

Министерство образования и науки Российской Федерации
Федеральное государственное автономное образовательное учреждение высшего
образования

САНКТ-ПЕТЕРБУРГСКИЙ НАЦИОНАЛЬНЫЙ ИССЛЕДОВАТЕЛЬСКИЙ
УНИВЕРСИТЕТ ИТМО

Факультет систем управления и робототехники

Лабораторная работа № 4 "Линейная фильтрация"

по дисциплине Частотные методы

Выполнила: студентка гр. **R3238**

Нечаева А. А.

Преподаватель: *Перегудин Алексей Алексеевич*

Санкт-Петербург, 2024

1 Задание. Спектральное дифференцирование

1.1 Исходный график

Рассмотрим сигнал $y = \sin(t)$ на промежутке $[-100; 100]$ (рисунок 1).

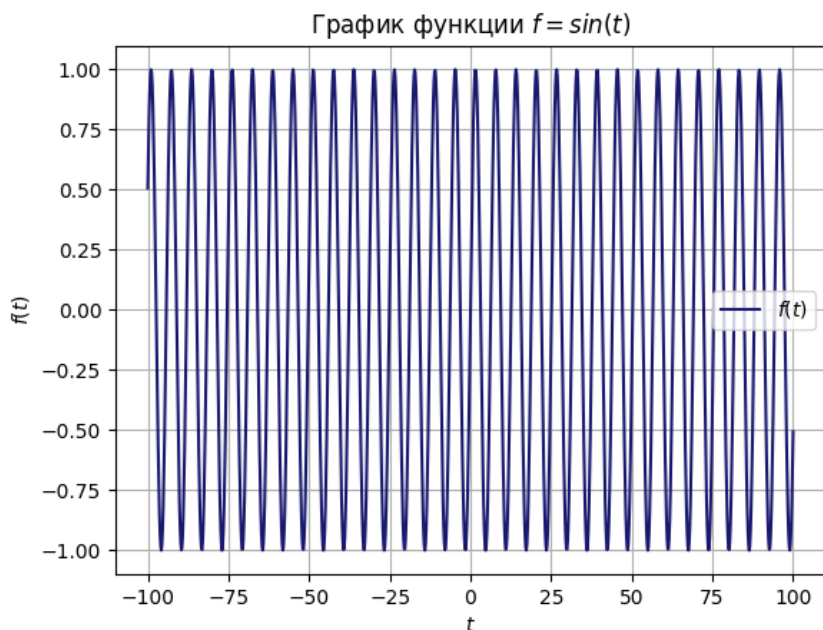


Рис. 1. Исходный график $f = \sin(t)$.

Будем также рассматривать часть исходного графика на промежутке $[-10; 10]$ (рисунок 2) для большей наглядности.

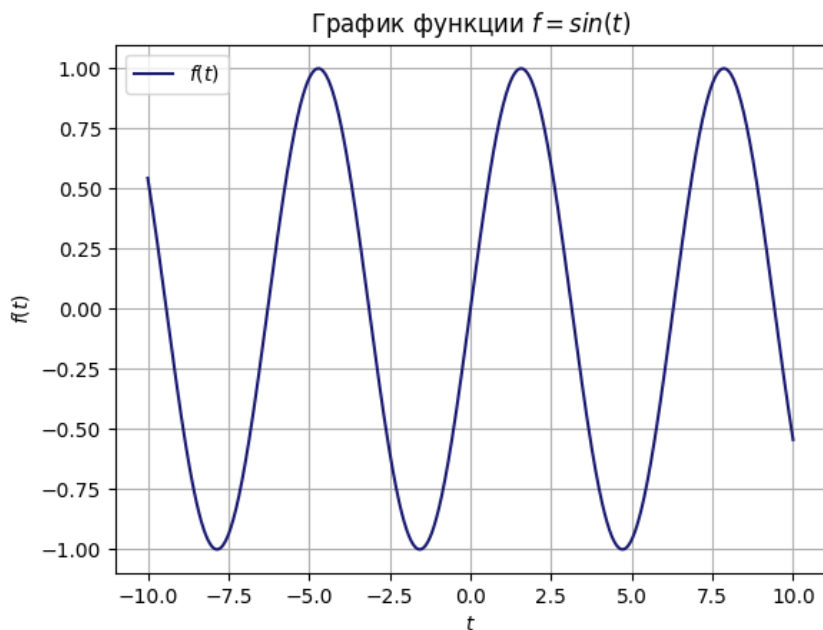


Рис. 2. Часть исходный график $f = \sin(t)$.

1.2 Добавление шума

Добавим к исходному графику функции небольшой шум вида

$$a \cdot (\text{rand}(\text{size}(t)) - 0.5)$$

результат представлен на рисунках 4 и 5.

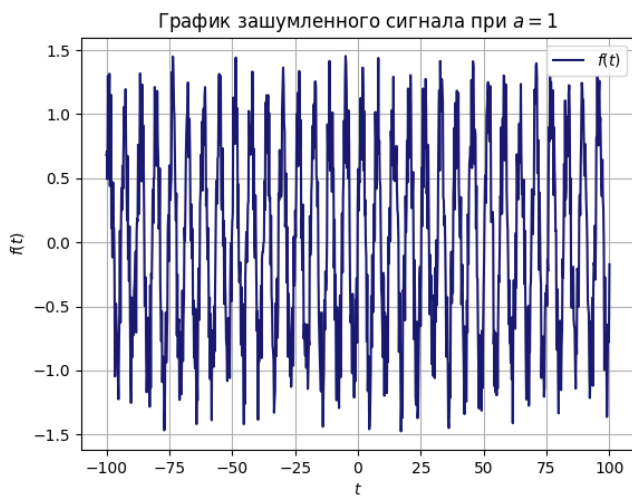


Рис. 3. Зашумленный график.

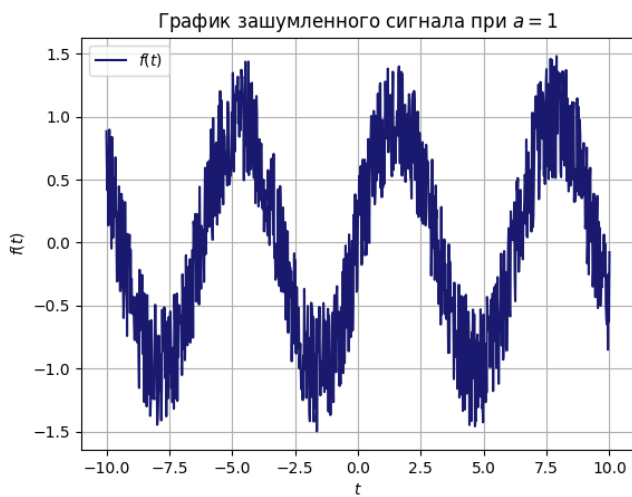


Рис. 4. Часть зашумленного графика.

