

2012 年 11 月 22 日
山田光太郎
kotaro@math.titech.ac.jp

線形代数学第二 B 講義資料 8

お知らせ

- OCW/OCW-i にて「11 月 29 日に中間試験」と誤って表示されておりました。11 月 29 日には中間試験をいたしません(11 月 15 日に訂正しました)。中間試験は 10 月に予告したとおり 2013 年 1 月 10 日です。一部の方にご心配をおかけし、申しわけありません。
- 今回は都合により提出物は受け付けません。今回の講義に関する質問も来週 11 月 29 日分の提出用紙をご利用ください。

前回までの訂正

- 講義資料 7, 3 ページ 3 行目: $A = {}^t\bar{A} \Rightarrow A^* = \bar{A}$
- 講義資料 7, 3 ページ: 定義 7.3 に次を追加:
また、複素数を成分とする n 次正方行列 A が $A^*A = I$ を満たすとき、 A をユニタリ行列 a unitary matrix という。
- 講義資料 7, 4 ページ 6 行目: $\{v_1, \dots, v_n\} \Rightarrow \{v_1, \dots, v_n\}$
- 講義資料 7, 4 ページ, 問題 7-5: 9 つの成分が全て 0 でないもの \Rightarrow 成分が 9 つすべて 0 でないもの(こういう意味です)
- 講義資料 7, 4 ページ, 問題 7-6 の 3, 4 番目の項目: $x(t_1) \Rightarrow u(t_1); y(t_1) \Rightarrow v(t_1)$.

授業に関する御意見

- OCW-i には 11 月 29 日に中間試験とありましたが、本当にやるんですか?
山田のコメント: 申しわけありません。手違いです。10 月に予告したように 1 月です。
- 来週は中間試験が多くて困っています。山田のコメント: なのでこの科目は年明けにやりますね。
- 授業のプリント数が少しずつ少なくなってきています!
山田のコメント: そうなんです。提出物も減っているし。
- エルミート行列とかなつかしかった。山田のコメント: そんな昔?
- 自炊が面倒になってきました。山田のコメント: そこを乗り越えれば
- 周回積分の記号とト音記号が似ていることに気づいた。山田のコメント: ほんとだ(?)
- ビッグコア Mk-III が強いです。山田のコメント: そうなんですか。
- 先週休んでしまい困った。山田のコメント: それは困ったね。
- 特にありません。山田のコメント: me, too

質問と回答

質問: 授業にて、 X は対称行列で、 $\mathbf{a} = \begin{bmatrix} \cos t \\ \sin t \end{bmatrix}$ としたときに、 $2(X\mathbf{a}(t), \mathbf{a}(t)) = 0$ から $X\mathbf{a}(t) // \mathbf{a}'(t)$ が導ける理由を教えてください。

お答え: $\mathbf{a}'(t)$ は $\mathbf{a}(t)$ に直交する単位ベクトルになっています。とくに $\mathbf{a}'(t) \in \langle \mathbf{a}(t) \rangle^\perp$ ($\mathbf{a}'(t)$ は、 $\mathbf{a}(t)$ が生成する \mathbb{R}^2 の部分空間の直交補空間の要素である)。ここで講義資料 6 の命題 6.15 から $\dim \langle \mathbf{a}(t) \rangle^\perp = 2 - 1 = 1$ なので $\mathbf{a}'(t)$ は $\langle \mathbf{a}(t) \rangle^\perp$ の基底である。一方、 $(X\mathbf{a}(t), \mathbf{a}(t)) = 0$ だから $X\mathbf{a}(t) \in \langle \mathbf{a}(t) \rangle^\perp$ 。したがって、 $X\mathbf{a}(t)$ は

$\mathbf{a}'(t)$ の線形結合, すなわちスカラー倍で表される.

質問: 「 $\mathbf{a}' \perp \mathbf{a} \Rightarrow X\mathbf{a}(t_1) // \mathbf{a}(t_1)$ 」というのはなぜですか?

