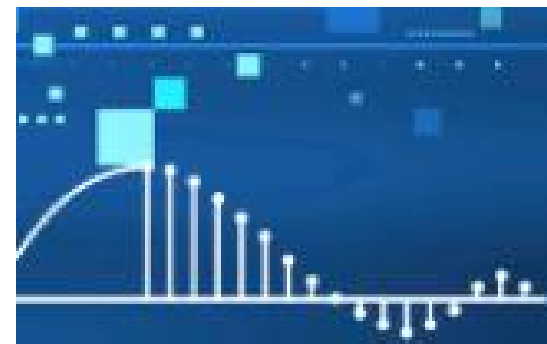




北京航空航天大学  
BEIHANG UNIVERSITY



# 数字信号处理

授课教师：孙国良

电子信息工程学院

# 第四章

## Contents

# 离散傅里叶变换 及快速算法

德才兼备 知行合一

DECAIJIANBEIZHIXINGHEYIHEYI



一

离散傅里叶级数



二

频域采样与重构



三

离散傅里叶变换



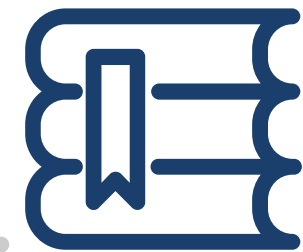
四

DFT快速算法



五

DFT的工程应用



离散傅里叶级数

频域采样与重构

离散傅里叶变换

DFT快速算法

DFT的工程应用

- ◆ DFT是有限长序列的DTFT的频域采样
- ◆ FFT是DFT的快速算法
- ◆ 实现途径：
  - 硬件实现
  - 软件实现
- ◆ 主要用途：
  - LTI系统实现
  - 信号频谱分析



# FFT效率

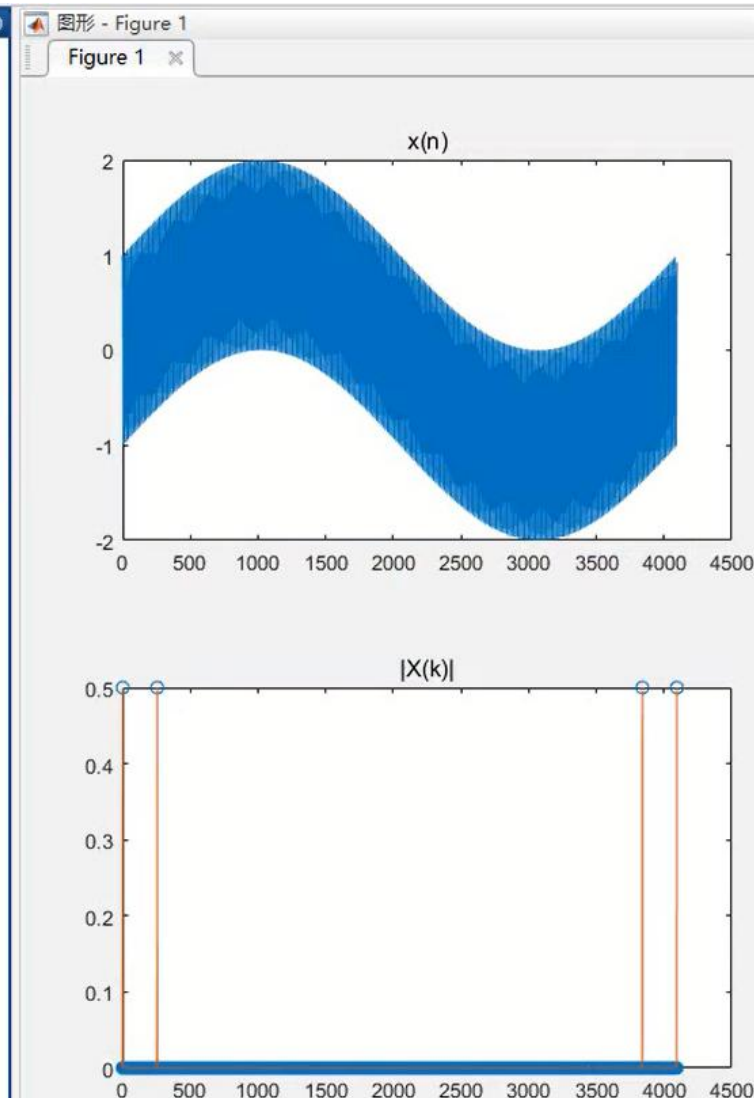
```
sglfft.m
function [Xk]=sglfft(x,N)
M=log2(N);
xtmp=zeros(1,N);
value=zeros(1,M);
for i=0:N-1
    repr=i;
    for t=1:M
        repr=bitshift(i,1-t);
        value(t)=bitand(repr,1);
    end
    pos=0;
    for k=1:M
        pos=pos+value(k)*2^(M-k);
    end
    xtmp(pos+1)=x(i+1);
end
for i=1:M
    depth=2^(i-1);
    width=2^(M-i);
    for t=1:2^i:N
        for k=1:depth
            tmp=xtmp(t+k-1);
            wn=width*(k-1);
            xtmp(t+k-1)=tmp+exp(-j*2*pi*wn/N)*tmp(t+k+depth-1);
        end
    end
end
Xk=xtmp;

sgldft.m
function [Xk]=sgldft(xn,N)
%离散傅里叶变换
%Xk DFT频域序列, k=[0,N-1]
%N, DFT序列长度
n=[0:1:N-1];
k=n;
WN=exp(-j*2*pi/N);
nk=n'*k;
WNnk=WN.^nk;
Xk=xn*WNnk;
end

tstdft.m
function tstdft(N)
clear all;
%close all;
%N=1024;
n=0:N-1;
k=n;
%x=[ones(1,5),zeros(1,N-5)];
x=sin(2*pi/N*n)+cos(pi/8*n);
hold off
tic; X=sgldft(x,N);
str=['DFT 耗时',num2str(toc),'s'];disp(str);
subplot(2,1,1):plot(n,x);title('x(n)');
subplot(2,1,2):plot(k,abs(X)/N,'o');title('');

hold on
tic; X=sglfft(x,N);
str=['FFT 耗时',num2str(toc),'s'];disp(str);
subplot(2,1,2):plot(k,abs(X)/N);
```

```
命令窗口
>> tstdft(1024)
DFT 耗时 0.2467s
FFT 耗时 0.021336s
>> tstdft(2048)
DFT 耗时 1.1883s
FFT 耗时 0.046576s
>> tstdft(4096)
DFT 耗时 5.5059s
FFT 耗时 0.098824s
fx >>
```





MATLAB R2016a
主 页 绘 图 应 用 程 序 编 辑 器 发 布 视 图
搜索文档
E:\BDrive\讲义课件\数字信号处理讲义\其他资料\Matlab资料\
sglfft.m
sgldft.m
tstdft.m
命令窗口
图形 - Figure 1
Figure 1

```

function [Xk]=sglfft(x,N)
M=log2(N);
xtmp=zeros(1,N);
value=zeros(1,M);
for i=0:N-1
    repr=i;
    for t=1:1:M
        repr=bitshift(i,1-t);
        value(t)=bitand(repr,1);
    end
    pos=0;
    for k=1:1:M
        pos=pos+value(k)*2^(M-k);
    end
    xtmp(pos+1)=x(i+1);
end
for i=1:M
    depth=2^(i-1);
    width=2^(M-i);
    for t=1:2^i:N
        for k=1:depth
            tmp=xtmp(t+k-1);
            wn=width*(k-1);
            xtmp(t+k-1)=tmp+exp(-j*2*pi*wn/N)*tmp;
            xtmp(t+k+depth-1)=tmp-exp(-j*2*pi*wn/N)*tmp;
        end
    end
end
Xk=xtmp;
end

```

```

function [Xk] = sgldft(xn,N)
%离散傅里叶变换
%Xk DFT频域序列, k=[0,N-1]
%N, DFT序列长度
n=[0:1:N-1];
k=n;
WN=exp(-j*2*pi/N);
nk=n'*k;
WNnk=WN.^nk;
Xk=xn*WNnk;
end

```

```

function tstdft(N)
clear all;
%close all;
%N=1024;
n=0:N-1;
k=n;
%x=[ones(1,5),zeros(1,N-5)];
x=sin(2*pi/N*n)+cos(pi/8*n);
hold off
tic; X=sgldft(x,N);
str = ['DFT 耗时 ',num2str(toc),'s'];disp(str);
subplot(2,1,1):plot(n,x):title('x(n)');
subplot(2,1,2):plot(k,abs(X)/N,'o'):title('');
hold on
tic; X=sglfft(x,N);
str = ['FFT 耗时 ',num2str(toc),'s'];disp(str);
subplot(2,1,2):plot(k,abs(X)/N);

