

第十三次作业

1. $A = \begin{pmatrix} 2 & 0 & 0 \\ 1 & 2 & 1 \\ 1 & 0 & 1 \end{pmatrix}$ 求特征值, 特征向量, 特征子空间和 A^k ($k \in \mathbb{N}$)

解: $\chi_A = |\lambda E - A| = \begin{vmatrix} \lambda-2 & 0 & 0 \\ 1 & \lambda-2 & 1 \\ 1 & 0 & \lambda-1 \end{vmatrix} = (\lambda-2)^2(\lambda-1)$

\therefore 特征值为 $\lambda_1 = 2$ (2重), $\lambda_2 = 1$ (1重).

$(\lambda_1 E - A)\vec{x} = \begin{pmatrix} 0 & 0 & 0 \\ 1 & 0 & 1 \\ 1 & 0 & 1 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} x_1 \\ x_2 \\ x_3 \end{pmatrix} = \vec{0} \Rightarrow V^2 = \langle \begin{pmatrix} 1 \\ 0 \\ 1 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 0 \\ 1 \\ 0 \end{pmatrix} \rangle$

$(\lambda_2 E - A)\vec{x} = \begin{pmatrix} 1 & 0 & 0 \\ 1 & 1 & 1 \\ 1 & 0 & 0 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} x_1 \\ x_2 \\ x_3 \end{pmatrix} = \vec{0} \Rightarrow V^1 = \langle \begin{pmatrix} 0 \\ 1 \\ 1 \end{pmatrix} \rangle$

$\therefore \mathbb{R}^3 = V^2 \oplus V^1 \therefore A$ 可对角化.

令 $P = \begin{pmatrix} 1 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & 1 \\ 1 & 0 & 1 \end{pmatrix}$, 则 $P^{-1}AP = \begin{pmatrix} 2 & & \\ & 2 & \\ & & 1 \end{pmatrix} \triangleq \Lambda \therefore A^k = P \Lambda^k P^{-1} = \begin{pmatrix} 2^k & 0 & 0 \\ 2^k & 2^k & 1 \cdot 2^k \\ 2^k & 0 & 1 \end{pmatrix}$

2. 设 $A = \begin{pmatrix} a_0 & a_1 & \dots & a_{n-1} \\ a_{n-1} & a_0 & \dots & a_{n-2} \\ \vdots & \vdots & \ddots & \vdots \\ a_1 & a_2 & \dots & a_0 \end{pmatrix}$ 其中 $a_0, \dots, a_{n-1} \in \mathbb{C}$. 证明

(i). A 在 \mathbb{C} 上可对角化

(ii). $\forall B \in M_n(\mathbb{C})$ 可对角化, 则 \exists 形如 A 的矩阵

Pf: (i). 由上节习题课结论. A 有 n 个线性无关的特征向量 $\vec{v}_k = \begin{pmatrix} 1 \\ \varepsilon_k \\ \vdots \\ \varepsilon_k^{n-1} \end{pmatrix}$, $\varepsilon_k = e^{\frac{2\pi i k}{n}}$, $k=0, 1, \dots, n-1$. 相似于 B .

于是 A 可对角化. 令 $V = (\vec{v}_0, \vec{v}_1, \dots, \vec{v}_{n-1})$, 则 $V^{-1}AV = \begin{pmatrix} \lambda_0 & & \\ & \lambda_1 & \\ & & \ddots \\ & & & \lambda_{n-1} \end{pmatrix}$

其中 $\lambda_k = \sum_{j=0}^{n-1} a_j \varepsilon_k^j$, $k=0, 1, \dots, n-1$.

(ii). $\forall B \in M_n(\mathbb{C})$ 若可对角化, 则 $\exists P \in GL_n(\mathbb{C})$, s.t. $P^{-1}BP = \begin{pmatrix} b_0 & & \\ & b_1 & \\ & & \ddots \\ & & & b_{n-1} \end{pmatrix}$

其中 $b_i \in \mathbb{C}$. ($i=0, \dots, n-1$)

若可对角化, 则对角矩阵唯一. 考虑排序时 别与合同混. $\therefore \exists P \in GL_n(\mathbb{C})$, s.t. $A = P^{-1} \Lambda P$.