お答え: 文脈を明確にすべきですが, 推測するところ上の質問と同じですね. とくに考えている空間が 2 次元であることは重要です.

質問: 対角化の例として授業や演習問題のように $F(t) = (X\mathbf{u}(t), \mathbf{u}(t))$ ($\mathbf{u}(t) = \begin{pmatrix} \cos t \\ \sin t \end{pmatrix}$) (X : 対称行列) が最小値をとるとき $F'(t) = 0$ のとき最小値をとると導いていますが, $F(t)$ が最小値をとるときは $F'(t) = 0$ が成立するのではないですか. なぜ $F'(t) = 0$ のとき $F(t)$ は最小値をとるのですか?

お答え: 講義ではただだと話してしまったのですが, 話の筋を整理します: (1) $F(t)$ は周期関数だから, 最大値および最小値をとる. (2) $t = t_1$ で $F(t)$ は最小値をとるとせよ. すると $F'(t_1) = 0$ である. というロジックです.

質問: 3 次直交行列は一般に $\sin \theta$ と $\cos \theta$ と $\sin \varphi$ と $\cos \varphi$ で表現できますか? どのように導くのが教えて下さい.

お答え: 講義で述べたように, 3 次直交行列の一般形を表すには 3 パラメータ必要なので, θ, φ だけでは表せません.

質問: 問題 7-5 が分かりません. 3 次の行列なので, 成分計算ですすめると解けそうな気がしますが, もっと楽に解く方法があるのでしょうか. 出来れば考え方と軽く方針を教えてください.

お答え: 講義でヒントを出した. 正規直交基底をつくる.

質問: 7-3: ユニタリ行列は $I = A^*A$ より $|I| = |A^*||A| = \overline{|A|}|A|$ より $\overline{|A|} = \frac{1}{|A|}$ で, $|A| = re^{ix}$ ($r \in \mathbb{R}$) とおくと $re^{-ix} = \frac{e^{-ix}}{r}$ より $r = \pm 1$ で $|A| = \pm e^{ix} = \pm(\cos x + i \sin x)$ ですかね?

お答え: 間違っはイませんが, ちょっと補足: $-e^{ix} = e^{i(x+\pi)}$ なので \pm は不要ですね. 複素数に少しなれてくると次のように簡単に書けます: $\overline{|A|}|A| = 1$ だから $|A|$ は絶対値 1 の複素数. すなわち $|A| = e^{ix}$ ($x \in \mathbb{R}$) と書ける.

質問: 2 次の正方行列全体 $M_2(\mathbb{K})$ と数ベクトル全体 \mathbb{K}^4 はともに線形空間になるので, 少なくとも線形代数において

は $\begin{pmatrix} a & b \\ c & d \end{pmatrix}$ と $\begin{pmatrix} a \\ b \\ c \\ d \end{pmatrix}$ は見た目が違うだけで同一のものとみなせるということで OK ですか?

お答え: 「線形代数においては」は言い過ぎ. $M_2(\mathbb{K})$ と \mathbb{K}^4 はベクトル空間とみなすときは同じ. だが, $M_2(\mathbb{K})$ の要素を \mathbb{K}^2 にかけることはできるが \mathbb{K}^4 の要素を \mathbb{K}^2 にかけることはできない. すなわち「何をみるか」によって同一のものとみなせるかどうかは違ってくる.

質問: 正規直交基底とは何ですか? 他の基底とはどう違いますか. お答え: 講義資料 6, 定義 6.8

質問: $(\mathbf{a}_k, \mathbf{a}_l) = \sum_{i=1}^n a_{ki}a_{li}$ から “ A は直交行列である” のが $\{\mathbf{a}_1, \dots, \mathbf{a}_n\}$ が正規直交基底であるための必要条件であるのがわかる. 十分条件であることの証明はどうやってしたらいいですか.

