Techniques d'Egalisation

3 janvier 2012

Plan

- Communications avec interférences symboles
- Estimation de canal
- Egalisation linéaire
- Structures d'égalisation non linéaire
- Maximum de Vraisemblance

Modélisation

Signal émis en bande de base

On considère une modulation de type QAM d'ordre M.

$$s(t) = \sum_{k \in \mathbb{N}} s_k h_e(t - kT), \ s_k \in \mathbb{C}$$

- $s_k = I_k + jQ_k$: séquence de symboles émis appartenant à une constellation M-QAM $\mathcal{S}(|\mathcal{S}| = M = 2^m)$,
- T : période symbole,
- $h_e(t)$: filtre de mise en forme à l'émission.

Modélisation

Signal émis en bande transposée (signal modulé)

$$\tilde{s}(t) = Re[s(t)e^{j2\pi f_0 t}]
= Re[s(t)]cos(2\pi f_0 t) - Im[s(t)]sin(2\pi f_0 t)
= I(t)cos(2\pi f_0 t) - Q(t)sin(2\pi f_0 t)$$
(1)

avec

- $I(t) = \sum_{k} i_k h_e(t kT)$: signal en phase (PAM voie I),
- $Q(t) = \sum_{k} q_k h_e(t kT)$: signal en quadrature (PAM voie Q),

Modélisation

Signal reçu en bande transposée (signal modulé)

$$\tilde{r}(t) = \alpha_0 \tilde{s}(t) + \sum_{l=1}^{L-1} \alpha_l \tilde{s}(t - \tau_l) + \tilde{b}(t)$$

$$= Re[r(t)e^{i2\pi f_0 t}]$$
(2)

avec b(t): bruit blanc thermique Gaussien

$$ilde{b}(t) = Re[b(t)e^{i2\pi f_0 t}]$$
 $= Re[b(t)]cos(2\pi f_0 t) - Im[b(t)]sin(2\pi f_0 t)$
 $= b_i(t)cos(2\pi f_0 t) - b_a(t)sin(2\pi f_0 t)$

Modélisation

Signal reçu équivalent en bande de base

$$r(t) = \sum_{k \in \mathbb{N}} s_k \left[\sum_{l=0}^{L-1} \alpha_l \exp\left(-j2\pi f_0 \tau_l\right) h_e(t - kT - \tau_l) \right] + b(t)$$

$$= \sum_{k \in \mathbb{N}} s_k h_c * h_e(t - kT) + b(t)$$

$$= h_c * s(t) + b(t)$$
(3)

avec $h_c(t)$: canal de propagation équivalent en bande de base

$$h_{c}(t) = \sum_{l=0}^{L-1} \alpha_{l} e^{-j2\pi f_{0}\tau_{l}} \delta(t - \tau_{l})$$

$$H_{c}(t) = \sum_{l=0}^{L-1} \alpha_{l} e^{-j2\pi f_{0}\tau_{l}} e^{-j2\pi \tau_{l} t}$$
(4)

Modélisation - Filtrage adapté blanchissant

Filtrage adapté et modèle équivalent bande de base

$$y(t) = h_{r} * r(t) + h_{r} * b(t)$$

$$= \sum_{k \in \mathbb{N}} s_{k} h_{r} * h_{c} * h_{e}(t - kT) + h_{r} * b(t)$$

$$= \sum_{k \in \mathbb{N}} s_{k} h(t - kT) + b_{r}(t)$$
(5)

avec $h(t) = h_r * h_c * h_e(t)$: enveloppe complexe du canal global *équivalent* en bande de base

- Récepteur optimal : Whitened Matched Filter [Forney]
 - $h_r(t)$ est le filtre adapté à $g(t) = h_c * h_\theta(t)$,
 - échantillonnage au rythme symbole T_s, IES toujours présente et nécessité d'un filtre blanchissant.
 - odétection au sens ML ou critère de détection sous-optimaux. pas très réaliste dans un contexte canal $h_c(t)$ variable rapidement en temps.

