



Recent results on the norm of localization operators

Candidato:

Federico Riccardi

Relatore:

Prof. F. Nicola

Laurea Magistrale in Ingegneria Matematica







■ **Problema**: trattare un segnale, ad esempio una traccia audio, un'immagine, una misurazione di un sensore, ecc.;





- **Problema**: trattare un segnale, ad esempio una traccia audio, un'immagine, una misurazione di un sensore, ecc.;
- Motivazioni: analizzare il segnale ed estrarne informazioni rilevanti, filtrare componenti non desiderate;





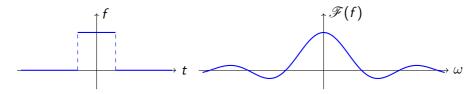
- **Problema**: trattare un segnale, ad esempio una traccia audio, un'immagine, una misurazione di un sensore, ecc.;
- Motivazioni: analizzare il segnale ed estrarne informazioni rilevanti, filtrare componenti non desiderate;
- Come fare: trasformate, ad esempio la trasformata di Fourier F, trasformate tempo-frequenza, come la short-time Fourier transform, operatori di localizzazione.



Principi di indeterminazione

L'obiettivo di localizzare un segnale si scontra con un limite fondamentale, ovvero i *principi di indeterminazione*. Esistono numerosi principi di indeterminazione, ognuno espressione del seguente concetto:

una funzione non può essere troppo concentrata sia in tempo che in frequenza.



Esempio di funzione ben concentrata in tempo con trasformata poco concentrata in frequenza.





Esempio: principio di indeterminazione di Heisenberg

Principio di indeterminazione di Heisenberg

Sia $f \in L^2(\mathbb{R})$ con $||f||_2 = 1$ e siano $a, b \in \mathbb{R}$. Allora:

$$\left(\int_{\mathbb{R}} (t-a)^2 |f(t)|^2 dt\right)^{1/2} \left(\int_{\mathbb{R}} (\omega-b)^2 |\mathscr{F}f(\omega)|^2 d\omega\right)^{1/2} \geq \frac{1}{4\pi}.$$

Le funzioni che raggiungono l'uguaglianza sono solo le gaussiane.

Interpretazione: i due integrali si possono vedere come misure della concentrazione di f e $\mathscr{F}f$ vicino ai punti a e b, rispettivamente. Se una delle concentrazioni è "piccola", l'altra deve essere "grande".





Short-time Fourier transform

Definizione

La short-time Fourier transform, in breve STFT, è una trasformata tempo-frequenza. Prima di definirla, dobbiamo introdurre gli operatori di traslazione e modulazione. Dati $x,\omega\in\mathbb{R}$ abbiamo:

$$T_x f(t) = f(t-x), \quad M_\omega f(t) = e^{2\pi i \omega t} f(t).$$





Short-time Fourier transform

Definizione

La short-time Fourier transform, in breve STFT, è una trasformata tempo-frequenza. Prima di definirla, dobbiamo introdurre gli operatori di traslazione e modulazione. Dati $x,\omega\in\mathbb{R}$ abbiamo:

$$T_X f(t) = f(t-X), \quad M_\omega f(t) = e^{2\pi i \omega t} f(t).$$

Short-time Fourier transfrom

La short-time Fourier transform di una funzione $f \in L^2(\mathbb{R})$ rispetto alla finestra $\phi \in L^2(\mathbb{R})$ è data da:

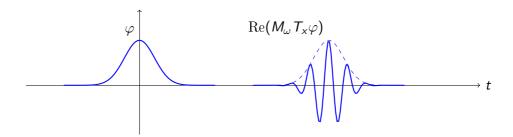
$$\mathcal{V}_{\phi}f(x,\omega) = \langle f, M_{\omega}T_{x}\phi \rangle = \int_{\mathbb{R}} f(t)\overline{\phi(t-x)}e^{-2\pi i\omega t} dt$$





