

关于算子可对角化的基本结论

设  $\dim_F V = n$ ,  $A \in L(V)$

特征向量版 (定理 5.3 (i)  $\Leftrightarrow$  (ii))

$A$  可对角化  $\Leftrightarrow A$  有  $n$  个线性无关的特征向量

特征子空间版 (定理 5.3 (i)  $\Leftrightarrow$  (iii))

$A$  可对角化  $\Leftrightarrow V$  是特征子空间的直和

特征值版 (定理 5.4)

$A$  可对角化  $\Leftrightarrow$  (i)  $\chi_A(t)$  在  $F$  上分解为一次因子之积  
(ii)  $\forall \lambda \in \text{spec}_F(A)$   
 $\lambda$  的几何重数 =  $\lambda$  的代数重数.

设  $A$  可对角化.

$\vec{v}_1, \dots, \vec{v}_n$  是  $A$  的  $n$  个线性无关的特征向量. 则  $A(\vec{v}_i) = \alpha_i \vec{v}_i, i=1, 2, \dots, n$

$A$  在  $\vec{v}_1, \dots, \vec{v}_n$  下的矩阵是

$$\begin{pmatrix} \alpha_1 & & \\ & \ddots & \\ & & \alpha_n \end{pmatrix}$$

~~证明~~ 其中  $\alpha_1, \dots, \alpha_n \in \text{spec}_F(A)$ , 不一定为  $\mathbb{R}$  或  $\mathbb{C}$  ①

例: 设  $A: \mathbb{R}^3 \rightarrow \mathbb{R}^3$  由下列关系确定.

$$(A(\vec{e}_1), A(\vec{e}_2), A(\vec{e}_3)) = (\vec{e}_1, \vec{e}_2, \vec{e}_3) \underbrace{\begin{pmatrix} 2 & 1 & 1 \\ 1 & 2 & 1 \\ 1 & 1 & 2 \end{pmatrix}}_A$$

其中  $\vec{e}_1, \vec{e}_2, \vec{e}_3$  是标准基.

问:  $A$  是否可以对角化? 如果是  
求  $V$  的一组基使得  $A$  在该基下的矩阵  
是对角的

解: 直接计算得:  $\chi_A(t) = (t-4)(t-1)^2$

$$\text{spec}_{\mathbb{R}}(F) = \left\{ \begin{matrix} 4, & 1 \\ \lambda_1 & \lambda_2 \end{matrix} \right\}$$

$$\dim(V^{\lambda_1}) = 1 \quad [\because \lambda_1 \text{ 的代数重数是 } 1]$$

$$\dim(V^{\lambda_2}) \leq 2 \quad [\because \lambda_2 \text{ 的代数重数是 } 2]$$

求  $V^{\lambda_1}$  的一组基

$$(4E - A) \begin{pmatrix} x_1 \\ x_2 \\ x_3 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 0 \\ 0 \\ 0 \end{pmatrix}$$

$$\begin{pmatrix} 2 & -1 & -1 \\ -1 & 2 & -1 \\ -1 & -1 & 2 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} x_1 \\ x_2 \\ x_3 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 0 \\ 0 \\ 0 \end{pmatrix}$$

$$V^{\lambda_1} = \left\langle \underbrace{\begin{pmatrix} 1 \\ 1 \\ 1 \end{pmatrix}}_{\vec{v}_1} \right\rangle$$

求  $V^{\lambda_2}$  的一组基

$$(E - A) \begin{pmatrix} x_1 \\ x_2 \\ x_3 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 0 \\ 0 \\ 0 \end{pmatrix}$$

$$\begin{pmatrix} -1 & -1 & -1 \\ -1 & -1 & -1 \\ -1 & -1 & -1 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} x_1 \\ x_2 \\ x_3 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 0 \\ 0 \\ 0 \end{pmatrix}$$

$$\Rightarrow \dim V^{\lambda_2} = 2. \Rightarrow \mathbb{R}^3 = V^{\lambda_1} \oplus V^{\lambda_2} \Rightarrow \text{可约化}$$

$$V^{\lambda_2} = \left\langle \underbrace{\begin{pmatrix} 1 \\ -1 \\ 0 \end{pmatrix}}_{\vec{v}_2}, \underbrace{\begin{pmatrix} 0 \\ 1 \\ -1 \end{pmatrix}}_{\vec{v}_3} \right\rangle$$

在  $\vec{v}_1, \vec{v}_2, \vec{v}_3$  下

$$(A(\vec{v}_1), A(\vec{v}_2), A(\vec{v}_3)) = (4\vec{v}_1, \vec{v}_2, \vec{v}_3) \quad (2)$$

$$= (\vec{v}_1, \vec{v}_2, \vec{v}_3) \underbrace{\begin{pmatrix} 4 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 1 \end{pmatrix}}_B$$

一般而言:

设  $\lambda_1, \dots, \lambda_m$  是  $A$  在  $F$  中的互异特征根  
它们的代数重数分别是  $d_1, \dots, d_m$   
 $\vec{v}_{1,1}, \dots, \vec{v}_{1,d_1}$  是  $V^{\lambda_1}$  中线性无关的特征向量

$\vec{v}_{m,1}, \dots, \vec{v}_{m,d_m}$  是  $V^{\lambda_m}$  中  $\dots$

由定理 5.1  $V^{\lambda_1} + \dots + V^{\lambda_m} = \mathbb{R}^n$

于是  $\vec{v}_{1,1}, \dots, \vec{v}_{1,d_1}, \dots, \vec{v}_{m,1}, \dots, \vec{v}_{m,d_m}$

线性无关. 再设

$\vec{v}_{1,1}, \dots, \vec{v}_{1,d_1}, \dots, \vec{v}_{m,1}, \dots, \vec{v}_{m,d_m}, \vec{e}_{d_1+1}, \dots, \vec{e}_n$

是  $V$  的基, 其中  $d = d_1 + \dots + d_m$

则  $A$  在上述基底下的矩阵是

$$\begin{pmatrix} \lambda_1 E_{d_1} & & \\ & \ddots & \\ & & \lambda_m E_{d_m} \end{pmatrix}$$

无法确定

$n \times n$

而当  $d=m$  时, 矩阵是

$$\begin{pmatrix} \lambda_1 E_{d_1} & & \\ & \circ & \\ & & \ddots & \\ & & & \lambda_m E_{d_m} \end{pmatrix}$$

此时  $\chi_A(t) = (t - \lambda_1)^{d_1} \cdots (t - \lambda_m)^{d_m}$

$\lambda_i$  的代数重数也是  $d_i$ ,  $i=1, \dots, m$ .

