第一章 离散信号与系统

1.1 因果性、记忆性

是否用到了 x[n] 的未来值/过去值, 而不是其他可计算的值。

1.2 LTI 系统

既是线性系统,又是时不变系统,称为 LTI 系统。其**充要条件**是 $y[n] = x[n] \otimes h[n]$ 。 无法直接判断可以假设是一个 LTI 系统:

$$\frac{1}{2^n} \to \frac{1}{4^n}$$

假设是:

• LTI:

$$y[n] = \sum_{-\infty}^{+\infty} h[k] \frac{1}{2^{n-k}} = \frac{1}{2^n} h_1[k]$$

矛盾!

• TI and Linear:

$$\frac{1}{2^{n-1}} \to \frac{1}{4^{n-1}} \\ 2\frac{1}{2^n} \to 4\frac{1}{4^n}$$

1.2.1 因果系统

$$h[n] = h[n]u[n]$$

1.2.2 稳定系统

$$\sum_{-\infty}^{+\infty} |h(n)| = M < +\infty$$

1.2.3 特征频率与 LTI 系统

若是有一个无限长的指数信号,那么有一个单频信号:

2.27

$$\left[e^{j\omega_0 n}\right] \to \sum_{k=-\infty}^{+\infty} 2\pi\delta\left(\omega - \omega_0 + 2k\pi\right)$$

但是若是有限长,那么就有引入除去 ω_0 的分量,因此对于一个 LTI 系统来说,放大 $e^{j\omega_0n}$ 和 $e^{j\omega_0n}u[n]$ 需要的系统函数是不一样的。

1.3 差分方程的阶数

输出 y[n-i] 最高值和最低值 i 的差值。

LCCDE = linear constant-coefficient difference equation .

第二章 DTFT 变换

2.1 频域阶数

2.42

若是在原有的系统函数多一个 z ,说明原来 a_0z^0 的位置变成了 a_0z^1 ,也就是 a_n 变成了 a_{n+1} 。同理 z^{-1} 对应 a_{n-1} 。由于使用因果信号, z^{-1} 的形式更合适。

2.2 系统设计

2.56,

需要一个系统时,可以通过其定义入手,配凑式子。同时,对于特定的频率分量,其幅度、角度变换是由其频率响应改变的。

2.3 DTFT 推导细节

$$\begin{split} DTFT^{-1}\left[X\left(e^{j\omega}\right)\right] &= \frac{1}{2\pi} \int_{-\pi}^{\pi} X\left(e^{j\omega}\right) e^{j\omega n} d\omega \\ &= \frac{1}{2\pi} \int_{-\pi}^{\pi} \left(\sum_{k=-\infty}^{+\infty} x(k) e^{-j\omega k}\right) e^{j\omega n} d\omega \\ &= \sum_{k=-\infty}^{+\infty} x(k) \frac{1}{2\pi} \int_{-\pi}^{\pi} e^{-j\omega(k-n)} d\omega \\ &= \sum_{k=-\infty}^{+\infty} x(k) \delta(k-n) = x(n) \end{split}$$

注意 2π 与 $\delta(n)$ 的由来: 单位虚数的积分。

将 IDTFT 展开成累加的形式,实际上是将不同频率的分量逐个恢复:

$$\begin{split} X(n) &= \frac{1}{2\pi} \int_{-\pi}^{\pi} X\left(e^{j\omega}\right) e^{j\omega n} d\omega \\ &= \frac{1}{2\pi} \sum_{-\infty}^{+\infty} X\left(e^{jk\Delta\omega}\right) e^{jk\Delta\omega n} \Delta\omega = \sum_{-\infty}^{+\infty} \frac{\left[X\left(e^{jk\Delta\omega}\right)\Delta\omega\right]}{2\pi} e^{jk\Delta\omega n} \end{split}$$

表 2.1: DTFT 变换对

时域函数	DTFT
$\delta(n)$	1
1	$\sum_{k=-\infty}^{+\infty} 2\pi\delta(\omega + 2k\pi)$
u(n)	$\frac{1}{1 - e^{-j\omega}} + \sum_{k = -\infty}^{+\infty} \pi \delta(\omega + 2k\pi)$
$e^{j\omega_0 n}$	$\sum_{k=-\infty}^{+\infty} 2\pi\delta \left(\omega - \omega_0 + 2k\pi\right)$
$W_N(n)$	$\frac{\sin\left(\frac{\omega N}{2}\right)}{\sin\left(\frac{\omega}{2}\right)}e^{-j\frac{(N-1)\omega}{2}}$
$\frac{w_c}{\pi} \frac{\sin\left[w_c(n-\alpha)\right]}{w_c(n-\alpha)}$	$e^{-j\omega\alpha}(u(\omega+\omega_c)-u(\omega-\omega_c))$

表 2.2: DTFT 变换性质

性质名称	表达式
线性	
时域平移-频域调制	$x(n-m) \to e^{-jwm} X\left(e^{jw}\right)$
时域调制-频域平移	$e^{jnw}x(n) \rightarrow X\left(e^{j(w-w_0)}\right)$
时域翻折	$x(-n) \to X(e^{-j\omega})$
帕塞瓦尔定理	$\sum_{n=-\infty}^{\infty} x(n)y^*(n) = \frac{1}{2\pi} \int_{-\pi}^{\pi} X(e^{jw}) Y^*(e^{jw}) dw$ $\sum_{n=-\infty}^{\infty} x(n) ^2 = \frac{1}{2\pi} \int_{-\pi}^{\pi} X(e^{jw}) ^2 dw$

可以利用帕赛瓦尔定理解决一些求和式子: Slide P83.

2.4 DTFT 对称性

共轭对称与共轭反对称序列定义,实际上是实部、虚部分别的奇偶对称:

$$x_e(n) = x_e^*(-n)$$

$$x_o(n) = -x_o^*(-n)$$

任意序列都可以进行共轭分解:

$$x(n) = x_e(n) + x_o(n)$$

$$x(-n) = x_e(-n) + x_o(-n) = x_e^*(n) - x_o^*(n)$$

$$x_e(n) = \frac{1}{2} [x(n) + x^*(-n)]$$

$$x_o(n) = \frac{1}{2} [x(n) - x^*(-n)]$$

根据下一小节的性质:

$$X_{e} (e^{j\omega}) = \frac{1}{2} \left[X (e^{j\omega}) + X^{*} (e^{-j\omega}) \right]$$
$$X_{o} (e^{j\omega}) = \frac{1}{2} \left[X (e^{j\omega}) - X^{*} (e^{-j\omega}) \right]$$

同样的对频域函数进行变换:

$$X(e^{j\omega}) = X_e(e^{j\omega}) + X_o(e^{-j\omega})$$

$$X_e (e^{j\omega}) = \frac{1}{2} \left[X (e^{j\omega}) + X^* (e^{-j\omega}) \right]$$
$$X_o (e^{j\omega}) = \frac{1}{2} \left[X (e^{j\omega}) - X^* (e^{-j\omega}) \right]$$