$\xi_k = e^{\frac{2\pi k}{n}i}$ (n 次单位根), (以 a_0, a_1, \dots, a_{n-1} 为变量求解线性方程组)

设 $\sum_{j=0}^{n-1} a_j \xi_k^j = b_k, k=0, 1, \dots, n-1$ 即 $(a_0, \dots, a_{n-1})V = (b_0, \dots, b_{n-1})$.

$\therefore V$ 可逆, \therefore 可求得 $(a_0, \dots, a_{n-1}) = (b_0, \dots, b_{n-1})V^{-1}$ 由 a_0, \dots, a_{n-1} 构造得到 A .

则由 (1) 知 $A \sim_S \Lambda \sim_S B$ □

3. 证明: $\forall A, B \in M_n(K)$. 则 AB 与 BA 的特征多项式相同. 举例: 极小多项式不同.

Pf: 由命题 7.8 若 A, B 中有一个矩阵非退化, 则 $AB \sim_S BA \Rightarrow \chi_{AB} = \chi_{BA}$.

(3.1) ($C \sim_S D \Leftrightarrow \exists P \in GL_n(K)$, s.t. $P^{-1}CP = D \Rightarrow |\lambda E - C| = |\lambda E - PDP^{-1}| = |P(\lambda E - D)P^{-1}| = |\lambda E - D|$).

若 A, B 均退化. 设 $\tilde{B} = sE + B$ (s 是未定元).

则 $|\tilde{B}| = |sE + B| = s^n + \dots \in K[s]$ 非零 $\therefore \tilde{B} \in M_n(K(s))$ 可逆.

则 $A\tilde{B} \sim_S \tilde{B}A \Rightarrow |\lambda E - A\tilde{B}| = |\lambda E - \tilde{B}A|$ 特征多项式相同

设 $f(s) = |\lambda E - sA - AB| = |\lambda E - sA - BA|$. 是关于 s 的多项式.

$\therefore f(0) = |\lambda E - AB| = |\lambda E - BA|$. (赋值同态)

(3.2). (证 $\chi_{AB} = \chi_{BA}$, 即证 $|\lambda E - AB| = |\lambda E - BA|$).

$$\begin{pmatrix} E_n & 0 \\ -A & E_n \end{pmatrix} \begin{pmatrix} \lambda E_n & B \\ \lambda A & \lambda E_n \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} \lambda E_n & B \\ 0 & \lambda E_n - AB \end{pmatrix} \quad (1)$$

$$\begin{pmatrix} \lambda E_n & B \\ \lambda A & \lambda E_n \end{pmatrix} \begin{pmatrix} E_n & 0 \\ -A & E_n \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} \lambda E_n - BA & B \\ 0 & \lambda E_n \end{pmatrix} \quad (2)$$

$$\det(1) = \det(2) \Rightarrow \lambda^n \cdot |\lambda E_n - AB| = \lambda^n \cdot |\lambda E_n - BA|.$$

$$\lambda \text{ 是变元不为 } 0. \Rightarrow |\lambda E_n - AB| = |\lambda E_n - BA| \Rightarrow \chi_{AB} = \chi_{BA}. \quad \square$$

eg: $A = \begin{pmatrix} 1 & 0 \\ 0 & 0 \end{pmatrix}, B = \begin{pmatrix} 0 & 1 \\ 0 & 0 \end{pmatrix}$ $AB = \begin{pmatrix} 0 & 1 \\ 0 & 0 \end{pmatrix}, BA = \begin{pmatrix} 0 & 0 \\ 0 & 0 \end{pmatrix}$.

$$\text{则 } \mu_{AB} = t^2, \mu_{BA} = t. \quad \mu_{AB} \neq \mu_{BA}$$

$$\text{但 } \chi_{AB} = t^2 = \chi_{BA}.$$

(薛 P65. T14). 幂等方阵 ($A^2=A$) 相似于对角阵 $\begin{pmatrix} E_r & \\ & 0 \end{pmatrix}$, 其中 $r = \text{rank}(A)$. 3

特别地, 若 $\text{char}(F) = 0$, 则 $\text{rank}(A) = \text{tr}(A)$.

