

# 対称行列の対角化

Shane Kelly

2026 年 1 月 4 日

## 概要

(実) 対称行列が直交行列によって対角化できることの証明を 3 通り与える.

## 1

第 1 の証明は**中間値の定理**を用いる. また, **矢印行列** (arrowhead matrix) では行列式を明示的に計算できることを用いる.

**定義 1.**  $n$  次正方行列  $A = [a_{ij}]$  が**矢印行列**であるとは, 第 1 行・第 1 列・対角成分以外がすべて 0 であることをいう. すなわち, 次の形である:

$$\begin{pmatrix} a_{11} & a_{12} & \cdots & a_{1,n-1} & a_{1,n} \\ a_{21} & a_{22} & & & \\ \vdots & & \ddots & & \\ a_{n-1,1} & & & a_{n-1,n-1} & \\ a_{n,1} & & & & a_{n,n} \end{pmatrix} \quad (1)$$

ここで空欄はすべて 0 である.

**補題 2.** 式 (1) の形の矢印行列  $A$  をとる.  $2 \leq i \leq n$  のすべてで  $a_{ii} \neq 0$  と仮定する. このとき

$$\det A = \left( a_{11} - \sum_{j=2}^n \frac{a_{1j}a_{jn}}{a_{jj}} \right) \left( \prod_{j=2}^n a_{jj} \right)$$

が成り立つ.

証明.

$$\underbrace{\begin{pmatrix} a_{11} & a_{12} & \cdots & a_{1n} \\ a_{21} & a_{22} & \cdots & 0 \\ \vdots & \vdots & \ddots & \vdots \\ a_{n1} & 0 & \cdots & a_{nn} \end{pmatrix}}_A \underbrace{\begin{pmatrix} 1 & 0 & \cdots & 0 \\ \frac{-a_{21}}{a_{22}} & 1 & \cdots & 0 \\ \vdots & \vdots & \ddots & \vdots \\ \frac{-a_{n1}}{a_{nn}} & 0 & \cdots & 1 \end{pmatrix}}_{\det=1} = \begin{pmatrix} a_{11} - \sum_{j=2}^n \frac{a_{1j}a_{jn}}{a_{jj}} & a_{12} & \cdots & a_{1n} \\ 0 & a_{22} & \cdots & 0 \\ \vdots & \vdots & \ddots & \vdots \\ 0 & 0 & \cdots & a_{nn} \end{pmatrix}$$

□

**定理 3.**  $n \geq 1$  とし,  $A$  を  $n$  次対称行列とする. 次の 2 つの命題を考える.

(Eig.) $_n$   $A$  は少なくとも 1 つの固有値をもつ.

(Diag.) $_n$  ある直交行列  $P$  が存在して  $P^{-1}AP$  は対角行列である.

すると,

(a) (Eig.) $_n \wedge$  (Diag.) $_{n-1} \implies$  (Diag.) $_n$ ,

(b) (Diag.) $_n \implies$  (Eig.) $_{n+1}$ , 特に,

(c) (Diag.) $_n$  はすべての  $n \geq 1$  で成り立つ.

**注意 4.** 0 次正方行列は ( $1 \leq i \neq j \leq 0$  となる成分が存在しないので) 対角行列とみなせる. したがって (Diag.) $_0$  は意味を持ち, 真である. しかし,  $\mathbb{R}^0 = \{0\}$  には零でないベクトルが存在しないので, 0 次正方行列は固有値をもたない. よって (Eig.) $_0$  は偽である. (c) の帰納法ステップでは  $n \geq 2$  なので, (a) の  $n = 1$  の場合は無視してよい.

