

Matrice, vektorové prostory

Petr Olšák
petr@olsak.net

<http://petr.olsak.net/>

Maticy, součet a součin matic

Definice:

$\mathbf{A} \in \mathbb{R}^{m \times n}$, $\mathbf{B} \in \mathbb{R}^{m \times n}$, pak definujeme **součet** $\mathbf{C} = \mathbf{A} + \mathbf{B}$ po prvcích: $c_{ij} = a_{ij} + b_{ij}$ a **násobek skalárem** $\mathbf{C} = \alpha \mathbf{A}$ rovněž po prvcích: $c_{ij} = \alpha a_{ij}$.
Je-li $\mathbf{A} \in \mathbb{R}^{m \times p}$, $\mathbf{B} \in \mathbb{R}^{p \times n}$, pak definujeme **součin** $\mathbf{C} = \mathbf{AB}$, $\mathbf{C} \in \mathbb{R}^{m \times n}$ po prvcích: $c_{ij} = \sum_{k=1}^p a_{ik} b_{kj}$.

Blokový pohled na násobení matic:

Jsou-li matice \mathbf{A} , \mathbf{B} rozděleny do bloků takto:

$$\mathbf{A} = \begin{bmatrix} \mathbf{A}_{11} & \cdots & \mathbf{A}_{1p} \\ \cdots & \cdots & \cdots \\ \mathbf{A}_{m1} & \cdots & \mathbf{A}_{mp} \end{bmatrix}, \quad \mathbf{B} = \begin{bmatrix} \mathbf{B}_{11} & \cdots & \mathbf{B}_{1n} \\ \cdots & \cdots & \cdots \\ \mathbf{B}_{p1} & \cdots & \mathbf{B}_{pn} \end{bmatrix},$$

pak je

$$\mathbf{C} = \mathbf{AB}, \quad \mathbf{C} = \begin{bmatrix} \sum \mathbf{A}_{1k} \mathbf{B}_{k1} & \cdots & \sum \mathbf{A}_{1k} \mathbf{B}_{kn} \\ \cdots & \cdots & \cdots \\ \sum \mathbf{A}_{mk} \mathbf{B}_{k1} & \cdots & \sum \mathbf{A}_{pk} \mathbf{B}_{kn} \end{bmatrix}.$$

Rozmyslíme si, jak velké musejí být bloky, aby toto násobení bylo definováno.

Vektorový prostor, vektory, značení

- V optimalizaci si vystačíme s vektorovým (lineárním) prostorem \mathbb{R}^n .
- Sčítání vektorů po složkách, násobení skalárem každou složku.
- Geometrická interpretace vektorů jako orientovaných úseček či bodů je často velmi užitečná.
- Vektory píšeme tučně: \mathbf{x}, \mathbf{y} a tím je odlišíme od skalárů z \mathbb{R} .
- Vektor v kontextu maticového násobení vždy považujeme za jednosloupcovou matici.
- Máme tedy lineární prostor matic $\mathbb{R}^{n,1}$ který ztotožníme s \mathbb{R}^n .
- Standardní bázi v \mathbb{R}^n označujeme $\mathbf{e}_1, \mathbf{e}_2, \dots, \mathbf{e}_n$.
- Jedničkový vektor (sloupec jedniček) značíme $\mathbf{1}$.
- Řádkový vektor píšeme pomocí transpozice: $\mathbf{x}^T, \mathbf{y}^T$.
- Chceme-li vypsát složky vektoru, píšeme je oddělené čárkou v kulatých závorkách do řádků (ušetříme místo) nebo v hranatých závorkách do sloupců.
- Budeme potřebovat výhradně standardní skalární součin.
- Skalární součin vektorů \mathbf{x}, \mathbf{y} zapisujeme jako maticové násobení $\mathbf{x}^T \mathbf{y}$.

