

线性代数 二次型

张晓平

武汉大学数学与统计学院

2023年12月27日



目录

- 1 二次型与合同矩阵
- 2 化二次型为标准型
 - 正交变换法
 - 配方法
 - 初等变换法
- 3 正定二次型

目录

- 1 二次型与合同矩阵
- 2 化二次型为标准型
- 3 正定二次型

定义

n 元变量 x_1, x_2, \cdots, x_n 的二次齐次多项式

$$f(x_1, x_2, \dots, x_n) =$$

$$a_{11}x_1^2 + 2a_{12}x_1x_2 + 2a_{13}x_1x_3 + \dots + 2a_{1n}x_1x_n$$

$$+ a_{22}x_2^2 + 2a_{23}x_2x_3 + \dots + 2a_{2n}x_2x_n$$

$$\dots \dots \dots$$

$$+ a_{nn}x_n^2$$

当系数属于数域 \mathbb{F} 时,称为数域 \mathbb{F} 上的一个n 元二次型。

$$f(x_1, x_2, \dots, x_n) =$$

$$a_{11}x_1^2 + a_{12}x_1x_2 + a_{13}x_1x_3 + \dots + a_{1n}x_1x_n$$

$$+ a_{21}x_2x_1 + a_{22}x_2^2 + a_{23}x_2x_3 + \dots + a_{2n}x_2x_n$$

$$\dots \dots \dots \dots \dots$$

$$+ a_{n1}x_nx_1 + a_{n2}x_nx_2 + a_{n3}x_2x_3 + \dots + a_{nn}x_n^2$$

$$f(x_1, x_2, \dots, x_n) =$$

$$a_{11}x_1^2 + a_{12}x_1x_2 + a_{13}x_1x_3 + \dots + a_{1n}x_1x_n$$

$$+ a_{21}x_2x_1 + a_{22}x_2^2 + a_{23}x_2x_3 + \dots + a_{2n}x_2x_n$$

$$\dots + a_{n1}x_nx_1 + a_{n2}x_nx_2 + a_{n3}x_2x_3 + \dots + a_{nn}x_n^2$$

$$= (x_1, x_2, \dots, x_n) \begin{pmatrix} a_{11}x_1 + a_{12}x_2 + \dots + a_{1n}x_n \\ a_{21}x_1 + a_{22}x_2 + \dots + a_{2n}x_n \\ \vdots \\ a_{n1}x_1 + a_{n2}x_2 + \dots + a_{nn}x_n \end{pmatrix}$$

$$f(x_1, x_2, \dots, x_n) =$$

$$a_{11}x_1^2 + a_{12}x_1x_2 + a_{13}x_1x_3 + \dots + a_{1n}x_1x_n$$

$$+ a_{21}x_2x_1 + a_{22}x_2^2 + a_{23}x_2x_3 + \dots + a_{2n}x_2x_n$$

$$\dots + a_{n1}x_nx_1 + a_{n2}x_nx_2 + a_{n3}x_2x_3 + \dots + a_{nn}x_n^2$$

$$= (x_1, x_2, \dots, x_n) \begin{pmatrix} a_{11}x_1 + a_{12}x_2 + \dots + a_{1n}x_n \\ a_{21}x_1 + a_{22}x_2 + \dots + a_{2n}x_n \\ \vdots \\ a_{n1}x_1 + a_{n2}x_2 + \dots + a_{nn}x_n \end{pmatrix}$$

$$egin{aligned} &= (x_1, x_2, \cdots, x_n) \left(egin{array}{cccc} a_{11} & a_{12} & \cdots & a_{1n} \ a_{21} & a_{22} & \cdots & a_{2n} \ dots & dots & dots \ a_{n1} & a_{n2} & \cdots & a_{nn} \end{array}
ight) \left(egin{array}{c} x_1 \ x_2 \ dots \ x_n \end{array}
ight) = oldsymbol{x}^T oldsymbol{A} oldsymbol{x} \end{array}$$

注

• 对于任意一个二次型,总可以写成对称形式

$$f(x) = x^T A x$$

其中 A 为对称矩阵。

注

• 对于任意一个二次型,总可以写成对称形式

$$f(\boldsymbol{x}) = \boldsymbol{x}^T \boldsymbol{A} \boldsymbol{x}$$

其中 A 为对称矩阵。

若 A, B 为对称矩阵,且

$$f(\boldsymbol{x}) = \boldsymbol{x}^T \boldsymbol{A} \boldsymbol{x} = \boldsymbol{x}^T \boldsymbol{B} \boldsymbol{x}$$

则必有 A = B。

注

• 对于任意一个二次型,总可以写成对称形式

$$f(\boldsymbol{x}) = \boldsymbol{x}^T \boldsymbol{A} \boldsymbol{x}$$

其中 A 为对称矩阵。

若 A, B 为对称矩阵,且

$$f(x) = x^T A x = x^T B x$$

则必有 A = B。

- ullet 二次型和它的矩阵是相互唯一确定的,因此研究二次型的性质可转化为研究 A 的性质。
- 二次型 f 的秩即为矩阵 A 的秩.

