Практикум анализа временных рядов

Отчет по индивидуальному заданию

Автор: Павел Соболев

3 апреля 2020 г.

Часть 1

Постановка и решение задачи

Дан временной ряд $x_k = x\left(\Delta t k\right), k = 0, 1, \ldots, 2N-1$, у которого первое и второе, третье и четвертое и т. д. значения попарно совпадают. Докажите аналитически, что периодограмма такого ряда будет симметрична относительно частоты $\nu = 0.5\nu_c = 1/4\Delta t$. Проиллюстрируйте это свойство с помощью программы СКАВРя.

1.1 Представление входных данных

Имеем следующий временной ряд:

$$x_k = x\left(\Delta t k\right), \quad k = 0, 1, \ldots, 2N-1, \tag{1}$$

для которого выполняется следующее свойство:

$$x_{2k} = x_{2k+1}, \quad k = 0, 1, \ldots, N-1. \tag{2}$$

Объединяя с (1), получаем систему:

$$\begin{cases} x_k = x\left(\Delta t k\right), \quad k = 0, 1, \ldots, 2N-1 \\ x_{2k} = x_{2k+1}, \quad k = 0, 1, \ldots, N-1, \end{cases} \tag{3}$$

полностью описывающую входные данные, соответствующие условию задачи.

1.2 Выполнение преобразования Фурье

Имеем следующую формулу для вычисления периодограммы Шустера:

$$D(\nu) = \frac{1}{4N^2} \left| \sum_{k=0}^{2N-1} x_k e^{-i2\pi\nu\Delta t k} \right|^2. \tag{4}$$

Введем следующие обозначения:

$$X(\nu) \coloneqq \sum_{k=0}^{2N-1} x_k e^{-i2\pi\nu\Delta t k}; \tag{5}$$

$$X_{Re}(\nu) \coloneqq Re(X(\nu)) = \sum_{k=0}^{2N-1} x_k \cos(2\pi\nu\Delta t k); \tag{6}$$

$$X_{Im}(\nu) \coloneqq Im(X(\nu)) = -\sum_{k=0}^{2N-1} x_k \sin(2\pi\nu\Delta t k). \tag{7}$$

Тогда выражение (4) можно будет переписать как

$$D(\nu) = \frac{1}{4N^2}|X(\nu)|^2 = \frac{1}{4N^2}(X_{Re}^2 + X_{Im}^2). \tag{8}$$

1.2.1 Вычисление $X_{Re}^2(\nu)$

Воспользуемся свойством (2), характерным исходному временному ряду (3), и преобразуем выражение (6):

$$X_{Re}(\nu) = \sum_{k=0}^{N-1} x_{2k}[\cos(2\pi\nu\Delta t(2k)) + \cos(2\pi\nu\Delta t(2k+1)]. \tag{9}$$

Воспользуемся тригонометрическим тождеством

$$\cos(\alpha) + \cos(\beta) = 2\cos\frac{\alpha+\beta}{2}\cos\frac{\alpha-\beta}{2} \tag{10}$$

и преобразуем (9):

$$\begin{aligned} X_{Re}(\nu) &= 2\sum_{k=0}^{N-1} x_{2k}\cos\left(\frac{2\pi\nu\Delta t(2k+2k+1)}{2}\right)\cos\left(\frac{2\pi\nu\Delta t(2k-2k-1)}{2}\right) = \\ &= 2\sum_{k=0}^{N-1} x_{2k}\cos(\pi\nu\Delta t(4k+1))\cos(\pi\nu\Delta t) = \\ &= 2\cos(\pi\nu\Delta t)\sum_{k=0}^{N-1} x_{2k}\cos(\pi\nu\Delta t(4k+1)). \end{aligned} \tag{11}$$

Возведем (11) в квадрат:

$$X_{Re}^2(\nu) = 4\cos^2(\pi\nu\Delta t)\left[\sum_{k=0}^{N-1} x_{2k}\cos(\pi\nu\Delta t(4k+1))\right]^2. \tag{12}$$

1.2.2 Вычисление $X^2_{Im}(\nu)$

Аналогично предыдущему пункту получим выражение для $X_{Im}(\nu)$, используя следующее тригонометрическое тождество:

$$\sin(\alpha) + \sin(\beta) = 2\sin\frac{\alpha+\beta}{2}\cos\frac{\alpha-\beta}{2}; \tag{13}$$

$$\begin{aligned} X_{Im}(\nu) &= -\sum_{k=0}^{N-1} x_{2k}[\sin(2\pi\nu(2k)\Delta t) + \sin(2\pi\nu(2k+1)\Delta t)] = \\ &= -2\sum_{k=0}^{N-1} x_{2k}\sin(\pi\nu\Delta t(4k+1))\cos(\pi\nu\Delta t) = \\ &= -2\cos(\pi\nu\Delta t)\sum_{k=0}^{N-1} x_{2k}\sin(\pi\nu\Delta t(4k+1)). \end{aligned} \tag{14}$$

