

2次形式

変数 x_1, x_2, \dots, x_n の斉次 2 次多項式

$$q(x_1, x_2, \dots, x_n) = \sum c_{ij} x_i x_j \quad (1.1)$$

は 2 次形式とよばれる。このノートでは、変数 x_j は実数を動くものとし、係数 c_{ij} もすべて実数の定数であるものとする。2 次形式 (1.1) は

$$q : \mathbf{x} = {}^t(x_1, x_2, \dots, x_n) \in \mathbb{R}^n \mapsto q(x_1, x_2, \dots, x_n) \in \mathbb{R}$$

というように、ベクトルにスカラーを対応させる写像とも解釈される。

● 2 変数の 2 次形式

(1.1) で述べたことを $n = 2$ の場合に適用すれば、2 変数 x, y の 2 次形式 $q = q(x, y)$ とは、定数 a, b, c により

$$q(x, y) = ax^2 + 2bxy + cy^2 \quad (1.2)$$

と表されるものといえる。(ただし $a = b = c = 0$ という場合は除く。) 2 次形式 (1.2) は

$$q(x, y) = \begin{pmatrix} x & y \end{pmatrix} \begin{pmatrix} a & b \\ b & c \end{pmatrix} \begin{pmatrix} x \\ y \end{pmatrix} \quad (1.3)$$

というように対称行列 $\begin{pmatrix} a & b \\ b & c \end{pmatrix}$ を用いて表すことができる。 $\mathbf{x} = \begin{pmatrix} x \\ y \end{pmatrix}$, $A = \begin{pmatrix} a & b \\ b & c \end{pmatrix}$ と置いてしまえば、簡潔に

$$q = {}^t \mathbf{x} A \mathbf{x} \quad (1.4)$$

と書ける。逆に、任意の対称行列 A が与えられたとき、(1.4) で 2 次形式を定めることができる。こうして、(2 変数の) 2 次形式と (2 次) 対称行列は 1 対 1 に対応する。

問 1. 次の 2 次形式を対称行列を用いて表せ。

$$(1) 3x^2 + 8xy + y^2 \quad (2) x^2 - y^2 \quad (3) -x^2 + xy + 2y^2 \quad (4) x^2 - 4xy$$

任意の対称行列 A はある直交行列 P により対角化されるという事実を思い出そう：

$${}^t P A P = \begin{pmatrix} \lambda_1 & 0 \\ 0 & \lambda_2 \end{pmatrix},$$

ここで λ_1, λ_2 は A の固有値であり、それらは実数である。(Web「対称行列の直交行列による対角化」の定理 3 を参照せよ。) ${}^t P$ を T と書きあらためれば、 T もまた直交行列であり

$$A = P \begin{pmatrix} \lambda_1 & 0 \\ 0 & \lambda_2 \end{pmatrix} {}^t P = {}^t T \begin{pmatrix} \lambda_1 & 0 \\ 0 & \lambda_2 \end{pmatrix} T$$

b に 2 倍を付けてあるのは、(1.3) 型に書き換えたときに都合がよいからである。

(2 変数の) 2 次形式を扱うことは、(2 次) 対称行列を扱うことと言ってよい。

直交行列 P に対しては、 $P^{-1} = {}^t P$ であることも思い出そう。

であるから、2次形式 $q = {}^t \mathbf{x} A \mathbf{x}$ は

$$q = {}^t \mathbf{x} {}^t T \begin{pmatrix} \lambda_1 & 0 \\ 0 & \lambda_2 \end{pmatrix} T \mathbf{x} = {}^t (T \mathbf{x}) \begin{pmatrix} \lambda_1 & 0 \\ 0 & \lambda_2 \end{pmatrix} T \mathbf{x}$$

と表せる。この内容を定理としてまとめておこう。

定理 2. 2次形式 $q = q(x, y)$ は、適当な変数の直交変換 $\mathbf{x}' = T \mathbf{x}$ により

$$q = \lambda_1 (x')^2 + \lambda_2 (y')^2 \quad (1.5)$$

と表せる。 $(\mathbf{x}' = {}^t(x' \ y').)$

(1.5) の形で表された2次形式 q を、標準形で表された2次形式とよぶ。

問 3. 適当な変数の直交変換を施すことにより、次の2次形式を標準形で表せ。

$$(1) 5x^2 + 4xy + 2y^2 \quad (2) x^2 - 6xy + y^2 \quad (3) x^2 + 6xy + 9y^2 \quad (4) 3x^2 + 4xy$$

