

Mathematik für InformatikerInnen 2

Frank-Olaf Schreyer

Universität des Saarlandes, SS 2020

Eigenwerte, Eigenräume

Die Themen heute sind

- ▶ Determinante eines Endomorphismus, Orientierung
- ▶ Eigenwerte, Eigenvektoren, charakteristisches Polynom
- ▶ Lineare Rekursionen
- ▶ Orthogonale Transformationen des \mathbb{R}^3
- ▶ Charakteristisches Polynom eines Endomorphismus
- ▶ Die Spur
- ▶ Diagonalisierbarkeitskriterium

In der letzten Woche hatten wir die Determinante studiert. Diese Woche sind Endomorphismen, Eigenwerte und Eigenvektoren das Thema.

Endomorphismen

Sei V ein K -Vektorraum, $\dim V < \infty$ und

$$f \in \text{End}(V) := \text{Hom}(V, V) := \text{Hom}_K(V, V)$$

ein **Endomorphismus**, wobei $\text{Hom}(V, W)$ die Menge aller Vektorraumhomomorphismen von V nach W bezeichnet.

Bemerkung. $\text{Hom}(V, W)$ ist selbst ein K -Vektorraum. Für $f, g \in \text{Hom}(V, W)$ und $\lambda, \mu \in K$ ist

$$\lambda f + \mu g: V \rightarrow W \text{ durch } (\lambda f + \mu g)(v) = \lambda f(v) + \mu g(v)$$

definiert.

Ist $\dim V = n$ und $\dim W = m$, dann ist

$$\text{Hom}(V, W) \cong K^{m \times n}, \quad f \mapsto A = \varphi_B^A(f)$$

vermöge der Matrixdarstellung von Homomorphismen bzgl. Basen \mathcal{A} und \mathcal{B} von V und W . Es gilt:

$$\dim \text{Hom}(V, W) = \dim V \dim W.$$

Determinante eines Endomorphismus

Definition. Sei V ein endlich-dimensionaler K -Vektorraum und $f \in \text{End}(V)$ ein Endomorphismus. Wir definieren die

Determinante von f wie folgt: Wir wählen eine Basis \mathcal{A} von V , betrachten die Matrixdarstellung $A = M_{\mathcal{A}}^{\mathcal{A}}(f)$ von f bzgl. \mathcal{A} und setzen

$$\det f := \det A.$$

Dies ist wohldefiniert, d.h., unabhängig von der Wahl der Basis.

Beweis. Ist \mathcal{B} eine andere Basis und $S = M_{\mathcal{B}}^{\mathcal{A}}(\text{id}_V) \in \text{GL}(n, K)$ die Basiswechselmatrix, dann gilt für die Matrixdarstellung $B = M_{\mathcal{B}}^{\mathcal{B}}(f)$ von f bzgl. \mathcal{B}

$$B = SAS^{-1}$$

$$\begin{array}{ccc} K^n & \xrightarrow{B} & K^n \\ \downarrow \varphi_B & & \downarrow \varphi_B \\ V & \xrightarrow{f} & V \\ \uparrow \varphi_A & & \uparrow \varphi_A \\ K^n & \xrightarrow{A} & K^n \end{array} \quad \begin{array}{l} M_{\mathcal{B}}^{\mathcal{A}}(\text{id}_V) = S \\ S = M_{\mathcal{A}}^{\mathcal{B}}(\text{id}_V) \end{array}$$

Der Determinantenmultiplikationssatz angewendet auf $B = SAS^{-1}$ gibt

$$\det B = \det S \det A \det S^{-1} = \det A,$$

da $\det S \det S^{-1} = \det(SS^{-1}) = \det E = 1$ gilt. □

Definition. Sei V ein \mathbb{R} -Vektorraum, $\dim V = n < \infty$. Ein Endomorphismus $f: V \rightarrow V$ heißt **orientierungstreu**, wenn $\det f > 0$. Insbesondere ist f dann ein Isomorphismus.

Beispiel. $V = \mathbb{R}^2$. Wir betrachten die Matrizen

$$A = \begin{pmatrix} 2 & 1 \\ 1 & 2 \end{pmatrix}, \quad B = \begin{pmatrix} 1 & 2 \\ 2 & 1 \end{pmatrix}.$$

Die Auswirkung der beiden Matrizen auf den Buchstaben F sind folgende:

Was ist eine Orientierung von $V = \mathbb{R}^n$?