Pf: 令 $f(t) = t^2 - t = t(t-1) \in F[t]$ ~~则~~ $\text{gcd}(t, t-1) = 1$.

设 $\mathcal{A}: F^n \rightarrow F^n$, $\vec{x} \mapsto A\vec{x}$ 则 $\mathcal{A} \in \mathcal{L}(F^n)$, 且 $\mathcal{A}^2 = \mathcal{A}$. 即 $f(\mathcal{A}) = 0$.

由核核分解定理, $F^n = \ker(\mathcal{A} - \mathcal{E}) \oplus \ker(\mathcal{A})$.

设 $\vec{\varepsilon}_1, \dots, \vec{\varepsilon}_m$ 为 $\ker(\mathcal{A} - \mathcal{E})$ 的一组基, $\vec{\varepsilon}_{m+1}, \dots, \vec{\varepsilon}_n$ 为 $\ker(\mathcal{A})$ 的一组基.

则 $\vec{\varepsilon}_1, \dots, \vec{\varepsilon}_n$ 构成 F^n 的一组基.

满足 $\mathcal{A}(\vec{\varepsilon}_i) = \vec{\varepsilon}_i, i=1, \dots, m; \mathcal{A}(\vec{\varepsilon}_i) = \vec{0}, i=m+1, \dots, n$.

则令 $V = (\vec{\varepsilon}_1, \dots, \vec{\varepsilon}_n)$. 有 $V^{-1}AV = \begin{pmatrix} E_r & 0 \\ 0 & 0 \end{pmatrix}$ 即 $A \sim_s \begin{pmatrix} E_r & \\ & 0 \end{pmatrix}$

又 $\because \text{tr}$ 是相似不变量. $\therefore \text{tr}(A) = \text{tr} \begin{pmatrix} E_r & \\ & 0 \end{pmatrix} = r = \text{rank}(A)$ \square .

Rmk. $A^2=A \iff A \sim_s \begin{pmatrix} E_r & \\ & 0 \end{pmatrix}$, 其中 $r = \text{rank}(A)$.

4. 证明: 设 $A \in \mathcal{L}(V)$. 证明: $A^2=A \iff \text{rank } A + \text{rank}(\mathcal{E}-A) = n (= \dim V)$

Pf: " \implies " 设 $f(t) = t^2 - t = t(t-1) \in F[t]$ ~~则~~ $\text{gcd}(t, t-1) = 1, f(\mathcal{A}) = 0$.

由核核分解定理, $V = \ker A \oplus \ker(\mathcal{E}-A)$.

$\therefore n = \dim V = \dim \ker A + \dim \ker(\mathcal{E}-A) = n - \dim \text{im } A + n - \dim \text{im}(\mathcal{E}-A)$

即 $n = \text{rank } A + \text{rank}(\mathcal{E}-A)$.

" \impliedby " (另). 由 $n = \text{rank } A + \text{rank}(\mathcal{E}-A)$ 知 $n = \dim \ker A + \dim \ker(\mathcal{E}-A)$.

转为 ker. 下证 $V = \ker A \oplus \ker(\mathcal{E}-A)$. 只需证 $\ker A \cap \ker(\mathcal{E}-A) = \{\vec{0}\}$.

直和不叠并的关系. 的角度易证. $\forall \vec{x} \in \ker A \cap \ker(\mathcal{E}-A)$. 则 $A\vec{x} = \vec{0}, (\mathcal{E}-A)\vec{x} = \vec{x} - A\vec{x} = \vec{0}$

$\therefore \vec{x} = A\vec{x} = \vec{0} \quad \therefore \ker A \cap \ker(\mathcal{E}-A) = \{\vec{0}\} \quad \therefore V = \ker A \oplus \ker(\mathcal{E}-A)$

再证 $A^2=A$. $\forall \vec{x} \in V$. $\exists \vec{y} \in \ker A, \vec{z} \in \ker(\mathcal{E}-A)$, s.t. $\vec{x} = \vec{y} + \vec{z}$

则 $A\vec{x} = A\vec{y} + A\vec{z} = \vec{0} + \vec{z}$, $A^2(\vec{x}) = A^2(\vec{y}) + A^2(\vec{z}) = A(A\vec{y}) + A(A\vec{z})$

$\therefore A^2\vec{x} = A\vec{x}, \quad \therefore A^2=A \quad \square$

(3.2). 类似得到 $V = \ker(A) \oplus \ker(\Sigma - A)$.

