

線形代数学第 2 期末試験 < 解答例 > 2008.2.6

1. 2次元ベクトル $\boldsymbol{x}(n) = [x_1(n), x_2(n)]^T$ が次式により更新される。

$$\boldsymbol{x}(n+1) = \boldsymbol{A}\boldsymbol{x}(n), \quad \boldsymbol{A} = \begin{bmatrix} 1 & 0 \\ -1 & 2 \end{bmatrix} \quad \boldsymbol{x}(0) = \begin{bmatrix} 1 \\ -1 \end{bmatrix}$$

(a) $\boldsymbol{x}(3)$ を求めよ。

< 解答例 >

一般解は

$$\boldsymbol{x}(n) = \boldsymbol{A}^n \boldsymbol{x}(0) \quad (1)$$

与えられる。 \boldsymbol{A}^n は \boldsymbol{A} の固有値を対角要素とする対角行列を $\boldsymbol{\Lambda}$ ，固有ベクトルを列ベクトルとする行列を \boldsymbol{S} とすると，行列の対角化により， $\boldsymbol{A}^n = \boldsymbol{S}\boldsymbol{\Lambda}^n\boldsymbol{S}^{-1}$ と表される。固有値は \boldsymbol{A} が三角行列であるから， $\lambda_1 = 1$ ， $\lambda_2 = 2$ である。これらに対する固有ベクトルは

$$\begin{bmatrix} 0 & 0 \\ -1 & 1 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} u_1 \\ v_1 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 0 \\ 0 \end{bmatrix} \quad (2)$$

$$\begin{bmatrix} -1 & 0 \\ -1 & 0 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} u_2 \\ v_2 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 0 \\ 0 \end{bmatrix} \quad (3)$$

より，

$$\boldsymbol{x}_1 = \begin{bmatrix} 1 \\ 1 \end{bmatrix} \quad \boldsymbol{x}_2 = \begin{bmatrix} 0 \\ 1 \end{bmatrix} \quad (4)$$

となる。これらより，

$$\boldsymbol{\Lambda} = \begin{bmatrix} 1 & 0 \\ 0 & 2 \end{bmatrix} \quad (5)$$

$$\boldsymbol{S} = \begin{bmatrix} 1 & 0 \\ 1 & 1 \end{bmatrix} \quad \boldsymbol{S}^{-1} = \begin{bmatrix} 1 & 0 \\ -1 & 1 \end{bmatrix} \quad (6)$$

を得る．これらより， A^n は次のようになる．

$$\begin{aligned} A^n &= \begin{bmatrix} 1 & 0 \\ 1 & 1 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} 1^n & 0 \\ 0 & 2^n \end{bmatrix} \begin{bmatrix} 1 & 0 \\ -1 & 1 \end{bmatrix} \\ &= \begin{bmatrix} 1 & 0 \\ 1-2^n & 2^n \end{bmatrix} \end{aligned} \quad (7)$$

従って，一般解は

$$\boldsymbol{x}(n) = \begin{bmatrix} 1 & 0 \\ 1-2^n & 2^n \end{bmatrix} \begin{bmatrix} 1 \\ -1 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 1 \\ 1-2^{n+1} \end{bmatrix} \quad (8)$$

となる． $\boldsymbol{x}(3)$ は上式で $n=3$ とおいて，求まる．

$$\boldsymbol{x}(n) = \begin{bmatrix} 1 \\ -15 \end{bmatrix} \quad (9)$$

(b) $n \rightarrow \infty$ としたとき， $\boldsymbol{x}(n)$ はどうなるか。

<解答例>

一般解において， $n \rightarrow$ とする．

$$\boldsymbol{x}(\infty) = \begin{bmatrix} 1 \\ -\infty \end{bmatrix} \quad (10)$$