逆变换:

$$DTFT\{\operatorname{Re}[x(n)]\} = X_e\left(e^{j\omega}\right)$$

$$DTFT\{j\operatorname{Im}[x(n)]\} = X_o\left(e^{j\omega}\right)$$

2.5 变换共轭性质

具有普适性。

$$\mathcal{Z}[x^*[n]] = \sum_{n = -\infty}^{\infty} x^*[n] z^{-n} = \left(\sum_{n = -\infty}^{\infty} x[n] (z^*)^{-n}\right)^* = X^*(z^*)$$

$$\mathcal{Z}[x[-n]] = \sum_{n = -\infty}^{\infty} x[-n] z^{-n} = \sum_{n = -\infty}^{\infty} x[n] (z^{-1})^{-n} = X(z^{-1})$$

$$\mathcal{Z}[\operatorname{Re}\{x[n]\}] = \mathcal{Z}\left[\frac{x[n] + x^*[n]}{2}\right] = \frac{1}{2} [X(z) + X^*(z^*)]$$

$$\mathcal{Z}[\operatorname{Im}\{x[n]\}] = \mathcal{Z}\left[\frac{z[n] - x^*[n]}{2j}\right] = \frac{1}{2j} [X(z) - X^*(z^*)]$$

2.6 Z 变换

表 2.3: 2 变换对

时域函数	z 域函数	ROC
$\delta(n)$	1	全平面
u(n)	$\frac{z}{z-1}$	z > 1
$a^n u(n)$	$\frac{z}{z-a}$	z > a
$-a^n u(-n-1)$	$\frac{z}{z-a}$	z < a
$\cos(\omega_0 n)u(n)$	$\frac{z^2 - z\cos\omega_0}{z^2 - 2z\cos\omega_0 + 1}$	z > 1
$\sin(\omega_0 n)u(n)$	$\frac{z\sin\omega_0}{z^2 - 2z\cos\omega_0 + 1}$	z > 1

表 2.4: 2 变换性质

时域函数	z 域函数	原 ROC	变换后 ROC
x(-n)	$X(z^{-1})$	$\alpha < z < \beta$	$\frac{1}{\beta} < z < \frac{1}{\alpha}$
$x(\frac{n}{a}), a > 0$	$X(z^a)$	$\alpha < z < \beta$	$\alpha^{1/a} < z < \beta^{1/a}$
$x(n \pm m)$	双边 $z^{\pm m}X(z)$	1 1 '	$\alpha < z < \beta$
x(n-m)u(n)	单边 z^{-m} $\left[X(z) + \sum_{k=-m}^{-1} x(k)z^{-k} \right]$	z > a	z > a

见下页

时域函数	z 域函数	原 ROC	变换后 ROC
x(n+m)u(n)	单边 $z^m \left[X(z) - \sum_{k=0}^{m-1} x(k) z^{-k} \right]$	z > a	z > a
线性性			原收敛域的交集
nx(n)	$-z\frac{\mathrm{d}X(z)}{\mathrm{d}z}$	$\alpha < z < \beta$	$\alpha < z < \beta$
$n^m x(n)$	$\left[-z\frac{\mathrm{d}}{\mathrm{d}z}\right]^m X(z)$	$\alpha < z < \beta$	$\alpha < z < \beta$
$a^n x(n)$	$X(\frac{z}{a})$	$\alpha < z < \beta$	$\alpha < \left \frac{z}{a} \right < \beta$
$x_1(n)\otimes x_2(n)$	$X_1(z)X_2(z)$		原收敛域交集
$x_1(n)x_2(n)$	$\frac{1}{2\pi j} \oint_C X_1(\frac{z}{v}) X_2(v) v^{-1} \mathrm{d}v^{1}$		收敛域是边界的乘积

初值定理

$$\lim_{z \to \infty} X(z) = \lim_{z \to \infty} \sum_{n=0}^{\infty} x(n)z^{-n} = x(0)$$

终值定理

$$\lim_{z \to 1} (z - 1)X(z) = x(\infty)$$

帕塞瓦尔定理

$$|Y(z)|_{z=1} = \sum_{n=-\infty}^{+\infty} x(n)h^*(n) = \frac{1}{2\pi j} \oint_c X(v)H^*\left(\frac{1}{V^*}\right)_V^{-1} dV$$

2.7 逆 Z 变换

2.7.1 部分分式法

对于有理多项式

$$X(z) = \frac{B(z)}{A(z)} = \frac{b_m z^m + b_{m-1} z^{m-1} + \dots + b_1 z + b_0}{a_n z^n + a_{n-1} z^{n-1} + \dots + a_1 z + a_0}$$

对于分解得到的 $\frac{kz}{z-a}$

$$ka^{n}u(n), |z| > a$$
$$-ka^{n}u(-n-1), |z| < a$$

 $^{^{1}}$ 其中 C 是 $X_{1}(\frac{z}{v})X_{2}(v)$ 收敛域交集内的逆时针方向围线

2.8 从能量看 Z 变换与 DTFT

时域频域的能量是一致的、没有发生衰减。

2.9 Z变换与时域频域

为了解决非零状态系统,使用单边 Z 变换。 系统不改变频率:

$$y(n) = x(n)^*h(n)$$

$$= \sum_{m=-\infty}^{+\infty} h(m)e^{j[\omega_0(n-m)+\phi]} = e^{j[\omega_0n+\phi]} \sum_{m=-\infty}^{+\infty} h(m)e^{-j\omega_0m}$$

$$= e^{j[\omega_0n+\phi]}H(e^{j\omega_0}) = x(n)H(e^{j\omega_0})$$

2.10 系统零极点与频率响应

单位圆上的系统函数是频率响应。

2.10.1 幅度响应

- 原点处的零极点幅度无影响
- 经过单位圆上的零点幅度归零,单位圆附近的零点出现谷点
- 经过单位圆上的极点幅度无穷大,单位圆附近的极点出现峰点
- 远离零极点时影响较小

2.10.2 相位响应

- 原点处的零极点对相位影响为线性, 极点会引起滞后, 零点会引起超前
- 靠近单位圆的零极点会引起较大的波动
- 远离极点零点的位置变换比较平缓
- 单位圆外部零点或极点造成相位连续增长,而单位圆内零极点对相位影响则随频率 周期性归零

对于圆内外零极点:

• 圆内极点: 顺时针经过, 相位迅速延后

• 圆外极点: 顺时针经过, 相位迅速提前

• 圆内零点: 顺时针经过: 相位迅速提前

• 圆外零点: 顺时针经过: 相位迅速延后

过单位圆零点相位突变 π。

2.11 LTI 系统幅相特性分析

当给定幅度特性时,总可以通过共轭分解找到一个系统满足要求:

$$\left|H\left(e^{j\omega}\right)\right|^{2} = H\left(e^{j\omega}\right)H*\left(e^{j\omega}\right) = H(z)H^{*}\left(\frac{1}{z^{*}}\right)\Big|_{z=e^{j\omega}}$$