● 2次曲線

$a_{11}, a_{12}, a_{22}, b_1, b_2, c$ を実定数とする。 $(a_{11} = a_{12} = a_{22} = 0$ という場合は除く。) 方程式

$$\Gamma : a_{11}x^2 + 2a_{12}xy + a_{22}y^2 + b_1x + b_2y + c = 0 \quad (1.6)$$

で表される xy 平面上の図形 Γ を、**2次曲線** (quadric curve) とよぶ。

注意 4. 定数 a_{ij}, b_i, c の値によっては、(1.6) の定める集合が空集合、1点、1本ないし2本の直線となってしまうこともあるが、このノートではそれらを2次曲線とはよばないこととする。

つまり、本ノートの意味する2次曲線は、いくつかの書物でよばれるところの「真の2次曲線」(proper quadric curve) である。

$$A = \begin{pmatrix} a_{11} & a_{12} \\ a_{12} & a_{22} \end{pmatrix}, \quad B = \begin{pmatrix} b_1 & b_2 \end{pmatrix}$$

と置けば、(1.6) は

$$\Gamma : {}^t \mathbf{x} A \mathbf{x} + B \mathbf{x} + c = 0 \quad (1.6')$$

と表せる。

(1.6) の2次の項の部分を標準形にするための直交変換 $\mathbf{x}' = T \mathbf{x}$ を考えれば、 Γ は

$$\Gamma : \lambda_1 (x')^2 + \lambda_2 (y')^2 + b'_1 x' + b'_2 y' + c = 0 \quad (1.7)$$

と表すことができる。高校数学で習うように (1.7) は一般に楕円などの方程式である。

実際、 λ_1, λ_2 がともに0でないならば、更に適当な平行移動による座標変換 $\begin{cases} X = x' + \xi \\ Y = y' + \eta \end{cases}$ を考えれば

$$\Gamma : \lambda_1 X^2 + \lambda_2 Y^2 = k \quad (1.8)$$

変数 x', y' のそれぞれの部分を平方完成するよに ξ, η を選ぶ。

となるから、(いくつかの例外的な場合を除けば) λ_1, λ_2 が同符号ならば楕円、異符号ならば双曲線である。もう少し精密に述べよう：

- λ_1, λ_2 が同符号のとき :

必要ならば (1.8) の辺々を (-1) 倍すればよいから, $\lambda_1 > 0, \lambda_2 > 0$ としてよい.

$k > 0$ ならば楕円であり, $k = 0$ ならば1点 O であり, $k < 0$ ならば空集合である.

- λ_1, λ_2 が異符号のとき :

$k \neq 0$ ならば双曲線であり, $k = 0$ ならば2本の直線である.

(1.8) が楕円または双曲線であるとき, 両辺を k (または $-k$) で割って

$$\Gamma: \left(\frac{X}{\alpha}\right)^2 + \left(\frac{Y}{\beta}\right)^2 = 1 \quad \text{もしくは} \quad \Gamma: \left(\frac{X}{\alpha}\right)^2 - \left(\frac{Y}{\beta}\right)^2 = \pm 1 \quad (1.8')$$

という形まで式変形することもよくある.

次に, λ_1, λ_2 の一方が0の場合を考えよう. 今ここでは $\lambda_1 \neq 0, \lambda_2 = 0$ とする. やはり適当な平行移動による座標変換 $\begin{cases} X = x' + \xi \\ Y = y' + \eta \end{cases}$ により, 方程式 (1.7) は

$$\Gamma: \lambda_1 X^2 + b_2' Y = 0 \quad (1.9)$$

と表すことができる. これは, $b_2' \neq 0$ ならば放物線の方程式であり, $b_2' = 0$ ならば1本の直線を表す. $b_2' \neq 0$ ならば (1.9) もまた, 通常

$$\Gamma: Y = \alpha X^2 \quad (1.9')$$

のような形で表す.

