Paradigmas de Solução de Problemas

Divisão e Conquista: Transformada Rápida de Fourier

Prof. Edson Alves – UnB/FGA

Sumário

- 1. Transformada de Fourier
- 2. Transformada Rápida de Fourier
- 3. Implementação

Transformada de Fourier

Série de Fourier

- Uma série de Fourier consiste na expansão de uma função períodica f(x) em termos de senos e cosenos
- Isto possível porque as funções $\sin(mx)$ e $\cos(ny)$ são ortogonais para os inteiros m,n tais que $m \neq n$ no intervalo $[-\pi,\pi]$:

$$\int_{-\pi}^{\pi} \sin(mx) \sin(nx) dx = \int_{-\pi}^{\pi} \sin(mx) \cos(nx) dx = \int_{-\pi}^{\pi} \cos(mx) \cos(nx) dx = 0$$

• Para m=n, segue que

$$\int_{-\pi}^{\pi} \sin^2(mx) dx = \int_{-\pi}^{\pi} \cos^2(mx) dx = \pi$$

2

Série de Fourier

Deste modo,

$$f(x) = \frac{1}{2}a_0 + \sum_{n=1}^{\infty} a_n \cos(nx) + \sum_{n=1}^{\infty} b_n \sin(nx),$$

onde

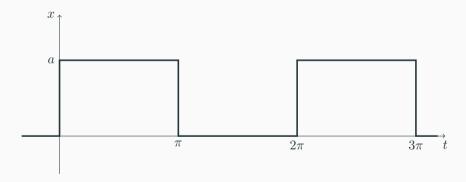
$$a_0 = \frac{1}{\pi} \int_{-\pi}^{\pi} f(x) dx$$

$$a_n = \frac{1}{\pi} \int_{-\pi}^{\pi} f(x) \cos(nx) dx$$

$$b_n = \frac{1}{\pi} \int_{-\pi}^{\pi} f(x) \sin(nx) dx$$

Exemplo: Onda Quadrada

Considere a onda quadrada abaixo:



Exemplo: Onda Quadrada

• O coeficiente a_0 é dado por

$$a_0 = \frac{1}{\pi} \int_{-\pi}^{\pi} f(t)dt = \frac{1}{\pi} \int_{0}^{\pi} a \, dt = a$$

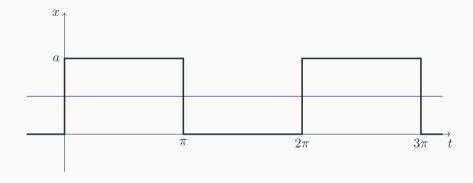
• Os coeficientes a_n , para $n \ge 1$, são todos iguais a zero, pois

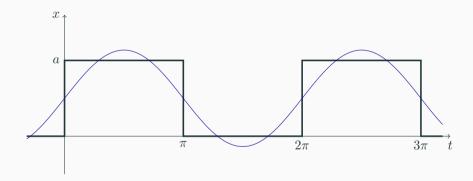
$$a_n = \frac{1}{\pi} \int_{-\pi}^{\pi} f(t) \cos(nt) dt = \frac{a}{\pi} \left[\left. \frac{\sin(nt)}{n} \right|_0^{\pi} \right] = 0$$

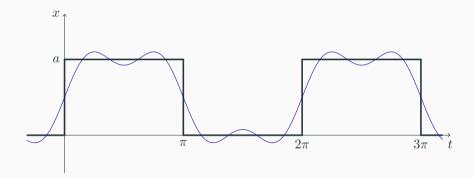
ullet Os coeficientes b_n são iguais a zero, para n par, e

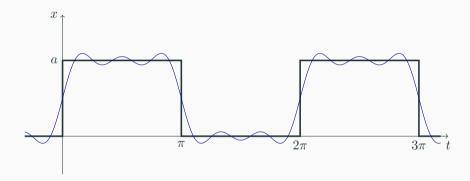
$$b_n = \frac{1}{\pi} \int_{-\pi}^{\pi} f(t) \sin(nt) dt = -\frac{a}{\pi} \left[\frac{\cos(nt)}{n} \Big|_{0}^{\pi} \right] = \frac{2a}{n\pi},$$