1.3 Численная производная

Найдем численную производную от зашумленного сигнала, используя формулу поэлементного дифференцирования

$$\frac{y(k+1) - y(k)}{dt} \quad (1)$$

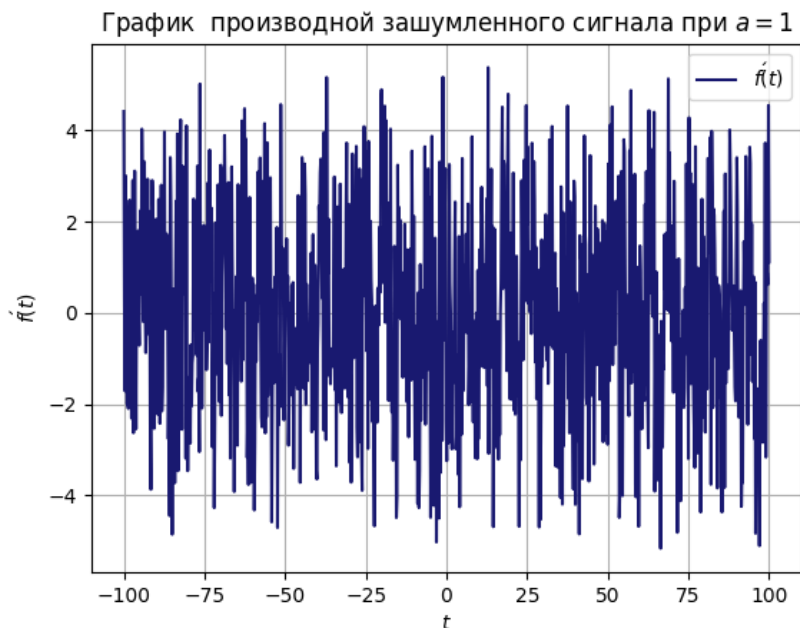


Рис. 5. Численная производная зашумленного графика функции при $a = 1$ на полном промежутке $[-100; 100]$.

Несмотря на то, что исходный график функции можно узнать при добавлении шума с коэффициентом $a = 1$, график численной производной в этом случае практически неузнаваем (рисунки 5-6), но при $a = 0.1$ очертания косинуса хорошо заметны и на графике численной производной (рисунок 7).

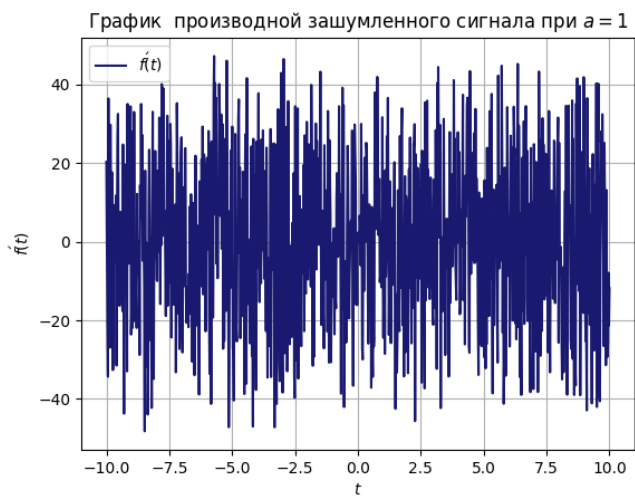


Рис. 6. Численная производная зашумленного графика функции при $a = 1$.



Рис. 7. Численная производная зашумленного графика функции при $a = 0.1$.

1.4 Спектральная производная

Найдем *спектральную производную* от зашумленного сигнала. Для этого с помощью численного интегрирования (*numpy.trapz*) найдем Фурье-образ сигнала и домножим его на ωi , так как $F\{f'(t)\} = \omega i F\{f(t)\}$, для того, чтобы получить Фурье-образ производной.

После чего выполним обратное преобразование Фурье для получения спектральной производной.



Рис. 8. Спектральная производная зашумленного графика функции при $a = 1$.

На промежутке $[-10; 10]$ графика заметно, что спектральная производная сильнее приближает точную производную $f'(t) = \cos(t)$ (рисунок 10) исходного графика функции по сравнению с численной производной. Причем как в случае $a = 1$, так и $a = 0.1$. Спектральная производная отличается меньшим количеством шумов, чем численная.

Вывод: применение Фурье-преобразования может помочь получить более точную производную функции зашумленного сигнала.

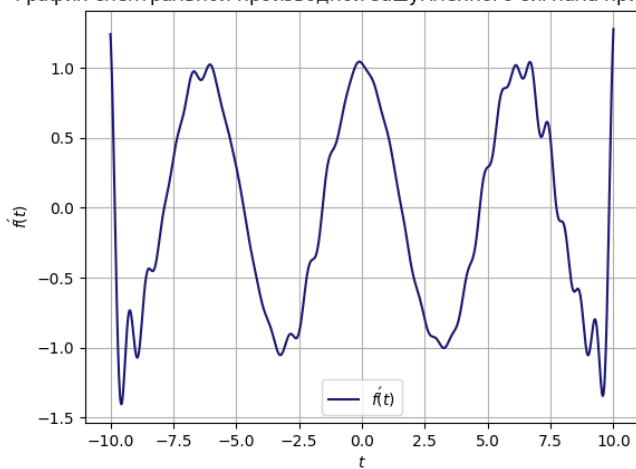
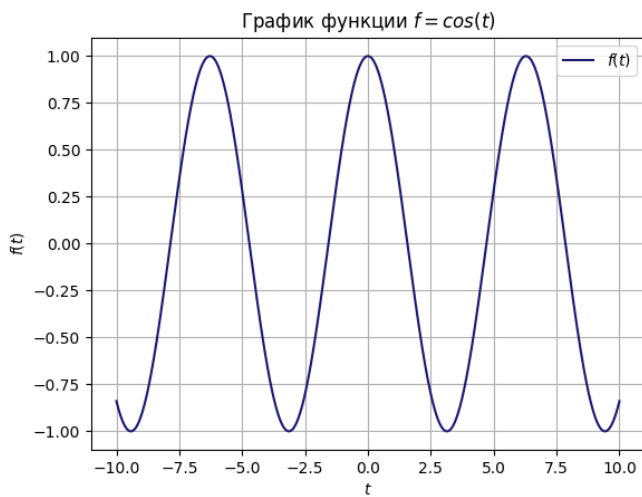
График спектральной производной зашумленного сигнала при $a = 0.1$ Рис. 9. Спектральная производная зашумленного графика функции при $a = 0.1$.

Рис. 10. График истинной производной.

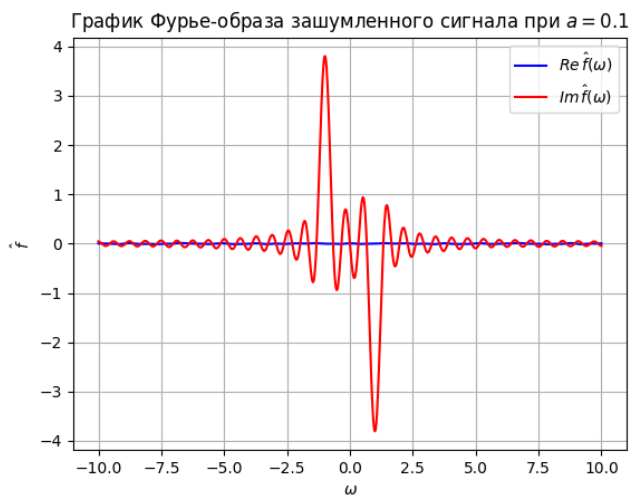


Рис. 11. График Фурье-образа зашумленной функции при $a = 0.1$.