このように，負の無限大に発散する．

2. 行列 A を掛けることにより，任意のベクトル \boldsymbol{a} を $\boldsymbol{x}_1 = [1, 1]^T$ 方向に 1 倍， $\boldsymbol{x}_2 = [1, -1]^T$ 方向に 2 倍するような行列 A を求めよ (ヒント) \boldsymbol{a} から \boldsymbol{x}_1 上への射影， \boldsymbol{x}_2 上への射影を考える． $A\boldsymbol{a}$ をスペクトル定理に基づいて表現．但し，固有ベクトルは正規化．

<解答例>

A の固有値を λ_1, λ_2 とし，固有ベクトルを $\boldsymbol{x}_1, \boldsymbol{x}_2$ とすると， $A\boldsymbol{a}$ はスペクトル定理により，次のように表される．

$$A\boldsymbol{a} = \lambda_1 \boldsymbol{x}_1 \boldsymbol{x}_1^T \boldsymbol{a} + \lambda_2 \boldsymbol{x}_2 \boldsymbol{x}_2^T \boldsymbol{a} \quad (11)$$

さらに，固有ベクトルが正規化されているとすると，

$$\boldsymbol{x}_i \boldsymbol{x}_i^T \boldsymbol{a} = \frac{\boldsymbol{x}_i \boldsymbol{x}_i^T}{\boldsymbol{x}_i^T \boldsymbol{x}_i} \boldsymbol{a} \quad (12)$$

であるから，これは，ベクトル a からベクトル x_i への射影を表している．
 ベクトル a の x_i 方向の成分とは， a から x_i への射影に相当する．式 (11)
 は固有ベクトルへの射影（成分）を固有値倍している．従って，固有値が
 $\lambda_1 = 1, \lambda_2 = 2$ であり，固有ベクトル（正規化する）が $x_1 = [1/\sqrt{2}, 1/\sqrt{2}]^T$ ，
 $x_2 = [1/\sqrt{2}, -1/\sqrt{2}]^T$ である行列が求めるものである．行列 A はスペクトル
 定理，または，行列の対角化の関係を用いて求めることができる．

（スペクトル定理により）

$$\begin{aligned} A &= \lambda_1 x_1 x_1^T + \lambda_2 x_2 x_2^T \\ &= \begin{bmatrix} 1/\sqrt{2} \\ 1/\sqrt{2} \end{bmatrix} \begin{bmatrix} 1/\sqrt{2} & 1/\sqrt{2} \end{bmatrix} + 2 \begin{bmatrix} 1/\sqrt{2} \\ -1/\sqrt{2} \end{bmatrix} \begin{bmatrix} 1/\sqrt{2} & -1/\sqrt{2} \end{bmatrix} \\ &= \frac{1}{2} \begin{bmatrix} 1 & 1 \\ 1 & 1 \end{bmatrix} + \begin{bmatrix} 1 & -1 \\ -1 & 1 \end{bmatrix} \\ &= \frac{1}{2} \begin{bmatrix} 3 & -1 \\ -1 & 3 \end{bmatrix} \end{aligned} \quad (13)$$

（行列の対角化により）

$$\begin{aligned} A &= S \Lambda S^{-1} \quad (14) \\ &= \frac{1}{\sqrt{2}} \begin{bmatrix} 1 & 1 \\ 1 & -1 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} 1 & 0 \\ 0 & 2 \end{bmatrix} \frac{1}{\sqrt{2}} \begin{bmatrix} 1 & 1 \\ 1 & -1 \end{bmatrix} \\ &= \frac{1}{2} \begin{bmatrix} 3 & -1 \\ -1 & 3 \end{bmatrix} \end{aligned} \quad (15)$$