お答え: ご質問にある式だけで ok です. $A = [\mathbf{a}_1, \dots, \mathbf{a}_n]$ ($\mathbf{a}_j \in \mathbb{R}^n$) とし $\mathbf{a}_j = {}^t[a_{1j}, \dots, a_{nj}]$ とおけば $A = [a_{ij}]$ と表されますが (ここまでがご質問の前提) ${}^tAA = [b_{kl}]$ とすれば $b_{kl} = \sum_{i=1}^n a_{il}a_{ik} = (\mathbf{a}_l, \mathbf{a}_k)$ なので

$${}^tAA = I \quad \Leftrightarrow \quad b_{kl} = \delta_{kl} \quad \Leftrightarrow \quad (\mathbf{a}_l, \mathbf{a}_k) = \delta_{kl}.$$

ただし δ_{kl} は Kronecker の delta 記号.

質問: 直交行列による線形変換の性質を教えてください. お答え: 講義資料 7, 命題 7.4 (5)

質問: パラメータの自由度の定義がわかりませんでした. $\frac{1}{2}n(n-1)$ とパラメータの数の関係はどうなっているのですか.

お答え: 明確に定義はしていない, この講義の範囲ではいい加減な話です: 一般に n 次の直交行列全体はいくつのパラメータを用いて表されるか? という問いをいい加減に考えよう. n 次正方行列は n^2 個の成分を持っているので n^2 個のパラメータで表されると思っで良い. ここで, 行列 A が直交行列である, という条件は $\frac{1}{2}n(n+1)$ 個の等式で表される. 実際 ${}^tAA = I$ は n^2 個の等式であるが, 左辺も右辺も対称行列だから, 独立な式は $\frac{1}{2}n(n+1)$ 本である (これらが独立である, というものの定義も証明もここでは避けている). したがって, ${}^tAA = I$ を満たす A の集まりは $n^2 - \frac{1}{2}n(n+1) = \frac{1}{2}n(n-1)$ 個のパラメータを用いて表せそうである.

質問: 複素数におけるエルミート行列を ${}^tA = A$ ではなく $A^t = A$ と表していましたが, この添字の位置は実数, 複素数を扱うかの違いで表記が異なるものでいいのですか.

お答え: A^t という記号は使っていません. A^* です.

8 固有値・固有ベクトル・対角化

固有値 ここではしばらくの間、とくにことわりのない限りスカラーを複素数としておく。

定義 8.1. 複素数を成分とする n 次正方行列 A に対して関係式

$$Ax = \lambda x \quad (\lambda \in \mathbb{C}, x \in \mathbb{C}^n, x \neq o)$$

が成り立っているとき、スカラー λ を A の固有値 an eigenvalue, x を A の固有値 λ に関する固有ベクトル an eigenvector with respect to the eigenvalue λ という。

命題 8.2. スカラー λ が正方行列 A の固有値であるための必要十分条件は $\det(A - \lambda I) = 0$ が成り立つことである。ただし I は単位行列。

証明：関係式 $Ax = \lambda x$ は $(A - \lambda I)x = o$ と書き換えられる。これを満たす零ベクトルでないベクトル x が存在するための必要十分条件は $A - \lambda I$ が正則行列でないことである（補題 2.15 参照）。

ここで n 次正方行列 A に対して、

$$(8.1) \quad f_A(\lambda) := \det(A - \lambda I)$$

とおくと、これは λ の n 次の多項式で、とくに λ^n の係数は $(-1)^n$ である。これを A の固有多項式、特性多項式 the characteristic polynomial という。固有値は f_A の根であるが、その重複度（注意 8.11 参照）を固有値の重複度 multiplicity という。命題 8.2 と代数学の基本定理 8.10 より

系 8.3. 複素数を係数とする n 次正方行列は、複素数の固有値を重複度も含めてちょうど n 個持つ。

命題 8.4. 正方行列 A と正則行列 P に対して $f_{P^{-1}AP} = f_A$ が成り立つ。とくに $P^{-1}AP$ と A の固有値は重複度を含めて一致する。

