



# Allgemeines Lineares Modell

BSc Psychologie SoSe 2023

Prof. Dr. Dirk Ostwald

### (3) Matrizen

## Motivation

Matrizen sind die Worte der Sprache der Datenanalyse.

Vektoren sind nur spezielle Matrizen.

Matrizen können als Tabellen der Datenrepräsentation dienen.

Matrizen können lineare Abbildungen repräsentieren.

Matrizen können Vektorräume repräsentieren.

Ein sicherer Umgang mit Matrizen ist für  
das Verständnis moderner datenanalytischer Verfahren unverzichtbar.

---

Definition

Operationen

Determinanten

Rang

Spezielle Matrizen

Selbstkontrollfragen

---

## **Definition**

Operationen

Determinanten

Rang

Spezielle Matrizen

Selbstkontrollfragen

## Definition (Matrix)

Eine Matrix ist eine rechteckige Anordnung von Zahlen, die wie folgt bezeichnet wird

$$A := \begin{pmatrix} a_{11} & a_{12} & \cdots & a_{1m} \\ a_{21} & a_{22} & \cdots & a_{2m} \\ \vdots & \vdots & \ddots & \vdots \\ a_{n1} & a_{n2} & \cdots & a_{nm} \end{pmatrix} := (a_{ij})_{1 \leq i \leq n, 1 \leq j \leq m}. \quad (1)$$

### Bemerkungen

- Matrizen bestehen aus *Zeilen (rows)* und *Spalten (columns)*.
- Die Matrixeinträge  $a_{ij}$  werden mit einem *Zeilenindex*  $i$  und einem *Spaltenindex*  $j$  indiziert.

- Zum Beispiel gilt für  $A := \begin{pmatrix} 2 & 7 & 5 & 2 \\ 8 & 2 & 5 & 6 \\ 6 & 4 & 0 & 9 \\ 9 & 2 & 1 & 2 \end{pmatrix}$ , dass  $a_{32} = 4$ .

## Bemerkungen (fortgeführt)

- Die *Größe* oder *Dimension* einer Matrix ergibt sich aus der Anzahl ihrer Zeilen  $n \in \mathbb{N}$  und Spalten  $m \in \mathbb{N}$ .
- Matrizen mit  $n = m$  heißen *quadratische Matrizen*.
- In der Folge benötigen wir nur Matrizen mit reellen Einträgen, also  $a_{ij} \in \mathbb{R} \forall i = 1, \dots, n, j = 1, \dots, m$ .
- Wir nennen die Matrizen mit reellen Einträge *reelle Matrizen*.
- Die Menge der reellen Matrizen mit  $n$  Zeilen und  $m$  Spalten bezeichnen wir mit  $\mathbb{R}^{n \times m}$
- Aus dem Ausdruck  $A \in \mathbb{R}^{2 \times 3}$  lesen wir ab, dass  $A$  eine reelle Matrix mit zwei Zeilen und drei Spalten ist.
- Wir identifizieren die Menge  $\mathbb{R}^{1 \times 1}$  mit der Menge  $\mathbb{R}$ .
- Wir identifizieren die Menge  $\mathbb{R}^{n \times 1}$  mit der Menge  $\mathbb{R}^n$ .
- Reelle Matrizen mit einer Spalte und  $n$  Zeilen sind also dasselbe wie  $n$ -dimensionale reelle Vektoren.

---

Definition

**Operationen**

Determinanten

Rang

Spezielle Matrizen

Selbstkontrollfragen

## Matrixoperationen

Man kann mit Matrizen rechnen.

In der Folge betrachten wir folgende grundlegende Matrixoperationen

- Addition und Subtraktion von Matrizen gleicher Größe (Matrixaddition und Matrixsubtraktion)
- Multiplikation einer Matrix mit einem Skalar (Skalarmultiplikation)
- Vertauschen der Zeilen- und Spaltenanordnung (Matrixtransposition)
- Multiplikation einer Matrix mit einer passenden zweiten Matrix (Matrixmultiplikation)
- "Teilen" durch eine quadratische Matrix (Matrixinversion)

## Definition (Matrixaddition)

Es seien  $A, B \in \mathbb{R}^{n \times m}$ . Dann ist die *Addition* von  $A$  und  $B$  definiert als die Abbildung

$$+ : \mathbb{R}^{n \times m} \times \mathbb{R}^{n \times m} \rightarrow \mathbb{R}^{n \times m}, (A, B) \mapsto +(A, B) := A + B \quad (2)$$

mit

$$\begin{aligned} A + B &= \begin{pmatrix} a_{11} & a_{12} & \cdots & a_{1m} \\ a_{21} & a_{22} & \cdots & a_{2m} \\ \vdots & \vdots & \ddots & \vdots \\ a_{n1} & a_{n2} & \cdots & a_{nm} \end{pmatrix} + \begin{pmatrix} b_{11} & b_{12} & \cdots & b_{1m} \\ b_{21} & b_{22} & \cdots & b_{2m} \\ \vdots & \vdots & \ddots & \vdots \\ b_{n1} & b_{n2} & \cdots & b_{nm} \end{pmatrix} \\ &:= \begin{pmatrix} a_{11} + b_{11} & a_{12} + b_{12} & \cdots & a_{1m} + b_{1m} \\ a_{21} + b_{21} & a_{22} + b_{22} & \cdots & a_{2m} + b_{2m} \\ \vdots & \vdots & \ddots & \vdots \\ a_{n1} + b_{n1} & a_{n2} + b_{n2} & \cdots & a_{nm} + b_{nm} \end{pmatrix}. \end{aligned} \quad (3)$$

### Bemerkungen

- Nur Matrizen identischer Größe können miteinander addiert werden.
- Die Addition zweier gleich großer Matrizen ist elementweise definiert.

## Definition (Matrixsubtraktion)

Es seien  $A, B \in \mathbb{R}^{n \times m}$ . Dann ist die *Subtraktion* von  $A$  und  $B$  definiert als die Abbildung

$$- : \mathbb{R}^{n \times m} \times \mathbb{R}^{n \times m} \rightarrow \mathbb{R}^{n \times m}, (A, B) \mapsto -(A, B) := A - B \quad (4)$$

mit

$$\begin{aligned} A - B &= \begin{pmatrix} a_{11} & a_{12} & \cdots & a_{1m} \\ a_{21} & a_{22} & \cdots & a_{2m} \\ \vdots & \vdots & \ddots & \vdots \\ a_{n1} & a_{n2} & \cdots & a_{nm} \end{pmatrix} - \begin{pmatrix} b_{11} & b_{12} & \cdots & b_{1m} \\ b_{21} & b_{22} & \cdots & b_{2m} \\ \vdots & \vdots & \ddots & \vdots \\ b_{n1} & b_{n2} & \cdots & b_{nm} \end{pmatrix} \\ &:= \begin{pmatrix} a_{11} - b_{11} & a_{12} - b_{12} & \cdots & a_{1m} - b_{1m} \\ a_{21} - b_{21} & a_{22} - b_{22} & \cdots & a_{2m} - b_{2m} \\ \vdots & \vdots & \ddots & \vdots \\ a_{n1} - b_{n1} & a_{n2} - b_{n2} & \cdots & a_{nm} - b_{nm} \end{pmatrix}. \end{aligned} \quad (5)$$

### Bemerkungen

- Nur Matrizen identischer Größe können voneinander subtrahiert werden.
- Die Subtraktion zweier gleich großer Matrizen ist elementweise definiert.