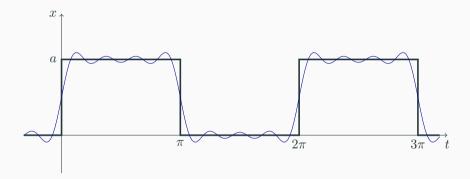
se n é ímpar











Série de Fourier com coeficientes complexos

 A série de Fourier pode ser estendida para coeficientes complexos a partir da observação que

$$e^{bi} = \cos b + i\sin b$$

ullet Seja f(x) uma função nos reais. Faça

$$f(x) = \sum_{-\infty}^{\infty} A_n e^{inx}$$

• Assim, vale que

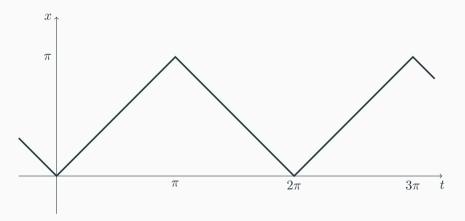
$$\int_{-\pi}^{\pi} f(x)e^{-imx}dx = 2\pi A_m,$$

de modo que

$$A_n = \frac{1}{2\pi} \int_{-\pi}^{\pi} f(x)e^{-inx} dx$$

Exemplo: Onda Triangular

Considere a onda triangular abaixo:



Exemplo: Onda Triangular

• No intervalo $[-\pi,\pi]$ temos que

$$f(x) = \begin{cases} -x, & \text{se } x \le 0, \\ x, & \text{caso contrário} \end{cases}$$

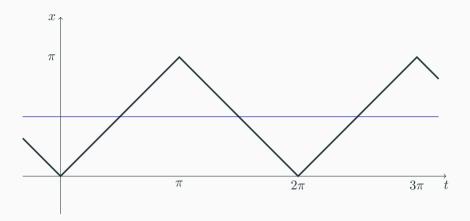
Daí

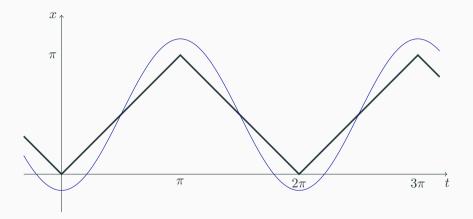
$$A_0 = \frac{1}{2\pi} \int_{-\pi}^{\pi} f(x) dx = \frac{\pi}{2}$$

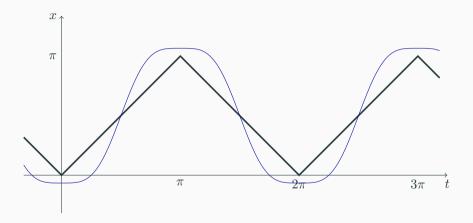
• Para n > 1 ímpar vale que

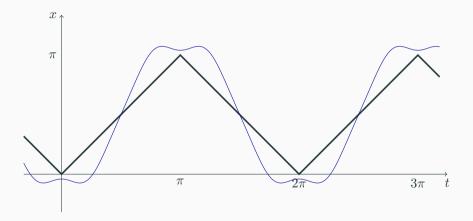
$$A_n = \frac{1}{2\pi} \int_{-\pi}^{\pi} f(x)e^{inx}dx = -\frac{4}{n^2}$$

• $A_n = 0$, se n é par









Transformada de Fourier

- A transformada de Fourier é uma generalização das séries de Fourier com coeficientes complexos quando o período tende ao infinito
- ullet Seja f(x) uma função com um número finito de descontinuidades e tal existe a integral

$$\int_{-\infty}^{\infty} |f(x)| dx$$

• A Transformada de Fourier \mathcal{F} de f(x) é dada por

$$\mathcal{F}[f(x)] = F(k) = \int_{-\infty}^{\infty} f(x)e^{-2\pi ikx}dx$$

ullet A Transformada Inversa \mathcal{F}^{-1} é dada por

$$\mathcal{F}^{-1}[F(k)] = f(x) = \int_{-\infty}^{\infty} F(k)e^{2\pi ikx}dk$$

Propriedades

• A Transformada de Fourier é linear:

$$\mathcal{F}[af(x) + bg(x)] = a\mathcal{F}[f(x)] + b\mathcal{F}[g(x)],$$

onde a e b são constantes

 A transformada da derivada da função está diretamente relacionada com a transformada da função

$$\mathcal{F}[f^{(n)}(x)](k) = (2\pi i k)^n \mathcal{F}[f(x)](k)$$

• Teorema da Convolução:

$$\mathcal{F}[f*g] = \mathcal{F}[f]\mathcal{F}[g]$$

Exemplo: Exponencial Descrescente

Seja

$$f(x) = \begin{cases} e^{-x}, & \text{se } x \ge 0, \\ 0, & \text{caso contrário} \end{cases}$$