Modélisation - Filtrage adapté partiel

Filtrage adapté et modèle équivalent bande de base

$$y(t) = h_r * r(t) + h_r * b(t)$$

$$= \sum_{k \in \mathbb{N}} s_k h_r * h_c * h_e(t - kT) + h_r * b(t)$$

$$= \sum_{k \in \mathbb{N}} s_k h(t - kT) + b_r(t)$$
(6)

avec $h(t) = h_r * h_c * h_e(t)$: enveloppe complexe du canal global *équivalent* en bande de base

- Récepteur sous-optimal : Partial Matched Filter
 - $h_r(t)$ est le filtre adapté à $h_e(t)$,
 - échantillonnage au rythme symbole T_s , IES toujours présente, mais plus nécessité d'un filtre blanchissant,
 - détection au sens ML ou critère de détection sous-optimaux (égalisation linéaire).

Modélisation

Modèle discret équivalent bande de base (Temps symbole)

$$y[n] \triangleq y(nT)$$

$$= \sum_{k \in \mathbb{N}} s_k h((n-k)T) + b_r(nT)$$

$$= \sum_{k \in \mathbb{N}} s_k h_{n-k} + b[n]$$
(7)

avec $h[n] = h_r * h_c * h_e(nT)$: réponse impulsionnelle discrète du canal équivalent en bande de base.

Modélisation

Bruit échantillonné

 $b_r(t)$ est Gaussien car filtré de b(t), b[n] non corrélés et Gaussiens donc indépendants

$$\overset{\circ}{\Gamma}_b(f) = N_0$$

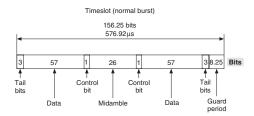
$$\overset{\circ}{\Gamma}_{b_r}(f) = N_0 |H_e(f)|^2$$

$$\gamma_b(p) = N_0 \delta(p) \tag{8}$$

Estimation de canal

Séquence d'apprentissage

- pour égaliser, nécessité de connaître une estimation de *h*[*n*],
- utilisation de séquences pilotes dites d'apprentissage



Estimation de canal

Principe - inter-corrélation

Identification par inter-corrélation

• On suppose une séquence de symboles connus s[n] i.i.d. tels que

$$\gamma_s(p) = \sigma_s^2 \delta(p)$$

• Calcul de de l'inter-corrélation entre $y[n] = \sum_k h_k s_{n-k} + b[n]$ et s[n]:

$$\gamma_{y,s}(p) = \mathbb{E}(y[n]s^*[n-p]) = \sigma_s^2 h[p]$$

 en pratique, s[n] non réellement i.i.d., mais s[n] doit donc avoir de bonnes propriétés d'auto-corrélation (séquences pseudo-aléatoires).

Estimation de canal

Principe - estimateur max. de vraisemblance

Modèle pour estimation

$$\mathbf{v} = \mathbf{Sh} + \mathbf{b}$$

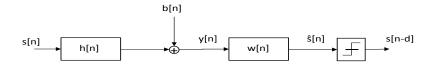
avec

•
$$\mathbf{y} = [y[0], \dots, y[N_{app} - 1]], \ \mathbf{h} = [h[0], \dots, h[L - 1]], \ \mathbf{b} = [b[0], \dots, b[N_{app} - 1]], \ \mathbf{s} = \begin{bmatrix} s_0 & s_{-1} & \dots & s_{-L+1} \\ s_1 & & & \\ \vdots & & & \\ s_{Napp-1} & s_{Napp-2} & \dots & s_{Napp-L} \end{bmatrix}$$

Estimateur Maximum de vraisemblance

$$\hat{\mathbf{h}} = (\mathbf{S}^{\dagger} \mathbf{S})^{-1} \mathbf{S}^{\dagger} \mathbf{y} = \hat{\mathbf{R}}_{s} \hat{\Gamma}_{ys}
= \mathbf{S}^{\sharp} \mathbf{y} \text{ (pseudo - inverse)}$$
(9)

Principes



- w[n] est un filtre dît égaliseur,
- différentes structures possibles : FIR ou IIR,
- différents critères d'optimisation pour la décision : ZF ou MMSE (Wiener).