例

设有二次型
$$f(x_1,x_2,x_3,x_4)=2x_1^2+x_1x_2+2x_1x_3+4x_2x_4+x_3^2+5x_4^2$$
,其矩阵为

$$\mathbf{A} = \begin{pmatrix} 2 & \frac{1}{2} & 1 & 0\\ \frac{1}{2} & 0 & 0 & 2\\ 1 & 0 & 1 & 0\\ 0 & 2 & 0 & 5 \end{pmatrix}$$

二次型要讨论的问题

寻找可逆的线性变换

$$x = Cy \tag{1}$$

使二次型只含平方项, 即

$$f = x^{T} A x = y^{T} (C^{T} A C) y = y^{T} \Lambda y = \lambda_{1} y_{1}^{2} + \dots + \lambda_{n} y_{n}^{2}$$
 (2)

其中

$$\mathbf{\Lambda} = \begin{pmatrix} \lambda_1 & & \\ & \ddots & \\ & & \lambda_n \end{pmatrix}$$

二次型要讨论的问题

寻找可逆的线性变换

$$x = Cy \tag{1}$$

使二次型只含平方项,即

$$f = x^{T} A x = y^{T} (C^{T} A C) y = y^{T} \Lambda y = \lambda_{1} y_{1}^{2} + \dots + \lambda_{n} y_{n}^{2}$$
 (2)

其中

$$\mathbf{\Lambda} = \begin{pmatrix} \lambda_1 & & \\ & \ddots & \\ & & \lambda_n \end{pmatrix}$$

注

- 形如(2)的只包含平方项的二次型,称为二次型的标准型。
- 若标准型的系数 $\lambda_1,\cdots,\lambda_n$ 只在 1,-1,0 三个数中取值, 即经过线性变换 (1), 使得

$$f = y_1^2 + \dots + y_p^2 - y_{p+1}^2 - \dots - y_{p+q}^2$$

则称上式为二次型的规范型.

化二次型为标准型的基本做法

• 求线性变换

$$x = Cy$$
 (C 为可逆矩阵)

使得

$$\boldsymbol{x}^T \boldsymbol{A} \boldsymbol{x} = \boldsymbol{y}^T \boldsymbol{C}^T \boldsymbol{A} \boldsymbol{C} \boldsymbol{y} = \boldsymbol{y}^T \boldsymbol{\Lambda} \boldsymbol{y} = \lambda_1 y_1^2 + \dots + \lambda_n y_n^2$$

化二次型为标准型的基本做法

• 求线性变换

$$x = Cy$$
 (C 为可逆矩阵)

使得

$$\boldsymbol{x}^{T} \boldsymbol{A} \boldsymbol{x} = \boldsymbol{y}^{T} \boldsymbol{C}^{T} \boldsymbol{A} \boldsymbol{C} \boldsymbol{y} = \boldsymbol{y}^{T} \boldsymbol{\Lambda} \boldsymbol{y} = \lambda_{1} y_{1}^{2} + \dots + \lambda_{n} y_{n}^{2}$$

• 从矩阵的角度来说,就是对于一个实对称矩阵 A,寻找一个可逆矩阵,使得 C^TAC 成为对角阵 Λ 。

定义 (矩阵的合同)

对于两个方阵 A 和 B, 若存在可逆矩阵 C, 使得

$$C^T A C = B$$
,

就称 A 合同于 B, 记作 $A \simeq B$ 。

目录

- 1 二次型与合同矩阵
- 2 化二次型为标准型
- 3 正定二次型

目录

- 1 二次型与合同矩阵
- 2 化二次型为标准型
 - 正交变换法
 - ■配方法
 - ■初等变换法
- 3 正定二次型

回顾

对于实对称矩阵 A, 存在正交阵 Q, 使得

$$\boldsymbol{Q}^{-1}\boldsymbol{A}\boldsymbol{Q}=\boldsymbol{\Lambda},$$

回顾

对于实对称矩阵 A, 存在正交阵 Q, 使得

$$Q^{-1}AQ = \Lambda,$$

由于
$$Q^{-1} = Q^T$$
, 故

$$Q^T A Q = \Lambda.$$

回顾

对于实对称矩阵 A,存在正交阵 Q,使得

$$Q^{-1}AQ = \Lambda,$$

由于 $Q^{-1} = Q^T$,故

$$Q^T A Q = \Lambda.$$

定理 (主轴定理)

对于任一个 n 元二次型

$$f(x_1, x_2, \cdots, x_n) = \boldsymbol{x}^T \boldsymbol{A} \boldsymbol{x},$$

存在正交变换 x = Qy(Q) 为正交阵), 使得

$$\boldsymbol{x}^T \boldsymbol{A} \boldsymbol{x} = \boldsymbol{y}^T (\boldsymbol{Q}^T \boldsymbol{A} \boldsymbol{Q}) \boldsymbol{y} = \boldsymbol{y}^T \boldsymbol{\Lambda} \boldsymbol{y} = \lambda_1 y_1^2 + \lambda_2 y_2^2 + \dots + \lambda_n y_n^2,$$

其中 $\lambda_1,\lambda_2,\cdots,\lambda_n$ 为 A 的 n 个特征值,Q 的 n 个列向量 $\alpha_1,\alpha_2,\cdots,\alpha_n$ 是 A 对应于 $\lambda_1,\lambda_2,\cdots,\lambda_n$ 的标准正交特征向量。

例

用正交变换法,将二次型

$$f(x_1, x_2, x_3) = 2x_1^2 + 5x_2^2 + 5x_3^2 + 4x_1x_2 - 4x_1x_3 - 8x_2x_3$$

化为标准型。

例

用正交变换法,将二次型

$$f(x_1, x_2, x_3) = 2x_1^2 + 5x_2^2 + 5x_3^2 + 4x_1x_2 - 4x_1x_3 - 8x_2x_3$$

化为标准型。

解

二次型的矩阵为

$$\mathbf{A} = \left(\begin{array}{rrr} 2 & 2 & -2 \\ 2 & 5 & -4 \\ -2 & -4 & 5 \end{array} \right)$$

