

© С.К.Соболев.

Краткие лекции по линейной алгебре

Лекция 7. Квадратичные формы

Квадратичные формы. Координатная и матричная формы записи. Преобразование матрицы квадратичной формы при переходе к новому базису. Ранг квадратичной формы, его независимость от выбора базиса. Знакоопределённые квадратичные формы. Критерий Сильвестра (без док-ва). Канонический вид квадратичной формы. Метод Лагранжа. Приведение квадратичной формы к каноническому виду ортогональным преобразованием. Закон инерции квадратичных форм (без док-ва)

Обращение к лектору

Термин квадратичная форма в математике используется в двух смыслах.

1) **Квадратичная форма** – это просто функция от n переменных, являющаяся однородным многочленом второй степени от переменных x_1, x_2, \dots, x_n :

$$\varphi(x_1, x_2, \dots, x_n) = \sum_{i=1}^n a_{ii}x_i^2 + \sum_{1 \leq i < j \leq n} 2a_{ij}x_ix_j.$$

Коэффициенты a_{ij} образуют матрицу этой квадратичной формы.

Такого понятия квадратичной формы достаточно, например, чтобы объяснить, как выглядит **дифференциал второго порядка** функции $f(x_1, \dots, x_n)$ – это квадратичная форма (т.е. однородный многочлен второй степени) от дифференциалов независимых переменных, dx_1, dx_2, \dots, dx_n с матрицей Хессе

$$H = \left(\frac{\partial^2 f}{\partial x_i \partial x_j} \right).$$

2) Но такого понятия квадратичной формулы совершенно не достаточно, чтобы объяснить, почему это квадратичная форма в понимании (1) должна менять матрицу при переходе к другому базису, ведь при определении (1) ни о каком базисе нет речи. Поэтому требуется более глубокое определение квадратичной формы как особого рода функции от вектора в линейном пространстве, т.е. **функционала**.

7.1. Линейный и билинейный функционалы.

Напомним, что **линейным функционалом** называется отображение вида $\varphi : L \rightarrow \mathbf{R}$, т.е. определенная на некотором линейном пространстве L и принимающая произвольные вещественные значения, и удовлетворяющая свойству

$$\varphi(\alpha x + \beta y) = \alpha \varphi(x) + \beta \varphi(y)$$

для любых векторов $x, y \in L$ и чисел $\alpha, \beta \in \mathbf{R}$.

Пример линейного функционала в пространстве $C_{[a,b]}$. Если $x(t) \in C_{[a,b]}$ пусть $\varphi[x(t)] = \int_a^b x(t) dt$

Пусть L – n -мерное линейное пространство с базисом $\varepsilon = \{e_1; e_2; \dots; e_n\}$, и в нем задан линейный функционал $\varphi : L \rightarrow \mathbf{R}$. **Строкой** этого функционала в данном базисе называется матрица-строка

$$A_{\varphi, \varepsilon} = (a_1 \ a_2 \ \dots \ a_n) = (\varphi(e_1) \ \varphi(e_2) \ \dots \ \varphi(e_n)).$$

Пусть, далее $X = (x_1 \ x_2 \ \dots \ x_n)^T$ – столбец координат вектора $x \in L$ в данном базисе, Тогда, значение линейного функционала φ на векторе x равно:

$$\varphi(x) = \left(\sum_{k=1}^n x_k e_k \right) = \sum_{k=1}^n x_k \varphi(e_k) = (a_1 \ a_2 \ \dots \ a_n) \cdot \begin{pmatrix} x_1 \\ x_2 \\ \dots \\ x_n \end{pmatrix} = A \cdot X.$$

Понятно, что строка функционала меняется при переходе к другому базису

Теорема 1. Пусть A и A' – строки одного и того же функционала в старом базисе ε и в новом базисе δ соответственно, $P = P_{\varepsilon \rightarrow \delta}$ – матрица перехода. Тогда $A' = AP$.

Определение. Билинейным функционалом на пространстве L называется отображение

$B: L^2 \rightarrow \mathbf{R}$, которое каждой паре векторов $\mathbf{x}, \mathbf{y} \in L$ ставит в соответствие число $B(\mathbf{x}, \mathbf{y}) \in \mathbf{R}$, и это отображение линейно по каждому аргументу:

$$B(\alpha \mathbf{x} + \beta \mathbf{y}, \mathbf{z}) = \alpha B(\mathbf{x}, \mathbf{z}) + \beta B(\mathbf{y}, \mathbf{z})$$

$$B(\mathbf{x}, \alpha \mathbf{y} + \beta \mathbf{z}) = \alpha B(\mathbf{x}, \mathbf{y}) + \beta B(\mathbf{x}, \mathbf{z})$$

для любых $\mathbf{x}, \mathbf{y}, \mathbf{z} \in L$ и $\alpha, \beta \in \mathbf{R}$

Пример 1. (а) В пространстве геометрических векторов V формула $\varphi(\mathbf{x}, \mathbf{y}) = (\mathbf{a}\mathbf{x}\mathbf{y})$ (смешанное произведение), где $\mathbf{a} \in V$ – фиксированный вектор, задает билинейный функционал.

(б) В пространстве $C_{[a; b]}$ формула

$$B(x(t), y(t)) = \int_a^b f(t)x(t)y(t)dt,$$

где $f(t)$ – фиксированная функция, непрерывная на отрезке $[a; b]$, $x(t), y(t) \in C_{[a; b]}$, задает билинейный функционал.

(в) Пусть в произвольном евклидовом пространстве E действует линейный оператор $\mathcal{A}: E \rightarrow E$. Тогда формула $\varphi(\mathbf{x}, \mathbf{y}) = (\mathcal{A}(\mathbf{x}), \mathbf{y})$ (скалярное произведение) задает билинейный функционал.