いずれにせよ, 2次曲線 (1.6) は, 座標系 (X, Y) を用いれば (1.8) または (1.9) (もしくは (1.8'), (1.9')) で表され, 注目すべきは2つの座標系 (x, y) と (X, Y) が直交変換と平行移動の違いしかないことである.

これは「2次曲線は楕円, 双曲線, 放物線のいずれかであり, 適当な座標系を用いれば (1.8) や (1.9) の形に表すことができる」ことを意味する. ひとつ例を見ておこう.

例 5. 2次曲線

$$\Gamma: 5x^2 + 4xy + 2y^2 + 4x - 8y - 5 = 0$$

を考える. 直交変換

$$\begin{pmatrix} x' \\ y' \end{pmatrix} = \frac{1}{\sqrt{5}} \begin{pmatrix} 1 & -2 \\ 2 & 1 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} x \\ y \end{pmatrix} \quad \text{すなわち} \quad \begin{pmatrix} x \\ y \end{pmatrix} = \frac{1}{\sqrt{5}} \begin{pmatrix} 1 & 2 \\ -2 & 1 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} x' \\ y' \end{pmatrix}$$

により

$$\Gamma: (x')^2 + 6(y')^2 + 4 \cdot \frac{x' + 2y'}{\sqrt{5}} - 8 \cdot \frac{-2x' + y'}{\sqrt{5}} - 5 = 0$$

と表すことができる. $\Gamma: (x')^2 + 6(y')^2 + 4\sqrt{5}x' - 5 = 0$ と整理でき, 更に

$$\Gamma: (x' + 2\sqrt{5})^2 + 6(y')^2 = 25$$

と式変形できる。これは楕円である。そして更に（平行移動による）座標変換 $\begin{cases} X = x' + 2\sqrt{5} \\ Y = y' \end{cases}$ により

$$\Gamma : X^2 + 6Y^2 = 25$$

と表すことができる。

2次曲線を (1.8) や (1.9) で表すこと（もしくは (1.8') や (1.9') で表すこと）を「2次曲線を標準形で表す」と言い表す。

問 6. 次の2次曲線を、適当な変数の直交変換と平行移動により、標準形で表せ。

- (1) $x^2 + 4xy + y^2 - 1 = 0$ (2) $x^2 - 2xy + y^2 + 5x + y - 2 = 0$
 (3) $7x^2 - 8xy + 13y^2 - 5\sqrt{5}x + 20\sqrt{5}y + 5 = 0$

● n 変数の2次形式

2変数の場合に説明した2次形式に関する事からの大半は n 変数でも同様に成り立つ。

n 変数の2次形式 $q = q(\mathbf{x})$ は、 n 次対称行列 A を用いて $q = {}^t\mathbf{x}A\mathbf{x}$ と表すことができる。

例題 7. 次の2次形式を、対称行列を用いて表せ。

(1) $q_1 = q_1(x_1, x_2, x_3) = x_1^2 - 5x_3^2 + 4x_1x_2 - 6x_1x_3 + 8x_2x_3$

(2) $q_2 = q_2(x_1, x_2, x_3, x_4) = (x_1 + x_4)^2 - x_2x_3$

(解答). (1)

$$q_1 = \begin{pmatrix} x_1 & x_2 & x_3 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} 1 & 2 & -3 \\ 2 & 0 & 4 \\ -3 & 4 & -5 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} x_1 \\ x_2 \\ x_3 \end{pmatrix}$$

(2)

$$q_2 = \begin{pmatrix} x_1 & x_2 & x_3 & x_4 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} 1 & 0 & 0 & 1 \\ 0 & 0 & -1/2 & 0 \\ 0 & -1/2 & 0 & 0 \\ 1 & 0 & 0 & 1 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} x_1 \\ x_2 \\ x_3 \\ x_4 \end{pmatrix}$$

□

定理 2 の内容は n 変数でも全く同様である。具体的には次のように述べられる。

定理 8. n 変数の2次形式 $q = {}^t\mathbf{x}A\mathbf{x}$ は、適当な変数の直交変換 $\mathbf{x}' = T\mathbf{x}$ により

$$q = \lambda_1(x'_1)^2 + \lambda_2(x'_2)^2 + \cdots + \lambda_n(x'_n)^2 \tag{1.10}$$

と表せる。ここに λ_i ($i = 1, 2, \dots, n$) は A の固有値である。

定理 9. $q = q(\mathbf{x})$ を 2 次形式とする. この q が対称行列 A を用いて $q = {}^t\mathbf{x}A\mathbf{x}$ と表され, A のすべての固有値は $\lambda_1 \leq \lambda_2 \leq \dots \leq \lambda_n$ というように番号付けされているとする.

