回顾上次课内容:

- 1. 矩阵的运算: 加法、数乘、乘法和转置
- 2. 通过线性映射的加法与数乘定义矩阵的加法与数乘
- 3. $M_{m\times n}(\mathbb{R})$ 在加法与数乘下满足向量空间的8条性质
- 4. 线性映射的复合给出矩阵的乘法
- 5. 几种运算之间的关系
- 6. 特殊的矩阵:初等矩阵,对称矩阵等

1.6 可逆矩阵



如果 \mathcal{A} 是双射, 那么 \mathcal{A} 的逆映射 \mathcal{A}^{-1} : $\mathbb{R}^n \to \mathbb{R}^n$ 也是线性映射.



对应的矩阵 A^{-1} 称为A的逆矩阵两个重要学习内容:

- 1. 矩阵可逆的等价条件
- 2. 高斯-若尔当消元法求 A^{-1}

主要内容:

- (a) 可逆矩阵的定义与例子
- (b) 矩阵可逆的等价判定条件
- (c) 高斯-若尔当(Gauss-Jordan)消元求矩阵的逆
- (d)一些特殊的可逆矩阵:对角占优矩阵,置换矩阵与正交矩阵

可逆线性变换

线性变换 $A: \mathbb{R}^n \to \mathbb{R}^n$

称为单射, 如果 \mathcal{A} 满足若 $x \neq y$, 则 $\mathcal{A}(x) \neq \mathcal{A}(y)$.

称为满射, 如果 \mathcal{A} 满足 $\mathcal{A}(\mathbb{R}^n) = \mathbb{R}^n$.

称为双射, 如果。印单且满。

如果A为双射, 定义A的**逆映射**

$$\mathcal{A}^{-1}$$
: $\mathbb{R}^n \to \mathbb{R}^n$, $y \mapsto \mathcal{A}^{-1}(y)$,

其中 $\mathcal{A}^{-1}(y)$ 为唯一的 $x \in \mathbb{R}^n$ 满足 $\mathcal{A}(x) = y$.

命题:

 \mathcal{A}^{-1} 是线性映射,且 \mathcal{A}^{-1} 满足

$$\mathcal{A}^{-1}\circ\mathcal{A}=\mathcal{A}\circ\mathcal{A}^{-1}=\mathcal{I}_{\mathbb{R}^n}$$
,

其中 $\mathcal{I}_{\mathbb{R}^n}$ 为 \mathbb{R}^n 上的恒同映射,即 $\mathcal{I}_{\mathbb{R}^n}(x) = x, \forall x \in \mathbb{R}^n$.

证明:

验证 A^{-1} 满足线性映射的定义

$$\mathcal{A}(\mathcal{A}^{-1}(c\mathbf{x}+d\mathbf{y}))=c\mathbf{x}+d\mathbf{y}$$

$$\mathcal{A}(c\mathcal{A}^{-1}(\mathbf{x}) + d\mathcal{A}^{-1}(\mathbf{y})) = c\mathbf{x} + d\mathbf{y}$$

由于 \mathcal{A} 为双射, $\mathcal{A}^{-1}(c\mathbf{x}+d\mathbf{y})=c\mathcal{A}^{-1}(\mathbf{x})+d\mathcal{A}^{-1}(\mathbf{y}).$

可逆矩阵的定义:

设A为n阶方阵,如果存在n阶方阵B满足

$$AB = BA = I_n$$

则称A是**可逆矩阵**或非奇异矩阵.

方阵B称为A的逆(矩阵),记为 A^{-1} .

A为n阶可逆矩阵, $k \ge 1$ 为自然数, 定义 $A^{-k} = (A^{-1})^k$, $A^0 = I_n$.

若A可逆,那 ΔA^{-1} 也可逆,且 $(A^{-1})^{-1}=A$.

小结: 可逆线性映射与可逆矩阵

1. 从可逆线性映射到可逆矩阵:

 $A: \mathbb{R}^n \to \mathbb{R}^n$ 是双射,表出矩阵是A.

