

7.3 Normale Endomorphismen

a) Eigenwerte

Def.: Ist V ein Skalarproduktraum, so heißt

$f \in \text{End}(V)$ **normal**, wenn $f \circ f^+ = f^+ \circ f$.

Eine Matrix $A \in \mathbb{C}^{n \times n}$ heißt normal, wenn

$$A \bar{A}^T = \bar{A}^T A. \quad (f^+ \dots \text{adjungierte Abbildung})$$

Bew.:

(1) Ist f **selbstadjungiert**, so ist f normal. Die Eigenwerte von f sind reell (auch für $K = \mathbb{C}$).

Bew.: $f^+ = f \Rightarrow f \circ f^+ = f^+ \circ f$. Sei $v \in \text{Eig}(f; \lambda)$

$$\lambda \langle v, v \rangle = \langle v, \lambda v \rangle = \langle v, f(v) \rangle = \langle f(v), v \rangle = \bar{\lambda} \langle v, v \rangle$$

$$\Rightarrow \lambda = \bar{\lambda}, \text{ d.h. } \text{Im } \lambda = 0. \quad \square$$

(2) Ist f **orthogonal/unitär**, so ist $f^+ = f^{-1}$, und f ist normal. Die Eigenwerte erfüllen $|\lambda| = 1$.

Bew.: Wegen $|\det f| = 1$ ist f umkehrbar.

$$\langle v, f(w) \rangle = \langle f(f^{-1}(v)), f(w) \rangle = \langle f^{-1}(v), w \rangle \quad \forall v, w \in V.$$

Also ist $f^+ = f^{-1}$. Wegen $f \circ f^{-1} = f^{-1} \circ f$ ist f normal.

$$v \in \text{Eig}(f; \lambda) \Rightarrow \|v\| = \|f(v)\| = \|\lambda v\| = |\lambda| \cdot \|v\| \Rightarrow |\lambda| = 1. \quad \square$$

Satz: Für $f \in \text{End}(V)$ normal gilt: $\ker f^\dagger = \ker f$ und $\text{im } f^\dagger = \text{im } f$. Insbesondere ist die Zerlegung $V = \text{im } f \oplus \ker f$ orthogonal.

Bew.: $v \in \ker f \Leftrightarrow 0 = \langle f(v), f(v) \rangle = \langle f^\dagger(f(v)), v \rangle$
 $= \langle f(f^\dagger(v)), v \rangle = \langle v, f(f^\dagger(v)) \rangle = \langle f^\dagger(v), f^\dagger(v) \rangle$
 $\Leftrightarrow f^\dagger(v) = 0 \Leftrightarrow v \in \ker f^\dagger.$

Nach Satz 2 in §6.4c ist $V = \text{im } f^\dagger \oplus \ker f$ und $V = \ker f^\dagger \oplus \text{im } f$. $\rightarrow \text{im } f = \text{im } f^\dagger.$

(orthogonale Summe ist eindeutig.) \square

Korollar: Ist f normal, so ist $\text{Eig}(f, \lambda) = \text{Eig}(f^\dagger, \bar{\lambda})$ für jedes $\lambda \in \mathbb{C}$.

Bew.: $g := f - \lambda \text{id}_V$. Dann ist $g^\dagger = f^\dagger - \bar{\lambda} \text{id}_V$.

$$\begin{aligned} g^\dagger \circ g &= f^\dagger \circ f - \lambda f^\dagger \circ \text{id}_V - \bar{\lambda} \text{id}_V \circ f + \bar{\lambda} \lambda \text{id}_V \\ &= f \circ f^\dagger - \bar{\lambda} f - \lambda f^\dagger + \lambda \bar{\lambda} \text{id}_V = g^\dagger \circ g. \end{aligned}$$

$\Rightarrow g$ ist normal $\Rightarrow \text{Eig}(f, \lambda) = \ker g = \ker g^\dagger = \text{Eig}(f^\dagger, \bar{\lambda}).$ \square

Bem.:

(3) Die Rechts- und Linkseigenvektoren symmetrischer bzw. hermitescher Matrizen $A \in K^{n \times n}$ stimmen überein:

$$Ax = \lambda x \Leftrightarrow \bar{x}^T A = \bar{\lambda} \bar{x}^T \quad (A = A^T)$$

(4) Für f selbstadjungiert ($f^+ = f$) folgt $\lambda = \bar{\lambda}$,
d.h. $\lambda \in \mathbb{R}$.