例

用正交变换法,将二次型

$$f(x_1, x_2, x_3) = 2x_1^2 + 5x_2^2 + 5x_3^2 + 4x_1x_2 - 4x_1x_3 - 8x_2x_3$$

化为标准型。

解

二次型的矩阵为

$$\mathbf{A} = \left(\begin{array}{rrr} 2 & 2 & -2 \\ 2 & 5 & -4 \\ -2 & -4 & 5 \end{array} \right)$$

其特征多项式为

$$|\mathbf{A} - \lambda \mathbf{I}| = -(\lambda - 1)^2 (\lambda - 10)$$

得特征值 $\lambda_{1,2} = 1$ 和 $\lambda_3 = 10$.

$$(A - \lambda_1 I)x = 0$$
 \Rightarrow $\begin{pmatrix} 1 & 2 & -2 \\ 2 & 4 & -4 \\ -2 & -4 & 4 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} x_1 \\ x_2 \\ x_3 \end{pmatrix} = 0$
 $\Rightarrow x_1 = (-2, 1, 0)^T, x_2 = (2, 0, 1)^T.$

$$(A - \lambda_1 I)x = \mathbf{0} \quad \Rightarrow \quad \begin{pmatrix} 1 & 2 & -2 \\ 2 & 4 & -4 \\ -2 & -4 & 4 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} x_1 \\ x_2 \\ x_3 \end{pmatrix} = \mathbf{0}$$

$$\Rightarrow \quad x_1 = (-2, 1, 0)^T, \quad x_2 = (2, 0, 1)^T.$$

$$(A - \lambda_3 I)x = \mathbf{0} \quad \Rightarrow \quad \begin{pmatrix} -8 & 2 & -2 \\ 2 & -5 & -4 \\ -2 & -4 & -5 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} x_1 \\ x_2 \\ x_3 \end{pmatrix} = \mathbf{0}$$

$$(A - \lambda_1 I)x = \mathbf{0} \quad \Rightarrow \quad \begin{pmatrix} 1 & 2 & -2 \\ 2 & 4 & -4 \\ -2 & -4 & 4 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} x_1 \\ x_2 \\ x_3 \end{pmatrix} = \mathbf{0}$$

$$\Rightarrow \quad x_1 = (-2, 1, 0)^T, \quad x_2 = (2, 0, 1)^T.$$

$$(A - \lambda_3 I)x = \mathbf{0} \quad \Rightarrow \quad \begin{pmatrix} -8 & 2 & -2 \\ 2 & -5 & -4 \\ -2 & -4 & -5 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} x_1 \\ x_2 \\ x_3 \end{pmatrix} = \mathbf{0}$$

$$\Rightarrow \quad x_3 = (1, 2, -2)^T.$$

解 (续)

$$(A - \lambda_1 I)x = \mathbf{0} \quad \Rightarrow \quad \begin{pmatrix} 1 & 2 & -2 \\ 2 & 4 & -4 \\ -2 & -4 & 4 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} x_1 \\ x_2 \\ x_3 \end{pmatrix} = \mathbf{0}$$

$$\Rightarrow \quad x_1 = (-2, 1, 0)^T, \quad x_2 = (2, 0, 1)^T.$$

$$(A - \lambda_3 I)x = \mathbf{0} \quad \Rightarrow \quad \begin{pmatrix} -8 & 2 & -2 \\ 2 & -5 & -4 \\ -2 & -4 & -5 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} x_1 \\ x_2 \\ x_3 \end{pmatrix} = \mathbf{0}$$

$$\Rightarrow \quad x_3 = (1, 2, -2)^T.$$

对 x_1, x_2 用施密特正交化方法先正交化再单位化得

$$\boldsymbol{\xi}_1 = \left(-\frac{2\sqrt{5}}{5}, \frac{2\sqrt{5}}{5}, 0\right)^T, \quad \boldsymbol{\xi}_2 = \left(\frac{2\sqrt{5}}{15}, \frac{4\sqrt{5}}{15}, \frac{\sqrt{5}}{3}\right)^T$$

再将 x_3 单位化为

$$\boldsymbol{\xi}_3 = \left(\frac{1}{3}, \frac{2}{3}, -\frac{2}{3}\right)^T$$

解(续)

取正交矩阵

$$Q = (\xi_1, \xi_2, \xi_3) = \begin{pmatrix} -\frac{2\sqrt{5}}{5} & \frac{2\sqrt{5}}{15} & \frac{1}{3} \\ \frac{2\sqrt{5}}{5} & \frac{4\sqrt{5}}{15} & \frac{2}{3} \\ 0 & \frac{\sqrt{5}}{3} & -\frac{2}{3} \end{pmatrix}$$

则

$$\boldsymbol{Q}^{-1}\boldsymbol{A}\boldsymbol{Q} = \boldsymbol{Q}^T\boldsymbol{A}\boldsymbol{Q} = \mathrm{diag}(1,1,10).$$

解(续)

取正交矩阵

$$Q = (\xi_1, \xi_2, \xi_3) = \begin{pmatrix} -\frac{2\sqrt{5}}{5} & \frac{2\sqrt{5}}{15} & \frac{1}{3} \\ \frac{2\sqrt{5}}{5} & \frac{4\sqrt{5}}{15} & \frac{2}{3} \\ 0 & \frac{\sqrt{5}}{3} & -\frac{2}{3} \end{pmatrix}$$

则

$$\boldsymbol{Q}^{-1}\boldsymbol{A}\boldsymbol{Q} = \boldsymbol{Q}^T\boldsymbol{A}\boldsymbol{Q} = \text{diag}(1, 1, 10).$$

