第二章　矩阵

7　方阵

实数上所有方阵的集合记为 $\mathrm{M}_n(\mathbb{R})$.

7.1　$\mathrm{M}_n(\mathbb{R})$ 上的运算

对于任意 $A, B, C \in \mathrm{M}_n(\mathbb{R})$, $\lambda, \mu \in \mathbb{R}$, 我们有

(A1) $A + B = B + A$;

(A2) $(A + B) + C = A + (B + C)$;

(A3) $A + O = A$, 其中 O 是 n 阶零矩阵;

(A4) $A + (-A) = O$.

(M1) $(AB)C = A(BC)$;

(M2) $AE = EA = A$, 其中 E 是 n 阶单位矩阵.

(S1) $(\lambda\mu)A = \lambda(\mu A)$;

(S2) $1A = A$.

(AM) $A(B + C) = AB + AC$; $(A + B)C = AC + BC$.

(AS) $(\lambda+\mu)A=\lambda A+\mu A;\ \lambda(A+B)=\lambda A+\lambda B.$

(MS) $(\lambda A)(\mu B)=\lambda(A(\mu B))=(\lambda\mu)(AB).$

我们把 $\mathrm{M}_n(\mathbb{R})$ 称为 $\mathbb{R}$ 上的 n 阶矩阵代数.

例 7.1 设 $A,B\in\mathrm{M}_n(\mathbb{R})$. 展开 $(A+B)^2$ 和 $(A+B)(A-B)$.

解. $(A+B)^2=(A+B)(A+B)=A^2+AB+BA+B^2.$

$(A+B)(A-B)=A^2+BA-AB-B^2.$

只有当 $AB=BA$ 时, 我们才有

$$(A+B)^2=A^2+2AB+B^2 \quad 和 \quad (A+B)(A-B)=A^2-B^2.$$

定义 7.2 设 $A\in\mathrm{M}_n(\mathbb{R})$. 如果 $A^t=A$, 则称 A 是对称矩阵. 如果 $A^t=-A$, 则称 A 是斜对称矩阵. 如果存在 $k\in\mathbb{Z}^+$ 使得 $A^k=O$. 则称 A 是幂零矩阵. 如果 $A^2=A$, 则称 A 是幂等矩阵.

注解 7.3 设 $A=(a_{i,j})\in\mathrm{M}_n(\mathbb{R})$. 则 A 对称当且仅当 $a_{i,j}=a_{j,i},\ i,j\in\{1,2,\ldots,n\}$. 而 A 斜对称当且仅当 $a_{i.i}=0$ 且 $a_{i,j}=-a_{j,i}$, 其中 $i,j\in\{1,2,\ldots,n\}$ 且 $i\neq j$. 我们来验证关于斜对称的必要充分条件如下

$$\begin{aligned}
&A=-A^t\Longleftrightarrow A+A^t=O\\
&\Longleftrightarrow a_{i,j}+a_{j,i}=0,\ i,j\in\{1,2,\ldots,n\}\\
&\Longleftrightarrow 2a_{i,i}=0, a_{i,j}+a_{j,i}=0,\ i,j\in\{1,2,\ldots,n\}, i\neq j\\
&\Longleftrightarrow a_{i,i}=0, a_{i,j}+a_{j,i}=0,\ i,j\in\{1,2,\ldots,n\}, i\neq j \quad (2\neq 0).
\end{aligned}$$

7.2 交换不变量与中心元

由第二章第四讲例 6.19 可知, 对 $A, B \in \mathrm{M}_n(\mathbb{R})$, $\mathrm{rank}(AB)$ 可能不等于 $\mathrm{rank}(BA)$. 换言之, 秩关于矩阵乘法不是交换不变量.

定义 7.4 设 $A = (a_{i,j}) \in \mathrm{M}_n(\mathbb{R})$. 我们称 $\sum_{i=1}^{n} a_{i,i}$ 是 A 的迹 *(trace)*. 记为 $\mathrm{tr}(A)$.