(5) Jede **symmetrische Matrix** hat einen reellen Eigenwert.

Bew.: $P_A \in \mathbb{C}[t]$ mit $\deg P_A \geq 1$ hat mindestens
eine Nullstelle. Nach (4) ist diese reell. \square

(6) Für $f \in \text{End}(V)$ bijektiv gilt $\text{Eig}(f; \lambda) = \text{Eig}(f^{-1}; \lambda^{-1})$.

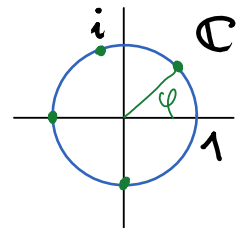
Bew.: $v \in \text{Eig}(f; \lambda)$. Wegen f bijektiv ist $\lambda \neq 0$.

$$\Rightarrow f^{-1}(v) = \frac{1}{\lambda} f^{-1}(\lambda v) = \frac{1}{\lambda} f^{-1}(f(v)) = \frac{1}{\lambda} v. \quad \square$$

(7) Für f orthogonal/unitär ($f^{-1} = f^+$) impliziert das

Korollar: $\bar{\lambda} = \frac{1}{\lambda} \Leftrightarrow |\lambda| = 1$

$$\Leftrightarrow \lambda = e^{i\varphi}$$



Proposition: Ist $f \in \text{End}(V)$ normal, und sind $\lambda \neq \mu$
Eigenwerte von f , so ist $\text{Eig}(f; \lambda) \perp \text{Eig}(f; \mu)$.

„Eigenvektoren zu verschiedenen Eigenwerten sind orthogonal.“

Bew.: Wähle $v \in \text{Eig}(f; \lambda)$ und $w \in \text{Eig}(f; \mu)$. Dann
ist $f^+(v) = \bar{\lambda}v$ und $f^+(w) = \bar{\mu}w$.

$$\lambda \langle v, w \rangle = \langle f^+(v), w \rangle = \langle v, f(w) \rangle = \mu \langle v, w \rangle,$$

also $(\lambda - \mu) \langle v, w \rangle = 0$. Mit $\lambda \neq \mu$ folgt $\langle v, w \rangle = 0$.

\square

b) Diagonalisierung

Lemma: Sind $f \in \text{End}(V)$ normal und λ ein Eigenwert von f , dann ist $U := \text{Eig}(f; \lambda)^\perp$ f -invariant und die Einschränkung $f|_U$ ist normal.

Bew.: Sei $u \in U$. Für alle $v \in \text{Eig}(f; \lambda)$ gilt:

$$\langle v, f(u) \rangle \stackrel{1}{=} \langle f^+(v), u \rangle \stackrel{2}{=} \langle \lambda v, u \rangle \stackrel{3}{=} \lambda \langle v, u \rangle \stackrel{4}{=} 0.$$

Also ist $f(u) \in \text{Eig}(f; \lambda)^\perp = U$, d.h. $f(u) \in U$.

Weiterhin ist $f^+(u) \in U$, denn

$$\langle f^+(u), v \rangle = \langle u, f(v) \rangle = \lambda \langle u, v \rangle = 0.$$

$\Rightarrow f|_U \circ f^+|_U$ und $f^+|_U \circ f|_U$ existieren und sind gleich, also ist $f|_U$ normal. \square

¹ Def. f^+ , ² obiges Korollar, ³ Semilinearität, ⁴ $u \in \text{Eig}(f; \lambda)^\perp$

Bem.:

(1) Sei $B = (v_1, \dots, v_n)$ eine Basis mit $v_1, \dots, v_r \in \text{Eig}(f; \lambda)$.