# Operationen

## Beispiel

Es seien  $A, B \in \mathbb{R}^{2 \times 3}$  definiert als

$$A := \begin{pmatrix} 2 & -3 & 0 \\ 1 & 6 & 5 \end{pmatrix} \text{ und } B := \begin{pmatrix} 4 & 1 & 0 \\ -4 & 2 & 0 \end{pmatrix}. \quad (6)$$

Da  $A$  und  $B$  gleich groß sind, können wir sie addieren

$$\begin{aligned} C = A + B &= \begin{pmatrix} 2 & -3 & 0 \\ 1 & 6 & 5 \end{pmatrix} + \begin{pmatrix} 4 & 1 & 0 \\ -4 & 2 & 0 \end{pmatrix} \\ &= \begin{pmatrix} 2+4 & -3+1 & 0+0 \\ 1-4 & 6+2 & 5+0 \end{pmatrix} \\ &= \begin{pmatrix} 6 & -2 & 0 \\ -3 & 8 & 5 \end{pmatrix} \end{aligned} \quad (7)$$

und voneinander subtrahieren

$$\begin{aligned} D = A - B &= \begin{pmatrix} 2 & -3 & 0 \\ 1 & 6 & 5 \end{pmatrix} - \begin{pmatrix} 4 & 1 & 0 \\ -4 & 2 & 0 \end{pmatrix} \\ &= \begin{pmatrix} 2-4 & -3-1 & 0-0 \\ 1+4 & 6-2 & 5-0 \end{pmatrix} \\ &= \begin{pmatrix} -2 & -4 & 0 \\ 5 & 4 & 5 \end{pmatrix}. \end{aligned} \quad (8)$$

# Operationen

## Beispiel

```
# Spaltenweise Definition von A (R default)
```

```
A = matrix(c(2,1,-3,6,0,5), nrow = 2)
```

```
print(A)
```

```
>      [,1] [,2] [,3]
```

```
> [1,]    2   -3    0
```

```
> [2,]    1    6    5
```

```
# Zeilenweise Definition von B
```

```
B = matrix(c(4,1,0,-4,2,0), nrow = 2, byrow = TRUE)
```

```
print(B)
```

```
>      [,1] [,2] [,3]
```

```
> [1,]    4    1    0
```

```
> [2,]   -4    2    0
```

# Operationen

## Beispiel

```
# Addition
```

```
C = A + B
```

```
print(C)
```

```
>      [,1] [,2] [,3]
```

```
> [1,]    6  -2    0
```

```
> [2,]   -3    8    5
```

```
# Subtraktion
```

```
D = A - B
```

```
print(D)
```

```
>      [,1] [,2] [,3]
```

```
> [1,]   -2  -4    0
```

```
> [2,]    5    4    5
```

## Definition (Skalarmultiplikation)

Es sei  $c \in \mathbb{R}$  ein Skalar und  $A \in \mathbb{R}^{n \times m}$ . Dann ist die *Skalarmultiplikation* von  $c$  und  $A$  definiert als die Abbildung

$$\cdot : \mathbb{R} \times \mathbb{R}^{n \times m} \rightarrow \mathbb{R}^{n \times m}, (c, A) \mapsto \cdot(c, A) := cA \quad (9)$$

mit

$$cA = c \begin{pmatrix} a_{11} & a_{12} & \cdots & a_{1m} \\ a_{21} & a_{22} & \cdots & a_{2m} \\ \vdots & \vdots & \ddots & \vdots \\ a_{n1} & a_{n2} & \cdots & a_{nm} \end{pmatrix} := \begin{pmatrix} ca_{11} & ca_{12} & \cdots & ca_{1m} \\ ca_{21} & ca_{22} & \cdots & ca_{2m} \\ \vdots & \vdots & \ddots & \vdots \\ ca_{n1} & ca_{n2} & \cdots & ca_{nm} \end{pmatrix}. \quad (10)$$

## Bemerkungen

- Die Skalarmultiplikation ist elementweise definiert.

# Operationen

## Beispiel

Es seien  $c := -3$  und  $A \in \mathbb{R}^{4 \times 3}$  definiert als

$$A := \begin{pmatrix} 3 & 1 & 1 \\ 5 & 2 & 5 \\ 2 & 7 & 1 \\ 3 & 4 & 2 \end{pmatrix}. \quad (11)$$

Dann ergibt sich

$$B := cA = -3 \begin{pmatrix} 3 & 1 & 1 \\ 5 & 2 & 5 \\ 2 & 7 & 1 \\ 3 & 4 & 2 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} -3 \cdot 3 & -3 \cdot 1 & -3 \cdot 1 \\ -3 \cdot 5 & -3 \cdot 2 & -3 \cdot 5 \\ -3 \cdot 2 & -3 \cdot 7 & -3 \cdot 1 \\ -3 \cdot 3 & -3 \cdot 4 & -3 \cdot 2 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} -9 & -3 & -3 \\ -15 & -6 & -15 \\ -6 & -21 & -3 \\ -9 & -12 & -6 \end{pmatrix}. \quad (12)$$

# Operationen

## Beispiel

```
# Definitionen
A = matrix(c(3,1,1,
            5,2,5,
            2,7,1,
            3,4,2),
          nrow = 4,
          byrow = TRUE)

c = -3

# Skalarmultiplikation
B = c*A
print(B)
```

```
>      [,1] [,2] [,3]
> [1,]  -9  -3  -3
> [2,] -15  -6 -15
> [3,]  -6 -21  -3
> [4,]  -9 -12  -6
```

## Theorem (Vektorraum $\mathbb{R}^{n \times m}$ )

Das Tripel  $(\mathbb{R}^{n \times m}, +, \cdot)$  mit der oben definierten Matrixaddition und Skalarmultiplikation ist ein Vektorraum. Insbesondere gelten also für  $A, B, C \in \mathbb{R}^{n \times m}$  und  $r, s, t \in \mathbb{R}$  folgende Rechenregeln:

- |  |   |
|--|---|
| (1) Kommutativität der Addition                                | $A + B = B + A$   |
| (2) Assoziativität der Addition                                | $(A + B) + C = A + (B + C)$                                       |
| (3) Existenz eines neutralen Elements der Addition             | $\exists 0 \in \mathbb{R}^{n \times m}$ mit $A + 0 = 0 + A = A$ . |
| (4) Existenz inverser Elemente der Addition                    | $\forall A \exists -A$ mit $A + (-A) = 0$ .                       |
| (5) Existenz eines neutralen Elements der Skalarmultiplikation | $\exists 1 \in \mathbb{R}$ mit $1 \cdot A = A$ .                  |
| (6) Assoziativität der Skalarmultiplikation                    | $r \cdot (s \cdot t) = (r \cdot s) \cdot t$ .                     |
| (7) Distributivität hinsichtlich der Matrixaddition            | $r \cdot (A + B) = r \cdot A + r \cdot B$ .                       |
| (8) Distributivität hinsichtlich der Skalaraddition            | $(r + s) \cdot A = r \cdot A + s \cdot A$ .                       |

### Bemerkungen

- Wir verzichten auf einen Beweis.
- Der Beweis ergibt sich mit dem elementweisen Charakter von  $+$ ,  $-$ ,  $\cdot$  und den Rechenregeln in  $(\mathbb{R}, +, \cdot)$ .
- Das neutrale Element der Addition heißt *Nullmatrix*; wir schreiben  $0_{nm} := (0)_{1 \leq i \leq n, 1 \leq j \leq m}$  mit  $0 \in \mathbb{R}$ .
- Die inversen Elemente der Addition sind durch  $-A := (-a_{ij})_{1 \leq i \leq n, 1 \leq j \leq m}$  gegeben.
- Das neutrale Element der Skalarmultiplikation ist  $1 \in \mathbb{R}$ .