Пусть билинейный функционал $B(\mathbf{x}, \mathbf{y})$ задан на конечномерном пространстве с базисом $\varepsilon = \{\mathbf{e}_1, \mathbf{e}_2, \dots, \mathbf{e}_n\}$. Вычислим значения билинейного функционала на каждой паре базисных векторов $a_{ij} = B(\mathbf{e}_i, \mathbf{e}_j)$. Квадратная матрица

$$A = (a_{ij}) = \begin{pmatrix} a_{11} & a_{11} & \dots & a_{11} \\ a_{11} & a_{11} & \dots & a_{11} \\ \dots & \dots & \dots & \dots \\ a_{11} & a_{11} & \dots & a_{11} \end{pmatrix}$$

называется **матрицей билинейного функционала** в данном базисе. С помощью этой матрицы можно вычислять значение билинейного функционала для любой пары векторов $\mathbf{x}, \mathbf{y} \in L$.

Теорема 2. Пусть $(x_1; x_2; \dots; x_n)$ и $(y_1; y_2; \dots; y_n)$ координаты (в некотором базисе) векторов \mathbf{x} и \mathbf{y} соответственно, $A = (a_{ij})$ – матрица билинейного функционала $B(\mathbf{x}, \mathbf{y})$ в том же базисе.

Тогда

$$B(\mathbf{x}, \mathbf{y}) = \sum_{i=1}^n \sum_{j=1}^n a_{ij}x_i y_j = a_{11}x_1 y_1 + a_{12}x_1 y_2 + \dots + a_{21}x_2 y_1 + \dots + a_{nn}x_n y_n. \quad (*)$$

Если же $X = (x_1; x_2; \dots; x_n)^T$ и $Y = (y_1; y_2; \dots; y_n)^T$ – столбцы координат векторов \mathbf{x} и \mathbf{y} соответственно, то формулу (*) можно записать в матричном виде:

$$B(\mathbf{x}, \mathbf{y}) = X^T A Y.$$

Пример 2. Найти матрицу билинейного функционала $\varphi(\mathbf{x}, \mathbf{y}) = (\mathbf{a}\mathbf{x}\mathbf{y})$ из примера 1 в базисе $\{\mathbf{i}, \mathbf{j}, \mathbf{k}\}$, если вектор \mathbf{a} имеет в этом базисе координаты $\mathbf{a}(p; q; r)$

Решение. Вычисляем $a_{11} = \varphi(\mathbf{i}, \mathbf{i}) = (\mathbf{a}\mathbf{i}\mathbf{i}) = \begin{vmatrix} p & q & r \\ 1 & 0 & 0 \\ 1 & 0 & 0 \end{vmatrix} = 0$

Аналогично, $a_{22} = a_{33} = 0$.

Далее, $a_{12} = \varphi(\mathbf{i}, \mathbf{j}) = (\mathbf{a}\mathbf{i}\mathbf{j}) = \begin{vmatrix} p & q & r \\ 1 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & 0 \end{vmatrix} = r$

Аналогично находим $a_{21} = -r, a_{13} = -q, a_{31} = q, a_{23} = p, a_{32} = -p$

Окончательно, матрица данного билинейного функционала.: $A = \begin{pmatrix} 0 & r & -q \\ -r & 0 & p \\ q & -p & 0 \end{pmatrix}$. ■

При переходе к другому базису матрица билинейного функционала также меняется.

Теорема 3. Пусть A и A' – матрицы одного и того же функционала в старом базисе ε и в новом базисе δ соответственно, $P = P_{\varepsilon \rightarrow \delta}$ – матрица перехода. Тогда $A' = P^T A P$.

7. 2. Квадратичный функционал

Определение. Пусть $B(x, y)$ некоторый билинейный функционал на линейном пространстве L . Функция $\varphi(x) = B(x, x)$, получаемая отождествлением его аргументов, называется **квадратичным функционалом**. Таким образом, функционал $\varphi : L \rightarrow \mathbf{R}$ называется **квадратичным**, если найдется билинейный функционал $B(x, y)$ такой, что $\varphi(x) = B(x, x)$ для всех $x \in L$. Отметим, что квадратичный функционал **не является линейным**.

Пример 3. Найти квадратичные функционалы, порожденные билинейными функционалами примеров 1 (б) и (в):

$$(б) \varphi(x(t)) = \int_a^b f(t) \cdot x^2(t) dt$$

$$(в) \psi(x) = (\mathcal{A}(x), x) \text{ (скалярное произведение).}$$

Свойства квадратичного функционала описывает следующая

Теорема 4. Пусть $\varphi(x)$ – квадратичный функционал, заданный на линейном пространстве L . Тогда для любых векторов $x, y \in L$ и произвольных чисел $\alpha, \beta \in \mathbf{R}$ выполняются равенства:

$$(а) \varphi(\alpha x) = \alpha^2 \varphi(x);$$

$$(б) \varphi(x + y) + \varphi(x - y) = 2(\varphi(x) + \varphi(y));$$

$$(в) \varphi(\alpha x + \beta y) + \varphi(\beta x - \alpha y) = (\alpha^2 + \beta^2)(\varphi(x) + \varphi(y)).$$

Доказательство. Очевидно, что свойства (а) и (б) являются частными случаями свойства (в), поэтому его и докажем. Пусть $B(x, y)$ – билинейный функционал, порождающий наш квадратичный функционал: $\varphi(x) = B(x, x)$. Тогда

$$\begin{aligned} \varphi(\alpha x + \beta y) &= B(\alpha x + \beta y, \alpha x + \beta y) = \alpha \cdot B(x, \alpha x + \beta y) + \beta \cdot B(y, \alpha x + \beta y) = \\ &= \alpha \cdot (\alpha \cdot B(x, x) + \beta \cdot B(x, y)) + \beta \cdot (\alpha \cdot B(y, x) + \beta \cdot B(y, y)) = \\ &= \alpha^2 B(x, x) + \alpha\beta (B(x, y) + B(y, x)) + \beta^2 B(y, y). \end{aligned}$$