Dann ist

$$M_B(f) = \left(\begin{array}{c|c} \lambda & 0 \\ \vdots & \\ \lambda & 0 \\ \hline 0 & D \end{array} \right) \begin{array}{l} \left. \vphantom{\begin{array}{c|c} \lambda & 0 \\ \vdots & \\ \lambda & 0 \\ \hline 0 & D \end{array}} \right\} r\text{-mal} \\ \left. \vphantom{\begin{array}{c|c} \lambda & 0 \\ \vdots & \\ \lambda & 0 \\ \hline 0 & D \end{array}} \right\} n-r \text{ Zeilen} \end{array}$$

$\text{Eig}(f; \lambda)$ und U verhalten sich unter f unabhängig, sie sind „entkoppelt“.

Korollar: Zu $f \in \text{End}(V)$ normal gibt es eine orthogonale Zerlegung in f -invariante Untervektorräume:
 $V = \text{Eig}(f; \lambda_1) \oplus \dots \oplus \text{Eig}(f; \lambda_k) \oplus U. \quad (\rightarrow \S 7.2a)$

Satz: Sei V ein unitärer Vektorraum mit $\dim V < \infty$.
 Zu einem $f \in \text{End}(V)$ gibt es genau dann eine orthonormale Eigenbasis, wenn f normal ist.

Bew.: Sei f normal. Wegen $K = \mathbb{C}$ hat das charakteristische Polynom mindestens eine Nullstelle λ_1 .
 Aus dem Lemma folgt, daß $V = \text{Eig}(f; \lambda_1) \oplus U$ mit $\dim U < \dim V$, und $f|_U$ ist normal.
 Ist $\dim U \geq 1$, dann ist $\deg P_{f|_U} \geq 1$, und $f|_U$ hat einen Eigenwert $\lambda_2 \neq \lambda_1$. Iteriere das Argument, bis $\dim U = 0$.

Umkehrung: Sei $B = (v_1, \dots, v_n)$ eine orthonormale Eigenbasis mit $f(v_i) = \lambda_i v_i$. Dann ist $f^+(v_i) = \bar{\lambda}_i v_i$ für alle $i = 1, \dots, n$, weil für alle $j = 1, \dots, n$:

$$\begin{aligned} \langle f^+(v_i), v_j \rangle &= \langle v_i, f(v_j) \rangle = \langle v_i, \lambda_j v_j \rangle = \lambda_j \delta_{ij} = \lambda_i \delta_{ij} \\ &= \lambda_i \langle v_i, v_j \rangle = \langle \bar{\lambda}_i v_i, v_j \rangle. \end{aligned}$$

Weiter folgt: $f(f^+(v_i)) = f(\bar{\lambda}_i v_i) = \bar{\lambda}_i \lambda_i v_i = \dots = f^+(f(v_i))$,
 d.h. $f \circ f^+$ und $f^+ \circ f$ stimmen auf B überein.

$\Rightarrow f \circ f^+ = f^+ \circ f$, f ist normal. \square

Korollar: (Spektraldarstellung)

15.2.

Sind V unitär und $f \in \text{End}(V)$ normal mit Eigenwerten $\lambda_1, \dots, \lambda_k$, dann hat f die Darstellung

$$f = \sum_{i=1}^k \lambda_i P_i,$$

wobei $P_i \in \text{End}(V)$ die orthogonale Projektion auf $\text{Eig}(f; \lambda_i)$ bezeichnet, $i=1, \dots, k$. Sind $(v_1^{(i)}, \dots, v_{r_i}^{(i)})$ die Basen der $\text{Eig}(f; \lambda_i)$, so gilt:

$$f = \sum_{i=1}^k \sum_{j=1}^{r_i} \lambda_i |v_j^{(i)}\rangle \langle v_j^{(i)}|. \quad (\text{Bra-ket-Notation})$$

Korollar 2:

Eine Matrix $A \in \mathbb{C}^{n \times n}$ ist genau dann normal, wenn sie unitär diagonalisierbar ist, d.h. wenn es ein $S \in U(n)$ gibt, so daß SAS^{-1} diagonal ist.

Bew.: Nehme orthonormierte Eigenbasis von \mathbb{C}^n bezüglich A . Diese Vektoren bilden die Spalten von S^{-1} .