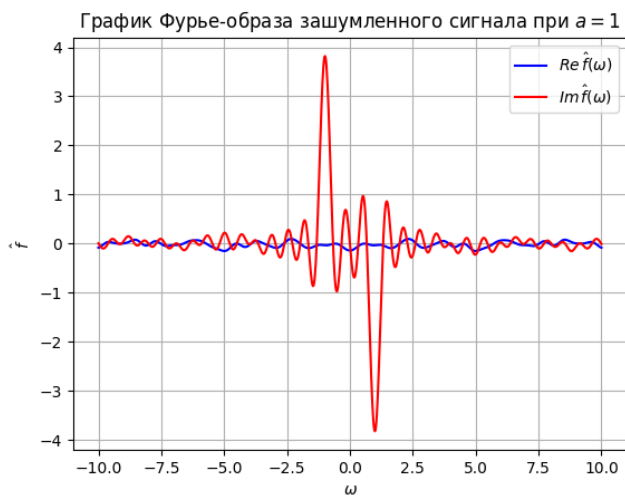


Рис. 12. График Фурье-образа зашумленной функции при $a = 1$.

2 Задание. Линейные фильтры.

Рассмотрим сигнал

$$u = g + b \cdot (\text{rand}(\text{size}(t)) - 0.5) + c \cdot \sin(d \cdot t)$$

и выполним фильтрацию указанного сигнала, используя линейные фильтры.

Сигнал $g(t)$ также перепишем из лабораторной 3: зададимся числами $a = 1$, $t_1 = 0$, $t_2 = 2$ и рассмотрим функцию $g(t) = a$ при $t \in [t_1, t_2]$ и $g(t) = 0$ при других t .

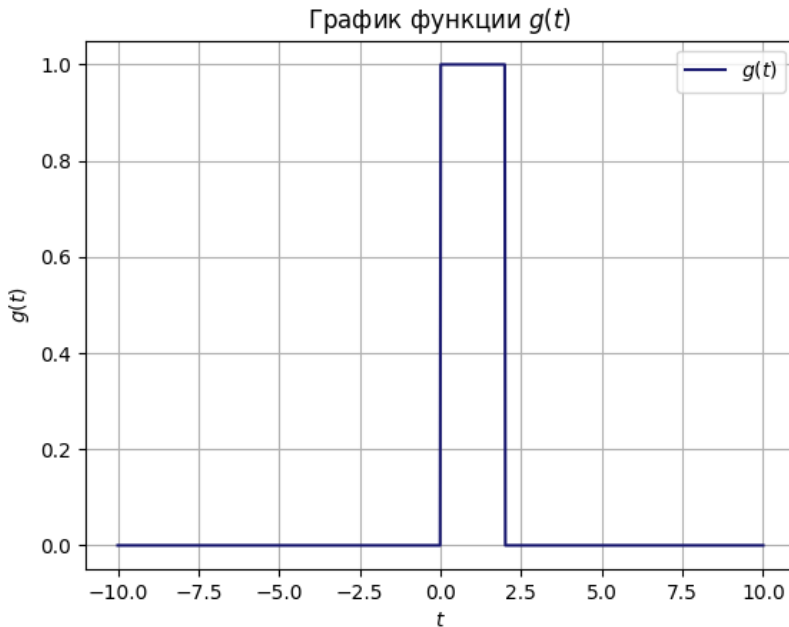


Рис. 13. Исходный график функции $g(t)$.

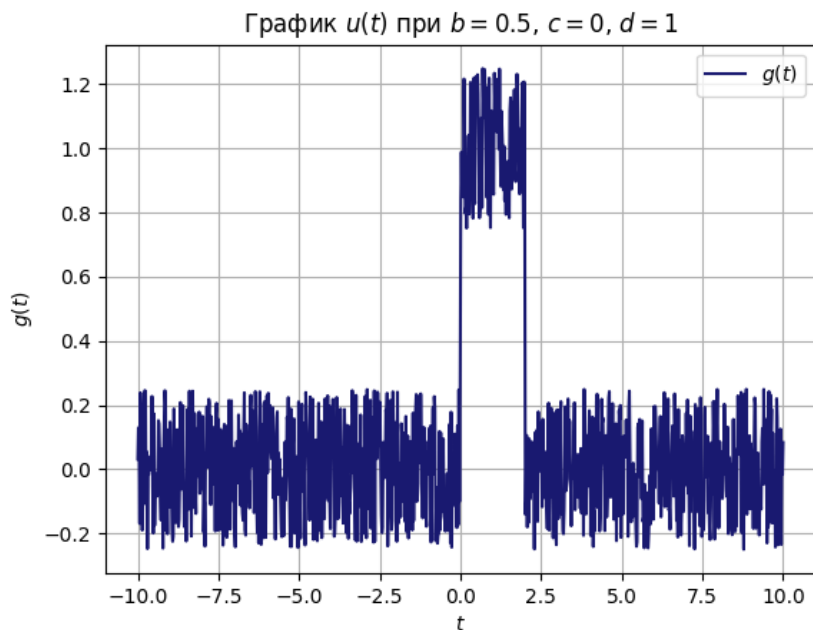


Рис. 14. График $u(t)$ при $b = 0.5, c = 0, d = 1$.

2.1 Фильтр первого порядка.

Пусть $c = 0$. Зададим постоянную времени $T > 0$ и пропустим сигнал u через линейный фильтр первого порядка

$$W_1(p) = \frac{1}{Tp + 1} \quad (2)$$

Заметим, что при малом значении параметра T шумы из сигнала практически не убираются (рисунок 15), но при увеличении значения коэффициента T график становится более гладким (рисунок 16).

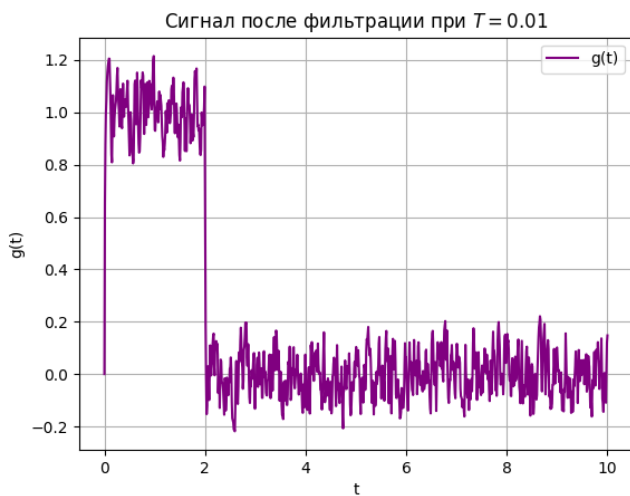


Рис. 15. График после фильтрации при $T = 0.01$.