 \mathcal{A}^{-1} : $\mathbb{R}^n \to \mathbb{R}^n$ 是 \mathcal{A} 的逆映射,表出矩阵是B.

$$\mathcal{A}^{-1}\circ\mathcal{A}=\mathcal{A}\circ\mathcal{A}^{-1}=\mathcal{I}_{\mathbb{R}^n}$$
 \longrightarrow $AB=BA=I_n$,于是 A 可逆

2. 从可逆矩阵到可逆线性映射:

A可逆,存在n 阶方阵B满足 $AB = BA = I_n$

n阶方阵B给出线性映射 $B: \mathbb{R}^n \to \mathbb{R}^n$,满足 $A \circ B = B \circ A = \mathcal{I}_{\mathbb{R}^n}$,

特别的,线性映射 $\mathcal{A}: \mathbb{R}^n \to \mathbb{R}^n$ 是双射, \mathcal{B} 是它的逆映射

例: n阶零矩阵不可逆.

否则,如果有B使得 $OB = I_n$,那么得到 $O = I_n$,矛盾.

例:可逆矩阵不含零行也不含零列.

证明:

如果n阶方阵A的第i行为零行,

则对任意 $B \in M_{n \times p}(\mathbb{R})$, AB的第i行 $\widetilde{\boldsymbol{a}}_i^T B$ 为零行

因此,不存在n阶方阵B满足 $AB = I_n$,A不可逆。

如果n阶方阵A的第i列为零列,

则对任意 $B \in M_{m \times n}(\mathbb{R})$, BA的第i列为零列

因此,不存在n阶方阵B满足 $BA = I_n$,A不可逆。

例:
$$A = \begin{bmatrix} 1 & 1 \\ 1 & 1 \end{bmatrix}$$
不可逆

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

A不是单射,因此,不是双射。

$$\mathcal{A}(\mathbb{R}^2) = Span\left(\begin{bmatrix}1\\1\end{bmatrix}, \begin{bmatrix}1\\1\end{bmatrix}\right) = \mathbb{R}\begin{bmatrix}1\\1\end{bmatrix}$$

A不是满射,因此,不是双射。

 π

例:
$$A = \begin{bmatrix} a & b \\ c & d \end{bmatrix}$$
, A 可逆当且仅当 $ad - bc \neq 0$, 且
$$A^{-1} = \frac{1}{ad - bc} \begin{bmatrix} d & -b \\ -c & a \end{bmatrix}$$

$$\begin{bmatrix} a & b \\ c & d \end{bmatrix} \begin{bmatrix} d & -b \\ -c & a \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} d & -b \\ -c & a \end{bmatrix} \begin{bmatrix} a & b \\ c & d \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} ad - bc \\ & ad - bc \end{bmatrix} \tag{*}$$

如果 $ad - bc \neq 0$,(*)同时乘以常数 $\frac{1}{ad-bc}$ 得到

$$A\left(\frac{1}{ad-bc}\begin{bmatrix} d & -b \\ -c & a \end{bmatrix}\right) = \left(\frac{1}{ad-bc}\begin{bmatrix} d & -b \\ -c & a \end{bmatrix}\right)A = I_2.$$

$$A^{-1}$$

反之,如果A可逆,那么线性映射 \mathcal{A} 即单且满假设ad-bc=0,那么

$$\begin{bmatrix} a & b \\ c & d \end{bmatrix} \begin{bmatrix} d & -b \\ -c & a \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} ad - bc \\ & ad - bc \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 0 & 0 \\ 0 & 0 \end{bmatrix}$$

因此,
$$\mathcal{A}\left(\begin{bmatrix} d \\ -c \end{bmatrix}\right) = \mathcal{A}\left(\begin{bmatrix} -b \\ a \end{bmatrix}\right) = \begin{bmatrix} 0 \\ 0 \end{bmatrix} = \mathcal{A}\left(\begin{bmatrix} 0 \\ 0 \end{bmatrix}\right)$$

由于
$$\mathcal{A}$$
是单射, $\begin{bmatrix} d \\ -c \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} -b \\ a \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 0 \\ 0 \end{bmatrix}$.