\mathbf{x} が $|\mathbf{x}| = 1$ (すなわち $x_1^2 + \dots + x_n^2 = 1$) を満たしながら変化するとき, q の値域は $\lambda_1 \leq q \leq \lambda_n$ である.

最小値 λ_1 をとるのは, \mathbf{x} が A の固有値 λ_1 に対する固有ベクトル \mathbf{v}_1 ($|\mathbf{v}_1| = 1$) のとき, 最大値 λ_n をとるのは, \mathbf{x} が A の固有値 λ_n に対する固有ベクトル \mathbf{v}_n ($|\mathbf{v}_n| = 1$) のときである.

(証明). 直交変換 $\mathbf{x}' = T\mathbf{x}$ により, q を標準形に表したうえで考える.

\mathbf{x} が $|\mathbf{x}| = 1$ を満たしながら変化することは, \mathbf{x}' が $|\mathbf{x}'| = 1$ を満たしながら変化することに等しいことに注意して

$$\begin{aligned} q &= \lambda_1(x'_1)^2 + \lambda_2(x'_2)^2 + \dots + \lambda_n(x'_n)^2 \\ &\geq \lambda_1(x'_1)^2 + \lambda_1(x'_2)^2 + \dots + \lambda_1(x'_n)^2 = \lambda_1 \{(x'_1)^2 + (x'_2)^2 + \dots + (x'_n)^2\} = \lambda_1 \end{aligned}$$

すなわち $\lambda_1 \leq q$ を得る. 等号が成立するのは

$$(\lambda_2 - \lambda_1)(x'_2)^2 + \dots + (\lambda_n - \lambda_1)(x'_n)^2 = 0$$

のときである. したがって, 最小固有値 λ_1 が単根, つまり $\lambda_1 < \lambda_2$ ならば, 等号が成立するのは $x'_2 = \dots = x'_n = 0$ のとき, すなわち $\mathbf{x}' \in \text{Span}\{\mathbf{e}_1\}$ のときである. 最小固有値 λ_1 が重根, つまり $\lambda_1 = \lambda_2 = \dots = \lambda_j < \lambda_{j+1}$ ならば, 等号が成立するのは $x'_{j+1} = \dots = x'_n = 0$ のとき, すなわち $\mathbf{x}' \in \text{Span}\{\mathbf{e}_1, \dots, \mathbf{e}_j\}$ のときである. いずれにせよ, $\mathbf{x} = T^{-1}\mathbf{x}'$ が固有値 λ_1 に対する固有空間に属するときといえる.

以上より, q の最小値は λ_1 であり, その値をとるのは固有値 λ_1 に対する固有ベクトル \mathbf{v}_1 ($|\mathbf{v}_1| = 1$) のときであることが示された.

q の最大値が λ_n であり, その値をとるのは固有値 λ_n に対する固有ベクトル \mathbf{v}_n ($|\mathbf{v}_n| = 1$) のときであることも同様に確かめられる. (読者自ら示されたい.) \square

問 10. $x_1^2 + x_2^2 = 1$ のとき, 次の 2 次形式の最大値・最小値を求めよ.

(1) $x_1^2 + 4x_1x_2 + x_2^2$ (2) $4x_1 - 12x_1x_2 + 13x_2^2$

問 11. $x_1^2 + x_2^2 + x_3^2 = 1$ のとき, 次の 2 次形式の最大値・最小値を求めよ.

(1) $3x_1^2 + x_2^2 - 4x_1x_3$ (2) $2x_1^2 + 3x_2^2 - x_3^2 + 4x_1x_3$

● 正定値性

定義 12. $q = q(\mathbf{x})$ を 2 次形式とする.