例: 设  $\mathbb{A}: \mathbb{R}[x] \longrightarrow \mathbb{R}[x]$   
 $p(x) \longmapsto p'(x)$

~~$\mathbb{A} = \chi, \chi_2 = \chi^2$~~   $e_1=1, e_2=x, \dots, e_n=x^{n-1}$  ③

① 在上述基底下的矩阵是

$$A = \begin{pmatrix} 0 & 1 & 0 & \cdots & 0 \\ 0 & 0 & 2 & \cdots & 0 \\ \vdots & \vdots & \vdots & \ddots & \vdots \\ 0 & 0 & 0 & \cdots & 0 \end{pmatrix}$$

$\chi_{\mathbb{A}}(t) = t^n$       $\text{spec}_F(\mathbb{A}) = \{0\}$

$V^{\lambda} = \{e_i\} = \langle 1 \rangle \Rightarrow A$  不可对角化

$$A = \begin{pmatrix} 0 \cdot E_1 & \begin{matrix} 1 & 0 & 0 & \cdots & 0 \\ 0 & 2 & 0 & \cdots & 0 \\ & & \ddots & & \\ 0 & \cdots & 0 & n-1 & \\ 0 & \cdots & 0 & 0 & 0 \end{matrix} \end{pmatrix}$$

~~推论 8.1.2~~

定义: 设  $A \in M_n(F)$ . 如果  $A$  相似于一个对角矩阵, 则称  $A$  可对角化

定理 5.5 (关于可对角化的矩阵版)

设  $A \in M_n(F)$ . 则下列断言等价

- (i)  $A$  可对角化
- (ii)  $A$  有  $n$  个线性无关的特征向量
- (iii)  $A$  的特征子空间之和是  $F^n$
- (iv)  $\chi_A(t)$  在  $F$  中分解为一次因式之积  
且  $\forall \lambda \in \text{spec } F(A)$ ,  
 $\lambda$  的几何重数与代数重数相同.

证: 设  $A: F^n \rightarrow F^n$   

$$\begin{pmatrix} x_1 \\ \vdots \\ x_n \end{pmatrix} \mapsto A \begin{pmatrix} x_1 \\ \vdots \\ x_n \end{pmatrix}$$

则  $A$  可对角化  $\Leftrightarrow A$  可对角化  
 再利用定理 5.3 和 5.4 即可.

证: 设  $A \in M_n(F)$  可对角化  
 $\vec{v}_1, \dots, \vec{v}_n$  是  $A$  的  $n$  个线性  
 无关向量. 令  $P = (\vec{v}_1, \dots, \vec{v}_n)$

则  $P^{-1}AP$  是对角矩阵

验证: 因为基  $\vec{v}_1, \dots, \vec{v}_n$  下  $A$  的矩阵  
 是对角阵. 所以, 由线性映射在基  
 变换下的矩阵关系可知

$P^{-1}AP$  是对角阵 (见本章定理 2.1)

我们也可以直接验证如下.

故  $A\vec{v}_i = \lambda_i \vec{v}_i, \quad i=1, 2, \dots, n$

$$\begin{aligned} P^{-1}AP &= P^{-1}A(\vec{v}_1, \dots, \vec{v}_n) \\ &= P^{-1}(A\vec{v}_1, \dots, A\vec{v}_n) \\ &= P^{-1}(\lambda_1 \vec{v}_1, \dots, \lambda_n \vec{v}_n) \\ &= P^{-1}(\underbrace{\vec{v}_1, \dots, \vec{v}_n}_P) \begin{pmatrix} \lambda_1 & & 0 \\ & \ddots & \\ 0 & & \lambda_n \end{pmatrix} \\ &= \begin{pmatrix} \lambda_1 & & 0 \\ & \ddots & \\ 0 & & \lambda_n \end{pmatrix} \end{aligned}$$

推论 5.1 设  $A \in \mathcal{L}(V)$ ,  $A \in M_n(F)$

(i) 如果  $\chi_A(t)$  的根都在  $F$  中且无重根

则  $A$  可对角化

(ii) 同样的结论适合矩阵  $A$   
 证: 此时代数重数  $d_i$  必为 1 可数且

例 设  $A = \begin{pmatrix} 0 & 1 \\ 1 & 1 \end{pmatrix} \in M_2(\mathbb{R})$ , 计算  $A^m$

$$\chi_A(t) = |tE - A| = t^2 - t - 1$$

$$\lambda_1 = \frac{1+\sqrt{5}}{2}, \lambda_2 = \frac{1-\sqrt{5}}{2}$$

两个互异的实根. 于是  $A$  可对角化

$$(\lambda_1 E - A) \begin{pmatrix} x_1 \\ x_2 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 0 \\ 0 \end{pmatrix} \Rightarrow V^{\lambda_1} = \left\langle \underbrace{\begin{pmatrix} 1 \\ \lambda_1 \end{pmatrix}}_{v_1} \right\rangle$$

$$\updownarrow$$

$$\begin{pmatrix} \lambda_1 & -1 \\ -1 & \lambda_1 - 1 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} x_1 \\ x_2 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 0 \\ 0 \end{pmatrix}$$

同理  $V^{\lambda_2} = \left\langle \begin{pmatrix} 1 \\ \lambda_2 \end{pmatrix} \right\rangle$