于是A是零矩阵,与A可逆矛盾.

A的行列式

因此,
$$A = \begin{bmatrix} a & b \\ c & d \end{bmatrix}$$
可逆当且仅当 $ad - bc \neq 0$.

$$R_{\theta} = \begin{bmatrix} \cos \theta & -\sin \theta \\ \sin \theta & \cos \theta \end{bmatrix}$$
, $\mathcal{R}_{\theta} : \mathbb{R}^2 \to \mathbb{R}^2$ 为平面上逆时针旋转 θ 角。

 \mathcal{R}_{θ} 可逆,逆映射为逆时针旋转- θ 角。

因此,
$$R_{\theta}^{-1} = R_{-\theta} = \begin{bmatrix} \cos(-\theta) & -\sin(-\theta) \\ \sin(-\theta) & \cos(-\theta) \end{bmatrix}$$
.

例:对角矩阵

$$D = \begin{bmatrix} d_1 & & \\ & \ddots & \\ & & d_n \end{bmatrix}$$

D可逆当且仅当 $d_i \neq 0$, ∀i.

$$D^{-1} = \begin{bmatrix} d_1^{-1} & & & \\ & \ddots & & \\ & & d_n^{-1} \end{bmatrix}$$

A为可逆方阵, $c \neq 0$, cA是否可逆? cA可逆.

$$(cA)^{-1} = c^{-1}A^{-1}$$

$$A$$
为可逆方阵, $A(B-C)=O \Rightarrow B=C$

$$A(B-C) = O \Longrightarrow A^{-1}A(B-C) = O \Longrightarrow B-C = O$$

$$f(x) = a_0 + a_1 x + \dots + a_d x^d$$
 为一d次实系数多项式

A为n阶方阵

定义:
$$f(A) = a_0 I_n + a_1 A + \dots + a_d A^d$$

若 $a_0 \neq 0$ 且f(A) = O,则A可逆。

$$I_n = \left(-\frac{a_1}{a_0}I_n - \dots - \frac{a_d}{a_0}A^{d-1}\right)A = A\left(-\frac{a_1}{a_0}I_n - \dots - \frac{a_d}{a_0}A^{d-1}\right)$$

回顾:初等矩阵

定义:对单位矩阵 I_n 做一次 \overline{N} 等行变换得到的矩阵称为 \overline{N} 等矩阵

1. 对换矩阵: 互换 I_n 的i,j行, 得到对换矩阵 P_{ij}

2.倍乘矩阵:

 I_n 的第i行乘以非零常数k,得到倍乘矩阵 $E_{ii}(k)$

$$E_{ii}(k) = \begin{bmatrix} \ddots & & & & \\ & 1 & & & \\ & & & 1 & \\ & & & \ddots \end{bmatrix}$$

3.倍加矩阵:把 I_n 的第i行的k倍加到第j行上,得到倍加矩阵 $E_{ji}(k)$

$$E_{ji}(k) = \begin{bmatrix} \ddots & & & & \\ & 1 & \ddots & \\ & k & & 1 \\ & & & \ddots \end{bmatrix} (j > i) \quad i$$

$$i \qquad j$$

$$E_{ji}(k) = \begin{bmatrix} \ddots & & & & \\ & 1 & \ddots & k \\ & & & 1 \\ & & & \ddots \end{bmatrix} (j < i) \quad j$$

$$j \qquad i$$

命题:

初等矩阵都可逆.