令 $x=(x_1,x_2,x_3)^T, y=(y_1,y_2,y_3)^T$,做正交变换 $x=\mathbf{Q}y$,原二次型就化成标准型

$$x^{T}Ax = y^{T}(Q^{T}AQ)y = y_1^2 + y_2^2 + 10y_3^2.$$

例

判断二次曲面

$$x^2 - 2y^2 + 10z^2 + 28xy - 8yz + 20zx - 26x + 32y + 28z - 38 = 0$$

的类型。

例

判断二次曲面

$$x^{2} - 2y^{2} + 10z^{2} + 28xy - 8yz + 20zx - 26x + 32y + 28z - 38 = 0$$

的类型。

解

二次型部分 $x^2 - 2y^2 + 10z^2 + 28xy - 8yz + 20zx$ 对应的矩阵为

$$\begin{pmatrix} 1 & 14 & 10 \\ 14 & -2 & -4 \\ 10 & -4 & 10 \end{pmatrix}$$

同前例,可得正交阵

$$Q = \begin{pmatrix} \frac{1}{3} & \frac{2}{3} & \frac{2}{3} \\ \frac{2}{3} & \frac{1}{3} & -\frac{2}{3} \\ -\frac{2}{3} & \frac{2}{3} & -\frac{1}{3} \end{pmatrix}$$

使得

$$\mathbf{Q}^T \mathbf{A} \mathbf{Q} = \text{diag}(9, 18, -18).$$

做正交变换
$$x = Qy$$
, $x = (x, y, z)^T$, $y = (x_1, y_1, z_1)^T$, 可得
$$x^T A x = y^T (Q^T A Q) y = 9{x_1}^2 + 18{y_1}^2 - 18{z_1}^2$$

解 (续)

做正交变换
$$x = Qy$$
, $x = (x, y, z)^T$, $y = (x_1, y_1, z_1)^T$, 可得
$$x^T A x = y^T (Q^T A Q) y = 9{x_1}^2 + 18{y_1}^2 - 18{z_1}^2$$

将 x = Qy 代入原方程即得

$$x_1^2 + 2y_1^2 - 2z_1^2 - \frac{2}{3}x_1 + \frac{4}{3}y_1 - \frac{16}{3}z_1 - \frac{28}{9} = 0$$

解 (续)

做正交变换
$$x = Qy$$
, $x = (x, y, z)^T$, $y = (x_1, y_1, z_1)^T$, 可得
$$x^T A x = y^T (Q^T A Q) y = 9{x_1}^2 + 18{y_1}^2 - 18{z_1}^2$$

将 x = Qy 代入原方程即得

$${x_1}^2 + 2{y_1}^2 - 2{z_1}^2 - \frac{2}{3}x_1 + \frac{4}{3}y_1 - \frac{16}{3}z_1 - \frac{28}{9} = 0$$

配方得

$$\left(x_1 - \frac{1}{3}\right)^2 + 2\left(y_1 + \frac{1}{3}\right)^2 - 2\left(z_1 + \frac{4}{3}\right)^2 = 1$$

正交变换法

解 (续)

做正交变换
$$x = Qy$$
, $x = (x, y, z)^T$, $y = (x_1, y_1, z_1)^T$, 可得
$$x^T A x = y^T (Q^T A Q) y = 9x_1^2 + 18y_1^2 - 18z_1^2$$

将 x = Qy 代入原方程即得

$${x_1}^2 + 2{y_1}^2 - 2{z_1}^2 - \frac{2}{3}x_1 + \frac{4}{3}y_1 - \frac{16}{3}z_1 - \frac{28}{9} = 0$$

配方得

$$\left(x_1 - \frac{1}{3}\right)^2 + 2\left(y_1 + \frac{1}{3}\right)^2 - 2\left(z_1 + \frac{4}{3}\right)^2 = 1$$

再令

$$x_2 = x_1 - \frac{1}{3}, \quad y_2 = y_1 + \frac{1}{3}, \quad z_2 = z_1 + \frac{4}{3},$$

代入上式得标准方程

$$x_2^2 + 2y_2^2 - 2z_2^2 = 1,$$

由此可知二次曲面为单叶双曲面.

正交变换法

二次曲面的分类

- 椭球面
- 二次锥面
- 单叶双曲面
- 双叶双曲面

$$\frac{x^2}{a^2} + \frac{y^2}{b^2} + \frac{z^2}{c^2} = 1$$

$$\frac{x^2}{a^2} + \frac{y^2}{b^2} - \frac{z^2}{c^2} = 0$$

$$\frac{x^2}{a^2} + \frac{y^2}{b^2} - \frac{z^2}{c^2} = 1$$

$$\frac{x^2}{a^2} - \frac{y^2}{b^2} - \frac{z^2}{c^2} = 1$$

目录

- 1 二次型与合同矩阵
- 2 化二次型为标准型
 - ■正交变换法
 - 配方法
 - ■初等变换法
- 3 正定二次型

例

用配方法把三元二次型

$$f(x_1, x_2, x_3) = 2x_1^2 + 3x_2^2 + x_3^2 + 4x_1x_2 - 4x_1x_3 - 8x_2x_3$$

化为标准型。

例

用配方法把三元二次型

$$f(x_1, x_2, x_3) = 2x_1^2 + 3x_2^2 + x_3^2 + 4x_1x_2 - 4x_1x_3 - 8x_2x_3$$

化为标准型。

解

先按 x_1^2 和含 x_1 的混合项配成完全平方,即

$$f(x_1, x_2, x_3) = 2[x_1^2 + 2x_1(x_2 - x_3) + (x_2 - x_3)^2] - 2(x_2 - x_3)^2 + 3x_2^2 + x_3^2 - 8x_2x_3$$
$$= 2(x_1 + x_2 - x_3)^2 + x_2^2 - x_3^2 - 4x_2x_3$$