设  $P = \begin{pmatrix} 1 & 1 \\ \lambda_1 & \lambda_2 \end{pmatrix}$

则  $P^{-1}AP = \begin{pmatrix} \lambda_1 & 0 \\ 0 & \lambda_2 \end{pmatrix}$

$$\Rightarrow A = P \begin{pmatrix} \lambda_1 & 0 \\ 0 & \lambda_2 \end{pmatrix} P^{-1}$$

$$A^m = P \begin{pmatrix} \lambda_1^m & 0 \\ 0 & \lambda_2^m \end{pmatrix} P^{-1}$$

(5)

计算  $P^{-1}$

$$\begin{pmatrix} 1 & 1 & | & 0 & 1 \\ \lambda_1 & \lambda_2 & | & 0 & 1 \end{pmatrix} \rightarrow \begin{pmatrix} 1 & 1 & | & 1 & 0 \\ 0 & \lambda_2 - \lambda_1 & | & -\lambda_1 & 1 \end{pmatrix}$$

$$\rightarrow \begin{pmatrix} 1 & 1 & | & 1 & 0 \\ 0 & 1 & | & \frac{-\lambda_1}{\lambda_2 - \lambda_1} & \frac{1}{\lambda_2 - \lambda_1} \end{pmatrix}$$

$$\rightarrow \begin{pmatrix} 1 & 0 & | & \frac{\lambda_1}{\lambda_2 - \lambda_1} & \frac{-1}{\lambda_2 - \lambda_1} \\ 0 & 1 & | & \frac{-\lambda_1}{\lambda_2 - \lambda_1} & \frac{1}{\lambda_2 - \lambda_1} \end{pmatrix}$$

$$P^{-1} = \begin{pmatrix} \frac{\lambda_1}{\lambda_2 - \lambda_1} & \frac{-1}{\lambda_2 - \lambda_1} \\ \frac{-\lambda_1}{\lambda_2 - \lambda_1} & \frac{1}{\lambda_2 - \lambda_1} \end{pmatrix}$$

设  $f_0 = 0, f_1 = 1, f_2 = 1, f_m = f_{m-1} + f_{m-2} (m \geq 2)$

$$A = \begin{pmatrix} f_0 & f_1 \\ f_1 & f_2 \end{pmatrix}$$

$$A^m = \begin{pmatrix} f_{m-1} & f_m \\ f_m & f_{m+1} \end{pmatrix}$$

此即递推关系

$$A^m = A^{m-1}A = \begin{pmatrix} f_{m-2} & f_{m-1} \\ f_{m-1} & f_m \end{pmatrix} \begin{pmatrix} 0 & 1 \\ 1 & 1 \end{pmatrix}$$

$$= \begin{pmatrix} f_{m-1} & f_{m-2}+f_{m-1} \\ f_m & f_{m-1}+f_m \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} f_{m-1} & f_m \\ f_m & f_{m+1} \end{pmatrix}$$

此即递推关系

⇒ 由

$$A^m = \begin{pmatrix} 1 & 1 \\ \lambda_1 & \lambda_2 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} \lambda_1^m & 0 \\ 0 & \lambda_2^m \end{pmatrix} \begin{pmatrix} \frac{\lambda_2}{\lambda_2-\lambda_1} & \frac{-1}{\lambda_2-\lambda_1} \\ \frac{-\lambda_1}{\lambda_2-\lambda_1} & \frac{1}{\lambda_2-\lambda_1} \end{pmatrix}$$

$$= \begin{pmatrix} \lambda_1^m & \lambda_2^m \\ \lambda_1^{m+1} & \lambda_2^{m+1} \end{pmatrix} \begin{pmatrix} \frac{\lambda_2}{\lambda_2-\lambda_1} & \frac{-1}{\lambda_2-\lambda_1} \\ \frac{-\lambda_1}{\lambda_2-\lambda_1} & \frac{1}{\lambda_2-\lambda_1} \end{pmatrix}$$

得此

$$f_m = \frac{-\lambda_1^m}{\lambda_2-\lambda_1} + \frac{\lambda_2^m}{\lambda_2-\lambda_1}$$

$$= \frac{\lambda_2^m - \lambda_1^m}{\lambda_2 - \lambda_1} = \frac{1}{\sqrt{5}} \left( \left( \frac{1+\sqrt{5}}{2} \right)^m - \left( \frac{1-\sqrt{5}}{2} \right)^m \right)$$

$$\sim \frac{1}{\sqrt{5}} \left( \frac{1+\sqrt{5}}{2} \right)^m \quad (m \rightarrow \infty)$$

$$\frac{1}{\sqrt{5}} \left( \left( \frac{1+\sqrt{5}}{2} \right)^m - \left( \frac{1-\sqrt{5}}{2} \right)^m \right)$$

$\frac{1}{\sqrt{5}} \left( \frac{1+\sqrt{5}}{2} \right)^m \rightarrow$

$\sum_{m=0}^{\infty} f_m x^m$

$f_m = f_{m-1} + f_{m-2}$   
 $f_0 = 0, f_1 = 1$

Concrete Tetrahedron  
 Continuous discrete

例：设  $A \in L(V)$

证明： $\exists c \in F$  使得  $A = cE \Leftrightarrow V$  中的每个向量都是特征向量

证:  $\Rightarrow$  设  $\vec{v} \in V \setminus \{\vec{0}\}$

$$A(\vec{v}) = c\vec{v} \Rightarrow \vec{v} \text{ 是特征向量}$$

$\Leftarrow$  设  $\vec{u}, \vec{v} \in V \setminus \{\vec{0}\}$ , 线性无关  
 $A(\vec{u}) = \alpha\vec{u}, A(\vec{v}) = \beta\vec{v}, \alpha, \beta \in F$

~~假设  $\alpha \neq \beta$~~

$$A(\vec{u} + \vec{v}) = A(\vec{u}) + A(\vec{v}) = \alpha\vec{u} + \beta\vec{v}$$