2.11.1 全通系统

频响恒为 1, 其零极点分别为 a 与 $1/a^*$:

$$H_{ap}(z) = \frac{z^{-1} - a^*}{1 - az^{-1}} = -a^* \left(\frac{z - \frac{1}{a^*}}{z - a} \right)$$

其相位响应为: 群延迟为正值, 连续相位递减。

Assume:
$$a = re^{j\theta}$$

 $\arg \left[H_{ap} \left(e^{j\omega} \right) \right]$
 $= -\omega - 2 \arctan \left[\frac{r \sin(\omega - \theta)}{1 - r \cos(\omega - \theta)} \right]$
 $grd \left[H_{ap} \left(e^{j\omega} \right) \right]$
 $= \frac{1 - r^2}{\left| 1 - re^{-j(\omega - \theta)} \right|^2}$

用途:

- 相位均衡器,用于提高群延迟
- 任何因果稳定系统均可以分解为全通系统和最小相位的级联
- 若是系统不稳定,可以用于交换系统的零极点,而不改变幅度特性

2.11.2 最小相位系统

要求极点在单位圆内(主要考虑系统稳定性),要求零点在单位圆内(主要考虑相位变化最小)。

最小相位系统零极点均在单位圆内,极点往往与系统稳定性联系在一起,零点则往往与系统的延时特性联系在一起。逆系统也是因果稳定的,可以实现幅度和相位失真的完全补偿。

• 最小相位延迟,全通系统总是使最小相位系统的连续相位减小:

$$H(z) = H_{\min}(z)H_{ap}(z)$$

$$\arg \left[H\left(e^{j\omega}\right)\right] = \arg \left[H\min\left(e^{j\omega}\right)\right] + \arg \left[H_{ap}\left(e^{j\omega}\right)\right]$$

$$\arg \left[H\left(e^{j\omega}\right)\right] \le \arg \left[H_{\min}\left(e^{j\omega}\right)\right]$$

$$\left|\arg \left[H\left(e^{j\omega}\right)\right]\right| \ge \left|\arg \left[H_{\min}\left(e^{j\omega}\right)\right]\right|$$

• 最小群延迟, 全通系统的群延迟对于所有的频率皆为正值:

$$\operatorname{grd}\left[H\left(e^{j\omega}\right)\right] = \operatorname{grd}\left[H_{\min}\left(e^{j\omega}\right)\right] + \operatorname{grd}\left[H_{ap}\left(e^{j\omega}\right)\right]$$

 $\operatorname{grd}\left[H\left(e^{j\omega}\right)\right] \ge \operatorname{grd}\left[H_{\min}\left(e^{j\omega}\right)\right]$

• 最小能量延迟,最集中在n=0范围内:

$$\sum_{m=0}^{n} |h(n)|^2 \le \sum_{m=0}^{n} |h_{\min}(m)|^2$$

因此:

$$|h(0)| \le |h_{\min}(0)|$$

最大能量延迟则发生在全部零点位于单位圆外的系统,因此该系统也称为最大相位系统。

2.11.3 系统的补偿

幅度失真由最小相位因子补偿、相位失真利用全通因子补偿特定频段。

2.11.4 线性相位系统

定义: 群延迟 α 为常数 $\phi(\omega) = -\alpha\omega + \beta$

线性相位响应时域表现为信号平移,波形不发生失真。

不考虑幅度响应条件下,线性相位系统即是所要寻找的物理可实现的无失真传输系统。

若是群延迟 α 满足 2α 为整数,那么单位冲激响应严格对称,否则不严格对称,但是仍满足线性相位。

2.11.5 广义线性相位系统

在系统相位存在突变以及固定相位时,仍然存在恒定群延迟。 已知线性相位系统存在对称性,进行分析:

$$H\left(e^{j\omega}\right) = A(\omega)e^{-j(\omega\alpha-\beta)}$$

$$DTFT \quad [h(\alpha-n)] = H\left(e^{-j\omega}\right)e^{-j\omega\alpha} = A(\omega)e^{j\beta}$$

$$DTFT \quad [h(n+\alpha)] = H\left(e^{j\omega}\right)e^{j\omega\alpha} = A(-\omega)e^{j\beta}$$

因此, $A(\omega)$ 的对称性决定了 h(n) 的对称性(一致)。 根据对称形式与 2α 的奇偶性,有四类 FIR 线性相位滤波器。 对称冲激响应的系统特性推导:

得到:

- 1. 系统零点个数等于系统在原点的极点阶数相等
- 2. z_i 与 z_i^{-1} 均为零点
- 3. h(n) 为实数,零点共轭成对四类,其中 M = N 1:

$$H(z) = \pm z^{-(N-1)} H\left(z^{-1}\right)$$

$$H(z) = \frac{1}{2} \left[H(z) \pm z^{-(N-1)} H\left(z^{-1}\right) \right]$$

$$= \frac{1}{2} \left[\sum_{n=0}^{N-1} h(n) z^{-n} \pm z^{-(N-1)} \sum_{n=0}^{N-1} h(n) z^{n} \right]$$

$$= \frac{1}{2} \sum_{n=0}^{N-1} h(n) \left[z^{-n} \pm z^{-(N-1)} z^{n} \right]$$

$$= z^{-\frac{N-1}{2}} \sum_{n=0}^{N-1} h(n) \left[\frac{z^{-\frac{N-1}{2}-n}}{z^{-\frac{N-1}{2}-n}} \pm z^{-\frac{N-1}{2}-n} \right]$$

$$H(\omega) = e^{-j\omega} \frac{N-1}{2} h(n) \left[\frac{(e^{j\omega})^{\frac{N-1}{2}-n}}{z^{-\frac{N-1}{2}-n}} \pm (e^{j\omega})^{-\frac{N-1}{2}-n} \right]$$

• I 类: M 为偶数,偶对称: h(n) = h(M-n)

$$H(\omega) = \sum_{n=0}^{N-1} h(n) \cos \left[\left(\frac{N-1}{2} - n \right) \omega \right] = \sum_{n=0}^{N-1} h(n) \cos \left[\left(\frac{M}{2} - n \right) \omega \right]$$

• II 类: M 为奇数, 偶对称, 存在特殊零点:

$$H(z) = z^{-M} H\left(z^{-1}\right)$$

解得 $z = -1, \omega = \pi$

$$H(\omega) = \sum_{n=0}^{N-1} h(n) \cos \left[\left(\frac{N-1}{2} - n \right) \omega \right] = \sum_{n=0}^{N-1} 2h(n) \cos \left[\left(\frac{N-1}{2} - n \right) \omega \right]$$
$$\frac{N}{2} - n = m = \sum_{m=1}^{N-1} 2h \left(\frac{N}{2} - m \right) \cos \left[\left(m - \frac{1}{2} \right) \omega \right]$$