Definition. Zwei Basen \mathcal{A} und \mathcal{B} von V heißen **gleich orientiert**, falls $\det_{\mathcal{B}}^{\mathcal{A}}(\text{id}_V) > 0$; andernfalls **entgegengesetzt orientiert**.

Nach dem Determinantenmultiplikationssatz ist Gleichorientiertheit eine Äquivalenzrelation auf der Menge

$$\{\mathcal{A} \mid \mathcal{A} = \{v_1, \dots, v_n\} \text{ Basis von } V\}$$

mit genau zwei Äquivalenzklassen. Die Wahl einer dieser zwei Klassen nennt man eine Orientierung von V .

Beispiel. $\{e_1, \dots, e_n\}$ und $\{e_{\sigma(1)}, \dots, e_{\sigma(n)}\}$, $\sigma \in S_n$, sind gleich orientiert genau dann, wenn $\text{sign } \sigma = +1$.

Satz. Seien $A \in \text{GL}(n, \mathbb{R})$ und a_1, \dots, a_n die Spaltenvektoren von A . Dann sind die Basen $\mathcal{A} = \{a_1, \dots, a_n\}$ und $\mathcal{E} = \{e_1, \dots, e_n\}$ gleich orientiert genau dann, wenn es eine Abbildung

$$\varphi: [0, 1] \rightarrow \text{GL}(n, \mathbb{R}), \quad t \mapsto (\varphi_{ij}(t))$$

gibt mit $\varphi_{ij}: [0, 1] \rightarrow \mathbb{R}$ stetig für alle $i, j \in \{1, 2, \dots, n\}$ und $\varphi(0) = A, \varphi(1) = E$.

Beweis. Die Notwendigkeit der Bedingung ergibt sich aus dem Zwischenwertsatz. Mit den φ_{ij} ist auch

$$[0, 1] \rightarrow \mathbb{R}, \quad t \mapsto \det(\varphi_{ij}(t))$$

stetig, als Summe von Produkten von stetigen Funktionen.

Da $\det(\varphi_{ij}(t)) \neq 0 \forall t$, folgt aus dem Zwischenwertsatz, dass $\det \varphi(0) = \det A = M_{\mathcal{A}}^{\mathcal{E}}(\text{id}_{\mathbb{R}^n})$ und $\det \varphi(1) = \det E = 1 > 0$ das gleiche Vorzeichen haben.

Dass die Bedingung auch hinreichend ist, kann man aus dem Gram-Schmidt-Verfahren herleiten. □

Ende Teil 1

Normalformen für Endomorphismus?

Sei K ein Körper, $f: V \rightarrow W$ eine lineare Abbildung zwischen endlich-dimensionalen K -Vektorräumen. Nach dem Struktursatz über lineare Abbildungen existieren Basen \mathcal{A}, \mathcal{B} von V bzw. W , so dass

$$M_{\mathcal{B}}^{\mathcal{A}}(f) = \left(\begin{array}{ccc|c} 1 & & & 0 \\ & \ddots & & \\ & & 1 & \\ \hline & & & 0 \\ & 0 & & 0 \end{array} \right).$$

Bei einem Endomorphismus wollen wir $\mathcal{B} = \mathcal{A}$ wählen und fragen, ob bei geschickter Wahl von \mathcal{A} die Matrix $M_{\mathcal{A}}^{\mathcal{A}}(f)$ möglichst einfach wird.

Konjugationsklassen

Mit anderen Worten: Wir betrachten die Operation

$$GL(n, K) \times K^{n \times n} \rightarrow K^{n \times n}, (S, A) \mapsto S \cdot A \cdot S^{-1}$$

von $GL(n, K)$ auf $K^{n \times n}$ durch **Konjugation** und fragen:

Gibt es in den Bahnen bzgl. dieser Operation besonders einfache Matrizen?

Definition. Zwei quadratische Matrizen $A, B \in K^{n \times n}$ heißen **ähnlich** bzw. **konjugiert**, wenn sie in der gleichen Bahn (genannt **Konjugationsklasse**) bezüglich dieser Operation liegen, d.h., wenn ein $S \in GL(n, K)$ existiert mit $B = S \cdot A \cdot S^{-1}$.

Der Schlüssel zur Beantwortung dieser Frage ist das Konzept der Eigenwerte!

