & 2 \\ 3 & 4 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} 1 \\ 1 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 3 \\ 7 \end{pmatrix}, \quad \mathbf{A}\mathbf{b}_2 = \begin{pmatrix} 1 & 2 \\ 3 & 4 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} 2 \\ 1 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 4 \\ 10 \end{pmatrix}$$

$$A(\boldsymbol{b}_1,\boldsymbol{b}_2) = (A\boldsymbol{b}_1,A\boldsymbol{b}_2)$$

一般地,
$$(b_1,b_2,\dots,b_n)A \neq (b_1A,b_2A,\dots,b_nA)$$

设 
$$\begin{pmatrix} \alpha_1 \\ \alpha_2 \\ \vdots \\ \alpha_m \end{pmatrix}$$
 是按行分块矩阵, $\begin{pmatrix} \alpha_1 \\ \alpha_2 \\ \vdots \\ \alpha_m \end{pmatrix}$   $A = \begin{pmatrix} \alpha_1 A \\ \alpha_2 A \\ \vdots \\ \alpha_m A \end{pmatrix}$ 

例如: 
$$\begin{pmatrix} 1 & 2 \\ 3 & 4 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} 1 & 2 \\ 1 & 1 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 3 & 4 \\ 7 & 10 \end{pmatrix}$$

記
$$\alpha_1 = (1, 2), \quad \alpha_2 = (3, 4), \quad A = \begin{pmatrix} 1 & 2 \\ 1 & 1 \end{pmatrix},$$

$$\alpha_1 A = (1, 2) \begin{pmatrix} 1 & 2 \\ 1 & 1 \end{pmatrix} = (3, 4), \quad \alpha_2 A = (3, 4) \begin{pmatrix} 1 & 2 \\ 1 & 1 \end{pmatrix} = (7, 10)$$

$$\begin{pmatrix} \alpha_1 \\ \alpha_2 \end{pmatrix} A = \begin{pmatrix} \alpha_1 A \\ \alpha_2 A \end{pmatrix}$$

## 

一般地,
$$A \begin{pmatrix} \alpha_1 \\ \alpha_2 \\ \vdots \\ \alpha_m \end{pmatrix} \neq \begin{pmatrix} A\alpha_1 \\ A\alpha_2 \\ \vdots \\ A\alpha_m \end{pmatrix}$$

读 
$$A_{n \times n} = (a_1, a_2, \dots, a_n), E_n = (e_1, e_2, \dots, e_n)$$

$$A = AE_n = A(e_1, e_2, \dots, e_n) = (Ae_1, Ae_2, \dots, Ae_n)$$

$$a_j = Ae_j (j = 1, 2, \dots n).$$

于是可用  $Ae_i$  表示 A 的第 i 列.

$$e_i^{\mathsf{T}} A = \left[ \left( e_i^{\mathsf{T}} A \right)^{\mathsf{T}} \right]^{\mathsf{T}} = \left( A^{\mathsf{T}} e_i \right)^{\mathsf{T}} (i = 1, 2, \dots n).$$
 $A^{\mathsf{T}} e_i = A^{\mathsf{T}}$  的第  $i$  列  $= A$  的第  $i$  行 的转置
 $A^{\mathsf{T}} e_i$  转置正是 $A$  的第 $i$  行
用  $e_i^{\mathsf{T}} A$  表示 $A$  的第 $i$  行.

$$\text{FI} \ \, \boldsymbol{A} = \left( \begin{array}{ccc} a_{11} & a_{12} & a_{13} \\ a_{21} & a_{22} & a_{23} \\ a_{31} & a_{32} & a_{33} \end{array} \right),$$

$$\mathbf{Ae}_{3} = \begin{pmatrix} a_{11} & a_{12} & a_{13} \\ a_{21} & a_{22} & a_{23} \\ a_{31} & a_{32} & a_{33} \end{pmatrix} \begin{pmatrix} 0 \\ 0 \\ 1 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} a_{13} \\ a_{23} \\ a_{33} \end{pmatrix} \quad \mathbf{E} \cdot \mathbf{A} + \mathbf{A}$$

$$\mathbf{e}_{2}^{\mathsf{T}}\mathbf{A} = (0,1,0) \begin{pmatrix} a_{11} & a_{12} & a_{13} \\ a_{21} & a_{22} & a_{23} \\ a_{31} & a_{32} & a_{33} \end{pmatrix} = (a_{21}, a_{22}, a_{23}) \, \text{ $\xi$ $\pi$A$ $\text{A}$ $\text{$\frac{1}{3}$}$ $\text{$\frac{$$

