

# Глава X. Квадратичные формы

## § 39. Приведение формы к каноническому виду и закон инерции

Б.М.Верников

Уральский федеральный университет,  
Институт математики и компьютерных наук,  
кафедра алгебры и дискретной математики

В гл. V (§ 18–20) мы изучали многочлены от одной переменной. Общая теория многочленов от нескольких переменных выходит за рамки нашего курса. Но в этом и следующем параграфах мы рассмотрим один очень важный тип таких многочленов — так называемые *квадратичные формы*. Дадим необходимые определения.

## Определения

Пусть  $F$  — произвольное поле. *Одночленом от  $n$  переменных* над полем  $F$  называется выражение вида

$$ax_1^{k_1}x_2^{k_2}\cdots x_n^{k_n}, \quad (1)$$

где  $a \in F$ ,  $x_1, x_2, \dots, x_n$  — переменные (которые могут принимать значения в поле  $F$ ), а  $k_1, k_2, \dots, k_n \in \mathbb{N} \cup \{0\}$  (как обычно, мы считаем, что  $x^0 = 1$  для любого  $x \in F$ ; поэтому, если  $k_i = 0$  для некоторого  $i \in \{1, 2, \dots, n\}$ , то одночлен (1) не содержит переменной  $x_i$  в явном виде). Число  $k_i$  называется *степенью переменной  $x_i$  в одночлене (1)*, а число  $k_1 + k_2 + \dots + k_n$  — *степенью одночлена (1)*. *Многочленом от  $n$  переменных* над полем  $F$  называется выражение вида  $f_1 + f_2 + \dots + f_m$ , где  $f_1, f_2, \dots, f_m$  — одночлены от  $n$  переменных над этим полем.

## Определения

**Формой** над полем  $F$  называется многочлен от произвольного числа переменных над этим полем, в котором все одночлены имеют одну и ту же ненулевую степень. Эта степень называется **степенью формы**. Формы 1-й степени, т. е. многочлены вида  $a_1x_1 + a_2x_2 + \dots + a_nx_n$ , где  $a_1, a_2, \dots, a_n \in F$ , а  $x_1, x_2, \dots, x_n$  — переменные, называются **линейными**. Формы 2-й степени называются **квадратичными**. Квадратичную форму принято записывать в виде

$$\begin{aligned}
 f(x_1, x_2, \dots, x_n) = & a_{11}x_1^2 + a_{22}x_2^2 + \dots + a_{nn}x_n^2 + \\
 & + 2a_{12}x_1x_2 + 2a_{13}x_1x_3 + \dots + 2a_{1n}x_1x_n + \\
 & + 2a_{23}x_2x_3 + \dots + 2a_{2n}x_2x_n + \\
 & + \dots + \\
 & + 2a_{n-1n}x_{n-1}x_n,
 \end{aligned} \tag{2}$$

где  $a_{ij} \in F$  для всех  $i, j = 1, 2, \dots, n$ ,  $i \leq j$ , а  $x_1, x_2, \dots, x_n$  — переменные. Скаляры  $a_{ij}$  называются **коэффициентами** формы (2).

В дальнейшем мы будем иметь дело почти исключительно с квадратичными формами. Поэтому слово «квадратичная» часто будет опускаться.

**!** *Всюду в дальнейшем, кроме тех случаев, когда в явном виде оговорено противное, слово «форма» означает «квадратичная форма».*

## Определение

*Матрицей квадратичной формы (2) называется матрица*

$$A = \begin{pmatrix} a_{11} & a_{12} & a_{13} & \cdots & a_{1n} \\ a_{12} & a_{22} & a_{23} & \cdots & a_{2n} \\ a_{13} & a_{23} & a_{33} & \cdots & a_{3n} \\ \dots & \dots & \dots & \dots & \dots \\ a_{1n} & a_{2n} & a_{3n} & \cdots & a_{nn} \end{pmatrix}.$$

- *Матрица любой квадратичной формы является симметрической.*
- Кратко матрицу формы (2) записывают в виде  $A = (a_{ij})$ , полагая (как правило, неявно), что  $a_{ij} = a_{ji}$  для всех  $i, j = 1, 2, \dots, n$ .