Аналогично,

$$\varphi(\beta x - \alpha y) = \beta^2 B(x, x) - \alpha\beta (B(x, y) + B(y, x)) + \alpha^2 B(y, y).$$

Поэтому

$$\varphi(\alpha x + \beta y) + \varphi(\beta x - \alpha y) = (\alpha^2 + \beta^2)(B(x, x) + B(y, y)) = (\alpha^2 + \beta^2)(\varphi(x) + \varphi(y)). \blacksquare$$

Билинейный функционал $B(x, y)$ называется **симметричным**, если $B(x, y) = B(y, x)$ для всех $x, y \in L$. Очевидно, что матрица симметричного функционала в любом базисе тоже симметрична, т.е. не меняется при транспонировании.

Лемма. Для любого билинейного функционала $B(x, y)$ и числа $\lambda \in \mathbf{R}$ билинейный функционал $B_0(x, y) = \lambda (B(x, y) + B(y, x))$ – симметричный.

Замечание. Пусть $B(x, y)$ билинейный функционал. $B_0(x, y) = \frac{1}{2}(B(x, y) + B(y, x))$. Тогда $B(x, y)$ и $B_0(x, y)$ порождают один и тот же квадратичный функционал. $\varphi(x) = B(x, x) = B_0(x, x)$. Поэтому в дальнейшем будем полагать, что любой квадратичный функционал порождается именно симметричным билинейным функционалом.

7.3. Квадратичные формы. Координатная и матричная формы записи. Общий подход.

В конечномерном пространстве с базисом $\varepsilon = \{e_1, e_2, \dots, e_n\}$ если вектор x имеет координаты $(x_1; x_2; \dots; x_n)$, то квадратичный функционал $\varphi(x)$ порожденный симметричным билинейным функционалом $B_0(x, y)$, задается однородным многочленом второй степени от координат вектора x :

$$\begin{aligned}\varphi(x_1, x_2, \dots, x_n) &= \sum_{i=1}^n \sum_{j=1}^n a_{ij} x_i x_j = \\ &= a_{11}x_1^2 + a_{22}x_2^2 + \dots + a_{nn}x_n^2 + 2a_{12}x_1x_2 + 2a_{13}x_1x_3 + \dots + 2a_{n-1,n}x_{n-1}x_n.\end{aligned}$$

где $a_{ij} = B_0(e_i, e_j) = B_0(e_j, e_i) = a_{ji}$.

Этот многочлен называется **квадратично формой** (в базисе ε).

Симметричная матрица $A = (a_{ij}) = \begin{pmatrix} a_{11} & a_{12} & \dots & a_{1n} \\ a_{21} & a_{22} & \dots & a_{2n} \\ \dots & \dots & \dots & \dots \\ a_{n1} & a_{n2} & \dots & a_{nn} \end{pmatrix}$

называется **матрицей квадратичного функционала $\varphi(x)$** , или, что тоже самое, **матрицей квадратичной формы** в базисе $\varepsilon = \{e_1, e_2, \dots, e_n\}$.

7.4. Квадратичные формы, упрощенный подход. Координатная и матричная формы записи.

Квадратичную форму можно определить и упрощенным образом, т.е. не вводя понятие билинейного и квадратичного функционала. А именно,

Определение. Квадратичной формой в данном базисе называется числовая функция вектора x конечномерного пространства, (т.е. функционал), выражающаяся однородным многочлена второй степени от координат вектора в данном базисе.

Например,

При $n = 2$: $f(x) = f(x, y) = 2x^2 + 5xy - y^2$

При $n = 3$: $g(x) = g(x_1, x_2, x_3) = x_1^2 + 3x_2^2 - 5x_3^2 + 4x_1x_2 - 7x_2x_3$

В общем случае квадратичная форма от n переменных имеет вид

$$\varphi(x_1, x_2, \dots, x_n) = \sum_{i=1}^n \sum_{j=1}^n a_{ij} x_i x_j$$

Коэффициент при произведении переменных $x_i x_j$ равен $a_{ij} + a_{ji}$, поэтому, не нарушая общности, можно считать, что $a_{ij} = a_{ji}$. Следовательно, матрицу коэффициентов

$$A = (a_{ij}) = \begin{pmatrix} a_{11} & a_{12} & \dots & a_{1n} \\ a_{21} & a_{22} & \dots & a_{2n} \\ \dots & \dots & \dots & \dots \\ a_{n1} & a_{n2} & \dots & a_{nn} \end{pmatrix}$$

можно считать симметричной, и

$$\varphi(x_1, x_2, \dots, x_n) = \sum_{i=1}^n a_{ii} x_i^2 + \sum_{1 \leq i < j \leq n} 2a_{ij} x_i x_j$$

Квадратичную форму можно записать в матричном виде.

$$\varphi(x_1, x_2, \dots, x_n) = (x_1 \ x_2 \ \dots \ x_n) A \begin{pmatrix} x_1 \\ x_2 \\ \dots \\ x_n \end{pmatrix} = X^T A X$$

где $X = (x_1; x_2; \dots; x_n)^T$.

Диагональный элемент a_{ii} матрицы квадратичной формы равен коэффициенту при x_i^2 , а при $i \neq j$ элемент $a_{ij} = a_{ji}$ равен половине коэффициента при произведении $x_i x_j$.