Short-time Fourier transform

Finestra gaussiana



Per avere una buona risoluzione è necessario scegliere una finestra ben localizzata sia in tempo che in frequenza. Una scelta ottimale è quindi una finestra gaussiana normalizzata

$$\varphi(t) = 2^{1/4} e^{-\pi t^2}.$$





Definizione

Con la particolare scelta di finestra gaussiana normalizzata l'operatore $\mathcal{V}_{\varphi}:L^2(\mathbb{R})\to L^2(\mathbb{R}^2)$ diventa unitario:

$$\mathcal{V}_{\varphi}^{*}\mathcal{V}_{\varphi}=I_{L^{2}(\mathbb{R})}.$$





Definizione

Con la particolare scelta di finestra gaussiana normalizzata l'operatore $\mathcal{V}_{\varphi}: L^2(\mathbb{R}) \to L^2(\mathbb{R}^2)$ diventa unitario:

$$\mathcal{V}_{\varphi}^*\mathcal{V}_{\varphi}=I_{L^2(\mathbb{R})}.$$

Questo suggerisce come definire un operatore di localizzazione:

$$f \in L^2(\mathbb{R})$$





Definizione

Con la particolare scelta di finestra gaussiana normalizzata l'operatore $\mathcal{V}_{\omega}: L^2(\mathbb{R}) \to L^2(\mathbb{R}^2)$ diventa unitario:

$$\mathcal{V}_{\varphi}^{*}\mathcal{V}_{\varphi}=\mathit{I}_{\mathit{L}^{2}(\mathbb{R})}.$$

Questo suggerisce come definire un operatore di localizzazione:

$$f \in L^2(\mathbb{R}) \mapsto \mathcal{V}_{\varphi} f \in L^2(\mathbb{R}^2)$$



Definizione

Con la particolare scelta di finestra gaussiana normalizzata l'operatore $\mathcal{V}_{\varphi}: L^2(\mathbb{R}) \to L^2(\mathbb{R}^2)$ diventa unitario:

$$\mathcal{V}_{\varphi}^{*}\mathcal{V}_{\varphi}=\mathit{I}_{\mathit{L}^{2}(\mathbb{R})}.$$

Questo suggerisce come definire un operatore di localizzazione:

$$f \in L^2(\mathbb{R}) \mapsto \mathcal{V}_{\varphi} f \in L^2(\mathbb{R}^2) \mapsto F \mathcal{V}_{\varphi} f \in L^2(\mathbb{R}^2)$$





Definizione

Con la particolare scelta di finestra gaussiana normalizzata l'operatore $\mathcal{V}_{\varphi}: L^2(\mathbb{R}) \to L^2(\mathbb{R}^2)$ diventa unitario:

$$\mathcal{V}_{\varphi}^*\mathcal{V}_{\varphi}=I_{L^2(\mathbb{R})}.$$

Questo suggerisce come definire un operatore di localizzazione:

$$f \in L^2(\mathbb{R}) \mapsto \mathcal{V}_{\varphi} f \in L^2(\mathbb{R}^2) \mapsto F \mathcal{V}_{\varphi} f \in L^2(\mathbb{R}^2) \mapsto \mathcal{V}_{\varphi}^* F \mathcal{V}_{\varphi} f \in L^2(\mathbb{R})$$

Operatore di localizzazione in tempo-frequenza - Daubechies 1988 [5]

Data una finestra $F:\mathbb{R}^2\to\mathbb{C}$, l'operatore di localizzazione in tempo-frequenza con finestra φ e peso F è definito da

$$L_{F,\varphi} := \mathcal{V}_{\varphi}^* F \mathcal{V}_{\varphi} : L^2(\mathbb{R}) \to L^2(\mathbb{R}).$$





Proprietà

A seconda del peso scelto, il corrispondente operatore $L_{F,\varphi}$ avrà alcune proprietà:

lacksquare se $F\in L^p(\mathbb{R}^2)$ con $p\in [1,+\infty]$ allora $L_{F,arphi}$ è limitato e $\|L_{F,arphi}\|\leq \|F\|_p$;





Proprietà

- lacksquare se $F\in L^p(\mathbb{R}^2)$ con $p\in [1,+\infty]$ allora $L_{F,arphi}$ è limitato e $\|L_{F,arphi}\|\leq \|F\|_p$;
- lacksquare se $F\in L^p(\mathbb{R}^2)$ con $p\in [1,+\infty)$ allora $L_{F,arphi}$ è compatto;