証明. (a) まず (Eig.) $_n \wedge$  (Diag.) $_{n-1} \implies$  (Diag.) $_n$  を示す. 仮定 (Eig.) $_n$  より, 固有値  $\lambda$  をもつ固有ベクトル  $v$  を第 1 列にもつ直交行列  $Q = [v, x_2, \dots, x_n]$  を取れる. すると,

$$Q^{-1}AQ = \begin{pmatrix} \lambda & 0 \\ 0 & B \end{pmatrix}$$

が成り立つ. ここで  $B$  は  $(n-1)$  次正方対称行列である. 仮定 (Diag.) $_{n-1}$  より,  $D = R^{-1}BR$  は対角行列である  $(n-1)$  次正方直交行列  $R$  が存在する. 2 つの直交行列の積  $P = Q \begin{bmatrix} 1 & 0 \\ 0 & R \end{bmatrix}$  も直交行列であり,

$$P^{-1}AP = \begin{bmatrix} 1 & 0 \\ 0 & R \end{bmatrix}^{-1} Q^{-1}AQ \begin{bmatrix} 1 & 0 \\ 0 & R \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} \lambda & 0 \\ 0 & D \end{bmatrix}$$

は対角行列なので,  $A$  について (Diag.) $_n$  が成り立つ.

(b) 次に (Diag.) $_n \implies$  (Eig.) $_{n+1}$  を示す.  $A$  を  $(n+1)$  次正方対称行列とし,  $A$  の第  $(1, 1)$  小行列を  $A_1$  として

$$A = \begin{bmatrix} d_0 & {}^t b \\ b & A_1 \end{bmatrix}$$

と書ける. ここで,  $b$  は列ベクトルである. 仮定 (Diag.) $_n$  より  $A_1$  は直交行列  $Q_1$  で対角化できる. 次の直交行列を考える:

$$Q = \begin{bmatrix} 1 & 0 \\ 0 & Q_1 \end{bmatrix}.$$

講義の定理 3.16 より<sup>\*1</sup>,  $A$  の固有値と  $Q^{-1}AQ$  の固有値は一致する. したがって  $A$  を  $Q^{-1}AQ$  に

---

<sup>\*1</sup> 次の等式が成り立つからである:  $\det(A-tE) = 1 \cdot \det(A-tE) \cdot 1 = \det Q^{-1} \det(A-tE) \det Q = \det(Q^{-1}(A-tE)Q) = \det(Q^{-1}AQ - Q^{-1}tEQ) = \det(Q^{-1}AQ - tE)$ .

置き換えれば,  $A$  は式 (1) の形の矢印行列であると仮定してよい. あとは, 対称矢印行列

$$\begin{pmatrix} d_0-t & b_1 & \dots & b_n \\ b_1 & d_1-t & \dots & 0 \\ \vdots & \vdots & & \vdots \\ b_n & 0 & \dots & d_n-t \end{pmatrix} \quad (2)$$

の行列式が, ある  $t \in \mathbb{R}$  で 0 となることを示せばよい.  $1 \leq i \leq n$  について  $d_i - t$  は  $\mathbb{R} \setminus \{d_1, \dots, d_n\}$  上で可逆なので, 補題 2 よりそのような  $t$  では行列式は

$$\left( (d_0-t) - \sum_{i=1}^n \frac{b_i^2}{d_i-t} \right) (d_1-t)(d_2-t) \dots (d_n-t) \quad (3)$$

となる. 式 (3) が, ある  $t \in \mathbb{R} \setminus \{d_1, \dots, d_n\}$  で 0 となることは, 下記の式 (4) が, ある  $t \in \mathbb{R} \setminus \{d_1, \dots, d_n\}$  で 0 となることと同値である:

$$f(t) = (d_0-t) - \sum_{i=1}^n \frac{b_i^2}{d_i-t} \quad (4)$$

式 (4) を観察すると

$$\lim_{t \rightarrow \infty} f(t) = -\infty \quad \text{かつ} \quad \lim_{t \rightarrow d_m^+} f(t) = \infty$$

が分かる. ここで,  $d_m = \max\{d_1, \dots, d_n\}$  とする. したがって 中間値の定理 より, 連続関数 (4) は  $(d_m, \infty)$  のどこかで 0 となる. よって  $A$  は少なくとも 1 つの固有値をもつ.