固有ベクトルの一次独立性

命題 8.5. 正方行列 A の互いに相異なる固有値 $\lambda_1, \dots, \lambda_k$ に関する固有ベクトル x_1, \dots, x_k は一次独立。

証明：スカラー s_1, \dots, s_k に対して $s_1 x_1 + \dots + s_k x_k = o$ が成り立っているとす。この等式の両辺に A を左からかけて、固有ベクトルの定義 $Ax_j = \lambda_j x_j$ を用いると $s_1 \lambda_1 x_1 + \dots + s_k \lambda_k x_k = o$ が得られる。この式に更に A をかけると $s_1 \lambda_1^2 x_1 + \dots + s_k \lambda_k^2 x_k = o$, これをつづけて

$$s_1 \lambda_1^l x_1 + \dots + s_k \lambda_k^l x_k = o \quad (l = 0, \dots, k-1)$$

が得られる。これをまとめると

$$[x_1, \dots, x_k]SV = O \quad \left(S = \begin{bmatrix} s_1 & 0 & \dots & 0 \\ 0 & s_2 & \dots & 0 \\ \vdots & \vdots & \ddots & \vdots \\ 0 & 0 & \dots & s_k \end{bmatrix}, V = \begin{bmatrix} 1 & \lambda_1 & \dots & \lambda_1^{k-1} \\ 1 & \lambda_2 & \dots & \lambda_2^{k-1} \\ \vdots & \vdots & \ddots & \vdots \\ 1 & \lambda_k & \dots & \lambda_k^{k-1} \end{bmatrix} \right)$$

が得られる。とくに λ_j は互いに異なるスカラーなので、命題 8.9 から V は正則行列。したがって、上の式の両辺に V^{-1} を右からかけると $[x_1, \dots, x_k]S = O$ 。すなわち $s_1 x_1 = o, \dots, s_k x_k = o$ が成り立つ。ここで、固有ベクトル x_j は零ベクトルでないから $s_1 = s_2 = \dots = s_k = 0$ を得る。

対角化 正方行列 $A = [a_{ij}]$ の (i, i) -成分を対角成分 the diagonal components というのであった。とくに、対角成分以外のすべての成分が 0 であるような正方行列を対角行列 a diagonal matrix という。対角成分が 1 行目から順に t_1, \dots, t_n であるような n 次対角行列を

$$\text{diag}[t_1, \dots, t_n] := \begin{bmatrix} t_1 & 0 & \dots & 0 \\ 0 & t_2 & \dots & 0 \\ \vdots & \vdots & \ddots & \vdots \\ 0 & 0 & \dots & t_n \end{bmatrix}$$

と表すこともある。

正方行列 A を対角化する to diagonalize とは、正則行列 P を選んで

$$(8.2) \quad P^{-1}AP = \Lambda \quad (\Lambda = \text{diag}[\lambda_1, \dots, \lambda_n])$$

の形にすることである。

命題 8.6. 正方行列 A が (8.2) のように対角化されているならば、 λ_j は A の固有値で、 P の第 j 列は A の固有値 λ_j に対する固有ベクトルである。とくに $\{\lambda_1, \dots, \lambda_n\}$ は A の固有値と重複度を含めて一致する。

証明：式 (8.2) を $AP = P\Lambda$ と書き換え、 $P = [p_1, \dots, p_n]$ と分解して $p_j \neq 0$ (なぜか) に注意すればよい。後半は命題 8.4 から得られる。

注意 8.7. 任意の正方行列が対角化できるわけではない。実際

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

は対角化できない。

定理 8.8. 正方行列 A の固有値 $\lambda_1, \dots, \lambda_n$ がすべて固有多項式の単根であるとする。このとき、 A は対角化可能である。