- 任意の $\mathbf{x} \in \mathbb{R}^n$ に対し $q(\mathbf{x}) \geq 0$ が成り立つとき, 2 次形式 q は半正定値 (positive semi-definite) であるという. さらに, 半正定値 2 次形式 q が, $q(\mathbf{x}) = 0$ となるのは $\mathbf{x} = \mathbf{0}$ に限るとき, q は正定値 (positive definite) であるという.
- 任意の $\mathbf{x} \in \mathbb{R}^n$ に対し $q(\mathbf{x}) \leq 0$ が成り立つとき, 2 次形式 q は半負定値 (negative semi-definite) であるという. さらに, 半負定値 2 次形式 q が, $q(\mathbf{x}) = 0$ となるのは $\mathbf{x} = \mathbf{0}$ に限るとき, q は負定値 (negative definite) であるという.

- $q(\mathbf{x})$ の値が正にも負にもなり得るとき, 2 次形式 q は不定値 (indefinite) であるという.

n 次対称行列 A も, 対応する 2 次形式 $q = {}^t\mathbf{x}A\mathbf{x}$ が (半) 正定値, (半) 負定値, 不定値であるかに応じて, (半) 正定値, (半) 負定値, 不定値であると言い表す.

命題 13. A を n 次対称行列とし, A のすべての固有値を $\lambda_1, \lambda_2, \dots, \lambda_n$ とする.

(1) A が半正定値 $\iff \lambda_1 \geq 0, \lambda_2 \geq 0, \dots, \lambda_n \geq 0$.

(2) A が正定値 $\iff \lambda_1 > 0, \lambda_2 > 0, \dots, \lambda_n > 0$.

(証明). (1) A から作られる 2 次形式を $q = {}^t\mathbf{x}A\mathbf{x}$ とする. また, 直交変換 $\mathbf{x}' = T\mathbf{x}$ により q は標準形 $q = \lambda_1(x'_1)^2 + \dots + \lambda_n(x'_n)^2$ に表されるとする.

まず, 「すべての $j = 1, \dots, n$ で $\lambda_j \geq 0$ 」ならば「任意の $\mathbf{x} \in \mathbb{R}^n$ に対し $q(\mathbf{x}) \geq 0$ である」ことは明らかである. 逆に「任意の $\mathbf{x} \in \mathbb{R}^n$ に対し $q(\mathbf{x}) \geq 0$ である」としたとき, \mathbf{x} として $\mathbf{x} = T^{-1}\mathbf{e}_j$ (ここに, \mathbf{e}_j は基本ベクトル) を考えれば $0 \leq q(T^{-1}\mathbf{e}_j) = \lambda_j$ を得る.

(2) (1) の証明において等号付の不等号の等号をとればよい. □

問 14. 次の行列が (半) 正定値, (半) 負定値, 不定値のどれであるか調べよ.

$$(1) \begin{pmatrix} 1 & 2 \\ 2 & -1 \end{pmatrix} \quad (2) \begin{pmatrix} 1 & 2 \\ 2 & 2 \end{pmatrix} \quad (3) \begin{pmatrix} 1 & 2 \\ 2 & 4 \end{pmatrix} \quad (4) \begin{pmatrix} 2 & -1 & -1 \\ -1 & 1 & 1 \\ -1 & 1 & 2 \end{pmatrix}$$

命題 15. 2 次の対称行列 $A = \begin{pmatrix} a & b \\ b & c \end{pmatrix}$ が正定値であるためには, 「 $a > 0$ かつ $\det A > 0$ 」で正定値の条件は「 $c > 0, \det A > 0$ 」でもよい. あることが必要十分である.

(証明).

$$\begin{aligned} A \text{ が正定値} &\iff A \text{ の固有値 } \lambda_1, \lambda_2 \text{ が共に正} \\ &\iff A \text{ の固有方程式 } \lambda^2 - (a+c)\lambda + ac - b^2 = 0 \text{ の 2 根が正} \\ &\iff a+c > 0, ac - b^2 > 0 \\ &\iff a > 0, ac - b^2 > 0. \end{aligned}$$

□

命題 15 を含む事実が, 一般の n 次の場合でも成立する. それは次のように述べられる.