(c) 最後に,  $(\text{Diag.})_1$  と  $(\text{Eig.})_1$  はいずれも真であることが気づく. 以上より帰納法で, すべての  $n \geq 1$  について  $(\text{Eig.})_n$  と  $(\text{Diag.})_n$  が成り立つ. 具体的には,

$$(\text{Eig.})_{n-1} \wedge (\text{Diag.})_{n-1} \xrightarrow{(b)} (\text{Eig.})_n \wedge (\text{Diag.})_{n-1} \xrightarrow{(a)} (\text{Eig.})_n \wedge (\text{Diag.})_n.$$

□

## 2

第 2 の証明は複素共役・三角化・代数学の基本定理を用いる.

**定理 5.**  $A$  を  $n$  次正方実対称行列とする. すなわち,  $A$  の成分がすべて実数である. このとき,  $n$  次多項式  $\varphi_A(t) = \det(A - tE)$  の複素根はすべて実数である. 特に,  $A$  は直交行列により対角化できる.

証明.  $\lambda \in \mathbb{C}$  が  $\varphi_A(\lambda) = 0$  を満たすとする. このとき複素行列  $A - \lambda E$  の行列式は 0 なので, 対応する  $\mathbb{C}$ -線形写像  $T_{A-\lambda E} : \mathbb{C}^n \rightarrow \mathbb{C}^n; x \mapsto (A - \lambda E)x$  は非自明な核をもつ. すなわち,  $Ax = \lambda x$

を満たす  $0 \neq x \in \mathbb{C}^n$  が存在する．複素共役  ${}^t\bar{x} = (\bar{x}_1, \dots, \bar{x}_n)$  を用いると，次の計算より  $\lambda \in \mathbb{R}$  が従う：

$$\overline{\lambda({}^t\bar{x}x)} \stackrel{(*)}{=} \overline{\lambda({}^t\bar{x}x)} = \overline{{}^t\bar{x}\lambda x} = \overline{{}^t\bar{x}Ax} \stackrel{(**)}{=} {}^t x A \bar{x} = {}^t({}^t x A \bar{x}) \stackrel{(***)}{=} {}^t\bar{x} A x = {}^t\bar{x}\lambda x = \lambda({}^t\bar{x}x)$$

ここで  $(*)$  は  ${}^t\bar{x}x$  が実数であること， $(**)$  は  $A$  が実行列であること， $(***)$  は  $A$  が対称であることによる．したがって， $n$  次多項式  $\varphi_A(t)$  の複素根はすべて実数である．

最後に， $n$  次正方行列  $A$  は（重複度込みで） $n$  個の固有値をもつので，講義の定理 4.2 より直交行列  $P$  が存在して  ${}^t P A P$  は三角行列となる．さらに  $A$  が対称なので  ${}^t P A P$  も対称であり，対称な三角行列は対角行列である．  $\square$

以下の資料（第 3 の証明・極値定理の付録）は  
授業の範囲外で、参考用です。

第 3 の証明は微積分と極値定理を用いる。用いる形は、1 年次の数学で必ずしも扱われないことがあるので、後で自己完結的に説明する。証明では  $V \subseteq \mathbb{R}^n$  の直交補

$$V^\perp = \{w \in \mathbb{R}^n \mid {}^t wv = 0 \ \forall v \in V\}$$

および  $v$  の張る部分空間

$$\langle v \rangle = \{av \mid a \in \mathbb{R}\}$$

を用いる。補題 7 より  $(V^\perp)^\perp = V$  である ( $\mathbb{R}^n$  の次元は有限であるから)。

**定理 6.**  $A$  を  $n$  次正方対称行列とする。このとき  $A$  は少なくとも 1 つの実固有値をもつ。したがって任意の対称行列は直交行列により対角化できる。

証明。単位球面上で  $f: x \mapsto {}^t xAx$  を考える。

$$S^{n-1} = \{x \in \mathbb{R}^n \mid {}^t xx = 1\}.$$

$S^{n-1}$  はコンパクトであり (定理 10), また  $f: S^{n-1} \rightarrow \mathbb{R}$  は連続である (演習 13) から、最大値定理 (定理 14) により  $f$  は最大値  $M$  をとる。すなわち、ある  $x \in S^{n-1}$  が存在して  $f(x) = M$  である。

