

一、 填空题【每空5分、共25分】：

1.  $\begin{pmatrix} 0 & 0 & 0 \\ 1 & 1 & 0 \\ 0 & 1 & 1 \end{pmatrix}$     2.  $\underline{1, 1, 1}$     3.  $\underline{x_i, \frac{(x_1^2 + x_2^2 + \cdots + x_n^2)^{\frac{1}{2}}}{n}}$     4.  $\underline{2, 1}$     5.  $\underline{\pm 1}$ .

二、 判断题【每题5分、共20分】 每题结论正确2分，理由或反例3分.

1. 正确. 任意有限维实线性空间 $V$ ，设 $\alpha_1, \alpha_2, \cdots, \alpha_n$ 是一组基，取任意正定方阵 $A$ ，定义 $(x, y) = (x_1, x_2, \cdots, x_n)A(y_1, y_2, \cdots, y_n)^T$ ，其中 $(x_1, x_2, \cdots, x_n)^T, (y_1, y_2, \cdots, y_n)^T$ 分别为向量 $x, y$ 在基 $\alpha_1, \alpha_2, \cdots, \alpha_n$ 下的坐标. 如此定义的运算即为一个内积.
2. 错误. 必须是 $n$ 个线性无关的向量，才能Schmidt正交化得到标准正交基.
3. 错误. 反例：  $A = \begin{pmatrix} 1 & 0 \\ 0 & 1 \end{pmatrix}, B = \begin{pmatrix} 1 & 1 \\ 0 & 1 \end{pmatrix}$
4. 正确. 由 $A$ 对称知 $A^k$ 对称；又 $A^k$ 的特征值为 $A$ 的特征值的 $k$ 次方，全为正. 故 $A^k$ 正定.

三、 【5+4+6+5=20】

证明：（1）任意 $\lambda, \mu \in \mathbb{R}, f = c_1 e^x + c_2 x + c_3, g = d_1 e^x + d_2 x + d_3 \in V$ ：

$$\mathcal{D}(\lambda \cdot f + \mu \cdot g) = \frac{d}{dx}((\lambda c_1 + \mu d_1)e^x + (\lambda c_2 + \mu d_2)x + (\lambda c_3 + \mu d_3)) = (\lambda c_1 + \mu d_1)e^x + (\lambda c_2 + \mu d_2) = \lambda \mathcal{D}(f) + \mu \mathcal{D}(g) \in V, \text{ 故 } \mathcal{D} \text{ 为线性变换.}$$

$$(2) \mathcal{D}(1, x, e^x) = (1, x, e^x) \begin{pmatrix} 0 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 1 \end{pmatrix}, \text{ 故所求矩阵为 } A = \begin{pmatrix} 0 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 1 \end{pmatrix}$$

(3).法I)计算矩阵 $A$ 的特征多项式为 $\phi_A(\lambda) = |\lambda I - A| = \lambda^2(\lambda - 1)$ ，故特征值为0和1.

代入 $\lambda = 0$ ，解线性方程 $-A\alpha = 0$ 得 $A$ 的特征向量为 $(1, 0, 0)^T$ .

代入 $\lambda = 1$ ，解线性方程 $(I - A)\alpha = 0$ 得 $A$ 的特征向量为 $(0, 0, 1)^T$ .

故 $\mathcal{D}$ 有特征值0, 1，对应的特征向量分别为1和 $e^x$ .

法II)设 $\mathcal{D}$ 的特征值与对应的特征向量为 $\lambda$ 和 $\alpha = c_1 e^x + c_2 x + c_3$ . 则由

$$\mathcal{D}(c_1 e^x + c_2 x + c_3) = \lambda(c_1 e^x + c_2 x + c_3) = c_1 e^x + c_2.$$

进而 $\lambda = 0$ 且 $c_1 = c_2 = 0$ 或 $\lambda = 1$ 且 $c_2 = c_3 = 0$ . 即 $\mathcal{D}$ 的特征值为0, 1, 对应的特征向量分别为1和 $e^x$ .

(4). 不存在这样的基, 使得 $\mathcal{D}$ 在此基下的矩阵可以对角化; 因为由(3)的计算知道 $\mathcal{D}$ 只有两个线性无关的特征向量.

#### 四、【5+10=15】

(1) 二次型的矩阵为 $A = \begin{pmatrix} 3 & 0 & 0 \\ 0 & 8 & -6 \\ 0 & -6 & -1 \end{pmatrix}$ .

(2). 计算 $A$ 的特征值为 $\lambda_1 = 3, \lambda_2 = 11, \lambda_3 = -4$ .

对应的特征向量分别为 $\alpha_1 = (1, 0, 0)^T, \alpha_2 = (0, -2, 1)^T, \alpha_3 = (0, 1, 2)^T$ .

由于 $A$ 有三个不同特征值, 不同特征值的特征向量正交, 将 $\alpha_1, \alpha_2, \alpha_3$  单位化并

令 $P_1 = \begin{pmatrix} 1 & 0 & 0 \\ 0 & -\frac{2}{\sqrt{5}} & \frac{1}{\sqrt{5}} \\ 0 & \frac{1}{\sqrt{5}} & \frac{2}{\sqrt{5}} \end{pmatrix}$ , 则 $P_1^{-1}AP_1 = \text{diag}(3, 11, -4)$ .

令 $P = P_1 = \begin{pmatrix} 1 & 0 & 0 \\ 0 & -\frac{2}{\sqrt{5}} & \frac{1}{\sqrt{5}} \\ 0 & \frac{1}{\sqrt{5}} & \frac{2}{\sqrt{5}} \end{pmatrix}$ , 则 $\bar{Q}(y) = Q(x)|_{x=P^{-1}y} = y^T(P_1^{-1}AP_1)y = 3y_1^2 +$

$11y_2^2 - 4y_3^2$ . 由于 $A$ 的正特征值有2个, 故正惯性指数为 $2 < 3$ , 故 $A$ 非正定.