可直接验证: 对任意 $\alpha, \beta \in \mathbb{R}, A, B \in \mathrm{M}_n(\mathbb{R})$,

$$\mathrm{tr}(\alpha A + \beta B) = \alpha \mathrm{tr}(A) + \beta \mathrm{tr}(B).$$

命题 7.5 设 $A = (a_{i,j}), B = (b_{i,j}) \in \mathrm{M}_n(\mathbb{R})$. 则

$$\mathrm{tr}(AB) = \mathrm{tr}(BA).$$

证明. 设 $C = (c_{ij}) = AB$ 和 $D = (d_{i,j}) = BA$. 则

$$c_{i,i} = \sum_{k=1}^{n} a_{i,k} b_{k,i} \quad \text{和} \quad d_{i,i} = \sum_{k=1}^{n} b_{i,k} a_{k,i}.$$

于是,

$$\mathrm{tr}(C) = \sum_{i=1}^{n} \sum_{k=1}^{n} a_{i,k} b_{k,i} \quad \text{和} \quad \mathrm{tr}(D) = \sum_{i=1}^{n} \sum_{k=1}^{n} b_{i,k} a_{k,i}.$$

故 $\mathrm{tr}(C) = \mathrm{tr}(D)$. □

例 7.6 证明*:* 对任意 $A, B \in \mathrm{M}_n(\mathbb{R})$, $AB - BA \neq E$.

证明. 我们计算 $\mathrm{tr}(AB - BA) = \mathrm{tr}(AB) - \mathrm{tr}(BA) = 0$ *(*命题 *7.5)*. 但 $\mathrm{tr}(E) = n > 0$. 故 $AB - BA \neq E$. □

定义 7.7 设 $C \in \mathrm{M}_n(\mathbb{R})$. 如果对任意 $A \in \mathrm{M}_n(\mathbb{R})$, 我们有 $AC = CA$. 则称 C 是中心元.

定理 7.8 设 $C \in \mathrm{M}_n(\mathbb{R})$. 则 C 是中心元当且仅当 C 是数乘矩阵.

为了证明每个中心元是数乘矩阵, 我们需要下述引理.

引理 7.9 *(搬运工引理)* 对任意 $i, j \in \{1, \ldots, k\}$, 设 $E_{i,j}^{(k)}$ 是在 i 行 j 列处的元素等于 1, 而其它元素都等于零的 k 阶方阵. 则对于 $A \in \mathbb{R}^{m\times n}$,

$$E_{i,j}^{(m)} A = \begin{pmatrix} O_{(i-1)\times n} \\ \vec{A}_j \\ O_{(m-i)\times n} \end{pmatrix} \quad \text{和} \quad AE_{i,j}^{(n)} = (O_{m\times(j-1)}, \vec{A}^{(i)}, O_{m\times(n-j)}).$$

证明. 根据列向量乘法公式, $AE_{i,j}^{(n)}$ 中除第 j 列外都是 $\mathbf{0}_n$. 而第 j 列是 $A\mathbf{e}_i = \vec{A}^{(i)}$. 故第二个等式成立. 由此可知

$$(E_{i,j}^{(m)} A)^t = A^t E_{j,i}^{(m)} = (O_{n\times(i-1)}, \vec{A}_j^t, O_{n\times(m-i)}).$$

对上式再次转置得到

$$(E_{i,j}^{(m)} A) = (O_{n\times(i-1)}, \vec{A}_j^t, O_{n\times(m-i)})^t = \begin{pmatrix} O_{(i-1)\times n} \\ \vec{A}_j \\ O_{(m-i)\times n} \end{pmatrix}.$$

第一个等式成立. □

定理 7.8 的证明. 设 $C = \lambda E$. 则对任意 $A \in \mathrm{M}_n(\mathbb{R})$, $CA = \lambda A$ 且 $AC = \lambda A$. 故 $CA = AC$.

反之, 设 $C = (c_{i,j}) \in \mathrm{M}_n(\mathbb{R})$ 是中心元. 对任意 $i, j \in \{1, \ldots, n\}$, $E_{i,j}^{(n)} C = C E_{i,j}^{(n)}$. 于是

$$\begin{pmatrix} O_{(i-1)\times n} \\ \vec{C}_j \\ O_{(n-i)\times n} \end{pmatrix} = (O_{n\times(j-1)}, \vec{C}^{(i)}, O_{n\times(n-j)}).$$

比较等式两侧矩阵的第 i 行可知, 当 $k \neq j$ 时, $c_{j,k} = 0$; 当 $k = j$ 时, $c_{j,j} = c_{i,i}$. 于是, C 是数乘矩阵. □

7.3 可逆元

定义 7.10 设 $A \in \mathrm{M}_n(\mathbb{R})$. 如果存在 $B \in \mathrm{M}_n(\mathbb{R})$ 使得 $AB = BA = E$, 则称 A 是可逆矩阵. 此时, B 称为 A 的一个逆矩阵.