 $\mathbf{w}_{\mathsf{z}\mathsf{f}} * h[\mathsf{n}] = \delta[\mathsf{n} - \mathsf{d}]$

Critère zéro-forcing (ZF) : imposer les IES nulles en absence de bruit

structure non contrainte

En Temporel Domaine transformé en Z $\hat{s}[n] = w_{ZF} * y(n) = s[n-d] \iff \hat{s}(z) = w_{ZF}(z)h(z)s(z) = s(z)z^{-d}$

 $W_{zf}(z) = \frac{z^{-d}}{h(z)}$

structure contrainte FIR (sans délai) :
$$\mathbf{w}_{zf} = \{w_k, k = -N \dots + N\}$$

$$w_{zf} * h[n] = \sum_{k=-N}^{N} w_k h_{n-k} = \begin{cases} 1, & n=0\\ 0, & n=\pm 1, , \pm N \end{cases}$$

$$\begin{pmatrix} h[0] & \dots & h[-N] & \dots & h[-2N] \\ \vdots & & \vdots & & \vdots \\ h[N-1] & \dots & h[-1] & \dots & h[-N-1] \\ h[N] & \dots & h[0] & \dots & h[-N] \\ h[N+1] & \dots & h[1] & \dots & h[-N+1] \\ \vdots & & \vdots & & \vdots \\ h[2N] & \dots & h[N] & \dots & h[0] \end{pmatrix} \begin{pmatrix} w_{-N} \\ \vdots \\ w_{-1} \\ w_{0} \\ w_{1} \\ \vdots \\ w_{N} \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 0 \\ \vdots \\ 0 \\ 1 \\ 0 \\ \vdots \\ 0 \end{pmatrix}$$

Critère zéro-forcing (ZF) - Analyse en présence de bruit

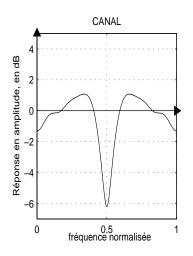
structure non contrainte	
En Temporel	Domaine fréquentiel
$\hat{s}[n] = s[n-d] + \underbrace{w_{ZF} * b[n]}_{b_{l}[n]}$	$ \overset{\circ}{\gamma}_{b_{t}}(\nu) = \overset{\circ}{\sigma_{b}^{2}} \left \overset{\circ}{\mathbf{w}}_{zf}(\nu) \right ^{2} $ $ \downarrow \qquad \qquad \qquad \downarrow \qquad \qquad \qquad \downarrow \qquad \qquad \qquad \downarrow \qquad \qquad \qquad \downarrow \qquad$

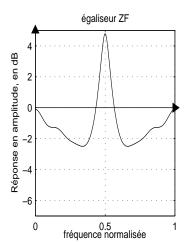
structure contrainte FIR (sans délai)

$$b_{f}[n] = \sum_{k=-N}^{N} w_{k} b_{n-k}$$
 $\sigma_{b_{f}}^{2} = \sigma_{b}^{2} \sum_{k=-N}^{N} |w_{k}|^{2} = \sigma_{b}^{2} E_{w}$

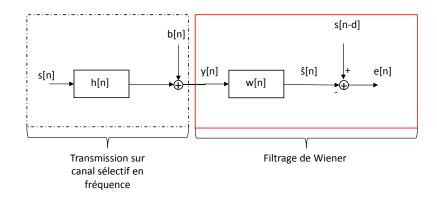
- Amplification du bruit : si $\exists \nu_0 \in [0,1]$, tel que $\overset{\circ}{h}(\nu_0) = 0$, le gain du filtre ZF peut devenir infini et donc la puissance de bruit filtré est peut être très grande,
- faible complexité mais forte amplification du bruit