• III 类: M 为偶数, h(n) = -h(M-n) 特殊零点: $z = \pm 1$ 。

$$H(\omega) = \sum_{n=0}^{N-3} \frac{N-3}{2} 2h(n) \sin\left[\left(\frac{N-1}{2} - n\right)\omega\right]$$
$$\left(\frac{N-1}{2} - n = m\right) = \sum_{m=1}^{2} 2h\left(\frac{N-1}{2} - m\right) \sin(m\omega)$$

• IV 类: M 为奇数, h(n) = -h(M-n) 特殊零点: z = 1 。

$$H(\omega) = \sum_{n=0}^{N-1} h(n) \sin\left[\left(\frac{N-1}{2} - n\right)\omega\right]$$

$$= \sum_{n=0}^{N-1} 2h(n) \sin\left[\left(\frac{N-1}{2} - n\right)\omega\right]$$

$$\left(\frac{N}{2} - n = m\right) = \sum_{m=1}^{N-1} 2h\left(\frac{N}{2} - m\right) \sin\left[\left(m - \frac{1}{2}\right)\omega\right]$$

对于一个关于 n = k 对称的序列, 其群延时为 k 。

2.11.5.1 最小相位分解

根据零点成对进行分解,分解到最小相位系统与线性相位系统。

第三章 信号采样与重构

需要解决的问题:

- 数字频率和模拟频率之间的对应关系: 时域采样对频域的影响
- 采样定理: 能否包含原始信号的所有信息? 如何无失真恢复原始信号? 是否有冗余信息可以去除? 是否可以进行速率的变化?
- 离散处理如何等效为一个模拟 LTI 系统?

3.1 理想周期采样重构

3.1.1 模拟-采样-数字频谱关系

一般采样都是不可逆的, 为了不丢失信息, 需要进行约束。

理想时域采样:

$$x_s(t) = x_c(t) * s(t) = \sum_{-\infty}^{+\infty} x_c(nT)\delta(t - nT)$$

其中:

$$s(t) = \sum_{-\infty}^{\infty} \delta(t - nT)$$

频域表示为:

$$\delta_{T_1}(t) = \sum_{-\infty}^{\infty} \delta\left(t - nT_1\right) \to \frac{2\pi}{T_1} \sum_{-\infty}^{\infty} \delta\left(\omega - n\omega_1\right)$$

$$X_s(\Omega) = \frac{1}{2\pi} X_c(\Omega) S(\Omega)$$

$$= \frac{1}{T} X_c(\Omega) \otimes \sum_{-\infty}^{+\infty} \delta(\Omega - n\Omega_0)$$

$$= \frac{1}{T} \sum_{n=1}^{\infty} X_c(\Omega - n\Omega_0)$$

那么从连续信号采样得到的是原始信号的频谱(带限 Ω_N)的周期(Ω_s)性拓延,当然,这是存在混叠的。

AD 是 CD 的工程近似。

进一步研究其离散采样信号的频谱:

对于采样信号:

$$X_{s}(j\Omega) = \int_{-\infty}^{+\infty} x_{s}(t)e^{-j\Omega t}dt$$

$$= \int_{-\infty}^{+\infty} \left[\sum_{n=-\infty}^{+\infty} x_{c}(nT)\delta(t-nT) \right] e^{-j\Omega t}dt$$

$$= \sum_{n=-\infty}^{+\infty} \int_{-\infty}^{+\infty} x_{c}(nT)\delta(t-nT)e^{-j\Omega t}dt$$

$$= \sum_{n=-\infty}^{+\infty} x_{c}(nT)e^{-j(\Omega T)n}$$

对于数字信号:

$$X(j\omega) = \sum_{-\infty}^{\infty} x(n)e^{-j\omega n}$$
$$= \sum_{-\infty}^{\infty} x_c(nT)e^{-j\omega n}$$

经过两种形式的比对,可以得到:

$$X(j\omega)\Big|_{\omega=\Omega T} = X_s(j\Omega)$$

这就得到了一个重要的频率转换公式:

$$\Omega T = \omega$$

3.1.2 信号重构

通过理想重构滤波器:

$$h_r(t) = \frac{\sin(\pi t/T)}{\pi t/T}$$

其频域形式:

$$H(\omega) = TG_{\omega_c}(\omega)$$

其频率表示为,无混叠时采样点之外也无失真,有混叠时,则采样点之外存在一定 失真。

$$x_r(t) = x_s(t) \otimes h_r(t)$$

$$= \sum_{-\infty}^{+\infty} x(n)\delta(t - nT) \otimes h_r(t)$$

$$= \sum_{-\infty}^{+\infty} x(n)h_r(t - nT)$$

$$= \sum_{-\infty}^{+\infty} x(n)\frac{\sin(\pi(t - nT)/T)}{\pi(t - nT)/T}$$

3.1.3 奈奎斯特低通采样定理

若信号的频带满足 $|\omega| < \omega_c$,那么以至少 $2\omega_c$ 的速率采样就可以无失真的恢复原始信号。

3.1.4 奈奎斯特带通采样定理

若信号的频带满足 $|f|<\omega_c$,那么以至少 $2f_c$ 的速率采样,且满足 $f_s=\frac{4f_0}{2n+1}$ 就可以无失真的恢复原始信号。其中 f_0 为频带中心频率。

3.2 连续信号的离散化

$$X_r(j\Omega) = H_r(j\Omega)X_s(j\Omega) = H_r(j\Omega)X(e^{j\omega})\Big|_{\omega=\Omega T}$$

实际上处理的系统函数 $H_{eff}(j\Omega)$ 只能处理 $|\Omega| < \pi/T$ 。

3.3 抽取和内插

虽然带通定理降低了采样的速率,但是有时我们需要更高的带宽也就是更快的速度, 优点有:

- 处理带宽变宽
- 信号处理的盲区减少
- 量化信噪比可以提升

但是高速率的采样又会造成后续的信号处理速度不匹配,因此又需要降速,但是减少采样又想要不丢失信息。

3.3.1 信号整倍数抽取

其采样序列转变为,通过统一的形式表示一个周期的冲激函数,很是美观、方便:

$$\delta_D(n) = \frac{1}{D} \sum_{i=0}^{D-1} e^{j\frac{2\pi}{D}ni} = \begin{cases} 1 & n = 0, \pm D, \pm 2D, \dots \\ 0 & \sharp \text{ i.e. } \end{cases}$$

