



Multivariate Verfahren

MSc Psychologie | MSc Klinische Psychologie und Psychotherapie

WiSe 2023/24

Prof. Dr. Dirk Ostwald

(1) Matrizen

Motivation

Matrizen sind die Worte der Sprache der multivariaten Datenanalyse.

Vektoren sind 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 multivariater Verfahren unverzichtbar.

Definition

Operationen

Determinanten

Spur

Spezielle Matrizen

Selbstkontrollfragen

Definition

Operationen

Determinanten

Spur

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

Spur

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 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

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

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

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

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.

Operationen

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

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

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

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

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)

Es ergibt sich zum anderen

$$D = BA$$

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

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

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

Dann gilt

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

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

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

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 $1 \leq j \leq m$

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

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.

Operationen

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

- 2×2 bis etwa 5×5 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.
- In **R** berechnet man inverse Matrizen für gewöhnlich mit `solve`.

Definition

Operationen

Determinanten

Spur

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

$$\begin{pmatrix} a_{11} & a_{12} & a_{13} & | & a_{11} & a_{12} \\ a_{21} & a_{22} & a_{23} & | & a_{21} & a_{22} \\ a_{31} & a_{32} & a_{33} & | & a_{31} & a_{32} \end{pmatrix} \quad (44)$$

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 2×2 Matrizen

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

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

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

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

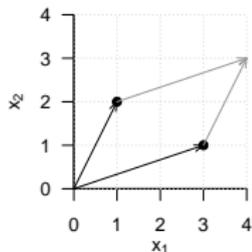
$a_1, \dots, a_n \in \mathbb{R}^n$ seien die Spalten von $A \in \mathbb{R}^{n \times n}$.

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

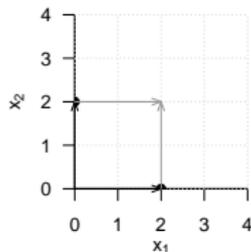
$$A_1 = \begin{pmatrix} 3 & 1 \\ 1 & 2 \end{pmatrix}$$

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

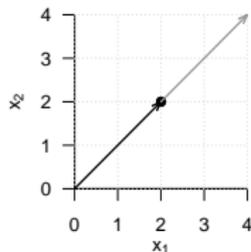
$$A_3 = \begin{pmatrix} 2 & 2 \\ 2 & 2 \end{pmatrix}$$



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



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



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

Definition

Operationen

Determinanten

Spur

Spezielle Matrizen

Selbstkontrollfragen

Definition (Spur)

Sei eine quadratische Matrix. Dann ist die *Spur von A* definiert als die Zahl

$$\operatorname{tr}(A) = \sum_{i=1}^n a_{ii}. \quad (58)$$

Bemerkungen

- Die Spur einer quadratischen Matrix ist die Summe ihrer Diagonalelemente.
- tr ist die Abkürzung für *trace*.

Beispiel

Es sei

$$A := \begin{pmatrix} 3 & 2 & 1 \\ 8 & 1 & 7 \\ 4 & 5 & 2 \end{pmatrix} \quad (59)$$

Dann gilt

$$\operatorname{tr}(A) = 3 + 1 + 2 = 6. \quad (60)$$

Theorem (Eigenschaften der Spur)

(1) (Invarianz bei Transposition) Es sei $A \in \mathbb{R}^{n \times n}$. Dann gilt

$$\operatorname{tr}(A^T) = \operatorname{tr}(A) \quad (61)$$

(2) (Linearität) Es seien $A, B \in \mathbb{R}^{n \times n}$, $c, d \in \mathbb{R}$. Dann gilt

$$\operatorname{tr}(cA + dB) = c \operatorname{tr}(A) + d \operatorname{tr}(B) \quad (62)$$

(3) (Reihenfolgeninvarianz) Es sei $A \in \mathbb{R}^{n \times m}$ und $B \in \mathbb{R}^{m \times n}$. Dann gilt

$$\operatorname{tr}(AB) = \operatorname{tr}(BA). \quad (63)$$

(4) (Zyklische Permutationsinvarianz) Es seien $A, B, C \in \mathbb{R}^{n \times n}$. Dann gilt

$$\operatorname{tr}(ABC) = \operatorname{tr}(CAB) = \operatorname{tr}(BCA). \quad (64)$$

Bemerkung

- Eigenschaft (4) kann auf beliebig viele und multiplikationskonforme Matrizen erweitert werden.