对换矩阵:

$$P_{ij}P_{ij} = I_n$$

因此,
$$P_{ij}^{-1} = P_{ij}$$

对换矩阵的逆是对换矩阵

倍乘矩阵:

$$E_{ii}(k) = \begin{bmatrix} \ddots & & & & \\ & 1 & & & \\ & & k & \\ & & & 1 & \\ & & & \ddots \end{bmatrix} \qquad i$$

$$E_{ii}(k)E_{ii}(1/k) = E_{ii}(1/k)E_{ii}(k) = I_n$$

因此, $E_{ii}(k)^{-1} = E_{ii}(1/k)$
倍乘矩阵的逆是倍乘矩阵

倍加矩阵:

$$E_{ji}(k) = \begin{bmatrix} \ddots & & & & \\ & 1 & \ddots & \\ & k & & 1 & \\ & & & \ddots \end{bmatrix} \quad i \qquad (j > i)$$

$$i \qquad \qquad i \qquad \qquad i$$

$$E_{ji}(-k)E_{ji}(k) = E_{ji}(k)E_{ji}(-k) = I_n$$

因此, $E_{ji}(k)^{-1} = E_{ji}(-k)$.
倍加矩阵的逆是倍加矩阵

转置的逆等于逆的转置:

A为n阶可逆方阵,则 A^T 可逆,且 $(A^T)^{-1} = (A^{-1})^T$.

证明:

$$A^{T}(A^{-1})^{T} = (A^{-1}A)^{T} = I_{n}^{T} = I_{n}.$$

$$(A^{-1})^T A^T = (AA^{-1})^T = I_n.$$

因此
$$(A^T)^{-1} = (A^{-1})^T$$
.

可逆对称矩阵与可逆反对称矩阵:

- 一个可逆对称矩阵 $S(S^T = S)$ 的逆 S^{-1} 也是对称矩阵
- 一个可逆反对称矩阵 $A(A^T = -A)$ 的逆 A^{-1} 也是反对称矩阵

证明:

$$(S^{-1})^T = (S^T)^{-1} = S^{-1}.$$

 $(A^{-1})^T = (A^T)^{-1} = (-A)^{-1} = -A^{-1}.$

AB的逆:

A, B都是n阶方阵,如果A, B可逆,那么AB可逆,且 $(AB)^{-1} = B^{-1}A^{-1}$.

证明:

$$(B^{-1}A^{-1})(AB) = B^{-1}(A^{-1}A)B = B^{-1}I_nB = I_n.$$

$$(AB)(B^{-1}A^{-1}) = A(BB^{-1})A^{-1} = AI_nA^{-1} = I_n.$$

线性变换复合的角度理解:

$$\mathcal{A} \circ \mathcal{B} \colon \mathbb{R}^n \xrightarrow{\mathcal{B}} \mathbb{R}^n \xrightarrow{\mathcal{A}} \mathbb{R}^n$$

$$\mathcal{B}^{-1} \qquad \mathcal{A}^{-1}$$

逆为
$$\mathcal{B}^{-1}\circ\mathcal{A}^{-1}$$

(b) 矩阵可逆的等价条件 (理论性较强)

定理:对n阶方阵A,下列叙述等价:

(1)A可逆;

 $(2) \forall \boldsymbol{b} \in \mathbb{R}^n$,方程组 $A\boldsymbol{x} = \boldsymbol{b}$ 有唯一解 $\boldsymbol{x} = A^{-1}\boldsymbol{b}$;

(3)齐次方程组Ax = 0只有零解;

(4)A对应的阶梯形矩阵有n个主元;

 $(5)rref(A) = I_n;$

(6)A是有限个初等矩阵的乘积。

之后的课程还会看到更多的等价条件

证明:我们采用(1)⇒(2) ⇒(3) ⇒(4) ⇒(5) ⇒(6) ⇒(1)。

(1)

(4) (5) **矩阵**

(6)

(2) 方程

(3)

(1)A可逆 \Rightarrow $(2)\forall b \in \mathbb{R}^n$, 方程组Ax = b有唯一解 $x = A^{-1}b$:

有解:代入 $x = A^{-1}b$, $Ax = A(A^{-1}b) = b$, 知 $x = A^{-1}b$ 是解

唯一解: 若有 $x, y \in \mathbb{R}^n$ 满足Ax = Ay = b,则

$$A(x - y) = Ax - Ay = 0$$

等式两边同时左乘A-1得到

$$x - y = A^{-1}(A(x - y)) = A^{-1}0 = 0$$

因此x = y.

