

面向21世纪本科生教材

线性空间

叶明训 郑延履 陈恭亮 编著

修订版

引 论



全国优秀出版社
武汉大学出版社

面向21世纪本科生教材

线性空间

叶明训 郑延履 陈恭亮 编著

修订版

引论

武汉大学出版社

全国优秀出版社
武汉大学出版社

图书在版编目(CIP)数据

线性空间引论/叶明训, 郑延履, 陈恭亮编著. —3 版. —武汉:
武汉大学出版社, 2002. 2
面向 21 世纪本科生教材
ISBN 7-307-03454-9

I . 线… II . ①叶… ②郑… ③陈… III . 线性空间—理论
N . O177. 3

中国版本图书馆 CIP 数据核字(2001)第 096079 号

责任编辑: 顾素萍 责任校对: 李桂珍 版式设计: 支 笛

出版: 武汉大学出版社 (430072 武昌 喀珈山)
(电子邮件: wdp4@whu.edu.cn 网址: www.wdp.whu.edu.cn)

发行: 新华书店湖北发行所

印刷: 湖北民政印刷厂

开本: 850×1168 1/32 印张: 12. 25 字数: 313 千字

版次: 1990 年 7 月第 1 版 2002 年 2 月第 3 版

2002 年 2 月第 3 版第 1 次印刷

ISBN 7-307-03454-9/0 · 253 定价: 18. 00 元

版权所有. 不得翻印; 凡购买我社的图书. 如有缺页、倒页、脱页等质量问题.
请与当地图书销售部门联系调换。

内 容 提 要

全书共九章。前两章由群、环、域介绍线性空间的基本理论，并利用它在第三、五章和 § 4.6 讨论矩阵运算、矩阵相似和线性方程组；第四章用交错的多重线性型来讨论行列式；第九章再深入讨论交错多重线性型的一般理论；第六章讲对偶空间后，第七章讲对称的双线性型，并讨论二次齐式、欧氏空间等，第八章则讲类似的埃米特型。

这是一本以线性空间与线性变换为理论基础的线性代数教材，写法力求方便于教学和自学，适用于综合大学、师范院校数学系，也可以作其他院校线性代数课程的参考书。

序　　言

线性代数是线性空间与线性变换的理论，我们用这个观点来阐述全书的内容。介绍集合、映射和基本代数结构后，线性空间和线性变换看做带算加群和带算同态。解线性方程组归结成求线性变换为核子空间。矩阵运算性质由线性变换推出；求矩阵的相似对角块型，实质是把线性空间分解成不变子空间的直和。线性泛函是一类特殊的线性变换，对偶空间则是讨论多重线性型的基础。二次齐式和欧氏空间都包含在对称双线性型的内容中，行列式也包含在多重交错线性型的内容中。多重交错线性型的深入讨论，又利用了张量代数和外代数的基本知识。

在上述教材体系下，我们还注意以下几点：交代概念和问题的背景，再抽象到“公理化”的讨论；较现行教材内容有所增减，又保证教学大纲的基本要求；分析和解决问题的思想方法在进化，基本运算能力和解题技巧要保持；大量的例题和习题，使讲课与作业相配合。这个教材，可用于综合大学和师范院校数学系，也可以作其他读者的参考。

1980 年至 1986 年，在武汉大学《中法数学试验班》的线性代数教学中，采用法国的教材和参考书。在教学中，我们吸取这些书籍的大框架，结合中国的具体情况，组织教学内容，自编成讲义，从 1986 年以来又使用了五次。边使用，边修改，还参考了一些中、美的教材，写成现在的这个本子。成书过程中，得到许多师长和同事的指导和帮助，谨致谢意。

水平所限，错误难免，抛砖引玉，力求更新教学内容。

作者

再 版 前 言

这个教材初版于 1990 年，此后在武汉大学数学基地班使用了六次。吸收各位任课教师的具体意见，又作了较多的增添和修改，成为现在的这个本子。再版主要的改动在：

1. 保持初版的体系和大框架，把线性代数作为线性空间和线性变换的理论。同时，不拘泥于统一的模式，适时地增加了矩阵运算的许多方法和技巧，例如分块矩阵和初等变换等，以便更灵活地讨论问题。
2. 增加了例题和习题的类型和份量，例题所占的篇幅大约可达全书之半。力求精讲多练，使基本理论与解题有较紧密的配合。
3. 对全书的习题，除特别简单的，都作了一个提示性的解答，帮助初学者澄清思路，不能代替学生的作业。