#### 习题4-2

2. 设a是n元列向量, $a^{T}a=k, A=aa^{T}$ ,证明: $A^{m+1}=k^{m}A$ .

i.e. 
$$A^{m+1} = (aa^{T})(aa^{T})\cdots(aa^{T})$$
$$= a(a^{T}a)(a^{T}a)\cdots(a^{T}a)a^{T}$$
$$= ak^{m}a^{T} = k^{m}A$$

3. 淡
$$a, b \in \mathbb{R}^3, ab^T = \begin{bmatrix} 1 & 2 & 3 \\ 1 & 2 & 3 \\ 1 & 2 & 3 \end{bmatrix}, 求 $ba^T, b^Ta$ .$$

方法1 
$$ab^T = \begin{bmatrix} 1 & 2 & 3 \\ 1 & 2 & 3 \\ 1 & 2 & 3 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 1 \\ 1 \\ 1 \end{bmatrix} [1,2,3] = k \begin{bmatrix} 1 \\ 1 \\ 1 \end{bmatrix} [1,2,3] \frac{1}{k}$$

可不妨设
$$a = \begin{bmatrix} 1 \\ 1 \\ 1 \end{bmatrix}, b^T = [1,2,3]$$

3. 淡
$$a, b \in \mathbb{R}^{3}, ab^{T} = \begin{bmatrix} 1 & 2 & 3 \\ 1 & 2 & 3 \\ 1 & 2 & 3 \end{bmatrix}, 求 $ba^{T}, b^{T}a.$$$

方法2 
$$\boldsymbol{ba}^{\mathrm{T}} = (\boldsymbol{ab}^{\mathrm{T}})^{\mathrm{T}} = \begin{bmatrix} 1 & 2 & 3 \\ 1 & 2 & 3 \\ 1 & 2 & 3 \end{bmatrix}^{\mathrm{T}}$$

3. 淡
$$a, b \in \mathbb{R}^3, ab^T = \begin{bmatrix} 1 & 2 & 3 \\ 1 & 2 & 3 \\ 1 & 2 & 3 \end{bmatrix}, 求 $ba^T, b^Ta$ .$$

$$(ab^T)^2 = \begin{bmatrix} 1 & 2 & 3 \\ 1 & 2 & 3 \\ 1 & 2 & 3 \end{bmatrix},$$

$$(ab^T)^2 = (ab^T)(ab^T) = a(b^Ta)b^T = (b^Ta)(ab^T)$$

$$(\mathbf{b}^{T}\mathbf{a})(\mathbf{a}\mathbf{b}^{T}) = 6 \begin{bmatrix} 1 & 2 & 3 \\ 1 & 2 & 3 \\ 1 & 2 & 3 \end{bmatrix}, \qquad \mathbf{b}^{T}\mathbf{a} = 6$$

读
$$\boldsymbol{a} = \begin{pmatrix} a_1 \\ a_2 \\ a_2 \end{pmatrix}, \boldsymbol{b} = \begin{pmatrix} b_1 \\ b_2 \\ b_2 \end{pmatrix},$$

$$\mathbb{D} \boldsymbol{a} \boldsymbol{b}^{T} = \begin{pmatrix} a_{1} \\ a_{2} \\ a_{3} \end{pmatrix} (b_{1}, b_{2}, b_{3}) = \begin{pmatrix} a_{1}b_{1} & a_{1}b_{2} & a_{1}b_{3} \\ a_{2}b_{1} & a_{2}b_{2} & a_{2}b_{3} \\ a_{3}b_{1} & a_{3}b_{2} & a_{3}b_{3} \end{pmatrix},$$

$$\mathbf{b}^{T}\mathbf{a} = (b_1, b_2, b_3) \begin{pmatrix} a_1 \\ a_2 \\ a_3 \end{pmatrix} = a_1b_1 + a_2b_2 + a_3b_3 = \mathbf{a}\mathbf{b}^{T}$$
的对角元之和

# 

4. 设
$$a \in \mathbb{R}^n$$
,  $k = a^T a \neq 0$ ,  $A = E - aa^T$ ,  $B = E + 3aa^T$ ,  $AB = E$ , 求 $k$ .

