

Über die Konstruktion der Jordanschen Normalform

Autor(en): **Lesky, Peter**

Objektyp: **Article**

Zeitschrift: **Elemente der Mathematik**

Band (Jahr): **40 (1985)**

Heft 5

PDF erstellt am: **12.07.2024**

Persistenter Link: <https://doi.org/10.5169/seals-38836>

Nutzungsbedingungen

Die ETH-Bibliothek ist Anbieterin der digitalisierten Zeitschriften. Sie besitzt keine Urheberrechte an den Inhalten der Zeitschriften. Die Rechte liegen in der Regel bei den Herausgebern. Die auf der Plattform e-periodica veröffentlichten Dokumente stehen für nicht-kommerzielle Zwecke in Lehre und Forschung sowie für die private Nutzung frei zur Verfügung. Einzelne Dateien oder Ausdrucke aus diesem Angebot können zusammen mit diesen Nutzungsbedingungen und den korrekten Herkunftsbezeichnungen weitergegeben werden. Das Veröffentlichen von Bildern in Print- und Online-Publikationen ist nur mit vorheriger Genehmigung der Rechteinhaber erlaubt. Die systematische Speicherung von Teilen des elektronischen Angebots auf anderen Servern bedarf ebenfalls des schriftlichen Einverständnisses der Rechteinhaber.

Haftungsausschluss

Alle Angaben erfolgen ohne Gewähr für Vollständigkeit oder Richtigkeit. Es wird keine Haftung übernommen für Schäden durch die Verwendung von Informationen aus diesem Online-Angebot oder durch das Fehlen von Informationen. Dies gilt auch für Inhalte Dritter, die über dieses Angebot zugänglich sind.

ELEMENTE DER MATHEMATIK

Revue de mathématiques élémentaires – Rivista di matematica elementare

*Zeitschrift zur Pflege der Mathematik
und zur Förderung des mathematisch-physikalischen Unterrichts*

El. Math.

Band 40

Nr. 5

Seiten 105–128

Basel, 10. September 1985

Über die Konstruktion der Jordanschen Normalform

Bei den verschiedenen Verfahren zur Gewinnung der Jordanschen Normalform J einer quadratischen n -reihigen Matrix A kommt den Hauptvektorketten besondere Bedeutung zu: Die Hauptvektorketten erzeugen unmittelbar eine Transformationsmatrix X für die gesuchte Ähnlichkeitstransformation $X^{-1}AX = J$. Daher wird selbst die Theorie der Jordanschen Normalform manchmal über die Hauptvektorketten entwickelt (z. B. in [1–3]). Daneben treten eigenartigerweise die praktischen Möglichkeiten zur Konstruktion der Hauptvektorketten in den Hintergrund (so werden z. B. in [1] die Hauptvektorketten zwar theoretisch verwendet, die Konstruktion einer Transformationsmatrix soll dagegen unabhängig davon über die Lösung des linearen Gleichungssystems $AX = XJ$ erfolgen). Diesen *praktischen* Konstruktionsmöglichkeiten sind die folgenden Ausführungen gewidmet (daher wird auf Beweise verzichtet).

Die quadratische n -reihige Matrix A mit komplexen Elementen besitze die *charakteristische Gleichung*

$$(|\lambda E - A| =) (\lambda - \lambda_1)^{n_1} (\lambda - \lambda_2)^{n_2} \cdots (\lambda - \lambda_m)^{n_m} = 0, \quad (1)$$

in der die *Eigenwerte* λ_i mit den Vielfachheiten n_i auftreten ($n_1 + n_2 + \cdots + n_m = n$). Dann genügt A der Matrizengleichung

$$(A - \lambda_1 E)^{n_1} (A - \lambda_2 E)^{n_2} \cdots (A - \lambda_m E)^{n_m} = 0. \quad (2)$$

Wir gehen davon aus, dass mindestens für ein i ($i = 1, 2, \dots, m$) der Rang $n - r_i$ von $A - \lambda_i E$ grösser als $n - n_i$ ist, denn sonst besteht für A Diagonalähnlichkeit. Der *Rangabfall* r_i gibt die Anzahl der linear unabhängigen Eigenvektoren der Matrix A zum Eigenwert λ_i an.