例

用配方法把三元二次型

$$f(x_1, x_2, x_3) = 2x_1^2 + 3x_2^2 + x_3^2 + 4x_1x_2 - 4x_1x_3 - 8x_2x_3$$

化为标准型。

解

先按 x_1^2 和含 x_1 的混合项配成完全平方,即

$$f(x_1, x_2, x_3) = 2[x_1^2 + 2x_1(x_2 - x_3) + (x_2 - x_3)^2] - 2(x_2 - x_3)^2 + 3x_2^2 + x_3^2 - 8x_2x_3$$
$$= 2(x_1 + x_2 - x_3)^2 + x_2^2 - x_3^2 - 4x_2x_3$$

再按 $x_2^2-4x_2x_3$ 配成完全平方,得

$$f(x_1, x_2, x_3) = 2(x_1 + x_2 - x_3)^2 + (x_2 - 2x_3)^2 - 5x_3^2.$$

例

用配方法把三元二次型

$$f(x_1, x_2, x_3) = 2x_1^2 + 3x_2^2 + x_3^2 + 4x_1x_2 - 4x_1x_3 - 8x_2x_3$$

化为标准型。

解

先按 x_1^2 和含 x_1 的混合项配成完全平方,即

$$f(x_1, x_2, x_3) = 2[x_1^2 + 2x_1(x_2 - x_3) + (x_2 - x_3)^2] - 2(x_2 - x_3)^2 + 3x_2^2 + x_3^2 - 8x_2x_3$$
$$= 2(x_1 + x_2 - x_3)^2 + x_2^2 - x_3^2 - 4x_2x_3$$

再按 $x_2^2 - 4x_2x_3$ 配成完全平方,得

$$f(x_1, x_2, x_3) = 2(x_1 + x_2 - x_3)^2 + (x_2 - 2x_3)^2 - 5x_3^2.$$



例

用配方法把三元二次型

$$f(x_1, x_2, x_3) = 2x_1^2 + 3x_2^2 + x_3^2 + 4x_1x_2 - 4x_1x_3 - 8x_2x_3$$

化为标准型。

解

先按 x_1^2 和含 x_1 的混合项配成完全平方,即

$$f(x_1, x_2, x_3) = 2[x_1^2 + 2x_1(x_2 - x_3) + (x_2 - x_3)^2] - 2(x_2 - x_3)^2 + 3x_2^2 + x_3^2 - 8x_2x_3$$
$$= 2(x_1 + x_2 - x_3)^2 + x_2^2 - x_3^2 - 4x_2x_3$$

再按 $x_2^2 - 4x_2x_3$ 配成完全平方,得

$$f(x_1, x_2, x_3) = 2(x_1 + x_2 - x_3)^2 + (x_2 - 2x_3)^2 - 5x_3^2.$$



$$\left\{ \begin{array}{cccccc} y_1 & = & x_1 & + & x_2 & - & x_3 \\ y_2 & = & & x_2 & - & 2x_3 \\ y_3 & = & & & x_3 \end{array} \right. \implies \left(\begin{array}{c} x_1 \\ x_2 \\ x_3 \end{array} \right) = \left(\begin{array}{cccc} 1 & -1 & -1 \\ 0 & 1 & 2 \\ 0 & 0 & 1 \end{array} \right) \left(\begin{array}{c} y_1 \\ y_2 \\ y_3 \end{array} \right)$$

例

用配方法把三元二次型

$$f(x_1, x_2, x_3) = 2x_1^2 + 3x_2^2 + x_3^2 + 4x_1x_2 - 4x_1x_3 - 8x_2x_3$$

化为标准型。

解

先按 x_1^2 和含 x_1 的混合项配成完全平方,即

$$f(x_1, x_2, x_3) = 2[x_1^2 + 2x_1(x_2 - x_3) + (x_2 - x_3)^2] - 2(x_2 - x_3)^2 + 3x_2^2 + x_3^2 - 8x_2x_3$$
$$= 2(x_1 + x_2 - x_3)^2 + x_2^2 - x_3^2 - 4x_2x_3$$

再按 $x_2^2 - 4x_2x_3$ 配成完全平方,得

$$f(x_1, x_2, x_3) = 2(x_1 + x_2 - x_3)^2 + (x_2 - 2x_3)^2 - 5x_3^2.$$

$$\left\{ \begin{array}{cccccc} y_1 & = & x_1 & + & x_2 & - & x_3 \\ y_2 & = & & x_2 & - & 2x_3 \\ y_3 & = & & & x_3 \end{array} \right. \implies \left(\begin{array}{c} x_1 \\ x_2 \\ x_3 \end{array} \right) = \left(\begin{array}{cccc} 1 & -1 & -1 \\ 0 & 1 & 2 \\ 0 & 0 & 1 \end{array} \right) \left(\begin{array}{c} y_1 \\ y_2 \\ y_3 \end{array} \right)$$

则

$$f(x_1, x_2, x_3) = 2y_1^2 + y_2^2 - 5y_3^2.$$

例

用配方法化二次型

$$f(x_1, x_2, x_3) = 2x_1x_2 + 4x_1x_3$$

为标准型。

例

用配方法化二次型

$$f(x_1, x_2, x_3) = 2x_1x_2 + 4x_1x_3$$

为标准型。

解

$$\begin{cases} x_1 = y_1 + y_2 \\ x_2 = y_1 - y_2 \\ x_3 = y_3 \end{cases}$$

则

$$f(x_1, x_2, x_3) = 2(y_1 + y_2)(y_1 - y_2) + 4(y_1 + y_2)y_3 = 2y_1^2 - 2y_2^2 + 4y_1y_3 + 4y_2y_3$$