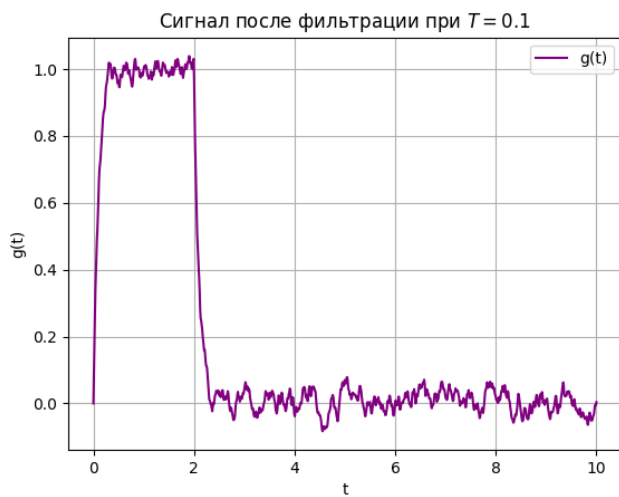


Рис. 16. График после фильтрации при $T = 0.1$.

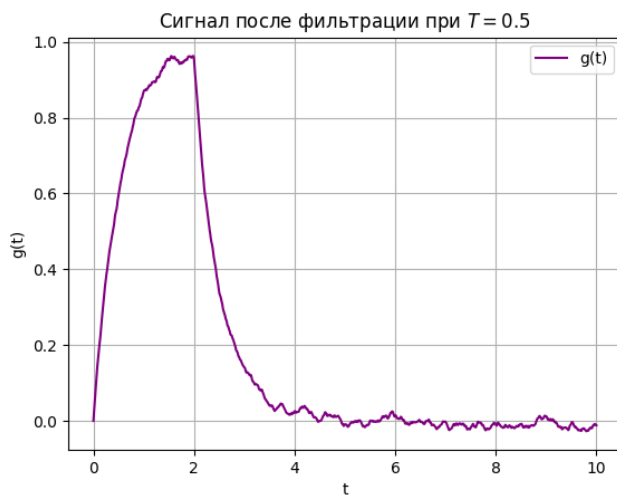


Рис. 17. График после фильтрации при $T = 0.5$.

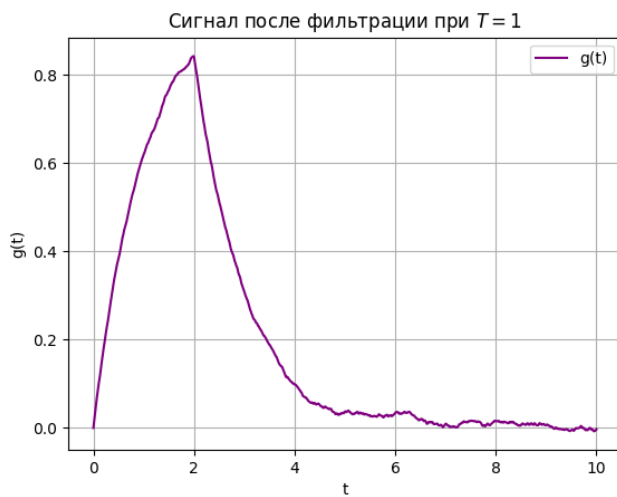


Рис. 18. График после фильтрации при $T = 1$.

При дальнейшем увеличении значения параметра T , начиная с $T = 1$ (рисунок 18), теряется точность передаваемого сигнала.

2.1.1 Сравнительные графики исходного, зашумленного и сигнала после фильтрации

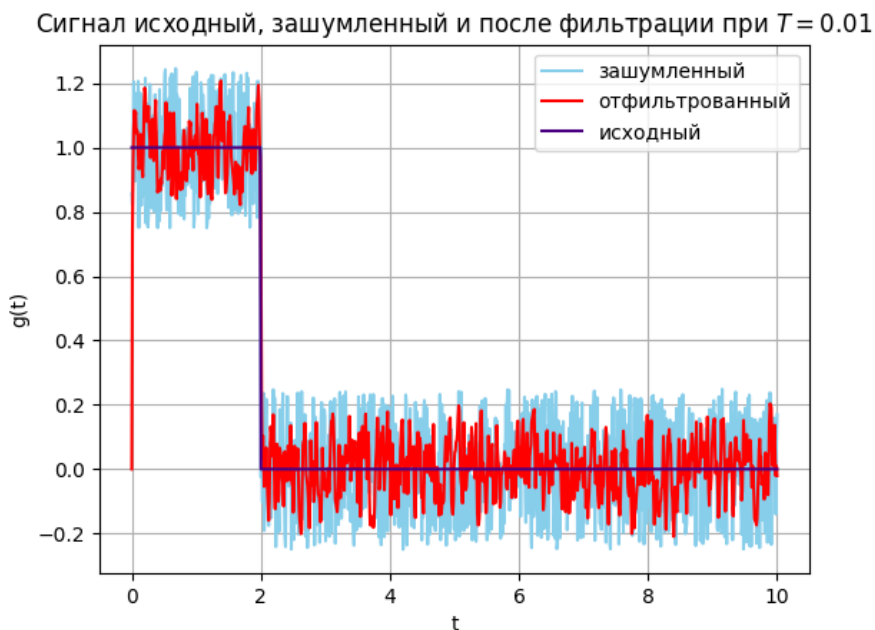


Рис. 19. Сравнительные графики при $T = 0.01$.

Далее, на рисунках 19-22 представлены сравнительные графики исходного сигнала $g(t)$, сигнала с шумами $u(t)$ и сигнала после фильтрации при разных значениях параметра T .

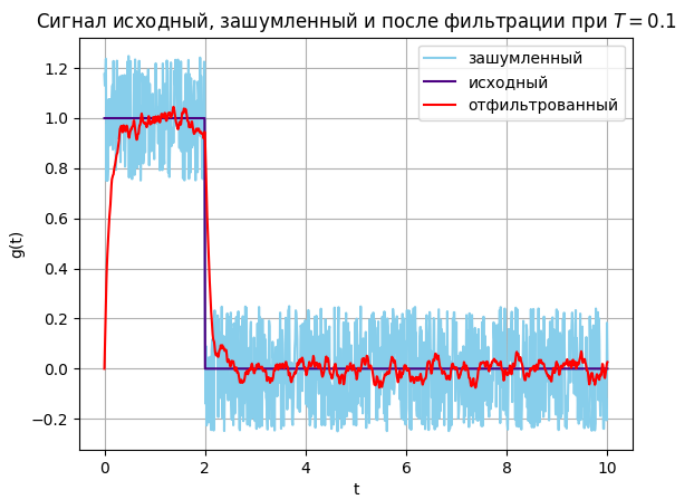


Рис. 20. Сравнительные графики при $T = 0.1$.

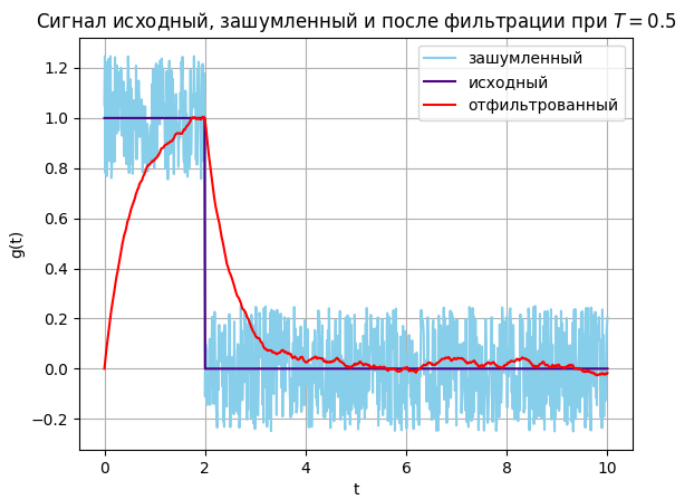


Рис. 21. Сравнительные графики при $T = 0.5$.