设 $BA = AB = E$ 且 $CA = AC = E$. 则

$$CAB = C \Longrightarrow (CA)B = C \Longrightarrow EB = C \Longrightarrow B = C.$$

故上述定义中 B 是唯一的. 我们把 B 称为可逆矩阵的逆矩阵, 记为 A^{-1}.

定理 7.11 设 $A \in \mathrm{M}_n(\mathbb{R})$. 则 A 可逆当且仅当 A 满秩.

证明. 设 A 可逆, 则 $AA^{-1} = E$. 根据定理 **??** (i), $\mathrm{rank}(A) \geq \mathrm{rank}(AA^{-1}) = \mathrm{rank}(E) = n$. 故 $\mathrm{rank}(A) = n$.

反之, 设 A 满秩. 则对任意 $\mathbf{b} \in \mathbb{R}^n$, $A\mathbf{x} = \mathbf{b}$ 有解 (第二章第三讲推论 4.3). 设 $\mathbf{v}_j$ 是 方程组 $A\mathbf{x} = \mathbf{e}_j$ 的解, $j = 1, 2, \ldots, n$. 令 $B = (\mathbf{v}_1, \ldots, \mathbf{v}_n)$. 则

$$AB = (A\mathbf{v}_1, \ldots, A\mathbf{v}_n) = (\mathbf{e}_1, \ldots, \mathbf{e}_n) = E.$$

由第二章第三讲例 3.15, $\mathrm{rank}(A^t) = n$. 由上述证明可知存在 $C \in \mathrm{M}_n(\mathbb{R})$ 使得 $A^tC = E$. 故 $C^tA = E$ (见第二章第四讲命题 6.23). 由此得出, $C^tAB = B$. 从而,

$$C^t(AB) = C^tE = C^t = B.$$

我们得到 $BA = E$. 于是, A 可逆. □

注解 7.12 上述定理也可以用线性映射证明如下: 如果 A 可逆, 则存在 $B \in \mathrm{M}_n(\mathbb{R})$ 使得 $BA = AB = E$. 注意到 ϕ_A, ϕ_B 都是从 $\mathbb{R}^n$ 到自身的映射. 于是, $\phi_A \circ \phi_B = \phi_E$ 和 $\phi_B \circ \phi_A = \phi_E$. 因为 ϕ_E 是恒同映射, 所以 ϕ_A 是双射. 故 A 满秩. *(第二章第四讲命题 6.10 (iii)).*

反之, 同样的命题蕴含 ϕ_A 是双射. 由第九周作业题 *4* 可知, ϕ_A^{-1} 是线性映射. 故存在 $B \in \mathrm{M}_n(\mathbb{R})$, 使得 $\phi_A^{-1} = \phi_B$. 我们得出 $\phi_A \circ \phi_B = \phi_E$ 和 $\phi_B \circ \phi_A = \phi_E$. 于是, $AB = BA = E$.

推论 7.13 矩阵 $A\in\mathrm{M}_n(\mathbb{R})$ 可逆当且仅当存在 $B\in\mathrm{M}_n(\mathbb{R})$ 使得 $AB=E$ 或 $BA=E$.

证明. 这是因为 $AB=E$ 或 $BA=E$ 都可推出 A 满秩. □

注解 7.14 上述推论也可以根据第二章第三讲推论 *5.15* 推出. 这是因为 $\phi_A:\mathbb{R}^n\longrightarrow\mathbb{R}^n$ 是单射当且仅当它是满射当且仅当它是双射.

命题 7.15 设 $A,B\in\mathrm{M}_n(\mathbb{R})$ 都可逆. 则

(i) AB 可逆且它的逆是 $B^{-1}A^{-1}$;

(ii) A^{-1} 可逆且它的逆是 $(A^{-1})^{-1}=A$;

(iii) A^t 可逆且其逆是 $(A^{-1})^t$.

证明. (i) $AB(B^{-1}A^{-1})=A(BB^{-1})A^{-1}=AEA^{-1}=E$. 类似可验证 $(B^{-1}A^{-1})AB=E$.