Critère zéro-forcing (ZF) - Illustration





Critère EQMM - filtrage de Wiener pour l'égalisation

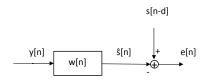


Filtrage de Wiener appliquée à l'égalisation

Trouver le filtre optimal $w_{opt}(z)$ qui minimiser la fonction de coût

$$J_{\mathbf{w}} = \mathbb{E}(|e[n]|^2), \ e[n] = s[n-d] - \hat{s}[n], \ s[n] = w * y[n]$$

Critère EQMM - filtrage de Wiener appliquée à l'égalisation



Filtrage de Wiener : cadre générale

Trouver le filtre optimal $w_{opt}(z)$ qui minimiser la fonction de coût

$$J(\mathbf{w}) = \mathbb{E}(|e[n]|^2), \ e[n] = s[n-d] - \hat{s}[n]$$

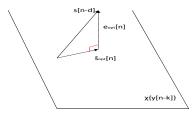
Critère EQMM - filtrage de Wiener appliquée à l'égalisation

Principe d'othogonalité

CNS:
$$\mathbb{E}(e_{opt}[n]y[n-k]^*) = 0, \forall k \in \mathbb{Z}$$

Interprétation géométrique

- Opérateur $\mathbb{E}(XY*) = \langle X, Y \rangle$ définit un produit scalaire sur $\mathcal{H} = L^2(\Omega)$ si variables centrées,
- l'erreur optimale est donc obtenue si elle est orthogonale à l'espace des observations (meilleure estimation obtenue)



Critère EQMM - filtrage de Wiener appliquée à l'égalisation

Wiener non contraint

• Expression du filtre de Wiener non contraint :

Domaine en z :
$$w_{\infty}(z) = \frac{\sigma_s^2 z^{-d} h^*(z^{-1})}{\sigma_s^2 h(z) h^*(z^{-1}) + \sigma_b^2}$$

avec
$$h^*(z) = \sum_{n} h^*(n) z^{-n}$$

Domaine fréquentiel :
$$\overset{\circ}{w}_{\infty}(\nu) = e^{-j2\pi\nu d} \frac{\sigma_s^2 \overset{\circ}{h}^*(\nu)}{\sigma_s^2 |\overset{\circ}{h}(\nu)|^2 + \sigma_b^2}$$

• Equivalence à fort SNR avec le filtre ZF :

$$W_{\infty}(z) \approx W_{zf}(z)$$

Critère EQMM - filtrage de Wiener appliquée à l'égalisation

Wiener RIF de taille N

$$s[\hat{n}] = \sum_{k=0}^{N-1} w_k y_{n-k} \text{ et } \mathbb{E}(e_{opt}[n]y[n-p]^*) = 0, \ \forall p \in [0, N-1]$$

• Expression générale :

$$R_y$$
w = $[(\gamma_{sy}(p-d))_{p=0\cdots N-1}] = \Gamma_{sy}$

• Expression détaillée :

$$\mathbf{Y}_n = \mathbf{H} \mathbf{S}_n + \mathbf{B}_n$$

$$\mathbf{w} = \sigma_s^2 (\sigma_s^2 \mathbf{H}^* \mathbf{H}^\top + \sigma_b^2)^{-1} \mathbf{H}^* \mathbf{1}_d$$

$$\mathbf{1}_d = [0 \cdots 0 \underbrace{1}_{\text{position d}} 0 \cdots 0]^{\top}$$