提示: 
$$AB = (E - aa^T)(E + 3aa^T)$$
  

$$= E + 3aa^T - aa^T - 3(aa^T)(aa^T)$$

$$= E + 3aa^T - aa^T - 3a(a^Ta)a^T$$

## •

5.设方阵A的按列分块矩阵为 $A = [a_1, a_2, \dots, a_n]$ , 求 $AA^T n A^T A$ .

提示: 
$$AA^{T} = (a_{1}, a_{2}, \dots, a_{n})$$
$$\begin{pmatrix} a_{1}^{T} \\ a_{2}^{T} \\ \vdots \\ a_{n}^{T} \end{pmatrix}$$

$$\mathbf{A}^{T}\mathbf{A} = \begin{pmatrix} a_{1}^{T} \\ a_{2}^{T} \\ \vdots \\ a_{n}^{T} \end{pmatrix} (\mathbf{a}_{1}, \mathbf{a}_{2}, \dots, \mathbf{a}_{n})$$

设A,B,C和E都是n阶方阵,下列结论是否成立?为什么?

$$1. (\mathbf{A} + \mathbf{B})^2 = \mathbf{A}^2 + 2\mathbf{A}\mathbf{B} + \mathbf{B}^2$$
  
不成立

2. 
$$(A + E)^2 = A^2 + 2A + E$$
  
成立,原因: $AE = EA$ 

3. 
$$(A+E)(A-E)=(A-E)(A+E)$$
  
成立、原因:  $AE=EA$ 

$$4. (AB)^2 = A^2B^2 \Leftrightarrow AB = BA$$

(⇐)正确.

当
$$AB = BA$$
时,  $(AB)^2 = (AB)(AB) = AABB = A^2B^2$ 

(⇒)不正确.

$$(AB)^2 = A^2B^2 \Rightarrow ABAB = AABB$$

再往下,得不出
$$BA = AB$$

反例 让
$$A = \begin{bmatrix} 1 & 1 \\ 0 & 1 \end{bmatrix}, B = \begin{bmatrix} 1 & 1 \\ 0 & 0 \end{bmatrix},$$

$$(AB)^2 = A^2B^2$$
, 但是 $AB \neq BA$ 

不成立. 反例 设
$$A = \begin{bmatrix} 1 & 1 \\ -1 & -1 \end{bmatrix}$$
, 则 $A^2 = O$ , 但 $A \neq O$ .

不成立. 
$$A^2 = A \Rightarrow A(A - E) = 0$$
,  $A \approx A - E$  可以都不为 $O$ 

反例 
$$A = \begin{bmatrix} 1 & 0 \\ 0 & 0 \end{bmatrix}, A^2 = A, 但是 $A \neq 0, A \neq E$ .$$

反例 
$$A = \begin{bmatrix} 1 & 0 \\ 0 & -1 \end{bmatrix}, A^2 = E, \ 但是A \neq E, \ A \neq -E.$$

- 8. 若A为对称矩阵,则 $A^k$ 也为对称矩阵(k为正整数). 成立. 因为( $A^k$ ) $^T = (A^T)^k = A^k$

不成立. 因为
$$(A^k)^T = (A^T)^k = (-A)^k$$
  
不一定等于 $-A^k$ .

10. 对称矩阵的第i行与第i列的对应元素相等. 正确

- 1. 若a和b都是n元列向量,则 $a^Tb=b^Ta$ 是否正确?. 正确
- 2. 若a和b都是n元列向量,则 $ab^{T}=ba^{T}$ 是否正确? 不正确

读
$$a = \begin{pmatrix} 1 \\ 2 \\ 3 \end{pmatrix}, b = \begin{pmatrix} 4 \\ 5 \\ 6 \end{pmatrix}, 则ab^T = \begin{pmatrix} 1 \\ 2 \\ 3 \end{pmatrix} (4,5,6) = \begin{pmatrix} 4 & 5 & 6 \\ 8 & 10 & 12 \\ 12 & 15 & 18 \end{pmatrix},$$

$$\boldsymbol{b}\boldsymbol{a}^{T} = \begin{pmatrix} 4 \\ 5 \\ 6 \end{pmatrix} (1,2,3) = \begin{pmatrix} 4 & 8 & 12 \\ 5 & 10 & 15 \\ 6 & 12 & 18 \end{pmatrix}$$

3. 对任意的n元列向量u,是否都有 $(uu^T)(uu^T)=(u^Tu)(uu^T)$ ? 正确

$$(uu^{T})(uu^{T}) = u(u^{T}u)u^{T} = (u^{T}u)(uu^{T})$$

$$u^{T}u$$
 数

4. 用分块的方法计算AB时,对A的行的分法及B的列的分法是否有特殊要求?