设 $\vec{u}_1, \dots, \vec{u}_m$ 为 $\ker(\Sigma - A)$ 的基, $\vec{u}_{m+1}, \dots, \vec{u}_n$ 为 $\ker A$ 的基.

则 A 在 $\vec{u}_1, \dots, \vec{u}_n$ 下矩阵为 $\begin{pmatrix} E_r & 0 \\ & 0 \end{pmatrix}$. 由上题知, A 对应的矩阵幂等

$\therefore A^2 = A$. □

$A \in \mathcal{L}(V)$, $\vec{v} \in V \setminus \{\vec{0}\}$.

回忆: Prop 7.2. (1). $M_{A, \vec{v}}$ 存在且唯一-

(2). 若 $p(t)$ 是关于 A, \vec{v} 的零化多项式, 则 $M_{A, \vec{v}} \mid p$.

(3). $\dim(F[A]\vec{v}) = \deg M_{A, \vec{v}} \iff \vec{v}, A\vec{v}, \dots, A^{d-1}\vec{v}$ 是 $F[A]\vec{v}$ 的一组基.

Thm 8.2. 设 $A \in \mathcal{L}(V)$. $M_A = p_1^{m_1} \cdots p_k^{m_k}$ 是 M_A 在 $F[t]$ 中的不可约分解.

其中 $p_1, \dots, p_k \in F[t] \setminus F$ 不可约, 首一, 两两互素, $m_1, \dots, m_k \in \mathbb{Z}^+$. 则有

(1). $V = V(p_1) \oplus \dots \oplus V(p_k)$, 其中 $V(p_i) = \ker(p_i^{m_i}(A))$, $i=1, \dots, k$.

(2). $p_i^{m_i}$ 是 $A|_{V(p_i)}$ 的极小多项式, $i=1, \dots, k$.

(3). $p_i(A)$ 在 $V(p_1) \oplus \dots \oplus V(p_{i-1}) \oplus V(p_{i+1}) \oplus \dots \oplus V(p_k)$ 上的限制是双射. 证: \dots

lemma 8.2. 设 $A \in \mathcal{L}(V)$. U 是 A -子空间, $p \in F[t]$. 则 U 也是 $p(A)$ -子空间.

eg. 设 $A \in \mathcal{L}(V)$, $\vec{v} \in V \setminus \{\vec{0}\}$. 则

- (i). $M_{A, \vec{v}}(t) \mid M_A(t)$
- (ii). $\exists \vec{w} \in V$, st. $M_{A, \vec{w}} = M_A$.

pf: (i). $\because M_A(A) = 0. \therefore M_A(A)(\vec{v}) = \vec{0}$

$\therefore M_A$ 是关于 A 和 \vec{v} 的零化多项式, 由 Prop 7.2 (2).

$M_{A, \vec{v}} \mid M_A$.

(ii). Case 1. 设 $M_A = p^m$, 其中 $p \in F[t] \setminus F$ 首一, 不可约, $m > 0$.

反证, $\forall \vec{v} \in V$, $\deg(M_{A, \vec{v}}) < \deg(M_A)$.

则由 (i) 知, $M_{A, \vec{v}} \mid p^{m-1}$, 于是 $p^{m-1}(A)(\vec{v}) = \vec{0}$. 对 $\forall \vec{v}$ 成立

$\therefore p^{m-1}(A) = 0 \quad \therefore M_A = p^m \mid p^{m-1} \quad (\rightarrow \leftarrow)$.

再考虑一般情形.