Пример 4. Найти матрицу квадратичной формы $f(x_1, x_2, x_3) = 2x_1^2 - x_2^2 + 4x_3^2 + 5x_1x_2 - 6x_1x_3$

Ответ $A = \begin{pmatrix} 2 & \frac{5}{2} & -3 \\ \frac{5}{2} & -1 & 0 \\ -3 & 0 & 4 \end{pmatrix}$

Пример 5. Восстановить квадратичную форму $g(\mathbf{x})$ по её матрице

$$B = \begin{pmatrix} 1 & -2 & 3 & 0 \\ -2 & 0 & -1 & 4 \\ 3 & -1 & 4 & 0 \\ 0 & 4 & 0 & -5 \end{pmatrix}$$

Ответ $g(x_1, x_2, x_3, x_4) = x_1^2 + 4x_3^2 - 5x_4^2 - 4x_1x_2 + 6x_1x_3 - 2x_2x_3 + 8x_2x_4$

7.5. Преобразование матрицы квадратичной формы при переходе к новому базису.

При изменении базиса матрица квадратичной формы тоже меняется.

Теорема 5. Пусть A – матрица квадратичной формы в исходном базисе ε , A' – матрица этой же квадратичной формы в новом базисе ε' , $P = P_{\varepsilon \rightarrow \varepsilon'}$ – матрица перехода. Тогда $A' = P^T A P$.

Доказательство.

Лемма. Пусть квадратные симметричные матрицы A и B порядка n таковы, что для любого столбца X размером $n \times 1$ выполняется равенство $X^T A X = X^T B X$. Тогда $A = B$.

Доказательство Леммы. Рассмотрим матрицу $C = A - B = (c_{ij})$. Тогда $X^T C X = 0$ для любого столбца X . Сначала в качестве X возьмем столбец E_i , у которого на i -м месте стоит 1, а остальные нули. Тогда $E_i^T C E_i = c_{ii} = 0$. Затем в качестве X возьмем столбец E_{ij} , у которого на местах с номерами i и j стоят единицы, а остальные нули. Тогда $E_{ij}^T C E_{ij} = c_{ii} + 2c_{ij} + c_{jj} = 0 \Rightarrow c_{ij} = 0$. Следовательно, $A - B = C = 0 \Rightarrow A = B$.

Доказательство самой теоремы.

Пусть столбец координат вектора \mathbf{x} в старом базисе равен X , а в новом Y . Тогда

$$\varphi(\mathbf{x}) = X^T A X = Y^T A' Y.$$

С другой стороны,

$$X = P Y \Rightarrow X^T = Y^T P^T,$$

Поэтому

$$Y^T A' Y = \varphi(\mathbf{x}) = X^T A X = (Y^T P^T) A (P Y) = Y^T (P^T A P) Y,$$

и это равенство верно для любого столбца Y . Отсюда, по Лемме, $A' = P^T A P$. ■

Пример 6. Дана квадратичная форма $f(\mathbf{x}) = 3x^2 + 2xy - 2y^2$ в базисе $\{\mathbf{i}, \mathbf{j}\}$. Найти вид этой квадратичной формы в базисе $\mathbf{e}_1 = \mathbf{i} + \mathbf{j}$, $\mathbf{e}_2 = 3\mathbf{i} - \mathbf{j}$.

Матрица данной квадратичной формы в исходном базисе $A = \begin{pmatrix} 3 & 1 \\ 1 & -2 \end{pmatrix}$.

Матрица перехода $P = \begin{pmatrix} 1 & 3 \\ 1 & -1 \end{pmatrix}$.

Тогда в новом базисе матрица квадратичной формы будет

$$A' = P^T A P = \begin{pmatrix} 1 & 1 \\ 3 & -1 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} 3 & 1 \\ 1 & -2 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} 1 & 3 \\ 1 & -1 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 4 & -1 \\ 8 & 5 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} 1 & 3 \\ 1 & -1 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 3 & 13 \\ 13 & 19 \end{pmatrix}$$

Сама квадратичная форма в новом базисе выглядит так:

$$f(\mathbf{x}) = 3(x')^2 + 26x'y' + 19(y')^2.$$

Напомним, что $(x; y)$ и $(x'; y')$ – координаты одного и того же вектора x в старом и новом базисах соответственно.

7.6. Ранг квадратичной формы, его независимость от выбора базиса.

Рангом квадратичной формы называется ранг её матрицы.

Теорема 6. Ранг квадратичной формы не зависит от базиса.

В самом деле, если A – матрица квадратичной формы в одном базисе, а A' – матрица этой же квадратичной формы в другом базисе, то $A' = P^T A P$, где P – (невырожденная!!) матрица перехода, то $\text{rg } A' = \text{rg}(P^T A P) = \text{rg}(P^T A) = \text{rg } A$, поскольку при умножении произвольной матрицы A справа или слева на невырожденную матрицу ранг матрицы A не меняется.

Пример 7. Найти ранг квадратичной формы $f(x, y, z) = x^2 + 3y^2 - z^2 + 4xy + 2yz$.

Решение. Выпишем матрицу квадратичной формы и найдем её ранг, приведя матрицу к ступенчатому виду с помощью элементарных преобразований строк:

$$A = \begin{pmatrix} 1 & 2 & 0 \\ 2 & 3 & 1 \\ 0 & 1 & -1 \end{pmatrix} \sim \begin{pmatrix} 1 & 2 & 0 \\ 0 & -1 & 1 \\ 0 & 1 & -1 \end{pmatrix} \sim \begin{pmatrix} 1 & 2 & 0 \\ 0 & -1 & 1 \\ 0 & 0 & 0 \end{pmatrix}$$

Следовательно, ранг квадратичной формы равен 2.

7.7. Знакоопределённые квадратичные формы. Критерий Сильвестра (без док-ва).

Определение. Квадратичная форма $f(x) = f(x_1, x_2, \dots, x_n)$ называется **положительно определённой**, если $f(x) > 0$ для всех векторов $x \neq 0$, и **отрицательно определённой**, если $f(x) < 0$ для всех векторов $x \neq 0$. Положительно и отрицательно определённые квадратичные формы называются **знакоопределёнными**.