另一方面  $\exists \lambda \in F$

$$A(\vec{u} + \vec{v}) = \lambda(\vec{u} + \vec{v})$$

$$\Rightarrow \lambda\vec{u} + \lambda\vec{v} = \alpha\vec{u} + \beta\vec{v}$$

$$\Rightarrow (\lambda - \alpha)\vec{u} + (\lambda - \beta)\vec{v} = \vec{0}$$

$$\text{由于 } \vec{u}, \vec{v} \Rightarrow \lambda = \alpha \text{ 且 } \lambda = \beta$$

设  $\vec{e}_1, \dots, \vec{e}_n$  是  $V$  的一组基

则  $\exists c \in F$

$$\text{使得 } A(\vec{e}_i) = c\vec{e}_i, i=1, 2, \dots, n$$

于是  $A$  在该基下的矩阵是  $cE$  (7)

$$\Rightarrow A = cE \quad \square$$

§6 商算子

引理 6.1 设  $A \in L(V)$ ,  $U$  是  $A$ -不变子空间

$$\text{定义: } \bar{A}: V/U \rightarrow V/U$$

$$\vec{v} + U \mapsto A(\vec{v}) + U$$

$$\text{则 } \bar{A} \in L(V/U).$$

证: 验证  $\bar{A}$  是良定义的

设  $\vec{v}_1, \vec{v}_2 \in V$  满足  $\vec{v}_1 + U = \vec{v}_2 + U$

$$\text{即 } \vec{v}_1 - \vec{v}_2 \in U$$

$$\text{则 } A(\vec{v}_1 - \vec{v}_2) \in U \quad [U \text{ 是 } A\text{-不变}]$$

$$\Rightarrow A(\vec{v}_1) - A(\vec{v}_2) \in U$$

$$\Rightarrow A(\vec{v}_1) + U = A(\vec{v}_2) + U$$

$$\Rightarrow \bar{A}(\vec{v}_1 + U) = \bar{A}(\vec{v}_2 + U)$$

$\bar{A}$  是良定义的.

再验证  $A$  是线性的

$$\forall \alpha_1, \alpha_2 \in F, \vec{v}_1 + U, \vec{v}_2 + U \in V/U$$

$$\overline{A}(\alpha_1(\vec{v}_1 + U) + \alpha_2(\vec{v}_2 + U))$$

$$= \overline{A}((\alpha_1 \vec{v}_1 + \alpha_2 \vec{v}_2) + U) \quad [\text{商空间定义}]$$

$$= \overline{A}(\alpha_1 \vec{v}_1 + \alpha_2 \vec{v}_2) + U \quad [\overline{A} \text{ 的定义}]$$

$$= [\alpha_1 A(\vec{v}_1) + \alpha_2 A(\vec{v}_2)] + U \quad [A \text{ 线性}]$$

$$= \alpha_1(A(\vec{v}_1) + U) + \alpha_2(A(\vec{v}_2) + U) \quad [\text{商空间定义}]$$

$$= \alpha_1 \overline{A}(\vec{v}_1 + U) + \alpha_2 \overline{A}(\vec{v}_2 + U). \quad \square$$

称  $\overline{A}$  是关于  $A$  和  $U$  的商算子

定理 6.1 设  $A \in \mathcal{L}(V)$ ,  $U$  是  $A$ -不变子空间

$\vec{e}_1, \dots, \vec{e}_d$  是  $U$  的一组基,  $\vec{e}_1, \dots, \vec{e}_d, \vec{e}_{d+1}, \dots, \vec{e}_n$  是  $V$  的基

设  $A|_U$  在  $\vec{e}_1, \dots, \vec{e}_d$  下的矩阵是  $A_U$  ⑧

$\overline{A}$  在  $\vec{e}_{d+1} + U, \dots, \vec{e}_n + U$  上的矩阵

是  $B$ . 则

$A$  在  $\vec{e}_1, \dots, \vec{e}_d, \vec{e}_{d+1}, \dots, \vec{e}_n$  下的矩阵是

$$A = \begin{pmatrix} A_U & C \\ 0 & B \end{pmatrix}, \text{ 其中 } C \in \mathbb{F}^{d \times (n-d)}.$$

注:  $\vec{e}_{d+1} + U, \dots, \vec{e}_n + U$  是  $V/U$  的基  
证明见: 第一章定理 7.3

定理 6.1 的证明

$$(A(\vec{e}_1), \dots, A(\vec{e}_d)) = (A|_U(\vec{e}_1), \dots, A|_U(\vec{e}_d))$$

$$= (\vec{e}_1, \dots, \vec{e}_d) A_U \quad (*)$$

$$(\overline{A}(\vec{e}_{d+1} + U), \dots, \overline{A}(\vec{e}_n + U))$$

$$= (\vec{e}_{d+1} + U, \dots, \vec{e}_n + U) B \quad [B \text{ 的定义}]$$



由命题 3.1.  $A$  在  $\vec{e}_1, \dots, \vec{e}_d, \vec{e}_{d+1}, \dots, \vec{e}_n$  下的矩阵为

$$A = \begin{pmatrix} A_1 & A_2 \\ 0 & A_3 \end{pmatrix}$$

其中  $A_1 \in M_d(F)$ ,  $A_2 \in F^{d \times (n-d)}$ ,  $A_3 \in M_{n-d}(F)$

下面证:  $A_1 = AU$ ,  $A_3 = B$

由 (\*) 可知  $A_1 = AU$

$\forall j \in \{d+1, \dots, n\}$

$$\begin{aligned} A(\vec{e}_j) &= (\vec{e}_1, \dots, \vec{e}_d, \vec{e}_{d+1}, \dots, \vec{e}_n) \begin{pmatrix} \vec{A}^{(j)} \\ \vec{A}_2^{(j-d)} \\ \vec{A}_3^{(j-d)} \end{pmatrix} \\ &= (\vec{e}_1, \dots, \vec{e}_d, \vec{e}_{d+1}, \dots, \vec{e}_n) \begin{pmatrix} \vec{A}^{(j)} \\ \vec{A}_2^{(j-d)} \\ \vec{A}_3^{(j-d)} \end{pmatrix} \end{aligned}$$

$$= (\vec{e}_1, \dots, \vec{e}_d) \vec{A}_2^{(j-d)} + (\vec{e}_{d+1}, \dots, \vec{e}_n) \vec{A}_3^{(j-d)}$$