作 者

2000 年 2 月

目 录

第一章 代数系	1
§ 1.1 集合	1
§ 1.2 映射	5
§ 1.3 等价关系	13
§ 1.4 代数系	18
§ 1.5 群和子群	32
§ 1.6 环和域	41
第二章 线性空间与线性变换	48
§ 2.1 线性空间	48
§ 2.2 线性变换	55
§ 2.3 直和	60
§ 2.4 基底	67
§ 2.5 维数	77
§ 2.6 线性算子代数	87
第三章 矩阵运算	98
§ 3.1 矩阵空间和矩阵代数	98
§ 3.2 矩阵的秩	116
§ 3.3 初等变换	122
§ 3.4 等价矩阵	131

第四章 行列式和线性方程组	145
§ 4.1 多重线性型	145
§ 4.2 方阵的行列式	152
§ 4.3 行列式的性质	159
§ 4.4 行列式展开	172
§ 4.5 矩阵的秩	187
§ 4.6 线性方程组	191
第五章 矩阵的相似	209
§ 5.1 特征根与特征向量	209
§ 5.2 与对角型矩阵相似的矩阵	221
§ 5.3 矩阵的相似对角块型	229
第六章 对偶空间	240
§ 6.1 对偶空间和对偶基底	240
§ 6.2 正交	247
§ 6.3 转置变换	252
第七章 对称双线性型	259
§ 7.1 双线性型与二次型	259
§ 7.2 正交基底	269
§ 7.3 实二次齐式	280
§ 7.4 欧氏空间	290
§ 7.5 正交子空间	295
§ 7.6 伴随变换	300
§ 7.7 正交变换	309
第八章 埃米特型	317
§ 8.1 埃米特型	317

§ 8.2 正交基底	320
§ 8.3 伴随变换	326
§ 8.4 西变换	330
§ 8.5 埃米特变换	332
第九章 多重交错线性型.....	339
§ 9.1 线性型的外积	339
§ 9.2 多重交错线性型	344
§ 9.3 多重交错线性型的外积	350
§ 9.4 交错双线性型	354
习题提示.....	360

第一章 代数系

集合论的语言和方法,已经深入到数学理论的各个分支,也是代数方面课程的重要基础.为了给这本书各章作准备,在这一章里首先介绍集合论的一些基本概念,然后在集合内引入运算,讲几种常用的代数系.主要讲 5 个问题:(1) 集合与元素;(2) 映射;(3) 等价关系和等价分类;(4) 运算与代数系;(5) 群、环、域.

§ 1.1 集合

在讨论一个数学问题的时候,我们常常把一些讨论的对象作为一个整体来看待,以便确定这些对象的共同性质和相互关系.在一个问题中,这些讨论对象的全体作为一个整体,叫做集合;其中的每一个对象叫做集合的元素,简称为元.

例如:所有的自然数组成一个集合,叫做自然数集,记成 N ;所有的整数组成一个集合,叫做整数集,记成 Z ;此外,类似的还有有理数集 Q 、实数集 R 、复数集 C 等.

值得注意的,集合不一定是数集,元素不一定是数.例如:一个平面上的所有点组成一个集合;直观空间内的所有直线也组成一个集合;一台计算机内,所有的集成电路元件也组成一个集合.集合的例子,是不胜枚举的.

集合有两种表示方法,一种是列举元素来表示集合.如集合

$$E = \{1, 2, 3, 5, 6, 10, 15, 30\},$$

是 30 的所有正约数组成的集合,它的元素可以列举无遗.又例如:

$$\{1, 2, 3, \dots\},$$

$$\{\dots, -2, -1, 0, 1, 2, \dots\},$$

N 和 **Z** 等, 它们的元素不可能列举无遗, 只好辅以省略号. 集合的另一种表示方法, 是指出集合内元素所具有的公共性质. 例如: $x \in N$ 表示 x 是 **N** 的元时, 前面的 E 又可以表示成