Proprietà

- se $F \in L^p(\mathbb{R}^2)$ con $p \in [1, +\infty]$ allora $L_{F,\varphi}$ è limitato e $\|L_{F,\varphi}\| \leq \|F\|_p$;
- lacksquare se $F\in L^p(\mathbb{R}^2)$ con $p\in [1,+\infty)$ allora $L_{F,arphi}$ è compatto;
- se $F \in L^1(\mathbb{R}^2)$ allora $L_{F,\varphi}$ è un operatore integrale di Hilbert-Schmidt e la sua norma di Hilbert-Schmidt è minore o uguale di $\|F\|_1$;





Proprietà

- se $F \in L^p(\mathbb{R}^2)$ con $p \in [1, +\infty]$ allora $L_{F,\varphi}$ è limitato e $\|L_{F,\varphi}\| \leq \|F\|_p$;
- lacksquare se $F\in L^p(\mathbb{R}^2)$ con $p\in [1,+\infty)$ allora $L_{F,arphi}$ è compatto;
- se $F \in L^1(\mathbb{R}^2)$ allora $L_{F,\varphi}$ è un operatore integrale di Hilbert-Schmidt e la sua norma di Hilbert-Schmidt è minore o uguale di $||F||_1$;
- ullet se $F\in L^1(\mathbb{R}^2)$ è un operatore di classe traccia;





Proprietà

- se $F \in L^p(\mathbb{R}^2)$ con $p \in [1, +\infty]$ allora $L_{F,\varphi}$ è limitato e $\|L_{F,\varphi}\| \leq \|F\|_p$;
- ullet se $F\in L^p(\mathbb{R}^2)$ con $p\in [1,+\infty)$ allora $L_{F,arphi}$ è compatto;
- se $F \in L^1(\mathbb{R}^2)$ allora $L_{F,\varphi}$ è un operatore integrale di Hilbert-Schmidt e la sua norma di Hilbert-Schmidt è minore o uguale di $||F||_1$;
- ullet se $F\in L^1(\mathbb{R}^2)$ è un operatore di classe traccia;
- se F è radialmente simmetrica, ovvero $F(x,\omega)=\mathcal{F}(r^2)$ con $r^2=x^2+\omega^2$, le autofunzioni di $L_{F,\varphi}$ sono le funzioni di Hermite e i corrispondenti autovalori sono dati da

$$\lambda_k = \frac{1}{k!} \int_0^{+\infty} \mathcal{F}\left(\frac{s}{\pi}\right) s^k e^{-s} ds.$$





Disuguaglianza di Faber-Krahn per la STFT

Recentemente, il seguente risultato è stato ottenuto in [24].

Disuguaglianza di Faber-Krahn per la STFT

Dato $\Omega \subset \mathbb{R}^2$ misurabile di misura finita si ha

$$\int_{\Omega} |\mathcal{V}_{\varphi} f(x,\omega)|^2 dx d\omega \le (1 - e^{-|\Omega|}) \int_{\mathbb{R}^2} |\mathcal{V}_{\varphi} f(x,\omega)|^2, \tag{1}$$

con uguaglianza se e solo se Ω è una palla di centro $(x_0, \omega_0) \in \mathbb{R}^2$ e f è una gaussiana traslata e modulata, ovvero $f = cM_{\omega_0}T_{x_0}\varphi$ con $c \in \mathbb{C} \setminus \{0\}$.





Disuguaglianza di Faber-Krahn per la STFT

Questo risultato può essere riformulato in termini di norma di operatori di localizzazione con funzione indicatrice come peso. Infatti:

$$\int_{\Omega} |\mathcal{V}_{\varphi} f(x,\omega)|^2 dx d\omega = \langle \chi_{\Omega} \mathcal{V}_{\varphi} f, \mathcal{V}_{\varphi} f \rangle = \langle \mathcal{V}_{\varphi}^* \chi_{\Omega} \mathcal{V}_{\varphi} f, f \rangle = \langle L_{\Omega,\varphi} f, f \rangle.$$





