

Lineární algebra : Vlastní čísla

(8. přednáška)

Daniel Dombek, Luděk Kleprlík,
Karel Klouda

`daniel.dombek@fit.cvut.cz`, `ludek.kleprlik@fit.cvut.cz`,
`karel.klouda@fit.cvut.cz`

Katedra aplikované matematiky
Fakulta informačních technologií

České vysoké učení technické v Praze

LS 2021/2022

vytvořeno: 15. února 2022, 13:47

- 1 Úvod
- 2 Vlastní čísla a vektory lineárního operátoru a matice
- 3 Diagonalizace operátoru a podobnost matic

O co nám jde?

- Budeme zkoumat lineární operátory $A \in \mathcal{L}(V)$ a jejich matice ${}^x A$. V bude VP nad **tělesem komplexních čísel!**
- Ukážeme si, že pro každý operátor existují vektory, pro které je aplikování operátoru A rovno jednoduchému násobení nějakým číslem z tělesa \mathbb{C} , tj. existují vektory x a pro ně $\alpha \in \mathbb{C}$ tak, že

$$Ax = \alpha x.$$

- Spec. pro čtvercové matice $A \in \mathbb{C}^{n,n}$: budeme hledat x a číslo $\alpha \in \mathbb{C}$ tak, že

$$Ax = \alpha x.$$

- Těmto vektorům a číslům budeme říkat vlastní vektory a vlastní čísla operátoru (resp. matice).

Báze z vlastních vektorů

- Pro některé lineární operátory bude možné sestavit z vlastních vektorů bázi, označme takový operátor $A \in \mathcal{L}(V_n)$ a tuto bázi $\mathcal{X} = (x_1, \dots, x_n)$.
- Označme dále vlastní čísla příslušná těmto vektorům $\lambda_1, \dots, \lambda_n$, tj. pro všechna $i \in \hat{n}$ platí:

$$Ax_i = \lambda_i x_i.$$

- Zkusme si sestavit matici ${}^{\mathcal{X}}A$: její i tý sloupec je (jak strašně dobře víme), roven

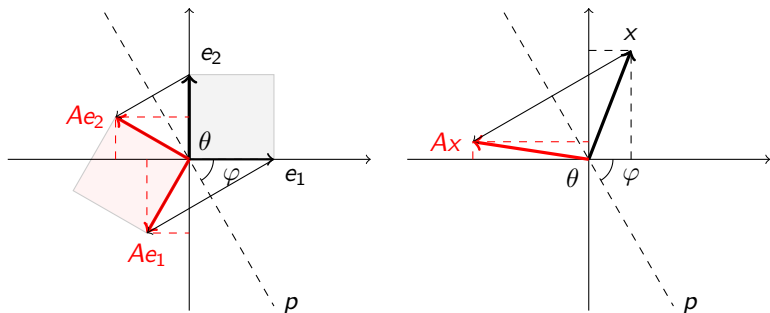
$$({}^{\mathcal{X}}A)_i = (\lambda_i x_i)_{\mathcal{X}} = \lambda_i (x_i)_{\mathcal{X}} = \lambda_i e_i,$$

kde e_i je i tý vektor standardní báze $\mathbb{C}^{n,1}$.

- Matice ${}^{\mathcal{X}}A$ je tedy **diagonální** matice a na diagonále má vlastní čísla. V této bázi je tedy extrémně jednoduché aplikovat zobrazení A , neboť násobení diagonální maticí odpovídá pouhému vynásobení n čísel z tělesa.

Geometrická interpretace vlastních čísel (1 ze 2)

Operátor zrcadlení podle přímky: Necht' $\varphi \in \mathbb{R}$ a p je přímka procházející počátkem, která svírá s osou x úhel φ . Každému vektoru v v \mathbb{R}^2 přiřadíme vektor osově souměrný podle přímky p .



Již dříve jsme odvodili, že pro tento lineární operátor je matice ve standardní bázi rovna

$$\varepsilon A = \begin{pmatrix} \cos(2\varphi) & \sin(2\varphi) \\ \sin(2\varphi) & -\cos(2\varphi) \end{pmatrix} = \varepsilon(A^{-1}).$$

Geometrická interpretace vlastních čísel (2 ze 2)

- Co jsou vlastní čísla a vektory operátoru zrcadlení?
- Jistě pro vektory x ležící na přímce p platí

$$Ax = x,$$

jedná se tedy o vlastní vektory s vlastním číslem $\lambda_1 = 1$.