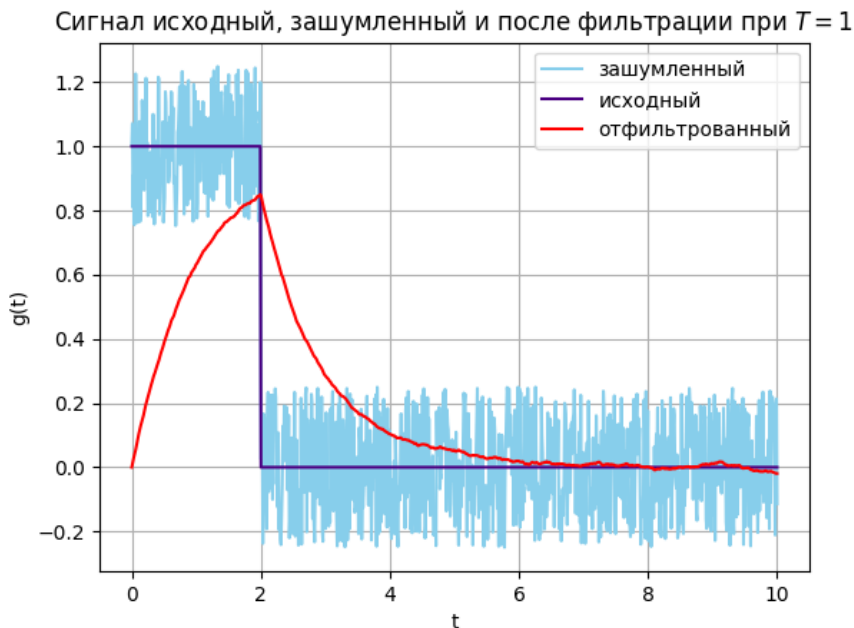


Рис. 22. Сравнительные графики при $T = 1$.

Наибольшее сходство фильтрованного сигнала с исходным достигается при $T = 0.1$, в чем можно убедиться, сравнив результаты, представленные на рисунках 19 - 22.

2.1.2 Модули Фурье-образов

Модули Фурье-образов исходного и фильтрованного сигналов наиболее близки друг к другу при небольших значениях T , например, $T = 0.01$ (рисунок 23) и $T = 0.1$ (рисунок 24). При дальнейшем возрастании параметра T модуль Фурье-образа фильтрованного сигнала становится все более гладким и отличным от исходного сигнала. Фильтр избавляет от более высоких частот и чем выше параметр T тем ниже модуль подавляемых частот.



Рис. 23. Модули Фурье-образов сигналов при $T = 0.01$.



Рис. 24. Модули Фурье-образов сигналов при $T = 0.1$.



Рис. 25. Модули Фурье-образов сигналов при $T = 0.5$.

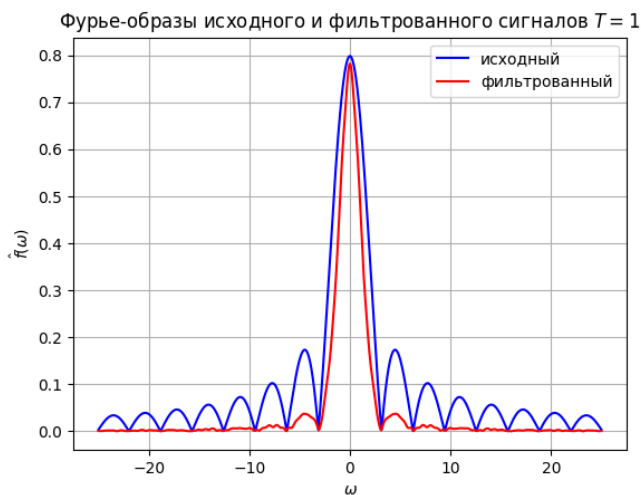


Рис. 26. Модули Фурье-образов сигналов при $T = 1$.

2.1.3 Амплитудно-частотные характеристики фильтра

Построим также графики амплитудно-частотной характеристики линейного фильтра первого порядка.

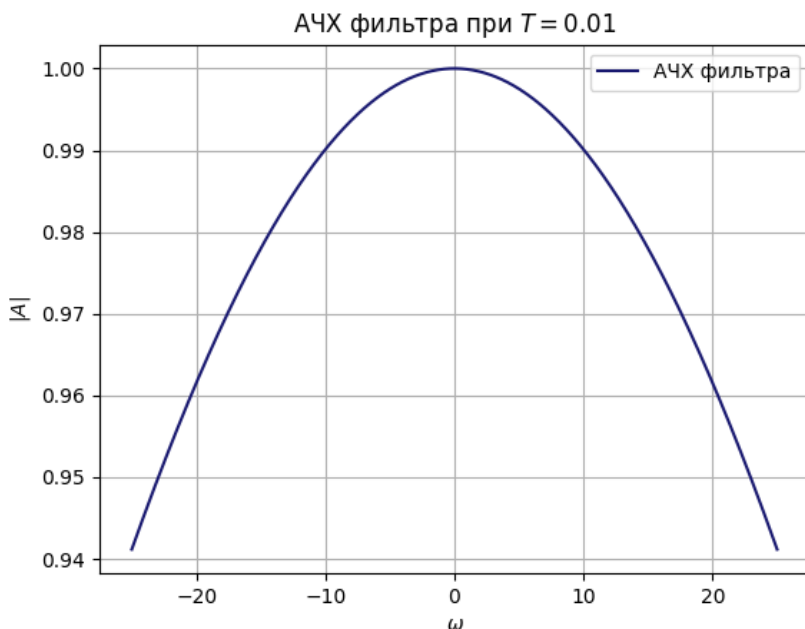


Рис. 27. АЧХ при $T = 0.01$.

Если опустить перпендикуляры на ось абсцисс из точек пересечения графика АЧХ с прямой $|A| = \frac{1}{\sqrt{2}} \simeq 0.7$, получим значения частот, выше которых частоты подавляются фильтром. Нетрудно заметить, что в случае $T = 0.01$ подавляются очень высокие значения частот, поэтому разницы между сигналом с шумом и фильтрованным сигналом практически нет (рисунок 19). Наилучший результат был достигнут при $T = 0.1$, в этом случае подавляются частоты выше 7 по модулю, при увеличении значения T (рисунки 29-30) диапазон подавляемых частот становится настолько большим, что теряется сходство исходного сигнала и сигнала после фильтрации.