其 Z 变换:

$$X_{D}(z) = \sum_{n=-\infty}^{\infty} x_{D}(n)z^{-n}$$

$$= \sum_{m=-\infty}^{+\infty} x(m)\delta_{D}(m)z^{-m/D}$$

$$= \sum_{m=-\infty}^{+\infty} \left(x(m)\frac{1}{D}\sum_{i=0}^{D-1} e^{i\frac{2\pi}{D}mi}\right)z^{-m/D}$$

$$= \frac{1}{D}\sum_{i=0}^{D-1} \sum_{m=-\infty}^{+\infty} x(m)e^{i\frac{2\pi}{D}mi}z^{-m/D}$$

$$= \frac{1}{D}\sum_{i=0}^{D-1} \sum_{m=-\infty}^{+\infty} x(m)\left(z\frac{1}{D}e^{-j\frac{2\pi}{D}i}\right)^{-m}$$

$$= \frac{1}{D}\sum_{i=0}^{D-1} X\left(z\frac{1}{D}e^{-j\frac{2\pi}{D}i}\right)$$

$$= \frac{1}{D}\sum_{i=0}^{D-1} \sum_{m=-\infty}^{+\infty} x(m)\left(z\frac{1}{D}e^{-j\frac{2\pi}{D}i}\right)^{-m}$$

$$= \frac{1}{D}\sum_{i=0}^{D-1} X\left(z\frac{1}{D}e^{-j\frac{2\pi}{D}i}\right)$$

当 D=1 时,退化到原始的 Z 变换。

从采样的模拟谱来看,降采样将交叠平移的**频率间隔缩小**了D倍,因此数字谱也是如此。

$$x(n) \Leftrightarrow Xs(\Omega) = \frac{1}{T} \sum_{k=-\infty}^{+\infty} Xc(\Omega - k\Omega_0) \quad \Leftrightarrow X(\omega) = \frac{1}{T} \sum_{k=-\infty}^{+\infty} Xc\left(\frac{\omega}{T} - k\frac{2\pi}{T}\right)$$
$$x_D(n) \Leftrightarrow X_{DS}(\Omega) = \frac{1}{DT} \sum_{k=-\infty}^{+\infty} Xc\left(\Omega - k\frac{\Omega_0}{D}\right) \Leftrightarrow X_D(\omega) = \frac{1}{DT} \sum_{k=-\infty}^{+\infty} Xc\left(\frac{\omega}{DT} - k\frac{2\pi}{DT}\right)$$

这也导致交叠变得更加容易,原本交叠间隔是 2π,会变得更小。

最终在数字频域的表现如下,可以看到平移中心没有变化,但是频谱已经被稀释(拉伸)了。

$$X_D(\omega) = \frac{1}{D} \sum_{i=0}^{D-1} X(\frac{\omega - 2\pi i}{D})$$

为了**防止混叠**,需要把可能产生混叠的部分滤除,在对数字信号 D 倍抽取之前,先用数字低通滤波器 π/D 滤波。

3.3.2 信号整倍数内插

内插显得很不可思议,对于一个 I 倍的内插结构,就是在原始序列的每两个点之前,插入 I-1 个零。也就是对于 $x_i(m)$ 来说,除去 m 为 I 的整倍数的点,其余都为 0 。

$$x_I(m) = \begin{cases} x\left(\frac{m}{I}\right) & (m = 0, \pm I, \pm 2I, \cdots) \\ 0 & \text{else} \end{cases}$$

类似的,来分析其频谱:

$$X_{I}(e^{j\omega})$$

$$= \sum_{m=-\infty}^{+\infty} X_{I}(m)e^{-j\omega m}$$

$$= \sum_{k=-\infty}^{+\infty} X_{I}(kI)e^{-j\omega Ik}$$

$$= \sum_{k=-\infty}^{+\infty} X(k)e^{-j\omega Ik} = X(e^{j\omega I})$$

可见,这里的形式比较简洁,就是简单的将频谱压缩了I倍。

将抽取后的频谱进行内插后的频谱进行时域还原,可以得到准确的内插值,提高了 时域的分辨率。

类似的,在内插后需要进行低通滤波,防止其搬运频谱也进入之后系统。同时,内插需要增益为I。

3.3.3 非整倍数抽取和内插

可以通过如图 3.1 的系统对信号进行非整倍数的抽取和内插。

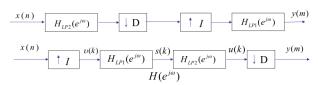


图 3.1: 非整倍数抽取与内插系统

滤波器只需满足在最小频带工作:同时补偿进行内插的增益 I。需要注意,给定分数后,**滤波器频率已经默认给定**。

$$H\left(e^{j\omega}\right) = \begin{cases} I & |\omega| \leq \min\left(\frac{\pi}{I}, \frac{\pi}{D}\right) \\ 0 & \text{else} \end{cases}$$

其时域表示:

$$v(n) = \begin{cases} x(n/I) & n = 0, \pm I, \pm 2I \cdots \\ 0 & \text{else} \end{cases}$$

$$u(n) = v(n) * h(n) = \sum_{k=-\infty}^{\infty} h(n-k)v(k) = \sum_{k=-\infty}^{\infty} h(n-k)x(k/I) = \sum_{k=-\infty}^{\infty} h(n-Ik)x(k)$$

$$y(n) = u(Dn) = \sum_{k=-\infty}^{\infty} x(k)h(Dn - Ik)$$

对时域计算的一点简化:

$$y(n) = u(Dn) = \sum_{k=-\infty}^{\infty} x(k)h(Dn - Ik)$$

$$Dn - Ik \ge 0 \quad k \le \frac{D}{I}n \quad \Leftrightarrow : \quad m = \lfloor \frac{Dn}{I} \rfloor - k, \quad m \ge 0$$

$$y(n) = \sum_{m=0}^{\infty} x\left(\lfloor \frac{Dn}{I} \rfloor - m\right)h\left(Dn - \lfloor \frac{Dn}{I} \rfloor I + mI\right)$$

$$y(n) = \sum_{m=0}^{\infty} x\left(\lfloor \frac{Dn}{I} \rfloor - m\right)h\left(mI + Dn\%I\right)$$

3.3.4 速率变换的多相结构

在高采样率的数据端,数字的滤波器计算量巨大。希望将数据转换到频率较低的位置进行计算,来降低功耗。

多相滤波器:将 Z 变化转化为多相形式,以特定频率倍数为周期:

$$H(z) = \sum_{n=0}^{\infty} h(n)z^{-n}$$

$$= h_0 + h_4 z^{-4} + h_8 z^{-8} + h_{12} z^{-12} + \cdots$$

$$+ h_1 z^{-1} + h_5 z^{-5} + h_9 z^{-9} + h_{13} z^{-13} + \cdots$$

$$+ h_2 z^{-2} + h_6 z^{-6} + h_{10} z^{-10} + h_{14} z^{-14} + \cdots$$

$$+ h_3 z^{-3} + h_7 z^{-7} + h_{11} z^{-11} + h_{15} z^{-15} + \cdots$$

$$= z^0 \left[h_0 + h_4 z^{-4} + h_8 z^{-8} + h_{12} z^{-12} + \cdots \right]$$

$$+ z^{-1} \left[h_1 + h_5 z^{-4} + h_9 z^{-8} + h_{13} z^{-12} + \cdots \right]$$

$$+ z^{-2} \left[h_2 + h_6 z^{-4} + h_{10} z^{-8} + h_{14} z^{-12} + \cdots \right]$$

$$+ z^{-3} \left[h_3 + h_7 z^{-4} + h_{11} z^{-8} + h_{15} z^{-12} + \cdots \right]$$