```

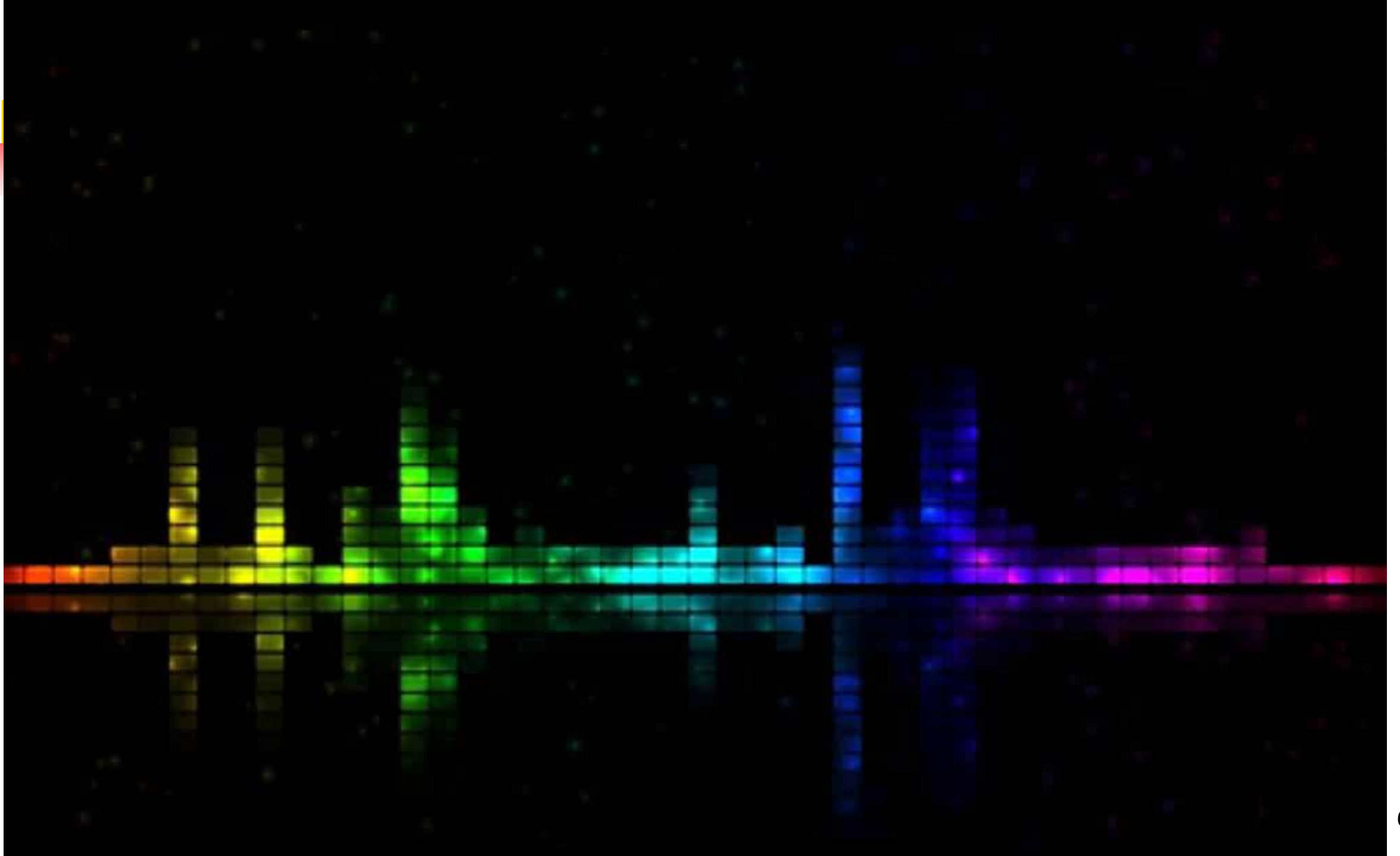
```

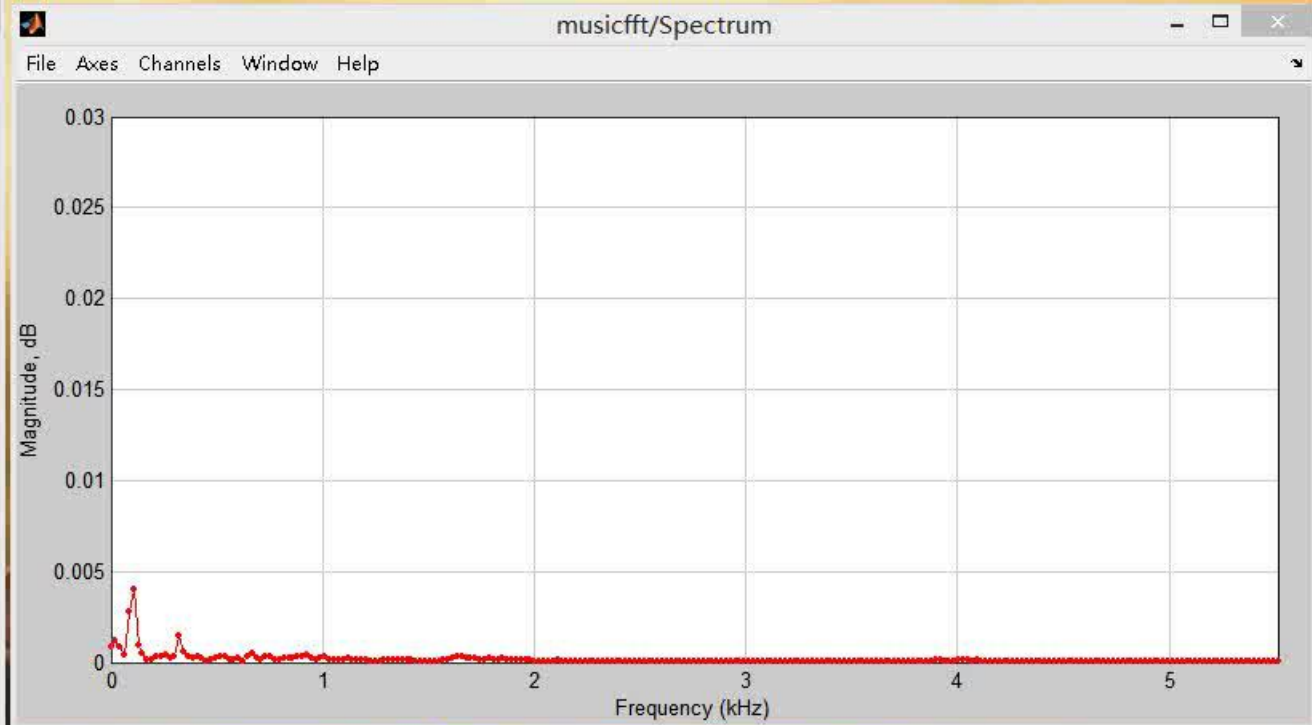
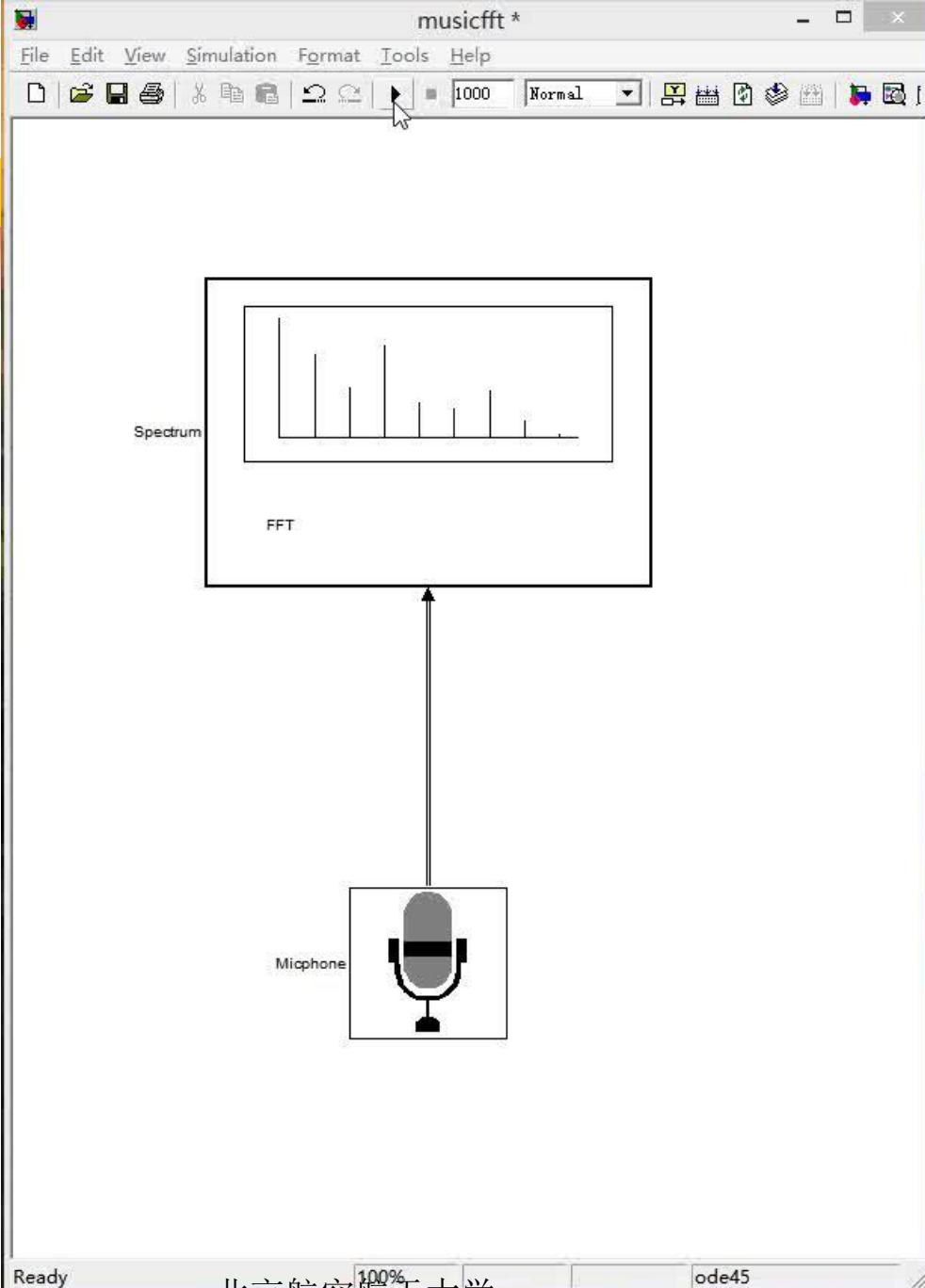
fx >> tstdft(1024)

```

**x(n)**

**|X(k)|**

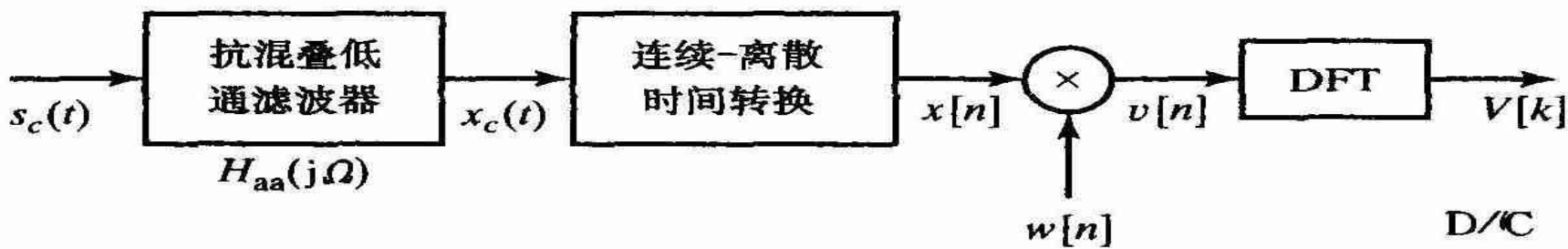




# 一、利用DFT的频谱分析

- DFT的主要应用之一是分析连续信号的频谱

- 如语音信号频率分析用于音腔辨识与建模



- 实际信号不严格带限，并且自然界中总存在着噪声(其频谱是宽带的)，在采样之前需要加入抗混叠滤波器，使混叠减小到最低程度。
- 采样的速率则根据抗混叠滤波器的带宽来确定，满足采样定理。随后进行时域加窗和频域采样。





# DFT对CTFT的逼近

---

- 连续时间非周期信号傅里叶变换为:

- $$X(j\Omega) = \int_{-\infty}^{\infty} x(t) e^{-j\Omega t} dt$$

$$x(t) = \frac{1}{2\pi} \int_{-\infty}^{\infty} X(j\Omega) e^{j\Omega t} d\Omega$$

- 用**DFT** 方法对该变换逼近:

# 时域离散化→时域截断

- 1、将  $x(t)$  在 **t** 轴上等间隔（宽度为 **T**）分段。

$$x(t) \Big|_{t=nT} = x(nT) = x(n)$$

- 则**CTFT**可以近似为：
$$X(j\Omega) \approx \sum_{n=-\infty}^{\infty} x(nT) e^{-j\Omega nT} \cdot T$$

- 2、将序列  **$x(n)=x_c(nT)$**  截断成从 **t=0** 开始长度为  **$T_0=NT$**  的有限长序列，包含有 **N** 个采样，即时域加窗：

$$X(j\Omega) \approx T \sum_{n=0}^{N-1} x(nT) e^{-j\Omega nT}$$

## 频域离散化→栅栏效应

**3、**由于数值计算限制，在频域上也只能计算离散点（频域抽样）上的数值。我们将频域的一个周期  $f_s$  中也分成 **N段**，即  $f_s = NF_0$ 。频域采样点间隔为  $F_0$ 。

$$\begin{aligned} X(j\Omega) &\approx T \sum_{n=0}^{N-1} x(nT) e^{-j\Omega nT} \\ X(jk\Omega_0) &\approx T \sum_{n=0}^{N-1} x(nT) e^{-jk\Omega_0 nT} \\ &= T \sum_{n=0}^{N-1} x(nT) e^{-jnk \frac{2\pi F_0}{f_s}} = T \sum_{n=0}^{N-1} x(nT) e^{-jnk \frac{2\pi}{N}} = T \left\{ DFT[x(n)] \big|_{x(n)=x(nT)} \right\} \end{aligned}$$



# DFT对CTFS的逼近

$$X(jk\Omega_0) = \frac{1}{T_0} \int_0^{T_0} x(t) e^{-jk\Omega_0 t} dt$$

$$x(t) = \sum_{k=-\infty}^{\infty} X(jk\Omega_0) e^{jk\Omega_0 t}$$

- 时域抽样:  $x(n) = x(nT) = x(t)|_{t=nT}$
- 取周期内的**N**个点, 即  $T_0 = NT$ , 则傅立叶级数近似为:

$$X(jk\Omega_0) \approx \frac{T}{T_0} \sum_{n=0}^{N-1} x(nT) e^{-jk\Omega_0 nT} = \frac{1}{N} \sum_{n=0}^{N-1} x(n) e^{-j\frac{2\pi}{N}nk} = \frac{1}{N} DFT[x(n)]$$

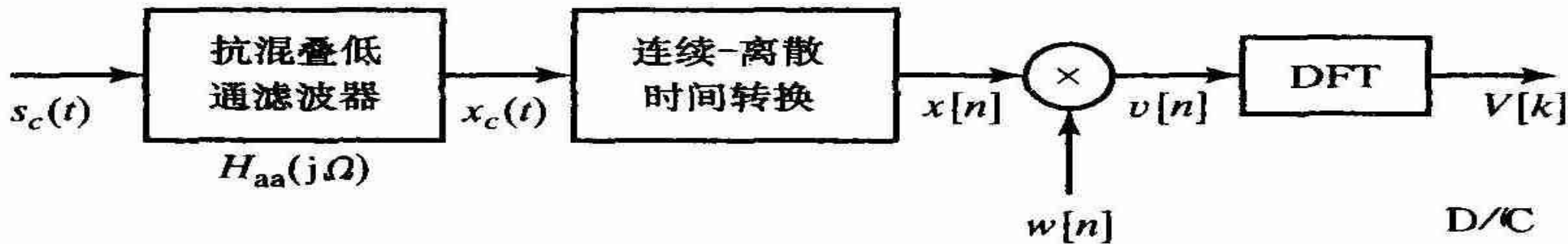




## Ex

- 考虑带限实信号  $x_c(t)$ ，且当  $|\Omega| > 2\pi * 2500$  时， $X_c(j\Omega) = 0$ 。利用上图中的系统来估计连续谱  $X_c(j\Omega)$ 。
- **1)** 采样速率为**5000Hz**，为了在尽可能少的基二**FFT**计算量的条件下使频谱采样的间隔不大于**10Hz**，则所需要样本数**N**的最小值应为多少？
- **2)** 若用上述采样率的数据，截取了**1024**点做谱分析，发现**320**点处有较大信号分量，请问此频点是多少**Hz**？
- **3)** 若用**512**点的**DFT**计算出 **$X(11) = 2000 * (1 + j)$** ，请问 **$X(501)$** 频点处的**DFT**是多少？同时请给出  $X_c(j\Omega)$  在对应连续频点处的模拟频率值及频谱幅度。

# 加窗的影响---谱泄露+分辨率降低



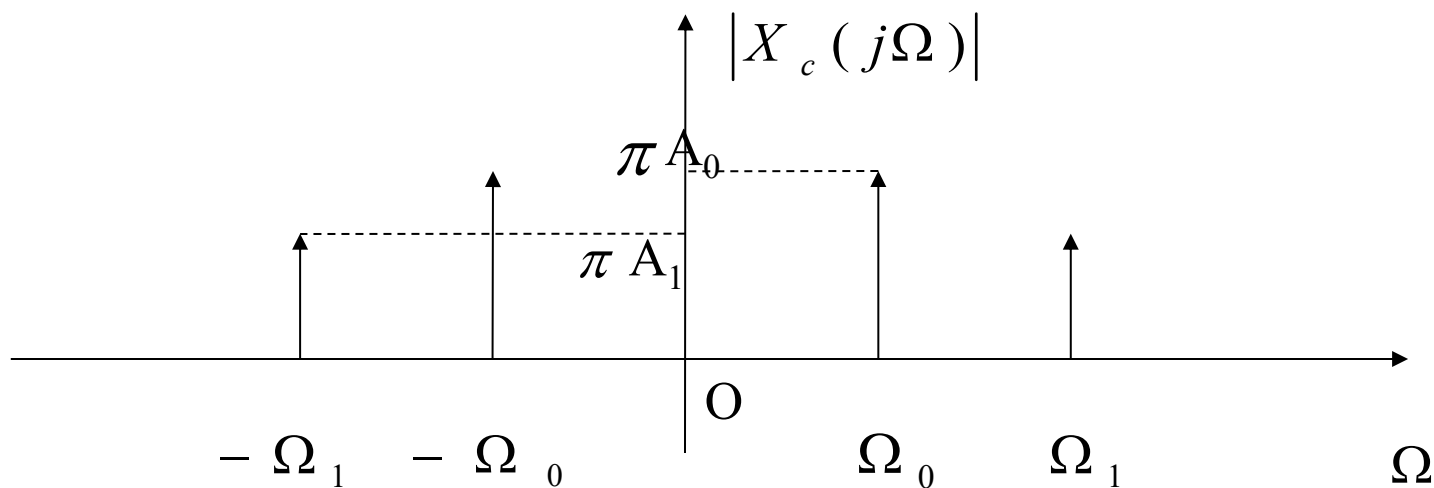
$$v(n) = x(n)w(n) = x_c(t) \big|_{t=nT} \quad w(n) = x_c(t)W(t) \big|_{t=nT}$$

$$V(j\omega) = X(j\omega) * W(j\omega) = \left[ \frac{1}{T} \sum_{n=-\infty}^{+\infty} X_c(j\Omega - j \frac{2\pi k}{T}) \big|_{\Omega=\omega/T} \right] * W(j\omega)$$

$$= \left[ \frac{1}{T} \sum_{n=-\infty}^{+\infty} X_{cw}(j\Omega - j \frac{2\pi k}{T}) \big|_{\Omega=\omega/T} \right] \quad X_{cw}(j\Omega) = X_c(j\Omega) * W(j\Omega)$$