Пусть  $A$  — матрица квадратичной формы (2). Положим

$$X = \begin{pmatrix} x_1 \\ x_2 \\ \vdots \\ x_n \end{pmatrix}.$$

Вычислив, согласно определению, произведение матриц  $X^T A X$ , можно убедиться, что оно представляет собой квадратную матрицу порядка 1, единственным элементом которой является правая часть равенства (2). Отождествляя, как это часто делается, квадратную матрицу 1-го порядка с ее единственным элементом, можно записать форму (2) в виде

$$f(x_1, x_2, \dots, x_n) = X^T A X. \quad (3)$$

## Определение

Правая часть равенства (3) называется *матричной записью* квадратичной формы (2).



## Определение

Говорят, что квадратичная форма имеет *канонический вид*, если матрица этой формы диагональна. Иными словами, форма имеет канонический вид, если в ней все коэффициенты при произведениях различных переменных равны 0.

## Теорема о приведении квадратичной формы к каноническому виду

*Из любой квадратичной формы можно с помощью невырожденной линейной замены переменных получить квадратичную форму, имеющую канонический вид.*

*Доказательство.* Мы приведем два доказательства этого факта. Оба они конструктивны, т. е. содержат алгоритмы приведения формы к каноническому виду. Первый алгоритм (*метод Лагранжа*) менее громоздок и его удобно применять при решении задач. Второй алгоритм (*метод приведения формы к главным осям*) применим только к формам над полем  $\mathbb{R}$ . Он пригодится нам в § 47 при изучении поверхностей второго порядка. Более подробные комментарии на эту тему см. после доказательства теоремы.

**Метод Лагранжа.** Пусть  $f(x_1, x_2, \dots, x_n)$  — квадратичная форма с матрицей  $A = (a_{ij})$ . Назовем переменную  $x_i$  **фиктивной**, если  $a_{ij} = 0$  для всех  $j = 1, 2, \dots, n$ . Если форма  $f$  содержит фиктивные переменные, то мы можем сначала привести к каноническому виду сумму всех слагаемых формы без фиктивных переменных, а затем добавить квадраты всех фиктивных переменных с коэффициентами 0. Поэтому будем далее считать, что форма не содержит фиктивных переменных. Покажем, что мы можем привести форму к виду

$$b_{11}y_1^2 + g(y_2, \dots, y_n), \quad (5)$$

где  $g(y_2, \dots, y_n)$  — квадратичная форма, зависящая только от переменных  $y_2, \dots, y_n$ . Если  $a_{1i} = 0$  для всех  $i > 1$ , то форма уже имеет такой вид (с точностью до обозначения переменных). Предположим поэтому, что  $a_{1i} \neq 0$  для некоторого  $i > 1$ . Для простоты обозначений будем считать, что  $i = 2$  (в общем случае рассуждения аналогичны). Дальнейшие рассуждения разбиваются на два случая.

**Случай 1:**  $a_{11} \neq 0$ . Обозначим через  $f'$  сумму всех слагаемых формы  $f$ , не содержащих переменную  $x_1$ . Тогда

$$f(x_1, x_2, \dots, x_n) = a_{11}x_1^2 + 2a_{12}x_1x_2 + \dots + 2a_{1n}x_1x_n + f'(x_2, \dots, x_n).$$

Сумму слагаемых, содержащих  $x_1$ , дополним до полного квадрата:

$$\begin{aligned}
 f(x_1, x_2, \dots, x_n) &= a_{11} \cdot \left( x_1^2 + 2x_1 \cdot \frac{a_{12}x_2 + \dots + a_{1n}x_n}{a_{11}} + \right. \\
 &\quad \left. + \frac{(a_{12}x_2 + \dots + a_{1n}x_n)^2}{a_{11}^2} \right) - \\
 &\quad - \frac{(a_{12}x_2 + \dots + a_{1n}x_n)^2}{a_{11}} + f'(x_2, \dots, x_n) = \\
 &= a_{11} \cdot \left( x_1 + \frac{a_{12}x_2 + \dots + a_{1n}x_n}{a_{11}} \right)^2 + g(x_2, \dots, x_n),
 \end{aligned}$$

где

$$g(x_2, \dots, x_n) = f'(x_2, \dots, x_n) - \frac{(a_{12}x_2 + \dots + a_{1n}x_n)^2}{a_{11}}.$$