## Definition (Matrixtransposition)

Es sei  $A \in \mathbb{R}^{n \times m}$ . Dann ist die *Transposition* von  $A$  definiert als die Abbildung

$${}^T : \mathbb{R}^{n \times m} \rightarrow \mathbb{R}^{m \times n}, A \mapsto {}^T(A) := A^T \quad (13)$$

mit

$$A^T = \begin{pmatrix} a_{11} & a_{12} & \cdots & a_{1m} \\ a_{21} & a_{22} & \cdots & a_{2m} \\ \vdots & \vdots & \ddots & \vdots \\ a_{n1} & a_{n2} & \cdots & a_{nm} \end{pmatrix}^T := \begin{pmatrix} a_{11} & a_{21} & \cdots & a_{n1} \\ a_{12} & a_{22} & \cdots & a_{n2} \\ \vdots & \vdots & \ddots & \vdots \\ a_{1m} & a_{2m} & \cdots & a_{nm} \end{pmatrix} \quad (14)$$

### Bemerkungen

- Die Matrixtransposition "vertauscht" Zeilen und Spalten.
- Für  $A \in \mathbb{R}^{n \times m}$  gilt immer  $A^T \in \mathbb{R}^{m \times n}$ .
- Für  $A \in \mathbb{R}^{1 \times 1}$  gilt immer  $A^T = A$ .
- Es gilt  $(A^T)^T = A$ .
- Es gilt  $(a_{ii})_{1 \leq i \leq \min(n,m)} = (a_{ii})_{1 \leq i \leq \min(n,m)}^T$
- Matrixelemente auf der Hauptdiagonalen einer Matrix bleiben bei Transposition also unberührt.

Beispiel

Es sei  $A \in \mathbb{R}^{2 \times 3}$  definiert durch

$$A := \begin{pmatrix} 2 & 3 & 0 \\ 1 & 6 & 5 \end{pmatrix}, \quad (15)$$

Dann gilt  $A^T \in \mathbb{R}^{3 \times 2}$  und speziell

$$A^T := \begin{pmatrix} 2 & 1 \\ 3 & 6 \\ 0 & 5 \end{pmatrix}. \quad (16)$$

Weiterhin gilt offenbar  $\min(m, n) = 2$  und folglich

$$(a_{11}) = (a_{11})^T \text{ und } (a_{22}) = (a_{22})^T. \quad (17)$$

# Operationen

## Beispiel

```
# Definition
A = matrix(c(2,3,0,
            1,6,5),
          nrow = 2,
          byrow = TRUE)
print(A)
```

```
>      [,1] [,2] [,3]
> [1,]    2    3    0
> [2,]    1    6    5
```

```
# Transposition
AT = t(A)
print(AT)
```

```
>      [,1] [,2]
> [1,]    2    1
> [2,]    3    6
> [3,]    0    5
```

## Definition (Matrixmultiplikation)

Es seien  $A \in \mathbb{R}^{n \times m}$  und  $B \in \mathbb{R}^{m \times k}$ . Dann ist die *Matrixmultiplikation* von  $A$  und  $B$  definiert als die Abbildung

$$\cdot : \mathbb{R}^{n \times m} \times \mathbb{R}^{m \times k} \rightarrow \mathbb{R}^{n \times k}, (A, B) \mapsto \cdot(A, B) := AB \quad (18)$$

mit

$$\begin{aligned} AB &= \begin{pmatrix} a_{11} & a_{12} & \cdots & a_{1m} \\ a_{21} & a_{22} & \cdots & a_{2m} \\ \vdots & \vdots & \ddots & \vdots \\ a_{n1} & a_{n2} & \cdots & a_{nm} \end{pmatrix} \begin{pmatrix} b_{11} & b_{12} & \cdots & b_{1k} \\ b_{21} & b_{22} & \cdots & b_{2k} \\ \vdots & \vdots & \ddots & \vdots \\ b_{m1} & b_{m2} & \cdots & b_{mk} \end{pmatrix} \\ &:= \begin{pmatrix} \sum_{i=1}^m a_{1i}b_{i1} & \sum_{i=1}^m a_{1i}b_{i2} & \cdots & \sum_{i=1}^m a_{1i}b_{ik} \\ \sum_{i=1}^m a_{2i}b_{i1} & \sum_{i=1}^m a_{2i}b_{i2} & \cdots & \sum_{i=1}^m a_{2i}b_{ik} \\ \vdots & \vdots & \ddots & \vdots \\ \sum_{i=1}^m a_{ni}b_{i1} & \sum_{i=1}^m a_{ni}b_{i2} & \cdots & \sum_{i=1}^m a_{ni}b_{ik} \end{pmatrix} \\ &= \left( \sum_{i=1}^m a_{ji}b_{il} \right)_{\substack{1 \leq j \leq n, \\ 1 \leq l \leq k}} \end{pmatrix} \quad (19)$$

## Bemerkungen

- Das Matrixprodukt  $AB$  ist nur dann definiert, wenn  $A$  genau so viele Spalten hat wie  $B$  Zeilen.
- Informell gilt für die beteiligten Matrixgrößen immer  $(n \times m)(m \times k) = (n \times k)$ .
- In  $AB$  ist  $(AB)_{ij}$  die Summe der multiplizierten  $i$ ten Zeilen von  $A$  und  $j$ ten Spalten von  $B$ .
- Zum Berechnen von  $(AB)_{ij}$  für  $1 \leq i \leq n, 1 \leq j \leq k$  geht man also wie folgt vor:
  1. Man legt in Gedanken die Transposition der  $i$ ten Zeile von  $A$  über die  $j$ te Spalte von  $B$ .
  2. Weil  $A$  genau  $m$  Spalten hat und  $B$  genau  $m$  Zeilen hat, gibt es zu jedem Element der Zeile aus  $A$  ein korrespondierendes Element in der Spalte von  $B$ .
  3. Man multipliziert die korrespondierenden Elemente miteinander.
  4. Die Summe dieser Produkte ist dann der Eintrag mit Index  $ij$  in  $AB$ .
- Die Multiplikation von Matrizen ist im Allgemeinen nicht kommutativ (also meist  $AB \neq BA$ ).

## Beispiel

$A \in \mathbb{R}^{2 \times 3}$  und  $B \in \mathbb{R}^{3 \times 2}$  seien definiert als

$$A := \begin{pmatrix} 2 & -3 & 0 \\ 1 & 6 & 5 \end{pmatrix} \text{ und } B := \begin{pmatrix} 4 & 2 \\ -1 & 0 \\ 1 & 3 \end{pmatrix}. \quad (20)$$

Wir wollen  $C := AB$  und  $D := BA$  berechnen.

Mit  $n = 2$ ,  $m = 3$  und  $k = 2$  wissen wir schon, dass  $C \in \mathbb{R}^{2 \times 2}$  und  $D \in \mathbb{R}^{3 \times 3}$ , weil

$$(2 \times 3)(3 \times 2) = (2 \times 2) \quad (21)$$

und

$$(3 \times 2)(2 \times 3) = (3 \times 3) \quad (22)$$

Es gilt hier also sicher  $AB \neq BA$ .

