

Repetitorium WiSe 2013/14

Lineare Algebra Teil:

Eigenwerttheorie, Diagonalisierbarkeit

Def. (EW/EV): Sei V ein K -VR, $f: V \rightarrow V$ Endo.



Vergessen
Sie nicht
"n=0"!

Ein Skalar $\lambda \in K$ heißt Eigenwert (EW) von f ,

falls ein Vektor $v \in V$, $v \neq 0$, existiert mit $f(v) = \lambda v$.

Der Vektor v heißt Eigenvektor (EV) von v zum EW λ .

Ausführlich: v ist ein Vektor, den f "in dieselbe Richtung" abbildet:

das Bild $f(v)$ ist das λ -fache von v .



Bem.: Ist $f: U \rightarrow W \neq V$ linear, kein Endo, macht $f(v) = \lambda v$ keinen Sinn, da $\lambda v \notin W$.

Def.: Die Menge $E_\lambda := \{v \in V \mid \underbrace{f(v) = \lambda v}_{} = 0\} = \ker(f - \lambda \text{id}_V)$

(ist Unterraum von V !) heißt Eigenraum von f .

Die Menge aller Eigenwerte von f heißt Spektrum von f .

- Da für eine quadr. Matrix $A \in K^{m \times m}$ ein Endo $K^m \rightarrow K^m$, $x \mapsto Ax$ festgelegt wird, kann man ebenso von Eigenvektor usw. einer Matrix A sprechen.
- Ähnliche Matrizen haben dieselben EWs: $A = S^{-1}BS$, $Bv = \lambda v \Rightarrow S^{-1}As = S^{-1}Bv = S^{-1}\lambda v = \lambda S^{-1}v$
- Ausführlich: jeder Eigenraum wird mit f in sich abgebildet: $f(E_\lambda) \subseteq E_\lambda$ (d.h. E_λ ist f -invariant)

⊗ Satz: V ein K -VR, $f: V \rightarrow V$ Endo, $\lambda_1, \dots, \lambda_k$ p.w.v. EWs von f mit EVen v_1, \dots, v_k .
Dann sind v_1, \dots, v_k linear unabhängig.

Bew.: VI nach k , $k=1$: Def. EV, $k \rightarrow k+1$: $c_1 v_1 + \dots + c_{k+1} v_{k+1} = 0 \stackrel{!}{=} 0 = \sum_{i=1}^{k+1} c_i \lambda_i v_i$,

andererseits $0 = \lambda_1 0 = \underbrace{\lambda_1 c_1 v_1}_{\lambda_1} + \lambda_2 v_2 + \dots + \lambda_{k+1} v_{k+1} = 0$

$$\Rightarrow (\lambda_2 - \lambda_1)c_2 v_2 + \dots + (\lambda_{k+1} - \lambda_1)c_{k+1} v_{k+1} = 0$$

$$\stackrel{\text{Ind. vor.}}{\Rightarrow} (\lambda_2 - \lambda_1)c_2 = \dots = (\lambda_{k+1} - \lambda_1)c_{k+1} = 0 \Rightarrow c_2 = \dots = c_{k+1} = 0, \underbrace{c_1 v_1}_{\Rightarrow c_1 = 0} = 0 \quad \square$$

- 2 -

Kor.: Jeder Endo eines m -dim. K -VRs V hat $\leq m$ viele EW.

Jede Matrix $A \in K^{m \times m}$ hat $\leq m$ viele EW.

Bestimmung von EW/EV: Sei V ein K -VR, $\dim_K V = m$, $f: V \rightarrow V$ Endo.

Sei $A := \beta_B^{-1} [f]_{\beta_B}$ und fest, Koordinatenvektor $\beta_B(v) \in K^m$ bzgl. Basis β_B .

Dann ist die Untersuchung von $f(v) = \lambda v$ gleichwertig mit $A \cdot v = \lambda v$

mit $v = \beta_B(v)$: $\begin{array}{ccc} V & \xrightarrow{\quad f \quad} & V \\ \downarrow \beta_B & & \downarrow \beta_B \\ K^m & \xrightarrow{\quad A \quad} & K^m \end{array}$ Es genügt also, EW/EV von Matrizen zu untersuchen!