例

用配方法化二次型

$$f(x_1, x_2, x_3) = 2x_1x_2 + 4x_1x_3$$

为标准型。

解

$$\begin{cases} x_1 = y_1 + y_2 \\ x_2 = y_1 - y_2 \\ x_3 = y_3 \end{cases}$$

则

$$f(x_1, x_2, x_3) = 2(y_1 + y_2)(y_1 - y_2) + 4(y_1 + y_2)y_3 = 2y_1^2 - 2y_2^2 + 4y_1y_3 + 4y_2y_3$$

先对含 y_1 的项配完全平方,得

$$f(x_1, x_2, x_3) = 2(y_1^2 + 2y_1y_3 + y_3^2) - 2y_2^2 - 2y_3^2 + 4y_2y_3$$

再对含 y_2 的项配完全平方,得

$$f(x_1, x_2, x_3) = 2(y_1 + y_3)^2 - 2(y_2 - y_3)^2$$

解【续】



$$\begin{cases} z_1 = y_1 + y_3 \\ z_2 = y_2 - y_3 \\ z_3 = y_3 \end{cases} \iff \begin{cases} y_1 = z_1 - z_3 \\ y_2 = z_2 + z_3 \\ y_3 = z_3 \end{cases}$$

则

$$f(x_1, x_2, x_3) = 2z_1^2 - 2z_2^2.$$

解【续】

令

$$\begin{cases} z_1 = y_1 + y_3 \\ z_2 = y_2 - y_3 \\ z_3 = y_3 \end{cases} \iff \begin{cases} y_1 = z_1 - z_3 \\ y_2 = z_2 + z_3 \\ y_3 = z_3 \end{cases}$$

则

$$f(x_1, x_2, x_3) = 2z_1^2 - 2z_2^2.$$

坐标变换记为

$$x = C_1 y$$
, $y = C_2 z$, $x = C_1 C_2 z = C z$

其中

$$C_1 = \left(egin{array}{ccc} 1 & 1 & 0 \\ 1 & -1 & 0 \\ 0 & 0 & 1 \end{array}
ight), \quad C_2 = \left(egin{array}{ccc} 1 & 0 & -1 \\ 0 & 1 & 1 \\ 0 & 0 & 1 \end{array}
ight)$$

$$C = C_1 C_2 = \begin{pmatrix} 1 & 1 & 0 \\ 1 & -1 & -2 \\ 0 & 0 & 1 \end{pmatrix}$$

表:

二次型	对应矩阵
$2x_1x_2 + 4x_1x_3$	$\mathbf{A} = \left(\begin{array}{ccc} 0 & 1 & 2 \\ 1 & 0 & 0 \\ 2 & 0 & 0 \end{array}\right)$
$2z_1^2 - 2z_2^2$	$oldsymbol{\Lambda} = \left(egin{array}{ccc} 2 & & & \ & -2 & & \ & & 0 \end{array} ight)$

易验证

$$\boldsymbol{C}^T\boldsymbol{A}\boldsymbol{C}=\mathrm{diag}(2,-2,0)$$

表:

二次型	对应矩阵
$2x_1x_2 + 4x_1x_3$	$\mathbf{A} = \left(\begin{array}{ccc} 0 & 1 & 2 \\ 1 & 0 & 0 \\ 2 & 0 & 0 \end{array}\right)$
$2z_1^2 - 2z_2^2$	$\mathbf{\Lambda} = \begin{pmatrix} 2 & & \\ & -2 & \\ & & 0 \end{pmatrix}$

易验证

$$\boldsymbol{C}^T\boldsymbol{A}\boldsymbol{C}=\mathrm{diag}(2,-2,0)$$

注

任何 n 元二次型都可用配方法化为标准型,相应的变换矩阵为主对角元为 1 的上三角阵和对角块矩阵,或者是这两类矩阵的乘积。

目录

- 1 二次型与合同矩阵
- 2 化二次型为标准型
 - ■正交变换法
 - ■配方法
 - 初等变换法
- 3 正定二次型

对于实对称矩阵,可通过一系列相同类型的初等行、列变换将其化为合同标准型。所谓 相同类型的初等行、列变换,指的是

(1)

$$m{A} \xrightarrow{c_i + kc_j} m{A}m{E}_{ij}(k) \xrightarrow{r_i + kr_j} m{E}_{ij}(k)^Tm{A}m{E}_{ij}(k)$$
 $m{E}_{ij}(k)^Tm{A}m{E}_{ij}(k)$ 仍为对称矩阵。

(2)

$$m{A} \quad \stackrel{c_i imes k}{\longrightarrow} \quad m{A}m{E}_i(k) \quad \stackrel{r_i imes k}{\longrightarrow} \quad m{E}_i(k)^Tm{A}m{E}_i(k)$$
 及对称矩阵。

(2)

$$m{A} \stackrel{c_i \leftrightarrow c_j}{\longrightarrow} m{A}m{E}_{ij} \stackrel{r_i \leftrightarrow r_j}{\longrightarrow} m{E}_{ij}^Tm{A}m{E}_{ij}$$
 $m{E}_{ij}(k)^Tm{A}m{E}_{ij}(k)$ 仍为对称矩阵。

定理

对于任一个 n 阶实对称矩阵 A,都存在可逆矩阵 C,使得

$$C^T A C = \operatorname{diag}(d_1, d_2, \cdots, d_n).$$

定理

对于任一个 n 阶实对称矩阵 A, 都存在可逆矩阵 C, 使得

$$C^T A C = \operatorname{diag}(d_1, d_2, \cdots, d_n).$$

注

由

$$C = P_1 P_2 \cdots P_k = I P_1 P_2 \cdots P_k$$

可知,将施加于 A 的列变换同时施加于单位阵 I,当 A 变为对角阵时,I 就变为变换矩阵 C。

例

用初等变换法将二次型

$$f(x_1, x_2, x_3) = (x_1, x_2, x_3) \begin{pmatrix} 2 & 2 & -2 \\ 2 & 5 & -4 \\ -2 & -4 & 5 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} x_1 \\ x_2 \\ x_3 \end{pmatrix}$$