Critère EQMM - filtrage de Wiener appliquée à l'égalisation

Modèle matriciel détaillé 1/2

$$\mathbf{Y}_n = [y[n] \dots y[n-N+1]]^{\top}$$

 $\mathbf{B}_n = [b[n] \dots b[n-N+1]]^{\top}$

$$\mathbf{H} = \begin{pmatrix} h[0] & \dots & h[L-1] & 0 & \dots & \dots & 0 \\ 0 & h[0] & \dots & h[L-1] & \ddots & & \vdots \\ \vdots & \ddots & \ddots & & \ddots & \ddots & \vdots \\ \vdots & & \ddots & \ddots & & \ddots & \ddots & 0 \\ 0 & \dots & \dots & 0 & h[0] & \dots & h[L-1] \end{pmatrix}$$

 $\mathbf{S}_{n} = [s[n] \dots s[n-N-L+2]]^{\top}$

Modèle matriciel détaillé 2/2

$$\mathbf{R}_{y} = \begin{pmatrix} \gamma_{Y}(0) & \gamma_{Y}(-1) & \cdots & \gamma_{Y}(-N+1) \\ \gamma_{Y}(1) & \gamma_{Y}(0) & \cdots & \gamma_{Y}(-N+2) \\ \vdots & \vdots & \ddots & \vdots \\ \gamma_{Y}(N-1) & \gamma_{Y}(N-2) & \cdots & \gamma_{Y}(0) \end{pmatrix} = \mathbb{E}(\mathbf{Y}_{n}^{*}\mathbf{Y}_{n}^{\top})$$

$$\Gamma_{sy} = [(\gamma_{sy}(p-d))_{p=0\cdots N-1}] = \mathbb{E}(s[n-d]\mathbf{Y}_n^*)$$

Erreur quadratique moyenne minimum et décomposition du critère

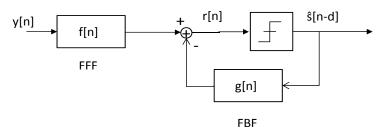
$$J(\mathbf{w}) = \sigma_s^2 + \mathbf{w}^{\dagger} \mathbf{R}_y \mathbf{w} - 2 \operatorname{Re}(\mathbf{w}^{\dagger} \Gamma_{sy})$$

$$\downarrow \downarrow$$

$$\sigma_{e, \text{opt}}^2 = \sigma_s^2 - \Gamma_{sy}^{\dagger} \mathbf{w} = \sigma_s^2 - \mathbf{w}^{\dagger} \Gamma_{sy}$$

$$= \sigma_s^2 - \mathbf{w}^{\dagger} \mathbf{R}_y \mathbf{w} = \sigma_s^2 (1 - \underbrace{\mathbf{w}^{\dagger} \mathbf{H}^* \mathbf{H}^{\dagger} \mathbf{w}}_{IES} - \underbrace{\operatorname{snr}^{-1} || \mathbf{w} ||^2}_{bruit})$$

Decision feedback Equalization(DFE): principe



DFE: data-aided equalization

- Motivation : Le filtrage linéaire classique peut laisser de l'IES résiduelle.
- Idée: Utiliser les décisions précédentes pour éliminer en partie cette IES résiduelle,
- Structure : Egaliseur non linéaire par nature.
- Question : comment choisir les filtres f[n] et g[n]

Decision feedback Equalization(DFE): principe

Block DFE: Modélisation matricielle pour critère MMSE

$$r[n] = \mathbf{F}^{\top} \mathbf{Y}_n - \mathbf{G}^{\top} \hat{\mathbf{S}}_{n-d-1} = \mathbf{w}^{\top} \tilde{\mathbf{Y}}_n$$

$$\mathbf{F} = [f_0, \dots, f_{N-1}]^{\top}$$

$$\mathbf{G} = [g_1, \dots, g_{M-1}]^{\top}$$

r[n] ne dépend que des symboles passés $\hat{s}(n-d-k)$

$$\mathbf{Y}_{n} = [y[n], \dots, y[n-N+1]]^{\top}, \hat{\mathbf{S}}_{n-d-1} = [\hat{s}[n-d-1], \dots, \hat{s}[n-d-M+1]]^{\top}$$
$$\tilde{\mathbf{Y}}_{n} = [\mathbf{Y}_{n}^{\top}, -\hat{\mathbf{S}}_{n-d-1}^{\top}]^{\top}$$