Wegen Orthonormalität ist S^{-1} unitär, also $S^{-1} = \overline{S}^T$.

Konkret: $\overline{S}^T = (v_1, \dots, v_n)$ und $Av_i = \lambda_i v_i$. Dann ist:

$$SAS^{-1} = \begin{pmatrix} \overline{v_1}^T \\ \vdots \\ \overline{v_n}^T \end{pmatrix} A (v_1, \dots, v_n) = \begin{pmatrix} \overline{v_1}^T \\ \vdots \\ \overline{v_n}^T \end{pmatrix} (\lambda_1 v_1, \dots, \lambda_n v_n) = (\lambda_i \delta_{ij})$$

□

c) euklidische Vektorräume ($K=\mathbb{R}$)

Erinnerung: Ist $f \in \text{End}(V)$ selbstadjungiert, dann sind alle Eigenwerte reell. Also zerfällt $P_f \in \mathbb{C}[t]$ stets in reelle Linearfaktoren. Wegen $\mathbb{R}[t] \subset \mathbb{C}[t]$ gilt das auch für euklidische Vektorräume ($K=\mathbb{R}$).
Alle Ergebnisse des vorigen Abschnitts übertragen sich.

Satz: Ein selbstadjungiertes $f \in \text{End}(V)$ mit $\dim V < \infty$ ist diagonalisierbar ($K=\mathbb{R}$ oder \mathbb{C}).

Korollar: Eine symmetrische, reelle Matrix $A \in \mathbb{R}^{n \times n}$ ist orthogonal diagonalisierbar, d.h. es gibt ein $S \in \text{SO}(n)$, so daß $SA S^T$ eine Diagonalmatrix ist.

Satz:

Sind V ein euklidischer Vektorraum mit $\dim V < \infty$ und $f \in \text{End}(V)$ orthogonal, so gibt es eine orthogonale Zerlegung

$$V = \text{Eig}(f; 1) \oplus \text{Eig}(f; -1) \oplus U_1 \oplus \dots \oplus U_k$$

mit f -invarianten Untervektorräumen U_i , wobei $\dim U_i = 2$.

Lemma: Sei V ein \mathbb{R} -Vektorraum mit $1 \leq \dim V < \infty$.
 Zu jedem $f \in \text{End}(V)$ gibt es einen f -invarianten
 Unterraum U mit $1 \leq \dim U \leq 2$.

Bew.: Hat f einen Eigenvektor v , dann ist $U = \text{span}(v)$
 invariant. Andernfalls hat $P_f \in \mathbb{R}[t]$ keine Nullstelle,
 aber einen Teiler $Q \in \mathbb{R}[t]$ mit $\deg Q = 2$ der Form
 $Q = (t - \lambda)(t - \bar{\lambda})$ mit $\lambda \in \mathbb{C}$, $\lambda \neq \bar{\lambda}$. $P = Q \cdot R$
(§1.4c)

Komplexifizierung von V und f : Seien B eine Basis
 in V und $A = M_B(f) \in \mathbb{R}^{n \times n} \subset \mathbb{C}^{n \times n}$. Definiere
 $\varphi: \mathbb{C}^n \rightarrow \mathbb{C}^n$, $z \mapsto Az$. Nun ist aber $P_\varphi = P_f$,
 also hat φ die Eigenwerte $\lambda \neq \bar{\lambda}$.

Sei $z \in \text{Eig}(\varphi; \lambda) \subset \mathbb{C}^n$. Dann ist $\bar{z} \in \text{Eig}(\varphi; \bar{\lambda})$,
 denn $\varphi(\bar{z}) \stackrel{A=\bar{A}}{=} \bar{Az} = \overline{\varphi(z)} = \bar{\lambda} \bar{z} \Rightarrow z \perp \bar{z}$.

$\Phi_B: \mathbb{R}^n \rightarrow V$ Koordinatensystem

Setze $x := z + \bar{z} \in \mathbb{R}^n$ und $v := \Phi_B(x) \in V$. $f(v)$ und
 v sind linear unabhängig (kein Eigenvektor von f).