## Beispiel (fortgeführt)

Es ergibt sich zum einen

$$\begin{aligned}C &= AB \\&= \begin{pmatrix} 2 & -3 & 0 \\ 1 & 6 & 5 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} 4 & 2 \\ -1 & 0 \\ 1 & 3 \end{pmatrix} \\&= \begin{pmatrix} 2 \cdot 4 + (-3) \cdot (-1) + 0 \cdot 1 & 2 \cdot 2 + (-3) \cdot 0 + 0 \cdot 3 \\ 1 \cdot 4 + 6 \cdot (-1) + 5 \cdot 1 & 1 \cdot 2 + 6 \cdot 0 + 5 \cdot 3 \end{pmatrix} & (23) \\&= \begin{pmatrix} 8 + 3 + 0 & 4 + 0 + 0 \\ 4 - 6 + 5 & 2 + 0 + 15 \end{pmatrix} \\&= \begin{pmatrix} 11 & 4 \\ 3 & 17 \end{pmatrix}.\end{aligned}$$

## Beispiel (fortgeführt)

```
# Definitionen
A = matrix(c(2,-3,0,
            1, 6,5),
           nrow = 2,
           byrow = TRUE)
B = matrix(c( 4,2,
            -1,0,
            1,3),
           nrow = 3,
           byrow = TRUE)

# Matrixmultiplikation
C = A %*% B
print(C)
```

```
>      [,1] [,2]
> [1,]   11   4
> [2,]    3  17
```

## Beispiel (fortgeführt)

Es ergibt sich zum anderen

$$\begin{aligned} D &= BA \\ &= \begin{pmatrix} 4 & 2 \\ -1 & 0 \\ 1 & 3 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} 2 & -3 & 0 \\ 1 & 6 & 5 \end{pmatrix} \\ &= \begin{pmatrix} 4 \cdot 2 + 2 \cdot 1 & 4 \cdot (-3) + 2 \cdot 6 & 4 \cdot 0 + 2 \cdot 5 \\ (-1) \cdot 2 + 0 \cdot 1 & (-1) \cdot (-3) + 0 \cdot 6 & (-1) \cdot 0 + 0 \cdot 5 \\ 1 \cdot 2 + 3 \cdot 1 & 1 \cdot (-3) + 3 \cdot 6 & 1 \cdot 0 + 3 \cdot 5 \end{pmatrix} \\ &= \begin{pmatrix} 8 + 2 & -12 + 12 & 0 + 5 \\ -2 + 0 & 3 + 0 & 0 + 0 \\ 2 + 3 & -3 + 18 & 0 + 15 \end{pmatrix} \\ &= \begin{pmatrix} 10 & 0 & 10 \\ -2 & 3 & 0 \\ 5 & 15 & 15 \end{pmatrix} \end{aligned} \tag{24}$$

# Operationen

## Beispiel (fortgeführt)

```
# Definitionen
A = matrix(c(2,-3,0,
            1, 6,5),
          nrow = 2,
          byrow = TRUE)
B = matrix(c( 4,2,
            -1,0,
            1,3),
          nrow = 3,
          byrow = TRUE)
```

```
# Matrixmultiplikation
D = B %*% A
print(D)
```

```
>      [,1] [,2] [,3]
> [1,]  10   0  10
> [2,]  -2   3   0
> [3,]   5  15  15
```

```
# Beispiel für eine undefinierte Matrixmultiplikation
E = t(A) %*% B      # (3 x 2)(3 x 2)
```

```
> Error in t(A) %*% B: nicht passende Argumente
```

## Theorem (Matrixmultiplikation und Skalarprodukt)

Es seien  $x, y \in \mathbb{R}^n$ . Dann gilt

$$\langle x, y \rangle = x^T y. \quad (25)$$

Weiterhin seien für  $A \in \mathbb{R}^{n \times m}$  für  $i = 1, \dots, n$

$$\bar{a}_i := (a_{ji})_{1 \leq j \leq m} \in \mathbb{R}^m \quad (26)$$

die Spalten von  $A^T$  und für  $B \in \mathbb{R}^{m \times k}$  für  $i = 1, \dots, k$

$$\bar{b}_j := (b_{ij})_{1 \leq i \leq m} \in \mathbb{R}^m \quad (27)$$

die Spalten von  $B$ , also

$$A^T = \begin{pmatrix} \bar{a}_1 & \bar{a}_2 & \cdots & \bar{a}_n \end{pmatrix} \in \mathbb{R}^{m \times n} \text{ und } B = \begin{pmatrix} \bar{b}_1 & \bar{b}_2 & \cdots & \bar{b}_k \end{pmatrix} \in \mathbb{R}^{m \times k}. \quad (28)$$

Dann gilt

$$AB = \left( \langle \bar{a}_i, \bar{b}_j \rangle \right)_{1 \leq i \leq n, 1 \leq j \leq k} \quad (29)$$

### Bemerkungen

- Der Eintrag  $(AB)_{ij}$  entspricht dem Skalarprodukt von  $i$ ter Spalte von  $A^T$  und  $j$ ter Spalte von  $B$ .
- Die erste Aussage folgt mit der Identifikation von  $\mathbb{R}^n = \mathbb{R}^{n \times 1}$
- Wir verzichten auf einen ausführlichen Beweis.

## Theorem (Matrixmultiplikation und Transposition)

Es seien  $A \in \mathbb{R}^{m \times n}$  und  $B \in \mathbb{R}^{n \times k}$ . Dann gilt

$$(AB)^T = B^T A^T. \quad (30)$$

Beweis

$$\begin{aligned} (AB)^T &= \left( \left( \sum_{i=1}^m a_{ji} b_{il} \right)_{1 \leq j \leq n, 1 \leq l \leq k} \right)^T \\ &= \left( \sum_{i=1}^m a_{ij} b_{li} \right)_{1 \leq i \leq k, 1 \leq j \leq n} \\ &= \left( \sum_{i=1}^m b_{li} a_{ij} \right)_{1 \leq j \leq k, 1 \leq l \leq n} \\ &= B^T A^T \end{aligned} \quad (31)$$

□

## Motivation für Begriff der Inversen einer quadratischen Matrix

- Es seien  $A \in \mathbb{R}^{n \times n}$ ,  $x \in \mathbb{R}^n$  und  $b \in \mathbb{R}^n$ ,  $A$  und  $b$  seien als bekannt vorausgesetzt,  $x$  sei unbekannt.
- Zum Beispiel sei  $A := \begin{pmatrix} 1 & 2 \\ 3 & 4 \end{pmatrix}$  und  $b := \begin{pmatrix} 5 \\ 11 \end{pmatrix}$
- In diesem Fall gilt  $Ax = b \Leftrightarrow \begin{pmatrix} 1 & 2 \\ 3 & 4 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} x_1 \\ x_2 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 5 \\ 11 \end{pmatrix} \Leftrightarrow \begin{array}{l} 1x_1 + 2x_2 = 5 \\ 3x_1 + 4x_2 = 11 \end{array}$
- Wir haben also ein *lineares Gleichungssystem (LGS)* mit zwei Gleichungen und zwei Unbekannten.
- Wir stellen uns vor, dass wissen möchten, für welche(s)  $x$  das LGS erfüllt ist.
- Wären  $A = a \in \mathbb{R}$ ,  $x \in \mathbb{R}$  und  $b \in \mathbb{R}$ , also  $ax = b$  gegeben so würden mit dem *multiplikativen Inversen* von  $a$  multiplizieren, also dem Wert, der mit  $a$  multipliziert 1 ergibt und durch  $a^{-1} = \frac{1}{a}$  gegeben ist.
- Dann würde nämlich gelten  $ax = b \Leftrightarrow a^{-1}ax = a^{-1}b \Leftrightarrow 1 \cdot x = a^{-1}b \Leftrightarrow x = \frac{b}{a}$
- Konkret etwa  $2x = 6 \Leftrightarrow 2^{-1}2x = 2^{-1}6 \Leftrightarrow \frac{1}{2}2x = \frac{1}{2}6 \Leftrightarrow x = 3$ .
- Analog möchte mit dem *multiplikativen Inversen*  $A^{-1}$  von  $A$  multiplizieren können, sodass " $A^{-1}A = 1$ ".
- Dann hätte man nämlich  $Ax = b \Leftrightarrow A^{-1}Ax = A^{-1}b \Leftrightarrow x = A^{-1}b$
- Die Idee des multiplikativen Inversen wird im folgenden als *Inverse einer quadratischen Matrix* formalisiert.