Eigenwerte und Eigenvektoren

Definition. Sei V ein K -Vektorraum, $f: V \rightarrow V$ ein Endomorphismus, $\lambda \in K$. Der Skalar λ heißt **Eigenwert** (engl. **eigenvalue**) von f , wenn es einen Vektor $0 \neq v \in V$ gibt, so dass

$$f(v) = \lambda v.$$

Solch ein v heißt dann **Eigenvektor** (engl. **eigenvector**) von f zum Eigenwert λ .

Achtung. Ein Eigenwert λ kann $0 \in K$ sein, ein Eigenvektor ist stets $\neq 0$.

Diagonalisierbarkeit

Satz. Es sei V ein K -Vektorraum, $n = \dim V < \infty$ und $f: V \rightarrow V$ ein Endomorphismus. Äquivalent sind:

1. V besitzt eine Basis aus Eigenvektoren von f .
2. Es gibt eine Basis \mathcal{B} von V , so dass

$$M_{\mathcal{B}}^{\mathcal{B}}(f) = \begin{pmatrix} \lambda_1 & & 0 \\ & \ddots & \\ 0 & & \lambda_n \end{pmatrix} \text{ mit } \lambda_i \in K.$$

Beweis. Sei $\mathcal{B} = \{v_1, \dots, v_n\}$ eine Basis aus Eigenvektoren zu Eigenwerten λ_i , also

$$f(v_i) = \lambda_i v_i.$$

Dann ist $M_{\mathcal{B}}^{\mathcal{B}}(f)$ eine **Diagonalmatrix** mit Einträgen λ_i auf der Diagonalen.

Umgekehrt ist $M_{\mathcal{B}}^{\mathcal{B}}(f)$ eine Diagonalmatrix, dann gilt $f(v_i) = \lambda_i v_i$, d.h., die v_i sind Eigenvektoren. □

Eigenräume und das charakteristische Polynom

Definition. Sei $A \in K^{n \times n}$ und $\lambda \in K$ beliebig. Dann heißt

$$\text{Eig}(A, \lambda) := \{v \in K^n \mid Av = \lambda v\}$$

der **Eigenraum** zu λ . Das **charakteristische Polynom** von A ist

$$\chi_A(t) := \det(A - tE) \in K[t].$$

Satz. Seien $A \in K^{n \times n}$ und $\lambda \in K$. Dann gilt:

λ ist ein Eigenwert von $A \Leftrightarrow \lambda$ ist eine Nullstelle von $\chi_A(t)$.

Beweis. Es gilt:

$$\begin{aligned} \lambda \text{ Eigenwert} &\Leftrightarrow Av = \lambda v \text{ für ein Vektor } v \neq 0 \\ &\Leftrightarrow (A - \lambda E) \cdot v = 0 \text{ hat eine Lösung } v \neq 0 \\ &\Leftrightarrow \text{Eig}(A, \lambda) = \ker(A - \lambda E) \neq 0 \\ &\Leftrightarrow \det(A - \lambda E) = 0 \\ &\Leftrightarrow \chi_A(\lambda) = 0. \quad \square \end{aligned}$$

Beispiel. Sei

$$V = \{(g_n) \in \mathbb{R}^{\mathbb{N}} \mid g_{n+1} = g_n + g_{n-1} \forall n \geq 1\}$$

der Vektorraum aller 'Fibonacci-Folgen'. Es gilt $\dim V = 2$, da (g_n) durch die Anfangswerte g_0 und g_1 bestimmt ist. Die Folgen $v_1 = (1, 0, 1, 1, 2, 3, \dots)$ und $v_2 = (0, 1, 1, 2, 3, 5, \dots)$ bilden eine Basis $\mathcal{A} = \{v_1, v_2\}$ von V .

$$F: V \rightarrow V, (g_0, g_1, g_2, g_3, \dots) \mapsto (g_1, g_2, g_3, g_4, \dots)$$

ist ein Endomorphismus von V , der die Basisdarstellung

$$A = M_{\mathcal{A}}^{\mathcal{A}}(F) = \begin{pmatrix} 0 & 1 \\ 1 & 1 \end{pmatrix}$$

hat. Dessen charakteristisches Polynom ist

$$\chi_A(t) = \det \begin{pmatrix} -t & 1 \\ 1 & 1-t \end{pmatrix} = t^2 - t - 1.$$

Die Nullstellen sind $\lambda_1 = \frac{1+\sqrt{5}}{2}$ und $\lambda_2 = \frac{1-\sqrt{5}}{2}$.