$\cap$   
 $U$

(\*\*\*)

$$\bar{A}(\vec{e}_j + U) = A(\vec{e}_j) + U \quad [\bar{A} \text{ 的定义}]$$

$$= (\vec{e}_{d+1}, \dots, \vec{e}_n) \vec{A}_3^{(j-d)} + U \quad [(\text{**})]$$

$$= (\vec{e}_{d+1} + U, \dots, \vec{e}_n + U) \vec{A}_3^{(j-d)} \quad [\forall U \text{ 的定义}]$$

$$\Rightarrow \bar{B} = \vec{A}_3^{(j-d)} \Rightarrow B = A_3$$

由 (\*)

~~命题 6.1 设  $A \in \mathcal{L}(V)$ ,  $U \subseteq V$  是  $A$  的不变子空间~~

~~设  $0 \subsetneq U \subsetneq V$~~

$$\chi_A(t) = \chi_{AU}(t) \chi_{\bar{A}}(t).$$

证: 由上述定理:

$A$  在  $V$  的基下的矩阵

$$\begin{pmatrix} A_1 & A_2 \\ 0 & A_3 \end{pmatrix}$$

其中  $A_1$  是  $A|_U$  的矩阵 (在  $M_d(F)$  中)  
 $A_3$  是  $\bar{A}$  的矩阵 (在  $M_{n-d}(F)$  中)

回忆: 定理 6.1

设  $A \in L(V)$ .  $U$  是  $A$ -不变子空间

设  $\vec{e}_1, \dots, \vec{e}_d$  是  $U$  的一组基,

~~再~~  $\vec{e}_1, \dots, \vec{e}_d, \vec{e}_{d+1}, \dots, \vec{e}_n$

是  $V$  的一组基.

设  $A_U$  是  $A|_U$  在  $\vec{e}_1, \dots, \vec{e}_d$  下的

矩阵.  $B$  是  $A$  在  $\vec{e}_{d+1}, \dots,$

$\vec{e}_n + U$  下的基. 则  $A$  在

$\vec{e}_1, \dots, \vec{e}_d, \vec{e}_{d+1}, \dots, \vec{e}_n$

下的矩阵是

$$A = \begin{pmatrix} A_U & C \\ 0 & B \end{pmatrix}, \text{ 其中 } C \in F^{d \times (n-d)}$$

(席南华, 基础代数 p67. 第 9 页)

"显然,  $A_2$  是  $A$  在基  $(\vec{e}_i)$  下的矩阵"

推论 6.1 设  $V$  是  $\mathbb{C}$  上  $n$  维线性空间 (19)  
 $A \in L(V)$ . 则  $A$  在  $V$  的某组基下的矩阵是上三角形. 即

$$A = \begin{pmatrix} \text{triangle} \\ 0 \end{pmatrix}_{n \times n} \in M_n(\mathbb{C})$$

证: 对  $n$  归纳.

$n=1$ . 显然

设  $n-1$  时定理成立. 考虑  $\dim V = n > 1$

因为  $\chi_A(t) \in \mathbb{C}[t]$  且次数大于零

所以  $\exists \lambda \in \mathbb{C}$ , 使得  $\lambda \in \text{spec}_{\mathbb{C}}(A)$

(代数学基本定理)

设  $\vec{e}_1$  是  $\lambda$  对应的特征向量.

令  $U = \langle \vec{e}_1 \rangle$ . 则

$$A|_U: U \rightarrow U \\ \alpha \vec{e}_1 \mapsto \lambda(\alpha \vec{e}_1)$$

$U$  是  $A$ -子空间.

设  $\vec{e}_1, \vec{e}_2, \dots, \vec{e}_n$  是  $V$  的一组基

因为  $\dim V/\langle \vec{e}_1 \rangle = n-1$  且  $\bar{A} \in \mathcal{L}(V/\langle \vec{e}_1 \rangle)$

是商映射. 所以  $\exists V/\langle \vec{e}_1 \rangle$  中一组基

$$\vec{e}_2 + \langle \vec{e}_1 \rangle, \dots, \vec{e}_n + \langle \vec{e}_1 \rangle$$

使得  $\bar{A}$  在该基下的矩阵  $B \in M_{n-1}(F)$

是上三角形. 即

$$B = \begin{pmatrix} \triangle \\ \bigcirc \end{pmatrix}_{(n-1) \times (n-1)}$$

由定理 6.1  $A$  在基底

$$\vec{e}_1, \vec{e}_2, \dots, \vec{e}_n$$

下的矩阵是

$$\begin{pmatrix} \lambda & \alpha_2 & \dots & \alpha_n \\ 0 & B & & \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} \lambda & \alpha_2 & \dots & \alpha_n \\ \bigcirc & \triangle & & \end{pmatrix}$$

注: 推论 6.1 是习南华书 p69.

⑪

定理 2.47. 证明类似, 也是

该定理也可由柯斯特金 p66

定理 9 直接证明.

这矩阵版

推论 6.2 设  $A \in \mathcal{L}(V)$ ,  $U$  是  $A$ -不变子空间且  $0 < \dim U < \dim V$ .

$$\text{则 } \chi_A(t) = \chi_{A|_U}(t) \chi_{\bar{A}}(t),$$

其中  $\bar{A}$  是  $A$  关于  $U$  的商算子.