Standardfrage: Wie berechnet man EW [mit dem charakteristischen Polynom]?

Haben: λ EW von $A \in K^{m \times m}$

\Leftrightarrow es ex. $v \in K^{m \times m}$, $v \neq 0$: $A \cdot v = \lambda v$

\Leftrightarrow "homogenes" "": $(A - \lambda I_m) \cdot v = 0$

\Leftrightarrow das LGS $(A - \lambda I_m) \cdot v = 0$ ist (in v) nichttrivial lösbar

$\Leftrightarrow \text{rg } (A - \lambda I_m) < m \Leftrightarrow \det(A - \lambda I_m) = 0 \quad | \quad (\Leftrightarrow \chi_A(\lambda) = 0)$

$$I_m = (\delta_{ij}) = \begin{pmatrix} 1 & 0 & \dots & 0 \\ 0 & 1 & \dots & 0 \\ \vdots & \vdots & \ddots & \vdots \\ 0 & 0 & \dots & 1 \end{pmatrix}$$

$I_m = m$ -te Einheitsmatrix

{ Nach Def. der Determinante haben wir für $A = (a_{ij}) \in K^{m \times m}$:

$$\det(A - X \cdot I_m) = \sum_{\pi \in S_m} \text{sgn}(\pi) \cdot (a_{\pi(1),1} - X \cdot \delta_{\pi(1),1}) \cdots (a_{\pi(m),m} - X \cdot \delta_{\pi(m),m}),$$

dies ist ein Polynom $\in K[X]$. Seine Nullstellen sind genau die EW von A .

Def.: Das Polynom $\chi_A(X) := \det(A - X \cdot I_m)$ heißt charakteristisches Polynom von A .

Der Eigenraum $E_\lambda = \ker(A - \lambda \cdot I_m)$ ist der Lösungsraum des homogenen LGS $(A - \lambda \cdot I_m) \cdot v = 0$.

{ Satz: Ähnliche Matrizen haben dasselbe charakteristische Polynom.

$$\text{Bew.: } A = S^{-1} B S \Rightarrow \det(A - X \cdot I_m) = \det(S^{-1} B S - X \cdot I_m) = \det(S^{-1}) \det(B - X \cdot I_m) \det(S) = \det(B - X \cdot I_m).$$

□

→ Somit haben Endos auch ein (eind. best.) charakteristisches Polynom $\chi_f \in K[X]$.

Bem.: "ähnlich" = "Konjugiert" (Gruppenel. der Form $h^{-1}gh$, $h \in G$, heißt Konjugiert zugehörig).

Die EWTtheorie ist nützlich bei folgender Problemstellung: Sei V ein K -VR, $\dim_K V = m$.

Geg. ein Endo $f: V \rightarrow V$. Gibt es eine Basis B , bezüglich der die darstellende Matrix $A = [f]_B$ möglichst einfache Gestalt hat?

M.a.W. gibt es zu irgendeiner darstellenden Matrix A eine dazu ähnliche Matrix \tilde{A} , so daß \tilde{A} möglichst einfache Gestalt hat?

Untersucht werden zuerst die Endos, für die eine solche einfache Gestalt existiert:

Def.: $A \in K^{n \times n}$ heißt diagonalisierbar, wenn sie zu einer Diagonalmatrix $\begin{bmatrix} \lambda_1 & & & \\ & \ddots & & \\ & & \lambda_m & \\ & 0 & \cdots & 0 \end{bmatrix}$ ähnlich ist. Endo $f: V \rightarrow V$ heißt diagonalisierbar, wenn f eine Abb. matrix besitzt, die diag'bar ist.

Bem.: • Alle Abb. matrizen ähnlich \Rightarrow im Fall der Diag'barkeit alle zur selben Diag'matrix ähnlich
• Die λ_i sind die EWs von A , da $Ae_i = \lambda_i e_i$ gilt.

Satz (äquivalente Bed. für Diag'barkeit): Sei V ein K -VR, $\dim_K V = m$, $f: V \rightarrow V$ Endo.