$x$  に直交する任意の単位ベクトル  $y \in S^{n-1} \cap \langle x \rangle^\perp$  を取る。  $\varepsilon \in \mathbb{R}$  に対し、下記の図のとおり、摂動したベクトル  $v_\varepsilon$  を

$$v_\varepsilon := \frac{1}{\sqrt{1+\varepsilon^2}}(x + \varepsilon y) \in S^{n-1}$$

で定める。  $y$  を固定すると、次の新しい関数が定まる：

$$g: \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}; \quad \varepsilon \mapsto g(\varepsilon) := f(v_\varepsilon).$$

この  $g$  は  $v_\varepsilon = x$  のとき、すなわち  $\varepsilon = 0$  のとき、最大値をとる。したがって  $g'(0) = 0$  である。  $g$  を

$$g(\varepsilon) = \frac{1}{\sqrt{1+\varepsilon^2}}(x + \varepsilon y)^t A \frac{1}{\sqrt{1+\varepsilon^2}}(x + \varepsilon y) = \frac{c_0 + c_1\varepsilon + c_2\varepsilon^2}{1 + \varepsilon^2}$$

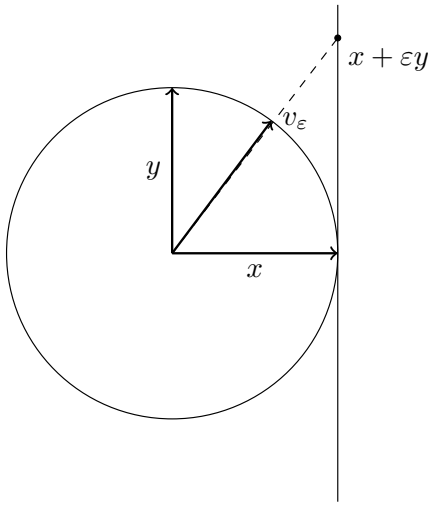
と書く。ここで  $c_0 = {}^t xAx$ ,  $c_1 = {}^t yAx + {}^t xAy$ ,  $c_2 = {}^t yAy$  である。右端の式を微分すると

$$0 = g'(0) = c_1 = {}^t yAx + {}^t xAy \stackrel{A \text{ が対称}}{=} 2 {}^t yAx$$

を得る。すなわち  $Ax \in \langle 2y \rangle^\perp = \langle y \rangle^\perp$  である。これは任意の  $y \in \langle x \rangle^\perp$  について成り立つので、

$$Ax \in \{y \mid y \in \langle x \rangle^\perp\}^\perp = (\langle x \rangle^\perp)^\perp \stackrel{\text{Lemma 7}}{=} \langle x \rangle$$

図 1



$$v_\varepsilon := \frac{1}{\sqrt{1+\varepsilon^2}}(x + \varepsilon y) \in S^{n-1}$$

と従う．よってある  $\lambda \in \mathbb{R}$  が存在して  $Ax = \lambda x$ ．言い換えると  $x$  は固有ベクトルである．