Optimisation avec critère MMSE

Trouver les filtres optimaux $f_{opt}[n]$ et $g_{opt}[n]$ qui minimisent la fonction de coût

$$J(\mathbf{w}) = \mathbb{E}(|e[n]|^2), \ e[n] = s[n-d] - r[n]$$

Decision feedback Equalization(DFE): principe

Optimisation avec critère MMSE, suite

• Résolution : Le problème initial revient au problème classique de Wiener consistant à optimiser le filtre \mathbf{w} avec comme vecteur d'observations étendu \tilde{Y}_n :

$$\mathbf{R}_{\tilde{y}}\mathbf{w} = \Gamma_{s\tilde{y}}$$

avec

$$\mathbf{R}_{ ilde{y}} = \mathbb{E}(ilde{\mathbf{Y}}_n^* ilde{\mathbf{Y}}_n^{ op}), \Gamma_{s ilde{y}} = \mathbb{E}(s[n-d] ilde{\mathbf{Y}}_n^*)$$

- Problème : $\tilde{\mathbf{Y}}_n$ dépend de $\hat{\mathbf{S}}_{n-d-1}$ dont on connaît difficilement les propriétés statistiques du fait de la non linéarité,
- Hypothèse de travail (approx. Fort SNR) : les symboles décidés sont tous corrects,

$$\hat{\mathbf{S}}_{n-d-1} = \mathbf{S}_{n-d-1}$$

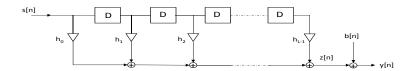
 \Rightarrow dans ce cas on peut expliciter les différents termes et on peut résoudre (voir TD).

Modèle discret équivalent bande de base

$$y[n] = \sum_{k \in \mathbb{N}} s_k h_{n-k} + b[n]$$

$$= \sum_{k=0}^{L_{h-1}} h[k] s[n-k] + b[n]$$

$$= h_0 s[n] + \underbrace{\sum_{k=1}^{L_{h-1}} h[k] s[n-k]}_{IES} + b[n]$$
(10)



_ _ _ _ _ _

Critère de décodage MLSE

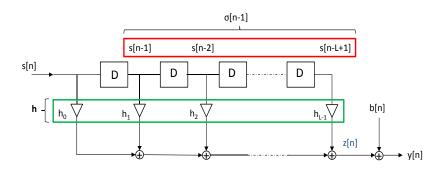
$$\hat{\mathbf{s}} = \arg \max_{\mathbf{s}'} p(\mathbf{y}|\mathbf{s}')$$

$$= \arg \max_{\mathbf{s}'} \prod_{n} p(y_n|\mathbf{s}')$$

$$= \arg \min_{\{s_n\}} \sum_{n} |y_n - \sum_{k=0}^{L-1} h_k s_{n-k}|^2$$

- $\mathbf{s} = [s_1 s_2 \dots s_N], \, \mathbf{y} = [y_1 y_2 \dots y_N], \, y[n] \sim \mathcal{N}(\sum_k h_k s_{n-k}, N_0),$
- la séquence optimale est celle qui minimise la distance euclidienne la plus faible.
- utilisation de la structure markovienne du canal pour réaliser un décodage MLSE avec complexité raisonnable.