Case 2. 设 $M_A = p_1^{m_1} \cdots p_k^{m_k}$ 其中 $p_1, \dots, p_k \in F[x] \setminus F$ 首一, 不可约, 两两互素. \checkmark

由 Thm 8.2 (i), $V = V(p_1) \oplus \cdots \oplus V(p_k)$, 其中 $V(p_i) = \ker(p_i^{m_i}(A))$, $i=1, \dots, k$.

由直和分解到局部再构造整体. 设 $A_i = A|_{V(p_i)}$, $i=1, \dots, k$. (即 $V(p_i)$ 是 A_i -子空间, $A_i \in \mathcal{L}(V(p_i))$.) 由 Thm 8.2 (ii), $p_i^{m_i} = \mu_{A_i}$.

由 Case 1 知, $\exists \bar{w}_i \in V(p_i)$, s.t. $\mu_{A_i} \bar{w}_i = \mu_{A_i} = p_i^{m_i}$, $i=1, \dots, k$.

令 $\bar{w} = \bar{w}_1 + \cdots + \bar{w}_k \in V(p_1) \oplus \cdots \oplus V(p_k)$.

$$\begin{aligned} \text{则 } \bar{0} &= \mu_{A, \bar{w}}(A)(\bar{w}) = \mu_{A, \bar{w}}(A)(\bar{w}_1) + \cdots + \mu_{A, \bar{w}}(A)(\bar{w}_k) \\ &= \mu_{A, \bar{w}}(A_1)(\bar{w}_1) + \cdots + \mu_{A, \bar{w}}(A_k)(\bar{w}_k) \end{aligned}$$

因 $V(p_i)$ 是 A_i -子空间 (由 Lemma 8.2),

$\therefore V(p_i)$ 是 $\mu_{A, \bar{w}}(A_i)$ -子空间, $\therefore \mu_{A, \bar{w}}(A_i)(\bar{w}_i) \in V(p_i)$.

由直和可知, $\mu_{A, \bar{w}}(A_i)(\bar{w}_i) = \bar{0} \quad \therefore \mu_{A_i, \bar{w}_i} \mid \mu_{A, \bar{w}}, i=1, \dots, k.$

$$\therefore \text{lcm}(p_1^{m_1}, \dots, p_k^{m_k}) \mid \mu_{A, \bar{w}} \quad \text{即 } \mu_A = p_1^{m_1} \cdots p_k^{m_k} \mid \mu_{A, \bar{w}}$$

$$\text{又 } \mu_{A, \bar{w}} \mid \mu_A \quad \therefore \mu_{A, \bar{w}} = \mu_A \quad \square$$

不变子空间与特征向量.

设 V 是 F 上 n 维线性空间. $\mathcal{L}(V)$ 为算子空间 (n^2 维) — F -代数.

Def: 不变子空间.

设 $\varphi \in \mathcal{L}(V)$, $U \subseteq V$ 为子空间. 若 $\varphi(U) \subseteq U$ 则称 U 为 φ -不变子空间.

记 $\varphi|_U: U \rightarrow U$ 为 φ 在 U 上的限制 (线性算子)
 $u \mapsto \varphi(u)$

eg. $V = F[x]$ $\ker(f(\varphi))$ 和 $\text{im}(f(\varphi))$ 都是 φ -子空间.

设 $\psi \in \mathcal{L}(V)$ 若 $\varphi \circ \psi = \psi \circ \varphi$ 则 $\ker \psi$ 和 $\text{im} \psi$ 都是 φ -子空间.

矩阵表示: 设 $\varphi \in \mathcal{L}(V)$. U 为 φ -子空间 设 $U = \langle \vec{e}_1, \dots, \vec{e}_m \rangle$ 为基底

且可扩充为 V 的一组基底 $\langle \vec{e}_1, \dots, \vec{e}_n, \vec{e}_{m+1}, \dots, \vec{e}_n \rangle$ 则

φ 在基 $\vec{e}_1, \dots, \vec{e}_n$ 下的矩阵为 $\begin{pmatrix} A_1 & A_3 \\ 0 & A_2 \end{pmatrix}$ 其中 A_1 为 $\varphi|_U$ 在 $\vec{e}_1, \dots, \vec{e}_m$ 下矩阵.