Temos que

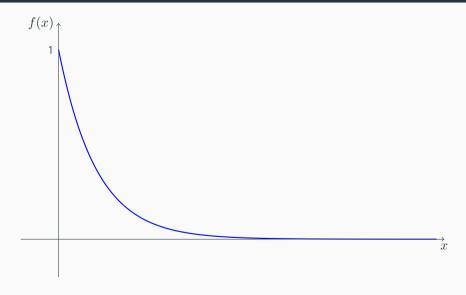
$$\mathcal{F}[f(x)] = F(k) = \int_{-\infty}^{\infty} f(x)e^{-2\pi ikx} dx$$

$$= \int_{0}^{\infty} e^{-x}e^{-2\pi ikx} dx = \int_{0}^{\infty} e^{-(1+2\pi ik)x} dx$$

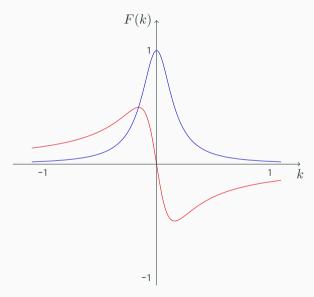
$$= -\frac{e^{-(1+2\pi ik)x}}{1+2\pi ik} \Big|_{0}^{\infty}$$

$$= \frac{1}{1+2\pi ik}$$

Visualização da função f(x)



Visualização da parte real (azul) e imaginária (vermelha) da função F(k)



Transformada Discreta de Fourier

- Uma série $x_i = \{x_0, x_1, \dots, x_{N-1}\}$ de N amostras de um sinal, igualmente espaçadas ao longo do tempo, pode ser interpretada como uma função y_i períodica de período N
- Para isso, defina $y(j) = x_i$, onde j é um inteiro tal que j = qN + i, e y(t) = 0, se t não é inteiro
- Contudo, ao invés de fazer esta adaptação e utilizar a transformada de Fourier, é melhor utilizar a Transformada Discreta de Fourier (DFT):

$$X_k = \sum_{n=0}^{N-1} x_n e^{-2\pi i k n/N}$$

• A Transformada Discreta Inversa de Fourier (IDFT) é dada por:

$$x_n = \frac{1}{N} \sum_{k=0}^{N-1} X_k e^{2\pi i k n/N}$$

Implementação da DFT e da IDFT em C++ em $O(N^2)$

```
1 #include <hits/stdc++ h>
2 #include <complex>
4 using namespace std;
6 const double PI { acos(-1.0) };
8 template<typename T>
9 vector<complex<T>> dft(const vector<T>& xs)
10 {
     int N = (int) xs.size();
     vector<complex<T>> F(N, ∅):
      for (int k = 0; k < N; ++k)
14
          for (int i = 0; i < N; ++i)
              F[k] += xs[i]*exp(complex<T>(0, -2*PI*i*k/N));
16
      return F:
18
19 }
```

Implementação da DFT e da IDFT em C++ em $O(N^2)$

```
21 template<typename T>
22 vector<T> idft(const vector<complex<T>>& Fs)
23 {
     int N = (int) Fs.size();
24
     vector<T> f(N, 0):
25
26
     for (int x = 0; x < N; ++x)
          for (int k = 0; k < N; ++k)
28
              f[x] += (1.0/N)*(Fs[k]*exp(complex<T>(0.2*PI*x*k/N))).real():
29
30
     return f:
31
32 }
```