## Definition (Einheitsmatrix)

Die Matrix

$$I_n := (a_{ij})_{1 \leq i \leq n, 1 \leq j \leq n} \in \mathbb{R}^{n \times n} := \begin{pmatrix} 1 & 0 & \cdots & 0 \\ 0 & 1 & \cdots & 0 \\ \vdots & \vdots & \ddots & \vdots \\ 0 & 0 & \cdots & 1 \end{pmatrix} \quad (32)$$

mit  $a_{ij} = 1$  für  $i = j$  und  $a_{ij} = 0$  für  $i \neq j$  heißt *n-dimensionale Einheitsmatrix*.

- $I_n$  wird in R mit dem Befehl `diag(n)` erzeugt.

## Theorem (Neutrales Element der Matrixmultiplikation)

$I_n$  ist das neutrale Element der Matrixmultiplikation, d.h. es gilt für  $A \in \mathbb{R}^{n \times m}$ , dass

$$I_n A = A \text{ und } A I_m = A. \quad (33)$$

### Beweis

Es sei  $B = (b_{ij}) = I_n A \in \mathbb{R}^{n \times m}$ . Dann gilt für alle  $1 \leq i \leq n$  und alle  $1 \leq j \leq m$

$$d_{ij} = 0 \cdot a_{1j} + 0 \cdot a_{2j} + \cdots + 0 \cdot a_{i-1,j} + 1 \cdot a_{ij} + \cdots + 0 \cdot a_{i+1,j} + 0 \cdot a_{nj} = a_{ij} \quad (34)$$

und analog für  $A I_m$ . □

## Definition (Invertierbare Matrix und inverse Matrix)

Eine quadratische Matrix  $A \in \mathbb{R}^{n \times n}$  heißt *invertierbar*, wenn es eine quadratische Matrix  $A^{-1} \in \mathbb{R}^{n \times n}$  gibt, so dass

$$A^{-1}A = AA^{-1} = I_n \quad (35)$$

ist. Die Matrix  $A^{-1}$  heißt die *inverse Matrix von A*.

### Bemerkungen

- Invertierbarkeit und inverse Matrizen beziehen sich nur auf quadratische Matrizen.
- Inverse Matrizen heißen auch einfach *Inverse*.
- Quadratische Matrizen können, müssen aber nicht invertierbar sein.
- Nicht invertierbare Matrizen nennt man *singuläre* Matrizen
- Für  $A = a \in \mathbb{R}^{1 \times 1}$  gilt  $A^{-1} = \frac{1}{a}$ .
- Die Definition sagt nur aus, was eine inverse Matrix ist, nicht wie man sie berechnet.

## Beispiel für eine invertierbare Matrix

Die Matrix  $A = \begin{pmatrix} 2.0 & 1.0 \\ 3.0 & 4.0 \end{pmatrix}$  ist invertierbar mit inverser Matrix  $A^{-1} = \begin{pmatrix} 0.8 & -0.2 \\ -0.6 & 0.4 \end{pmatrix}$ , denn

$$\begin{pmatrix} 2.0 & 1.0 \\ 3.0 & 4.0 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} 0.8 & -0.2 \\ -0.6 & 0.4 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 1 & 0 \\ 0 & 1 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 0.8 & -0.2 \\ -0.6 & 0.4 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} 2.0 & 1.0 \\ 3.0 & 4.0 \end{pmatrix}, \quad (36)$$

wovon man sich durch Nachrechnen überzeugt.

## Beispiel für eine nicht-invertierbare Matrix

Die Matrix  $B = \begin{pmatrix} 1 & 0 \\ 0 & 0 \end{pmatrix}$  ist nicht invertierbar, denn wäre  $B$  invertierbar, dann gäbe es  $\begin{pmatrix} a & b \\ c & d \end{pmatrix}$  mit

$$\begin{pmatrix} 1 & 0 \\ 0 & 0 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} a & b \\ c & d \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} a & b \\ 0 & 0 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 1 & 0 \\ 0 & 1 \end{pmatrix} \quad (37)$$

Das würde aber bedeuten, dass  $0 = 1$  in  $\mathbb{R}$  und das ist ein Widerspruch. Also kann  $B$  nicht invertierbar sein.

## Berechnen inverser Matrizen

- $2 \times 2$  bis etwa  $5 \times 5$  Matrizen kann man prinzipiell per Hand invertieren.
- Dazu lernt man im BSc Mathematik verschiedene Verfahren.
- Wir verzichten auf eine Einführung in die Matrizeninvertierung per Hand.
- Ein kurzes (30 min) Erklärvideo findet sich hier.
- In der Anwendung werden Matrizen standardmäßig numerisch invertiert.
- Matrixinversion ist ein weites Feld in der numerischen Mathematik.
- Es gibt sehr viele Algorithmen zur Invertierung invertierbarer Matrizen.
- Elegant berechnet man inverse Matrizen in R zum Beispiel mit dem Paket `matlib`.

## Berechnen inverser Matrizen

```
# Definition  
A = matrix(c(2,1,  
            3,4),  
          nrow = 2,  
          byrow = TRUE)
```

```
# Berechnen von A^{-1}  
solve(A)
```

```
>      [,1] [,2]  
> [1,]  0.8 -0.2  
> [2,] -0.6  0.4
```

## Berechnen inverser Matrizen

```
print(solve(A) %*% A)
```

```
>      [,1] [,2]
> [1,]    1    0
> [2,]    0    1
```

```
print(A %*% solve(A))
```

```
>      [,1]      [,2]
> [1,]    1 -5.55e-17
> [2,]    0  1.00e+00
```

```
# Nicht-invertierbare Matrizen sind auch numerisch nicht-invertierbar (singular)
```

```
B = matrix(c(1,0,
             0,0),
           nrow = 2,
           byrow = 2)
solve(B)
```

```
> Error in solve.default(B): Lapackroutine dgesv: System ist genau singular: U[2,2] = 0
```

---

Definition

Operationen

**Determinanten**

Rang

Spezielle Matrizen

Selbstkontrollfragen

## Definition (Determinante)

Für  $A = (a_{ij})_{1 \leq i, j \leq n} \in \mathbb{R}^{n \times n}$  mit  $n > 1$  sei  $A_{ij} \in \mathbb{R}^{n-1 \times n-1}$  die Matrix, die aus  $A$  durch Entfernen der  $i$ ten Zeile und der  $j$ ten Spalte entsteht. Dann heißt die Zahl

$$|A| := a_{11} \quad \text{für } n = 1 \quad (38)$$

$$|A| := \sum_{j=1}^n a_{1j} (-1)^{1+j} |A_{1j}| \quad \text{für } n > 1 \quad (39)$$

die *Determinante* von  $A$ .