化为标准型,并求坐标变换 x = Cy。

目录

- 1 二次型与合同矩阵
- 2 化二次型为标准型
- 3 正定二次型

定理 (惯性定理)

设二次型 $f = x^T A x$ 的秩为 r,且有两个可逆变换

$$x = Cy, x = Pz$$

使得

$$f = k_1 y_1^2 + \dots + k_r y_r^2 \ (k_i \neq 0), \quad f = l_1 z_1^2 + \dots + l_r z_r^2 \ (l_i \neq 0),$$

则 k_1, \dots, k_r 中正数的个数与 l_1, \dots, l_r 中正数的个数相等。

定理 (惯性定理)

设二次型 $f = x^T A x$ 的秩为 r,且有两个可逆变换

$$x = Cy, x = Pz$$

使得

$$f = k_1 y_1^2 + \dots + k_r y_r^2 \ (k_i \neq 0), \quad f = l_1 z_1^2 + \dots + l_r z_r^2 \ (l_i \neq 0),$$

则 k_1, \dots, k_r 中正数的个数与 l_1, \dots, l_r 中正数的个数相等。

定义 (正惯性指数和负惯性指数)

在二次型 f 的标准型中,正系数的个数称为二次型的<mark>正惯性指数</mark>,负系数的个数称为二次型的<mark>负惯性指数</mark>。设 f 的正惯性指数为 p,负惯性指数为 q,则 f 的规范型为

$$f = y_1^2 + \dots + y_p^2 - y_{p+1}^2 - \dots - y_{p+q}^2,$$

且

$$p + q = r$$
.

定义 (正定矩阵)

若对任意非零向量 $x = (x_1, x_2, \cdots, x_n)^T$,恒有

$$x^{T}Ax = \sum_{i=1}^{n} \sum_{j=1}^{n} a_{ij}x_{i}x_{j} > 0,$$

则称 $x^T A x$ 为正定二次型,称 A 为正定矩阵。

定义 (正定矩阵)

若对任意非零向量 $x = (x_1, x_2, \cdots, x_n)^T$,恒有

$$x^{T}Ax = \sum_{i=1}^{n} \sum_{j=1}^{n} a_{ij}x_{i}x_{j} > 0,$$

则称 $x^T A x$ 为正定二次型,称 A 为正定矩阵。

注

正定矩阵是针对对称矩阵而言的。

定义 (正定矩阵)

若对任意非零向量 $x = (x_1, x_2, \cdots, x_n)^T$,恒有

$$x^{T}Ax = \sum_{i=1}^{n} \sum_{j=1}^{n} a_{ij}x_{i}x_{j} > 0,$$

则称 $x^T A x$ 为正定二次型,称 A 为正定矩阵。

注

正定矩阵是针对对称矩阵而言的。

定义 (负定矩阵)

如果对于任意的非零向量 $x = (x_1, x_2, \dots, x_n)^T$,恒有

$$x^{T}Ax = \sum_{i=1}^{n} \sum_{j=1}^{n} a_{ij}x_{i}x_{j} < 0,$$

就称 $x^T A x$ 为负定二次型,称 A 为负定矩阵。

定理

二次型
$$f=\lambda_1y_1^2+\lambda_2y_2^2+\cdots+\lambda_ny_n^2$$
 正定的充分必要条件是 $\lambda_i>0$ $(i=1,2,\cdots,n)$

定理

二次型 $f=\lambda_1 y_1^2+\lambda_2 y_2^2+\cdots+\lambda_n y_n^2$ 正定的充分必要条件是 $\lambda_i>0$ $(i=1,2,\cdots,n)$

证明.

← 显然

定理

二次型 $f=\lambda_1 y_1^2+\lambda_2 y_2^2+\cdots+\lambda_n y_n^2$ 正定的充分必要条件是 $\lambda_i>0$ $(i=1,2,\cdots,n)$

证明.

← 显然

 \Rightarrow 设 $\lambda_i \leq 0$, 取 $y_i = 1, y_j = 0 (j \neq i)$, 代入二次型, 得

$$f(0, \dots, 0, 1, 0, \dots, 0) = \lambda_i \le 0$$

这与二次型 $f(y_1, y_2, \dots, y_n)$ 正定矛盾。



定理

对任意二次型 x^TAx ,经过可逆的线性变换 x=Cy,化为 $y^T(C^TAC)y$,其正定性保持不变。即当

$$x^T A x$$
 $\stackrel{x = C y}{\Longleftrightarrow}$ $y^T (C^T A C) y$ $(C$ 可逆)

时,等式两端的二次型有相同的正定性。换句话说:合同变换不会改变矩阵的正定性.

定理

对任意二次型 x^TAx ,经过可逆的线性变换 x=Cy,化为 $y^T(C^TAC)y$,其正定性保持不变。即当

$$x^T A x$$
 $\stackrel{x = C y}{\Longleftrightarrow}$ $y^T (C^T A C) y$ $(C$ 可逆)

时,等式两端的二次型有相同的正定性。换句话说:合同变换不会改变矩阵的正定性.

证明.