Důsledky blokového násobení matic

Součin \mathbf{Ax} po sloupcích

- $\mathbf{Ax} = [\mathbf{a}_1 \ \dots \ \mathbf{a}_n] \begin{bmatrix} x_1 \\ \vdots \\ x_n \end{bmatrix} = \mathbf{a}_1[x_1] + \dots + \mathbf{a}_n[x_n] = x_1\mathbf{a}_1 + \dots + x_n\mathbf{a}_n$
- \mathbf{Ax} je tedy LK sloupců \mathbf{A} s koeficienty x_i (velmi důležité!).
- Je tedy $\text{rng } \mathbf{A} = \{\mathbf{Ax}; \mathbf{x} \in \mathbb{R}^n\} = \text{Span}\{\mathbf{a}_1, \dots, \mathbf{a}_n\}$.

Součin \mathbf{Ax} po řádcích

- Nyní značím \mathbf{a}_i^T řádky matice \mathbf{A} :

$$\mathbf{Ax} = \begin{bmatrix} \mathbf{a}_1^T \\ \vdots \\ \mathbf{a}_n^T \end{bmatrix} \mathbf{x} = \begin{bmatrix} \mathbf{a}_1^T \mathbf{x} \\ \vdots \\ \mathbf{a}_n^T \mathbf{x} \end{bmatrix}$$

- Takže v jednotlivých složkách vektoru \mathbf{Ax} jsou skalární součiny řádků matice \mathbf{A} s vektorem \mathbf{x} .

Různé pohledy na soustavu lin. rovnic

Homogenní soustava $\mathbf{Ax} = \mathbf{0}$

- Označme \mathbf{a}_i^T řádky \mathbf{A} . Pro řešení \mathbf{x} platí $\mathbf{a}_i^T \mathbf{x} = 0$, tedy \mathbf{x} je kolmý na všechny řádky matice \mathbf{A} . Prostor všech řešení značíme $\text{Null } \mathbf{A}$ a je tedy kolmý na řádkový prostor matice \mathbf{A} a tvoří ortogonální doplněk.
- Řešíme-li tuto soustavu, hledáme bázi prostoru kolmého na řádkový prostor matice \mathbf{A} . Proto platí věta:

$$\dim \text{Null } \mathbf{A} + \dim \text{rng } \mathbf{A}^T = n, \quad \text{kde } \mathbf{A} \in \mathbb{R}^{m \times n}$$

Nehomogenní soustava $\mathbf{Ax} = \mathbf{b}$

- Označme $\mathbf{A} = [\mathbf{a}_1 \dots \mathbf{a}_n]$. Aby měla soustava řešení, musí $\mathbf{b} \in \text{Span}\{\mathbf{a}_i\}$, to je ekvivalentní s $\text{rank } \mathbf{A} = \text{rank}[\mathbf{A} \ \mathbf{b}]$ (Frobeniova věta).
Připomínám: $\text{rank } \mathbf{A} = \dim \text{rng } \mathbf{A} = \dim \text{rng } \mathbf{A}^T$.
- Má-li \mathbf{A} LN řádky, pak dle Frobeniovy věty má řešení pro každé $\mathbf{b} \in \mathbb{R}^m$ (protože $\text{rank } \mathbf{A} = \text{rank}[\mathbf{A} \ \mathbf{b}] = m$).
- Má-li \mathbf{A} LN sloupce (tvoří bázi $\text{rng } \mathbf{A}$), pak hledáme souřadnice vektoru \mathbf{b} v této bázi. Takové řešení je jediné.
- Vektor \mathbf{x} leží v průniku nadrovin $\mathbf{a}_i^T \mathbf{x} = b_i$.

Příklad

Máme dány tyto rovnice:

$$\sum_{j=1}^n a_{ij} x_j = b_i + y \quad \text{pro všechna } i \in \{1, \dots, m\},$$
$$\sum_{j=1}^n x_j = z,$$

kde x_j , y a z jsou proměnné, a_{ij} , b_i jsou zadané konstanty (parametry), $i \in \{1, \dots, m\}$, $j \in \{1, \dots, n\}$.