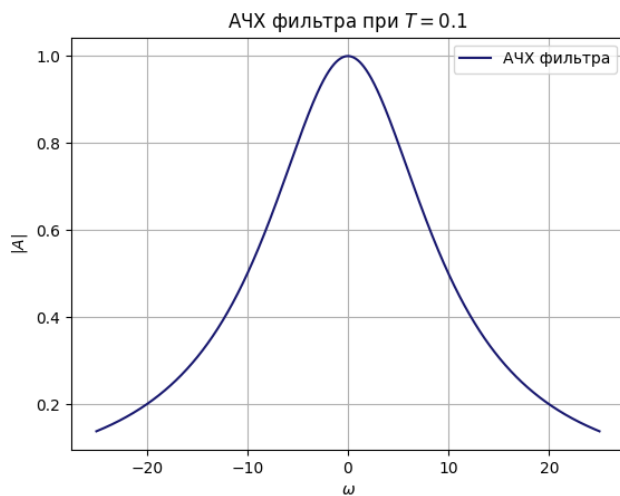


Рис. 28. АЧХ при $T = 0.1$.

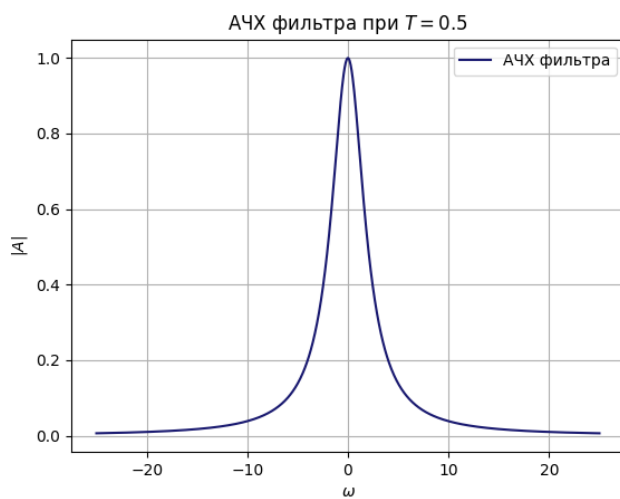
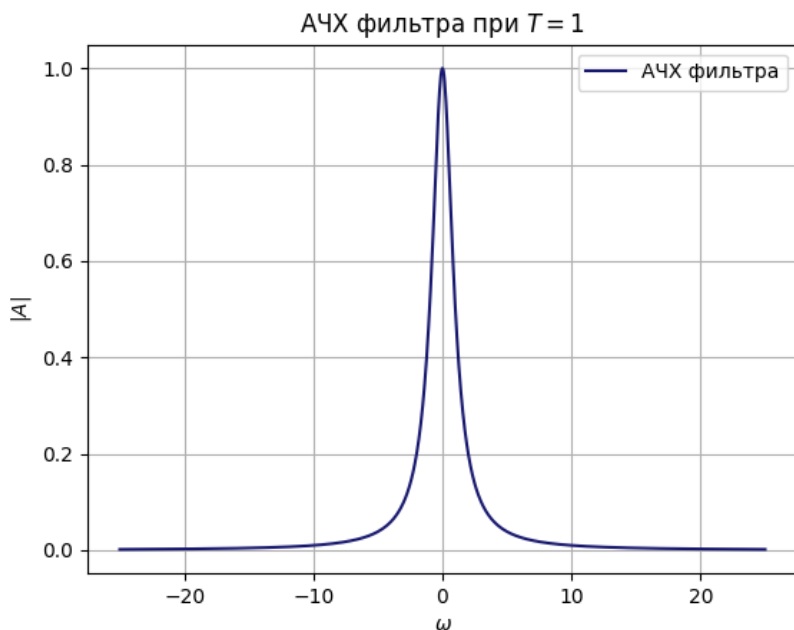


Рис. 29. АЧХ при $T = 0.5$.

Рис. 30. АЧХ при $T = 1$.

2.1.4 Влияние параметра a

Рассмотрим, как изменится результат фильтрации при $a = \{0.1, 0.5, 1, 2\}$ при $T = \{0.01, 0.1, 0.5, 1\}$.

Параметр a существенно не влияет на успешность фильтрации: при $T = 0.01$ – очистки от шумов практически не происходит, при $T = 1$ график получается слишком пологим, а наиболее оптимальный результат немного отличается, например, при $a = 0.1$ лучшее значение параметра $T = 0.5$, для значений $a = 0.5$, $a = 1$, $a = 2$ подходит $T = 0.1$.



a)



b)

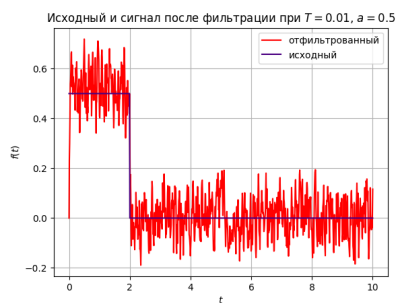


c)



d)

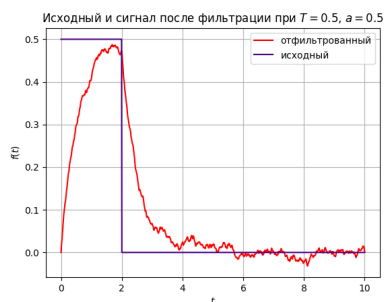
Рис. 31. Сравнительные графики исходного и фильтрованного сигналов для $a = 0.1$ при: a) $T = 0.01$, b) $T = 0.1$, c) $T = 0.5$, d) $T = 1$.



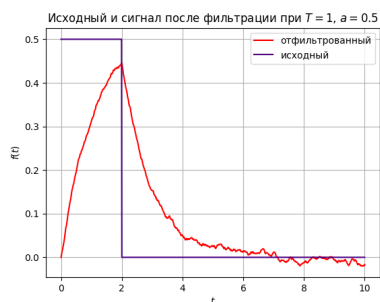
a)



b)

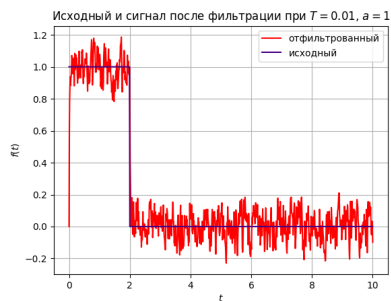


c)



d)

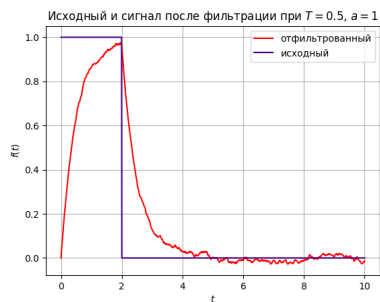
Рис. 32. Сравнительные графики исходного и фильтрованного сигналов для $a = 0.5$ при: a) $T = 0.01$, b) $T = 0.1$, c) $T = 0.5$, d) $T = 1$.