Рассмотрим замену переменных

$$\begin{cases}
 x_1 = y_1 - \frac{a_{12}}{a_{11}} \cdot y_2 - \dots - \frac{a_{1n}}{a_{11}} \cdot y_n, \\
 x_2 = y_2, \\
 \dots \\
 x_n = y_n.
 \end{cases} \quad (6)$$

Матрица этой замены имеет вид

$$\begin{pmatrix} 1 & -\frac{a_{12}}{a_{11}} & -\frac{a_{13}}{a_{11}} & \dots & -\frac{a_{1n}}{a_{11}} \\ 0 & 1 & 0 & \dots & 0 \\ 0 & 0 & 1 & \dots & 0 \\ \dots & \dots & \dots & \dots & \dots \\ 0 & 0 & 0 & \dots & 1 \end{pmatrix}.$$

Ее определитель равен 1. В частности, замена (6) невырождена. Ясно, что

$$y_1 = x_1 + \frac{a_{12}x_2 + \dots + a_{1n}x_n}{a_{11}}, \quad y_2 = x_2, \quad \dots, \quad y_n = x_n.$$

Следовательно, замена (6) приводит форму  $f(x_2, \dots, x_n)$  к виду  $a_{11}y_1^2 + g(y_2, \dots, y_n)$ , т. е. к форме вида (5).

**Случай 2:**  $a_{11} = 0$ . Напомним, что  $a_{12} \neq 0$ . Рассмотрим замену переменных

$$\begin{cases} x_1 = y_1 + y_2 & , \\ x_2 = y_1 - y_2 & , \\ x_3 = & y_3 & , \\ \dots & \dots & \\ x_n = & y_n & . \end{cases} \quad (7)$$

Матрица этой замены имеет вид

$$\begin{pmatrix} 1 & 1 & 0 & \dots & 0 \\ 1 & -1 & 0 & \dots & 0 \\ 0 & 0 & 1 & \dots & 0 \\ \dots & \dots & \dots & \dots & \dots \\ 0 & 0 & 0 & \dots & 1 \end{pmatrix}.$$

Обозначим ее через  $B$ . По предложению об определителе полураспавшейся матрицы (см. § 25) имеем:

$$|B| = \begin{vmatrix} 1 & 1 \\ 1 & -1 \end{vmatrix} \cdot \begin{vmatrix} 1 & \dots & 0 \\ \dots & \dots & \dots \\ 0 & \dots & 1 \end{vmatrix} = -2 \cdot 1 = -2 \neq 0.$$

Таким образом, замена (7) невырожденна. Применив ее, получим форму, в которой коэффициент при  $y_1^2$  равен  $2a_{12}$ , и, в частности, отличен от 0. Это сводит ситуацию к случаю 1.

Итак, мы можем невырожденной линейной заменой переменных привести форму  $f$  к виду (5), т. е. избавиться от слагаемых, содержащих произведения  $x_1$  на другие переменные. После этого аналогичными действиями можно избавиться от слагаемых, содержащих произведения  $x_2$  на другие переменные, затем произведения  $x_3$  на другие переменные и т. д.

## Метод Лагранжа (5). Изменение матрицы формы при замене переменных

Через конечное число шагов слагаемых, содержащих произведения различных переменных не останется, и форма примет канонический вид. Теорема доказана (первым способом).  $\square$

Прежде чем приводить второе доказательство теоремы, заметим, что справедливо следующее

**Замечание об изменении матрицы формы при замене переменных**

*Если к квадратичной форме  $f = X^T A X$  применить замену переменных  $X = B Y$ , то получится квадратичная форма с матрицей  $B^T A B$ .*

**Доказательство.** В самом деле, подставив  $B Y$  вместо  $X$  в форму  $X^T A X$ , мы получим форму  $(B Y)^T A (B Y) = Y^T (B^T A B) Y$ , матрица которой равна  $B^T A B$ .  $\square$

*Метод приведения к главным осям.* Пусть  $f$  — квадратичная форма от  $n$  переменных над полем  $\mathbb{R}$ . Будем рассматривать матрицу  $A$  формы  $f$  как матрицу в стандартном базисе некоторого линейного оператора  $\mathcal{A}$  в пространстве  $\mathbb{R}^n$ . Матрица  $A$  симметрична. В силу следствия о матрице самосопряженного оператора в евклидовом пространстве (см. § 38), оператор  $\mathcal{A}$  самосопряжен. По следствию о симметрических матрицах (см. тот же параграф), существуют ортогональная матрица  $T$  и диагональная матрица  $D$  такие, что  $D = T^T A T$ . Применим к форме  $f = X^T A X$  невырожденную линейную замену переменных  $X = T Y$ . В силу замечания об изменении матрицы формы при замене переменных мы получим форму, матрицей которой является матрица  $T^T A T = D$ . Таким образом, в результате этой замены матрица формы станет диагональной, т. е. форма будет приведена к каноническому виду. Теорема доказана (вторым способом). □

Более подробно алгоритм приведения квадратичной формы к главным осям изложен на следующем слайде.