(ii) 这是因为 $AA^{-1}=A^{-1}A=E$.

(iii) 由第二章第四讲命题 6.23 可知,

$$A^t(A^{-1})^t=(A^{-1}A)^t=E^t=E.$$

类似地, $(A^{-1})^tA^t=E$. □

注解 7.16 上述命题中第一个结论实际上是逆映射的穿衣脱衣规则*(第一章第二讲命题 4.14 (ii))*, 而第二个结论对应着第一章第二讲命题 *4.14 (i)*.

例 7.17 设 $A \in \mathrm{M}_n(\mathbb{R})$. 则线性方程组 $A\mathbf{x} = \mathbf{b}$ 确定当且仅当 A 可逆. 此时它的唯一解是 $\mathbf{x} = A^{-1}\mathbf{b}$.

例 7.18 设 $A \in \mathrm{M}_n(\mathbb{R})$ 幂零. 证明 $E - A$ 可逆.

证明. 设 $A^k = O$, 其中 $k > 0$. 则

$$E = E - A^k = (E - A)(E + A + \cdots + A^{k-1}).$$

故 $(E - A)^{-1} = E + A + \cdots + A^{k-1}$. □

例 7.19 设

$$A = \begin{pmatrix} 0 & 1 \\ 1 & 1 \end{pmatrix} \in \mathrm{M}_2(\mathbb{R}).$$

证明: 对 $m \in \mathbb{Z}^+$,

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

其中 $f_0 = 0, f_1 = 1, f_2 = 1, f_{m+1} = f_m + f_{m-1}$.

证明. $m = 1$ 时, 结论显然. 设 $m > 1$ 且 $m - 1$ 时结论成立. 则

$$\begin{aligned} A^m = A^{m-1}A &= \begin{pmatrix} f_{m-2} & f_{m-1} \\ f_{m-1} & f_m \end{pmatrix} \begin{pmatrix} 0 & 1 \\ 1 & 1 \end{pmatrix} \\ &= \begin{pmatrix} f_{m-1} & f_{m-1} + f_{m-2} \\ f_m & f_m + f_{m-1} \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} f_{m-1} & f_m \\ f_m & f_{m+1} \end{pmatrix}. \quad \square \end{aligned}$$

设

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

和

$$B = \begin{pmatrix} -\frac{\lambda_2}{5} & \frac{1}{5} \\ -\sqrt{5}\lambda_1 & \sqrt{5} \end{pmatrix}.$$

不难计算

$$B^{-1} = \begin{pmatrix} \sqrt{5} & -\frac{1}{5} \\ \sqrt{5}\lambda_1 & -\frac{\lambda_2}{5} \end{pmatrix} \quad \text{和} \quad A = B^{-1} \begin{pmatrix} \lambda_1 & 0 \\ 0 & \lambda_2 \end{pmatrix} B.$$

验证:

$$\begin{pmatrix} \sqrt{5} & -\frac{1}{5} \\ \sqrt{5}\lambda_1 & -\frac{\lambda_2}{5} \end{pmatrix} \begin{pmatrix} -\frac{\lambda_2}{5} & \frac{1}{5} \\ -\sqrt{5}\lambda_1 & \sqrt{5} \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} \frac{\sqrt{5}}{5}(\lambda_1-\lambda_2) & 0 \\ 0 & \frac{\sqrt{5}}{5}(\lambda_1-\lambda_2) \end{pmatrix} = E_2$$

和

$$\begin{aligned} &\begin{pmatrix} \sqrt{5} & -\frac{1}{5} \\ \sqrt{5}\lambda_1 & -\frac{\lambda_2}{5} \end{pmatrix} \begin{pmatrix} \lambda_1 & 0 \\ 0 & \lambda_2 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} -\frac{\lambda_2}{5} & \frac{1}{5} \\ -\sqrt{5}\lambda_1 & \sqrt{5} \end{pmatrix} \\ &= \begin{pmatrix} \sqrt{5}\lambda_1 & -\frac{1}{5}\lambda_2 \\ \sqrt{5}\lambda_1^2 & -\frac{\lambda_2^2}{5} \end{pmatrix} \begin{pmatrix} -\frac{\lambda_2}{5} & \frac{1}{5} \\ -\sqrt{5}\lambda_1 & \sqrt{5} \end{pmatrix} \\ &= \begin{pmatrix} 0 & \frac{\sqrt{5}}{5}(\lambda_1-\lambda_2) \\ \frac{\sqrt{5}}{5}\lambda_1\lambda_2(\lambda_2-\lambda_1) & \frac{\sqrt{5}}{5}(\lambda_1^2-\lambda_2^2) \end{pmatrix} = A. \end{aligned}$$