- Bud' p' přímka, která je kolmá na přímku p a také prochází počátkem, pak pro $x \in p'$ platí

$$Ax = -x,$$

jedná se tedy o vlastní vektory s vlastním číslem $\lambda_2 = -1$.

- Jak snadno ověříme, vlastní vektory příslušné danému vlastnímu číslu tvoří podprostor (do toho!).
- V našem případě jsou tyto podprostory dva: přímky p a p' .

Hledání vlastních čísel matice

- Pro danou matici $\mathbb{A} \in \mathbb{C}^{n,n}$ hledáme **nenulové** vektory \mathbf{x} a čísla $\lambda \in \mathbb{C}$ splňující rovnici

$$\mathbb{A}\mathbf{x} = \lambda\mathbf{x}.$$

- To je ekvivalentní hledání λ takové, že homogenní soustava rovnic

$$(\mathbb{A} - \lambda\mathbb{E})\mathbf{x} = \mathbf{0}$$

má nenulové řešení.

- To nastává ale tehdy a jen tehdy (vzpomeňme Frobeniovu větu), když je matice $\mathbb{A} - \lambda\mathbb{E}$ singulární (neregulární).
- A to je zase ekvivalentní tomu, že determinant matice $\mathbb{A} - \lambda\mathbb{E}$ je roven nule: **abychom tedy našli vlastní číslo, řešíme rovnici**

$$\det(\mathbb{A} - \lambda\mathbb{E}) = 0.$$

- Pro zadané vlastní číslo λ už najdeme vlastní vektory snadno jako řešení homogenní soustavy uvedené výše.

Příklad 1/2

- Najdeme vlastní čísla a vlastní vektory matice

$$\mathbb{A} = \begin{pmatrix} 5 & -2 & 2 \\ -1 & 4 & -1 \\ -4 & 4 & -1 \end{pmatrix}.$$

- Spočítáme:

$$\det(\mathbb{A} - \lambda \mathbb{E}) = -(\lambda - 2)(\lambda - 3)^2.$$

- Kořeny tohoto polynomu (budeme mu říkat charakteristický polynom) jsou $\lambda_1 = 2$ a $\lambda_2 = 3$.
- Dostáváme tedy dvě vlastní čísla 2 a 3.

Příklad 2/2

- Vlastní vektory \mathbb{A} k vlastnímu číslu $\lambda_1 = 2$ jsou všechna nenulová řešení soustavy $(\mathbb{A} - 2\mathbb{E})x = \theta$. Po výpočtu dostaneme množinu řešení jako $\langle(-2, 1, 4)\rangle$. Příslušný vlastní vektor je libovolný nenulový prvek x_1 této množiny (podprostoru).
- Podobně pro nalezení vlastních vektorů \mathbb{A} k vlastnímu číslu $\lambda_2 = 3$ řešíme homogenní soustavu s maticí $\mathbb{A} - 3\mathbb{E}$ a vyjde nám $\langle(1, 1, 0), (-1, 0, 1)\rangle$. Vlastní vektor je opět libovolný $\theta \neq x_2 \in \langle(1, 1, 0), (-1, 0, 1)\rangle$.
- Snadno ověříme, že pro vlastní vektory skutečně platí:

$$\mathbb{A}x_1 = 2x_1 \quad \text{a} \quad \mathbb{A}x_2 = 3x_2.$$

Hlavní body

1 Úvod

2 Vlastní čísla a vektory lineárního operátoru a matice

3 Diagonalizace operátoru a podobnost matic

Definice

Řekneme, že $\lambda \in \mathbb{C}$ je **vlastní číslo operátoru** $A \in \mathcal{L}(V)$ právě když existuje $x \in V$, $x \neq \theta$, takový, že $Ax = \lambda x$. Vektor x pak nazýváme **vlastním vektorem operátoru** A příslušejícím vlastnímu číslu λ . Množinu všech vlastních čísel A nazýváme **spektrém** A a značíme $\sigma(A)$.