Die Lösungsvektoren $\mathbf{z} = (z_1, z_2, \dots, z_n)$ von

$$(A - \lambda_i E)^{n_i} \mathbf{z}' = \mathbf{0}' \quad (3)$$

erzeugen für jedes i ($i = 1, 2, \dots, m$) einen n_i -dimensionalen Teilraum Z_i von \mathbb{C}^n (\mathbf{z}' ist der aus \mathbf{z} durch Transposition hervorgehende Spaltenvektor). Die m Teilräume Z_i des \mathbb{C}^n sind paarweise disjunkt.

Zur Vorbereitung des folgenden Verfahrens bestimmen wir unter Verwendung von (3) je n_i Basisvektoren $\mathbf{b}_{i1}, \mathbf{b}_{i2}, \dots, \mathbf{b}_{in_i}$ der Teilräume Z_i . Auf diese Weise ergeben sich insgesamt $n_1 + n_2 + \cdots + n_m = n$ Basisvektoren des \mathbb{C}^n .

Erster Schritt im Teilraum Z_1 : Wir ziehen die n_1 Basisvektoren des Z_1 heran und wenden auf diese sukzessive $A - \lambda_1 E$ (von links) an:

Die *Ähnlichkeitstransformation* veranschaulichen wir am speziellen Fall einer dreireihigen Matrix A mit dem dreifachen Eigenwert λ_1 und der Hauptvektorkette $\mathbf{b}'_1, (A - \lambda_1 E)\mathbf{b}'_1, (A - \lambda_1 E)^2\mathbf{b}'_1 = \mathbf{x}'_1$ (\mathbf{x}'_1 ist bis auf einen konstanten Faktor der einzige Eigenvektor von A zu λ_1). Mit der Transformationsmatrix $X = (\mathbf{x}'_1, (A - \lambda_1 E)\mathbf{b}'_1, \mathbf{b}'_1)$, in der die Hauptvektorketten immer in der umgekehrten Reihenfolge auftreten, und der inversen Matrix

$$X^{-1} = \begin{pmatrix} \mathbf{a}_1 \\ \mathbf{a}_2 \\ \mathbf{a}_3 \end{pmatrix}$$

erhalten wir unter Verwendung von $A\mathbf{x}'_1 = \lambda_1\mathbf{x}'_1$

$$\begin{aligned} & \begin{pmatrix} \mathbf{a}_1 \\ \mathbf{a}_2 \\ \mathbf{a}_3 \end{pmatrix} A(\mathbf{x}'_1, (A - \lambda_1 E)\mathbf{b}'_1, \mathbf{b}'_1) \\ &= \begin{pmatrix} \mathbf{a}_1 \\ \mathbf{a}_2 \\ \mathbf{a}_3 \end{pmatrix} (\lambda_1\mathbf{x}'_1, \mathbf{x}'_1 + \lambda_1(A - \lambda_1 E)\mathbf{b}'_1, (A - \lambda_1 E)\mathbf{b}'_1 + \lambda_1\mathbf{b}'_1) = \begin{pmatrix} \lambda_1 & 1 & 0 \\ 0 & \lambda_1 & 1 \\ 0 & 0 & \lambda_1 \end{pmatrix}. \end{aligned}$$

Beispiel:

$$A = \begin{pmatrix} 1 & 1 & -1 & 1 & -1 & 0 \\ 0 & 1 & 0 & 0 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 2 & -1 & 1 & 0 \\ 1 & -1 & 2 & -1 & 2 & 0 \\ 1 & -1 & 1 & -1 & 2 & 0 \\ -1 & 0 & -4 & 5 & -4 & 2 \end{pmatrix}; \begin{array}{l} \text{fünffacher Eigenwert } \lambda_1 = 1, \\ \text{einfacher Eigenwert } \lambda_2 = 2; \\ \text{der Rang von } A - \lambda_1 E \text{ ist vier,} \\ \text{der Rang von } A - \lambda_2 E \text{ ist fünf.} \end{array}$$

a) Eigenwert $\lambda_1 = 1$: Zur Bestimmung einer Basis des Teilraumes Z_1 berechnen wir

$$(A - \lambda_1 E)^5 = \begin{pmatrix} 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 \\ 0 & -1 & -2 & 3 & -2 & 1 \end{pmatrix};$$

als Basisvektoren werden $\mathbf{b}_1 = (1,0,0,0,0,0)$, $\mathbf{b}_2 = (0,1,0,0,0,1)$, $\mathbf{b}_3 = (0,0,1,0,-1,0)$, $\mathbf{b}_4 = (0,0,0,1,1,-1)$, $\mathbf{b}_5 = (0,0,0,0,1,2)$ verwendet. Wir schreiben diese als Spaltenvektoren einer Matrix und wenden darauf $A - \lambda_1 E$ (von links) an:

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

Auf die entstehende Matrix wenden wir nochmals $A - \lambda_1 E$ (von links) an:

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

Nochmalige Anwendung von $A - \lambda_1 E$ (von links) liefert die Nullmatrix. Es entstehen zwei Hauptvektorketten der Maximallänge drei, die (bis auf das Vorzeichen) zum Eigenvektor $x_{11} = (0,0,0,1,1, -1)$ von A zu λ_1 als Endvektor führen. Davon verwenden wir eine Kette:

$$b'_2 = \begin{pmatrix} 0 \\ 1 \\ 0 \\ 0 \\ 0 \\ 1 \end{pmatrix}, \quad (A - \lambda_1 E)b'_2 = \begin{pmatrix} 1 \\ 0 \\ 0 \\ -1 \\ -1 \\ 1 \end{pmatrix}, \quad x_{11} = (A - \lambda_1 E)^2 b'_2 = \begin{pmatrix} 0 \\ 0 \\ 0 \\ 1 \\ 1 \\ -1 \end{pmatrix}.$$

Aus dem vorletzten Schritt gewinnen wir durch

$$(A - \lambda_1 E)b'_2 + (A - \lambda_1 E)b'_5 = \begin{pmatrix} 0 \\ 0 \\ 1 \\ 1 \\ 0 \\ -1 \end{pmatrix} = x'_{12}$$

den zweiten linear unabhängigen Eigenvektor von A zu λ_1 , der Endvektor einer Hauptvektorkette mit der Länge zwei ist. Über die gleiche Linearkombination der Basisvektoren finden wir den Ausgangsvektor dieser Hauptvektorkette:

$$b'_2 + b'_5 = \begin{pmatrix} 0 \\ 1 \\ 0 \\ 0 \\ 1 \\ 3 \end{pmatrix}.$$

Damit liegen die fünf linear unabhängigen Vektoren des Teilraumes Z_1 vor.

b) Eigenwert $\lambda_2 = 2$: Hier erhalten wir $x'_2 = (0,0,0,0,0,1)$ als Eigenvektor von A zu λ_2 ; damit steht der einzige linear unabhängige Vektor des Teilraumes Z_2 fest.

c) Da in der Transformationsmatrix X die Hauptvektorketten in der umgekehrten Reihenfolge auftreten, erhalten wir insgesamt folgende Ähnlichkeitstransformation $X^{-1}AX = J$:

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

Peter Lesky, Math. Institut A,
Universität Stuttgart

LITERATURVERZEICHNIS

- 1 A. I. Kostrikin: Introduction to Algebra. Springer-Verlag, Berlin, Heidelberg, New York 1982.
- 2 W. Schmeidler: Vorträge über Determinanten und Matrizen mit Anwendungen in Physik und Technik. Akademie-Verlag, Berlin 1949.
- 3 R. Zurmühl und S. Falk: Matrizen und ihre Anwendungen, 5. Aufl., Teil 1. Springer-Verlag, Berlin, Heidelberg, New York 1984.

Statistische Inferenz und strategisches Spiel

1. Einleitung

Der Entscheidungsträger (z. B. der Statistiker, der Unternehmer, der Staat usw.) sieht sich oft in der Lage, aus einer Menge $A = \{a_{ij}\}^1$ von *Aktionen* oder *Entscheidungen* eine in einem gewissen Sinne *optimale* auszuwählen, und zwar angesichts einer *unsicheren* Umwelt. Von dieser nehmen wir an, dass sie die relevanten Zustände $z_j \in Z$ annehmen kann. Wählt der Entscheidungsträger eine Aktion a_i im Zustand z_j , so resultiert ein Ergebnis $e_{ij} \in E$. Mit Hilfe der *Nutzenaxiomatik* nach J. v. Neumann oder Luce-Raiffa [4], S. 105ff.,

1) Wir beschränken uns auf endliche Mengen.