A'quivalent sind: (i) f diag'bar, (ii) in V ex. Basis aus EVen von f ,
(iii) V ist direkte Summe der Eigenräume von f ,

(iv) die Summe der Dimensionen der Eigenräume von f ist gleich m .

Bew.: (i) \Rightarrow (ii): hat f bzgl. B die Diag'gestalt $\begin{bmatrix} \lambda_1 & & & \\ & \ddots & & \\ & & \lambda_m & \\ & 0 & \cdots & 0 \end{bmatrix} = A$, d.h. $Ae_i = \lambda_i e_i$, gilt $f(v_i) = \lambda_i v_i$
für die Basisel. v_i von B (da ja $A_B(v_i) = e_i$ gilt).

(ii) \Rightarrow (iii): seien $\lambda_1, \dots, \lambda_k$ die versch. EWs von f . Nach Satz \oplus ist die Summe der E_{λ_i} direkt, d.h. $E_{\lambda_1} \oplus \dots \oplus E_{\lambda_k} = V$. Für \exists sei $v \in V$ bel., bzgl. der Basis (v_1, \dots, v_m) aus EVen ist $v = c_1 v_1 + \dots + c_m v_m$. Fassen wir alle EVen zum gleichen EW c_i zusammen, erhalten wir $v = \tilde{v}_1 + \dots + \tilde{v}_k$, die $\tilde{v}_i \in E_{\lambda_i}$.

(iii) \Rightarrow (iv): \forall , (iv) \Rightarrow (i): Seien $E_{\lambda_1}, \dots, E_{\lambda_k}$ die Eigenräume von f , $\dim E_{\lambda_i} = m_i$. Wählen in jedem E_{λ_i} Basis B_i , setze $B = B_1 \cup \dots \cup B_k$, ist lin. unabh. nach Satz \oplus .

Wegen $m_1 + \dots + m_k = m$ ist B sogar Basis von V , bzgl. der f Diag'gestalt hat. \square

[Satz gilt analog für K^n statt V und Matrix $A \in K^{m \times m}$ statt f .]

Kor.: V ein K -VR, $\dim V = m$.

Dann: Ein Endo f [quadro. Matrix $A \in K^{m \times m}$] mit m verschiedenen EWen ist diag'bar.

Bem.: Bsp. für \Leftarrow : $f = \text{id}_V$ diag'bar, einziger EW ist = 1

hervorhebend
für Diag'
barkeit,
nicht notw.!

Kriterium für Diagonierbarkeit mit charakteristischem Polynom:

Satz: $V \in \mathbb{K}-\text{VR}$, $\dim_K V = n$, $f: V \rightarrow V$ Endo. Dann:

f diag'bar $\Leftrightarrow X_f$ hat die Form $X_f = (-1)^m (X - \lambda_1)^{r_1} \cdots (X - \lambda_k)^{r_k}$ \square
 mit $r_i \in \mathbb{N}$, p.w.v. $\lambda_1, \dots, \lambda_k \in K$,

\Rightarrow und wenn für $i=1, \dots, k$ gilt: $\dim_K \text{im}(f - \lambda_i \cdot \text{id}_V) = m - r_i$.

Bem.: • hat X_f die Form \square , zerfällt X_f in Linearfaktoren, r_i ist die Vielfachheit der Nullstelle λ_i
 wg. Rangsatz • Die λ_i sind gerade die (p.w.v.) EWe von f .

- die zweite Forderung besagt $\dim_K E_{\lambda_i} = r_i$ für $i=1, \dots, k$, da $E_{\lambda_i} = \ker(f - \lambda_i \cdot \text{id}_V)$.
- entsprechendes gilt für $A \in \mathbb{K}^{n \times n}$, ersetze $\dim \text{im}(f - \lambda_i \cdot \text{id}_V)$ durch $\text{rg}(A - \lambda_i \cdot I_n)$.
- hinreichend für Diagonierbarkeit: X_f zerfällt in linear verschiedene Linfaktoren (dann alle $r_i = 1$)

Def.: geometrische Vielfachheit eines EWs λ_i ist $\dim E_{\lambda_i}$, die Dimension des Eigenraums
 algebraische Vielfachheit eines EWs λ_i ist r_i , der Exponent von $(X - \lambda_i)$ in \square

- Somit: Sind geometrische und algebraische Vielfachheiten gleich (für jeden EW),
 so ist f diag'bar (und umgekehrt).