$$\{x \mid x \in N, x < 30\}.$$

又例如: 平面上以原点为圆心、以 1 为半径的圆上所有点, 组成一个集合 F , 它可以表示成

$$\{(x, y) \mid x, y \in R, x^2 + y^2 = 1\}.$$

同样, 奇数集、偶数集可以分别表示成

$$\{2x + 1 \mid x \in Z\}, \quad \{2x \mid x \in Z\}.$$

为了今后叙述的方便, 我们约定: 不包含任何元素也组成一个集合, 叫做**空集**, 记成 \emptyset . 譬如说,

$$\{x \mid x \in Z, 3 < x < 4\}$$

就是空集. 我们还约定: 集合不包含相同的元素. 也就是说, 集合是不同元素的全体. 当元素的个数有限时, 这个集合叫**有限集**, 否则叫**无限集**.

如果 x 是集合 E 的元素, 就称 x 属于 E , 记成 $x \in E$, 像上面已经用过的记号; 否则, 称 x 不属于 E , 记成 $x \notin E$.

假设 E, F 是两个集合. 如果 E 的任何元素都属于 F , 即任意 $x \in E$ 时都有 $x \in F$, 就称 E 是 F 的子集合, 记成 $E \subseteq F$, 读成 F 包含 E , 或 E 包含在 F 内. 如果 $E \subseteq F$ 但是 $E \neq F$, 就称 F 真包含 E , 记成 $E \subset F$. 譬如说,

$$N \subset Z \subset Q \subset R \subset C.$$

假设 E, F 是两个集合, $E \subseteq F$ 而且 $F \subseteq E$, 就称 E 与 F 相等, 记成 $E = F$.

假设 E, F 是两个集合. 那么, E 与 F 的公共元素的全体, 组成一个新的集合, 叫做 E 和 F 的交集, 记成 $E \cap F$. 这就是说,

$$E \cap F = \{x \mid x \in E, x \in F\}.$$

另外, E 的所有元素及 F 的所有元素的全体, 也组成一个新的集合, 叫做 E 和 F 的并集, 记成 $E \cup F$. 这就是说,

$$E \cup F = \{x \mid x \in E, \text{或 } x \in F\}.$$

最后, 属于 F 但不属于 E 的所有元素的全体, 也组成一个新的集合, 叫做 F 对于 E 的差集, 记成 $F - E$. 这就是说,

$$F - E = \{x \mid x \in F, x \notin E\}.$$

譬如说, $E = \{1, 2, 3\}$, $F = \{2, 3, 4\}$, $G = \{1, 2\}$ 时, 就有

$$E \cap F = \{2, 3\},$$

$$E \cup F = \{1, 2, 3, 4\},$$

$$E - F = \{1\},$$

$$E - G = \{3\},$$

$$G - E = \emptyset.$$

像初等数学的运算一样, 集合的交集、并集、差集也有一些类似的性质.

性质 1 假设 E, F, G 是 3 个集合. 那么有

1) 交换律: $E \cap F = F \cap E$, $E \cup F = F \cup E$;

2) 结合律: $(E \cap F) \cap G = E \cap (F \cap G)$,

$$(E \cup F) \cup G = E \cup (F \cup G);$$

3) 分配律: $E \cap (F \cup G) = (E \cap F) \cup (E \cap G)$,

$$E \cup (F \cap G) = (E \cup F) \cap (E \cup G).$$

证 性质 1 的这些命题, 证明方法都是一样的. 我们只就分配律的第一个命题来证明, 其余留给读者做练习.

对于任意 $x \in E \cap (F \cup G)$, 有 $x \in E$ 同时 $x \in F \cup G$. 也就是说, $x \in E$ 同时 $x \in F$, 或者 $x \in E$ 同时 $x \in G$. 即 $x \in E \cap F$, 或 $x \in E \cap G$. 总之, $x \in (E \cap F) \cup (E \cap G)$. 这就证明了

$$E \cap (F \cup G) \subseteq (E \cap F) \cup (E \cap G). \quad (1)$$

反过来, 显然 $E \cap F \subseteq F$, $E \cap G \subseteq G$. 因此,

$$(E \cap F) \cup (E \cap G) \subseteq F \cup G. \quad (2)$$

同理可证

$$(E \cap F) \cup (E \cap G) \subseteq E \cup F = E. \quad (3)$$

由(2), (3)两式就得到

$$(E \cap F) \cup (E \cap G) \subseteq E \cap (F \cup G). \quad (4)$$

由(1),(4)说明,分配律的第一个命题成立.