3. 固有値，固有ベクトルに関して，以下の性質を証明せよ．

(a) 対称行列 A において，固有値が異なるならば，固有ベクトルは直交する．

<解答例>

固有値，固有ベクトルの関係を

$$Ax_1 = \lambda_1 x_1 \quad (16)$$

$$Ax_2 = \lambda_2 x_2 \quad (17)$$

とおく．式 (16) を転置して，右から x_2 を掛ける．

$$x_1^T Ax_2 = \lambda_1 x_1^T x_2 \quad (18)$$

ここで、 $A^T = A$ を利用している。次に、式 (17) に左から x_1^T を掛ける。

$$x_1^T A x_2 = \lambda_2 x_1^T x_2 \quad (19)$$

式 (18) と (19) は左辺が等しいから、右辺も等しいとおいて、変形すると次式を得る。

$$(\lambda_1 - \lambda_2) x_1^T x_2 = 0 \quad (20)$$

$\lambda_1 \neq \lambda_2$ であるから、 $x_1^T x_2 = 0$ となる。内積=0 であるから、 x_1 と x_2 は直交する（証明終）

(b) A の固有値が λ で、固有ベクトルが x であるとき、 A^k の固有値は λ^k で固有ベクトルは x である。

< 解答例 > 固有値、固有ベクトルの関係を

$$Ax = \lambda x \quad (21)$$

とおく。上式に左から A を掛ける。

$$A^2 x = \lambda Ax = \lambda^2 x \quad (22)$$

これを繰り返すことにより、

$$A^k x = \lambda^k x \quad (23)$$

を得る。この式は、 A^k の固有値が λ^k で、固有ベクトルが x であることを示している。

さらに、式 (21) に左から A^{-1} を掛ける。

$$x = \lambda A^{-1} x \quad (24)$$

上式に λ^{-1} を掛けて、整理すると次式を得る。

$$A^{-1} x = \lambda^{-1} x \quad (25)$$

この式は、 A^{-1} の固有値が λ^{-1} で、固有ベクトルは変化しないことを表している。上式で、左から A^{-1} を掛けることにより、

$$A^{-k} x = \lambda^{-k} x \quad (26)$$

を得る．この式は， A^{-k} の固有値が λ^{-k} で，固有ベクトルが x であることを示している（証明終）

<別法>

$A = SAS^{-1}$ と表されることを利用する． $k > 0$ とする．

$$A^k = SA^k S^{-1} \quad (27)$$

であるから，固有値が k 乗され，固有ベクトルはそのままである．次に， A^{-1} を求める．

$$A^{-1} = SA^{-1} S^{-1} \quad (28)$$

であるから， A^{-1} を k 乗することにより，

$$A^{-k} = SA^{-k} S^{-1} \quad (29)$$

となり，固有値が $-k$ 乗され，固有ベクトルはそのままである．

(c) 行列 A と A^T は同じ固有値を持つ．

（参考） $A = SAS^{-1}$ ． $(S^{-1})^T = (S^T)^{-1}$ ．

<解答例>

一般に，固有値を対角要素とする対角行列 Λ と固有ベクトルを列ベクトルとする行列 S を用いて

$$A = SAS^{-1} \quad (30)$$

と表される．上式で転置をとる．

$$A^T = (S^{-1})^T \Lambda^T S^T = (S^{-1})^T \Lambda S^T \quad (31)$$

$B = (S^{-1})^T$ とおくと（参考）より $B^{-1} = S^T$ であるから，

$$A^T = B \Lambda B^{-1} \quad (32)$$

となる．これより， B が A^T の固有ベクトルを列ベクトルとする行列であり， Λ は A^T の固有値を対角要素とする対角行列である．従って， A と A^T の固有値は等しくなる（証明終）

4. 行列 A と B が同じ固有ベクトルを持ち、固有ベクトルを列ベクトルとする行列 S によって、 $A = S\Lambda_1 S^{-1}$ 、 $B = S\Lambda_2 S^{-1}$ と表されるとき、 $AB = BA$ となることを証明せよ。また、次の A に対する B の例を求めよ。但し、 B の固有値は適当に与えるものとする。

$$A = \begin{bmatrix} 1 & 0 \\ -1 & 2 \end{bmatrix}$$

< 解答例 >

AB 、 BA は次のように変形できる。

$$AB = S\Lambda_1 S^{-1} S\Lambda_2 S^{-1} = S\Lambda_1 \Lambda_2 S^{-1} \quad (33)$$

$$BA = S\Lambda_2 S^{-1} S\Lambda_1 S^{-1} = S\Lambda_2 \Lambda_1 S^{-1} \quad (34)$$