Víme, že na matici $\mathbb{A} \in \mathbb{C}^{n,n}$ se můžeme dívat také jako na lineární zobrazení

$$A : \mathbb{C}^n \rightarrow \mathbb{C}^n : \mathbf{x} \mapsto \mathbb{A} \cdot \mathbf{x}.$$

V tomto speciálním případě dostaneme pro $\mathbb{A} \in \mathbb{C}^{n,n}$:

Definice

Řekneme, že $\lambda \in \mathbb{C}$ je **vlastní číslo matice** $\mathbb{A} \in \mathbb{C}^{n,n}$ právě když existuje $\mathbf{x} \in \mathbb{C}^n$, $\mathbf{x} \neq \theta$, takový, že $\mathbb{A} \cdot \mathbf{x} = \lambda \mathbf{x}$. Vektor \mathbf{x} pak nazýváme **vlastním vektorem matice** \mathbb{A} příslušejícím vlastnímu číslu λ . Množinu všech vlastních čísel \mathbb{A} nazýváme **spektrém** \mathbb{A} a značíme $\sigma(\mathbb{A})$.

Charakteristický polynom

Ukážeme si, že hledat vlastní čísla operátoru $A \in \mathcal{L}(V_n)$ je stejná úloha, jako hledat vlastní čísla matice ${}^{\mathcal{X}}A \in \mathbb{C}^{n,n}$. Dokonce je jedno, jakou bází \mathcal{X} zvolíme!

Lemma

Nechť $A \in \mathcal{L}(V_n)$ a \mathcal{X} je báze V_n . Označme

$$p_A(\lambda) := \det^{\mathcal{X}}(A - \lambda E).$$

Potom p_A je polynom stupně n a nezávisí na volbě báze \mathcal{X} .

Definice

Polynom p_A z předchozího pozorování nazýváme **charakteristickým polynomem** operátoru A . Polynom $p_{\mathbb{A}} = \det(\mathbb{A} - \lambda \mathbb{E})$ nazýváme **charakteristickým polynomem** matice \mathbb{A} .

Něco málo o polynomech

Polynom komplexní proměnné x stupně $n \in \mathbb{N}_0$ je funkce

$$p(x) = \sum_{i=0}^n \alpha_i x^i,$$

kde $\alpha_i \in \mathbb{C}$ jsou koeficienty a $\alpha_n \neq 0$. O polynomech toho mnoho víme:

- (základní věta algebry): Každý polynom stupně alespoň jedna má alespoň jeden kořen.
- Z toho vyplyne, že **každý operátor má alespoň jedno vlastní číslo**.
- Jsou-li $\lambda_1, \dots, \lambda_k$ všechny různé kořeny $p(x)$, pak existují jednoznačně určená čísla (násobnosti kořenů) $\ell_1, \dots, \ell_k \in \mathbb{N}$ tak, že

$$p(x) = \alpha_n \prod_{i=1}^k (x - \lambda_i)^{\ell_i}$$

$$\text{a } \ell_1 + \dots + \ell_k = n.$$

Charakteristický polynom a spektrum

Víme z dřívějších

Věta

Zobrazení $A \in \mathcal{L}(P_m, Q_n)$ je izomorfismus, právě když je matice ${}^{\mathcal{X}}A^{\mathcal{Y}}$ regulární. V takovém případě nutně platí $m = n$.

Věta

Nechť $A \in \mathcal{L}(V_n)$. Potom $\sigma(A) \neq \emptyset$ a platí

$$\sigma(A) = p_A^{-1}(\{0\}) \equiv \{\lambda \in \mathbb{C} \mid p_A(\lambda) = 0\}.$$

Důsledek

Spektrum operátoru $A \in \mathcal{L}(V_n)$ je rovno spektru matice zobrazení A v libovolné bázi \mathcal{X} prostoru V_n , tj. $\sigma(A) = \sigma({}^{\mathcal{X}}A)$.