Sestavíme soustavu lineárních rovnic $\mathbf{P} \mathbf{u} = \mathbf{q}$. Tj. najdeme matici \mathbf{P} , vektor konstant \mathbf{q} a vektor neznámých \mathbf{u} tak, že soustava $\mathbf{P} \mathbf{u} = \mathbf{q}$ je ekvivalentní s výše uvedenými dílčími rovnicemi.

Příklad

Máme dány tyto rovnice:

$$\sum_{j=1}^n a_{ij}x_j = b_i + y \quad \text{pro všechna } i \in \{1, \dots, m\},$$
$$\sum_{j=1}^n x_j = z,$$

kde x_j , y a z jsou proměnné, a_{ij} , b_i jsou zadané konstanty (parametry), $i \in \{1, \dots, m\}$, $j \in \{1, \dots, n\}$.

Sestavíme soustavu lineárních rovnic $\mathbf{P}\mathbf{u} = \mathbf{q}$. Tj. najdeme matici \mathbf{P} , vektor konstant \mathbf{q} a vektor neznámých \mathbf{u} tak, že soustava $\mathbf{P}\mathbf{u} = \mathbf{q}$ je ekvivalentní s výše uvedenými dílčími rovnicemi.

Řešení: $\mathbf{A} = [a_{ij}]$, $\mathbf{b} = [b_i]$,

$$\begin{bmatrix} \mathbf{A} & -\mathbf{1} & \mathbf{0} \\ \mathbf{1}^T & 0 & -1 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} \mathbf{x} \\ y \\ z \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} \mathbf{b} \\ 0 \end{bmatrix}.$$

Připomenutí vlastností operací s maticemi

- $\mathbf{A} + \mathbf{B} = \mathbf{B} + \mathbf{A}$ (komutativita sčítání), $\mathbf{A}(\mathbf{B} + \mathbf{C}) = \mathbf{AB} + \mathbf{AC}$ (asociativita), $\mathbf{A}(\alpha\mathbf{B}) = (\alpha\mathbf{A})\mathbf{B} = \alpha(\mathbf{AB})$ (násobek).
- $(\mathbf{AB})^T = \mathbf{B}^T\mathbf{A}^T$ (transpozice součinu).
- Násobení není obecně komutativní ani pro čtvercové matice.

Pravá, levá inverze

- Jednotkovou matici značíme \mathbf{I} .
- Existuje-li k dané matici $\mathbf{A} \in \mathbb{R}^{m \times n}$ matice $\mathbf{B} \in \mathbb{R}^{n \times m}$, tak, že $\mathbf{AB} = \mathbf{I}$, pak \mathbf{B} nazýváme **pravou inverzí** k matici \mathbf{A} .
- Analogicky definujeme levou inverzi.
- \mathbf{A} má pravou inverzi, právě když má **plnou hodnost** a je široká nebo čtvercová (sloupce \mathbf{B} jsou řešenými nehomogeních soustav). Analogicky, \mathbf{A} má levou inverzi, právě když má plnou hodnost a je úzká nebo čtvercová.
- Má-li \mathbf{A} plnou hodnost a je čtvercová, pak je regulární a pravá inverze se rovná levé a je jediná.

Stopa

- Součet diagonálních prvků čtvercové matice je **stopa matice** (trace).
- Platí pochopitelně: $\text{tr}(\mathbf{A} + \mathbf{B}) = \text{tr} \mathbf{A} + \text{tr} \mathbf{B}$, $\text{tr}(\alpha \mathbf{A}) = \alpha \text{tr} \mathbf{A}$, $\text{tr}(\mathbf{A}^T) = \text{tr} \mathbf{A}$.
- Platí méně pochopitelně: $\text{tr}(\mathbf{AB}) = \text{tr}(\mathbf{BA})$ (cykličnost stopy).
- Z předchozího plyne, že $\text{tr}(\mathbf{ABC}) = \text{tr}(\mathbf{CAB}) = \text{tr}(\mathbf{BCA})$, ale není to rovno $\text{tr}(\mathbf{BAC})$ ani pro čtvercové matice.