## 正弦信号加窗分析

- 观察由两个正弦分量组成的连续时间信号在加窗之下的**CTFT**频谱。令信号为：
- $$X_c(t) = A_0 \cos(\Omega_0 t + \theta_0) + A_1 \cos(\Omega_1 t + \theta_1)$$
- 其傅立叶变换有两个频率，四个对称频点：



# 采样DTFT没有导致频谱畸变

- 无失真采样后:

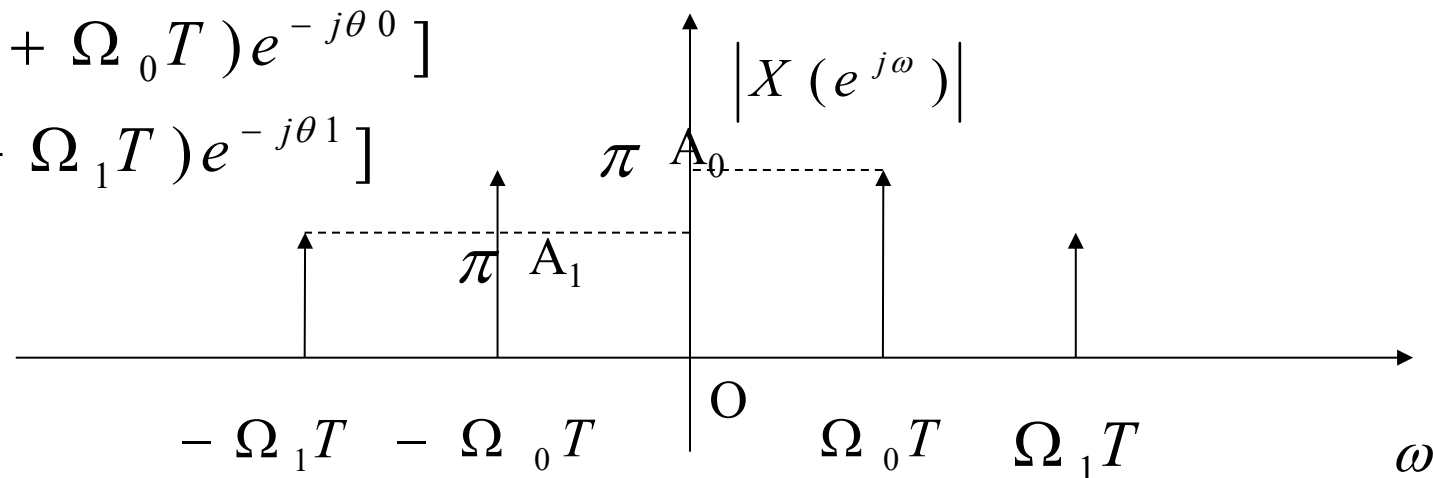
$$x(n) = A_0 \cos(\Omega_0 n T + \theta_0) + A_1 \cos(\Omega_1 n T + \theta_1)$$

- 其频谱为:

$$X(e^{j\omega})$$

$$= \pi A_0 [\delta(\omega - \Omega_0 T) e^{j\theta_0} + \delta(\omega + \Omega_0 T) e^{-j\theta_0}]$$

$$+ \pi A_1 [\delta(\omega - \Omega_1 T) e^{j\theta_1} + \delta(\omega + \Omega_1 T) e^{-j\theta_1}]$$





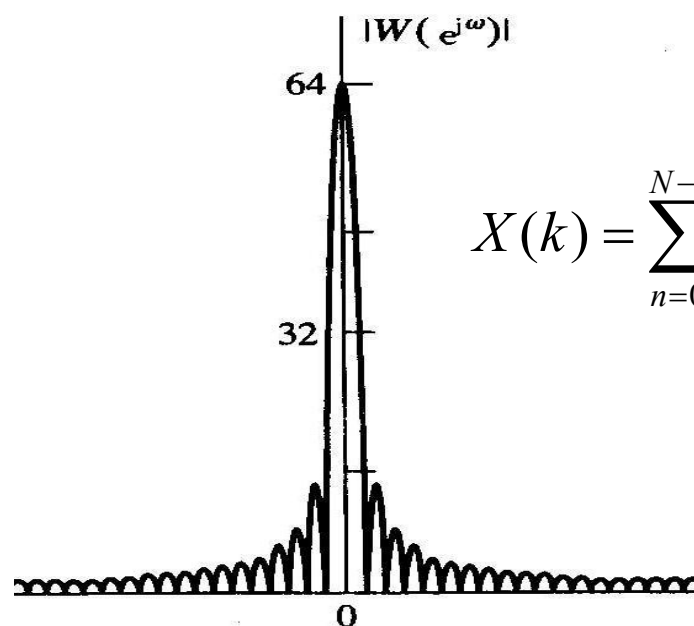
# ■ 加窗后DTFT谱形状产生畸变

若两处峰值分别为32和24，请问两个频率分量的幅度A0,A1分别是多少？

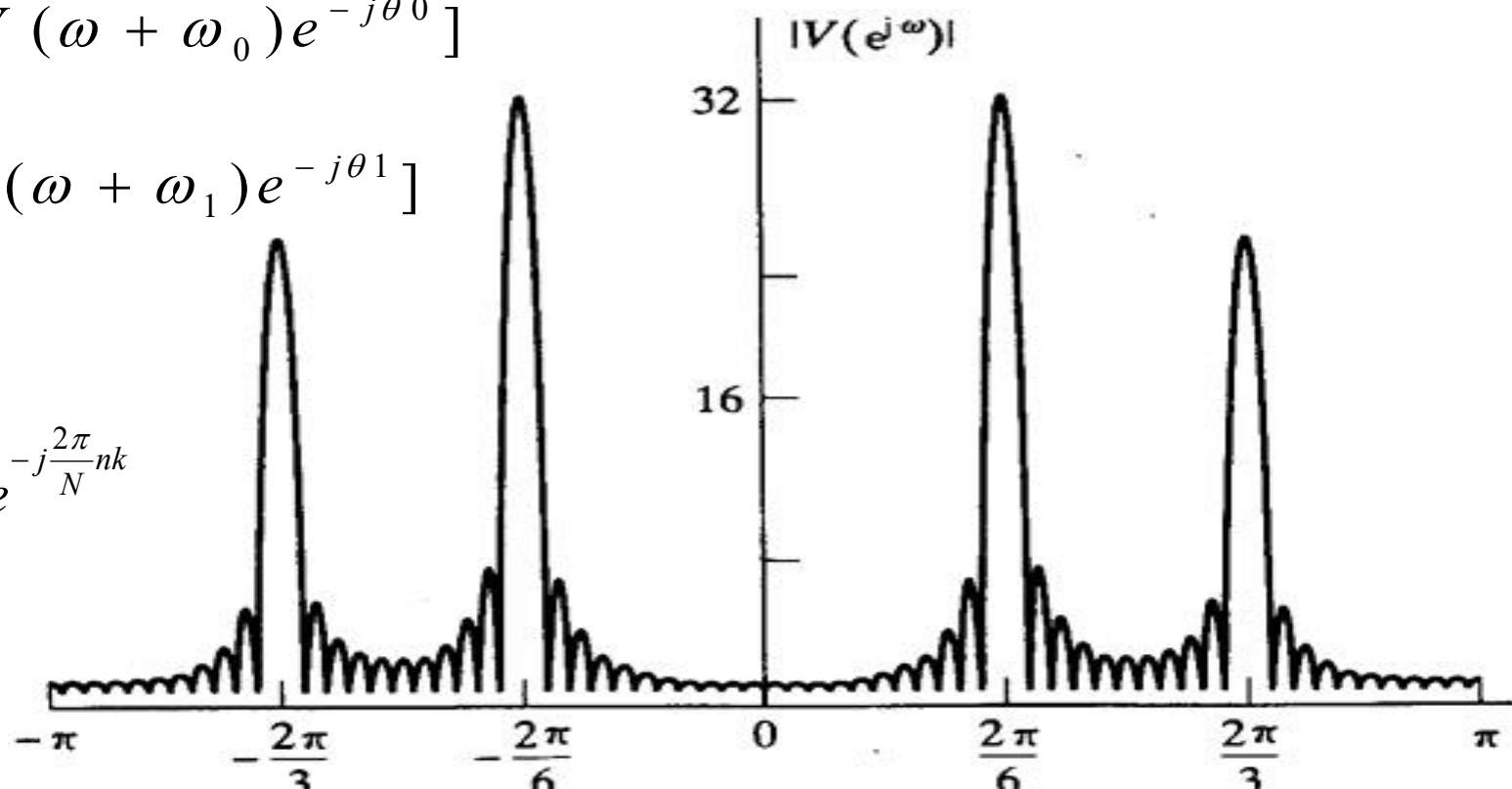
$$V(e^{j\omega})$$

$$= \frac{A_0}{2} [W(\omega - \omega_0)e^{j\theta_0} + W(\omega + \omega_0)e^{-j\theta_0}]$$

$$+ \frac{A_1}{2} [W(\omega - \omega_1)e^{j\theta_1} + W(\omega + \omega_1)e^{-j\theta_1}]$$