Aplicação da DFT: Multiplicação de Polinômios

- A convolução entre duas funções f(x) e g(x) é uma função h(x) = f(x) * g(x) que representa como a forma de uma função é modificada pela outra
- Ela é a integral do produto de ambas funções, sendo que uma delas é espelhada e deslocada:

$$h(x) = f(x) * g(x) = \int_{-\infty}^{\infty} f(\tau)g(x - \tau) d\tau$$

ullet A convolução discreta de f e g é dada por

$$(f * g)[n] = \sum_{m = -\infty}^{\infty} f[m]g[n - m]$$

ullet Se f(x) e g(x) são sequências de coeficientes de dois polinômios, a convolução de ambas será igual ao produto destes polinômios

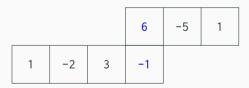
$$f(x) = x^{2} - 5x + 6$$
$$g(x) = x^{3} - 2x^{2} + 3x - 1$$

6	-5	1	
-1	3	-2	1

$$f(x) = x^{2} - 5x + 6$$

$$g(x) = x^{3} - 2x^{2} + 3x - 1$$

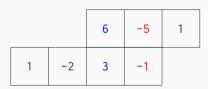
$$h(x) = -6$$



$$f(x) = x^{2} - 5x + 6$$

$$g(x) = x^{3} - 2x^{2} + 3x - 1$$

$$h(x) = 23x - 6$$



$$f(x) = x^{2} - 5x + 6$$

$$g(x) = x^{3} - 2x^{2} + 3x - 1$$

$$h(x) = -28x^{2} + 23x - 6$$

	6	-5	1
1	-2	3	-1

$$f(x) = x^{2} - 5x + 6$$

$$g(x) = x^{3} - 2x^{2} + 3x - 1$$

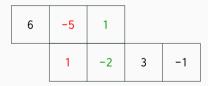
$$h(x) = \mathbf{19}x^{3} - 28x^{2} + 23x - 6$$

6	-5	1	
1	-2	3	-1

$$f(x) = x^{2} - 5x + 6$$

$$g(x) = x^{3} - 2x^{2} + 3x - 1$$

$$h(x) = -7x^{4} + 19x^{3} - 28x^{2} + 23x - 6$$



$$f(x) = x^{2} - 5x + 6$$

$$g(x) = x^{3} - 2x^{2} + 3x - 1$$

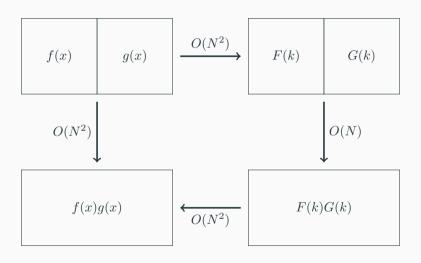
$$h(x) = x^{5} - 7x^{4} + 19x^{3} - 28x^{2} + 23x - 6$$

6	-5	1			
		1	-2	3	-1

Aplicação da DFT: Multiplicação de Polinômios

- ullet Considere as transformadas F(k) e G(k) dos polinômios f(x) e g(x)
- Pelo Teorema da Convolução, a transformada do produto será H(k)=F(k)G(k), onde a multiplicação, neste caso, é termo a termo
- No domínio do tempo, onde estão os polinômios, a multiplicação polinomial é convolução, com complexidade $O(N^2)$, onde N é o maior dentre os graus
- ullet No domínio das frequências, onde estão as transformadas, a convolução se torna uma multiplicação termo a termo, com complexidade O(N)
- Assim, é possível realizar a multiplicação de polinômios indiretamente, computando as transformadas F(k) e G(k), fazendo a multiplicação termo a termo, e computando a inversa de H(k)

Visualização da multiplicação indireta de polinômios



Implementação da multiplicação indireta de polinômios

```
34 vector<double>
35 operator*(const vector<double>& fx, const vector<double>& gx)
36 {
      auto n = fx.size() - 1, m = gx.size() - 1:
37
      vector<double> xs(n + m + 1), vs(n + m + 1);
38
39
      copv(fx.begin(), fx.end(), xs.begin());
40
      copy(gx.begin(), gx.end(), ys.begin());
41
42
      auto Fk = dft(xs), Gk = dft(ys), Hk(Fk);
43
44
      for (size_t i = 0; i < Hk.size(); ++i)</pre>
45
          Hk[i] *= Gk[i]:
46
47
      return idft(Hk);
48
49 }
```