Dvě různé násobnosti vlastních čísel 1/2

Definice

Nechť $A \in \mathcal{L}(V_n)$, $\lambda_0 \in \sigma(A)$. Násobnost čísla λ_0 jako kořene charakteristického polynomu p_A operátoru A nazýváme **algebraickou násobností** vlastního čísla λ_0 a značíme ji $\nu_a(\lambda_0)$.

Podprostor $\ker(A - \lambda_0 E)$ nazýváme **vlastním podprostorem operátoru A příslušejícím vlastnímu číslu λ_0** .

Číslo $d(A - \lambda_0 E)$ nazýváme **geometrickou násobností** vlastního čísla λ_0 a značíme ji $\nu_g(\lambda_0)$.

Poznámka

- Číslo $\nu_g(\lambda_0)$ je tedy maximální délka LN souboru vlastních vektorů k vlastnímu číslu λ_0 .
- Pro matici $\mathbb{A} \in \mathbb{C}^{n,n}$ platí $\nu_g(\lambda_0) = \dim S_0$, kde S_0 je řešení homogenní soustavy $(\mathbb{A} - \lambda_0 \mathbb{E})\mathbb{x} = \theta$.

Věta

Nechť $A \in \mathcal{L}(V_n)$, $\lambda_0 \in \sigma(A)$. Potom

$$\nu_g(\lambda_0) \leq \nu_a(\lambda_0).$$

Ještě jeden příklad

- Najdeme vlastní čísla a vlastní vektory matice

$$\mathbb{B} = \begin{pmatrix} 2 & 4 & -3 \\ -1 & 10 & -6 \\ -1 & 8 & -4 \end{pmatrix}.$$

- Postupujeme stejně jako dříve příkladě a dostáváme

$$p_{\mathbb{B}}(\lambda) = \det(\mathbb{B} - \lambda\mathbb{E}) = -(\lambda - 2)(\lambda - 3)^2.$$

- Proto $\sigma(\mathbb{B}) = \{2, 3\}$, ale vlastní podprostory nám nyní vyjdou:

$$\lambda_1 = 2: \quad \langle (0, 3, 4) \rangle,$$

$$\lambda_2 = 3: \quad \langle (1, 1, 1) \rangle.$$

- Tedy matice \mathbb{A} z kapitoly úvod a \mathbb{B} mají stejná spektra a charakteristické polynomy, ale různé vlastní podprostory a tedy různé geometrické násobnosti vlastního čísla 3.

Hledání vlastních čísel operátoru 1/2

Algoritmus (Výpočet vlastních čísel operátoru A na prostoru V_n a algebraických násobností)

1. Zvolme bázi \mathcal{X} prostoru V_n .
2. Spočtěme charakteristický polynom operátoru A , $p_A(\lambda) = \det^{\mathcal{X}}(A - \lambda E)$, pomocí známých metod pro výpočet determinantu.
3. Nalezněme všechny kořeny polynomu p_A . Tyto kořeny jsou vlastní čísla operátoru A .
4. Algebraická násobnost vlastního čísla λ , tj. $\nu_a(\lambda)$, je násobnost λ jako kořene charakteristického polynomu p_A .

Algoritmus (Výpočet vlastních vektorů operátoru a geometrických násobností)

Mějme lineární operátor A na prostoru V_n a jeho vlastní číslo $\lambda \in \mathbb{C}$.

1. *Vlastní vektory příslušné vlastnímu číslu λ jsou všechna nenulová řešení rovnice $(A - \lambda E)x = \theta$.*
2. *Geometrická násobnost vlastního čísla λ , tj. $\nu_g(\lambda)$, je dimenze vlastního podprostoru $\ker(A - \lambda E)$.*

Algoritmus (Výpočet vlastních čísel matice $\mathbb{A} \in \mathbb{C}^{n,n}$ a jejich algebraických násobností)

1. Spočtáme charakteristický polynom matice \mathbb{A} , $p_{\mathbb{A}}(\lambda) = \det(\mathbb{A} - \lambda\mathbb{E})$, pomocí známých metod pro výpočet determinantu.
2. Nalezneme všechny kořeny polynomu $p_{\mathbb{A}}$. Tyto kořeny jsou vlastní čísla operátoru \mathbb{A} .
3. Algebraická násobnost vlastního čísla λ , tj. $\nu_a(\lambda)$, je násobnost λ jako kořene charakteristického polynomu $p_{\mathbb{A}}$.