注意到: 对任意 $C \in \mathrm{M}_n(\mathbb{R})$,

$$\left(B^{-1}CB\right)^m = B^{-1}C^mB.$$

故

$$A^m = B^{-1}\mathrm{diag}(\lambda_1^m, \lambda_2^m)B.$$

于是,

$$f_m = \left(\sqrt{5}\lambda_1^m, -\frac{1}{5}\lambda_2^m\right)\vec{B}^{(2)} = \frac{\sqrt{5}}{5}(\lambda_1^m - \lambda_2^m).$$

于是, *Fibonacci* 序列的闭形式是

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

注意到 $f_0 = 0, f_1 = 1, f_2 = 1, f_3 = 2, f_4 = 3, \ldots, f_{10} = 55.$ 但 $f_{50} = 12586269025.$ 渐近公式是

$$\lim_{m\to\infty}\frac{f_m}{\left(\frac{1+\sqrt{5}}{2}\right)^m} = \frac{\sqrt{5}}{5} \Longrightarrow f_m \sim \left(\frac{1+\sqrt{5}}{2}\right)^m.$$

小结. *Fibonacci* 序列*:*

$$\underbrace{f_0 = 0,\ f_1 = 1,\ f_{m+1} = f_m + f_{m-1}}_{\text{递归公式}},$$

$$\underbrace{f_m = \frac{\sqrt{5}}{5}\left(\left(\frac{1+\sqrt{5}}{2}\right)^m - \left(\frac{1-\sqrt{5}}{2}\right)^m\right)}_{\text{闭形式}},$$

和

$$\underbrace{f_m \sim \left(\frac{1+\sqrt{5}}{2}\right)^m}_{\text{渐进公式}}.$$

8 矩阵的初等等价

定义 8.1 设 $A, B \in \mathbb{R}^{m\times n}$. 如果存在 m 阶可逆方阵 P 和 n 阶可逆方阵 Q 使得 $A = PBQ$. 则称 A 与 B 初等等价. 记为 $A \sim_e B$.

我们来验证 $\sim_e$ 是等价关系. 对任意 $A \in \mathbb{R}^{m\times n}$, 我们有 $A = E_m A E_n$. 于是, $A \sim_e A$. 自反性成立.

再设 $B \in \mathbb{R}^{m\times n}$ 满足 $A \sim_e B$. 则存在 m 阶可逆方阵 B 和 n 阶可逆方阵 Q 使得 $A = PBQ$. 则 $B = P^{-1}AQ^{-1}$. 故 $B \sim_e A$. 对称性成立.

设 $C \in \mathbb{R}^{m\times n}$ 且 $A \sim_e B$ 和 $B \sim_e C$. 则存在 m 阶可逆方阵 P 和 n 阶可逆方阵 Q 使得 $A = PBQ$ 和 $B = SCT$. 故 $A = (PS)C(TQ)$. 因为可逆方阵的积仍可逆, 所以 $A \sim_e C$. 传递性成立.

我们将证明

定理 8.2 设 $A, B \in \mathbb{R}^{m\times n}$. 则 $A \sim_e B \Longleftrightarrow \mathrm{rank}(A) = \mathrm{rank}(B)$.

为此, 我们需要用矩阵乘法来解释初等变换.

定义 8.3 设 $i, j \in \{1, 2, \ldots, n\}$.

(i) $F_{i,j}^{(n)}$ 是把 E_n 中第 i 行和第 j 行互换的得到的矩阵. 称之为第一类初等矩阵.

(ii) 设 $\alpha \in \mathbb{R}$ 且 $i \neq j$. 则 $F_{i,j}^{(n)}(\alpha)$ 是把 E_n 中第 i 行通乘 α 加到第 j 行得到的矩阵. 称之为第二类初等矩阵.