性质2 假设 A, B, E 是3个集合.那么有

$$1) E - (A \cup B) = (E - A) \cap (E - B);$$

$$2) E - (A \cap B) = (E - A) \cup (E - B).$$

证 先来证明第一个命题.

对于任意 $x \in E - (A \cup B)$, 有 $x \in E$ 但 $x \notin A \cup B$.也就是说,
 $x \in E, x \notin A, x \notin B$.

所以 $x \in E - A, x \in E - B$.因而 $x \in (E - A) \cap (E - B)$.这就证明了

$$E - (A \cup B) \subseteq (E - A) \cap (E - B). \quad (5)$$

反过来,对于任意 $x \in (E - A) \cap (E - B)$, 有 $x \in E - A$ 和 $x \in E - B$.也就是说, $x \in E$ 但 $x \notin A, x \notin B$.即是说 $x \in E$ 但 $x \notin A \cup B$.所以, $x \in E - (A \cup B)$.这就证明了

$$(E - A) \cap (E - B) \subseteq E - (A \cup B). \quad (6)$$

(5),(6)两式说明 1)成立.

利用 1),又得到

$$\begin{aligned} E - [(E - A) \cup (E - B)] &= [E - (E - A)] \cap [E - (E - B)] \\ &= E \cap A \cap B. \end{aligned}$$

再由差集的定义,不难得到

$$E - (A \cap B) = (E - A) \cup (E - B).$$

这就证明了 2).

最后,我们来介绍集合的直积,它是由若干个集合导出的一个新的集合.

假设 E, F 是两个集合.由 $x \in E, y \in F$ 作一个有顺序的元素对 (x, y) .当取遍 E, F 的元素时,所有这样的元素对的全体,组成一个新的集合,叫做 E 与 F 的直积,记成 $E \times F$.这就是说,

$$E \times F = \{(x, y) | x \in E, y \in F\}.$$

用同样的方法,可以定义 n 个集合 E_1, \dots, E_n 的直积

$$E_1 \times \cdots \times E_n = \{(x_1, \dots, x_n) \mid x_i \in E_i, i=1, \dots, n\}.$$

特别地, $E_1 = \cdots = E_n = E$ 时, 记 $E_1 \times \cdots \times E_n = E^n$, 即

$$E^n = \{(x_1, \dots, x_n) \mid x_i \in E, i=1, \dots, n\}.$$

在几何内有许多集合直积的实例, 平面上的点的集合可以看成两个实数集的直积、空间内的点的集合可以看成 3 个实数集的直积.

习 题

1. 列举下面每个集合的元素:

$$A = \{x \mid x \in \mathbb{Z}, 4 < x < 10\},$$

$$B = \{x \mid x \text{ 是偶数}, x^2 \text{ 是奇数}\},$$

$$C = \{x \mid \text{存在 } y \in \mathbb{Z} \text{ 使得 } x = 5y + 1\},$$

$$D = \{x \mid x^3 = 1\},$$

$$E = \{x \mid x \in \mathbb{Z}, x > 1 \text{ 或 } x < 2\}.$$

2. 假设 A, B 都是 E 的子集合. 那么, $B = E - A$ 的充要条件是

$$A \cup B = E, \quad A \cap B = \emptyset.$$

3. 假设 A, B 都是 E 的子集合. 那么, 下面 4 个条件是等价的:

$$A \subseteq B; \quad E - B \subseteq E - A; \quad A \cup B = B; \quad A \cap B = A.$$

4. 假设 A, B, C 都是 E 的子集合. 那么有

$$1) \quad A - B = A - (A \cap B);$$

$$2) \quad (A - B) \cup (B - A) = (A \cup B) - (A \cap B);$$

$$3) \quad A \cap (B - C) = B \cap (A - C) = (A \cap B) - C.$$

5. 假设 A, B, C, D 是 4 个集合. 那么有

$$1) \quad A \subseteq B, C \subseteq D \text{ 的充要条件是 } A \times C \subseteq B \times D;$$

$$2) \quad (A \times C) \cup (B \times C) = (A \cup B) \times C;$$

$$3) \quad (A \times C) \cap (B \times C) = (A \cap B) \times C;$$

$$4) \quad (A \times C) \cap (B \times D) = (A \cap B) \times (C \cap D).$$

6. 假设 A, B, C 都是 E 的子集合, $A \triangle B = (A - B) \cup (B - A)$. 那么有
 $A \triangle B = (A \cup B) - (A \cap B), A \triangle (B \triangle C) = (A \triangle B) \triangle C$.