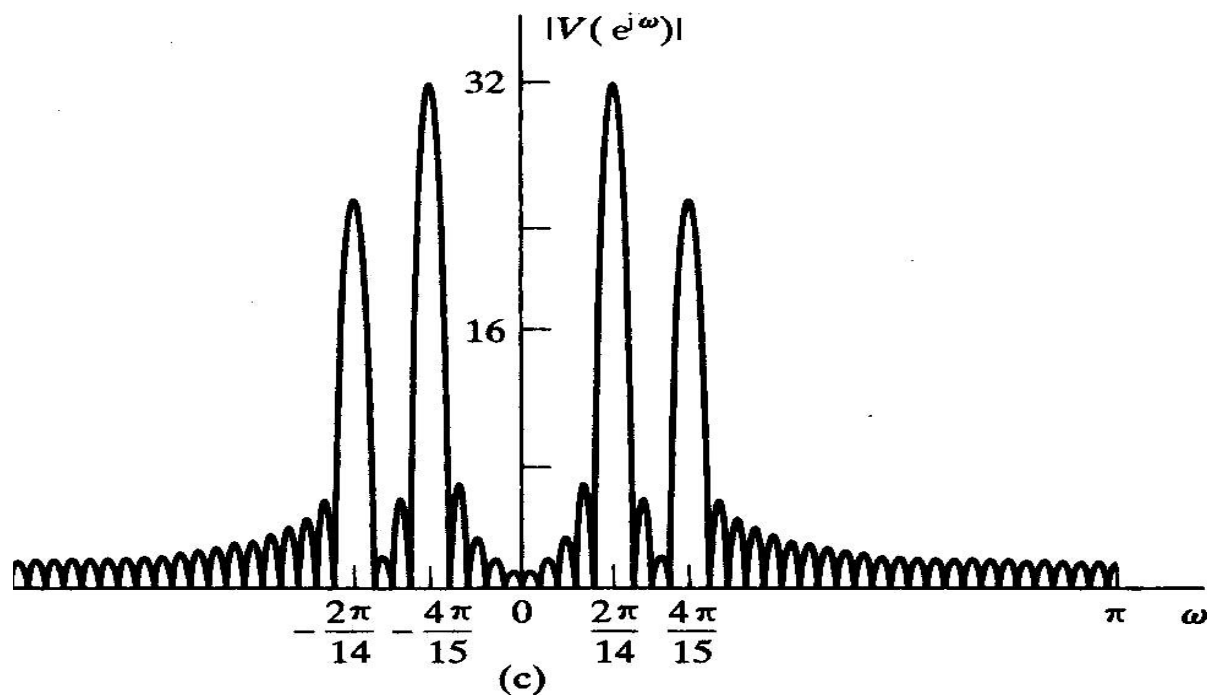
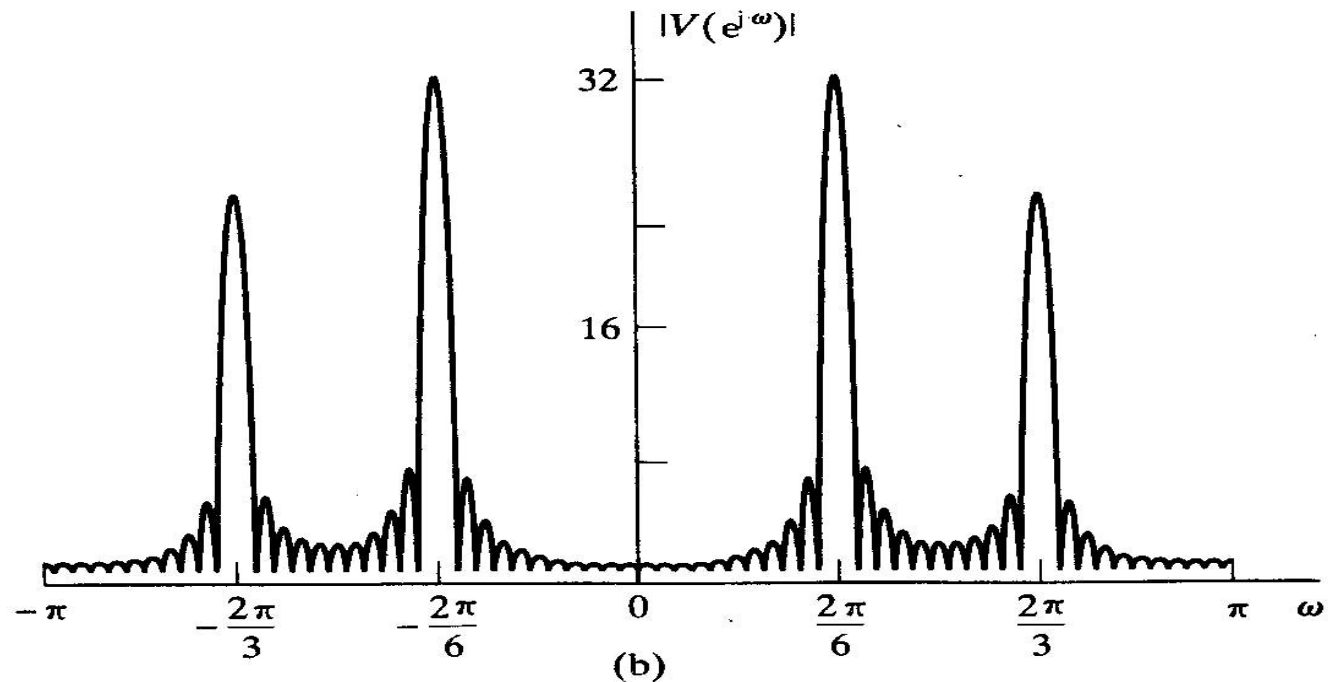
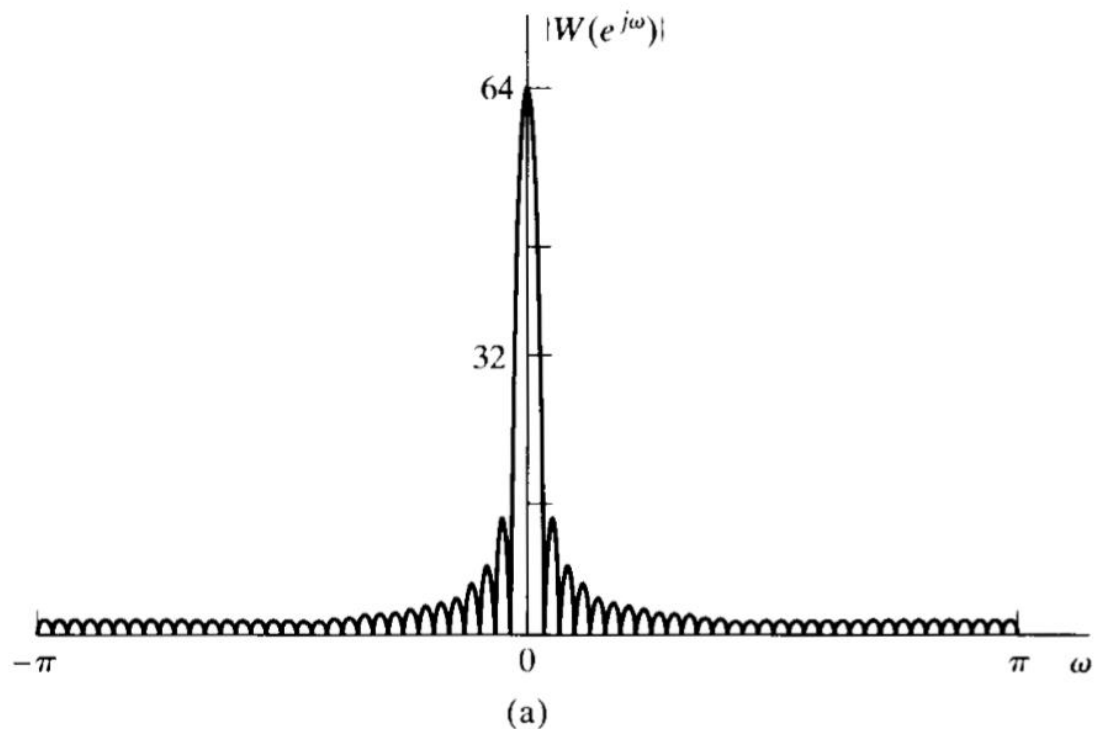
$$X(k) = \sum_{n=0}^{N-1} x(n)e^{-j\frac{2\pi}{N}nk}$$



A0=1 A1=0.75

# 频谱泄漏

- 时域上的截断（相乘），在频域上表现为周期卷积，这将会对信号的频谱起平滑和能量的分散，即**频谱泄漏**。



# 分辨力降低

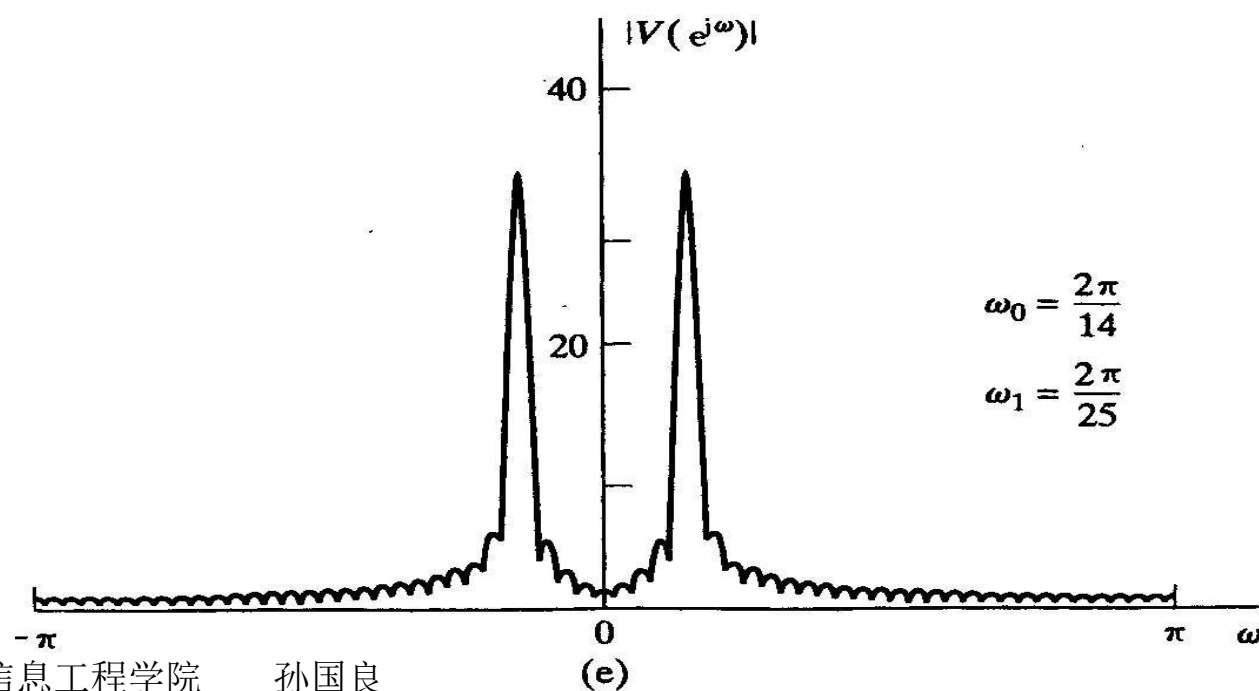
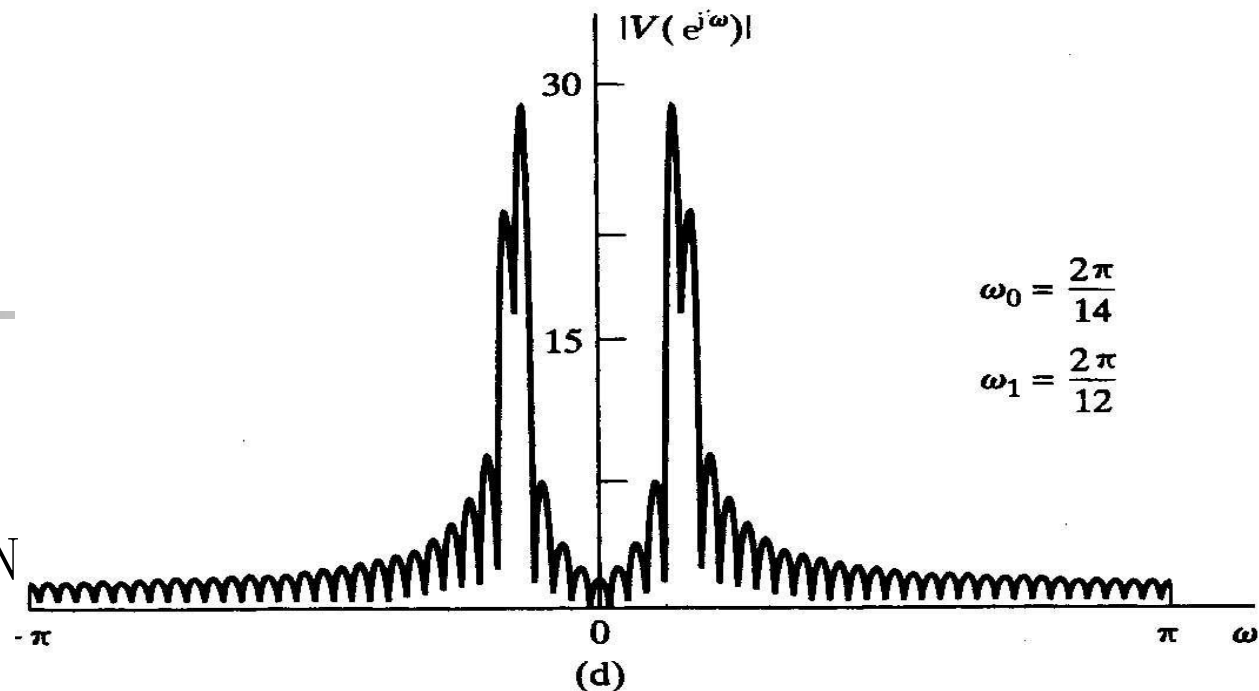
- 加窗使得频谱平滑或展宽，降低了频率上靠近的正弦信号的**分辨能力**
- 分辨力取决于窗函数的主瓣宽度  $2\pi/N$  其对应的模拟带宽为：