Disuguaglianza di Faber-Krahn per la STFT

Questo risultato può essere riformulato in termini di norma di operatori di localizzazione con funzione indicatrice come peso. Infatti:

$$\int_{\Omega} |\mathcal{V}_{\varphi} f(x,\omega)|^2 dx d\omega = \langle \chi_{\Omega} \mathcal{V}_{\varphi} f, \mathcal{V}_{\varphi} f \rangle = \langle \mathcal{V}_{\varphi}^* \chi_{\Omega} \mathcal{V}_{\varphi} f, f \rangle = \langle L_{\Omega,\varphi} f, f \rangle.$$

Poiché \mathcal{V}_{arphi} è un'isometria, da (1) otteniamo:

$$\langle L_{\Omega,\varphi}f,f\rangle \leq (1-e^{-|\Omega|})\|f\|_2^2.$$

Prendendo l'estremo superiore fra tutte le $f\in L^2(\mathbb{R})$ normalizzate si ottiene

$$||L_{\Omega,\varphi}|| \leq 1 - e^{|\Omega|},$$

con uguaglianza se e solo se Ω è una palla.





Stime ottimali sulla norma di $L_{F,\varphi}$: vincoli L^p e L^∞

Se immaginiamo quindi di fissare un limite s alla misura di Ω , quanto ottenuto ci dice che se $|\Omega| \leq s$ allora $||L_{\Omega,\varphi}|| \leq 1 - e^{-s}$.





Stime ottimali sulla norma di $L_{F,\varphi}$: vincoli L^p e L^{∞}

Se immaginiamo quindi di fissare un limite s alla misura di Ω , quanto ottenuto ci dice che se $|\Omega| \leq s$ allora $||L_{\Omega,\varphi}|| \leq 1 - e^{-s}$.

Anziché considerare solo funzioni indicatrici, si potrebbero prendere funzioni peso generiche F e tradurre il vincolo $|\Omega| \leq s$ in un vincolo sulla norma di F in qualche spazio di Lebesgue.





Stime ottimali sulla norma di $L_{F, \varphi}$: vincoli L^p e L^{∞}

Se immaginiamo quindi di fissare un limite s alla misura di Ω , quanto ottenuto ci dice che se $|\Omega| \leq s$ allora $||L_{\Omega,\varphi}|| \leq 1 - e^{-s}$.

Anziché considerare solo funzioni indicatrici, si potrebbero prendere funzioni peso generiche F e tradurre il vincolo $|\Omega| \leq s$ in un vincolo sulla norma di F in qualche spazio di Lebesgue. In [25] è stato considerato il seguente problema:

trovare
$$C>0$$
 tale che $\|L_{F,\varphi}\|\leq C$ per ogni F che soddisfa $\|F\|_{\infty}\leq A$ e $\|F\|_{p}\leq B$,

dove
$$p \in [1, +\infty)$$
, $A \in (0, +\infty]$ e $B \in (0, +\infty)$.





Stime ottimali sulla norma di $L_{F,\varphi}$: vincoli L^p e L^q

Nella mia tesi ho considerato l'analogo problema con due vincoli di tipo L^p :

trovare
$$C>0$$
 tale che $\|L_{F,\varphi}\|\leq C$ per ogni F che soddisfa $\|F\|_p\leq A$ e $\|F\|_q\leq B$,

dove
$$p, q \in (1, +\infty)$$
, $A, B \in (0, +\infty)$.





Stime ottimali sulla norma di $L_{F,\varphi}$: vincoli L^p e L^q

Teorema

Esistono due costanti $c_1 < c_2$, che dipendono solo da p e q, tali per cui:

I se $B/A \le c_1$ o se $B/A \ge c_2$, rispettivamente il vincolo L^q e L^p sono superflui, quindi la costante C e le funzioni peso che raggiungono il massimo sono date dal caso con un solo vincolo. In particolare, queste sono gaussiane traslate.