Es gibt also eine Basis aus Eigenvektoren $\mathcal{B} = \{w_1, w_2\}$, in der F Diagonalgestalt hat:

$$B = M_{\mathcal{B}}^{\mathcal{B}}(F) = \begin{pmatrix} \lambda_1 & 0 \\ 0 & \lambda_2 \end{pmatrix} = SAS^{-1}$$

Die Potenzen $B^n = \begin{pmatrix} \lambda_1^n & 0 \\ 0 & \lambda_2^n \end{pmatrix}$ lassen sich leicht berechnen. Die von $A = S^{-1}BS$ ebenfalls, da

$$A^n = S^{-1}BS \cdot S^{-1}BS \cdots S^{-1}BS = S^{-1}B^nS$$

gilt. Da $v_2 = (f_0, f_1, \dots)$ die Fibonacci-Folge ist, ist $F^n(v_2) = (f_n, f_{n+1}, \dots)$, also

$$A^n \begin{pmatrix} 0 \\ 1 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} f_n \\ f_{n+1} \end{pmatrix}.$$

Wenn wir also S und S^{-1} bestimmen, erhalten wir eine geschlossene Formel für die n -te Fibonacci-Zahl.

Die Gleichung

$$\begin{pmatrix} \lambda_1 & 0 \\ 0 & \lambda_2 \end{pmatrix} = SAS^{-1}$$

besagt, dass die Spalten von S^{-1} Eigenvektoren von A sind.

$$\text{Eig}(A, \lambda_1) = \ker \begin{pmatrix} -\lambda_1 & 1 \\ 1 & 1 - \lambda_1 \end{pmatrix} = \ker \begin{pmatrix} -\frac{1+\sqrt{5}}{2} & 1 \\ 1 & \frac{1-\sqrt{5}}{2} \end{pmatrix} = \left\langle \begin{pmatrix} 1 \\ \frac{1+\sqrt{5}}{2} \end{pmatrix} \right\rangle$$

$$\text{Eig}(A, \lambda_2) = \ker(A - \lambda_2 E) = \ker \begin{pmatrix} -\frac{1-\sqrt{5}}{2} & 1 \\ 1 & \frac{1+\sqrt{5}}{2} \end{pmatrix} = \left\langle \begin{pmatrix} 1 \\ \frac{1-\sqrt{5}}{2} \end{pmatrix} \right\rangle$$

$$\Rightarrow S^{-1} = \begin{pmatrix} 1 & 1 \\ \frac{1+\sqrt{5}}{2} & \frac{1-\sqrt{5}}{2} \end{pmatrix} \Rightarrow S = \frac{1}{-\sqrt{5}} \begin{pmatrix} \frac{1-\sqrt{5}}{2} & -1 \\ -\frac{1+\sqrt{5}}{2} & 1 \end{pmatrix}$$

$$\Rightarrow \begin{pmatrix} f_n \\ f_{n+1} \end{pmatrix} = \frac{1}{-\sqrt{5}} \begin{pmatrix} \frac{1-\sqrt{5}}{2} & -1 \\ -\frac{1+\sqrt{5}}{2} & 1 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} \left(\frac{1+\sqrt{5}}{2}\right)^n \\ \left(\frac{1-\sqrt{5}}{2}\right)^{n+1} \end{pmatrix}$$

$$\Rightarrow f_{n+1} = \frac{1}{\sqrt{5}} \left(\left(\frac{1+\sqrt{5}}{2}\right)^{n+1} - \left(\frac{1-\sqrt{5}}{2}\right)^{n+1} \right)$$

Lineare Rekursionen

Korollar aus dem Beispiel. Sei x_n eine durch $x_{n+1} = ax_n + bx_{n-1}$ rekursiv definierte Folge mit Anfangswerten x_0 und x_1 . Falls das Polynom

$$t^2 - at - b \in \mathbb{R}[t]$$

zwei verschiedene reelle Nullstellen λ_1, λ_2 hat, dann lässt sich für x_n eine geschlossene Formel der Gestalt

$$x_n = \alpha \lambda_1^n + \beta \lambda_2^n$$

herleiten, wobei α und β gewisse von x_0 und x_1 linear abhängige Konstanten sind.