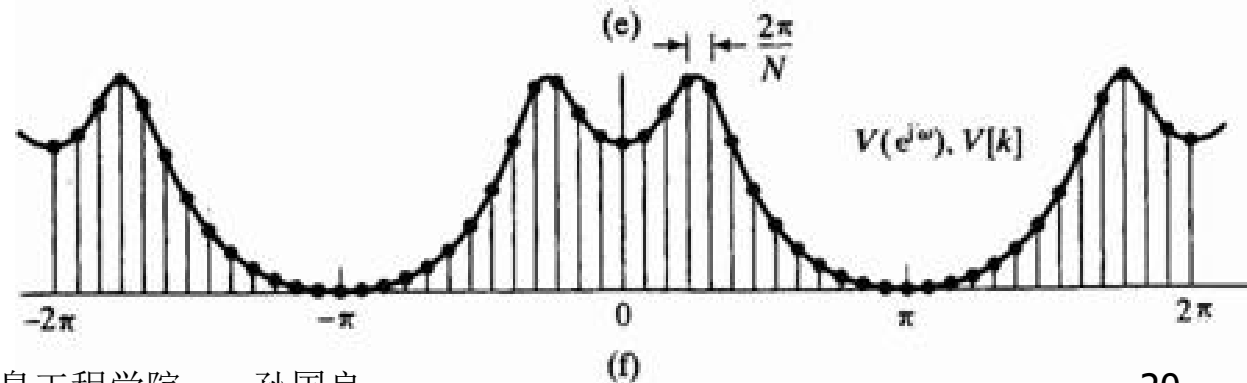
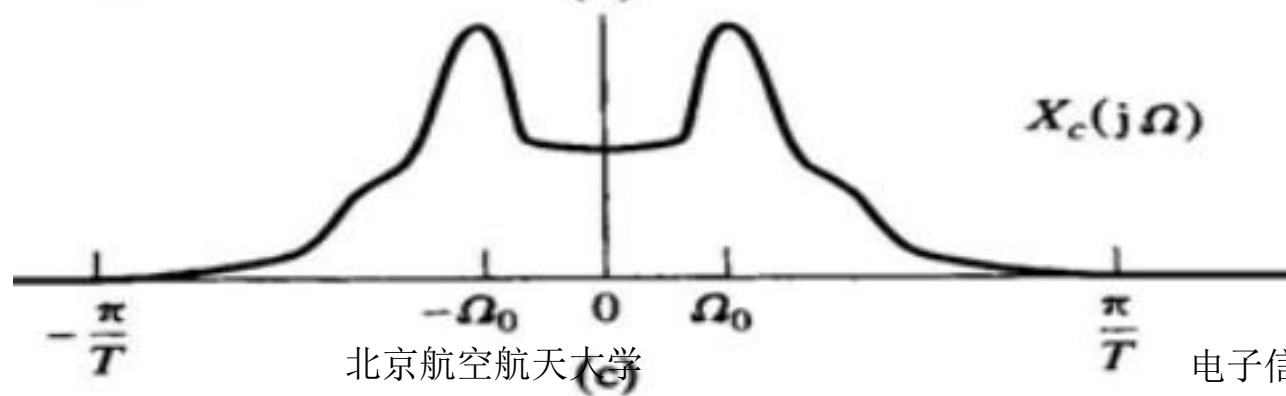
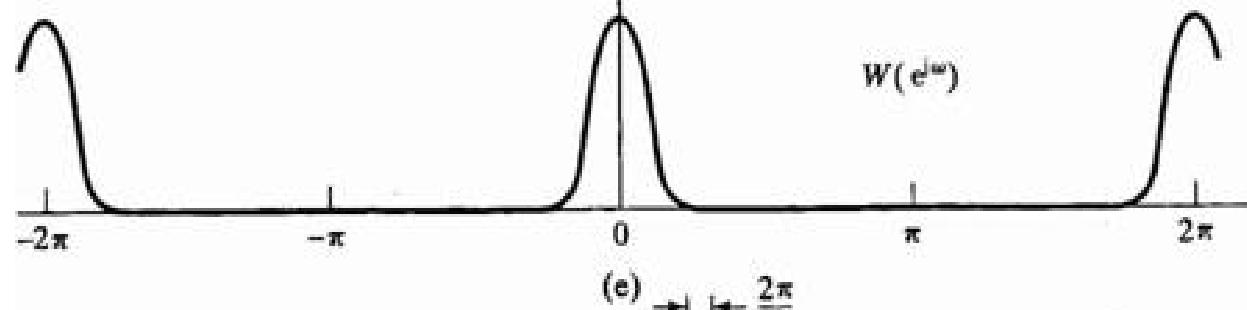
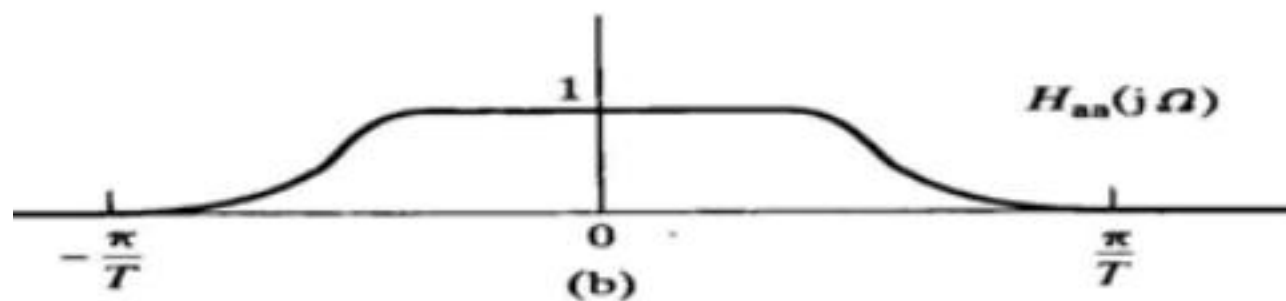
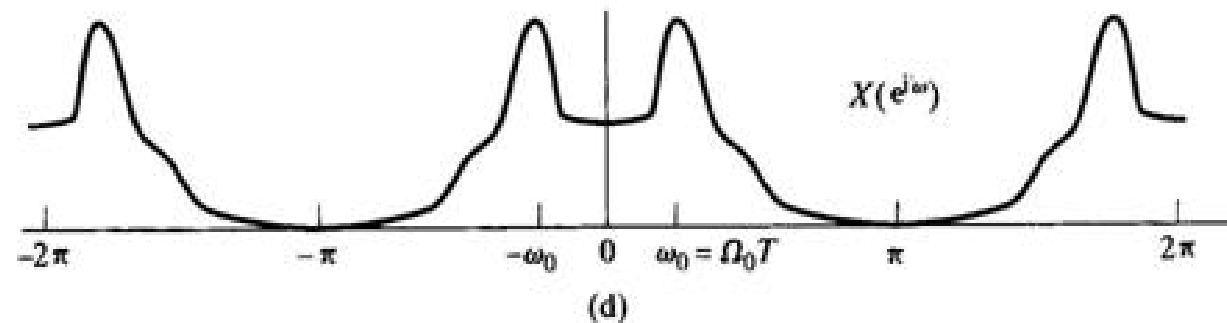
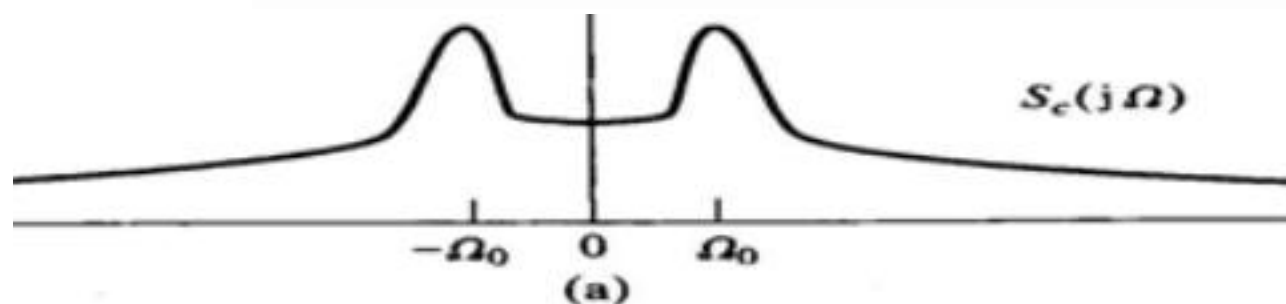
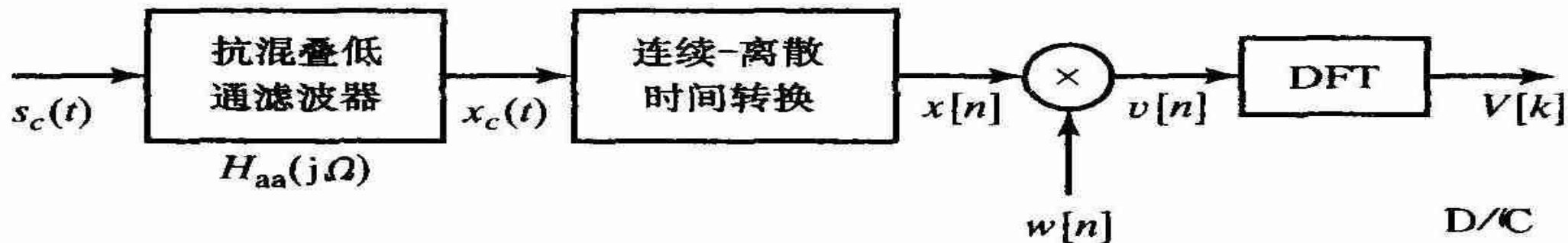
$$\Delta\Omega = \frac{2\pi}{NT} = \frac{2\pi}{L}$$

- 模拟频率**分辨率**（**HZ**）定义为

$$\Delta = \frac{1}{L}$$

- 物理含义：频率的分辨能力取决于（**有效**）时间窗的长度







# DFT谱采样---栅栏效应

- **DFT**计算频谱是**DTFT**连续谱采样，只能看到真实频谱的离散点，称之为“**栅栏效应**”。
- 离散信号的离散频率值

$$\omega_k = \frac{2\pi}{N} k \quad k = 0, 1, 2, \dots, N - 1$$

- 由于采样的缘故，所得到的**离散频率**  $\omega$  信号的**原始频率**  $\Omega$  之间的关系为：

$$\omega = \Omega T$$

- 所以对应于信号的连续域**频率**为：

$$\omega_k = \frac{2\pi}{N} k = \frac{2\pi F_0}{f_s} k = \Omega_k T$$
$$\Omega_k = \frac{\omega_k}{T} = k \frac{2\pi}{NT} = \frac{k}{N} \Omega_s \Rightarrow f_k = \frac{k}{N} f_s$$

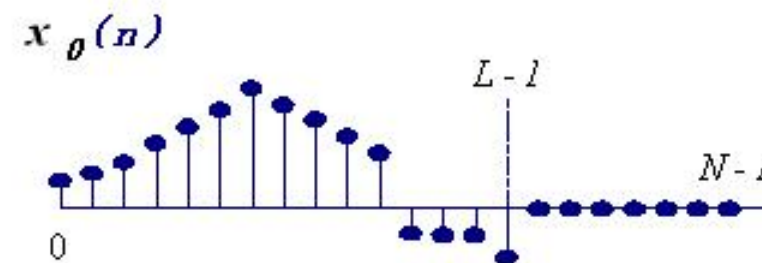
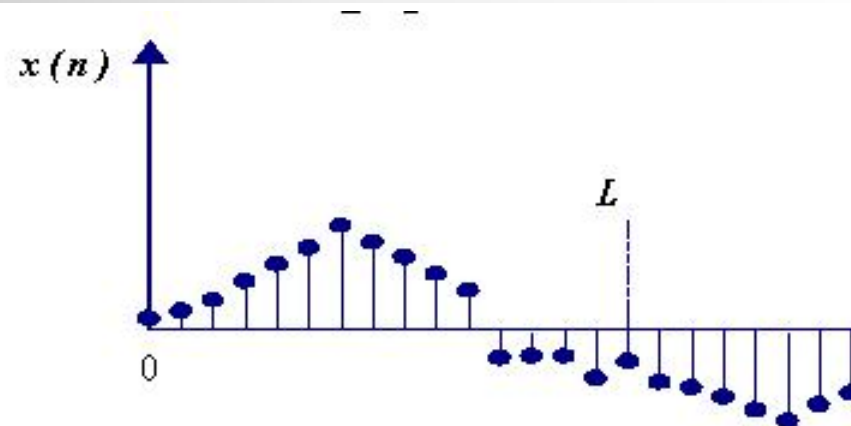
# 数字频率步进！=频率分辨力

- DFT所计算频点间隔（频率步进）：

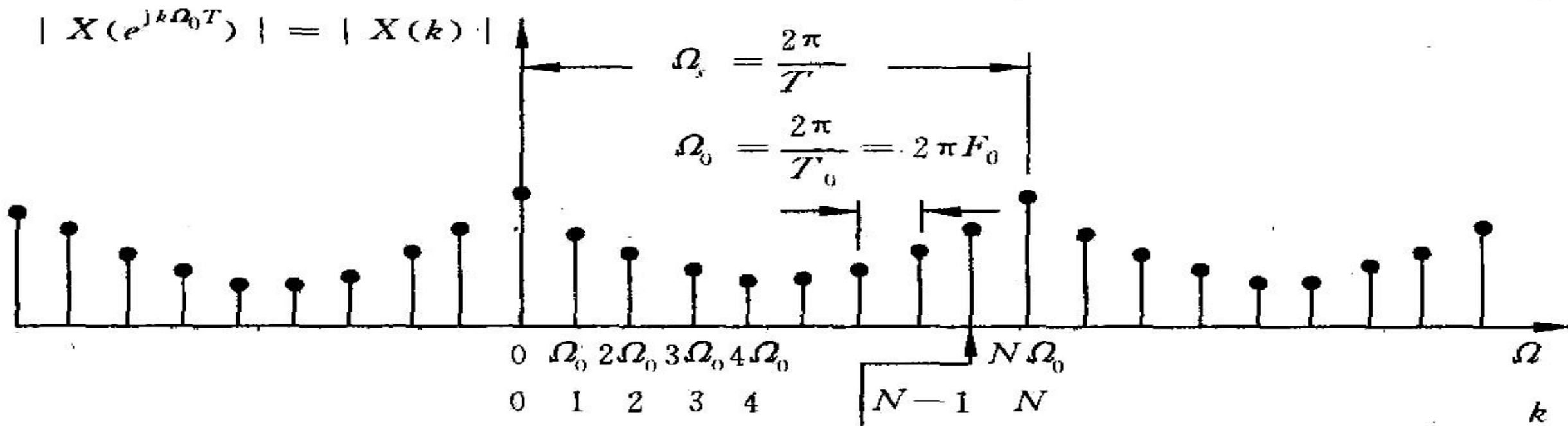
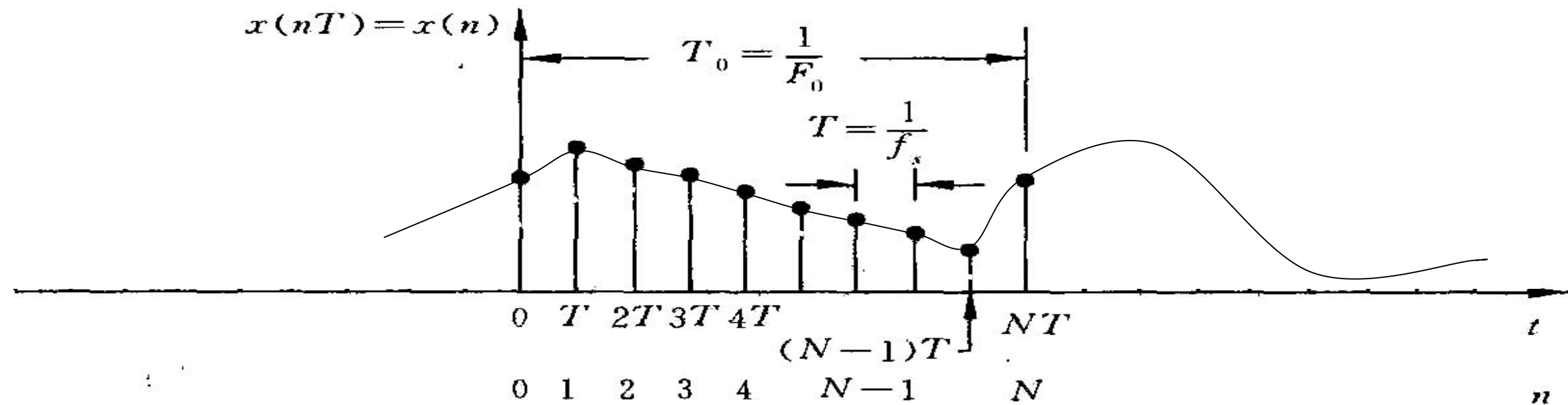
$$f_k = \frac{k}{N} f_s \quad \Delta f = \frac{f_s}{N} =$$