Stime ottimali sulla norma di $L_{F,\varphi}$: vincoli L^p e L^q

Teorema

Esistono due costanti $c_1 < c_2$, che dipendono solo da $p \in q$, tali per cui:

2 se $c_1 < B/A < c_2$ allora

$$||L_{F,\varphi}|| \le \int_0^{+\infty} (1 - e^{-u(t)}) dt,$$
 (2)

dove $u(t)=\max\{-\log(\lambda_1 t^{p-1}+\lambda_2 t^{q-1}),0\}$ e $\lambda_1,\lambda_2>0$ sono univocamente determinati da

$$p\int_0^{+\infty} t^{p-1}u(t) dt = A^p, \quad q\int_0^{+\infty} t^{q-1}u(t) dt = B^q.$$

Infine, l'uguaglianza in (2) si ha se e solo se F è (a meno di traslazioni) radialmente simmetrica e ha u come funzione di distribuzione.





Idea della dimostrazione nel secondo regime

■ Il primo passo viene suggerito da un Teorema presente in [25].

Teorema

Data $F\in L^p(\mathbb{R}^2)$ con $p\in [1,+\infty)$ e indicando con $\mu(t)=|\{|F|>t\}|$ la funzione di distribuzione di |F|, si ha

$$\|L_{F,arphi}\|\leq \int_0^{+\infty}(1-e^{-\mu(t)})\,dt,$$

con uguaglianza se e solo se F è (a meno di traslazioni) radialmente simmetrica.

Questo ci indica infatti che è necessario trovare stime sharp per il membro destro.





Idea della dimostrazione nel secondo regime

Il problema variazionale per la funzione di distribuzione, dopo un'opportuna traduzione dei vincoli di integrabilità, è il seguente:

$$\sup_{v\in\mathcal{C}}\int_0^{+\infty} (1-e^{-v(t)})\,dt$$

dove \mathcal{C} è l'insieme dell funzioni $v:(0,+\infty)\to [0,+\infty)$ decrescenti e che soddisfano i vincoli

$$\rho\int_0^{+\infty}t^{p-1}v(t)\,dt\leq A^p,\quad q\int_0^{+\infty}t^{q-1}v(t)\,dt\leq B^q.$$



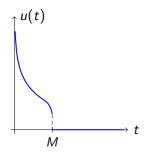


Idea della dimostrazione nel secondo regime

 Una volta dimostrata l'esistenza di soluzioni per il problema variazionale, si dimostra che le funzioni estremali sono della forma

$$u(t) = egin{cases} -\log\left(\lambda_1 t^{p-1} + \lambda_2 t^{q-1}
ight) & t \in (0,M) \ 0 & t \in (M,+\infty) \end{cases}$$

per qualche M>0 e dei moltiplicatori $\lambda_1,\lambda_2\in\mathbb{R}$.



Esempio di funzione estremale.





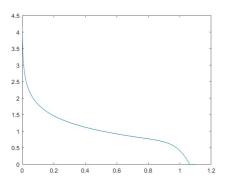
Idea della dimostrazione nel secondo regime

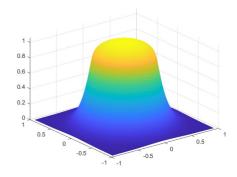
• Gli ultimi step prevedono di dimostrare che gli estremali sono continui e che λ_1, λ_2 sono entrambi positivi e univocamente determinati dall'uguaglianza nei vincoli.





Esempio di funzione ottimale nel secondo regime





Esempio di funzione ottimale con A=B=1, p=1.5, q=20. I corrispondenti moltiplicatori sono, approssimativamente, $\lambda_1=0.5144$ e $\lambda_2=0.1468$.



Bibliografia I

- [1] J. Bell. Trace class operators and Hilbert-Schmidt operators. 2016.
- [2] H. Brezis. Functional analysis, Sobolev spaces and partial differential equations. Vol. 2. 3. Springer, 2011.
- [3] N. G. de Bruijn. "Uncertainty principles in Fourier analysis". In: Inequalities (Proc. Sympos. Wright-Patterson Air Force Base, Ohio, 1965). Academic Press, New York, 1967, pp. 57–71.
- [4] J. B. Conway. A course in functional analysis. Vol. 96. Springer, 2019.
- [5] I. Daubechies. "Time-frequency localization operators: a geometric phase space approach". In: *IEEE Transactions on Information Theory* 34.4 (1988), pp. 605–612.
- [6] G. B. Folland. *Harmonic analysis in phase space*. 122. Princeton university press, 1989.