Algoritmus (Výpočet vlastních vektorů matice \mathbb{A} a jejich geometrických násobností)

Mějme matici $\mathbb{A} \in \mathbb{C}^{n,n}$ a její vlastní číslo $\lambda \in \mathbb{C}$.

1. *Vlastní vektory příslušné vlastnímu číslu λ jsou všechna nenulová řešení homogenní rovnice $(\mathbb{A} - \lambda\mathbb{E}) \cdot \mathbf{x}^T = \theta$.*
2. *Geometrická násobnost vlastního čísla λ , tj. $\nu_g(\lambda)$, je dimenze podprostoru všech řešení homogenní rovnice $(\mathbb{A} - \lambda\mathbb{E}) \cdot \mathbf{x}^T = \theta$.*

Hlavní body

1 Úvod

2 Vlastní čísla a vektory lineárního operátoru a matice

3 Diagonalizace operátoru a podobnost matic

Podobné matice

Idea: Chtěli bychom říct, že dvě matice $\mathbb{A}, \mathbb{B} \in \mathbb{C}^{n,n}$ jsou podobné, jsou-li to matice *téhož operátoru* A na nějakém VP v různých bázích.

Definice

Matice $\mathbb{A}, \mathbb{B} \in \mathbb{C}^{n,n}$ nazveme **podobné**, právě když existuje $\mathbb{P} \in \mathbb{C}^{n,n}$ regulární tak, že platí

$$\mathbb{A} = \mathbb{P}^{-1}\mathbb{B}\mathbb{P}.$$

Poznámka: V literatuře je obvyklé značení $\mathbb{A} \sim \mathbb{B}$, protože symbol \sim obecně označuje ekvivalenci. (Domácí úkol: Ověřte, že vztah „býti podobným“ je relace ekvivalence na prostoru $\mathbb{C}^{n,n}$.)

Podobné matice

Podobné matice mají i „podobné“ vlastnosti. Například mají stejné spektrum. Naopak tedy platí, že pokud matice \mathbb{A} a \mathbb{B} *nemají* stejné spektrum, tak *nejsou* podobné.

Věta

Nechť $\mathbb{A}, \mathbb{B} \in \mathbb{C}^{n,n}$. Potom matice \mathbb{A} a \mathbb{B} jsou podobné právě tehdy, když existuje operátor $A \in \mathcal{L}(V_n)$ a dvě báze \mathcal{X}, \mathcal{Y} takové, že

$${}^{\mathcal{X}}A = \mathbb{A} \quad \text{a} \quad {}^{\mathcal{Y}}A = \mathbb{B}.$$

Důsledek

Mějme dvě podobné matice $\mathbb{A}, \mathbb{B} \in \mathbb{C}^{n,n}$. Potom charakteristické polynomy obou matic jsou shodné, tj. $p_{\mathbb{A}} = p_{\mathbb{B}}$ a tedy i spektra obou matic jsou stejná, tj. $\sigma(\mathbb{A}) = \sigma(\mathbb{B})$.

K zamyšlení: Co platí pro determinanty podobných matic?

Soubor vlastních vektorů k různým vlastním číslům je LN

- Dříve jsme si řekli, že pro některé operátory z $\mathcal{L}(V_n)$ budeme schopni z vlastních vektorů sestavit bázi, ve které bude matice daného operátoru diagonální.
- Následující věta nám říká, že to budeme umět, pokud bude mít daný operátor n různých vlastních čísel.
- Později si ukážeme, že toto ale není nutná podmínka a že „diagonalizující“ bázi budou mít i jiné operátory nemající tuto vlastnost.

Věta

Nechť $A \in \mathcal{L}(V)$, $\lambda_1, \dots, \lambda_k$ jsou navzájem různá vlastní čísla A a necht' pro každé $i \in \hat{k}$ označuje x_i libovolný vlastní vektor A příslušející vlastnímu číslu λ_i . Potom soubor (x_1, \dots, x_k) je LN.