答:对A的行的分法及B的列的分法没有要求.要求A的列的分法与B的行的分法相同.

5. **AB**的第*j*列与**B**的第*j*列有什么关系? **AB**的第*i*行与**B**的第*i*行有什么关系?

$$AB$$
的 第 $j$ 列 =  $(AB)e_j = A(Be_j) = Ab_j$  
$$AB$$
的 第 $i$ 行 =  $e_i^T(AB) = (e_i^TA)B = (a_{i1}, a_{i2}, \dots, a_{ik})B$ 

### ₩ 提高题1-1

1. 证明:
$$\begin{bmatrix} \lambda & 1 & 0 \\ 0 & \lambda & 1 \\ 0 & 0 & \lambda \end{bmatrix}^n = \begin{bmatrix} \lambda^n & n\lambda^{n-1} & \frac{n(n-1)}{2} \lambda^{n-1} \\ 0 & \lambda^n & n\lambda^{n-1} \\ 0 & 0 & \lambda^n \end{bmatrix}$$

1. 证明: 
$$\begin{bmatrix} \lambda & 1 & 0 \\ 0 & \lambda & 1 \\ 0 & 0 & \lambda \end{bmatrix}^{n} = \begin{bmatrix} \lambda^{n} & n\lambda^{n-1} & \frac{n(n-1)}{2}\lambda^{n-2} \\ 0 & \lambda^{n} & n\lambda^{n-1} \\ 0 & 0 & \lambda^{n} \end{bmatrix}$$
证法1: 数学归纳法
$$[3] \begin{bmatrix} \lambda & 1 & 0 \\ 0 & \lambda & 1 \\ 0 & 0 & 1 \\ 0 & 0 & 0 \end{bmatrix}, \quad \mathbb{N}\mathbf{B}^{2} = \begin{bmatrix} 0 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 1 \\ 0 & 0 & 0 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} 0 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 1 \\ 0 & 0 & 0 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 0 & 0 & 1 \\ 0 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 0 \end{bmatrix}$$

$$B^3 = O$$

$$\begin{vmatrix} \lambda & 1 & 0 \\ 0 & \lambda & 1 \\ 0 & 0 & \lambda \end{vmatrix}^n = (\lambda \boldsymbol{E} + \boldsymbol{B})^n = \lambda^n \boldsymbol{E} + C_n^1 \lambda^{n-1} \boldsymbol{B} + C_n^2 \lambda^{n-2} \boldsymbol{B}^2$$

### 提高题1-1

提示: 
$$A = \begin{bmatrix} 1 & 2 & 3 \\ -1 & -2 & -3 \\ 2 & 4 & 6 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 1 \\ -1 \\ 2 \end{bmatrix} [1,2,3]$$

记
$$a = \begin{vmatrix} 1 \\ -1 \\ 2 \end{vmatrix}, b = \begin{vmatrix} 1 \\ 2 \\ 3 \end{vmatrix}, 则A = ab^{T}$$

### 提高题1-2

1. 设A是 $m \times n$ 矩阵,且对任-n元列向量x都有Ax = 0,证明:A = 0.

证:因为对任一n元列向量x都有Ax = 0, 所以 $Ae_j = 0$ ,即 $a_j = 0$ 这说明A的每一列都是零向量,所以A = 0

### 提高题1-2

2. 设A是实的n阶对称矩阵,且 $A^2 = 0$ ,证明:A = 0.

证: A是对称矩阵  $\Rightarrow A^T = A$ .

$$A^2 = \mathbf{O} \Rightarrow A^T A = \mathbf{O}$$

$$A^{T}A$$
的第一个对角元为  $a_{11}^{2} + a_{21}^{2} + \dots + a_{n1}^{2} = 0$   
 $\Rightarrow a_{11} = 0, a_{21} = 0, \dots, a_{n1} = 0$ 

通过考察 $A^TA$ 的其它对角元,可以证明A的每列都是零向量,所以A = O.