Transformada Rápida de Fourier

DFT em $O(N \log N)$

- A divisão e conquista pode ser aplicada no cálculo da DFT para reduzir sua complexidade assintótica
- Na etapa de divisão o sinal é dividido em duas partes de tamanhos aproximadamente iguais
- A conquista acontece quando o sinal tem uma única amostra: neste caso a transformada discreta coincide com a própria amostra
- A fusão permite o cálculo da DFT do sinal a partir das DFTs das duas partes
- ullet Se a fusão for feita em O(N), a recorrência se torna

$$f(N) = 2f(N/2) + O(N)$$

- ullet O Teorema Mestre nos diz que a complexidade da transformada passa a ser $O(N\log N)$
- Esta versão da DFT é denominada *Fast Fourier Transform* (FFT)

Decomposição do sinal FFT

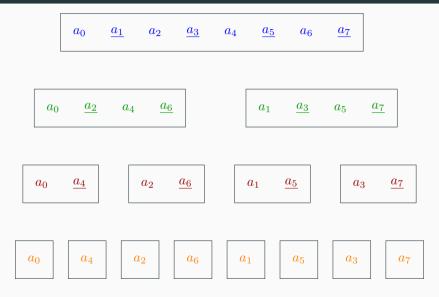
- Considere o sinal $(a_k) = a_0, a_1, \dots, a_{N-1}$
- ullet Assuma, sem perda de generalidade, que $N=2^t$, para algum t natural
- Se N não for uma potência de dois, basta adicionar um número suficiente de amostras $a_i=0$ ao sinal até que N se torne uma potência de dois
- A etapa de divisão, também denominada decomposição do sinal, o sinal é separado em duas partes de tamanho N/2: as amostras cujos índices são pares (e_k) e as amostras cujos índices são ímpares (o_k)
- Assim,

$$(e_k) = a_0, a_2, a_4, \dots, a_{N-2}$$

е

$$(o_k) = a_1, a_3, a_5, \dots, a_{N-1}$$

Visualização da decomposição do sinal



Decomposição × ordenação

- Gerando a decomposição por meio da alocação de novos dois subvetores com as cópias dos elementos de índices pares e ímpares permite uma implementação top-down da FFT
- Para uma implementação bottom-up, é preciso entender o padrão subjacente que surge desta decomposição
- De fato, os elementos que ocupam as folhas nas árvores de decomposição tem índices que correspondem à ordenação dos números $\{0,1,2,\ldots,N-1\}$ usando como critério a inversão de sua representação binária
- Assim, por meio de um comparador customizado este ordenação pode ser feita com complexidade $O(N\log N)$, o que não modifica a complexidade da FFT como um todo

Visualização da ordenação por padrão binário invertido

Padrão invertido	Padrão original
000	000
001	100
010	010
011	110
100	001
101	101
110	011
111	111
	000 001 010 011 100 101 110

Implementação da ordenação por padrão binário

```
1 #include <bits/stdc++.h>
3 using namespace std;
5 int reversed(int x, int bits)
6 {
     int res = 0;
     for (int i = 0; i < bits; ++i)
9
10
     res <<= 1;
     res |= (x \& 1);
12
         x >>= 1:
14
      return res;
16
17 }
```

Implementação da ordenação por padrão binário

```
19 template<typename T> vector<T> sortByBits(const vector<T>& xs) {
      int N = (int) xs.size(), bits = 1;
20
21
      while ((1 << bits) != N)</pre>
22
          ++bits:
24
      vector<int> is(N);
25
      iota(is.begin(), is.end(), 0);
26
      sort(is.begin(), is.end(), [&bits](int x, int y) {
28
           return reversed(x, bits) < reversed(y, bits);</pre>
29
      }):
30
31
      vector<T> ans(N):
32
33
      for (int i = \emptyset: i < N: ++i)
34
          ans[i] = xs[is[i]];
35
36
37
      return ans;
38 }
```

Conquista

- A etapa de conquista acontece em sinais como uma única amostra
- ullet Aplicando o valor N=1 na transformada discreta obtêm-se

$$X_0 = \sum_{n=0}^{N-1} x_n e^{-2\pi i k n/N} = \sum_{n=0}^{N} x_n e^{-2\pi k n} = x_0$$

- Assim, a própria amostra corresponde à sua transformada
- É preciso atentar, contudo, que embora numericamente iguais, X_0 reside no domínio das frequências, enquanto que x_0 está no domínio do tempo
- ullet Portanto esta etapa tem complexidade O(1)