Spur

Beweis

(1) Da die Diagonalelemente von A^T und A identisch sind, sind auch ihre Summen identisch.

(2) Es gilt

$$\operatorname{tr}(cA + dB) = \sum_{i=1}^n ca_{ii} + db_{ii} = c \sum_{i=1}^n a_{ii} + d \sum_{i=1}^n b_{ii} = c \operatorname{tr}(A) + d \operatorname{tr}(B). \quad (65)$$

(3) Wir halten zunächst fest, dass nach Definition der Matrixmultiplikation, die Diagonalelemente von $AB \in \mathbb{R}^{n \times n}$ gegeben sind durch

$$(AB)_{ii} = \sum_{j=1}^m a_{ij} b_{ji} \quad \text{für } i = 1, \dots, n. \quad (66)$$

und die Diagonalelemente von $BA \in \mathbb{R}^{m \times m}$ gegeben sind durch

$$(BA)_{jj} = \sum_{i=1}^n b_{ji} a_{ij} \quad \text{für } j = 1, \dots, m. \quad (67)$$

Dann aber gilt mit den Eigenschaften von Summen und der Kommutativität der Skalarmultiplikation

$$\operatorname{tr}(AB) = \sum_{i=1}^n \sum_{j=1}^m a_{ij} b_{ji} = \sum_{j=1}^m \sum_{i=1}^n b_{ji} a_{ij} = \operatorname{tr}(BA). \quad (68)$$

(4) Mit der Assoziativität der Matrixmultiplikation und Eigenschaft (4) gelten

$$\operatorname{tr}(ABC) = \operatorname{tr}((AB)C) = \operatorname{tr}(C(AB)) = \operatorname{tr}(CAB) = \operatorname{tr}((CA)B) = \operatorname{tr}(B(CA)) = \operatorname{tr}(BCA). \quad (69)$$

Definition

Operationen

Spur

Determinanten

Spezielle Matrizen

Selbstkontrollfragen

Definition (Einheitsmatrizen und Einheitsvektoren)

- Wir bezeichnen die *Einheitsmatrix* mit

$$I_n := (i_{jk})_{1 \leq i \leq n, 1 \leq j \leq n} \in \mathbb{R}^{n \times n} \text{ mit } i_{jk} = 1 \text{ f\"ur } j = k \text{ und } i_{jk} = 0 \text{ f\"ur } j \neq k \quad (70)$$

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

$$e_i := (e_{ij})_{1 \leq j \leq n} \in \mathbb{R}^n \text{ mit } e_{ij} = 1 \text{ f\"ur } i = j \text{ und } e_{ij} = 0 \text{ f\"ur } i \neq j \quad (71)$$

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

$$I_n = (e_1 \quad \dots \quad e_n) \quad (72)$$

- Es gelten weiterhin zum Beispiel f\"ur $1 \leq i, j \leq n$

$$e_i^T e_j = 0 \text{ f\"ur } i \neq j, e_i^T e_i = 1 \text{ und } e_i^T v = v^T e_i = v_i \text{ f\"ur } v \in \mathbb{R}^n. \quad (73)$$

Definition (Nullmatrizen, Einmatrizen)

- Wir bezeichnen *Nullmatrizen* mit

$$0_{nm} := (0)_{1 \leq i \leq n, 1 \leq j \leq m} \in \mathbb{R}^{n \times m} \text{ und } 0_n := (0)_{1 \leq i \leq n} \in \mathbb{R}^n \quad (74)$$