 $\forall y = (y_1, y_2, \dots, y_n) \neq \mathbf{0}$, 由于 x = Cy(C可逆),则 $x \neq \mathbf{0}$ 。若 $x^T A x$ 正定,则 $x^T A x > 0$ 。从而有: $\forall y \neq \mathbf{0}$,

$$\boldsymbol{y}^T(\boldsymbol{C}^T\boldsymbol{A}\boldsymbol{C})\boldsymbol{y} = \boldsymbol{x}^T\boldsymbol{A}\boldsymbol{x} > 0$$

故 $y^T(C^TAC)y$ 是正定二次型。

定理

对任意二次型 x^TAx ,经过可逆的线性变换 x=Cy,化为 $y^T(C^TAC)y$,其正定性保持不变。即当

$$x^T A x$$
 $\stackrel{x = C y}{\Longleftrightarrow}$ $y^T (C^T A C) y$ $(C$ 可逆)

时,等式两端的二次型有相同的正定性。换句话说: 合同变换不会改变矩阵的正定性.

证明.

 $\forall y = (y_1, y_2, \dots, y_n) \neq \mathbf{0}$, 由于 x = Cy(C可逆),则 $x \neq \mathbf{0}$ 。若 $x^T A x$ 正定,则 $x^T A x > 0$ 。从而有: $\forall y \neq \mathbf{0}$,

$$\boldsymbol{y}^T(\boldsymbol{C}^T\boldsymbol{A}\boldsymbol{C})\boldsymbol{y} = \boldsymbol{x}^T\boldsymbol{A}\boldsymbol{x} > 0$$

故 $y^T(C^TAC)y$ 是正定二次型。反之亦然。

定理

若 A 是 n 阶实对称矩阵,则以下命题等价:

- (1) A 是正定矩阵;
- (2) 二次型 $f = x^T A x$ 的正惯性指数为 n, 即 $A \simeq I$;
- (3) 存在可逆矩阵 P 使得 $A = P^T P$;
- (4) A 的 n 个特征值 $\lambda_1, \lambda_2, \dots, \lambda_n$ 全大于零。

定理

若 A 是 n 阶实对称矩阵,则以下命题等价:

- (1) A 是正定矩阵;
- (2) 二次型 $f = x^T A x$ 的正惯性指数为 n, 即 $A \simeq I$;
- (3) 存在可逆矩阵 P 使得 $A = P^T P$;
- (4) A 的 n 个特征值 $\lambda_1, \lambda_2, \dots, \lambda_n$ 全大于零。

例

A正定 \Longrightarrow A^{-1} 正定

定理

若 A 正定,则

- A 的所有主对角元皆大于零;
- |A| > 0 •

定理

若 A 正定,则

- A 的所有主对角元皆大于零;
- |A| > 0 •

证明.

• 取 $x = e_i$, 由 A 正定可知

$$a_{ii} = \boldsymbol{x}^T \boldsymbol{A} \boldsymbol{x} = \boldsymbol{e}_i^T \boldsymbol{A} \boldsymbol{e}_i > 0.$$

• 因 A 正定,故存在可逆阵 P 使得 $A = P^T P$,从而

$$|\boldsymbol{A}| = |\boldsymbol{P}^T||\boldsymbol{P}| = |\boldsymbol{P}|^2 > 0.$$



定理

• 对称矩阵 A 正定的充分必要条件为 A 的各阶顺序主子式全大于零,即

$$a_{11} > 0, \quad \begin{vmatrix} a_{11} & a_{12} \\ a_{21} & a_{22} \end{vmatrix} > 0, \quad \begin{vmatrix} a_{11} & \cdots & a_{1n} \\ \vdots & \ddots & \vdots \\ a_{n1} & \cdots & a_{nn} \end{vmatrix} > 0.$$

ullet 对称矩阵 A 负定的充分必要条件为 A 的奇数阶顺序主子式为负,而偶数阶主子式为正、即

$$(-1)^r \begin{vmatrix} a_{11} & \cdots & a_{1r} \\ \vdots & \ddots & \vdots \\ a_{r1} & \cdots & a_{rr} \end{vmatrix} > 0, \quad r = 1, \cdots, n.$$

例

判断二次型

$$f = x_1^2 + 2x_2^2 + 3x_3^2 + 2x_1x_2 - 2x_2x_3$$

是否正定。

例

判断二次型

$$f = x_1^2 + 2x_2^2 + 3x_3^2 + 2x_1x_2 - 2x_2x_3$$

是否正定。

解

f 的矩阵为

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

其中

$$a_{11} = 1 > 0, \ \begin{vmatrix} a_{11} & a_{12} \\ a_{21} & a_{22} \end{vmatrix} = \begin{vmatrix} 1 & 1 \\ 1 & 2 \end{vmatrix} = 1 > 0, \ |\mathbf{A}| = \begin{vmatrix} 1 & 1 & 0 \\ 1 & 2 & -1 \\ 0 & -1 & 3 \end{vmatrix} = 2 > 0$$

故 f 正定.

例

判断二次型

$$f = -5x_1^2 - 6x_2^2 - 4x_3^2 + 4x_1x_2 + 4x_1x_3$$

是否正定。

例

判断二次型

$$f = -5x_1^2 - 6x_2^2 - 4x_3^2 + 4x_1x_2 + 4x_1x_3$$

是否正定。

解

f 的矩阵为

$$\begin{pmatrix} -5 & 2 & 2 \\ 2 & -6 & 0 \\ 2 & 0 & -4 \end{pmatrix}$$

其中

$$a_{11} = -5 < 0, \ \begin{vmatrix} a_{11} & a_{12} \\ a_{21} & a_{22} \end{vmatrix} = \begin{vmatrix} -5 & 2 \\ 2 & -6 \end{vmatrix} = 26 > 0, \ |\mathbf{A}| = \begin{vmatrix} -5 & 2 & 2 \\ 2 & -6 & 0 \\ 2 & 0 & -4 \end{vmatrix} = -80 < 0$$

故 f 负定.