証明：各 λ_j に対する固有ベクトル p_j をとり、 $P := [p_1, \dots, p_n]$ とおくと、固有値が互いに相異なることと命題 8.5 から P は正則。さらに $Ap_j = \lambda_j p_j$ なので $AP = P\Lambda$ ($\Lambda = \text{diag}[\lambda_1, \dots, \lambda_n]$) である。

固有多項式が重根を持つ場合は次回以降に扱う。

復習 今回用いたいくつかの事実を復習しておく。

命題 8.9 (Vandermonde の行列式). スカラ a_1, \dots, a_k ($k \geq 2$) に対して

$$V(a_1, \dots, a_k) := \begin{bmatrix} 1 & a_1 & a_1^2 & \dots & a_1^{k-1} \\ 1 & a_2 & a_2^2 & \dots & a_2^{k-1} \\ \vdots & \vdots & \vdots & \ddots & \vdots \\ 1 & a_k & a_k^2 & \dots & a_k^{k-1} \end{bmatrix} \quad \text{とおくと} \quad \det(V(a_1, \dots, a_k)) = \prod_{i < j} (a_j - a_i)$$

が成り立つ。ここで右辺は $1 \leq i < j \leq k$ を満たす組 (i, j) 全てについて積をとることを表している。とくに $V(a_1, \dots, a_k)$ が正則行列であるための必要十分条件は a_1, \dots, a_k が互いに異なることである。

証明：行列のサイズ k に関する数学的帰納法による。

$$\det(V(a_1, a_2)) = \begin{vmatrix} 1 & a_1 \\ 1 & a_2 \end{vmatrix} = a_2 - a_1$$

なので, $k = 2$ のとき結論は正しい.
 いま, $k \geq 2$ が与えられ, 任意のスカラー $\alpha_1, \dots, \alpha_{k-1}$

$$\det(V(\alpha_1, \dots, \alpha_{k-1})) = \prod_{i < j} (\alpha_j - \alpha_i)$$

が成り立っているとす. このとき, スカラー a_1, \dots, a_k に対して $V := V(a_1, \dots, a_k)$ とおき, その第 l 行 ($l = 2, \dots, k$) から第 1 行をそれぞれ引くと,

$$\begin{aligned} \det V &= \begin{vmatrix} 1 & a_1 & a_1^2 & \dots & a_1^{k-1} \\ 0 & a_2 - a_1 & a_2^2 - a_1^2 & \dots & a_2^{k-1} - a_1^{k-1} \\ \vdots & \vdots & \vdots & \ddots & \vdots \\ 0 & a_k - a_1 & a_k^2 - a_1^2 & \dots & a_k^{k-1} - a_1^{k-1} \end{vmatrix} \\ &= (a_2 - a_1)(a_3 - a_1) \dots (a_k - a_1) \begin{vmatrix} 1 & a_1 & a_1^2 & \dots & a_1^{k-1} \\ 0 & 1 & a_2 + a_1 & \dots & a_2^{k-2} + a_2^{k-3}a_1 + \dots + a_1^{k-2} \\ \vdots & \vdots & \vdots & \ddots & \vdots \\ 0 & 1 & a_k + a_1 & \dots & a_k^{k-2} + a_k^{k-3}a_1 + \dots + a_1^{k-2} \end{vmatrix} \\ &= (a_2 - a_1)(a_3 - a_1) \dots (a_k - a_1) \begin{vmatrix} 1 & a_2 + a_1 & \dots & a_2^{k-2} + a_2^{k-3}a_1 + \dots + a_1^{k-2} \\ \vdots & \vdots & \ddots & \vdots \\ 1 & a_k + a_1 & \dots & a_k^{k-2} + a_k^{k-3}a_1 + \dots + a_1^{k-2} \end{vmatrix} \end{aligned}$$

この最後の行列式をとっている行列を $V' := [b_1, \dots, b_{k-1}]$ と列ベクトルに分解し,

$$b'_1 = b_1, \quad b'_2 = b_2 - a_1 b'_1, \quad b'_3 = b_3 - a_1 b'_2 - a_1^2 b'_1, \quad \dots, \quad b'_{k-1} = b_{k-1} - a_1 b'_{k-2} - a_1^2 b'_{k-3} - \dots - a_1^{k-2} b'_1$$

とおけば,

$$\det V' = \det[b_1, \dots, b_{k-1}] = \det(V(a_2, a_3, \dots, a_k))$$

となるので, 数学的帰納法の仮定から結論が得られる.