M 相分解:

$$H(z) = \sum_{l=0}^{M-1} z^{-l} \sum_{n=0}^{\infty} h(Mn+l) z^{-Mn}$$

$$E_I(z) = \sum_{n=0}^{\infty} h(Mn+l) z^{-n}$$

$$H(z) = \sum_{l=0}^{M-1} z^{-l} E_l(z^M)$$

对应的时域表示为:

$$e_l(n) = h(Mn + l)$$

$$E_l(z) = \sum_{n=0}^{\infty} e_l(n) z^{-n}$$

3.3.5 离散话处理工程问题

3.3.5.1 处理对能量的影响

- 采样降低 T 倍
- 抽取不影响信号功率
- 内插降低 I 倍

第四章 离散傅里叶变换及其快速算法

工程中对时域、频域的处理都只能局限在特定时段、频段内,并且采样和实现都是离散的。需要的变换需要满足时域序列和频域抽样的关系。

4.1 四类傅里叶变换

傅里叶变换的目的是建立**时域表达**和**频域表达**的变换关系,当时间与频率分别为连续、离散时,就得到不同形式的傅里叶变换对:

• 连续时间-连续频率: CTFT

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

● 连续时间-离散频率: CTFS 周期信号为功率信号,能力无限,因此变换需要特殊处理。时域周期化导致频域离散化

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

$$X(jk\Omega_0) = \frac{1}{T_0} \int_{-T_0/2}^{T_0/2} x(t)e^{-jk\Omega_0 t} dt$$

$$X(j\Omega) = 2\pi \sum_{-\infty}^{+\infty} X(jk\Omega_0)\delta(\Omega - \Omega_0)$$

• 离散时间-连续频率: DTFT 时域离散导致的频域周期化

$$X\left(e^{j\Omega T}\right) = \sum_{n=-\infty}^{\infty} x(n)e^{-j\omega n}$$
$$x(n) = \frac{1}{2\pi} \int_{-\pi}^{\pi} X\left(e^{j\omega}\right)e^{j\omega n}d\omega$$

• 离散时间-离散频率: DFS 时域周期性离散化, 不是绝对可和的:

$$\begin{split} \sum_{n=0}^{N-1} \tilde{x}(n) e^{-j\frac{2\pi}{N}rn} &= \frac{1}{N} \sum_{n=0}^{N-1} \sum_{k=0}^{N-1} \tilde{X}(k) e^{j\frac{2\pi}{N}(k-r)n} \\ &= \sum_{k=0}^{N-1} \tilde{X}(k) \left[\frac{1}{N} \sum_{n=0}^{N-1} e^{j\frac{2\pi}{N}(k-r)n} \right] \\ &\frac{1}{N} \sum_{n=0}^{N-1} e^{j\frac{2\pi}{N}rn} &= \frac{1}{N} \frac{1 - e^{j\frac{2\pi}{N}rN}}{1 - e^{j\frac{2\pi}{N}}} = 1, \text{ when } r = mN, 0, \text{ else} \end{split}$$

定义变换因子的符号: $W_N = e^{-j\frac{2\pi}{N}}$ 。那么变换对为:

$$\begin{split} \tilde{X}(k) &= DFS[\tilde{x}(n)] = \sum_{n=0}^{N-1} \tilde{x}(n) e^{-j\frac{2\pi}{N}nk} = \sum_{n=0}^{N-1} \tilde{x}(n) W_N^{nk} \\ \tilde{x}(n) &= IDFS[\tilde{X}(k)] = \frac{1}{N} \sum_{k=0}^{N-1} \tilde{X}(k) e^{j\frac{2\pi}{N}nk} = \frac{1}{N} \sum_{k=0}^{N-1} \tilde{X}(k) W_N^{-nk} \end{split}$$

DFS 可以看作是对周期序列主值区间的 Z 变换 / DTFT 在单位圆的等间隔取样。

4.2 频域采样定理

本节考虑:如何利用单位圆抽样恢复原始信号,并且抽样对于时域的影响。 对于任意信号进行频谱单位圆抽样并进行 IDFS 变换得到的序列是

$$\begin{split} \tilde{x}(n) &= \frac{1}{N} \sum_{k=0}^{N-1} X(k) e^{j\frac{2\pi}{N}kn} \\ &= \frac{1}{N} \sum_{k=0}^{N-1} \left(\sum_{m=-\infty}^{+\infty} x(m) e^{-j\frac{2\pi}{N}km} \right) e^{j\frac{2\pi}{N}kn} = \frac{1}{N} \sum_{m=-\infty}^{+\infty} x(m) \left(\sum_{k=0}^{N-1} e^{-j\frac{2\pi}{N}k(m-n)} \right) \\ & \text{where } \frac{1}{N} \sum_{k=0}^{N-1} e^{-j\frac{2\pi}{N}k(m-n)} = \begin{cases} 1 & m = n+rN \\ 0 & \text{else} \end{cases} \\ &= \sum_{m=-\infty}^{+\infty} x(m) \sum_{r=-\infty}^{+\infty} \delta(m-n-rN) = \sum_{r=-\infty}^{+\infty} x(n+rN) \end{split}$$

这个公式显示了原序列点数、采样点数之间的关系,以及交叠造成的数学形式。若 是可以无失真恢复原序列,那么可以完整表达其频谱:

$$X(z) = \sum_{n=-\infty}^{+\infty} x(n)z^{-n}$$

$$= \sum_{n=0}^{N-1} \left(\frac{1}{N} \sum_{k=0}^{N-1} X(k)e^{j\frac{2\pi}{N}kn}\right) z^{-n}$$

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

$$= \frac{1}{N} \sum_{k=0}^{N-1} \left(X(k) \frac{1-z^{-N}}{1-e^{j\frac{2\pi}{N}k}z^{-1}}\right)$$

$$= \frac{1-z^{-N}}{N} \sum_{k=0}^{N-1} \left(\frac{X(k)}{1-e^{j\frac{2\pi}{N}k}z^{-1}}\right)$$

那么定义一个因子即可建立从恢复频谱到原频谱的关系:

$$\Phi_k(z) = \frac{1 - z^{-N}}{N} \cdot \frac{1}{1 - e^{j\frac{2\pi}{N}k}z^{-1}}$$