Bew.: \Rightarrow : f diag'bar \Rightarrow hat Abb. matrix $A_f = \begin{pmatrix} \lambda_1 & & & \\ & \ddots & & \\ & & \lambda_k & \\ 0 & & & 0 \end{pmatrix}$ mit p.w.v. $\lambda_1, \dots, \lambda_k$.

Dann: $\det(A_f - X I_m) = (\lambda_1 - X)^{r_1} \cdots (\lambda_k - X)^{r_k} = (-1)^m (X - \lambda_1)^{r_1} \cdots (X - \lambda_k)^{r_k}$

und $\dim \text{im}(f - \lambda_i \cdot \text{id}_V) = \text{rg}(A_f - \lambda_i \cdot I_m) = \text{rg} \begin{pmatrix} \lambda_1 - \lambda_i & & & \\ & \ddots & & \\ & & \lambda_k - \lambda_i & \\ 0 & & & 0 \end{pmatrix} = m - r_i$. $\ker(f - \lambda_i \cdot \text{id}_V)$

\Leftarrow : $\square \Rightarrow \lambda_1, \dots, \lambda_k$ EWe von f , da $\dim \text{im}(f - \lambda_i \cdot \text{id}_V) = m - r_i$ ist $\dim E_{\lambda_i} = r_i$,

also $\dim E_{\lambda_1} + \dots + \dim E_{\lambda_n} = r_1 + \dots + r_k = m$. Wegen Satz auf §-3-(iv) ist f diag'bar. \square

Bsp.: (1) $A = \begin{pmatrix} 0 & 1 \\ -1 & 0 \end{pmatrix}$ über $\mathbb{K} = \mathbb{R}$ nicht diag'bar: char. Polynom ist $X_A = X^2 + 1$, ohne Nst. über \mathbb{R} .

Über $\mathbb{K} = \mathbb{C}$: $X_A = (X - i)(X + i)$, hat 2 versch. EWe \Rightarrow diag'bar zu $\tilde{A} = \begin{pmatrix} i & 0 \\ 0 & -i \end{pmatrix} = S^{-1}AS$
 mit $S = \begin{pmatrix} 1 & 1 \\ -1 & 1 \end{pmatrix}$, wobei die Spalten die EWe von A sind (zum EW $i, -i$)

$\rightarrow A: \mathbb{R}^2 \rightarrow \mathbb{R}^2$, $x \mapsto A \cdot x$ hat keine EWe über \mathbb{R} , ist geometrisch eine Drehung um -90°

(2) $A = \begin{pmatrix} 1 & 0 \\ 1 & 1 \end{pmatrix}$ hat $X_A = (X - 1)^2$, aber $\text{rg}(A - 1 \cdot I_2) = \text{rg} \begin{pmatrix} 0 & 0 \\ 1 & 0 \end{pmatrix} = 1 \neq m - 2 = 0$

\rightarrow alg. & geom. Vielfachheit versch.! $\Rightarrow A$ nicht diag'bar wegen Satz für $\lambda = 1$

(3) $f: \mathbb{R}^3 \rightarrow \mathbb{R}^3$ Endo hat immer EWe, da $X_f \in \mathbb{R}[X]$ den Grad 3 hat:

Polynome vom Grad 3 haben immer Nullstelle über \mathbb{R} [analytische Begründung: EWS,
 algebraische Begründung: über \mathbb{R} zerfallen Polynome in Produkt von Polynomen vom Grad ≤ 2]

Zum Satz von Cayley-Hamilton

Vor.: $V \text{ K-VR, } \dim_K V = m, f: V \rightarrow V \text{ Endo.}$

Gesehen: $f: V \rightarrow V \text{ diag'bar} \Rightarrow V = E_{\lambda_1} \oplus \dots \oplus E_{\lambda_k} = \ker(f-\lambda_1 \text{id}_V) \oplus \dots \oplus \ker(f-\lambda_k \text{id}_V)$
 Sei f diag'bar.