前期に以下の定理を紹介した. 証明はこの講義の範囲を超えるのでここでは述べない.

定理 8.10 (代数学の基本定理). 複素数 a_0, \dots, a_n ($n \neq 0$) を係数とする多項式

$$f(x) = a_n x^n + a_{n-1} x^{n-1} + \dots + a_1 x + a_0$$

は複素数の根をもつ. とくに $f(x)$ は

$$(8.3) \quad f(x) = a_n (x - \lambda_1)(x - \lambda_2) \dots (x - \lambda_n) \quad (\lambda_j \in \mathbb{C}, j = 1, \dots, n)$$

の形に因数分解される.

注意 8.11. 式 (8.3) に現れる根 $\lambda_1, \dots, \lambda_n$ のうち, 同じものをまとめて

$$f(x) = a_n (x - \lambda_{j_1})^{k_1} (x - \lambda_{j_2})^{k_2} \dots (x - \lambda_{j_m})^{k_m} \quad (k_1 + \dots + k_m = n)$$

とおく. ただし k_l は正の整数, $\lambda_{j_1}, \dots, \lambda_{j_m}$ は互いに異なる複素数である. このように表したとき, k_l を根 λ_{j_l} の重複度 the multiplicity という. とくに, 重複度 1 の根を単根 a simple root, 重複度 2 以上の根を重根 a multiple root という.

問題

8-1 命題 8.4 を示しなさい .

8-2 命題 8.6 を示しなさい .

8-3 例 8.7 を確かめなさい . (ヒント : 固有値は 1 (重根) だから対角化されるとしたら $P^{-1}AP = I$.)

8-4 テキスト 135 ページ , 例 1 ; 136 ページ , 問 1, 例 2, 問 2 ; 156 ページ , 6.1 ; 157 ページ , 6.7, 6.8 ; 158 ページ , 6.18 (オプション) .

8-5 行列

$$A = \begin{bmatrix} 1 & 1 & -2 & -1 \\ -3 & -9 & 8 & -5 \\ -4 & -11 & 9 & -7 \\ -1 & -1 & 0 & -1 \end{bmatrix}$$

に対して

- A の固有多項式 f_A を求めなさい .
- A の固有値を求めなさい .
- A のそれぞれの固有値に対する固有ベクトルを一つずつ求めなさい . (ヒント : 固有値を λ とするとき , 同次連立 1 次方程式 $(A - \lambda I)x = o$ をとき , o でない解をひとつ選べば良い .
- $\Lambda = P^{-1}AP$ が対角行列になるような正方行列 P と , Λ をそれぞれひとつずつ求めなさい .

8-6 次の行列を対角化しなさい .

$$\begin{bmatrix} 1 & 2 & 3 & 4 \\ 2 & 3 & 4 & 1 \\ 3 & 4 & 1 & 2 \\ 4 & 1 & 2 & 3 \end{bmatrix}, \quad \begin{bmatrix} 1 & -1 & 1 \\ -1 & 1 & 1 \\ 1 & 1 & -1 \end{bmatrix}, \quad \begin{bmatrix} 0 & 1 & -1 \\ -1 & 0 & 1 \\ 1 & -1 & 0 \end{bmatrix},$$

$$\begin{bmatrix} \cos \theta & \sin \theta \\ \sin \theta & -\cos \theta \end{bmatrix}, \quad \begin{bmatrix} \cos \theta & -\sin \theta \\ \sin \theta & \cos \theta \end{bmatrix}.$$

ただし θ は実数である .