若 $W = \langle \vec{e}_{m+1}, \dots, \vec{e}_n \rangle$ 也是 φ -子空间 则 φ 在基 $\vec{e}_1, \dots, \vec{e}_n$ 下矩阵

为 $\begin{pmatrix} A_1 & 0 \\ 0 & A_2 \end{pmatrix}$ 其中 $\varphi|_W$ 在 $\vec{e}_{m+1}, \dots, \vec{e}_n$ 下矩阵为 A_2 此时 $V = U \oplus W$.

Thm 1 (1) 设 $\varphi \in \mathcal{L}(V)$. φ 在某组基下的矩阵为 $\begin{pmatrix} A_1 & & \\ & A_2 & \\ & & \dots \\ & & & A_m \end{pmatrix}$

$\Leftrightarrow V = W_1 \oplus W_2 \oplus \dots \oplus W_m$, 其中 W_i 为 φ -子空间.

特别地. $\varphi|_{W_i}$ 在对应基下的矩阵为 A_i ($i=1, 2, \dots, m$)

(2) 若 $V = \bigoplus_{i=1}^m W_i$, 其中 W_i 为 φ -子空间 则 $\mu_\varphi = \text{lcm}(\mu_{\varphi|_{W_1}}, \dots, \mu_{\varphi|_{W_m}})$

Def 2 特征向量, 特征值, 特征子空间, 特征多项式

设 $\varphi \in \mathcal{L}(V)$ 若 $\exists \vec{v} \in V \setminus \{\vec{0}\}$ st. $\vec{v} \perp \varphi(\vec{v})$ 线性相关

则 $\exists \lambda \in F$ st. $\varphi(\vec{v}) = \lambda \vec{v}$, 则称 \vec{v} 为 φ 的特征向量, λ 为对应特征值.

记 $V^\lambda := \{ \vec{v} \in V \mid \varphi(\vec{v}) = \lambda \vec{v} \}$ 为 φ 关于 λ 的特征子空间 (φ -子空间)

称 $\dim_F V^\lambda$ 为 φ 在特征值 λ 处 (关于 λ) 的几何重数.

注: \vec{v} 是 φ 的特征向量 $\iff \langle \vec{v} \rangle$ 是 φ -子空间.

设 φ 在某组基下的矩阵为 A 称 $\chi_\varphi = \chi_A := |tE_n - A| \in F[t]$

为特征多项式. (注: 特征多项式是 n 次首 1 多项式)

注: 设 φ 在另组基下矩阵为 B 则 $\exists P \in GL_n(F)$ st. $B = P^{-1}AP$

于是 $\chi_A = |tE_n - A| = |P^{-1} \cdot |tE_n - A| \cdot P| = |tE_n - B| = \chi_B$

Thm 2 $\lambda \in F$ 是 φ 的特征值 $\iff \lambda$ 是 χ_φ 的根

称 λ 在 χ_φ 中的重数为 φ 关于 λ 的代数重数.

★ $1 \leq$ 几何重数 \leq 代数重数 (对任意特征值成立).

Def 3 可对角化

设 $\varphi \in \mathcal{L}(V)$ 若 φ 在某组基下的矩阵是对角阵 $\begin{pmatrix} \lambda_1 & & \\ & \dots & \\ & & \lambda_n \end{pmatrix}$ 则称 φ 可对角化.

Thm 3 φ 可对角化 $\iff \varphi$ 的特征向量构成 V 的一组基

$\iff \varphi$ 有 n 个线性无关的特征向量

$\iff \chi_\varphi$ 的根 $\in F$ 且几何重数 = 代数重数

$\iff V = \bigoplus_{i=1}^n V^{\lambda_i}$

$\iff \mu_\varphi$ 的根两两不同.

Thm 4 (Cayley-Hamilton) $\mu_\varphi \mid \chi_\varphi$ 且 $\text{sgtr}(\chi_\varphi) \mid \mu_\varphi$