### Bemerkungen

- Für

$$A := \begin{pmatrix} 1 & 2 & 3 \\ 4 & 5 & 6 \\ 7 & 8 & 9 \end{pmatrix} \quad (40)$$

ergeben sich zum Beispiel

$$A_{11} = \begin{pmatrix} 5 & 6 \\ 8 & 9 \end{pmatrix}, A_{12} = \begin{pmatrix} 4 & 6 \\ 7 & 9 \end{pmatrix}, A_{21} = \begin{pmatrix} 2 & 3 \\ 8 & 9 \end{pmatrix}, A_{22} = \begin{pmatrix} 1 & 3 \\ 7 & 9 \end{pmatrix} \quad (41)$$

- Determinanten sind nichtlineare Abbildungen der Form  $|\cdot| : \mathbb{R}^{n \times n} \rightarrow \mathbb{R}, A \mapsto |A|$

## Theorem (Determinanten von $2 \times 2$ und $3 \times 3$ Matrizen)

(1) Es sei  $A = (a_{ij})_{1 \leq i, j \leq 2} \in \mathbb{R}^{2 \times 2}$ . Dann gilt

$$|A| = a_{11}a_{22} - a_{12}a_{21}. \quad (42)$$

(2) Es sei  $A = (a_{ij})_{1 \leq i, j \leq 3} \in \mathbb{R}^{3 \times 3}$ . Dann gilt

$$|A| = a_{11}a_{22}a_{33} + a_{12}a_{23}a_{31} + a_{13}a_{21}a_{32} - a_{12}a_{21}a_{33} - a_{11}a_{23}a_{32} - a_{13}a_{22}a_{31}. \quad (43)$$

### Bemerkungen

- Für  $2 \times 2$  und  $3 \times 3$  Matrizen (und nur für diese) gilt die *Sarrusche Merkregel*  
"Summe der Produkte auf den Diagonalen minus Summe der Produkte auf den Gegendiagonalen"
- Bei  $3 \times 3$  Matrizen bezieht sich die Merkregel auf das Schema

$$\left( \begin{array}{ccc|cc} a_{11} & a_{12} & a_{13} & a_{11} & a_{12} \\ a_{21} & a_{22} & a_{23} & a_{21} & a_{22} \\ a_{31} & a_{32} & a_{33} & a_{31} & a_{32} \end{array} \right) \quad (44)$$

# Determinanten

## Beweis

Für  $A \in \mathbb{R}^{2 \times 2}$  gilt nach Definition

$$\begin{aligned} |A| &= \sum_{j=1}^n a_{1j} (-1)^{1+j} |A_{1j}| \\ &= a_{11} (-1)^{1+1} |A_{11}| + a_{12} (-1)^{1+2} |A_{12}| \\ &= a_{11} |a_{22}| - a_{12} |a_{21}| \\ &= a_{11} a_{22} - a_{12} a_{21}. \end{aligned} \tag{45}$$

Für  $A \in \mathbb{R}^{3 \times 3}$  gilt nach Definition und mit der Formel für Determinanten von  $2 \times 2$  Matrizen

$$\begin{aligned} |A| &= \sum_{j=1}^n a_{1j} (-1)^{1+j} |A_{1j}| \\ &= a_{11} (-1)^{1+1} |A_{11}| + a_{12} (-1)^{1+2} |A_{12}| + a_{13} (-1)^{1+3} |A_{13}| \\ &= a_{11} |A_{11}| - a_{12} |A_{12}| + a_{13} |A_{13}| \\ &= a_{11} \begin{vmatrix} a_{22} & a_{23} \\ a_{32} & a_{33} \end{vmatrix} - a_{12} \begin{vmatrix} a_{21} & a_{23} \\ a_{31} & a_{33} \end{vmatrix} + a_{13} \begin{vmatrix} a_{21} & a_{22} \\ a_{31} & a_{32} \end{vmatrix} \\ &= a_{11} (a_{22} a_{33} - a_{23} a_{32}) - a_{12} (a_{21} a_{33} - a_{23} a_{31}) + a_{13} (a_{21} a_{32} - a_{22} a_{31}) \\ &= a_{11} a_{22} a_{33} - a_{11} a_{23} a_{32} - a_{12} a_{21} a_{33} + a_{12} a_{23} a_{31} + a_{13} a_{21} a_{32} - a_{13} a_{22} a_{31} \\ &= a_{11} a_{22} a_{33} + a_{12} a_{23} a_{31} + a_{13} a_{21} a_{32} - a_{12} a_{21} a_{33} - a_{11} a_{23} a_{32} - a_{13} a_{22} a_{31}. \end{aligned} \tag{46}$$

# Determinanten

---

## Beispiel 1

Es seien

$$A := \begin{pmatrix} 2 & 1 \\ 3 & 4 \end{pmatrix} \text{ und } B := \begin{pmatrix} 1 & 0 \\ 0 & 0 \end{pmatrix} \quad (47)$$

Dann ergeben sich

$$|A| = 2 \cdot 4 - 1 \cdot 3 = 8 - 3 = 5. \quad (48)$$

und

$$|B| = 1 \cdot 0 - 0 \cdot 0 = 0 - 0 = 0. \quad (49)$$

## Beispiel 2 Es sei

$$C := \begin{pmatrix} 2 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 3 \end{pmatrix} \quad (50)$$

Dann ergibt sich

$$|C| = 2 \cdot 1 \cdot 3 + 0 \cdot 0 \cdot 0 + 0 \cdot 0 \cdot 0 - 0 \cdot 0 \cdot 3 - 0 \cdot 0 \cdot 0 - 0 \cdot 1 \cdot 0 = 2 \cdot 1 \cdot 3 = 6 \quad (51)$$

# Determinanten

```
# Beispiel 1  
A = matrix(c(2,1,          # Matrixdefinition  
            3,4),  
           nrow = 2,  
           byrow = TRUE)  
  
det(A)          # Determinantenberechnung
```

```
> [1] 5  
B = matrix(c(1,0,          # Matrixdefinition  
            0,0),  
           nrow = 2,  
           byrow = TRUE)  
  
det(B)          # Determinantenberechnung
```

```
> [1] 0  
# Beispiel 2  
C = matrix(c(2,0,0,          # Matrixdefinition  
            0,1,0,  
            0,0,3),  
           nrow = 3,  
           byrow = TRUE)  
  
det(C)          # Determinantenberechnung
```

```
> [1] 6
```

## Theorem (Rechenregeln für Determinanten)

(Determinantenmultiplikationssatz.) Für  $A, B \in \mathbb{R}^{n \times n}$  gilt

$$|AB| = |A||B|. \quad (52)$$

(Transposition.) Für  $A \in \mathbb{R}^{n \times n}$  gilt

$$|A| = |A^T|. \quad (53)$$

(Inversion.) Für eine invertierbare Matrix  $A \in \mathbb{R}^{n \times n}$  gilt

$$|A^{-1}| = \frac{1}{|A|} \quad (54)$$

(Dreiecksmatrizen.) Für Matrizen  $A = (a_{ij})_{1 \leq i, j \leq n} \in \mathbb{R}^{n \times n}$  mit  $a_{ij} = 0$  für  $i > j$  oder  $a_{ij} = 0$  für  $j > i$  gilt

$$|A| = \prod_{i=1}^n a_{ii} \quad (55)$$

### Bemerkungen

- Wir verzichten auf einen Beweis.
- Bei Dreiecksmatrizen sind alle Elemente unterhalb ( $i > j$ ) oder oberhalb ( $j > i$ ) der Diagonalen 0
- Bei  $I_n$  sind alle nicht-diagonalen Elemente 0 und alle diagonalen Elemente 1, also folgt  $|I_n| = 1$ .

## Theorem (Invertierbarkeit und Determinante)

$A \in \mathbb{R}^{n \times n}$  ist dann und nur dann invertierbar, wenn gilt, dass  $|A| \neq 0$ . Es gilt also

$$A \text{ ist invertierbar} \Leftrightarrow |A| \neq 0 \text{ und } A \text{ ist nicht invertierbar} \Leftrightarrow |A| = 0. \quad (56)$$

### Beweisandeutung

Wir zeigen lediglich, dass aus der Invertierbarkeit von  $A$  folgt, dass  $|A|$  nicht null sein kann. Nehmen wir also an, dass  $A$  invertierbar ist. Dann gibt es eine Matrix  $B$  mit  $AB = I_n$  und mit dem Determinantenmultiplikationssatz folgt

$$|AB| = |A||B| = |I_n| = 1. \quad (57)$$

Also kann  $|A| = 0$  nicht gelten, denn sonst wäre  $0 = 1$ .