证: 设  $d = \dim U$ . 由定理 6.1

$A$  在  $V$  的某组基下的矩阵

$$A = \begin{pmatrix} A_1 & A_2 \\ 0 & A_3 \end{pmatrix}$$

其中  $A_1 \in M_d(F)$  是  $A|_U$  的矩阵

$A_3 \in M_{n-d}(F)$  是  $\bar{A}$  的矩阵

$$\chi_A(t) = |tE_n - A| = \left| \begin{pmatrix} tE_d & 0 \\ 0 & tE_{n-d} \end{pmatrix} - \begin{pmatrix} A_1 & A_2 \\ 0 & A_3 \end{pmatrix} \right|$$

$$= \begin{vmatrix} tE_d - A_1 & -A_2 \\ 0 & tE_{n-d} - A_3 \end{vmatrix}$$

$$= |tE_d - A_1| |tE_{n-d} - A_3| \quad [\text{上学期讲义 } 12, \text{ 定理 } 2.2]$$

$$= \chi_{A|U}(t) \chi_{\bar{A}}(t) \quad \square$$

例: 设  $A \in \mathcal{L}(V)$ ,  $U$  是  $A$ -子空间  
 $\bar{A}$  是  $A$  关于  $U$  的商算子.

设  $p \in F[t]$ ,  $\vec{v} \in V$

$$\square \quad p(A)(\vec{v}) + U = p(\bar{A})(\vec{v} + U)$$

$$\text{证: } \begin{array}{ccc} V & \xrightarrow{p(A)} & V \\ \downarrow & \curvearrowright & \downarrow \\ V/U & \xrightarrow{p(\bar{A})} & V/U \end{array}$$

$$\text{证: } p(t) = \alpha_m t^m + \dots + \alpha_1 t + \alpha_0, \quad \alpha_m, \dots, \alpha_1, \alpha_0 \in F$$

$$p(A)(\vec{v}) = (\alpha_m A^m + \dots + \alpha_1 A + \alpha_0 E)(\vec{v})$$

$$= \alpha_m A^m(\vec{v}) + \dots + \alpha_1 A(\vec{v}) + \alpha_0 E(\vec{v})$$

$$p(A)(\vec{v}) + U = (\alpha_m A^m(\vec{v}) + \dots + \alpha_1 A(\vec{v}) + \alpha_0 \vec{v}) + U$$

$$= \alpha_m (A^m(\vec{v}) + U) + \dots + \alpha_1 (A(\vec{v}) + U) + \alpha_0 (\vec{v} + U)$$

$$= \alpha_m (\bar{A}^m(\vec{v} + U)) + \dots + \alpha_1 (\bar{A}(\vec{v} + U)) + \alpha_0 E(\vec{v} + U)$$

$$\text{其中 } E \text{ 是 } V/U \text{ 上的恒等映射}$$

$$= p(\bar{A})(\vec{v} + U) \quad \square$$

## §7 循环子空间

定义: 设  $A \in L(V)$ ,  $\vec{v} \in V$ . 由

$$\vec{v}, A(\vec{v}), \dots, A^k(\vec{v}), \dots$$

生成的子空间. 称为由  $A$  和  $\vec{v}$  生成的循环子空间. 记为  $F[A] \cdot \vec{v}$

命题 7.1. 设  $A \in L(V)$ ,  $\vec{v} \in V$

$$(i) \quad F[A] \cdot \vec{v} = \{p(A)(\vec{v}) \mid p \in F[t]\}$$

$$(ii) \quad F[A] \cdot \vec{v} \text{ 是 } A\text{-不变的}$$

$$(iii) \quad \text{设 } \vec{v} \neq \vec{0}. \text{ 则}$$

$$d = \dim(F[A] \cdot \vec{v}) \Leftrightarrow \vec{v}, A(\vec{v}), \dots, A^{d-1}(\vec{v})$$

是  $F[A] \cdot \vec{v}$  的一组基.

$$\text{证: } (i) \quad \text{设 } p(t) = \alpha_m t^m + \alpha_{m-1} t^{m-1} + \dots + \alpha_0,$$

其中  $\alpha_i \in F$

$$\begin{aligned} p(A)(\vec{v}) &= (\alpha_m A^m + \alpha_{m-1} A^{m-1} + \dots + \alpha_0 I)(\vec{v}) \\ &= \alpha_m A^m(\vec{v}) + \alpha_{m-1} A^{m-1}(\vec{v}) + \dots + \alpha_0 \vec{v} \\ &\in F[A] \cdot \vec{v}. \end{aligned}$$

$$\text{于是 } \{p(A)(\vec{v}) \mid p \in F[t]\} \subset F[A] \cdot \vec{v} \quad (B)$$

$$\text{反之 设 } \vec{w} \in F[A] \cdot \vec{v}$$

$$\text{则 } \exists i_1, \dots, i_k \in \mathbb{N}. \beta_1, \dots, \beta_k \in F$$

$$\text{使得 } \vec{w} = \beta_1 A^{i_1}(\vec{v}) + \dots + \beta_k A^{i_k}(\vec{v})$$

$$\text{令 } p(t) = \beta_1 t^{i_1} + \dots + \beta_k t^{i_k}.$$

$$\text{则 } \vec{w} = p(A)(\vec{v})$$

$$\Rightarrow F[A] \cdot \vec{v} \subset \{p(A)(\vec{v}) \mid p \in F[t]\}$$

$$(ii) \quad \text{设 } \vec{x} \in F[A] \cdot \vec{v}. \text{ 由 (i)}$$

$$\exists p \in F[t] \text{ 使得 } \vec{x} = p(A)(\vec{v})$$

$$A(\vec{x}) = A(p(A)(\vec{v})) = A \circ p(A)(\vec{v})$$

$$= q(A)(\vec{v}), \text{ 其中 } q = t p(t)$$

$$\text{由 (i)} \quad A(\vec{x}) \in F[A] \cdot \vec{v}$$

$$(iii) \quad \Leftarrow \text{显然}$$

$$\Rightarrow \because \dim(F[A] \cdot \vec{v}) = d < \infty$$

$$\therefore \exists k \in \mathbb{Z}^+$$

使得  $\vec{v}, A(\vec{v}), \dots, A^{k-1}(\vec{v})$  线性无关  
 且  $A^k(\vec{v}) \in \langle \vec{v}, A(\vec{v}), \dots, A^{k-1}(\vec{v}) \rangle$

不妨设  $A^k(\vec{v}) = \alpha_0 \vec{v} + \alpha_1 A(\vec{v}) + \dots + \alpha_{k-1} A^{k-1}(\vec{v})$

其中  $\alpha_0, \alpha_1, \dots, \alpha_{k-1} \in F$ .