§ 1.2 映 射

为了讨论不同集合之间的相互关系, 我们引入映射的概念.

假设集合 X 的元素与集合 Y 的元素之间,有一个对应的规则 f :对于任意 $x \in X$,都有一个对应的 $y \in Y$,记成 $y = f(x)$.那么,这个对应的规则 f 叫做 X 到 Y 的映射, y 叫做 x 的像, x 叫做 y 的像源.映射和元素的对应关系通常记成

$$f: X \longrightarrow Y \quad \text{或} \quad X \xrightarrow{f} Y,$$

$$f: x \longmapsto y \quad \text{或} \quad x \xrightarrow{f} y.$$

根据上述定义,对于映射 f , X 内的任意元素 x 都有像 $f(x)$ 在 Y 内.但是, Y 内的任意元素 y 不一定都有像源.譬如说,集合 E 到 E 的映射: $x \longmapsto x$,它把 E 的任意元都对应它自身.这个映射叫做 E 的恒等映射,记成 id_E .显然, E 内任意元素都有像源.再譬如说, \mathbf{R} 到 \mathbf{R} 的映射: $x \longmapsto x^2$. \mathbf{R} 内的元素 $y < 0$ 时, y 就没有像源.假若 f 是 X 到 Y 的映射,而且 Y 内任意元素都有像源.那么,这种 f 叫做 X 到 Y 上的映射或 X 到 Y 的满射.

根据映射的定义,对于映射 f , X 内任意元素 x 的像 $f(x)$ 是惟一的.但是, Y 内的元素 y 有像源时, y 的像源不一定是惟一的.譬如说,对恒等映射 id_E , E 内任意元素 x 有惟一的像源 x .再譬如说,对 \mathbf{R} 到 \mathbf{R} 内的映射: $x \longmapsto x^2$, \mathbf{R} 内元素 $y > 0$ 时, y 都有像源 $\pm\sqrt{y}$,不是惟一的.再举个例子,

$$f: x \longmapsto \frac{2x}{x-1}$$

是 $\mathbf{R} - \{1\}$ 到 \mathbf{R} 的映射.任意 $x \in \mathbf{R}$, $x \neq 1$, 都有像 $f(x) \in \mathbf{R}$.但是, \mathbf{R} 内 $y = 2$ 没有像源,不存在 $x \in \mathbf{R} - \{1\}$ 使 $\frac{2x}{x-1} = 2$.容易看出, f 是 $\mathbf{R} - \{1\}$ 到 $\mathbf{R} - \{2\}$ 上的映射;而且, $\mathbf{R} - \{2\}$ 内任意元素的像源是惟一的.假若 f 是 X 到 Y 的映射, Y 内元素 y 有像源时, y 的像源还是惟一的.那么, f 叫做 X 到 Y 的一一映射.上面的例子,就是 $\mathbf{R} - \{1\}$ 到 $\mathbf{R} - \{2\}$ 上的一一映射. X 到 Y 上的一一映射又叫做一一对应的映射或可逆映射.

还是用上面的例子,对于 $\mathbf{R} - \{1\}$ 到 $\mathbf{R} - \{2\}$ 上的一一映

射 f , 任意 $x \in \mathbf{R} - \{1\}$, 都有 $f(x) = \frac{2x}{x-1} \in \mathbf{R} - \{2\}$. 反过来, 任意 $y \in \mathbf{R} - \{2\}$, 都有 $x = \frac{y}{y-2} \in \mathbf{R} - \{1\}$, 而且是惟一的, 使得 $f(x) = y$. 于是,

$$g: y \longmapsto \frac{y}{y-2}$$

是 $\mathbf{R} - \{2\}$ 到 $\mathbf{R} - \{1\}$ 上的一对一的映射. 再举一个例子,

$$f: x \longmapsto x^3$$

是 \mathbf{R} 到 \mathbf{R} 的可逆映射. 于是, 把像与像源相颠倒, 又得到 \mathbf{R} 到 \mathbf{R} 的映射

$$g: y \longmapsto \sqrt[3]{y}.$$

一般地说, 假设 f 是 X 到 Y 的可逆映射. 那么, 对于任意 $y \in Y$, 存在惟一的 $x \in X$, 使得 $f(x) = y$. 如果把上述 y 对应于 x , 即 $y \longmapsto x$, 就得到一个 Y 到 X 的映射. 它是由 f 派生出来的一个新的映射, 叫做 f 的逆映射, 记成 f^{-1} . 前面的 g 就是 f 的逆映射, 即 $g = f^{-1}$.