- Wir bezeichnen den *Einmatrizen* mit

$$1_{nm} := (1)_{1 \leq i \leq n, 1 \leq j \leq m} \in \mathbb{R}^{n \times m} \text{ und } 1_n := (1)_{1 \leq i \leq n} \in \mathbb{R}^n \quad (75)$$

Bemerkungen

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

$$0_n 0_n^T = 0_{nn} \text{ und } 1_n 1_n^T = 1_{nn}. \quad (76)$$

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

$$D = \text{diag}(d_1, \dots, d_n). \quad (77)$$

- 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

$$D := \text{diag}(d_1, \dots, d_n) \Rightarrow |D| = \prod_{i=1}^n d_i \quad (78)$$

- Für Beweise dieser Eigenschaften wird auf die weiterführende 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 sind spezielle quadratische Matrizen.
- Symmetrische Matrizen haben viele "gute" Eigenschaften.
- Beispielweise gilt für die Summe zweier symmetrischer Matrizen, dass auch diese wieder symmetrisch ist

$$A = A^T \text{ und } B = B^T \Rightarrow A + B = (A + B)^T \quad (79)$$

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

$$S^T = S \Rightarrow (S^{-1})^T = S^{-1}. \quad (80)$$

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

Definition (Positiv-definite Matrizen und positiv-semidefinite Matrizen)

Eine quadratische Matrix $C \in \mathbb{R}^{n \times n}$ heißt *positiv-definit*, wenn C symmetrisch ist und gilt, dass

$$x^T C x > 0 \text{ für alle } x \in \mathbb{R}^n \text{ mit } x \neq 0_n. \quad (81)$$

Wenn $C \in \mathbb{R}^{n \times n}$ positiv-definit ist, so schreiben wir $C \in \mathbb{R}^{n \times n}$ pd.

Eine quadratische Matrix $C \in \mathbb{R}^{n \times n}$ heißt *positiv-semidefinit*, wenn C symmetrisch ist und gilt, dass

$$x^T C x \geq 0 \text{ für alle } x \in \mathbb{R}^n \text{ mit } x \neq 0_n. \quad (82)$$

Wenn $C \in \mathbb{R}^{n \times n}$ positiv-definit ist, so schreiben wir $C \in \mathbb{R}^{n \times n}$ psd.

Bemerkungen

- Positive-definite und positiv-semidefinite Matrizen sind spezielle symmetrische Matrizen.
- Kovarianzmatrixparameter von multivariaten Normalverteilungen sind positiv definite Matrizen grundlegend.
- Kovarianzmatrizen von Zufallsvektoren sind positiv-semidefinite Matrizen.
- Positiv-definite Matrizen haben viele "gute" Eigenschaften.
- Beispielsweise existiert die Inverse C^{-1} einer positiv-definiten Matrix und ist selbst positiv-definit, für einen Beweis dieser Eigenschaft verweisen wir auf die weiterführende Literatur, z.B. Searle (1982).

Definition (Orthogonale Matrix)

Eine Matrix $Q \in \mathbb{R}^{n \times n}$ heißt *orthogonal*, wenn

$$Q^T Q = I_n. \quad (83)$$

Bemerkung

- Die Spalten einer orthogonalen Matrix sind also paarweise orthogonal, es gilt für

$$Q = (q_1 \quad \dots \quad q_n) \text{ mit } q_i \in \mathbb{R}^n \text{ für } 1 \leq i \leq n, \quad (84)$$

dass

$$q_i^T q_j = 0 \text{ für } i \neq j \text{ und } q_i^T q_j = 1 \text{ für } i = j \text{ mit } 1 \leq i, j \leq n. \quad (85)$$

Theorem (Eigenschaften orthogonaler Matrizen)