Modèle convolutif et Représentation d'état



$$y[n] = \mathbf{h}^T \begin{bmatrix} \mathbf{s}_n \\ \sigma_{n-1} \end{bmatrix} + b[n]$$

= $z[n] + b[n]$

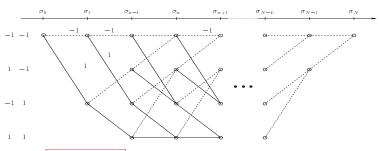
Décodage par Maximum de Vraisemblance Représentation en treillis

- Représentation fonctionnelle associée :
 - Equation d'évolution : passage d'un état à σ_{n-1} à σ_n .

$$\sigma_n = F_1(\sigma_{n-1}, s_n)$$

• Equation d'observation : génération des sorties observables $z_n = \sum_{k=0}^{L-1} h_k s_{n-k}$.

$$z_n = F_2(\sigma_{n-1}, s_n) = F_3(\sigma_{n-1}, \sigma_n)$$







Représentation en treillis

propriétés

 Chaque chemin sur le treillis représente une séquence de symboles émis possibles :

```
chemin le plus problable, ie

séquence MLSE ⇔ de plus petite distance euclidienne

cumulée sur le treillis
```

- Idée de Viterbi : utiliser la structure du treillis pour énumérer et sélectionner "intelligemment" les candidats.
- Ceci est possible en remarquant que

$$\{s[n]|n=1\cdots N\} \qquad \iff \{\sigma[n]|n=0\cdots N\}$$

Espace des séquences

Espaces des Etats

Décodage par Maximum de Vraisemblance Algorithme de Viterbi

MLSE revisité

$$\hat{\mathbf{s}} = \arg \min_{\{\mathbf{s}_n\}} \sum_{n} |y_n - \sum_{k=0}^{L-1} h_k \mathbf{s}_{n-k}|^2$$

$$\hat{\mathbf{s}} = \arg \min_{\{\sigma_n\}} \sum_{n} |y_n - z_n(\sigma_{n-1}, \sigma_n)|^2$$

Pour la section de treillis n, à l'état $\sigma_n(s)$, on peut écrire

Décodage par Maximum de Vraisemblance Algorithme de Viterbi

Algorithme de Viterbi

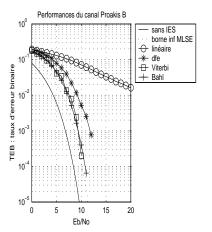
- Pour chaque section n ($n = 1 \cdots N$), pour chaque état $\sigma_n = s$ ($s = 0 \cdots |S|$):
 - \bigcirc calculer Λ_n tel que

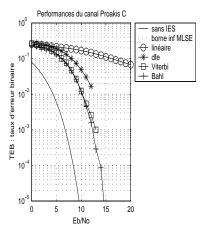
$$\Lambda_n(\sigma_n) = \underset{\left\{\sigma_{n-1} \to \sigma_n\right\}}{\operatorname{argmin}} \left\{\Lambda_{n-1}(\sigma_{n-1}) + \lambda_n(\sigma_{n-1}, \sigma_n)\right\}$$

- ② stocker l'état précédent σ_{n-1} (pour chaque état σ_n , on peut donc associer une séquence $\{\sigma_0, \cdots, \sigma_n\}$ de distance euclidienne $\Lambda_n(\sigma_n)$)
- A la fin du treillis, il ne reste plus que |S| chemins possibles, alors par parcours arrière des états du treillis

$$\hat{\mathbf{s}} = \left\{ \sigma_0, \sigma_1, \cdots, \sigma_{N-1}, \sigma_N | \underset{\sigma_N}{\operatorname{argmin}} \left\{ \Lambda_N(\sigma_N) \right\} \right\}$$

Algorithme de Viterbi : performance





Bibliographie

- B. P. Lathi and Zhi Ding, Modern Digital and Analog Communication Systems, Oxford University Press, 2009.
- John Barry, Edward Lee, David Mersserschnitt, Digital Communications, Kluwer Academic Publisher, Third edition.
- Andreas F. Molisch, Wireless Communications, 2nd Edition, IEEE Press-Wiley, 2010.
- Digital Communications, 4th edition, John G. Proakis, Mc Graw -Hill.
- J. Choi, Adaptive and Iterative Signal Processing in Communications, Cambridge University Press, 2006.
- Zhi Ding and Ye Li, Blind Equalization and Identification, Marcel Dekker, New York, 2001.