□

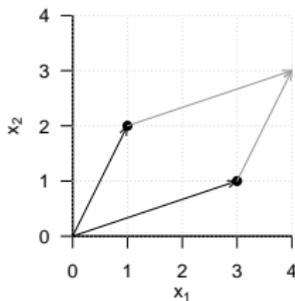
# Determinanten

## Visuelle Intuition

$a_1, \dots, a_n \in \mathbb{R}^n$  seien die Spalten von  $A \in \mathbb{R}^{n \times n}$ .

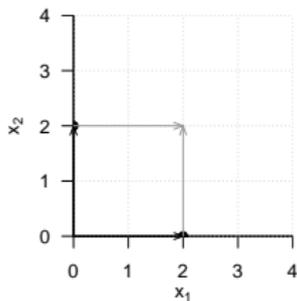
$\Rightarrow |A|$  entspricht dem signierten Volumen des von  $a_1, \dots, a_n \in \mathbb{R}^n$  aufgespannten Parallelotops.

$$A_1 = \begin{pmatrix} 3 & 1 \\ 1 & 2 \end{pmatrix}$$



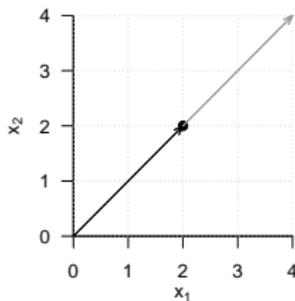
$$|A_1| = 3 \cdot 2 - 1 \cdot 1 = 5$$

$$A_2 = \begin{pmatrix} 2 & 0 \\ 0 & 2 \end{pmatrix}$$



$$|A_2| = 2 \cdot 2 - 0 \cdot 0 = 4$$

$$A_3 = \begin{pmatrix} 2 & 2 \\ 2 & 2 \end{pmatrix}$$



$$|A_3| = 2 \cdot 2 - 2 \cdot 2 = 0$$

---

Definition

Operationen

Determinanten

**Rang**

Spezielle Matrizen

Selbstkontrollfragen

## Überblick

- Der Rang einer Matrix ist eine Zahl an der bestimmte Eigenschaften der Matrix abgelesen werden können.
- In dieser Hinsicht ist der Rang einer Matrix sehr ähnlich zur Determinante einer Matrix.
- Viele Resultate in der linearen Algebra beruhen auf Annahmen über den Rang einer Matrix.
- Wir werden z.B. durchgängig annehmen, dass die Designmatrix des ALMs *vollen Spaltenrang* hat.
- Der Rang einer Matrix ist ein tiefgehendes Konzept, das wir hier nur oberflächlich behandeln können.
- Für ausführlichere Einführungen, siehe z.B. Searle (1982), Chapter 6 und Strang (2009), Kapitel Chapter 3.2.

## Definition (Spaltenraum einer Matrix)

$X \in \mathbb{R}^{n \times p}$  sei eine Matrix mit  $n > p$  und es seien  $x_1, \dots, x_p \in \mathbb{R}^n$  die Spalten von  $X$ . Dann wird die lineare Hülle der  $x_1, \dots, x_p \in \mathbb{R}^n$  *Spaltenraum von  $X \in \mathbb{R}^{n \times p}$*  genannt und mit  $\mathcal{S}(X)$  bezeichnet. Insbesondere gilt

$$\mathcal{S}(X) = \left\{ X\beta \in \mathbb{R}^n \mid \beta \in \mathbb{R}^p \right\}. \quad (58)$$

## Bemerkungen

- Ohne Beweis halten wir fest, dass  $\mathcal{S}(X)$  ein Untervektorraum von  $\mathbb{R}^n$  ist.
- Die lineare Hülle der  $x_1, \dots, x_p \in \mathbb{R}^n$  ist die Menge aller Linearkombinationen  $x_1, \dots, x_p \in \mathbb{R}^n$ .
- Die Menge aller Linearkombinationen der  $x_1, \dots, x_p \in \mathbb{R}^n$  hat die Form

$$\left\{ \sum_{i=1}^p \beta_i x_i \mid x_i \in \mathbb{R}^n, \beta_i \in \mathbb{R} \right\}. \quad (59)$$

- Die Form des Spaltenraums in der obigen Definition ergibt sich für  $x_{ij} \in \mathbb{R}$ ,  $1 \leq i \leq n$ ,  $1 \leq j \leq p$  durch

$$X\beta = \begin{pmatrix} \sum_{j=1}^p x_{1j}\beta_j \\ \vdots \\ \sum_{j=1}^p x_{nj}\beta_j \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} \sum_{j=1}^p \beta_j x_{1j} \\ \vdots \\ \sum_{j=1}^p \beta_j x_{nj} \end{pmatrix} = \beta_1 \begin{pmatrix} x_{11} \\ \vdots \\ x_{n1} \end{pmatrix} + \dots + \beta_p \begin{pmatrix} x_{1p} \\ \vdots \\ x_{np} \end{pmatrix} = \sum_{i=1}^p \beta_i x_i.$$

## Definition (Rang einer Matrix)

$X \in \mathbb{R}^{n \times p}$  sei eine Matrix. Dann wird die Dimension des Spaltenraums von  $X$  der *Rang von  $X$*  genannt und mit  $\text{rg}(X)$  bezeichnet. Gilt dabei  $\text{rg}(X) = p$ , so sagt man, dass  $X$  *vollen Spaltenrang hat*.

### Bemerkungen

- Ohne Beweis halten wir untenstehend einige wichtige Eigenschaften des Rangs einer Matrix fest.
- Der Rang einer Matrix entspricht der Anzahl der linear unabhängigen Spaltenvektoren der Matrix.
- Es gilt  $\text{rg}(X) = \text{rg}(X^T)$ .
- Für  $A \in \mathbb{R}^{p \times p}$  gilt  $\text{rg}(A) = p \Leftrightarrow A$  ist invertierbar.
- Für  $X \in \mathbb{R}^{n \times p}$  gilt  $\text{rg}(X) = \text{rg}(X^T X) = \text{rg}(X X^T)$ .
- Für  $X \in \mathbb{R}^{n \times p}$  gilt damit  $\text{rg}(X) = p \Leftrightarrow X^T X \in \mathbb{R}^{p \times p}$  ist invertierbar.
- Die Funktion `Rank()` aus dem R `pracma` Paket erlaubt die Berechnung des Rangs einer Matrix.
- Das Spaltenraum- und Rangkonzept einer Matrix erlauben einen geometrischen Zugang zur Theorie des ALMs.
- Wir verfolgen diesen geometrischen Zugang hier nicht, für Details siehe z.B. Christensen (2011).