令  $p(t) = t^k - \alpha_{k-1} t^{k-1} - \dots - \alpha_1 t - \alpha_0$

则  $p(A)(\vec{v}) = \vec{0}$

设  $\vec{z} = f(A) \cdot \vec{v}$ . 由 (i),  $\exists f \in F[t]$

使得  $\vec{z} = f(A)(\vec{v})$

由多项式除法

$$f(t) = q(t)p(t) + r(t)$$

其中  $q, r \in F[t]$ , 且  $r(t) = \beta_0 + \beta_1 t + \dots + \beta_{k-1} t^{k-1}$ ,

$\beta_0, \dots, \beta_{k-1} \in F$

$$\text{于是 } f(A) = q(A)p(A) + r(A)$$

$$\Rightarrow f(A)(\vec{v}) = q(A) \cdot p(A)(\vec{v}) + r(A)(\vec{v})$$

$$\Rightarrow \vec{z} = r(A)(\vec{v}) = \beta_0 \vec{v} + \beta_1 A(\vec{v}) + \dots + \beta_{k-1} A^{k-1}(\vec{v}). \quad (14)$$

$\Rightarrow \vec{z} \in \langle \vec{v}, A(\vec{v}), \dots, A^{k-1}(\vec{v}) \rangle$

即  $\vec{v}, A(\vec{v}), \dots, A^{k-1}(\vec{v})$  是  $F[A] \cdot \vec{v}$  的一组基. 特别地有  $d = k$   $\square$

例: 设  $A = \mathbb{R}^2 \rightarrow \mathbb{R}^2$   
 $\begin{pmatrix} x_1 \\ x_2 \end{pmatrix} \mapsto \begin{pmatrix} 0 & 1 \\ 0 & 0 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} x_1 \\ x_2 \end{pmatrix}$

设  $\vec{v} = \begin{pmatrix} 1 \\ 1 \end{pmatrix}$ ,  $\vec{w} = \begin{pmatrix} 1 \\ 0 \end{pmatrix}$ . 求:

$\dim(F[A] \cdot \vec{v})$  和  $\dim(F[A] \cdot \vec{w})$

的维数

$$A(\vec{v}) = \begin{pmatrix} 0 & 1 \\ 0 & 0 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} 1 \\ 1 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 1 \\ 0 \end{pmatrix}$$

$\vec{v}, A(\vec{v})$  线性无关  $\Rightarrow \dim(F[A] \cdot \vec{v}) = 2$

的维数  $\geq$

$$A^2(\vec{w}) = \begin{pmatrix} 0 & 1 \\ 0 & 0 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} 1 \\ 0 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 0 \\ 0 \end{pmatrix} \Rightarrow$$

$$\dim(F[A] \cdot \vec{w}) = 1.$$

定义: 设  $A \in \mathbb{C}(V)$ ,  $\vec{v} \in V$ ,  $p \in \mathbb{C}[t]$

- (i) 如果  $p(A)(\vec{v}) = \vec{0}$ , 则称  $p$  是关于  $A$  和  $\vec{v}$  的零化多项式
- (ii) 在所有关于  $A$  和  $\vec{v}$  的零化多项式中, 非零, 首一, 且次数最低的称为关于  $A$  和  $\vec{v}$  的极小多项式, 记为  $M_{A, \vec{v}}$ .

命题 7.2. 设  $A \in \mathbb{C}(V)$ ,  $\vec{v} \in V \setminus \{\vec{0}\}$

- (i)  $M_{A, \vec{v}}$  存在且唯一
- (ii) 若  $p \in \mathbb{C}[t]$  是关于  $A$  和  $\vec{v}$  的零化多项式, 则  $M_{A, \vec{v}}(t) \mid p(t)$
- (iii)  $\dim(\mathbb{C}[A]\vec{v}) = \deg M_{A, \vec{v}}$

证: (i)  $M_A(A) = 0$

于是  $M_A$  是关于  $A$  和  $\vec{v}$  的零化多项式. 由此可知  $M_{A, \vec{v}}$

存在. 设  $p$  是另一非零, 首一, 且次数最低的多项式. 使得  $p(A)(\vec{v}) = \vec{0}$  的多项式. 则

$$\deg M_{A, \vec{v}} = \deg p =: d$$

$$\Rightarrow q = M_{A, \vec{v}} - p \text{ 的次数} < d$$

$$q(A) = M_{A, \vec{v}}(A) - p(A)$$

$$q(A)(\vec{v}) = M_{A, \vec{v}}(A)(\vec{v}) - p(A)(\vec{v}) = \vec{0} - \vec{0} = \vec{0}$$

$$\Rightarrow q = 0 \quad [\because d \text{ 次数最低, } \vec{0} \text{ 除外}]$$

$$\Rightarrow M_{A, \vec{v}} = p.$$

(ii) 设  $f \in \mathbb{C}[t]$ ,  $f(A)(\vec{v}) = \vec{0}$

由多项式除法

$$f(t) = q(t) M_{A, \vec{v}}(t) + r(t)$$

其中  $\deg(r) < d$

$$f(A) = q(A) M_{A, \vec{v}}(A) + r(A)$$

$$f(A)(\vec{v}) = q(A) M_{A, \vec{v}}(A)(\vec{v}) + r(A)(\vec{v})$$

$$\Rightarrow r(A)(\vec{v}) = \vec{0} \Rightarrow r(t) = 0.$$

(iii) 由命题 7.1 (i)

$$\vec{v}, A\vec{v}, \dots, A^{d-1}\vec{v}$$

是  $F[A] \cdot \vec{v}$  的一组基, 且  $\exists \alpha_0, \alpha_1, \dots, \alpha_{d-1}$  使得