Λ_1 と Λ_2 は対角行列であるから、これらの積は交換可能である。

$$\Lambda_1 \Lambda_2 = \Lambda_2 \Lambda_1 \quad (35)$$

以上より、 $AB = BA$ となる（証明終）

次に、設問の行列 A に対する B を求める。行列 A は三角行列であるから、固有値は $\lambda_1 = 1$ 、 $\lambda_2 = 2$ である。これらに対する固有ベクトルは

$$\begin{bmatrix} 0 & 0 \\ -1 & 1 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} u_1 \\ v_1 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 0 \\ 0 \end{bmatrix} \quad (36)$$

$$\begin{bmatrix} -1 & 0 \\ -1 & 0 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} u_2 \\ v_2 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 0 \\ 0 \end{bmatrix} \quad (37)$$

より、

$$x_1 = \begin{bmatrix} 1 \\ 1 \end{bmatrix} \quad x_2 = \begin{bmatrix} 0 \\ 1 \end{bmatrix} \quad (38)$$

となる。ここで、 B の固有値を 1 、 -1 とする。

$$\begin{aligned} B &= S\Lambda S^{-1} \\ &= \begin{bmatrix} 1 & 0 \\ 1 & 1 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} 1 & 0 \\ 0 & -1 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} 1 & 0 \\ -1 & 1 \end{bmatrix} \\ &= \begin{bmatrix} 1 & 0 \\ 2 & -1 \end{bmatrix} \end{aligned} \quad (39)$$

(検証)

$$AB = \begin{bmatrix} 1 & 0 \\ -1 & 2 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} 1 & 0 \\ 2 & -1 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 1 & 0 \\ 3 & -2 \end{bmatrix} \quad (40)$$

$$BA = \begin{bmatrix} 1 & 0 \\ 2 & -1 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} 1 & 0 \\ -1 & 2 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 1 & 0 \\ 3 & -2 \end{bmatrix} \quad (41)$$

5. 次の微分方程式を解け．また，この微分方程式の解は安定であるか，不安定であるか示せ．

$$\frac{d^2 \mathbf{u}(t)}{dt^2} = \begin{bmatrix} 1 & 2 \\ 2 & 1 \end{bmatrix} \mathbf{u}(t), \quad \mathbf{u}(0) = \begin{bmatrix} 1 \\ 0 \end{bmatrix}, \quad \frac{d\mathbf{u}(0)}{dt} = \begin{bmatrix} 0 \\ 1 \end{bmatrix}$$

<解答例>

$$A = \begin{bmatrix} 1 & 2 \\ 2 & 1 \end{bmatrix} \quad (42)$$

とにおいて，固有値と固有ベクトルを求める．

$$\det(A - \lambda I) = \begin{vmatrix} 1 - \lambda & 2 \\ 2 & 1 - \lambda \end{vmatrix} = 0 \quad (43)$$

より，

$$(\lambda + 1)(\lambda - 3) = 0 \quad (44)$$

従って， $\lambda_1 = -1$ ， $\lambda_2 = 3$ を得る．これらに対する固有ベクトルは $(A - \lambda_i I)\mathbf{x}_i = \mathbf{0}$ より，

$$\begin{bmatrix} 2 & 2 \\ 2 & 2 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} u_1 \\ v_1 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 0 \\ 0 \end{bmatrix} \quad (45)$$

$$\begin{bmatrix} -2 & 2 \\ 2 & -2 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} u_2 \\ v_2 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 0 \\ 0 \end{bmatrix} \quad (46)$$

上式より，

$$\mathbf{x}_1 = \begin{bmatrix} 1 \\ -1 \end{bmatrix} \quad \mathbf{x}_2 = \begin{bmatrix} 1 \\ 1 \end{bmatrix} \quad (47)$$