- (2) $\forall b$, 方程组Ax = b有唯一 $ext{m} = A^{-1}b \Rightarrow (3)$ 方程组Ax = 0只有零解:
- (3)是(2)的特殊情况
- (3)方程组Ax = 0只有零解 \Rightarrow (4) A对应的阶梯形矩阵有n个主元:

 $Ax = \mathbf{0}$ 有唯一解,说明rref(A) 无自由列,所有列都是主列. 于是主列有n个,主元个数有n个

(4)A对应的阶梯形矩阵有n个主元⇒(5) $rref(A) = I_n$:

由(4)行简化阶梯形矩阵rref(A)也有n个主元,因此 $rref(A) = I_n$.

 $(5)rref(A) = I_n \Rightarrow (6)A$ 是有限个初等矩阵的乘积:

 $rref(A) = I_n$ 表明,我们可以通过一系列初等行变换将A化为 I_n .

于是有初等矩阵 $E_1, ..., E_t$ 使得 $E_t ... E_1 A = rref(A) = I_n$.

因此 $A = E_1^{-1} \dots E_t^{-1}$.

由于初等矩阵的逆也是初等矩阵, A为有限个初等矩阵的乘积。

(6)A是有限个初等矩阵的乘积 ⇒ (1)A可逆:

有限个初等矩阵的乘积是可逆矩阵。

定理:对n阶方阵A,下列叙述等价:

- (1)A可逆;
- $(2) \forall \boldsymbol{b} \in \mathbb{R}^n$,方程组 $A\boldsymbol{x} = \boldsymbol{b}$ 有唯一解 $\boldsymbol{x} = A^{-1}\boldsymbol{b}$;
- (3)齐次方程组Ax = 0只有零解;
- (4)A对应的阶梯形矩阵有n个主元;
- $(5)rref(A) = I_n;$
- (6)A是有限个初等矩阵的乘积。

根据(6), 如果A可逆,则AB是对B做有限步初等行变换

推论:

给定n阶方阵A,以下叙述等价:

- (1) A可逆
- (2) $\forall \mathbf{b} \in \mathbb{R}^n$, 方程组 $A\mathbf{x} = \mathbf{b}$ 有唯一解 $\mathbf{x} = A^{-1}\mathbf{b}$
- (3) $\forall b \in \mathbb{R}^n$,方程组Ax = b有解
- (4) 存在 $b \in \mathbb{R}^n$,方程组Ax = b有唯一解

证明:

若A 满足(3), 使用: A可逆等价于 $EA = rref(A) = I_n$, E为有限个初等矩阵的乘积。

此时rref(A)一定无零行,否则 $EAx=e_n$ 无解,即 $Ax=E^{-1}e_n$ 无解。于是 $rref(A)=I_n$

若A 满足(4), 使用: A可逆等价于Ax = 0有唯一解。

反设Ax = 0有一非零解 x_0 ,则对Ax = b的任一解x, $x + x_0$ 也是解。与假设矛盾。

推论:

给定n阶方阵A,以下叙述等价:

- (1)A可逆,即存在n阶方阵B,满足 $AB = BA = I_n$
- (2)存在n阶方阵B,满足 $BA = I_n$ (称A有左逆)
- (3)存在n阶方阵B,满足 $AB = I_n$ (称A有右逆)

证明:

- (1)自然得到(2)(3)
- (2) ⇒ (1): 使用 "方阵A可逆当且仅当Ax = 0只有零解"
- 由(2), $Ax = \mathbf{0}$ 得到 $x = I_n x = BAx = B(Ax) = \mathbf{0}$ 。 因此, A可逆。
- (3)⇒ (1): 使用 "方阵A可逆当且仅当对任意b, Ax = b有解"
- 由(3), $b = I_n b = (AB)b = A(Bb)$. 因此,A可逆。

小结:

对于**方阵**A, 以下3条等价

A可逆

A有左逆

A有右逆

假设A有左逆B,那么根据上面的等价条件A有右逆C,则B = C由B(AC) = (BA)C得到B = C同样的理由,如果A可逆,A的逆唯一