$\Rightarrow U := \text{span}(v, f(v))$ mit $\dim U = 2$. Wir zeigen:

$$2(\text{Re } \lambda) f(v) = f^2(v) + |\lambda|^2 v \quad (*)$$

$\Rightarrow f^2(v) \in U$, also ist U f -invariant.

$$f(v) = \Phi_B(Ax) = \Phi_B(\lambda z + \bar{\lambda} \bar{z}), \quad f^2(v) = \Phi_B(\lambda^2 z + \bar{\lambda}^2 \bar{z}).$$

Damit folgt Gl. (*) aus

$$\underbrace{(\lambda + \bar{\lambda})}_{2 \operatorname{Re} \lambda} \underbrace{(\lambda z + \bar{\lambda} \bar{z})}_{\Phi_B^{-1}(f(v))} = \underbrace{\lambda^2 z + \bar{\lambda}^2 \bar{z}}_{\Phi_B^{-1}(f^2(v))} + \underbrace{\lambda \bar{\lambda}}_{|\lambda|^2} \underbrace{(z + \bar{z})}_{\Phi_B^{-1}(v)}.$$

□

Bem.:

(1) Wegen $Q = t^2 - 2(\operatorname{Re} \lambda)t + |\lambda|^2$ entspricht Gl. (*)

$$Q(f) = 0 \in \operatorname{End}(V)$$

(für $Q = P_f$: Satz von Cayley-Hamilton)

(2) Die Einschränkung einer orthogonalen Abbildung auf einen invarianten Unterraum ist orthogonal.

Bew.: $\langle u, v \rangle = \langle f(u), f(v) \rangle$ für $u, v \in U \subset V$. □

(3) Für $f \in \operatorname{End}(V)$ orthogonal und $W \subset V$ f -invariant ist $U := W^\perp$ ebenfalls f -invariant.

Bew.: Wegen f orthogonal ist f injektiv und damit $f(W) = W$, $\dim W < \infty$. Da auch f^{-1} orthogonal ist, folgt für $w \in W$ und $u \in U$:

$$\langle w, f(u) \rangle = \langle f^{-1}(w), f^{-1}(f(u)) \rangle = \langle \underbrace{f^{-1}(w)}_{\in W}, \underbrace{u}_{\in W^\perp} \rangle = 0$$

$$\Rightarrow f(u) \in W^\perp, \text{ also } f(u) = u.$$

□

d) Anwendung: Quantenoszillator

(1) Seien V ein geeigneter Hilbertraum, $a \in \text{End}(V)$ ein „linearer Operator“ und a^\dagger die adjungierte Abbildung, wobei gelte:

$$[a, a^\dagger] := aa^\dagger - a^\dagger a = 1.$$

Kommutator

(2) Beispiel: V ist ein Funktionenraum mit Skalarprodukt $\langle f, g \rangle = \int_{\mathbb{R}} \overline{f(x)} g(x) dx$, $f, g \in V$.
z.B. $V = L^2(\mathbb{R}; \mathbb{C}) \cap C^\infty(\mathbb{R}; \mathbb{C})$ $f: \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{C}$

Dann erfüllt

$$a^\dagger: V \rightarrow V, \quad \varphi(x) \mapsto \frac{1}{2}x \varphi(x) + \frac{\partial}{\partial x} \varphi(x)$$

↑ partielle Integration

$$aa^\dagger \varphi(x) - a^\dagger a \varphi(x) = \varphi(x), \text{ also } [a, a^\dagger] = 1.$$

(3) Wegen $[a, a^\dagger] \neq 0$ ist a nicht normal. Aber der Operator $N := a^\dagger a$ ist selbstadjungiert. Der Hamiltonoperator $H = \hbar\omega(a^\dagger a + \frac{1}{2})$ beschreibt einen harmonischen Quantenoszillator.

$$H\varphi(x) = \hbar\omega \left(\frac{1}{4}x^2 - \frac{\partial^2}{\partial x^2} \right) \varphi(x)$$

(4) die **Eigenzustände** (Eigenvektoren) von H sind die Lösungen der Schrödingergleichung: $H|\psi\rangle = \epsilon|\psi\rangle$.