Fusão (Síntese)

- A última etapa consiste em combinar as transformadas das duas partes (pares e ímpares)
 na transformada do sinal
- Lembrando que a Transformada de Fourier é linear, a transformada de um sinal x_k pode ser computada como a soma de dois sinais distintos cuja soma resulte em x_k
- Considere os sinais e_k e o_k dados por

$$e_i = \begin{cases} x_i, & \text{se } i \in \text{par} \\ 0, & \text{caso contrário} \end{cases}$$

е

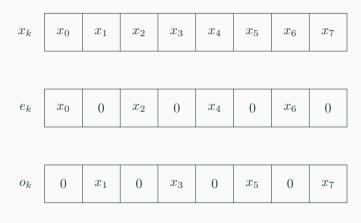
$$o_j = \left\{ \begin{array}{ll} x_j, & \text{se } j \text{ \'e impar} \\ 0, & \text{caso contr\'ario} \end{array} \right.$$

Fusão (Síntese)

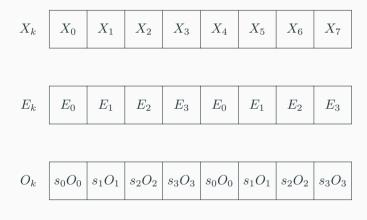
- Deste modo, $x_k = e_k + o_k$
- As transformadas de e_k e o_k tem um comportamento peculiar
- ullet A transformada de e_k duplica seus resultados
- ullet A transformada de o_k tem mesmo comportamento, porém com os valores multiplicados por uma componente sinusoidal
- Isto porque, em relação à x_k , o sinal o_k está deslocado no tempo em uma unidade
- Deslocar no tempo corresponde a convolução do sinal com uma função $\delta(t-a)$, onde a é o deslocamento
- A transformada da função $\delta(t-a)$ é uma exponencial complexa:

$$\mathcal{F}[\delta(t-a)] = \int_{-\infty}^{\infty} \delta(t-a)e^{-2\pi kit}dt = e^{-2\pi kai}$$

Visualização dos sinais no domínio do tempo



Visualização das transformadas no domínio das frequências



Padrão borboleta

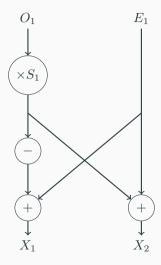
- Como as transformadas das duas partes foram computadas sem o deslocamento, é preciso compensá-lo na composição da transformada do todo
- \bullet As componentes oriundas da parte par E_k são somadas sem alteração em cada componente da transformada X_k
- ullet Já as componentes de O_k devem ser multiplicadas pela componente

$$S_k = e^{\frac{2\pi ki}{N}}$$

antes de serem somadas

- Esta multiplicação afeta o sinal do termo: a primeira metade terá sinal negativo, e a segunda metade sinal positivo
- Este ajuste é denominado padrão borboleta, por conta da visualização do diagrama gerado

Padrão borboleta para ${\cal N}=2$





Implementação recursiva top-down

- Uma forma de implementar a FFT é por meio de recursão
- A cada etapa, são criados dois subvetores e_k e o_k , de tamanho N/2, e a transformada é chamada em cada um destes subvetores
- ullet O caso base acontece quando N=1, onde a transformada é igual à própria amostra
- Na etapa de síntese ou fusão, os coeficientes da transformada X_k podem ser computado atráves das transformadas E_k e O_k dos subvetores:

$$X_j = \left\{ \begin{array}{ll} E_j + S_j O_j, & \text{se } 0 \leq j < N/2, \\ E_{j-N/2} - S_{j-N/2} O_{j-N/2}, & \text{caso contrário} \end{array} \right.$$

onde

$$S_j = e^{-2\pi ji/N}$$

Implementação recursiva top-down

- É possível implementar tanto a transformada quanto a inversa em uma única função
- Primeiramente, é preciso uniformizar o tipo dos vetores
- Uma opção é que todos sejam vetores de complexos
- Em segundo lugar, são duas as diferenças entre a transformada e sua inversa:
 - 1. os sinais dos ângulos são opostos
 - 2. na inversa os coeficientes são divididos por ${\cal N}$
- Uma flag booleana pode ser passada como parâmetro para decidir o sentido da transformada
- \bullet Como N é uma potência de 2, uma forma de realizar esta divisão por N é dividir, a cada etapa, os coeficientes por 2