Bibliografia II

- [7] G. B. Folland and A. Sitaram. "The uncertainty principle: a mathematical survey". In: *Journal of Fourier analysis and applications* 3 (1997), pp. 207–238.
- [8] D. Gabor. "Theory of communication. Part 1: The analysis of information". In: Journal of the Institution of Electrical Engineers-part III: radio and communication engineering 93.26 (1946), pp. 429–441.
- [9] L. Grafakos. Classical Fourier analysis. Vol. 2. Springer, 2008.
- [10] K. Gröchenig. Foundations of time-frequency analysis. Springer Science & Business Media, 2001.
- [11] Littlewood J. E. Hardy G. H. and G. Pólya. *Inequalities*. Cambridge University Press, 1952.
- [12] W. Heisenberg. "Über den anschaulichen Inhalt der quantentheoretischen Kinematik und Mechanik". In: Zeitschrift für Physik 43 (1927).



Bibliografia III

- [13] M. W. Hirsch. *Differential topology*. Vol. 33. Springer Science & Business Media, 2012.
- [14] H. Knutsen. "Norms and eigenvalues of time-frequency localization operators".
- [15] S. G. Krantz and H. R. Parks. A primer of real analytic functions. Springer Science & Business Media, 2002.
- [16] S. G. Krantz and H. R. Parks. *Geometric integration theory*. Springer Science & Business Media, 2008.
- [17] H. J. Landau and H. O. Pollak. "Prolate spheroidal wave functions, Fourier analysis and uncertainty—II". In: *Bell System Technical Journal* 40.1 (1961), pp. 65–84.



Bibliografia IV

- [18] H. J. Landau and H. O. Pollak. "Prolate spheroidal wave functions, fourier analysis and uncertainty—III: the dimension of the space of essentially time-and band-limited signals". In: *Bell System Technical Journal* 41.4 (1962), pp. 1295–1336.
- [19] E. H. Lieb. "Proof of an entropy conjecture of Wehrl". In: Communications in Mathematical Physics 62.1 (1978), pp. 35-41.
- [20] E. H. Lieb. "Integral bounds for radar ambiguity functions and Wigner distributions". In: Journal of Mathematical Physics 31.3 (1990), pp. 594-599.
- [21] E. H. Lieb and M. Loss. *Analysis*. Vol. 14. American Mathematical Soc., 2001.
- [22] B. Mityagin. "The zero set of a real analytic function". In: arXiv preprint arXiv:1512.07276 (2015).



Bibliografia V

- [23] F. Nicola and L. Rodino. *Global pseudo-differential calculus on Euclidean spaces*. Vol. 4. Springer, 2010.
- [24] F. Nicola and P. Tilli. "The Faber-Krahn inequality for the short-time Fourier transform". In: *Inventiones mathematicae* 230.1 (2022), pp. 1–30.
- [25] F. Nicola and P. Tilli. "The norm of time-frequency localization operators". In: *Transactions of the American Mathematical Society (to appear)* (2022).
- [26] M. Reed and B. Simon. I: Functional analysis. Vol. 1. Gulf Professional Publishing, 1980.
- [27] H. L. Royden and P. Fitzpatrick. Real analysis. Vol. 32. Macmillan New York, 1988.
- [28] W. Rudin et al. *Principles of mathematical analysis*. Vol. 3. McGraw-hill New York, 1976.



Bibliografia VI

- [29] A. Sard. "The measure of the critical values of differentiable maps". In: Bulletin of the American Mathematical Society 48 (1942), pp. 883–890.
- [30] D. Slepian. "Prolate spheroidal wave functions, Fourier analysis and uncertainty—IV: extensions to many dimensions; generalized prolate spheroidal functions". In: Bell System Technical Journal 43.6 (1964), pp. 3009–3057.
- [31] D. Slepian and H. O. Pollak. "Prolate spheroidal wave functions, Fourier analysis and uncertainty—I". In: *Bell System Technical Journal* 40.1 (1961), pp. 43–63.
- [32] M. W. Wong. Wavelet transforms and localization operators. Vol. 136. Springer Science & Business Media, 2002.
- [33] K. Zhu. *Analysis on Fock spaces*. Vol. 263. Springer Science & Business Media, 2012.



Grazie per l'attenzione