- 数字频率步进率和频率分辨力虽然形式上相同，但其存在根本区别，之间没有必然联系。

- 有效时间窗不变的情况下，通过对有效数据补零的方法，可以提高数字频率的分辨率，减小栅栏效应。但不能提高模拟频率分辨率。
- 有效时间窗固定不变时，采取加密采样点数N，减小采样周期T是不能提高模拟频率分辨率，也不能提高数字频率步进率。

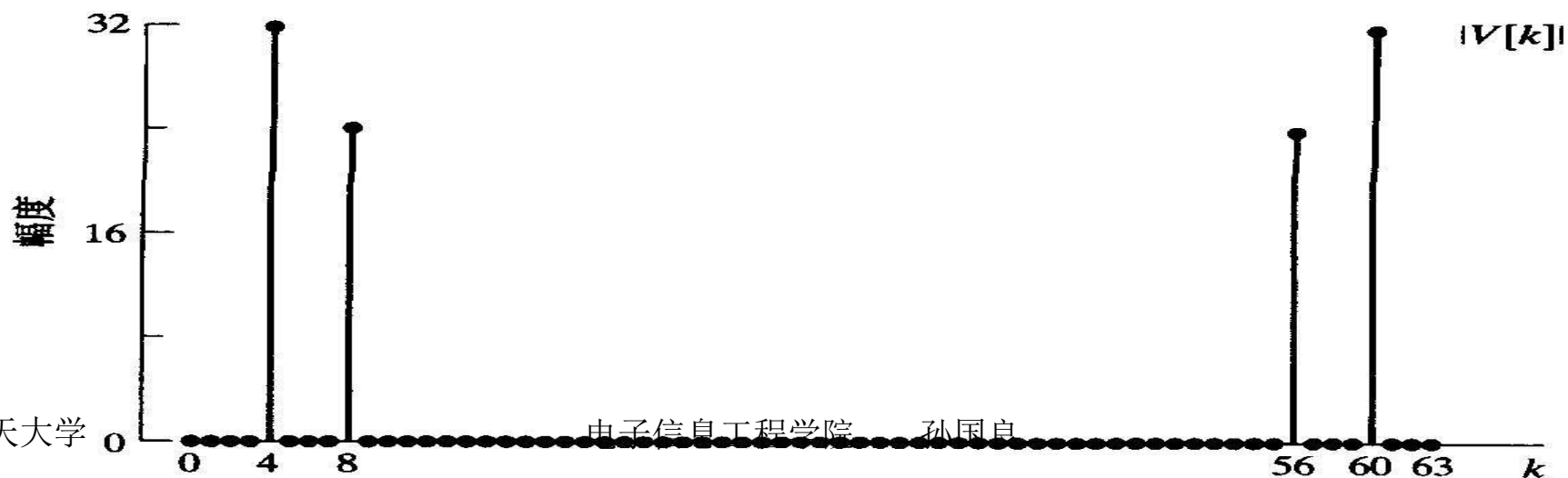
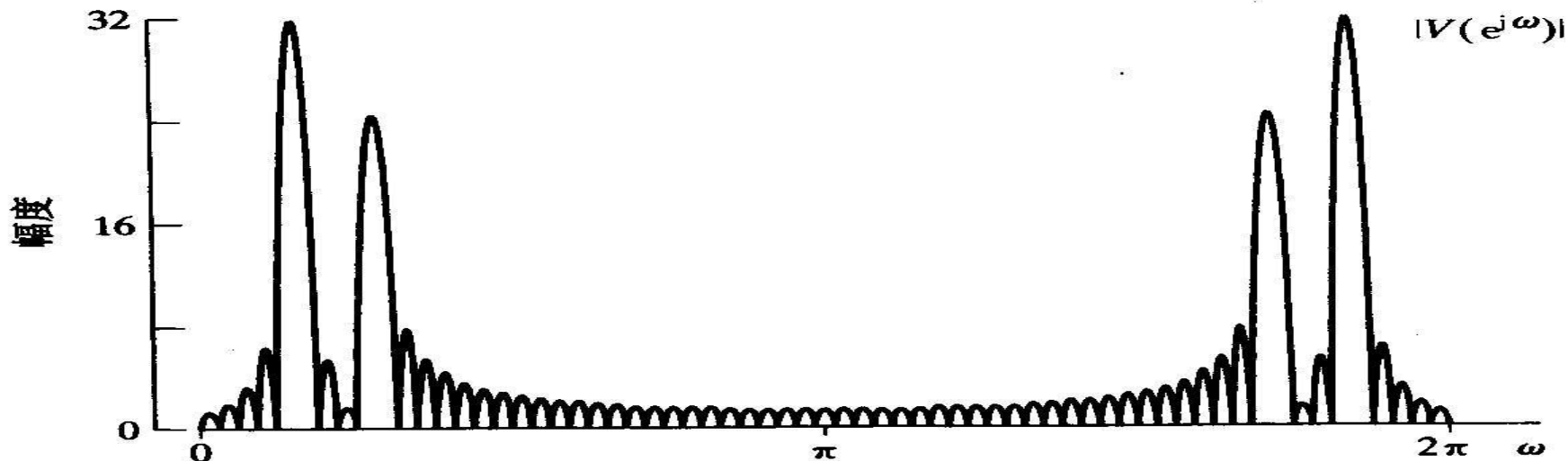


$$\Delta\Omega = \frac{2\pi}{NT} = \frac{2\pi}{L}$$



# 栅栏效应对频谱的“失真”

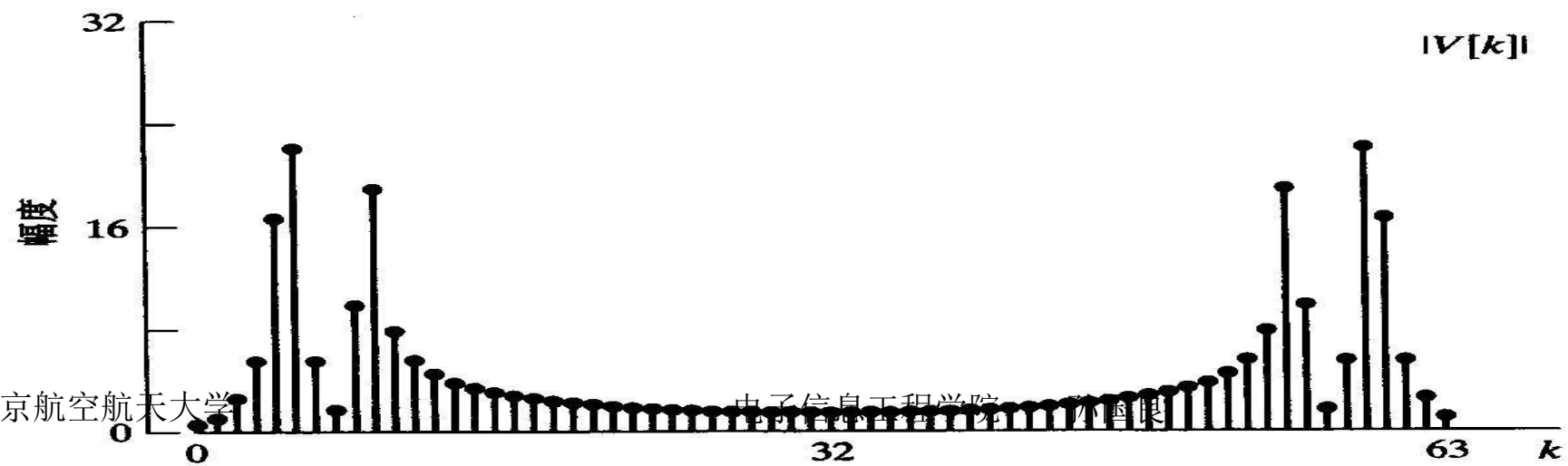
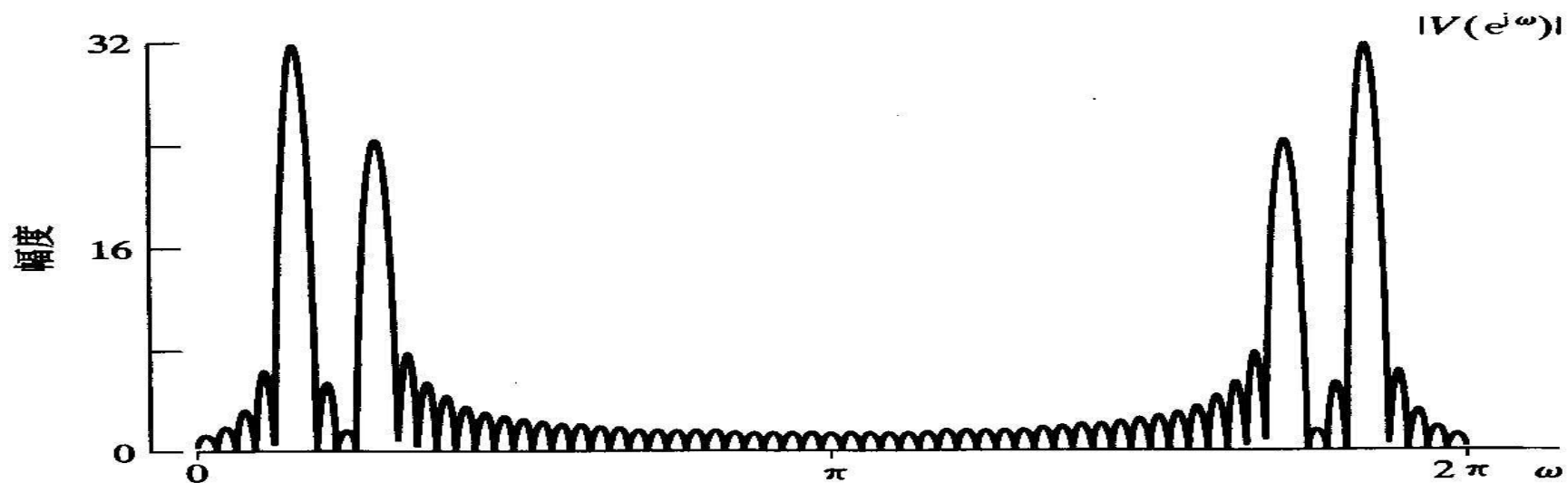
$$\omega_0 = \frac{2\pi}{16} = \frac{2\pi}{64} * 4$$
$$\omega_1 = \frac{2\pi}{8} = \frac{2\pi}{64} * 8$$



纯净的‘假象’  
信号谱位于过零点  
处

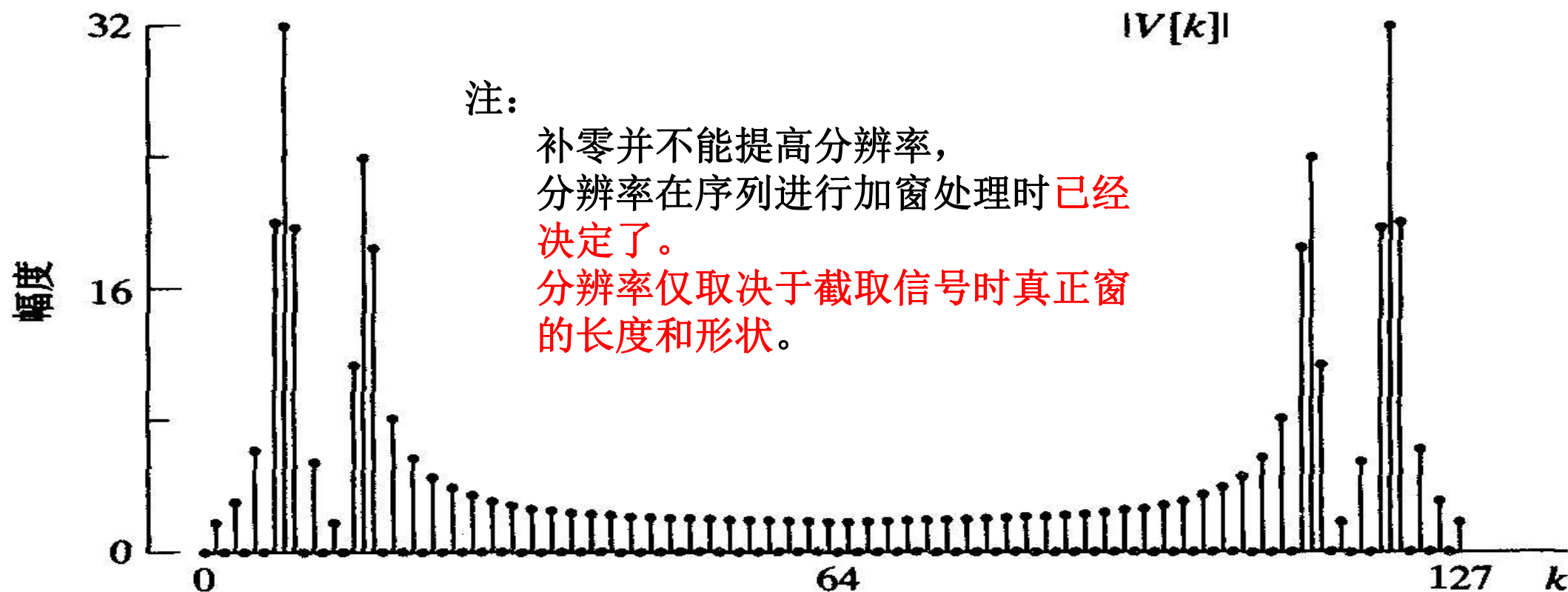


# 信号频谱不过零点时，衍生杂余分量



# 补零减弱栅栏效应，逼近真实

- 用**序列补零**将频谱采样点增加为**128**



# 频谱分析性能对时间窗的要求

- 分辨率降低和频谱泄漏是信号加窗的两种影响。
  - **分辨率**主要受窗函数**主瓣宽度**的影响；
  - 频谱**泄漏**主要指副瓣能量泄漏，一般不指主瓣能量的泄漏，主要取决于窗函数的**主瓣和副瓣幅值相对比例**。
- 进行频谱分析时，往往希望有**高分辨率**和**小的频谱泄漏**，也就是希望**时间窗有小的主瓣宽度和相对小旁瓣幅度**。
  - 在具体选择窗函数时，要在两者之间进行**折衷**。
  - 矩形窗函数在给定长度时具有最小的主瓣宽度，但是却有最大的相对旁瓣幅度。