Возводя результат в квадрат, получаем:

$$X^2_{Im}(\nu) = 4\cos^2(\pi\nu\Delta t)\left[\sum_{k=0}^{N-1} x_{2k}\sin(\pi\nu\Delta t(4k+1))\right]^2. \tag{15}$$

1.2.3 Вычисление $D(\nu)$

Воспользуемся полученными выражениями (12) и (15) для вычисления (8):

$$\begin{aligned} D(\nu) = \frac{\cos^2(\pi\nu\Delta t)}{N^2}\Bigg[&\left(\sum_{k=0}^{N-1} x_{2k}\cos(\pi\nu\Delta t(4k+1))\right)^2 + \\ &\left(\sum_{k=0}^{N-1} x_{2k}\sin(\pi\nu\Delta t(4k+1))\right)^2\Bigg]. \end{aligned} \tag{16}$$

1.3 Поиск симметрии

Рассмотрим подробнее суммы в выражении (16). Введем следующие обозначения:

$$S_{\cos}(\nu) \coloneqq \sum_{k=0}^{N-1} x_{2k}\cos(\pi\nu\Delta t(4k+1)); \tag{17}$$

$$S_{\sin}(\nu) \coloneqq \sum_{k=0}^{N-1} x_{2k}\sin(\pi\nu\Delta t(4k+1)). \tag{18}$$

Проверим наличие симметрии относительно частоты $0.5\nu_c$, где ν_c – частота Найквиста, равная $1/(2\Delta t)$:

$$\begin{aligned} S_{\cos}(\nu_c - \nu) &= \sum_{k=0}^{N-1} x_{2k} \cos(\pi(\nu_c - \nu)\Delta t(4k+1)) = \\ &= \sum_{k=0}^{N-1} x_{2k} \cos(\frac{\pi}{2}(4k+1) - \pi\nu\Delta t(4k+1)) \end{aligned} \tag{19}$$

$$\begin{aligned} S_{\sin}(\nu_c - \nu) &= \sum_{k=0}^{N-1} x_{2k} \sin(\pi(\nu_c - \nu)\Delta t(4k+1)) = \\ &= \sum_{k=0}^{N-1} x_{2k} \sin(\frac{\pi}{2}(4k+1) - \pi\nu\Delta t(4k+1)) \end{aligned} \tag{20}$$

Используя формулы приведения, упростим выражения (19) и (20):

$$S_{\cos}(\nu_c - \nu) = \sum_{k=0}^{N-1} x_{2k} \sin(\pi\nu\Delta t(4k+1)); \tag{21}$$

$$S_{\sin}(\nu_c - \nu) = \sum_{k=0}^{N-1} x_{2k} \cos(\pi\nu\Delta t(4k+1)). \tag{22}$$

Заметим следующее:

$$S_{\cos}(\nu) = S_{\sin}(\nu_c - \nu); \tag{23}$$

$$S_{\sin}(\nu) = S_{\cos}(\nu_c - \nu). \tag{24}$$

Отсюда:

$$S^2_{\cos}(\nu) + S^2_{\sin}(\nu) = S^2_{\cos}(\nu_c - \nu) + S^2_{\sin}(\nu_c - \nu). \tag{25}$$

Следовательно, значения, получаемые внутри квадратных скобок в выражении (16), симметричны относительно частоты, равной половине частоты Найквиста.

Однако значения $D(\nu)$ на частотах ν и $\nu_c - \nu$ не будут совпадать полностью вследствие наличия множителя $\cos^2(\pi\nu\Delta t)/N^2$, также зависящего от частоты ν. Это значит, что пики, имеющиеся на частотах меньших половины частоты Найквиста, будут отражены на симметричных относительно нее частотах с меньшей высотой.

Множитель изменения высоты пика можно вычислить как

$$\Gamma = \frac{\cos^2(\pi(\nu_c - \nu)\Delta t)}{\cos^2(\pi\nu\Delta t)} = \frac{\sin^2(\pi\nu\Delta t)}{\cos^2(\pi\nu\Delta t)}. \tag{26}$$