可以得到

$$X(z) = \sum_{k=0}^{N-1} X(k) \Phi_k(z)$$
$$X(e^{j\omega}) = \sum_{k=0}^{N-1} X(k) \Phi_k(e^{j\omega})$$

这个因子存在 N 零点,只有在这些零点处极点才会被抵消,在其他抽样点处都为 0

4.3 **DFT**

DFS 是主值区间的采样, DFT 是有限长序列(周期延拓后)的变换。

$$X(k) = X(z)|_{z=e^{j\frac{2\pi}{N}}} = \sum_{n=0}^{N-1} x(n)e^{-j\frac{2\pi}{N}kn} \quad k = 0, 1, 2, \dots N-1$$
$$x(n) = \tilde{x}(n)R_N(n) = \left(\frac{1}{N}\sum_{k=0}^{N-1} X(k)e^{j\frac{2\pi}{N}kn}\right)R_N(n)$$

DFT 是其 DTFT 的等长采样的主值区间。

4.3.1 DFT 性质

• 对偶性:

$$X(k) = \sum_{n=0}^{N-1} x[n] W_N^{nk}$$

$$x[n] = \frac{1}{N} \sum_{k=0}^{N-1} X(k) W_N^{-nk}$$

$$= \left(\frac{1}{N} \sum_{k=0}^{N-1} X^*(k) W_N^{nk}\right)^*$$

$$IDFT[X(k)] = \frac{1}{N} \left(DFT[X^*(k)]\right)^*$$

- 圆周对称性
- 线性性
- 循环移位特性:

$$x_m(n) = x((n+m))_N R_N(n)$$

• 频率圆周移位:

$$IDFT[X((k+l))_N R_N(k)] = W_N^{nl} x(n) = e^{-j\frac{2\pi}{N}nl} x(n)$$

据此可以得到:

$$DFT\left[x(n)\cos\left(\frac{2\pi nl}{N}\right)\right] = \frac{1}{2}\left[X((k-l))_N + X((k+l))_N\right]R_N(k)$$
$$DFT\left[x(n)\sin\left(\frac{2\pi nl}{N}\right)\right] = \frac{1}{2}\left[X((k-l))_N - X((k+l))_N\right]R_N(k)$$

• 圆周共轭性: 若x(n) 为共轭对称序列,那么 $x((n))_N$ 称为圆周共轭对称序列: $x(n) = x^*(N-n)$; 若x(n) 为共轭反对称序列,那么 $x((n))_N$ 称为圆周反共轭对称序列: $x(n) = -x^*(N-n)$;

• 时域-频域对称性:

$$DFT[x((-n))_{-k}] = X(N - k)$$

$$DFT[x^*(n)] = X^*((N - k))_N R_N(k) = X^*(N - k)$$

据以上两个式子可以得到实部、虚部的变化,首先定义共轭序列:

$$x_{ep}(n) = \tilde{x}_e(n)R_N(n) = \frac{1}{2} [x((n))_N + x^*((N-n))_N] R_N(n)$$

$$x_{op}(n) = \tilde{x}_o(n)R_N(n) = \frac{1}{2} [x((n))_N - x^*((N-n))_N] R_N(n)$$

那么:

$$DFT\{\text{Re}[x(n)]\} = X_{ep}(k)$$
$$DFT\{j \text{Im}[x(n)]\} = X_{op}(k)$$

$$DFT \{x_{ep}(n)]\} = \operatorname{Re}[X(k)]$$

$$DFT \{x_{op}(n)\} = j \operatorname{Im}[X(k)]$$

• 圆周卷积和: 可交换/点数相关

● 线性卷积和: 至少 N₁ + N₂ - 1 点结果

• 时域相乘:

$$Y(k) = DFT[y(n)] = \frac{1}{N}X_1(k) \otimes X_2(k)$$

• 圆周相关:

$$r_{xy}(m) = \sum_{n=-\infty}^{\infty} x(n)y^*(n-m) = \sum_{n=-\infty}^{\infty} x(n+m)y^*(n)$$

其频谱:

$$R_{xy}\left(e^{j\omega}\right) = X\left(e^{j\omega}\right)Y^*\left(e^{j\omega}\right) \quad R_{xx}\left(e^{j\omega}\right) = \left|X\left(e^{j\omega}\right)\right|^2$$

利用交叠求 DFT 实际上是搬移,搬移的源是原序列而不是补全的序列。 圆周卷积:翻折-向右平移

4.4 FFT

4.4.1 基底特性

• 对称性:

$$(W_N^{nk})^* = W_N^{-nk}$$

• 周期性:

$$W_N^{nk} = W_N^{(n+N)k} = W_N^{n(k+N)}$$

可约性:

$$W_{mN}^{mnk} = W_N^{nk}$$

4.5 戈泽尔算法

将 DFT 转换为卷积:

$$X(k) = \sum_{r=0}^{N-1} x[r] W_N^{kr} = W_N^{-kN} \sum_{r=0}^{N-1} x[r] = \sum_{r=0}^{N-1} x[r] W_N^{-k(N-r)} = x[n] \otimes W_N^{-kn} u[n]$$
 分解其 Z 变换:

$$\begin{split} H_k(z) &= \frac{1}{1 - W_N^{-k} z^{-1}} = \frac{1}{\left(1 - W_N^{-k} z^{-1}\right) \left(1 - W_N^k z^{-1}\right)} * \left(1 - W_N^k z^{-1}\right) \\ &= \frac{1}{1 - 2\cos(2\pi k/N)z^{-1} + z^{-2}} * \left(1 - W_N^k z^{-1}\right) \end{split}$$

4.6 基 2 FFT

特殊基:

$$W_N^{N/2} = -1$$
$$W_2^0 = 1$$
$$W_2^1 = -1$$

两类 FFT: 时间抽取 (DIT), 频域抽取 (DIF)

4.6.1 时域奇偶抽取

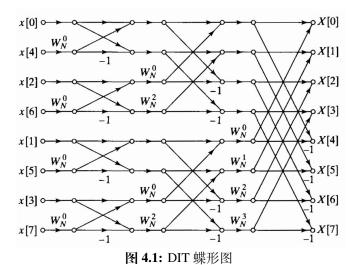
首先补零!

$$X(k) = \sum_{0}^{N-1} x[n] W_N^{nk}$$

$$= \sum_{r=0}^{N/2-1} x[2r] W_N^{2rk} + \sum_{r=0}^{N/2-1} x[2r+1] W_N^{(2r+1)k}$$

$$= X_1(k) + W_N^k X_2(k)$$

概括来说,就是在时域进行奇偶分解,在频域进行组合;旋转因子在前,加减在后;整体旋转在前,微调在后。其蝶形图如 **图** 4.1。



4.6.2 频域奇偶抽取

$$\begin{split} X(k) &= \sum_{0}^{N-1} x[n] W_N^{nk} \\ &= \sum_{r=0}^{N/2-1} x[2r] W_N^{2rk} + \sum_{r=0}^{N/2-1} x[2r+1] W_N^{(2r+1)k} \\ &= \sum_{n=0}^{N/2-1} x[n] W_N^{nk} + x[n+\frac{N}{2}] W_N^{(N/2+n)k} \\ &= \sum_{n=0}^{N/2-1} (x[n] + x[n+\frac{N}{2}] W_N^{Nk/2}) W_N^{nk} \\ &= \sum_{n=0}^{N/2-1} (x[n] + x[n+\frac{N}{2}] (-1)^k) W_N^{nk} \end{split}$$