Определение. Говорят, что квадратичная форма в некотором базисе имеет **канонический вид**, если в этом базисе её матрица A диагональная

$$A = \begin{pmatrix} \lambda_1 & 0 & \dots & 0 \\ 0 & \lambda_2 & \dots & 0 \\ \dots & \dots & \dots & \dots \\ 0 & 0 & \dots & \lambda_n \end{pmatrix}$$

Сама квадратичная форма при этом содержит только квадраты координат:

$$f(x) = \lambda_1 x_1^2 + \lambda_2 x_2^2 + \dots + \lambda_n x_n^2 \quad (*)$$

Ранг канонической формы, имеющей канонический вид, очевидно, равен числу её ненулевых коэффициентов

Также очевидно, что если квадратичная форма имеет канонический вид (*), то она:

положительно определена \Leftrightarrow все коэффициенты $\lambda_i > 0$

положительно определена \Leftrightarrow все коэффициенты $\lambda_i < 0$.

В общем случае для выявления знакоопределённости квадратичной формы, имеющей канонический вид, имеется критерий Сильвестра.

Определение. Напомним, что **главным минором** квадратной матрицы называется минор, составленный из элементов, стоящих на пересечении строк и столбцов этой матрицы с **одинаковыми** номерами. **Угловым минором** порядка k называется её главный минор, составленный из элементов матрицы, стоящих на пересечении её **первых** k строк и **первых** k столбцов. Квадратная матрица порядка n имеет n угловых миноров (по одному каждого порядка), и C_n^k главных миноров порядка k .

Например, матрица

$$A = \begin{pmatrix} 1 & 2 & 3 & 4 \\ 2 & 5 & 6 & 7 \\ 3 & 6 & 8 & 9 \\ 4 & 7 & 9 & 10 \end{pmatrix}$$

имеет такие угловые миноры

$$\Delta_1 = 1, \Delta_2 = \begin{vmatrix} 1 & 2 \\ 2 & 5 \end{vmatrix} = 1, \Delta_3 = \begin{vmatrix} 1 & 2 & 3 \\ 2 & 5 & 6 \\ 3 & 6 & 8 \end{vmatrix} \text{ и } \Delta_4 = \det(A)$$

Теорема 7 (критерий Сильвестра). Пусть квадратичная в некотором базисе имеет матрицу A . Тогда эта квадратичная форма:

(а) положительно определена \Leftrightarrow все угловые миноры матрицы A строго положительны, т.е. $\Delta_1 > 0, \Delta_2 > 0, \Delta_3 > 0, \dots$

(б) отрицательно определена \Leftrightarrow знаки её угловых миноров чередуются, причём, первый минор отрицательный: $\Delta_1 < 0, \Delta_2 > 0, \Delta_3 < 0, \dots$

Полезны также следующие определения.

Квадратичная форма $f(x)$ называется **неотрицательно определенной**, если $f(x) \geq 0$ для всех векторов $x \neq 0$, и **неположительно определенной**, если $f(x) \leq 0$ для всех векторов $x \neq 0$.

[напомним, что $f(0) = 0$ для любой квадратичной формы f].

Квадратичная форма $f(x)$ называется **знакопеременной**, или **знакопеременной**, обозначение $f \leq 0$, если она принимает как положительные, так и отрицательные значения. Следующее утверждение очевидно:

Предложение. Пусть квадратичная форма имеет канонический вид

$$f(x) = \lambda_1 x_1^2 + \lambda_2 x_2^2 + \dots + \lambda_n x_n^2 \quad (*)$$

Тогда она

(в) неотрицательно определена \Leftrightarrow все её коэффициенты неотрицательны: $\lambda_i \geq 0$;

(г) неположительно определена \Leftrightarrow все её коэффициенты неположительны: $\lambda_i \leq 0$;

(д) знакопеременна \Leftrightarrow среди её коэффициентов λ_i есть как положительные, так и отрицательные.

Для квадратичной формы, не имеющей канонический вид, соответствующие критерий более сложный

Теорема 8. Пусть квадратичная в некотором базисе имеет матрицу A . Тогда эта квадратичная форма:

(в) неотрицательно определена \Leftrightarrow все главные миноры матрицы A неотрицательны.

(г) неположительно определена \Leftrightarrow все главные миноры матрицы A четного порядка неотрицательны, а нечетного порядка – неположительны.

(д) знакопеременна \Leftrightarrow матрица A содержит отрицательный главный минор четного порядка или содержит главные миноры нечетного порядка разных знаков.

В частности, в двумерном случае, для квадратичной формы $f(x, y) = ax^2 + 2bxy + cy^2$ с матрицей

$$A = \begin{pmatrix} a & b \\ b & c \end{pmatrix}, \text{ получаем следующие критерии.}$$

Квадратичная форма $f(x, y) = ax^2 + 2bxy + cy^2$

(а) знакоопределена $\Leftrightarrow \Delta = ac - b^2 > 0$;

(б) положительно определена $\Leftrightarrow a > 0$ и $\Delta > 0$;

(в) отрицательно определена $\Leftrightarrow a < 0$ и $\Delta > 0$

(г) неотрицательно определена $\Leftrightarrow a \geq 0, c \geq 0$ и $\Delta \geq 0$;

(д) неположительно определена $\Leftrightarrow a \leq 0, c \leq 0$ и $\Delta \geq 0$;

(е) знакопеременна $\Leftrightarrow \Delta < 0$.

Пример 8. Исследовать знакоопределенность квадратичной формы

$$f(x, y) = \lambda x^2 - 4xy + (\lambda + 3)y^2$$

в зависимости от параметра λ .