Beweis. Der Endomorphismus $A = \begin{pmatrix} 0 & b \\ 1 & a \end{pmatrix}$ hat das

charakteristische Polynom $\chi_A(t) = \det(A - tE) = t^2 - at - b$. \square

Geometrie von orthogonalen Transformationen des \mathbb{R}^3

Sei $A = (a_{ij})$ eine orthogonale 3 Matrix. Das charakteristische Polynom $\chi_A(t)$ ist dann kubisch und hat daher wenigstens eine reelle Nullstelle λ . Sei $v \in \mathbb{R}^3$ ein zugehöriger Eigenvektor, $Av = \lambda v$.

Behauptung. $\lambda \in \{\pm 1\}$. **Beweis.** Da $A^t A = E$ gilt:

$$\langle Av, Av \rangle = (Av)^t \cdot Av = v^t A^t Av = v^t v = \|v\|^2$$

Andererseits, haben wir auch

$$\langle Av, Av \rangle = \langle \lambda v, \lambda v \rangle = \lambda^2 \|v\|^2.$$

Da Eigenvektoren nicht Null sind, folgt $\|v\| \neq 0$ und $\lambda^2 = 1$. □

Die Gerade $L = \langle v \rangle$ wird von A in sich abgebildet. Deren orthogonales Komplement

$$H = v^\perp = \{w \in \mathbb{R}^3 \mid \langle w, v \rangle = 0\}$$

wird ebenfalls von A in sich abgebildet, da für $w \in H$

$$\langle Aw, v \rangle = \lambda \langle Aw, \lambda v \rangle = \lambda \langle Aw, Av \rangle = \lambda w^t v = \lambda \langle w, v \rangle = 0$$

gilt.

Wenn also $f: \mathbb{R}^3 \rightarrow \mathbb{R}^3, x \mapsto Ax$ die zugehörige orthogonale Abbildung bezeichnet, dann haben wir folgende Situation:

$$f|_L: L \rightarrow L \text{ und } f|_H: H \rightarrow H$$

sind jeweils orthogonale Abbildungen der Geraden bzw. Ebene in sich. Ist $f|_H$ eine Drehung, dann ist f eine Drehung oder Drehspiegelung je nach dem ob $\lambda = 1$ oder $\lambda = -1$ gilt.

Ist $f|_H$ eine Spiegelung, dann hat $f|_H$ die Eigenwerte $\lambda_2 = -1$ und $\lambda_3 = 1$, und f ist eine Drehung um 180° , wenn für $\lambda, \lambda_2, \lambda_3$ zweimal den Wert -1 auftaucht. Taucht -1 nur einmal auf, dann ist es eine Spiegelung an der Ebene H' , die von v und dem Eigenvektor $v' \in H$ von $f|_H$ zum Eigenwert 1 aufgespannt wird.

Charakteristische Polynom eines Endomorphismus

Definition. Sei $f: V \rightarrow V$, $n = \dim V < \infty$, ein Endomorphismus eines endlich dimensionalen K -Vektorraums. Das **charakteristische Polynom** $\chi_f(t)$ definieren wir durch

$$\chi_f(t) := \det(f - t \cdot \text{id}_V) = \det(A - t \cdot E) = \chi_A(t),$$

wobei $A = M_{\mathcal{A}}^{\mathcal{A}}(f)$ die Matrixdarstellung von f bzgl. einer Basis \mathcal{A} von V ist. Dies ist wohldefiniert.

Beweis. Wenn B die Matrixdarstellung bzgl. einer anderen Basis \mathcal{B} ist, dann gilt

$$B = M_{\mathcal{B}}^{\mathcal{B}}(f) = SAS^{-1}.$$

Es folgt:

$$\begin{aligned}\chi_B(t) &= \det(B - t \cdot E) = \det(SAS^{-1} - t \cdot E) \\ &= \det(S(A - t \cdot E)S^{-1}), \quad (\text{da } SES^{-1} = E) \\ &= \det S \det(A - t \cdot E) \cdot \det S^{-1} \\ &= \chi_A(t)\end{aligned}$$

aus dem Matrixmultiplikationssatz.