---

Definition

Operationen

Determinanten

Rang

**Spezielle Matrizen**

Selbstkontrollfragen

## Definition (Einheitsmatrizen und Einheitsvektoren)

- Wir bezeichnen die *Einheitsmatrix* mit

$$I_n := (i_{jk})_{1 \leq j \leq n, 1 \leq k \leq n} \in \mathbb{R}^{n \times n} \text{ mit } i_{jk} = 1 \text{ f\"ur } j = k \text{ und } i_{jk} = 0 \text{ f\"ur } j \neq k. \quad (60)$$

- Wir bezeichnen die *Einheitsvektoren*  $e_i, i = 1, \dots, n$  mit

$$e_i := (e_{ij})_{1 \leq j \leq n} \in \mathbb{R}^n \text{ mit } e_{ij} = 1 \text{ f\"ur } i = j \text{ und } e_{ij} = 0 \text{ f\"ur } i \neq j. \quad (61)$$

### Bemerkungen

- $I_n$  besteht nur aus Nullen und Diagonalelementen gleich Eins.
- $e_i, i = 1, \dots, n$  besteht nur aus Nullen und einer Eins in der  $i$ ten Komponente.
- Es gilt

$$I_n = \begin{pmatrix} e_1 & \cdots & e_n \end{pmatrix} \quad (62)$$

- Es gelten weiterhin zum Beispiel für  $1 \leq i, j \leq n$

$$e_i^T e_j = 0 \text{ f\"ur } i \neq j, e_i^T e_i = 1 \text{ und } e_i^T v = v^T e_i = v_i \text{ f\"ur } v \in \mathbb{R}^n. \quad (63)$$

## Definition (Nullmatrizen, Einmatrizen)

- Wir bezeichnen *Nullmatrizen* mit

$$0_{nm} := (0)_{1 \leq i \leq m, 1 \leq j \leq n} \in \mathbb{R}^{n \times m} \text{ und } 0_n := (0)_{1 \leq i \leq n} \in \mathbb{R}^n \quad (64)$$

- Wir bezeichnen den *Einmatrizen* mit

$$1_{nm} := (1)_{1 \leq i \leq n, 1 \leq j \leq m} \in \mathbb{R}^{n \times m} \text{ und } 1_n := (1)_{1 \leq i \leq n} \in \mathbb{R}^n \quad (65)$$

### Bemerkungen

- $0_{nm}$  und  $0_n$  bestehen nur aus Nullen.
- $1_{nm}$  und  $1_n$  bestehen nur aus Nullen.
- Es gelten zum Beispiel

$$0_n 0_n^T = 0_{nn} \text{ und } 1_n 1_n^T = 1_{nn}. \quad (66)$$

## Definition (Diagonalmatrix)

Eine Matrix  $D \in \mathbb{R}^{n \times m}$  heißt *Diagonalmatrix*, wenn  $d_{ij} = 0$  für  $1 \leq i \leq n, 1 \leq j \leq m$  mit  $i \neq j$ .

### Bemerkungen

- Eine Diagonalmatrix  $D \in \mathbb{R}^{n \times n}$  mit Diagonalelementen  $d_1, \dots, d_n$  schreibt man auch als

$$D = \text{diag}(d_1, \dots, d_n). \quad (67)$$

- Diagonalmatrizen haben viele "gute" Eigenschaften.
- Zum Beispiel überzeugt man sich leicht davon, dass Multiplikation einer Matrix  $A$  von links mit einer Diagonalmatrix  $D$  der Multiplikation der Zeilen der Matrix  $A$  mit den entsprechenden Diagonaleinträgen von  $D$  entspricht. Die entsprechende Multiplikation von rechts entspricht der Multiplikation der Spalten von  $A$  mit entsprechenden Diagonaleinträgen von  $D$ .
- Eine weitere wichtige Eigenschaft ist

$$D := \text{diag}(d_1, \dots, d_n) \Rightarrow |D| = \prod_{i=1}^n d_i \quad (68)$$

- Für Beweise dieser Eigenschaften wird auf die einschlägige Literatur, z.B. Searle (1982), verwiesen.

## Definition (Symmetrische Matrix)

Eine Matrix  $S \in \mathbb{R}^{n \times n}$  heißt *symmetrisch*, wenn gilt dass  $S^T = S$ .

### Bemerkungen

- Symmetrische Matrizen haben viele "gute" Eigenschaften.
- Beispielweise gilt für die Summe zweier symmetrischer Matrizen, dass auch diese wieder symmetrisch ist

$$A = A^T \text{ und } B = B^T \Rightarrow A + B = (A + B)^T \quad (69)$$

und das die Inverse einer symmetrischen Matrix, sofern sie existiert, auch symmetrisch ist,

$$S^T = S \Rightarrow (S^{-1})^T = S^{-1}. \quad (70)$$

- Für Beweise dieser Eigenschaften wird auf die einschlägige Literatur, z.B. Searle (1982), verwiesen.

## Definition (Positiv-definite Matrix)

Eine quadratische Matrix  $C \in \mathbb{R}^{n \times n}$  heißt positiv-definit (p.d.), wenn

- $C$  eine symmetrische Matrix ist und
- für alle  $x \in \mathbb{R}^n$ ,  $x \neq 0_n$  gilt, dass  $x^T C x > 0$  ist.

### Bemerkungen

- Positiv-definite Matrizen sind für die Definition der multivariaten Normalverteilungen grundlegend.
- Positiv-definite Matrizen haben viele "gute" Eigenschaften
- Beispielsweise gilt

$$C \text{ ist positiv-definit} \Rightarrow C^{-1} \text{ existiert und ist ebenfalls positiv-definit.} \quad (71)$$

- Für Beweise dieser Eigenschaften wird auf die einschlägige Literatur, z.B. Searle (1982), verwiesen.

---

Definition

Operationen

Determinanten

Rang

Spezielle Matrizen

**Selbstkontrollfragen**

# Selbstkontrollfragen

1. Geben Sie die Definition einer Matrix wieder.
2. Nennen Sie sechs Matrixoperationen.
3. Geben Sie die Definitionen der Matrixaddition und -subtraktion wieder.
4. Geben Sie die Definition der Skalarmultiplikation für Matrizen wieder.
5. Geben Sie die Definition der Matrixtransposition wieder.

6. Es seien

$$A := \begin{pmatrix} 1 & 2 \\ 2 & 1 \end{pmatrix}, B := \begin{pmatrix} 3 & 0 \\ 1 & 2 \end{pmatrix}, \text{ und } c := 2 \quad (72)$$

Berechnen Sie

$$D := c(A - B^T) \text{ und } E := (cA)^T + B. \quad (73)$$

per Hand.

7. Geben Sie die Definition der Matrixmultiplikation wieder.
8. Es seien  $A \in \mathbb{R}^{3 \times 2}$ ,  $B \in \mathbb{R}^{2 \times 4}$  und  $C \in \mathbb{R}^{3 \times 4}$ . Prüfen Sie, ob folgende Matrixprodukte definiert sind, und wenn ja, geben Sie die Größe der resultierenden Matrix an:

$$ABC, \quad ABC^T, \quad A^T C B^T, \quad BAC. \quad (74)$$

9. Es seien

$$A := \begin{pmatrix} 1 & 2 & 3 \\ 4 & 5 & 6 \\ 3 & 2 & 0 \end{pmatrix} \quad B := \begin{pmatrix} 1 & 2 & 2 \\ 1 & 3 & 1 \\ 2 & 0 & 0 \end{pmatrix} \quad \text{und} \quad C := \begin{pmatrix} 1 \\ 3 \\ 2 \end{pmatrix}. \quad (75)$$

Berechnen Sie die Matrixprodukte

$$AB, \quad B^T A^T, \quad \left(B^T A^T\right)^T, \quad AC \quad (76)$$

per Hand.

- Definieren Sie die Begriffe der invertierbaren Matrix und der inversen Matrix.
- Geben Sie die Definition von Einheitsmatrix und Einheitsvektoren wieder.
- Geben Sie die Definition von Einmatrizen und Nullmatrizen wieder.
- Geben Sie die Definition einer symmetrischen Matrix wieder.
- Geben Sie die Definition einer Diagonalmatrix wieder.
- Geben Sie die Definition einer positiv-definiten Matrix wieder.

- Christensen, Ronald. 2011. *Plane Answers to Complex Questions*. Springer Texts in Statistics. New York, NY: Springer New York. <https://doi.org/10.1007/978-1-4419-9816-3>.
- Searle, Shayle. 1982. *Matrix Algebra Useful for Statistics*. Wiley-Interscience.
- Strang, Gilbert. 2009. *Introduction to Linear Algebra*.