(iii) 设 $\lambda \in \mathbb{R}$ 且 $\lambda \neq 0$. 则 $F_i^{(n)}(\lambda)$ 是把 E_n 中第 i 行通乘 λ 得到的矩阵. 称之为第三类类初等矩阵.

这三类矩阵统称为 n 阶初等矩阵.

注解 8.4 可直接验证

$$(F_{i,j}^{(n)})^2 = E_n,$$

$$F_{i,j}^{(n)}(\alpha)F_{i,j}^{(n)}(-\alpha) = E_n,$$

和

$$F_i^{(n)}(\lambda)F_i^{(n)}(\lambda^{-1}) = E_n.$$

故初等矩阵都是可逆的, 且它们的逆也是初等矩阵.

我们可以通过搬运工引理(上一讲引理 7.12)中定义矩阵 $E_{i,j}^{(k)}$ 表示初等矩阵如下:

$$F_{i,j}^{(n)} = E_n - E_{i,i}^{(n)} - E_{j,j}^{(n)} + E_{i,j}^{(n)} + E_{j,i}^{(n)}, \tag{1}$$

$$F_{i,j}^{(n)}(\alpha) = E_n + \alpha E_{j,i}^{(n)}, \tag{2}$$

$$F_i^{(n)}(\lambda) = E_n + (\lambda - 1)E_{i,i}^{(n)}. \tag{3}$$

设 $A \in \mathbb{R}^{m\times n}$. 根据 (1),

$$F_{i,j}^{(m)}A = A - E_{i,i}^{(m)}A - E_{j,j}^{(m)}A + E_{i,j}^{(m)}A + E_{j,i}^{(m)}A.$$

根据搬运工引理, $F_{i,j}^{(m)}A$ 是把 A 中 i,j 两行对换得到的矩阵. 根据 (2),

$$F_{i,j}^{(m)}(\alpha)A = A + \alpha E_{j,i}^{(m)}A.$$

同理, $F_{i,j}^{(m)}(\alpha)A$ 是把 A 中第i 行乘以 α 后加到第 j 行得到的矩阵. 根据 (3),

$$F_{i}^{(m)}(\lambda)A = A + (\lambda - 1)E_{i,i}^{(m)}A.$$

从而得到把 A 中第 i 行通乘 λ 的矩阵.

类似地, $AF_{i,j}^{(n)}$, $AF_{i,j}^{(n)}(\alpha)$ 和 $AF_{i}^{(n)}(\lambda)$ 分别是把 A 中 i,j 两行对换, 把 A 中第 i 列乘以 α 后加到第 j 列, 和把 A 中第 i 列通乘 λ 后得到的矩阵.

引理 8.5 *(打洞引理)* 设 $A \in \mathbb{R}^{m\times n}$. 则存在可逆矩阵

$$P \in \mathrm{M}_m(\mathbb{R}) \quad \text{和} \quad Q \in \mathrm{M}_n(\mathbb{R}),$$

其中 P 和 Q 都是初等矩阵的乘积, 使得

$$PAQ = \begin{pmatrix} E_r & O_{r\times(n-r)} \\ O_{(m-r)\times r} & O_{(m-r)\times(n-r)} \end{pmatrix},$$

且 $\mathrm{rank}(A) = r$.

证明. 根据第一章第一讲命题 2.3 和第三类初等行变换,

存在若干个 m 阶初等矩阵, 使得它们的积 P 满足

$$PA = \begin{pmatrix} 0\cdots0 & 1 & * & \cdots & * & * & * & \cdots & * & * & *\cdots* \\ 0\cdots0 & 0 & 0 & \cdots & 0 & 1 & * & \cdots & * & * & *\cdots* \\ \vdots & \vdots & \vdots & \vdots & \vdots & \vdots & \ddots & \vdots & \vdots & & \vdots \\ 0\cdots0 & 0 & 0 & \cdots & 0 & 0 & 0 & \cdots & 0 & 1 & *\cdots* \\ 0\cdots0 & 0 & 0 & \cdots & 0 & 0 & 0 & \cdots & 0 & 0\,0 & \cdots0 \\ \vdots & \vdots & \vdots & \vdots & \vdots & \vdots & \vdots & \vdots & \vdots & & \vdots \\ 0\cdots0 & 0 & 0 & \cdots & 0 & 0 & 0 & \cdots & 0 & 0\,0 & \cdots0 \end{pmatrix},$$