Korollar aus dem Beweis. *Konjugierte Matrizen* $A, B \in K^{n \times n}$ haben das gleiche charakteristische Polynom: $\chi_A(t) = \chi_B(t)$. \square

Bemerkung. Die Koeffizienten $c_0, \dots, c_n \in K$ von

$$\chi_A(t) = c_0 + c_1 t + \dots + c_{n-1} t^{n-1} + c_n t^n$$

sind also die gleichen $\forall B$ in der Konjugationsklasse von A . Es gilt:

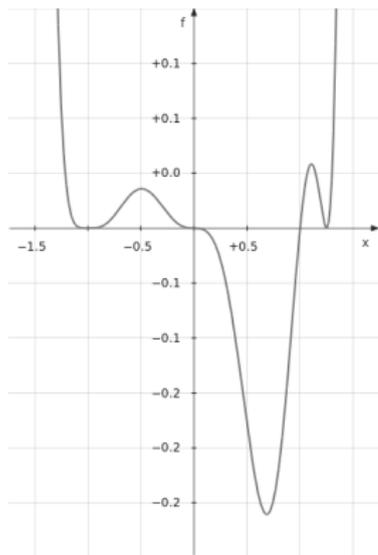
$$\begin{aligned} \chi_A(t) &= \det \begin{pmatrix} a_{11} - t & a_{12} & \dots & a_{1n} \\ a_{21} & a_{22} - t & \dots & a_{2n} \\ \vdots & \vdots & \ddots & \vdots \\ a_{n1} & a_{n2} & \dots & a_{nn} - t \end{pmatrix} \\ &= \det A + \dots + \left((-1)^{n-1} \sum_{i=1}^n a_{ii} \right) t^{n-1} + (-1)^n t^n \end{aligned}$$

Definition. Die **Spur** (engl. **trace**) von A ist definiert durch

$$\operatorname{tr}(A) := \operatorname{Spur}(A) := \sum_{i=1}^n a_{ii}.$$

$\det A$ und $\operatorname{tr}(A)$ sind wichtigste Koeffizienten von $\chi_A(t)$.

Definition. Sei $P(t) \in K[t]$ ein Polynom und $\lambda \in K$. Dann heißt $m(P(t), \lambda) := \max\{ m \mid \exists Q(t) \in K[t], \text{ s.d. } P(t) = (t - \lambda)^m Q(t) \}$ die **Vielfachheit** von λ als **Nullstelle** von $P(t)$. Es gilt:
 $m(P(t), \lambda) = m \Leftrightarrow P(t) = (t - \lambda)^m Q(t)$ für ein $Q(t)$ mit $Q(\lambda) \neq 0$.



Das Polynom

$$f(t) = (t+1)^4 \cdot t^3 \cdot (t-1) \cdot (t-1.25)^2 \in \mathbb{R}[t]$$

hat Nullstellen in

$$\lambda_1 = -1, \lambda_2 = 0, \lambda_3 = 1 \text{ und } \lambda_4 = 1.25$$

mit Vielfachheiten 4, 3, 1 und 2.

Diagonalisierbarkeitskriterium

Satz. Eine quadratische Matrix $A \in K^{n \times n}$ ist diagonalisierbar genau dann, wenn die beiden folgenden Bedingungen erfüllt sind:

1. $\chi_A(t) \in K[t]$ zerfällt (über K) in Linearfaktoren,
2. für jede Nullstelle λ von $\chi_A(t)$ gilt:

$$m(\chi_A(t), \lambda) = \dim \operatorname{Eig}(A, \lambda).$$

Sind die Bedingungen erfüllt, dann $\exists S \in \operatorname{GL}(n, K)$, so dass

$$SAS^{-1} = \begin{pmatrix} \lambda_1 & & 0 \\ & \ddots & \\ 0 & & \lambda_n \end{pmatrix}.$$

Dabei sind $\lambda_1, \dots, \lambda_n$ die nicht notwendig paarweise verschiedenen Eigenwerte von A .

Beispiel. $A = \begin{pmatrix} 0 & 1 \\ 0 & 0 \end{pmatrix}$ ist nicht diagonalisierbar. $\chi_A(t) = t^2$, aber

$$\operatorname{Eig}(A, 0) = \ker \begin{pmatrix} 0 & 1 \\ 0 & 0 \end{pmatrix} = \left\langle \begin{pmatrix} 1 \\ 0 \end{pmatrix} \right\rangle \text{ hat Dimension 1.}$$