#### 五、【共10分】

( $\implies$ : ) 设 $A_i$ 的阶数为 $k_i$ ,  $A_i$ 的特征向量的极大无关组为 $\alpha_{i1}, \alpha_{i2}, \dots, \alpha_{ir_i}(r_i \leq k_i)$ . 令 $\beta_{ij}$ 为 $\alpha_{ij}$ 的加长向量, 长度为 $n$ , 其中第 $k_1+k_2+\dots+k_{i-1}+1$  到第 $k_1+k_2+\dots+k_i$ 个分量构成 $\alpha_{ij}$ , 其余分量为0.

则易证向量组 $\{\beta_{ij}(1 \leq i \leq s, 1 \leq j \leq r_i)\}$ 线性无关且为 $A$ 的特征向量, 同时 $A$ 的特征向量都能表示为它们的线性组合.

于是 $\{\beta_{ij}\}$ 与 $A$ 的特征向量的极大无关组等价, 进而由这两组向量线性无关知它们所含向量个数相同.

当 $A$ 可对角化时,  $A$ 有 $n$ 个线性无关的特征向量, 故 $r_1 + r_2 + \dots + r_s = n$ .

但同时有  $r_i \leq k_i$  和  $k_1 + k_2 + \cdots + k_s = n$ . 故只能是  $r_i = k_i (1 \leq i \leq s)$ , 即每个  $A_i$  有  $k_i$  个线性无关的特征向量. 于是每个  $A_i$  都可以对角化.

( $\Leftarrow$ : ) 反之, 若每个  $A_i$  都能对角化, 则  $A_i$  有  $k_i$  个线性无关的特征向量, 从而  $\#\{\beta_{ij}\} = n$ , 即可找到  $A$  的  $n$  个线性无关的特征向量  $\{\beta_{ij}\}$ , 于是  $A$  可以对角化.

(另,  $\Leftarrow$ : 设任意  $A_{ii}$  都能对角化, 则存在可逆的  $Q_i$  使得  $Q_i^{-1} A_{ii} Q_i = D_i$  为对角阵 ( $1 \leq i \leq s$ ). 令  $Q = \text{diag}(Q_1, Q_2, \cdots, Q_s)$ , 则  $Q$  可逆, 且  $Q^{-1} A Q = \text{diag}(D_1, D_2, \cdots, D_s)$ . 即  $A$  可对角化.)

法II) 设  $A_i$  的 Jordan 标准型为  $T_i = \text{diag}(J_{i1}, \cdots, J_{ik_i})$  且  $P_i^{-1} A_i P_i = T_i$ , 则  $\text{diag}(P_1, \cdots, P_s)$  可将  $A$  相似到  $\text{diag}(J_{11}, \cdots, J_{1k_1}, \cdots, J_{s1}, \cdots, J_{sk_s})$ , 此即为  $A$  的 Jordan 标准型. 故  $A$  可对角化  $\iff A$  的 Jordan 块都是 1 阶  $\iff$  每个  $J_{ik_j}$  均为 1 阶  $\iff$  每个  $A_i$  的 Jordan 块均为 1 阶  $\iff$  每个  $A_i$  可对角化.

## 六、【6+4=10】

证明: (1) 设  $A = (\alpha_1, \alpha_2, \cdots, \alpha_n)$ , 其中  $\alpha_i$  为  $A$  的第  $i$  列. 由  $A$  可逆知  $\alpha_1, \alpha_2, \cdots, \alpha_n$  线性无关, 从而可以构成  $\mathbb{R}^n$  的一组基.

于是可经 Schmidt 正交化算法得到一组标准正交基  $\beta_1, \beta_2, \cdots, \beta_n$ .

注意到在 Schmidt 正交化过程中, 每个  $\beta_i$  都只是  $\alpha_1, \alpha_2, \cdots, \alpha_i$  的线性组合, 且关于  $\alpha_i$  的系数总是正的. 于是, 从基  $\alpha_1, \alpha_2, \cdots, \alpha_n$  到基  $\beta_1, \beta_2, \cdots, \beta_n$  的过渡矩阵  $T$  为上三角阵, 且对角元为正.

将向量组还原为矩阵, 即有  $Q = (\beta_1, \beta_2, \cdots, \beta_n) = (\alpha_1, \alpha_2, \cdots, \alpha_n) T = AT$ . 由  $\{\beta_i\}_{1 \leq i \leq n}$  为标准正交基知  $Q$  为正交阵.

令  $R = T^{-1}$ , 则  $R$  为上三角阵, 且对角线上元素仍然为正.

于是得到  $A$  的分解  $A = QR$ , 其中  $Q$  正交阵,  $R$  为上三角阵且对角元为正.

(2). 若  $A$  有两个分解  $A = Q_1 R_1 = Q_2 R_2$ , 满足:  $Q_1, Q_2$  都是正交阵,  $R_1, R_2$  都是上三角阵且对角元为正. 则  $Q_2^{-1} Q_1 = R_2 R_1^{-1}$ .

注意到  $Q_2^{-1} Q_1$  为正交阵, 且  $R_2 R_1^{-1}$  为上三角阵且对角元仍为正.

而若一个对角元为正的上三角阵同时为正交阵, 则它只能是单位阵  $I$ .

于是  $Q_2^{-1} Q_1 = R_2 R_1^{-1} = I$ , 即  $Q_1 = Q_2$  且  $R_1 = R_2$ . 即分解唯一.