其中共有 r 行非零. 则存在若干个 n 阶第一类初等矩阵, 使得它们的积 Q_1 满足

$$PAQ_1 = \begin{pmatrix} 1 & * & \cdots & * & * & * & \cdots & * & * & *\cdots* \\ 0 & 1 & \cdots & * & * & * & \cdots & * & * & *\cdots* \\ \vdots & \vdots & \vdots & \vdots & \vdots & \ddots & \vdots & \vdots & & \vdots \\ 0 & 0 & \cdots & 0 & 1 & * & \cdots & * & * & *\cdots* \\ 0 & 0 & \cdots & 0 & 0 & 0 & \cdots & 0 & 0\,0 & \cdots0 \\ \vdots & \vdots & \vdots & \vdots & \vdots & \vdots & \vdots & \vdots & & \vdots \\ 0 & 0 & \cdots & 0 & 0 & 0 & \cdots & 0 & 0\,0 & \cdots0 \end{pmatrix},$$

进而存在若干个 n 阶第一类初等矩阵, 使得它们的积 Q_2

满足

$$PAQ_1Q_2 = \begin{pmatrix} 1 & 0 & \cdots & 0 & 0 & 0 & \cdots & 0 & 0 & 0 \cdots 0 \\ 0 & 1 & \cdots & 0 & 0 & 0 & \cdots & 0 & 0 & 0 \cdots 0 \\ \vdots & \vdots & \vdots & \vdots & \vdots & \ddots & \vdots & \vdots & \vdots & \\ 0 & 0 & \cdots & 0 & 1 & 0 & \cdots & 0 & 0 & 0 \cdots 0 \\ 0 & 0 & \cdots & 0 & 0 & 0 & \cdots & 0 & 0 & 0 \cdots 0 \\ \vdots & \vdots & \vdots & \vdots & \vdots & \vdots & \vdots & \vdots & \vdots & \\ 0 & 0 & \cdots & 0 & 0 & 0 & \cdots & 0 & 0 & 0 \cdots 0 \end{pmatrix}.$$

再令 $Q = Q_1Q_2$ 即可, 这是因为初等矩阵之积必然可逆. 根据第二章第五讲推论 6.27, $\mathrm{rank}(A) = r$. □

注解 8.6 打洞引理也可写成:

设 $A \in \mathbb{R}^{m\times n}$ 和 $\mathrm{rank}(A) = r$. 则

$$A = P \begin{pmatrix} E_r & O \\ O & O \end{pmatrix} Q,$$

其中 $P \in \mathrm{M}_m(\mathbb{R})$ 可逆, $Q \in \mathrm{M}_n(\mathbb{R})$ 可逆.

例 8.7 设 $A \in \mathbb{R}^{m\times n}$ 且 $\mathrm{rank}(A)=r>0$. 则存在 $B \in \mathbb{R}^{m\times r}$ 和 $C \in \mathbb{R}^{r\times n}$ 满足 $A = BC$ 和 $\mathrm{rank}(B) = \mathrm{rank}(C) = r$.

证明. 根据打洞引理, 存在 m 阶和 n 阶可逆矩阵 P 和 Q 使得

$$A = P \begin{pmatrix} E_r & O \\ O & O \end{pmatrix} Q.$$

直接验证得

$$\begin{pmatrix} E_r & O \\ O & O \end{pmatrix}_{m\times n} = \begin{pmatrix} E_r \\ O \end{pmatrix}_{m\times r} (E_r, O)_{r\times n}.$$

令

$$B = P \begin{pmatrix} E_r \\ O \end{pmatrix}_{m\times r} \quad \text{和} \quad C = (E_r, O)_{r\times n} Q$$

即可.

推论 8.8 可逆矩阵是若干初等矩阵之积.

证明. 设 A 可逆. 则 A 满秩. 由打洞引理的证明可知, 存在初等矩阵 $P_1 \ldots, P_k, Q_1, \ldots, Q_\ell$ 使得

$$P_k \cdots P_1 A Q_1 \cdots Q_\ell = E.$$

故

$$A = (P_k \cdots P_1)^{-1} (Q_1 \cdots Q_\ell)^{-1} = P_1^{-1} \cdots P_k^{-1} Q_\ell^{-1} \cdots Q_1^{-1}.$$

因为初等矩阵的逆还是初等矩阵, 所以推论成立. □