以上を用いて，最後の主張を証明する． $A$  が対称であるとする．このとき  $A$  は少なくとも 1 つの固有ベクトル  $x_1$  (固有値  $\lambda_1$ ) をもつ．第一列が  $x_1$  である直交行列<sup>\*2</sup>

$$P_1 = [x_1 \ v_2 \ \dots \ v_n]$$

を取る．すると

$$P_1^{-1}AP_1 = \begin{pmatrix} \lambda_1 & 0 \\ 0 & A_1 \end{pmatrix}$$

となり，ここで  $A_1$  は  $n-1$  次対称行列である．よって  $A_1$  も固有ベクトル  $x_2$  (固有値  $\lambda_2$ ) をもつ．第一列が  $x_2$  である直交行列

$$P_2 = [x_2 \ w_2 \ \dots \ w_{n-1}]$$

を取る．このとき

$$\begin{pmatrix} 1 & 0 \\ 0 & P_2 \end{pmatrix}^{-1} P_1^{-1}AP_1 \begin{pmatrix} 1 & 0 \\ 0 & P_2 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} \lambda_1 & 0 & 0 \\ 0 & \lambda_2 & 0 \\ 0 & 0 & A_2 \end{pmatrix}$$

を得る．ここで  $A_2$  は  $n-2$  次対称行列である．この手順をさらに  $n-3$  回繰り返すと， $A$  は直交行列の積によって対角化される．直交行列の積は直交行列なので，結局  $A$  はある直交行列によって対角化される．  $\square$

**補題 7.** 任意の部分空間  $V \subseteq \mathbb{R}^n$  について  $(V^\perp)^\perp = V$  が成り立つ．

証明.  $(-)^\perp$  の定義から  $V \subseteq (V^\perp)^\perp$  は自明なので， $\dim V = \dim (V^\perp)^\perp$  を示せばよい． $V$  の基底を行ベクトルにもつ  $k \times n$  行列  $A$  を取る．このとき

$$V^\perp = \ker(T_A : \mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R}^k; x \mapsto Ax).$$

<sup>\*2</sup> 例えば， $x_1$  を  $\mathbb{R}^n$  の基底に延長し，それに Gram-Schmidt の正規直交化を施せばよい．

$A$  の行は独立なので, ある小行列式が 0 でない. したがって  $T_A$  は全射であり,

$$\begin{aligned}\dim V^\perp &= \dim \ker T_A = \dim \mathbb{R}^n - \dim \operatorname{im} T_A \\ &= n - k \\ &= \dim \mathbb{R}^n - \dim V.\end{aligned}$$

同様に,

$$\dim (V^\perp)^\perp = \dim \mathbb{R}^n - \dim V^\perp = n - (n - k) = k = \dim V$$

□

## 付録．極値定理

**定義 8.**  $X \subseteq \mathbb{R}^n$  を部分集合とする． $X$  がコンパクトであるとは、任意の列  $\{x_n\}_{n \in \mathbb{N}} \subseteq X$  が収束部分列をもつことをいう．すなわち、ある  $i_0 < i_1 < i_2 < \dots \in \mathbb{N}$  と  $x \in X$  が存在して  $\lim_{n \rightarrow \infty} \|x - x_{i_n}\| = 0$  となること．

**例 9.**  $a < b \in \mathbb{R} \cup \{-\infty, \infty\}$  に対し、 $\{t \in \mathbb{R} \mid a < t < b\}$  はコンパクトではない．

**定理 10.**

1. 任意の  $a < b \in \mathbb{R}$  について、 $[a, b] = \{t \in \mathbb{R} \mid a \leq t \leq b\}$  はコンパクトである．
2.  $X \subseteq \mathbb{R}^n$  と  $Y \subseteq \mathbb{R}^m$  がコンパクトならば、 $X \times Y \subseteq \mathbb{R}^{n+m}$  もコンパクトである．
3. 単位球面  $S^n = \{x \in \mathbb{R}^{n+1} \mid \|x\| = 1\}$  はコンパクトである．

証明．

1. 列  $\{x_i\}_{i \in \mathbb{N}} \subseteq [a, b]$  を取る． $a_0 = a$ ,  $b_0 = b$  と定める． $n > 0$  に対し、次を満たす  $a_n, b_n$  を帰納的に定める：

- (a)  $a_{n-1} \leq a_n < b_n \leq b_{n-1}$ ,
- (b)  $|b_n - a_n| = \frac{1}{2} |b_{n-1} - a_{n-1}|$ ,
- (c) 区間  $[a_n, b_n]$  は列  $\{x_i\}_{i \in \mathbb{N}}$  の項を無限個含む．