Implementação top-down da FFT

```
1 #include <bits/stdc++.h>
₃ using namespace std;
5 const double PI { acos(-1.0) };
void fft(vector<complex<double>>& xs, bool invert = false)
8 {
      int N = (int) xs.size();
9
10
     if (N == 1)
          return:
      vector<complex<double>> es(N/2), os(N/2);
14
      for (int i = 0; i < N/2; ++i)
16
          es[i] = xs[2*i];
18
      for (int i = 0; i < N/2; ++i)
19
          os[i] = xs[2*i + 1]:
20
```

Implementação top-down da FFT

```
fft(es, invert);
22
      fft(os, invert);
24
      auto signal = (invert ? 1 : -1);
25
      auto theta = 2 * signal * PI / N;
26
      complex<double> S { 1 }, S1 { cos(theta), sin(theta) };
27
28
      for (int i = 0; i < N/2; ++i)
29
30
          xs[i] = (es[i] + S * os[i]):
31
          xs[i] /= (invert ? 2 : 1);
32
          xs[i + N/2] = (es[i] - S * os[i]);
34
          xs[i + N/2] /= (invert ? 2 : 1):
35
36
          S *= S1:
37
38
39 }
```

Implementação bottom-up, in-place

- Utilizando a ordenação por bits invertidos, é possível implementar a FFT bottom-up
- Além de dispensar a recursão, o custo de memória é reduzido, pois só é preciso copiar dois coeficientes a cada atualização, sem precisar copiar os subvetores a cada iteração
- A ordenação baseada em bits pode ser feita em O(N): basta trocar de posição dos elementos de índices i e j tais que i < j e que i e j são mutuamente reversos

Implementação bottom-up, in-place da FFT

```
1 #include <bits/stdc++.h>
₃ using namespace std;
5 const double PI { acos(-1.0) };
7 int reversed(int x, int bits)
8 {
      int res = 0;
9
10
      for (int i = 0; i < bits; ++i)
     res <<= 1;
13
        res |= (x \& 1);
14
          x >>= 1;
15
16
18
      return res;
19 }
```

Implementação bottom-up, in-place da FFT

```
21 void fft(vector<complex<double>>& xs, bool invert = false)
22 {
      int N = (int) xs.size();
23
24
      if (N == 1)
25
          return:
26
      int bits = 1;
28
29
      while ((1 << bits) != N)</pre>
30
          ++bits;
31
32
      for (int i = 0; i < N; ++i)
33
34
          auto j = reversed(i, bits);
35
36
          if (i < j)
37
               swap(xs[i], xs[j]);
38
39
```

Implementação bottom-up, in-place da FFT

```
for (int size = 2; size <= N; size *= 2)
41
42
          auto signal = (invert ? 1 : -1);
43
          auto theta = 2 * signal * PI / size;
44
          complex<double> S1 { cos(theta), sin(theta) };
45
46
          for (int i = 0: i < N: i += size)
47
48
              complex<double> S { 1 }, k { invert ? 2.0 : 1.0 };
49
50
              for (int j = 0; j < size / 2; ++j)
51
52
                   auto a { xs[i + j] }, b { xs[i + j + size/2] * S };
                  xs[i + i] = (a + b) / k:
54
                  xs[i + j + size/2] = (a - b) / k;
55
                  S *= S1:
56
57
58
59
60 }
```

Referências

- 1. CHEEVER, Erick. The Fourier Series, acesso em 12/08/2020.
- 2. CP Algorithms. Fast Fourier Transform, acesso em 13/08/2020.
- SMITH, Steven W. The Scientist and Engineer's Guide to Digital Signal Processing, acesso em 17/08/2020.
- 4. Standford. Lecture 11 The Fourier Transform, acesso em 13/08/2020.
- 5. The Fourier Transform.com. The Dirac-Delta Function The Impulse, acesso em 18/08/2020.
- 6. Wikipédia. Discrete Fourier Transform, acesso em 13/08/2020.
- 7. Wolfram. Fourier Series, acesso em 12/08/2020.
- 8. Wolfram. Fourier Transform, acesso em 13/08/2020.