Решение. Составим матрицу этой квадратичной формы. $A(\lambda) = \begin{pmatrix} \lambda & -2 \\ -2 & \lambda + 3 \end{pmatrix}$

и вычислим главные миноры:

$$\text{первого порядка } \Delta_1 = \lambda, \Delta'_1 = \lambda + 3;$$

$$\text{второго порядка } \Delta_2 = \lambda(\lambda + 3) - 4 = \lambda^2 + 3\lambda - 4 = (\lambda - 1)(\lambda + 4)$$

Составим таблицу и сделаем заключения:

λ	$\lambda < -4$	-4		-3		0		1	$\lambda > 1$
$\Delta_1 = \lambda$	-	-	-	-	-	0	+	+	+
$\Delta'_1 = \lambda + 3$	-	-	-	0	+	+	+	+	+
$\Delta_2 = (\lambda - 1)(\lambda + 4)$	+	0	-	-	-	-	-	0	+
заключение	$f < 0$	$f \leq 0$	$f \leq 0$				$f \geq 0$		$f > 0$
	отрицательно определена	неположительно определена	знакопеременная				неотрицательно знакоопределена		положительно определена

7.7. Приведение квадратичной формы к каноническому виду. Метод Лагранжа.

Теорема 9. Для всякой квадратичной формы существует базис, в котором она имеет канонический вид, т.е. её матрица в этом базисе диагональная.

Этот канонический вид не единственен, результат зависит от способа приведения к каноническому виду.

Практические способы приведения квадратичной формы к каноническому виду.

1) Метод Лагранжа (выделение полных квадратов). Пусть дана квадратичная форма

$$f(\mathbf{x}) = \sum_{i=1}^n a_{ii}x_i^2 + \sum_{1 \leq i < j \leq n} 2a_{ij}x_i x_j$$

Для применения этого метода необходимо, чтобы среди коэффициентов a_{ii} хотя бы один был ненулевой. Если все коэффициенты при квадратах равны нулю: $a_{ii} = 0$, то возьмем какое-нибудь $a_{ij} \neq 0$, например, это a_{12} . Сделаем вспомогательное преобразование

$$x_1 = y_1 + y_2, x_2 = y_1 - y_2, x_k = y_k \text{ при } k \geq 3.$$

Тогда $f(\mathbf{x}) = 2a_{12}x_1x_2 + \dots = 2a_{12}(y_1 + y_2)(y_1 - y_2) + \dots = 2a_{12}y_1^2 - 2a_{12}y_2^2 + \dots$. Получим квадратичную форму (в другом базисе), содержащую ненулевой коэффициент при y_1^2 и y_2^2 .

Итак, среди коэффициентов a_{ii} хотя бы один ненулевой, пусть это a_{11} . Выпишем все слагаемые содержащие x_1 , и выделим полный квадрат:

$$\begin{aligned} f(\mathbf{x}) &= a_{11}x_1^2 + 2a_{12}x_1x_2 + 2a_{13}x_1x_3 + \dots + 2a_{1n}x_1x_n + Q(x_2, x_3, \dots, x_n) = \\ &= a_{11} \left(x_1^2 + 2x_1 \left(\frac{a_{12}}{a_{11}}x_2 + \frac{a_{13}}{a_{11}}x_3 + \dots + \frac{a_{1n}}{a_{11}}x_n \right) + \left(\frac{a_{12}}{a_{11}}x_2 + \frac{a_{13}}{a_{11}}x_3 + \dots + \frac{a_{1n}}{a_{11}}x_n \right)^2 \right) - \\ &- a_{11} \left(\frac{a_{12}}{a_{11}}x_2 + \frac{a_{13}}{a_{11}}x_3 + \dots + \frac{a_{1n}}{a_{11}}x_n \right)^2 + Q(x_2, x_3, \dots, x_n) = \\ &= a_{11} \left(x_1 + \frac{a_{12}}{a_{11}}x_2 + \frac{a_{13}}{a_{11}}x_3 + \dots + \frac{a_{1n}}{a_{11}}x_n \right)^2 + g(x_2, x_3, \dots, x_n) = \lambda_1 y_1^2 + g(x_2, x_3, \dots, x_n) \end{aligned}$$

где $y_1 = x_1 + \frac{a_{12}}{a_{11}}x_2 + \frac{a_{13}}{a_{11}}x_3 + \dots + \frac{a_{1n}}{a_{11}}x_n = x_1 + q_{12}x_2 + \dots + q_{1n}x_n$, а $g(x_2, x_3, \dots, x_n)$ – квадратичная форма от меньшего количества переменных. Эту же процедуру применим к $g(x_2, x_3, \dots, x_n)$, и

т.д., в результате получим $f(\mathbf{x}) = \lambda_1 y_1^2 + \lambda_2 y_2^2 + \dots + \lambda_n y_n^2$, где

$$y_k = x_k + q_{k,k+1}x_{k+1} + \dots + q_{k,n}x_n, \quad k = 1, 2, \dots, n \quad (*)$$

Переменные y_1, y_2, \dots, y_n рассматриваем как координаты вектора \mathbf{x} в новом базисе. Соотношения (*) можно записать в матричной форме

$$Y = QX,$$

где X – столбец координат вектора \mathbf{x} в старом базисе, Y – столбец координат этого же вектора в новом базисе, а верхнетреугольная матрица

$$Q = \begin{pmatrix} 1 & q_{12} & q_{13} & \dots & q_{1n} \\ 0 & 1 & q_{23} & \dots & q_{2n} \\ 0 & 0 & 1 & \dots & q_{3n} \\ \dots & \dots & \dots & \dots & \dots \\ 0 & 0 & 0 & \dots & 1 \end{pmatrix}$$

является матрицей перехода от нового базиса к старому. Чтобы найти новый базис нужно из уравнений (*) выразить старые координаты через новые

$$x_k = y_k + p_{k,k+1}y_{k+1} + \dots + p_{k,n}y_n, \quad k = 1, 2, \dots, n$$

Которые в матричном виде записываются так: $X = PY$, где

$$P = \begin{pmatrix} 1 & p_{12} & p_{13} & \dots & p_{1n} \\ 0 & 1 & p_{23} & \dots & p_{2n} \\ 0 & 0 & 1 & \dots & p_{3n} \\ \dots & \dots & \dots & \dots & \dots \\ 0 & 0 & 0 & \dots & 1 \end{pmatrix}$$

– матрица перехода от старого базиса к новому. Её столбцы состоят из координат новых базисных векторов.