$[a_n, b_n]$  がこれらの性質を満たすとして構成できたと仮定する．2つの区間  $[a_n, \frac{b_n + a_n}{2}]$  と  $[\frac{b_n + a_n}{2}, b_n]$  を考える．(c) より、少なくとも一方は  $\{x_i\}_{i \in \mathbb{N}}$  の項を無限個含む．前者なら  $a_{n+1} = a_n$ ,  $b_{n+1} = \frac{b_n + a_n}{2}$  とし、後者なら  $a_{n+1} = \frac{b_n + a_n}{2}$ ,  $b_{n+1} = b_n$  とする．(a),(b) は構成から従う．さらに (b) より

$$\lim_{n \rightarrow \infty} |b_n - a_n| = \lim_{n \rightarrow \infty} \frac{|b_0 - a_0|}{2^n} = |b_0 - a_0| \lim_{n \rightarrow \infty} \frac{1}{2^n} = 0.$$

(a) より列  $\{a_n\}_{n \in \mathbb{N}}$  は単調増加、 $\{b_n\}_{n \in \mathbb{N}}$  は単調減少である．したがって、ある  $c \in [a, b]$  が存在して  $\lim_{n \rightarrow \infty} a_n = \lim_{n \rightarrow \infty} b_n = c$  となる．各区間  $[a_n, b_n]$  は (c) を満たすので、 $x_{i_n} \in [a_n, b_n]$  となる  $i_0 < i_1 < \dots \in \mathbb{N}$  を取れる．このとき  $\lim_{n \rightarrow \infty} x_{i_n} = c$  が従う．

2. 列  $\{(x_i, y_i)\}_{i \in \mathbb{N}} \subseteq X \times Y$  を取る． $X$  がコンパクトなので、ある  $i_0 < i_1 < \dots \in \mathbb{N}$  と  $x \in X$  が存在して  $\lim_{n \rightarrow \infty} \|x - x_{i_n}\| = 0$  となる． $\{(x_i, y_i)\}$  を  $\{(x_{i_n}, y_{i_n})\}$  で置き換えれば  $i_n = n$  としてよいので、 $\lim_{n \rightarrow \infty} \|x - x_n\| = 0$  を仮定できる．さらに  $Y$  もコンパクトなので、ある  $i_0 < i_1 < \dots$  と  $y \in Y$  が存在して  $\lim_{n \rightarrow \infty} \|y - y_{i_n}\| = 0$  となる．再び部分列で置き換えて  $i_n = n$  とすれば、 $\lim_{n \rightarrow \infty} \|x - x_n\| = 0$  かつ  $\lim_{n \rightarrow \infty} \|y - y_n\| = 0$  を得る．すると

$$\begin{aligned} 0 \leq \lim_{n \rightarrow \infty} \|(x, y) - (x_n, y_n)\| &= \lim_{n \rightarrow \infty} \|(x - x_n, y - y_n)\| \\ &\leq \lim_{n \rightarrow \infty} \|x - x_n\| + \lim_{n \rightarrow \infty} \|y - y_n\| = 0. \end{aligned}$$

3. 列  $\{x_i\}_{i \in \mathbb{N}} \subseteq S^n$  を取る.  $S^n \subseteq [-1, 1]^{n+1} \subseteq \mathbb{R}^{n+1}$  であり,  $[-1, 1]^{n+1}$  はコンパクトなので, ある  $i_0 < i_1 < \dots \in \mathbb{N}$  と  $x \in [-1, 1]^{n+1}$  が存在して  $\lim_{n \rightarrow \infty} \|x - x_{i_n}\| = 0$  となる.  $x \in S^n$  を示せばよい. 逆三角不等式より

$$0 \leq \left| \|x\| - \|x_{i_n}\| \right| \leq \|x - x_{i_n}\|$$

したがって

$$0 = \lim_{n \rightarrow \infty} \|x\| - \|x_{i_n}\| = \lim_{n \rightarrow \infty} \|x\| - 1 = \|x\| - 1$$

すなわち,  $x \in S^n$  である.