## Алгоритм приведения квадратичной формы к главным осям

Дана квадратичная форма  $X^T A X$  от  $n$  переменных над полем  $\mathbb{R}$ . Матрица  $A$  симметрична. Линейный оператор в пространстве  $\mathbb{R}_n$ , имеющий в стандартном базисе этого пространства матрицу  $A$ , самосопряжен (см. следствие о матрице самосопряженного оператора в евклидовом пространстве в § 38). Находим сначала все собственные значения, а затем все линейно независимые собственные векторы матрицы  $A$ . Они образуют базис в  $\mathbb{R}_n$  (см. доказательство основной теоремы о самосопряженном операторе в § 38). Применяя процесс ортогонализации в тех случаях, когда к какому-то собственному значению относится более одного линейно независимого собственного вектора, находим ортогональный базис в  $\mathbb{R}_n$  (см. лемму о собственных векторах самосопряженного оператора в § 38). Нормируем векторы этого базиса и получаем ортонормированный базис, состоящий из собственных векторов матрицы  $A$ . Записываем векторы этого базиса в матрицу по столбцам, обозначаем эту матрицу через  $T$ . Вычисляем матрицу  $D = T^T A T$ . Эта матрица диагональна (см. критерий приводимости оператора к диагональному виду и его доказательство в § 33) и является матрицей искомой квадратичной формы, имеющей канонический вид. Вычисление матрицы  $D$  можно заменить применением замены переменных  $X = T Y$ .

Изложение метода приведения к главным осям занимает намного меньше места, чем метода Лагранжа, но при применении этих методов для решения задач ситуация прямо противоположна. Для применения метода Лагранжа надо несколько раз выделить полный квадрат по той или иной переменной и/или применить замену переменных вида (7). На практике это сводится к несложным арифметическим манипуляциям с многочленами. В то же время, алгоритм приведения квадратичной формы к главным осям, описанный на предыдущем слайде, предусматривает:

1) вычисление определителя матрицы  $A - xE$ , 2) решение уравнения  $|A - xE| = 0$  (эти два действия нужны для нахождения собственных значений матрицы  $A$ ), 3) решение систем линейных уравнений (для нахождения собственных векторов этой матрицы), 4) применение процесса ортогонализации Грама–Шмидта (для получения ортонормированного базиса из собственных векторов), 5) перемножение матриц (для нахождения матрицы  $D = T^T A T$ ). Таким образом, метод приведения формы к главным осям значительно более трудоемок, чем метод Лагранжа, особенно если число переменных в форме больше 3. Поэтому при решении задач метод приведения к главным осям рекомендуется применять только тогда, когда без этого обойтись нельзя — например, при упрощении уравнения поверхности второго порядка (см. § 47). Отметим, что в последнем случае форма зависит всего от трех переменных, и потому объем необходимых вычислений сравнительно невелик.

Из одной и той же квадратичной формы с помощью различных невырожденных линейных замен переменных можно получить бесконечно много форм канонического вида. Но, как показывает следующее утверждение, некоторые важные характеристики всех этих форм должны совпадать.

## Закон инерции квадратичных форм

*Если квадратичная форма над полем  $\mathbb{R}$  двумя различными невырожденными линейными заменами переменных приведена к двум различным формам, имеющим канонический вид, то полученные формы имеют одинаковое число положительных коэффициентов при квадратах переменных и одинаковое число отрицательных коэффициентов при квадратах переменных.*

**Доказательство.** Предположим, что мы привели квадратичную форму  $f = X^T A X$  к каноническому виду  $g = Y^T D Y$ . По определению канонического вида формы, матрица  $D$  диагональна. Согласно второму доказательству теоремы о приведении квадратичной формы к каноническому виду, можно считать, что переход от формы  $f$  к форме  $g$  сделан с помощью замены  $X = T Y$ , где матрица  $T$  ортогональна (и, в частности, невырожденна). Тогда  $D = T^T A T$ .