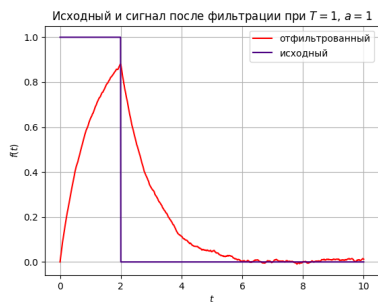
a)



b)

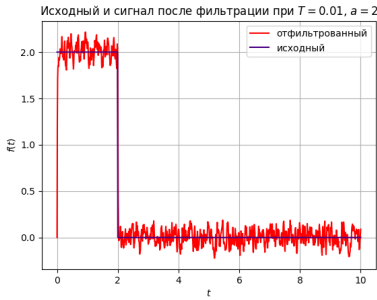


c)

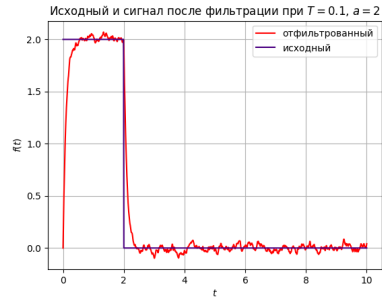


d)

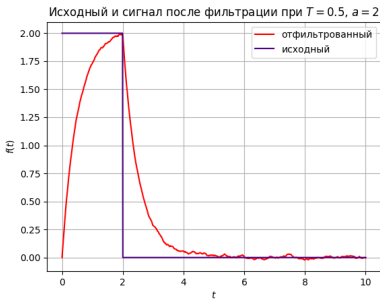
Рис. 33. Сравнительные графики исходного и фильтрованного сигналов для $a = 1$ при: a) $T = 0.01$, b) $T = 0.1$, c) $T = 0.5$, d) $T = 1$.



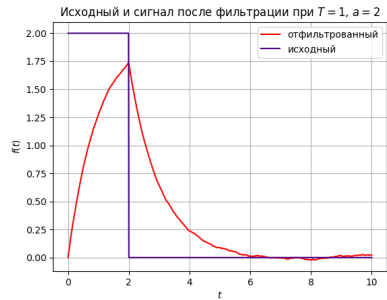
а)



б)



в)



г)

Рис. 34. Сравнительные графики исходного и фильтрованного сигналов для $a = 2$ при: а) $T = 0.01$, б) $T = 0.1$, в) $T = 0.5$, г) $T = 1$.

2.2 Специальный фильтр

Положим $b = 0$. Рассмотрим линейный фильтр вида

$$W_2(p) = \frac{(T_1 p + 1)^2}{(T_2 p + 1)(T_3 p + 1)} = \frac{T_1^2 p^2 + 2T_1 p + 1}{T_2 T_3 p^2 + (T_2 + T_3)p + 1} \quad (3)$$

Подберем значения параметров $T_1, T_2, T_3 > 0$ так, чтобы они хорошо убирали синусоидальную составляющую помехи и не сильно искажали полезный сигнал.

Результат представлен на рисунке 35, вклад синусоидальной составляющей сведен к минимуму, при этом полученный график не сильно искажает исходный сигнал – он все еще узнаваем.

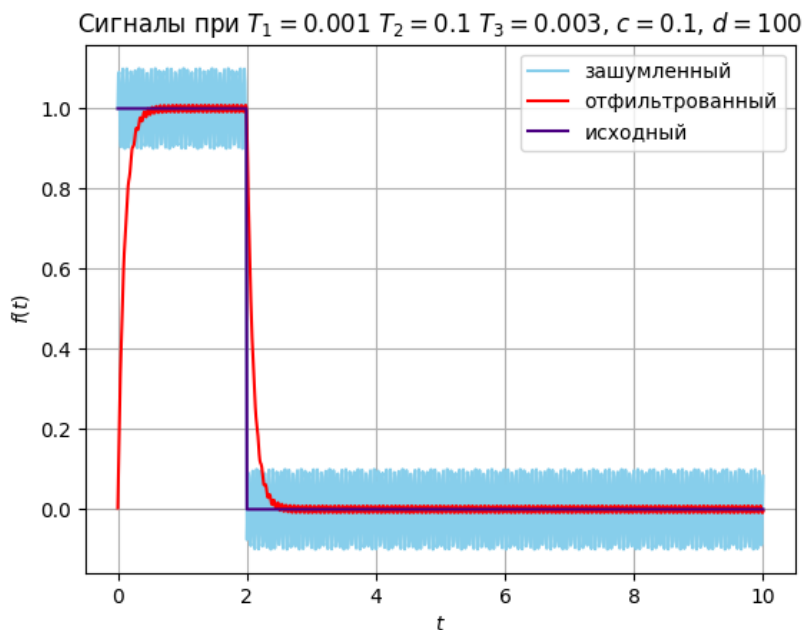


Рис. 35. Оптимальные параметры для специального фильтра при $d = 100$.

Теперь подберем оптимальные параметры $T_1, T_2, T_3 > 0$ для $d = \{20, 50\}$, полученные графики приведены на рисунках 36-38.

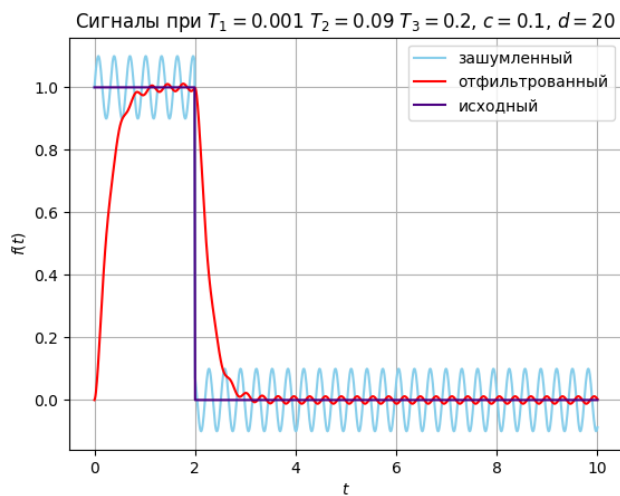


Рис. 36. Оптимальные параметры для специального фильтра при $d = 20$.

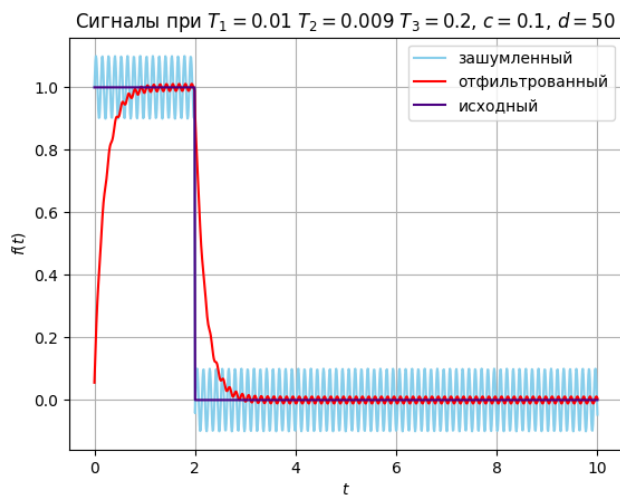


Рис. 37. Оптимальные параметры для специального фильтра при $d = 50$.

Теперь построим графики модулей Фурье-образов исходного и фильтрованного сигналов. Заметим, что наибольшее совпадение этих графиков при $d = 100$, $c = 0.1$, что подтверждает то, что параметры T_1, T_2, T_3 подобраны оптимально.