□

**注意 11.**  $S^n$  のコンパクト性は次のように直接示すこともできる. 立方体  $[-1, 1]^{n+1}$  を, 等しい大きさ 1 の  $2^{n+1}$  個の部分立方体に分割せよ.  $S^n$  上の任意の列  $\{x_i\}_{i \in \mathbb{N}}$  は, そのうち 1 つの小立方体に無限個の項をもつ. その小立方体をさらに等しい大きさ  $\frac{1}{2^{n+1}}$  の  $2^{n+1}$  個に分割し, 同様に無限個含むものを選ぶ. これを繰り返すと,  $C_0 \supseteq C_1 \supseteq \dots$  で各  $C_i$  が  $\{x_i\}$  の項を無限個含み, かつ  $C_i$  の大きさが  $(\frac{1}{2^{n+1}})^{i-1}$  であるような小立方体列を得る. したがって  $x_{i_j} \in C_j$  となる部分列を取り,  $\cap_{i \in \mathbb{N}} C_i$  の唯一の点に収束させられる. (ここには多少の作業があり, 詳細は演習とする.)

**定義 12.**  $X \subseteq \mathbb{R}^n$  と  $Y \subseteq \mathbb{R}^m$  を部分集合とする. 写像  $f: X \rightarrow Y$  が連続であるとは, 収束列を収束列に送ることをいう. すなわち,  $x_1, x_2, \dots \in X$  と  $x \in X$  が  $\lim_{n \rightarrow \infty} \|x - x_n\| = 0$  を満たすとき,  $\lim_{n \rightarrow \infty} \|f(x) - f(x_n)\| = 0$  が成り立つこと.

**演習 13.**

1.  $\mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R}; (x_1, \dots, x_n) \mapsto x_k$  は任意の  $1 \leq k \leq n$  で連続である.
2.  $f, g: \mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R}$  が連続ならば,  $f + g: x \mapsto f(x) + g(x)$  と  $fg: x \mapsto f(x)g(x)$  も連続である.
3.  $A$  を任意の  $n$  次正方行列とすると,  $\mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R}; x \mapsto {}^t x A x$  は連続である.
4.  $X \subseteq Y \subseteq \mathbb{R}^n$  とし,  $f: Y \rightarrow \mathbb{R}$  が連続ならば, 合成  $X \rightarrow Y \xrightarrow{f} \mathbb{R}$  も連続である.

**定理 14 (最大値定理).**  $X \subseteq \mathbb{R}^n$  がコンパクトで  $f: X \rightarrow \mathbb{R}$  が連続ならば,  $f$  は最大値をとる. すなわち, ある  $x_{\max} \in X$  が存在して任意の  $x \in X$  について  $f(x) \leq f(x_{\max})$  である.

証明. 背理法で示す. 最大値が存在しないと仮定する. すると帰納的に  $x_0, x_1, x_2, \dots \in X$  を構成して  $f(x_0) < f(x_1) < f(x_2) < \dots$  かつ

$$f(x) < \lim_{n \rightarrow \infty} f(x_n) \text{ が任意の } x \in X \text{ に対して成り立つ.} \quad (*)$$

ここで,  $\lim_{n \rightarrow \infty} f(x_n) = \infty$  となる場合も許す.  $X$  はコンパクトなので, ある  $i_0 < i_1 < \dots \in \mathbb{N}$  と  $x \in X$  が存在して  $\lim_{n \rightarrow \infty} \|x - x_{i_n}\| = 0$  となる.  $f$  は連続なので  $\lim_{n \rightarrow \infty} \|f(x) - f(x_{i_n})\| = 0$ , すなわち  $f(x) = \lim_{n \rightarrow \infty} f(x_{i_n})$  である. これは  $(*)$  に反する. □