# 频谱分析用的可调时间窗---凯泽窗

$$w(n) = \frac{I_0(\beta \sqrt{1 - [(n - \alpha) / \alpha]^2})}{I_0(\beta)} \quad 0 \leq n \leq N - 1 \quad \alpha = \frac{N - 1}{2}$$

- Kaiser和Schafer证明，相对旁瓣幅度 $A_{sl}$ 基本上与窗长度 $N$ 无关，只取决于窗的形状参数  $\beta$ ，它们之间的近似表达式为：

$$\beta = \begin{cases} 0 & A_{sl} < 13.26 \\ 0.76609 (A_{sl} - 13.26)^{0.4} + 0.09834 (A_{sl} - 13.26) & 13.26 < A_{sl} < 60 \\ 0.12438 (A_{sl} + 6.3) & 60 < A_{sl} < 120 \end{cases}$$

- 主瓣宽度 $\Delta_{ml}$ 主要取决于窗的长度 $N$ 。主瓣宽度、相对旁瓣幅度和窗长度之间的折衷关系的近似表达式为：

$$N \approx \frac{24 \pi (A_{sl} - 12)}{155 \Delta_{ml}} + 1$$

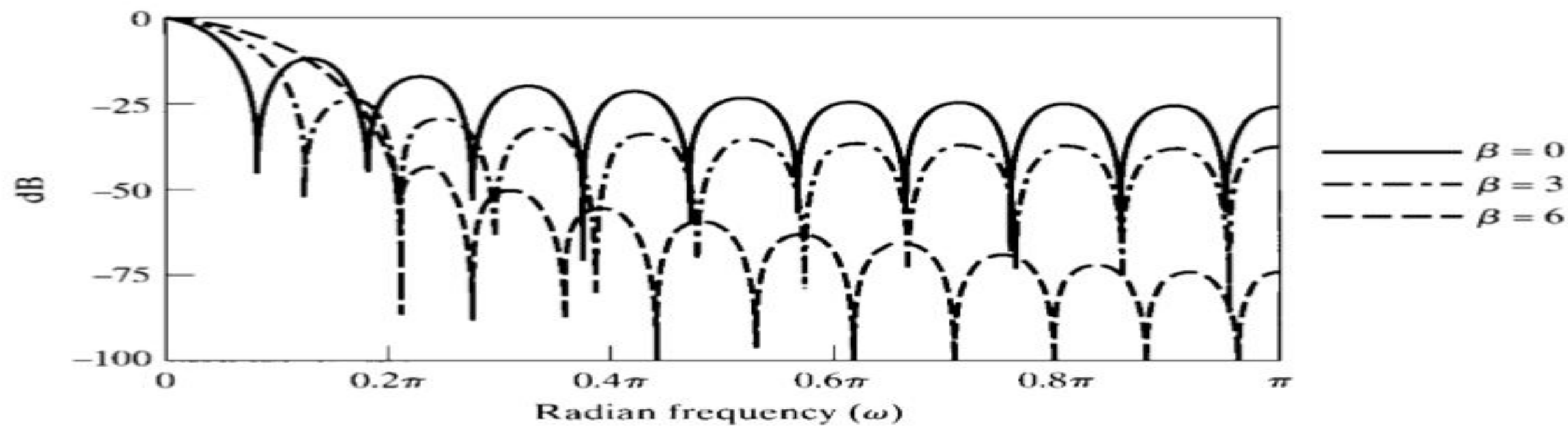
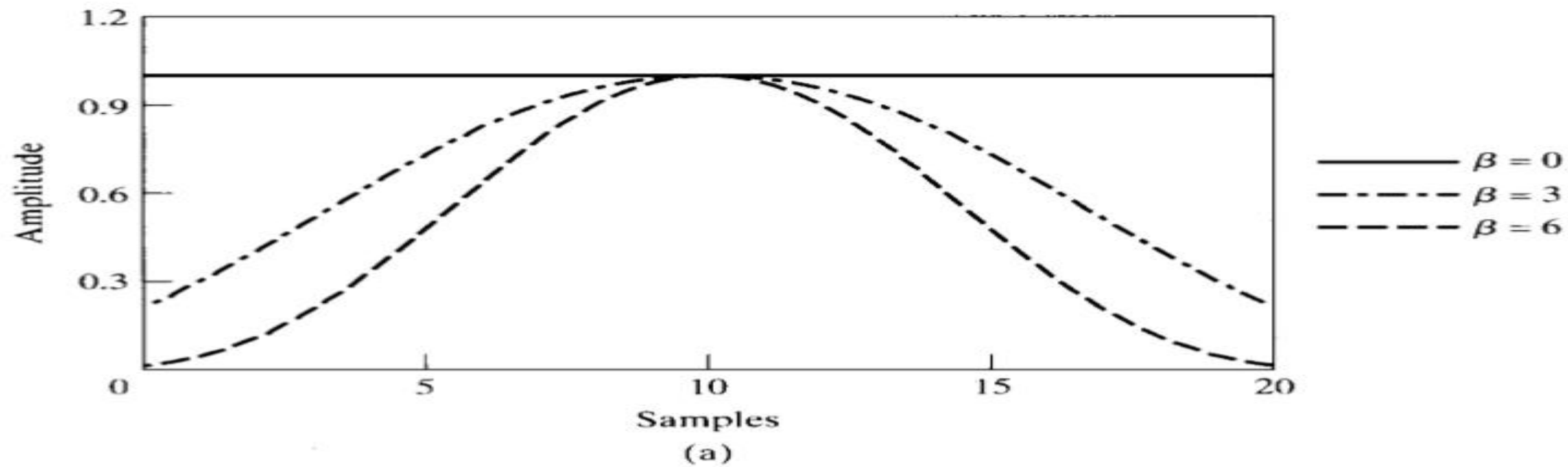
# 信号分析与滤波器设计的区别

$$\beta = \begin{cases} 0 & A_{sl} < 13.26 \\ 0.76609 (A_{sl} - 13.26)^{0.4} + 0.09834 (A_{sl} - 13.26) & 13.26 < A_{sl} < 60 \\ 0.12438 (A_{sl} + 6.3) & 60 < A_{sl} < 120 \end{cases}$$

$$N \approx \frac{24\pi (A_{sl} + 12)}{155 \Delta_{ml}} + 1$$

$$M = \frac{\delta_2 - 7.95}{2.286 \Delta_w}$$

$$\beta = \begin{cases} 0.1102 (\delta_2 - 8.7), \delta_2 \geq 50 \text{ dB} \\ 0.5842 (\delta_2 - 21)^{0.4} + 0.07886 (\delta_2 - 21), 21 \text{ dB} < \delta_2 < 50 \text{ dB} \\ 0, \delta_2 \leq 21 \text{ dB} \end{cases}$$





# DFT分析参数的选取

- 信号的分析，并不是在 $NT=L$ 为固定值的情况下， $N$ 、 $T$ 就可以任意取值。
  - 如果 $N$ 太小， $T$ 太大，则无法完成信号的谱分析；
  - 若 $N$ 太大， $T$ 太小，加大了运算量而且没必要。
  - 那么什么样的 $N$ 、 $T$ 选择比较合适呢？
- $T$ 的选取要满足无失真采样的条件：
  - 当信号是带限未知时， $T$ 越小越好；在信号带限已知时， $T < \frac{1}{2f_H}$ 。
  - 在此基础上再确定 $N$ ，要留有一定的余度。

$$f_H = f_c + \frac{1}{L}$$



## Ex

- 考虑带限连续信号  $x_c(t)$ ，且当  $|\Omega| > 2\pi * 2500$  时， $X_c(j\Omega) = 0$   
我们要利用上图中的系统来估计连续时间谱  $X_c(j\Omega)$ 。
- 为了在尽可能少的基二**FFT**计算量的条件下使模拟频率的分辨率不大于**10Hz**，则所需要截断多长的信号段？  
采样周期**T**为何值？样本数**N**的最小值应为多少？

- 
- 解：由于要求模拟频率的分辨率不大于**10Hz**，所以：

$$\Delta_s = \frac{1}{L} \leq 10$$

- 截取的信号段长度至少为：**0.1**秒。为了采样不使信号失真，则由采样定理可知：

$$T \leq 0.0002 \text{ s}$$

- 从而采样周期  $f_s \geq 2 * 2500 \text{ Hz}$ ，在**0.1**秒内只能采到**500**个点。所以样本数的最小值为：**500**。
- 为了利用**FFT**，采样点数应为**512**
  - 可以多采**12**个数据，也可以采用补零的方法

## 二、利用DFT(FFT)实现LTI系统(FIR)

### ■ 出发点:

- 线性时不变系统可以用线性卷积和来实现和描述;
- 圆周卷积和在满足一定约束的条件下可以得到线性卷积;
- 圆周卷积和可以利用DFT来完成
- DFT可以用FFT快速计算

$$\begin{array}{c} x(n) \\ \longrightarrow \end{array} \boxed{h(n)} \begin{array}{c} \xrightarrow{y(n)} \end{array} \quad y(n) = x(n) * h(n)$$

$$X(k) = DFT [x(n)]$$

$$H(k) = DFT [h(n)]$$

$$y(n) = IDFT [X(k)H(k)]$$



# 存在的问题

- 1) 输入信号无限长（如语音滤波）。
- 2) 尽管可以存储长时间的输入信号，但其DFT实现不现实
  - 输入和冲激响应长度严重不对称，需要大量补零，浪费运算量；
  - 采集完所有输入样本后才能计算滤波输出，导致有很大的处理延迟，损失实时性；

# 解决方法

- 采用块卷积
  - 将输入信号分割成多段，
  - 对每段信号进行DFT处理
  - 适当处理后进行衔接
- 块卷积方法
  - 重叠相加法
  - 重叠保留法



# 1) 重叠相加法 (Overlap)

- 设 $h(n)$ 的点数为 $M$ ， $x(n)$ 为很长的序列。
  - 将 $x(n)$ 分解为很多段，每段为 $L$ 点，
  - $L$ 选择成和 $M$ 的数量级相同
  - 用 $x_i(n)$ 表示第 $i$ 段：

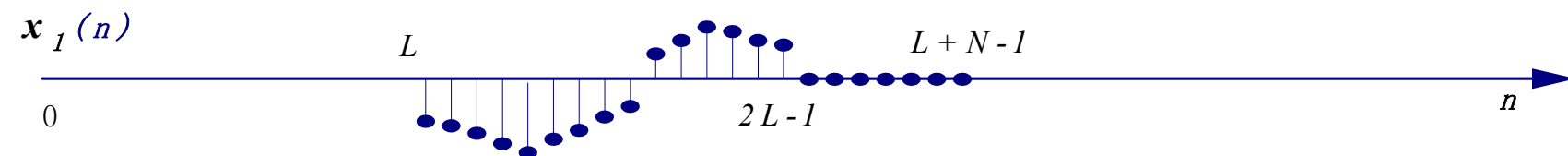
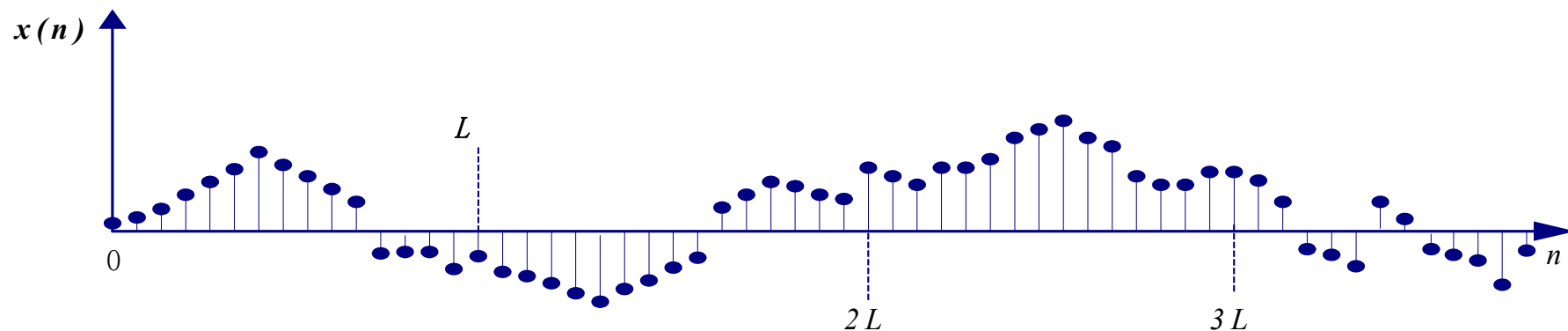
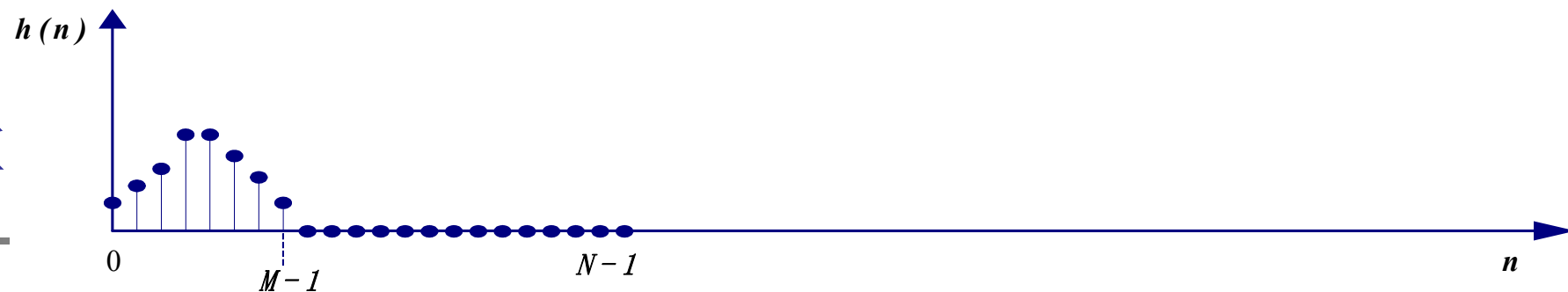
$$x_i(n) = \begin{cases} x(n), & iL \leq n \leq (i+1)L - 1 \\ 0, & \text{其他 } n \end{cases}$$