Připomenutí determinantu

- $\det \mathbf{A} = \sum_{\pi} \text{sgn } \pi a_{1,\pi(1)} a_{2,\pi(2)} \cdots a_{n,\pi(n)}$.
- Měří (až na znaménko) velikost objemu rovnoběžnostěnu vymezeného sloupci \mathbf{A} (řádky \mathbf{A}).
- $\det \mathbf{A} = \det \mathbf{A}^T$.
- $\det(\alpha \mathbf{A}) = \alpha^n \det \mathbf{A}$, $\det(\mathbf{AB}) = \det \mathbf{A} \det \mathbf{B}$, $\det \mathbf{I} = 1$, $\det \mathbf{A}^{-1} = 1 / \det \mathbf{A}$.
- $\det \mathbf{A} \neq 0$ právě když \mathbf{A} je regulární.
- Je lineární při lineární změně v jediném sloupci/řádku.

Lineární zobrazení

- Zachovává koeficienty lin. kombinace vzorů v obrazech, přesněji:
 $\mathbf{f}: \mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R}^m$ je lineární, když $\mathbf{f}(\alpha_1 \mathbf{x}_1 + \dots + \alpha_k \mathbf{x}_k) = \alpha_1 \mathbf{f}(\mathbf{x}_1) + \dots + \alpha_k \mathbf{f}(\mathbf{x}_k)$.
- Je jednoznačně reprezentovatelné maticí $\mathbf{A} \in \mathbb{R}^{m \times n}$ tak, že $\mathbf{f}(\mathbf{x}) = \mathbf{A}\mathbf{x}$.
- Je jednoznačně určeno svými hodnotami na bázi.
- Pochopitelně: $\text{Ker } \mathbf{f} = \text{Null } \mathbf{A}$, $\text{Rng } \mathbf{f} = \text{rng } \mathbf{A}$.
- Pravda o maticích z pohledu lineárního zobrazení zní:
 $\dim \text{Ker } \mathbf{f} + \dim \text{Rng } \mathbf{f} = n$.
- Je-li \mathbf{f} reprezentováno maticí \mathbf{A} a \mathbf{g} reprezentováno maticí \mathbf{B} a prostory vzorů a obrazů \mathbf{f} , \mathbf{g} jsou voleny tak, že lze setrojit složené zobrazení $\mathbf{f}(\mathbf{g}(\mathbf{x}))$, pak toto složené zobrazení je reprezentováno maticí \mathbf{AB} .
- Je-li lineární $\mathbf{f}: \mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R}^n$, nazýváme ho také lineární transformace, protože si lze činnost zobrazení představit geometricky: „předměty“ v \mathbb{R}^n se aplikací toho zobrazení transformují na „deformované předměty“ ve stejném prostoru \mathbb{R}^n (rotace, zkosení, zrcadlení, ...).

Další vlastnosti matic

Věta:

Pro $\mathbf{A} \in \mathbb{R}^{m \times n}$ jsou tvrzení pod sebou ekvivalentní.

- \mathbf{A} má LN řádky
- $\text{rng } \mathbf{A} = \mathbb{R}^m$
- $\text{rank } \mathbf{A} = m$
- $\mathbf{Ax} = \mathbf{b}$ má řešení $\forall \mathbf{b} \in \mathbb{R}^m$
- \mathbf{A} má pravou inverzi
- \mathbf{AA}^T je regulární
- \mathbf{A} má LN sloupce
- $\text{Null } \mathbf{A} = \{\mathbf{0}\}$
- $\text{rank } \mathbf{A} = n$
- $\mathbf{Ax} = \mathbf{0}$ má pouze triviální řešení
- \mathbf{A} má levou inverzi
- $\mathbf{A}^T \mathbf{A}$ je regulární

Věta:

$\text{rank } \mathbf{AB} \leq \min\{\text{rank } \mathbf{A}, \text{rank } \mathbf{B}\}$