Пример 9. Привести к каноническому виду квадратичные формы и указать новый базис, в котором они имеют такой вид.

(а) $f(\mathbf{x}) = f(x_1, x_2) = 5x_1^2 + 6x_1x_2 - 3x_2^2$

(б) $g(x, y, z) = xy + 4xz - 5yz$

Решение. Первый способ: Сначала выделим полный квадрат для переменной x_1 :

$$\begin{aligned} f(\mathbf{x}) = f(x_1, x_2) &= 5x_1^2 + 6x_1x_2 - 3x_2^2 = 5\left(x_1^2 + \frac{6}{5}x_1x_2\right) - 3x_2^2 = 5\left(x_1^2 + 2x_1 \cdot \frac{3}{5}x_2 + \frac{9}{25}x_2^2\right) - \frac{9}{5}x_2^2 - 3x_2^2 = \\ &= 5\left(x_1 + \frac{3}{5}x_2\right)^2 - \frac{24}{5}x_2^2 = 5y_1^2 - \frac{24}{5}y_2^2 \end{aligned}$$

– искомый канонический вид. Здесь

$$\left. \begin{matrix} y_1 = x_1 + \frac{3}{5}x_2 \\ y_2 = x_2 \end{matrix} \right\} \Rightarrow \left. \begin{matrix} x_1 = y_1 - \frac{3}{5}y_2 \\ x_2 = y_2 \end{matrix} \right\} \Rightarrow \begin{pmatrix} x_1 \\ x_2 \end{pmatrix} = P \begin{pmatrix} y_1 \\ y_2 \end{pmatrix}$$

Матрица перехода $P = \begin{pmatrix} 1 & -\frac{3}{5} \\ 0 & 1 \end{pmatrix}$, новый базис $e_1 = (1; 0)$, $e_2 = (-\frac{3}{5}; 1)$.

Второй способ: сперва выделим полный квадрат для переменной x_2 :

$$\begin{aligned} 5x_1^2 + 6x_1x_2 - 3x_2^2 &= -3\left(x_2^2 - 2x_2x_1 + x_1^2\right) + 8x_1^2 = -3(x_2 - x_1)^2 + 8x_1^2 = \\ &= -3z_1^2 + 8z_2^2 \end{aligned}$$

– искомый канонический вид. Здесь

$$\left. \begin{matrix} z_1 = x_2 - x_1 \\ z_2 = x_1 \end{matrix} \right\} \Rightarrow \left. \begin{matrix} x_1 = z_2 \\ x_2 = z_1 + z_2 \end{matrix} \right\} \Rightarrow \begin{pmatrix} x_1 \\ x_2 \end{pmatrix} = P \begin{pmatrix} z_1 \\ z_2 \end{pmatrix}$$

Матрица перехода $P = \begin{pmatrix} 0 & 1 \\ 1 & 1 \end{pmatrix}$, новый базис $f_1 = (0; 1)$, $f_2 = (1; 1)$.

Отметим, что хотя эти способы дали разные канонические виды, в обоих случаях получился один положительный и один отрицательный коэффициент.

(в) Квадратичная форма не содержит квадраты переменных, поэтому сначала сделаем вспомогательное преобразование

$$x = x_1 + y_1, y = x_1 - y_1, z = z_1.$$

Получим

$$xy + 4xz - 5yz = (x_1 + y_1)(x_1 - y_1) + (x_1 + y_1)z_1 - 5(x_1 - y_1)z_1 = x_1^2 - y_1^2 - 4x_1z_1 + 6y_1z_1$$

Теперь выделяем полный квадрат при x_1 , а затем при y_1

$$\begin{aligned} g &= x_1^2 - 4x_1z_1 - y_1^2 + 6y_1z_1 = (x_1 - 2z_1)^2 - 4z_1^2 - y_1^2 + 6y_1z_1 = \\ &= (x_1 - 2z_1)^2 - (y_1 - 3z_1)^2 + 5z_1^2 = x_2^2 - y_2^2 + 5z_2^2 \end{aligned}$$

– искомый канонический вид, где $x_2 = x_1 - 2z_1, y_2 = y_1 - 3z_1, z_2 = z_1$.

Выразим теперь старые переменные x, y, z через новые x_2, y_2, z_2 :

$$\left. \begin{aligned} x_2 &= x_1 - 2z_1 \\ y_2 &= y_1 - 3z_1 \\ z_2 &= z_1 \end{aligned} \right\} \Rightarrow \left. \begin{aligned} x_1 &= x_2 + 2z_2 \\ y_1 &= y_2 + 3z_2 \\ z_1 &= z_2 \end{aligned} \right\} \Rightarrow \left. \begin{aligned} x &= x_1 + y_1 = x_2 + y_2 + 5z_2 \\ y &= x_1 - y_1 = x_2 - y_2 - z_2 \\ z &= z_1 = z_2 \end{aligned} \right\}$$

Таким образом, $\begin{pmatrix} x \\ y \\ z \end{pmatrix} = P \begin{pmatrix} x_2 \\ y_2 \\ z_2 \end{pmatrix}$, где $P = \begin{pmatrix} 1 & 1 & 5 \\ 1 & -1 & -1 \\ 0 & 0 & 1 \end{pmatrix}$ – матрица перехода к новому базису, новый

базис: $e_1 = (1; 1; 0), e_2 = (1; -1; 0), e_3 = (5; -1; 1)$,

в котором квадратичная форма имеет канонический вид $g = x_2^2 - y_2^2 + 5z_2^2$.