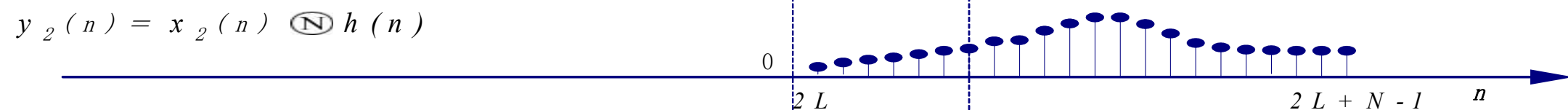
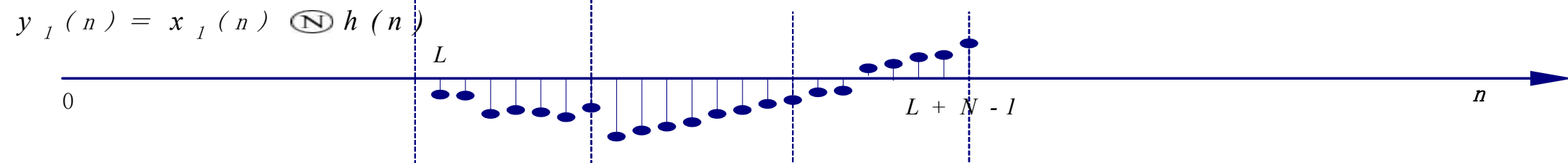
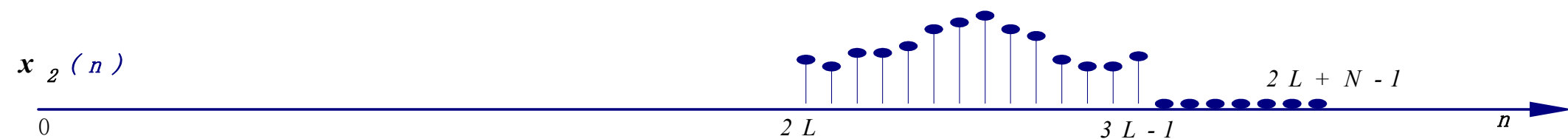
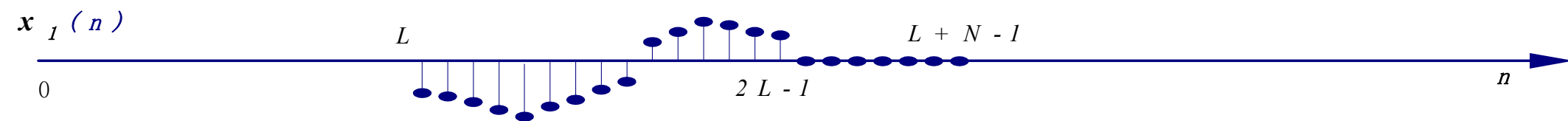
$$x(n) = \sum_{i=0}^{\infty} x_i(n) \quad y(n) = x(n) * h(n) = \sum_{i=0}^{\infty} x_i(n) * h(n)$$



# 输出重叠

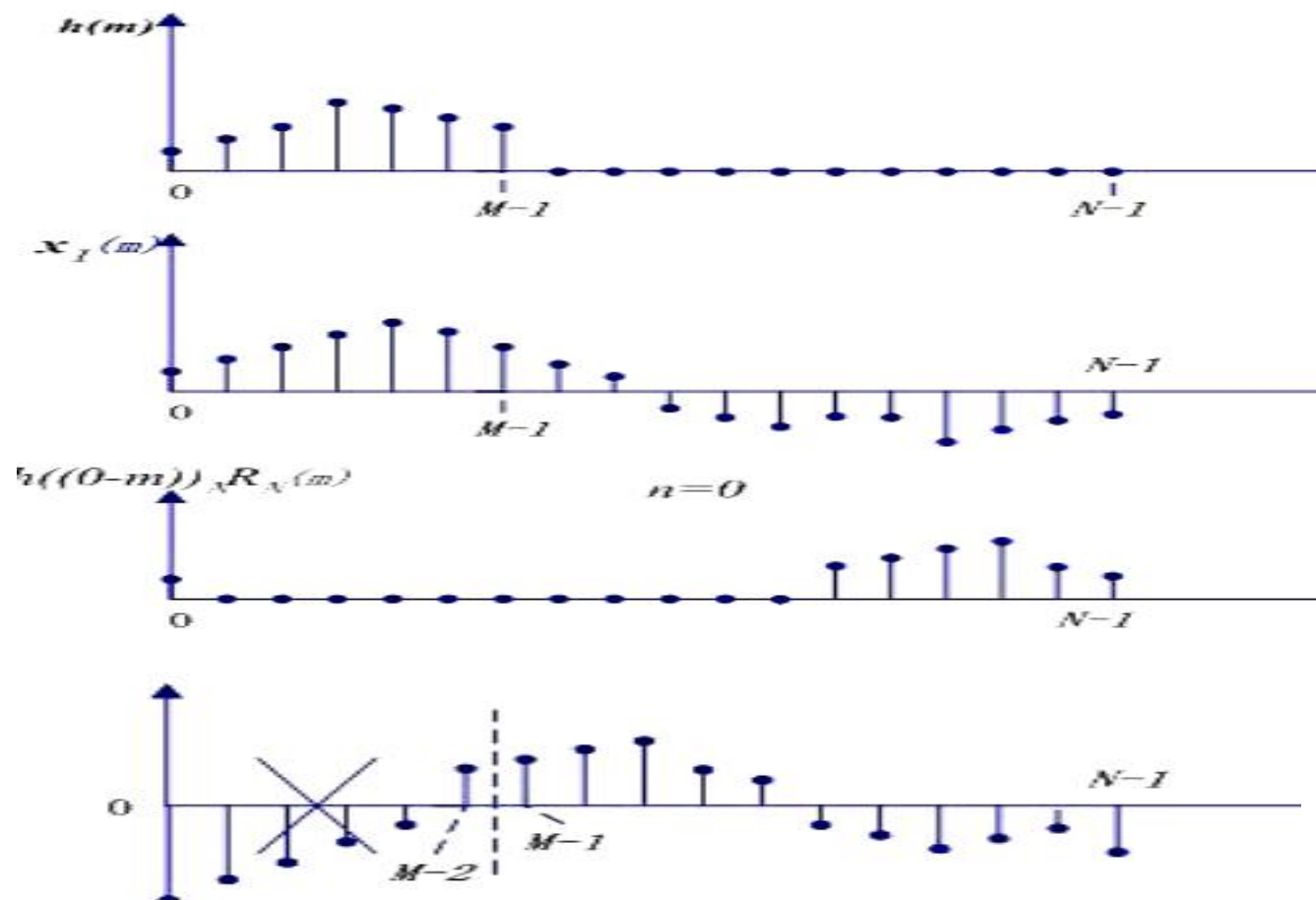
- $h(n)$ 为M点
- $x_i(n)$ 为L点
- $y_i(n)$ 为  $(L+M-1)$  点 (设 $N=L+M-1$ ) ,
- 相邻输出序列 $y_i(n)$ ,  $y_{i+1}(n)$ 必然有  $(M-1)$  个点发生重叠

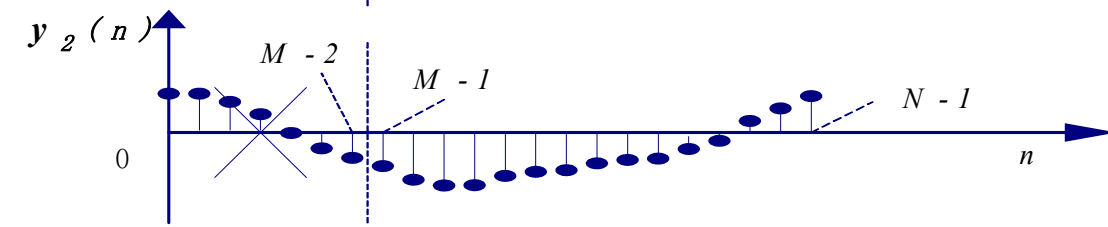
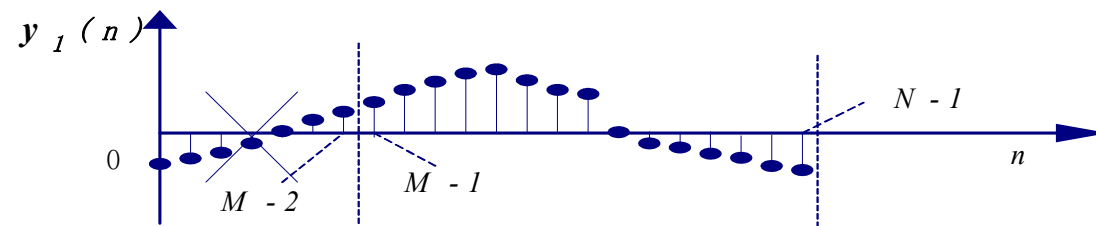
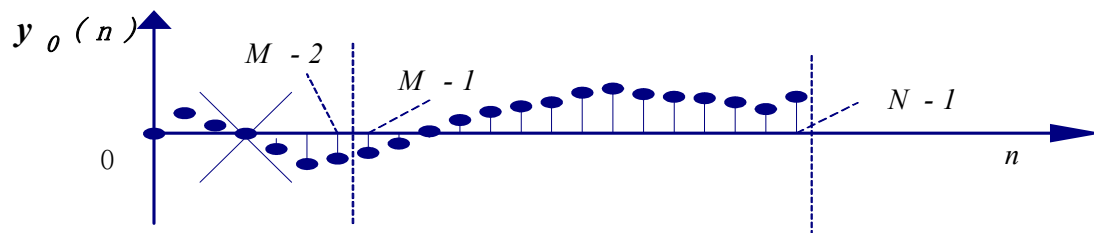
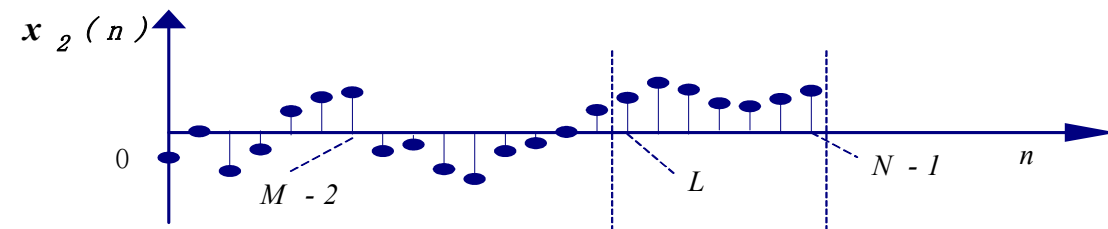
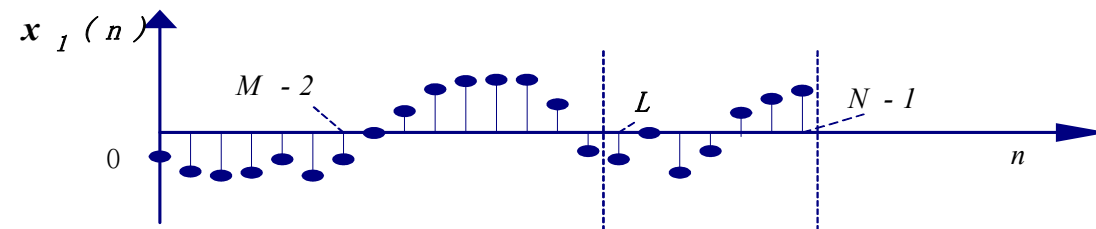
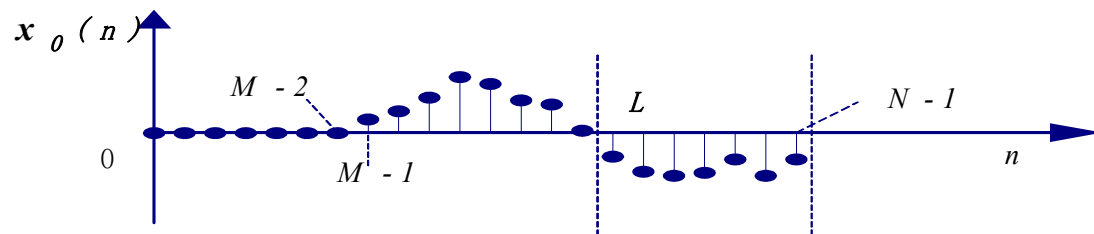
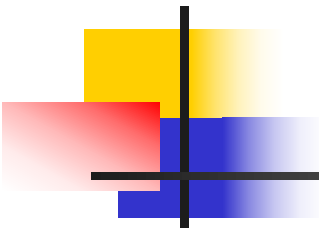




## 2) 重叠保留法( Oversave)

- $x(n)$ 分段，每段 $L$ 个点
- 输入序列 $x_i(n)$ 中不再补零，而是在每一段的前边补上前一段保留下来的 $(M-1)$ 个输入序列值，组成 $L+M-1$ 点序列。
- 每段圆周卷积结果的前 $(M-1)$ 个点的值
  - 不满足因果系统的要求，
  - 不等于线性卷积值





# 作业

- 10.1
- 10.4
- 10.5
- 10.9





# 谢 谢

-----● 授课教师：孙国良 ●-----

Email: [mrsgl@buaa.edu.cn](mailto:mrsgl@buaa.edu.cn)