これらより，微分方程式の一般解は次式で与えられる．

$$\mathbf{u}(n) = (c_1 e^{it} + d_1 e^{-it}) \begin{bmatrix} 1 \\ -1 \end{bmatrix} + (c_2 e^{\sqrt{3}t} + d_2 e^{-\sqrt{3}t}) \begin{bmatrix} 1 \\ 1 \end{bmatrix} \quad (48)$$

次に，初期条件を加味する．

$$\mathbf{u}(0) = (c_1 + d_1) \begin{bmatrix} 1 \\ -1 \end{bmatrix} + (c_2 + d_2) \begin{bmatrix} 1 \\ 1 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 1 \\ 0 \end{bmatrix} \quad (49)$$

$$\left. \frac{d\mathbf{u}(t)}{dt} \right|_{t=0} = (c_1 i - d_1 i) \begin{bmatrix} 1 \\ -1 \end{bmatrix} + (\sqrt{3}c_2 - \sqrt{3}d_2) \begin{bmatrix} 1 \\ 1 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 0 \\ 1 \end{bmatrix} \quad (50)$$

$du(0)/dt = [0, 1]^T$ では解が求まらない．ここまでで，微分方程式の解を求める問題としては満点とする

以下は $du(0)/dt = [0, 0]^T$ として求める

$$c_1 = c_2 = d_1 = d_2 = \frac{1}{4} \quad (51)$$

これを式 (48) に代入して，微分方程式の解が求まる．

$$\mathbf{u}(n) = \frac{1}{4}(e^{it} + e^{-it}) \begin{bmatrix} 1 \\ -1 \end{bmatrix} + \frac{1}{4}(e^{\sqrt{3}t} + e^{-\sqrt{3}t}) \begin{bmatrix} 1 \\ 1 \end{bmatrix} \quad (52)$$

安定性の評価：

$|Re[\pm\sqrt{\lambda_i}]| < 0$ 安定， $= 0$ 臨界， > 0 不安定（発散）．

$$|Re[\pm\sqrt{\lambda_1}]| = 0 \quad (53)$$

$$|Re[\pm\sqrt{\lambda_2}]| = \sqrt{3} > 0 \quad (54)$$

従って，この微分方程式の解は不安定（発散）である．

6. 複素ベクトル $\mathbf{x} = [1 + i, 1]^T$ と $\mathbf{y} = [1, 1 - i]^T$ について

(a) 各々の長さ（ノルム）を求めよ（ $\sqrt{\text{数値}}$ の形でよい）．

< 解答例 >

$$\begin{aligned}\| \mathbf{x} \|^2 &= \mathbf{x}^H \mathbf{x} = \begin{bmatrix} 1-i & 1 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} 1+i \\ 1 \end{bmatrix} \\ &= (1-i)(1+i) + 1 = 3\end{aligned}\tag{55}$$

$$\| \mathbf{x} \| = \sqrt{3}\tag{56}$$

$$\begin{aligned}\| \mathbf{y} \|^2 &= \mathbf{y}^H \mathbf{y} = \begin{bmatrix} 1 & 1+i \end{bmatrix} \begin{bmatrix} 1 \\ 1-i \end{bmatrix} \\ &= 1 + (1+i)(1-i) = 3\end{aligned}\tag{57}$$

$$\| \mathbf{y} \| = \sqrt{3}\tag{58}$$

$$\tag{59}$$

(b) \mathbf{x} と \mathbf{y} の内積を求めよ .

$$\begin{aligned}\mathbf{x}^H \mathbf{y} &= \begin{bmatrix} 1-i & 1 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} 1 \\ 1-i \end{bmatrix} \\ &= 1-i + 1-i = 2-2i\end{aligned}\tag{60}$$

$$\begin{aligned}\mathbf{y}^H \mathbf{x} &= \begin{bmatrix} 1 & 1+i \end{bmatrix} \begin{bmatrix} 1+i \\ 1 \end{bmatrix} \\ &= 1+i + 1+i = 2+2i\end{aligned}\tag{61}$$