(5) N ist **diagonalisierbar**, da selbstadjungiert.

Sei $\psi_\nu = \underbrace{|\nu\rangle}_{\text{„ket“}} \in \text{Eig}(N; \nu)$ mit $\langle \nu | \nu \rangle = 1$, $\nu \in \mathbb{C}$.

(6) N ist **nicht-negativ definit**, d.h. $\nu \geq 0$.

$$\nu = \langle \nu | N | \nu \rangle = \langle \nu | a^\dagger a | \nu \rangle = \langle a \nu | a \nu \rangle \geq 0$$

(7) Es gilt:

$$[N, a] = (a^\dagger a) a - a (a^\dagger a) = -[a, a^\dagger] a = -a$$

$$[N, a^\dagger] = a^\dagger$$

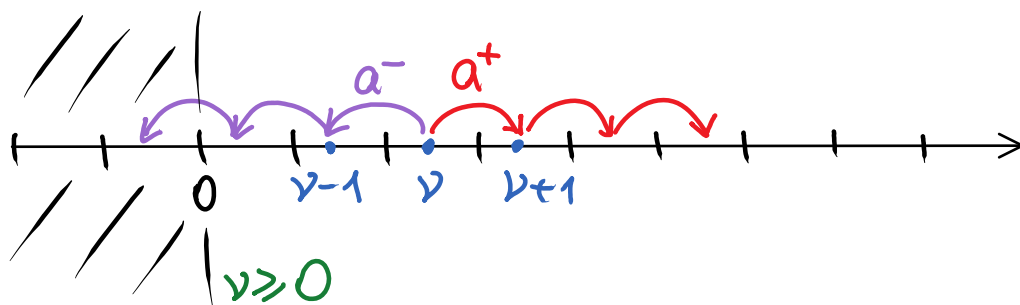
(8) $a|\nu\rangle \in \text{Eig}(N; \nu-1)$, a ist ein **Absteigeoperator**.

$a^\dagger|\nu\rangle \in \text{Eig}(N; \nu+1)$, a^\dagger ist ein **Aufsteigeoperator**.

$$N a |\nu\rangle = (a N - a) |\nu\rangle = (\nu - 1) a |\nu\rangle$$

$$N a^\dagger |\nu\rangle = (a^\dagger N + a^\dagger) |\nu\rangle = (\nu + 1) a^\dagger |\nu\rangle$$

Ist ν Eigenwert von N , dann auch $\nu-1$ und $\nu+1$,
es sei denn $a|\nu\rangle = 0$ bzw. $a^\dagger|\nu\rangle = 0$.



(9) Zu jedem Eigenwert ν gibt es ein $k \in \mathbb{N}$ mit $a^k |\nu\rangle = 0$.

Ansonsten ließen sich negative Eigenwerte generieren, im Widerspruch zu $\nu \geq 0$. \square

(10) 0 ist ein Eigenwert von N , und der einzige mit $a|\nu\rangle = 0$.

Es gibt ein $|\mu\rangle \in \text{Eig}(N; \mu)$ mit $a|\mu\rangle = 0$.
 $\Rightarrow 0 = \|a|\mu\rangle\| = \langle a|\mu\rangle = \langle \mu|a^\dagger a|\mu\rangle = \mu$. \square

(11) Alle Eigenvektoren sind von der Form

$$|\nu\rangle = c_\nu (a^\dagger)^\nu |0\rangle, \quad c_\nu \in \mathbb{R} \text{ und } \nu \in \mathbb{N}_0.$$

\leftarrow Normierungskonstante

\Rightarrow Eigenwerte von N haben Abstand 1, starten bei 0.

Für das ursprüngliche Problem $H\psi_\nu = E_\nu\psi_\nu$ heißt das: $E_n = \hbar\omega(n + \frac{1}{2})$, $n \in \mathbb{N}_0$.

Grundzustandsenergie $\frac{\hbar\omega}{2}$, Anregungsenergie $\hbar\omega$.

(12) ähnlich: Eigenfrequenzen einer eingespannten Saite, Leiteroperatoren für Spin bzw. Drehimpuls