Фурье-образы сигналов $T_1 = 0.001$ $T_2 = 0.1$ $T_3 = 0.003$, $c = 0.1$, $d = 100$

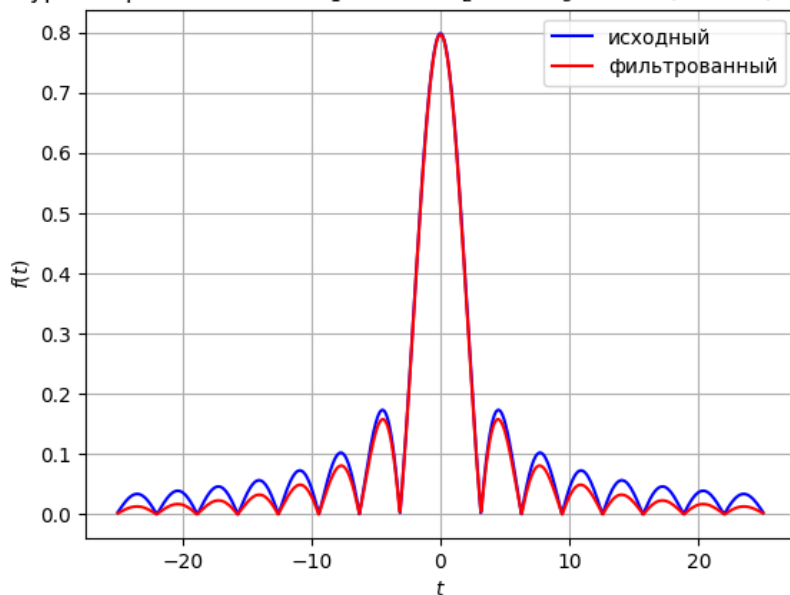


Рис. 38. Графики модулей Фурье-образов при $d = 100$.



Рис. 39. Графики модулей Фурье-образов при $d = 20$.



Рис. 40. Графики модулей Фурье-образов при $d = 50$.

Построим графики амплитудно-частотной характеристики фильтра специальных частот.

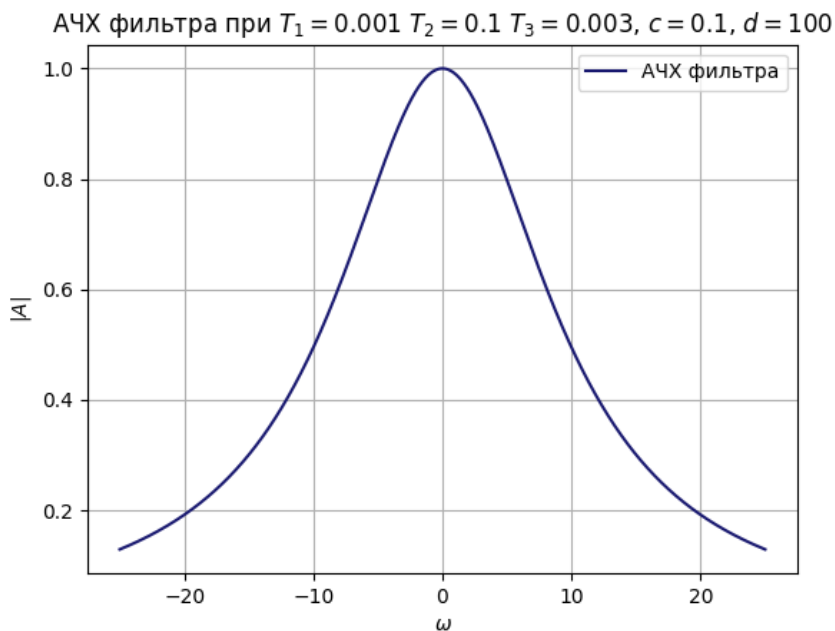


Рис. 41. АЧХ фильтра специальных частот при $d = 100$.

Вновь воспользуемся тем, что перпендикуляры на ось абсцисс из точек пересечения графика АЧХ с прямой $|A| = \frac{1}{\sqrt{2}} \simeq 0.7$ отмечают значения частот, выше которых частоты подавляются фильтром. Заметим, что для случая наибольшего значения параметра $d = 100$ модуль, выше которого частоты подавляются так же максимальный примерно равен 7, для $d = 50$ это 3, для $d = 20$ аналогичный параметр равен 2.

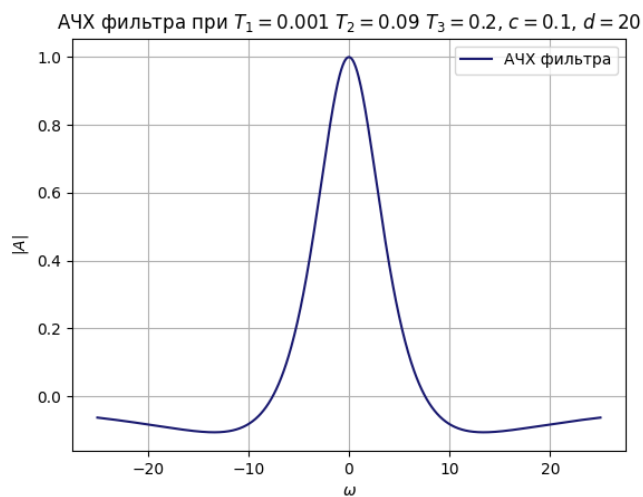


Рис. 42. АЧХ фильтра специальных частот при $d = 20$.

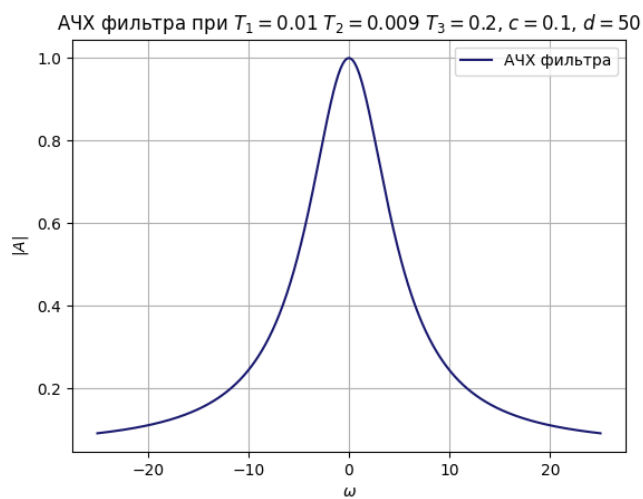


Рис. 43. АЧХ фильтра специальных частот при $d = 50$.

От параметра s прямо пропорционально зависит амплитуда синусоидального шума. И успешность подавления шума с помощью линейного фильтра специальных частот не зависит от амплитуды синусоидальной составляющей шума.

3 Задание. Сглаживание биржевых линий.

Рассмотрим график котировок акций *Sber* в период с 17.04.2023 по 17.04.2024.



Рис. 44. Исходные данные о стоимости акций компании *Sber* в период с 17.04.2023 по 17.04.2024.

Применим к данным о стоимости акций линейную фильтрацию с помощью фильтра первого порядка. Последовательно возьмем следующие значения постоянной времени T : 1 день, 1 неделя, 1 месяц, 3 месяца, 1 год.