那么有:

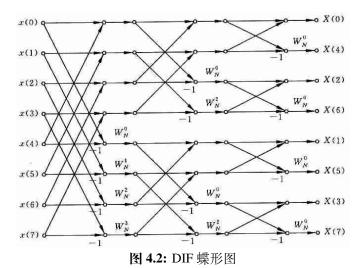
$$k = 2r, X(k) = \sum_{n=0}^{N/2-1} (x[n] + x[n + \frac{N}{2}]) W_N^{nk}$$

$$= \sum_{n=0}^{N/2-1} x_1[n] W_N^{nk}$$

$$k = 2r + 1, X(k) = \sum_{n=0}^{N/2-1} (x[n] - x[n + \frac{N}{2}]) W_N^{nk}$$

$$= \sum_{n=0}^{N/2-1} x_2[n] W_N^{nk}$$

概括来说,就是在时域进行前后分解,在频域进行奇偶分解;加减在前,旋转因子在后;微调在前,整体旋转在后。其蝶形图如**图 4.2**。

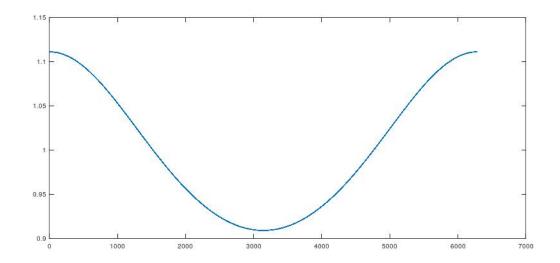


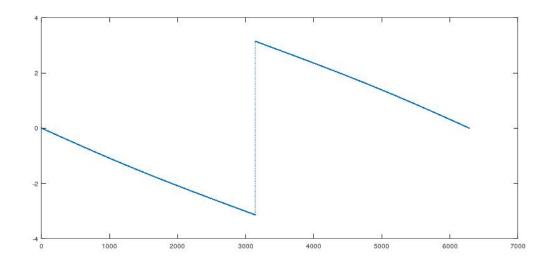
第五章 复习题

2.44, 5.49, 4.8, 4.53, 4.7, 4.34, 4.43, 4.49, 7.33

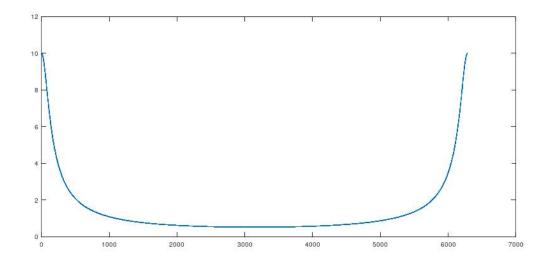
附录 A 零极点幅度相位研究

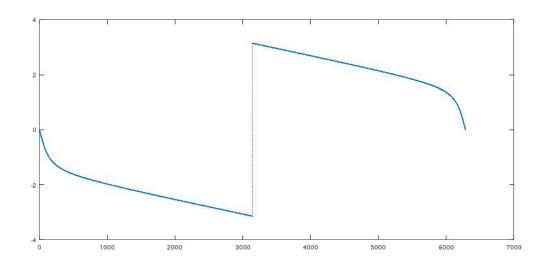
Z=0.1 极点 无零点



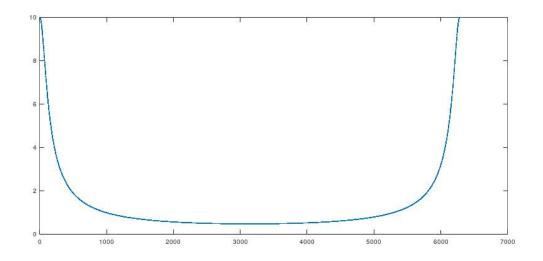


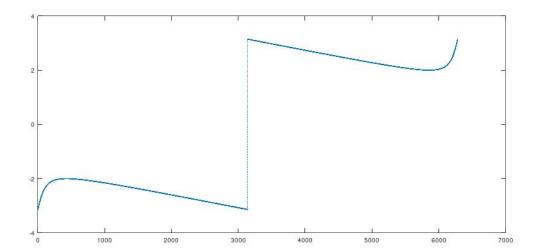
Z=0.9 极点 无零点



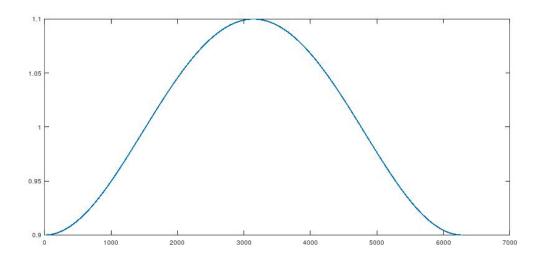


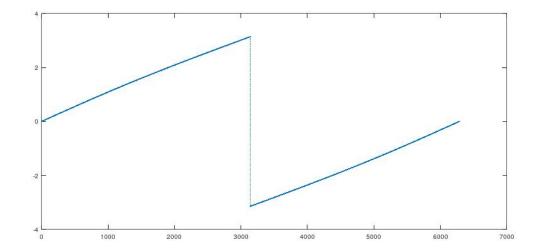
Z=1.1 极点 无零点



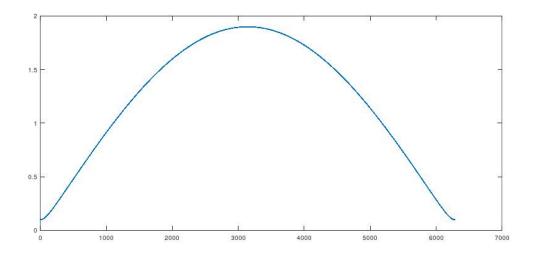


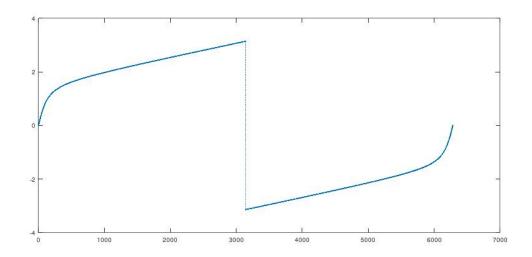
Z=0.1 零点 无极点





Z=0.9 零点 无极点





Z=1.1 零点 无极点