Diagonalizace operátoru

Definice

Operátor $A \in \mathcal{L}(V_n)$ nazveme **diagonalizovatelný**, jestliže existuje báze \mathcal{X} prostoru V_n taková, že matice ${}^{\mathcal{X}}A$ je diagonální. Matici $\mathbb{A} \in \mathbb{C}^{n,n}$ nazveme **diagonalizovatelnou**, jestliže je podobná diagonální matici.

Věta (o diagonalizovatelnosti)

Operátor $A \in \mathcal{L}(V_n)$ je diagonalizovatelný, právě když

$$(\forall \lambda_0 \in \sigma(A))(\nu_a(\lambda_0) = \nu_g(\lambda_0)).$$

Důsledek

Nechť $A \in \mathcal{L}(V_n)$ a $(\forall \lambda_0 \in \sigma(A))(\nu_a(\lambda_0) = 1)$, potom je A diagonalizovatelný.

Poznámka

Geometricky znamená rovnost ${}^{\mathcal{X}}A = \text{diag}(\lambda_1, \dots, \lambda_n)$, že A působí jako operátor změny měřítka ve směrech, které udávají vlastní vektory $\mathcal{X} = \{x_1, \dots, x_n\}$. (Škálovací koeficient ve směru x_i by byl vlastní číslo λ_i .)

Poznámka

Matice \mathbb{A} chápaná jako operátor A na \mathbb{C}^n , $\mathbb{A} = \varepsilon_n A$, je podle předchozí definice diagonalizovatelná právě když je podobná diagonální matici. Matice \mathbb{P} z relace podobnosti je rovna ${}^{\mathcal{X}}E^{\varepsilon_n}$, kde \mathcal{X} je báze diagonalizující A .

Jak jsme viděli v důkazu Věty o diagonalizovatelnosti matice \mathbb{P} má ve sloupcích souřadnice vlastních vektorů a diagonální matice $\mathbb{D} \equiv {}^{\mathcal{X}}A$ má na diagonále vlastní čísla \mathbb{A} (v příslušném pořadí). Potom skutečně platí

$$\mathbb{A}\mathbb{P} = \mathbb{P}\mathbb{D}, \quad \text{nebo-li} \quad \mathbb{D} = \mathbb{P}^{-1}\mathbb{A}\mathbb{P}.$$

Příklad – diagonalizovatelnost matic \mathbb{A} a \mathbb{B}

Příklad: Uvažujme matice \mathbb{A}, \mathbb{B} z příkladů uvedených výše.

- V případě matice \mathbb{A} nám vyšlo $\nu_a(2) = \nu_g(2) = 1$ a $\nu_a(3) = \nu_g(3) = 2$. Proto je \mathbb{A} diagonalizovatelná.
- V případě matice \mathbb{B} nám vyšlo $\nu_a(2) = \nu_g(2) = 1$, ale $\nu_a(3) = 2 \neq 1 = \nu_g(3)$. Proto \mathbb{B} diagonalizovatelná není.
- Z toho plyne, že \mathbb{A}, \mathbb{B} nejsou podobné matice (\sim je tranzitivní), ačkoliv měly stejný charakteristický polynom a spektrum.

Příklad – pokračování

- Jak vypadá diagonální matice \mathbb{D} a regulární matice \mathbb{P} z relace podobnosti pro diagonalizovatelnou matici \mathbb{A} ? Do sloupců matice \mathbb{P} stačí napsat vlastní vektory \mathbb{A} a na diagonálu matice \mathbb{D} vlastní čísla. V našem případě

$$\mathbb{P} = \begin{pmatrix} -2 & 1 & -1 \\ 1 & 1 & 0 \\ 4 & 0 & 1 \end{pmatrix}, \quad \mathbb{D} = \begin{pmatrix} 2 & 0 & 0 \\ 0 & 3 & 0 \\ 0 & 0 & 3 \end{pmatrix}.$$

Potom platí

$$\mathbb{A} = \mathbb{P}\mathbb{D}\mathbb{P}^{-1}.$$

(Ověřte!)

- Kdybychom chtěli udělat podobnou konstrukci matice \mathbb{P} pro matici \mathbb{B} , zjistíme, že “nemáme dost vlastních vektorů”. Tj. vlastní vektory netvoří bázi \mathbb{C}^n .