$Q \in \mathbb{R}^{n \times n}$ sei eine orthogonale Matrix. Dann gelten:

- (1) (Inverse) Die Inverse von Q ist Q^T , es gilt

$$Q^{-1} = Q^T. \quad (86)$$

- (2) (Transposition) Die Zeilen von Q sind orthonormal, es gilt

$$QQ^T = I_n. \quad (87)$$

- (3) (Determinante) Es gilt

$$|Q| = 1 \text{ oder } |Q| = -1. \quad (88)$$

Beweis

- (1) Unter der Annahme, dass Q^{-1} existiert, gilt

$$Q^T Q = I_n \Leftrightarrow Q^T Q Q^{-1} = I_n Q^{-1} \Leftrightarrow Q^{-1} = Q^T. \quad (89)$$

- (2) Es gilt

$$Q^T Q = I_n \Leftrightarrow Q Q^T Q = Q I_n \Leftrightarrow Q Q^T Q Q^T = Q Q^T \Leftrightarrow Q Q^T = I_n. \quad (90)$$

- (3) Mit dem Multiplikationssatz und Transpositionseigenschaft von Determinanten gilt

$$|Q|^2 = |Q||Q| = |Q||Q^T| = |QQ^T| = |I_n| = 1. \quad (91)$$

Aus $|Q|^2 = 1$ folgt dann aber, dass $|Q| = 1$ oder $|Q| = -1$ sein muss.

□

Definition

Operationen

Determinanten

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

$$A := \begin{pmatrix} 1 & 2 \\ 2 & 1 \end{pmatrix}, B := \begin{pmatrix} 3 & 0 \\ 1 & 2 \end{pmatrix} \text{ und } c := 2 \quad (92)$$

Berechnen Sie

$$D := c(A - B^T) \text{ und } E := (cA)^T + B. \quad (93)$$

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:

$$ABC, \quad ABC^T, \quad , A^T CB^T \quad , BAC. \quad (94)$$

9. Es seien

$$A := \begin{pmatrix} 1 & 2 & 3 \\ 4 & 5 & 6 \\ 3 & 2 & 0 \end{pmatrix} B := \begin{pmatrix} 1 & 2 & 2 \\ 1 & 3 & 1 \\ 2 & 0 & 0 \end{pmatrix} \text{ und } C := \begin{pmatrix} 1 \\ 3 \\ 2 \end{pmatrix}. \quad (95)$$

Berechnen Sie die Matrixprodukte

$$AB, \quad B^T A^T, \quad (B^T A^T)^T, \quad AC. \quad (96)$$

10. Geben Sie die Formel für die Determinante von $A := (A_{ij})_{1 \leq i, j \leq 2} \in \mathbb{R}^2$ wieder.

11. Geben Sie die Formel für die Determinante von $A := (A_{ij})_{1 \leq i, j \leq 3} \in \mathbb{R}^3$ wieder.

12. Berechnen Sie die Determinanten von

$$A := \begin{pmatrix} 2 & 1 \\ 1 & 2 \end{pmatrix} B := \begin{pmatrix} 3 & 2 & 1 \\ 2 & 3 & 2 \\ 1 & 2 & 3 \end{pmatrix} \text{ und } C := \text{diag}(1, 2, 3). \quad (97)$$

Selbstkontrollfragen

14. Geben Sie den Determinantenmultiplikationssatz wieder.
15. Geben Sie das Theorem zur Invertierbarkeit und Determinante von Matrizen wieder.
16. Geben Sie die Definition einer Diagonalmatrix wieder.
17. Geben Sie die Definition einer symmetrischen Matrix wieder.
18. Geben Sie die Definition einer positiv-definiten und einer positiv-semidefiniten Matrix wieder.
19. Geben Sie die Definition einer orthogonalen Matrix wieder.

Searle, Shayle. 1982. *Matrix Algebra Useful for Statistics*. Wiley-Interscience.