使得

$$A^d \vec{v} = \alpha_{d-1} A^{d-1} \vec{v} + \dots + \alpha_1 A \vec{v} + \alpha_0 \vec{v}$$

$$\text{设 } p(t) = t^d - \alpha_{d-1} t^{d-1} + \dots - \alpha_0$$

$$\text{则 } p(A) = 0.$$

$$\text{由 (ii) } \mu_{A, \vec{v}} \mid p.$$

$\mu_{A, \vec{v}}$  的次数不可能大于  $d$

否则  $\vec{v}, A\vec{v}, \dots, A^{d-1}\vec{v}$  线性相关.

$$\Rightarrow \dim_{F[A]} \mu_{A, \vec{v}} = d \quad \square$$

引理 7.1 设

$$p(t) = t^n + \alpha_{n-1} t^{n-1} + \dots + \alpha_1 t + \alpha_0$$

$$\text{则 } p(t) = |tE - A|, \text{ 其中 } A = \begin{pmatrix} \alpha_0 & \alpha_1 & \dots & \alpha_{n-1} \\ 1 & 0 & \dots & 0 \\ 0 & 1 & \dots & 0 \\ \vdots & \vdots & \ddots & \vdots \\ 0 & 0 & \dots & 1 \end{pmatrix}$$

$$\text{证: } |tE - A|$$

$$= \begin{vmatrix} t & 0 & \dots & 0 & -\alpha_0 \\ -1 & t & \dots & 0 & -\alpha_1 \\ 0 & -1 & \dots & 0 & -\alpha_2 \\ \vdots & \vdots & \ddots & \vdots & \vdots \\ 0 & 0 & \dots & -1 & t + \alpha_{n-1} \end{vmatrix}$$

对  $n$  归纳

$$n=1 \quad |tE - A| = t + \alpha_0 = p(t)$$

设  $n-1$  时结论成立

当  $n$  时

$$|tE - A| = t \begin{vmatrix} t & 0 & \dots & 0 & -\alpha_1 \\ -1 & t & \dots & 0 & -\alpha_2 \\ \vdots & \vdots & \ddots & \vdots & \vdots \\ 0 & 0 & \dots & -1 & t + \alpha_{n-1} \end{vmatrix} + \alpha_0 \begin{vmatrix} -1 & t & 0 & \dots & 0 \\ 0 & -1 & t & \dots & 0 \\ \vdots & \vdots & \vdots & \ddots & \vdots \\ 0 & 0 & \dots & -1 & t \end{vmatrix}$$

$$= t(t^{n-1} + \alpha_{n-1} t^{n-2} + \dots + \alpha_1) + \alpha_0$$

$$= t^n + \alpha_{n-1} t^{n-1} + \dots + t + \alpha_0 \quad \square$$



定义: 设  $A \in L(V)$ ,  $\vec{v} \in V$ .

如果  $V = F[A] \cdot \vec{v}$ , 则称  $V$  是  $A$ -循环空间,  $\vec{v}$  称为  $V$  的循环向量.

定理 7.1 设  $A \in L(V)$ ,  $V$  是  $A$ -循环空间. 则  $\mu_A(t) = \chi_A(t)$ .

证: 设  $V = F[A] \vec{v}$ .

则  $\vec{v}, A(\vec{v}), \dots, A^{n-1}(\vec{v})$  是  $V$  的一组基. (命题 7.1 (i))

设  $A^n(\vec{v}) = -\alpha_0 \vec{v} - \alpha_1 A(\vec{v}) - \dots - \alpha_{n-1} A^{n-1}(\vec{v})$

设  $\alpha_i \in F$

设  $p(t) = t^n + \alpha_{n-1}t^{n-1} + \dots + \alpha_0$

则  $p(A)(\vec{v}) = \vec{0}$

$\forall \vec{z} \in V, \exists q \in F[t]$  使得  $\vec{z} = q(A)(\vec{v})$  (命题 7.1 (ii))

于是:  $p(A)(\vec{z}) = p(A)q(A)(\vec{v}) = q(A)p(A)(\vec{v}) = \vec{0}$

由此可知:

$$p(A) = 0 \Rightarrow \mu_A | p$$

由命题 7.2 (iii) 和 (ii)

$$\mu_{A, \vec{v}} = p \text{ 且 } \mu_{A, \vec{v}} | \mu_A$$

$$\text{于是 } \mu_A = p.$$

$V$  在  $\vec{v}, A(\vec{v}), \dots, A^{n-1}(\vec{v})$  下的矩阵为

$$(A(\vec{v}), A^2(\vec{v}), \dots, A^n(\vec{v})) = (\vec{v}, A(\vec{v}), \dots, A^{n-1}(\vec{v}))$$

$$= \begin{pmatrix} 0 & 0 & \dots & 0 & -\alpha_0 \\ 1 & 0 & \dots & 0 & -\alpha_1 \\ 0 & 1 & \dots & 0 & \vdots \\ \vdots & \vdots & \ddots & \vdots & \vdots \\ 0 & 0 & \dots & 1 & -\alpha_{n-1} \end{pmatrix}$$

$$\Rightarrow \chi_A(t) = \begin{vmatrix} t & 0 & \dots & 0 & \alpha_0 \\ -1 & t & \dots & 0 & \alpha_1 \\ \vdots & \vdots & \ddots & \vdots & \vdots \\ 0 & 0 & \dots & -1 & t + \alpha_{n-1} \end{vmatrix} = p(t) \quad (\text{命题 7.1})$$