7.8. Приведение квадратичной формы к каноническому виду ортогональным преобразованием. Закон инерции.

Вспомним, что матрица квадратичной формы симметрична, и что для всякой симметричной матрицы A найдется ортогональная матрица Q такая, что матрица

$$A' = Q^{-1}AQ = Q^T A Q$$

диагональная. Следовательно, верна:

Теорема 10. Для всякой квадратичной формы найдется ортонормированный базис, в котором она будет иметь диагональный вид.

Алгоритм (приведения квадратичной формы к каноническому виду ортогональным преобразованием)

Пусть дана квадратичная форма $f(x_1, \dots, x_n)$.

1) Выписываем её матрицу A .

2) находим собственные значения матрицы A , т.е. корни её характеристического многочлена $P(\lambda) = \det(A - \lambda E) : \lambda_1, \lambda_2, \dots, \lambda_n$.

3) Выписываем канонический вид этой квадратичной формы (каждое собственное значение повторяется столько раз, какова его кратность):

$$f = \lambda_1 y_1^2 + \lambda_2 y_2^2 + \dots + \lambda_n y_n^2$$

4) находим ортонормированный базис из собственных векторов (как в Лекции 6)

$\varepsilon = \{e_1, e_2, \dots, e_n\}$, в котором данная квадратичная форма имеет канонический вид.

7) записываем ортогональную матрицу перехода Q , её столбцами являются координаты новых базисных (собственных) векторов.

Пример 10. Привести к каноническому виду ортогональным преобразованием квадратичную форму. $f(x) = f(x_1, x_2) = 5x_1^2 + 6x_1x_2 - 3x_2^2$

Решение. Составим матрицу квадратичной формы: $A = \begin{pmatrix} 5 & 3 \\ 3 & -3 \end{pmatrix}$, и найдем её собственные числа.

Характеристическое уравнение

$$\det(A - \lambda E) = \det \begin{pmatrix} 5 - \lambda & 3 \\ 3 & -3 - \lambda \end{pmatrix} = (5 - \lambda)(-3 - \lambda) - 9 = \lambda^2 - 2\lambda - 24 = 0$$

Корни (собственные значения) $\lambda_1 = 6$, $\lambda_2 = -4$.

Искомый канонический вид: $6u_1^2 - 5u_2^2$ (**)

Найдем собственные векторы

$$1) \lambda = 6: A - 6E = \begin{pmatrix} -1 & 3 \\ 3 & -9 \end{pmatrix},$$

решаем систему однородных уравнений

$$\begin{cases} -x_1 + 3x_2 = 0 \\ 3x_1 - 9x_2 = 0 \end{cases} \Leftrightarrow x_1 = 3x_2$$

Собственный вектор $\mathbf{b}_1 = (3; 1)$

$$2) \lambda = -4: A + 4E = \begin{pmatrix} 9 & 3 \\ 3 & 1 \end{pmatrix},$$

решаем систему однородных уравнений

$$\begin{cases} 9x_1 + 3x_2 = 0 \\ 3x_1 + x_2 = 0 \end{cases} \Leftrightarrow x_2 = -3x_1$$

Собственный вектор $\mathbf{b}_1 = (-1; 3)$.

Нормируем собственные векторы: $\mathbf{f}_1 = \frac{1}{\|\mathbf{b}_1\|} \mathbf{b}_1 = \frac{1}{\sqrt{10}} (3; 1)$, $\mathbf{f}_2 = \frac{1}{\|\mathbf{b}_2\|} \mathbf{b}_2 = \frac{1}{\sqrt{10}} (-1; 3)$.

В этом базисе квадратичная форма имеет канонический вид (**). Матрица перехода: (ортогональная!):

$$Q = \begin{pmatrix} \frac{3}{\sqrt{10}} & -\frac{1}{\sqrt{10}} \\ \frac{1}{\sqrt{10}} & \frac{3}{\sqrt{10}} \end{pmatrix} = \frac{1}{\sqrt{10}} \begin{pmatrix} 3 & -1 \\ 1 & 3 \end{pmatrix}$$

Замечание. Одну и ту же квадратичную форму $f(\mathbf{x}) = f(x_1, x_2) = 5x_1^2 + 6x_1x_2 - 3x_2^2$ мы привели к каноническим виду тремя способами (дважды методом Лагранжа и ортогональным преобразованием), и получили разные ответы

$$f = 5y_1^2 - \frac{24}{5}y_2^2 = -3z_1^2 + 8z_2^2 = 6u_1^2 - 4u_2^2.$$

Однако во всех трех случаях у нас получился один положительный и один отрицательный коэффициент. Справедлива общая теорема.

Теорема 11 (закон инерции квадратичных форм). При любом способе приведения квадратичной формы к каноническому виду всегда будет одно и то же как количество положительных коэффициентов, так и количество отрицательных коэффициентов.

Пример 11. Преподаватель задал трем студенткам: Маше, Даше и Глаше привести одну и ту же квадратичную форму к каноническому виду. Они получили такие ответы.

Маша: $3y_1^2 - 2y_2^2 + 5y_3^2$; **Даша:** $3y_1^2 - 2y_2^2 - 5y_3^2$; **Глаша:** $-7y_1^2 + 11y_2^2 + 4y_3^2$

Преподаватель посмотрел на ответы и сказал, что одна студентка ошиблась. Кто из них ошибся?

Ответ ашД ьсалбишО