Betr. dann den Endo $g := (f-\lambda_1 \text{id}_V) \circ \dots \circ (f-\lambda_k \text{id}_V): V \rightarrow V,$

d.h. ist $M_f(X) := (X-\lambda_1) \cdots (X-\lambda_k) \in K[X],$

setze f dort ein, d.h. $g := M_f(f).$

Wegen $(f-\lambda_i \text{id}_V) \circ (f-\lambda_j \text{id}_V) = f^2 - (\lambda_i + \lambda_j)f + \lambda_i \lambda_j \text{id}_V = (f-\lambda_j \text{id}_V) \circ (f-\lambda_i \text{id}_V)$

gilt mit $v = v_1 + \dots + v_k$, die $v_i \in E_{\lambda_i},$

dass $g(v) = \underbrace{(f-\lambda_1 \text{id}_V) \circ \dots \circ (f-\lambda_k \text{id}_V)(v_1)}_{=0, \text{da } (f-\lambda_1 \text{id}_V)(v_1)=0} + \dots + \underbrace{(f-\lambda_k \text{id}_V) \circ \dots \circ (f-\lambda_1 \text{id}_V)(v_k)}_{\text{analog }=0} = 0,$

d.h. $g = 0.$

Im Fall, dass f diag'bar ist, folgt also $M_f(f) = 0.$ Da $M_f | X_f \text{ in } K[X],$ folgt $X_f(f) = 0$.

Dies gilt immer:

Satz von Cayley-Hamilton: Sei V ein K -VR, $\dim_K V = m, f: V \rightarrow V \text{ Endo,}$

X_f das charakteristische Polynom von $f.$ Dann ist $X_f(f) = 0.$

Bem.: Die Null ist hier die Nullabb., ein "Beweis" der Form $X_f(f) = \det(f - f \text{id}_V) = \det(0) = 0$ ist also unsinnig!

- Der Satz gilt analog für $A: X_A(A) = 0.$

- Dass ein Polynom P ex. mit $P(f) = 0$ ex. wurde schon bei Termin 7 LA gesehen, als die Ex. des Mpos bewiesen wurde. Bemerkenswert am Cayley-Hamilton ist, dass auch X_f zu den annulierenden Polynomen gehört, so dass also $M_f | X_f$ folgt.

Kor.: Die Nullstellen von M_f sind genau die Nst. von $X_f (= EWE).$

Bew.: " \subseteq " klar wegen $M_f | X_f, \supseteq":$ ist $v \neq 0$ mit $f(v) = \lambda v$ geg., gilt $f^i(v) = \lambda^i v,$

also $0 = M_f(f)(v) = M_f(\lambda)v, \text{ also } M_f(\lambda) = 0.$ \square

Somit: $X_f = \dots \blacksquare \Rightarrow M_f = (X-\lambda_1)^{s_1} \cdots (X-\lambda_k)^{s_k}$ mit $1 \leq s_i \leq n_i$ für alle $i.$

- Bem.: M_f und X_f besitzen bei Diag'barkeit dieselben irreduz. Teiler, gilt auch allgemeine [→ JNF]

- Das Kor. zeigt: f diag'bar, $\lambda_1, \dots, \lambda_k$ versch. EWE von $f \Rightarrow M_f = (X-\lambda_1) \cdots (X-\lambda_k) = X_f$ oben.

Auch die Umkehrung gilt [→ Jordan-Normalform, vgl. nächsten Termin].

die
annulierenden
Polynome
bilden ein
Ideal in
 $K[X],$ es wird
von M_f erzeugt

!

Bew. des Satzes von Cayley-Hamilton:

$$\text{z.z.: } \forall v \in V: X_f(f)(v) = 0.$$

Sei m der Grad des Mipo's von f .

Dann ist $\tilde{\mathcal{B}} = \{\text{id}_V, f, \dots, f^{m-1}\} \subseteq \text{End}(V)$ lin. unabh., setze $U := L(\tilde{\mathcal{B}})$ (lin. Hülle).

Der $\tilde{\mathcal{B}} \cup \{f^m\}$ lin. abh., ex. $a_0, \dots, a_{m-1} \in K: f^m = a_0 \text{id}_V + a_1 f + \dots + a_{m-1} f^{m-1}$.