Подставив эти значения вместо переменных  $x_1, x_2, \dots, x_n$  в правые части равенств (12) и (13), получим значения левых частей этих равенств:

$$y_1 = y'_1, y_2 = y'_2, \dots, y_n = y'_n, z_1 = z'_1, z_2 = z'_2, \dots, z_n = z'_n.$$

Отметим, что

$$y'_1 = y'_2 = \dots = y'_k = z'_{p+1} = z'_{p+2} = \dots = z'_n = 0.$$

Покажем, что среди скаляров  $z'_1, z'_2, \dots, z'_n$  есть ненулевые. Пусть  $F = (f_{ij})$  — матрица замены (13). Поскольку эта замена невырождена,  $|F| \neq 0$ . Следовательно, ранг матрицы  $F$  по минорам равен  $n$ . В силу теоремы о ранге матрицы, ранг матрицы  $F$  по столбцам также равен  $n$ . Обозначим векторы-столбцы матрицы  $F$  через  $\mathbf{f}_1, \mathbf{f}_2, \dots, \mathbf{f}_n$ . Из того, что ранг матрицы  $F$  по столбцам равен  $n$ , вытекает, что векторы  $\mathbf{f}_1, \mathbf{f}_2, \dots, \mathbf{f}_n$  линейно независимы. В то же время, равенства (13) можно переписать в виде векторного равенства  $x_1 \mathbf{f}_1 + x_2 \mathbf{f}_2 + \dots + x_n \mathbf{f}_n = \mathbf{z}$ , где  $\mathbf{z} = (z_1, z_2, \dots, z_n)$ . Следовательно,  $x'_1 \mathbf{f}_1 + x'_2 \mathbf{f}_2 + \dots + x'_n \mathbf{f}_n = \mathbf{z}'$ , где  $\mathbf{z}' = (z'_1, z'_2, \dots, z'_n)$ . Поскольку среди скаляров  $x'_1, x'_2, \dots, x'_n$  есть ненулевые, а векторы  $\mathbf{f}_1, \mathbf{f}_2, \dots, \mathbf{f}_n$  линейно независимы, мы получаем, что  $\mathbf{z}' \neq \mathbf{0}$ . Но это и означает, что среди скаляров  $z'_1, z'_2, \dots, z'_n$  есть ненулевые.

Равенство (9) означает, что если в его левой части произвести замену переменных  $x_1, x_2, \dots, x_n$  на  $y_1, y_2, \dots, y_n$ , то получим правую часть этого равенства. Отсюда и из того, что  $y'_1 = y'_2 = \dots = y'_k = 0$ , следует, что

$$\begin{aligned} f(x'_1, x'_2, \dots, x'_n) &= t_1(y'_1)^2 + t_2(y'_2)^2 + \dots + t_k(y'_k)^2 - \\ &- t_{k+1}(y'_{k+1})^2 - t_{k+2}(y'_{k+2})^2 - \dots - t_{k+l}(y'_{k+l})^2 = \\ &= -t_{k+1}(y'_{k+1})^2 - t_{k+2}(z'_{k+2})^2 - \dots - t_{k+l}(y'_{k+l})^2 \leq 0. \end{aligned}$$

Аналогично из равенства (11) и того, что  $z'_{p+1} = z'_{p+2} = \dots = z'_n = 0$ , а среди скаляров  $z_1, z_2, \dots, z_p$  есть отличные от нуля, следует, что

$$\begin{aligned} f(x'_1, x'_2, \dots, x'_n) &= s_1(z'_1)^2 + s_2(z'_2)^2 + \dots + s_p(z'_p)^2 - \\ &- s_{p+1}(z'_{p+1})^2 - s_{p+2}(z'_{p+2})^2 - \dots - s_{p+q}(z'_{p+q})^2 = \\ &= s_1(z'_1)^2 + s_2(z'_2)^2 + \dots + s_p(z'_p)^2 > 0. \end{aligned}$$

Итак,  $f(x'_1, x'_2, \dots, x'_n) \leq 0$  и  $f(x'_1, x'_2, \dots, x'_n) > 0$ . Противоречие доказывает, что предположение о том, что  $k \neq p$ , ложно. Следовательно,  $k = p$ .  $\square$