对于元素个数相同的有限集合, 各种映射有下面的简单关系.

定理 1 假设 X, Y 都是 n 个元素的集合, f 是 X 到 Y 的映射. 那么, 下面的 3 个条件是等价的: 1) f 是到上的; 2) f 是一对一的; 3) f 是一一对应的.

证 事实上, 只要证明前两个条件是等价的, 命题就成立. 记 $X = \{x_1, \dots, x_n\}$.

如果 f 是到上的, 那么 $\{f(x_1), \dots, f(x_n)\} = Y$. 但是 Y 也是 n 个元素组成的, 所以 $f(x_1), \dots, f(x_n)$ 是 n 个不同的元素. 即是说, 不同的 n 个元素的 n 个像是不同的. 这说明, f 是一对一的.

反过来, 如果 f 是一对一的, 那么 $f(x_1), \dots, f(x_n)$ 是 Y 的 n 个不同元素. Y 只有 n 个元素, 因而 $Y = \{f(x_1), \dots, f(x_n)\}$, f 是到上的.

定理 1 证毕.

我们已经看到,映射是与两个集合相联系的.再举一个例子,
 Z 到 Z 的映射

$$f: 2n \mapsto n; 2n+1 \mapsto 2n+1.$$

奇数集 Z_1 与偶数集 Z_2 都是 Z 的子集合.假若只看 f 在 Z_1 内的作用,它是 Z_1 到 Z 内的一对一的映射.假若只看 f 在 Z_2 内的作用,它是 Z_2 到 Z 内的一对一的映射.一般地说,假设 f 是 X 到 Y 的映射, $X_1 \subseteq X$.对于任意 $x \in X_1$,使得 $x \mapsto f(x)$ 的映射 f_1 ,叫做 f 在 X_1 上的限制,它是 X_1 到 Y 的映射.上面例子中, f 不是一对一的,但 f 在 Z_1, Z_2 上的限制都是一对一的.

下面开始讨论两个映射,假设 f_1, f_2 都是 X 到 Y 的映射.如果对于任意 $x \in X$ 都有 $f_1(x) = f_2(x)$,就称 f_1 与 f_2 相等,记成 $f_1 = f_2$.

假设 X, Y, Z 是 3 个集合, f 是 X 到 Y 的映射, g 是 Y 到 Z 的映射.对于任意 $x \in X$,有 $f(x) \in Y$;对于 $f(x) = y \in Y$,又有 $g(y) = z \in Z$,即是

$$x \xrightarrow{f} y \xrightarrow{g} z.$$

那么,对于任意 $x \in X$,使得 $x \mapsto z$ 的对应规则是 X 到 Z 的映射,叫做 f 与 g 的乘积,记成 gf ,或 gf .即

$$gf(x) = g[f(x)].$$

值得注意的,上面的 gf 存在,是 X 到 Z 的映射;而 fg 不一定存在,因为 $Z \cap X = \emptyset$ 时 fg 就不能定义.还要注意,即使 fg 与 gf 都存在,也不一定相等.譬如 $X = Y = Z = \mathbf{R}$ 时,假设 $f(x) = \sin x$, $g(x) = x^2$.那么 $gf(x) = \sin^2 x$, $fg(x) = \sin x^2$,可见 $fg \neq gf$.

有了映射乘积的概念之后,介绍一个判别可逆映射的方法.

定理 2 假设 f 是 X 到 Y 的映射, g 是 Y 到 X 的映射,而且

$$gf = \text{id}_X, fg = \text{id}_Y,$$

那么, f 和 g 都是可逆映射,而且互为逆映射.

证 首先,由 $gf = \text{id}_X$,可以得到:(1) g 是到上的:因为对于