定理 16. n 次の対称行列 $A = (a_{ij})$ が正定値であるためには,

$$a_{11} > 0, \begin{vmatrix} a_{11} & a_{12} \\ a_{12} & a_{22} \end{vmatrix} > 0, \begin{vmatrix} a_{11} & a_{12} & a_{13} \\ a_{12} & a_{22} & a_{23} \\ a_{13} & a_{23} & a_{33} \end{vmatrix} > 0, \dots, \det A > 0$$

であることが必要十分である.

問 1 の答 (1) $(x \ y) \begin{pmatrix} 3 & 4 \\ 4 & 1 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} x \\ y \end{pmatrix}$ (2) $(x \ y) \begin{pmatrix} 1 & 0 \\ 0 & -1 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} x \\ y \end{pmatrix}$ (3) $(x \ y) \begin{pmatrix} -1 & 1/2 \\ 1/2 & 2 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} x \\ y \end{pmatrix}$ (4) $(x \ y) \begin{pmatrix} 1 & -2 \\ -2 & 0 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} x \\ y \end{pmatrix}$

問 3 の答 (1) $\mathbf{x}' = \frac{1}{\sqrt{5}} \begin{pmatrix} 1 & -2 \\ 2 & 1 \end{pmatrix} \mathbf{x}$ により, $q = (x')^2 + 6(y')^2$.

(2) $\mathbf{x}' = \frac{1}{\sqrt{2}} \begin{pmatrix} 1 & 1 \\ -1 & 1 \end{pmatrix} \mathbf{x}$ により, $q = 4(x')^2 - 2(y')^2$.

(3) $\mathbf{x}' = \frac{1}{\sqrt{10}} \begin{pmatrix} 1 & 3 \\ -3 & 1 \end{pmatrix} \mathbf{x}$ により, $q = 10(x')^2$.

(4) $\mathbf{x}' = \frac{1}{\sqrt{5}} \begin{pmatrix} 2 & 1 \\ -1 & 2 \end{pmatrix} \mathbf{x}$ により, $q = 4(x')^2 - (y')^2$.

問 6 の答 (1) $3(x')^2 - (y')^2 = 1$ (双曲線) (2) $X^2 + (3\sqrt{2}/2)Y = 0$ (放物線) (3) $X^2 + 3Y^2 = 27/4$ (楕円)

問 10 の答 (1) 最大値 3 ($\mathbf{x} = \pm \frac{1}{\sqrt{2}} \begin{pmatrix} 1 \\ 1 \end{pmatrix}$ のとき); 最小値 -1 ($\mathbf{x} = \pm \frac{1}{\sqrt{2}} \begin{pmatrix} 1 \\ -1 \end{pmatrix}$ のとき)

(2) 最大値 16 ($\mathbf{x} = \pm \frac{1}{\sqrt{5}} \begin{pmatrix} -1 \\ 2 \end{pmatrix}$ のとき); 最小値 1 ($\mathbf{x} = \pm \frac{1}{\sqrt{5}} \begin{pmatrix} 2 \\ 1 \end{pmatrix}$ のとき)

問 11 の答 (1) 最大値 4 ($\mathbf{x} = \pm \frac{1}{\sqrt{5}} \begin{pmatrix} -2 \\ 0 \\ 1 \end{pmatrix}$ のとき); 最小値 -1 ($\mathbf{x} = \pm \frac{1}{\sqrt{5}} \begin{pmatrix} 1 \\ 0 \\ 2 \end{pmatrix}$ のとき)

(2) 最大値 3 ($\mathbf{x} = \frac{c_1}{\sqrt{5}} \begin{pmatrix} 2 \\ 0 \\ 1 \end{pmatrix} + c_2 \begin{pmatrix} 0 \\ 1 \\ 0 \end{pmatrix}$ (c_1, c_2 は $c_1^2 + c_2^2 = 1$ なる定数) のとき)

最小値 -2 ($\mathbf{x} = \pm \frac{1}{\sqrt{5}} \begin{pmatrix} -1 \\ 0 \\ 2 \end{pmatrix}$ のとき)

問 14 の答 (1) 不定値 (2) 正定値 (3) 半正定値 (4) 正定値