Da $f(\tilde{\mathcal{B}}) \subseteq U$ ist $f(U) \subseteq U$, also ist $\tilde{f} := f|_U: U \rightarrow U$ ein Endo von U .

Bzgl. $\tilde{\mathcal{B}}$ hat \tilde{f} die Abb. matrix $\tilde{A} = \tilde{\mathcal{B}}[\tilde{f}]_{\tilde{\mathcal{B}}} = \begin{bmatrix} 0 & 0 & \dots & 0 & a_0 \\ 1 & 0 & \dots & 0 & a_1 \\ 0 & 1 & 0 & \dots & 0 & a_2 \\ \vdots & \vdots & \ddots & \ddots & \ddots & \vdots \\ 0 & 0 & \dots & 1 & a_{m-1} \end{bmatrix} \in K^{m \times m}$.

Bestimme $X_{\tilde{A}}$ von \tilde{f} :

$$X_{\tilde{A}}(X) = \det(\tilde{A} - X I_m) = \det \begin{bmatrix} -X & 0 & \dots & 0 & a_0 \\ 1 & -X & \dots & 0 & a_1 \\ 0 & 1 & -X & \dots & 0 & a_2 \\ \vdots & \vdots & \ddots & \ddots & \ddots & \vdots \\ 0 & 0 & \dots & 1 & a_{m-1} - X \end{bmatrix} = \dots$$

$$\dots = \det \begin{bmatrix} 0 & 0 & \dots & 0 & a_0 + a_1 X + \dots + a_{m-1} X^{m-1} - X^m \\ 1 & 0 & \dots & 0 & \vdots \\ 0 & 1 & 0 & \dots & \vdots \\ \vdots & \vdots & \ddots & \ddots & \vdots \\ 0 & 0 & \dots & 1 & a_{m-2} + a_{m-1} X + X^2 \end{bmatrix} = (-1)^{m+1} \cdot (a_0 + a_1 X + \dots + a_{m-1} X^{m-1} - X^m).$$

Ergänze nun $\tilde{\mathcal{B}}$ zu Basis \mathcal{B} von V . Bzgl. \mathcal{B} hat f eine Abb. Matrix $A_f = \tilde{A}|_{\mathcal{B}} = \begin{bmatrix} \tilde{A} & C \\ 0 & D \end{bmatrix}$ mit geeigneten Matrizen C, D , weil U f -invariant ist.

Für X_f folgt nach dem Kästchennummeli-Kastenrussatz für Determinanten

$$X_f = X_{\tilde{A}} = X_{\tilde{A}} \cdot X_D. \quad \text{Aus } X_{\tilde{A}} \cdot X_D = X_D \cdot X_{\tilde{A}} \text{ folgt}$$

$$X_{\tilde{A}}(A) = X_D(A) \circ \underbrace{X_{\tilde{A}}(A)}_{\text{da } A=0} = 0,$$

$$\text{denn } X_{\tilde{A}}(f) = (-1)^{m+1} (a_0 + a_1 f + \dots + a_{m-1} f^{m-1} - f^m) = 0 \text{ nach Def. der } a_i. \quad \square$$

Bem.: Im Bew. kommt eine "Begleitmatrix" vor.

Dif.: Sei $P \in K[X]$ normiert, $\deg P = m \geq 1$, $P = \sum_{i=0}^m a_i X^i$. Die Begleitmatrix von P

ist die Matrix

$$A_P = \begin{bmatrix} 0 & 0 & \dots & 0 & -a_0 \\ 1 & 0 & \dots & 0 & -a_1 \\ 0 & 1 & 0 & \dots & 0 & -a_2 \\ \vdots & \vdots & \ddots & \ddots & \ddots & \vdots \\ 0 & 0 & \dots & 1 & -a_{m-1} \end{bmatrix}.$$

(Die Begleitmatrix von $X-a_0$ ist $[a_0]$).

Dann ist $P = (-1)^m \cdot X_{A_P} = M_{A_P}$. [Konstruieren so Matrix zu Polynom P , die P als Mipo/char. Polynom hat]