

PSI3431 - Processamento Estatístico de Sinais (2022)

Exercício Computacional 1 - Filtragem de um sinal ruidoso

Aluno: Ivan Luiz de Moura Matos

N°USP: 11234162

Data de entrega: 02/05/2022

In [1]: `using PyPlot, DSP, WAV`

Resolução do item a)

In [2]: `# Sequencia de instantes em que o sinal x0 foi amostrado:
seq = 0:1/40000:2;

Constantes utilizadas na função que define o sinal x0:
omega = 2*pi*500; tau = 0.5;`

Obtenção do sinal discreto $x_0[n]$:

In [3]: `x0 = (sin.(omega*seq)).^3 .* exp.(-seq/tau);`

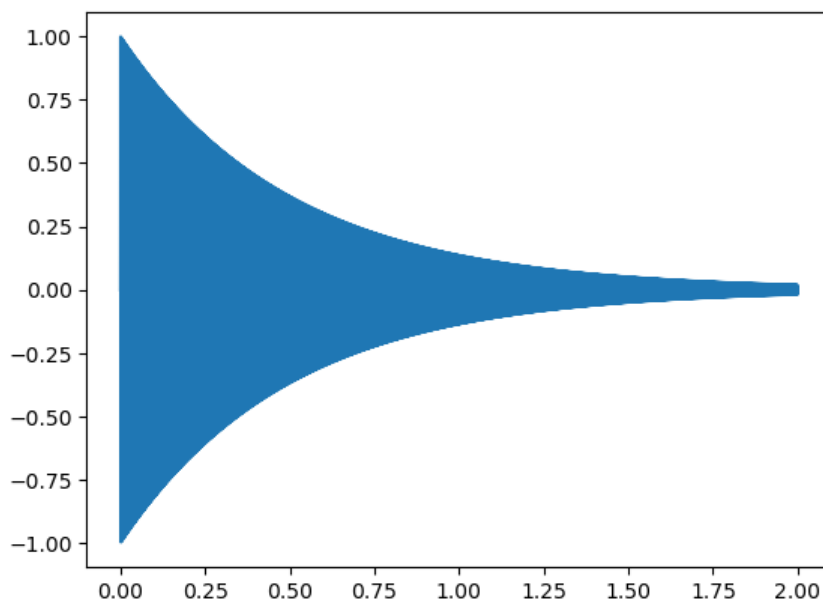
Cálculo do comprimento do sinal discreto $x_0[n]$:

In [4]: `print("O comprimento de x0[n] é: ", length(x0))`

O comprimento de $x_0[n]$ é: 80001

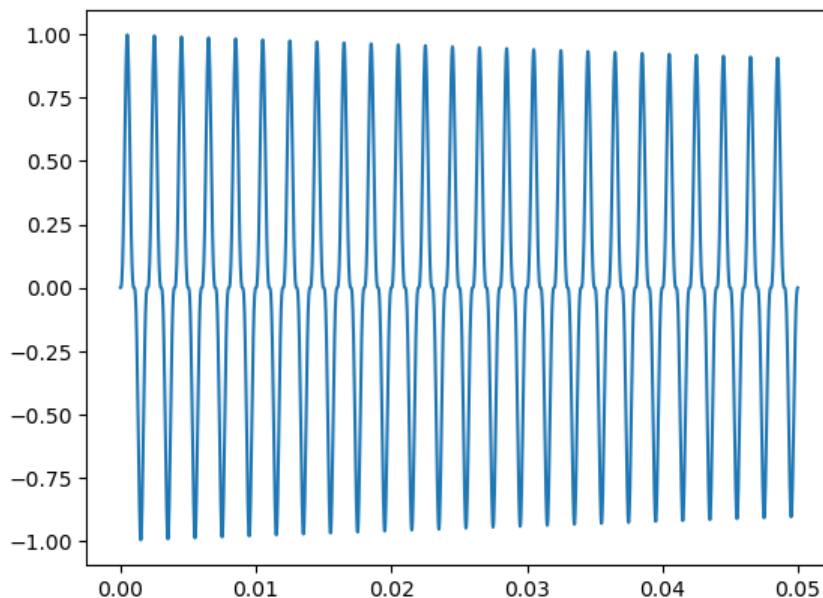
No gráfico abaixo, é plotado o sinal $x_0[n]$:

In [6]: `plot(seq, x0);`



Considerando um trecho menor do sinal, para melhor visualização:

In [8]: `plot(seq[1:2000], x0[1:2000]);`



Para escutar o sinal:

```
In [9]: wavplay(x0, 40_000)
```

Resolução do item b)

Cálculo da potência P_{signal} do sinal amostrado $x_0[n]$:

```
In [10]: Potencia_sinal = sum(x0.^2)/length(x0)
```

```
Out[10]: 0.03904888633891437
```

Podemos representar o ruído gaussiano branco por uma sequência de valores gerados a partir de variáveis aleatórias gaussianas, com média nula e variância σ^2 . Nesse caso, a potência do ruído gaussiano branco amostrado é dada por $P_{\text{ruído}} = \sigma^2$.

Determinemos a variância σ^2 , impondo que a relação sinal-ruído (SNR) deve ser igual a 10 dB:

$$SNR_{(dB)} = 10 \cdot \log(P_{\text{sinal}}/P_{\text{ruído}})$$

$$\Rightarrow \sigma^2 = P_{\text{ruído}} = P_{\text{sinal}}/10^{SNR_{(dB)}/10}$$

A seguir, calculamos a variância σ^2 do ruído:

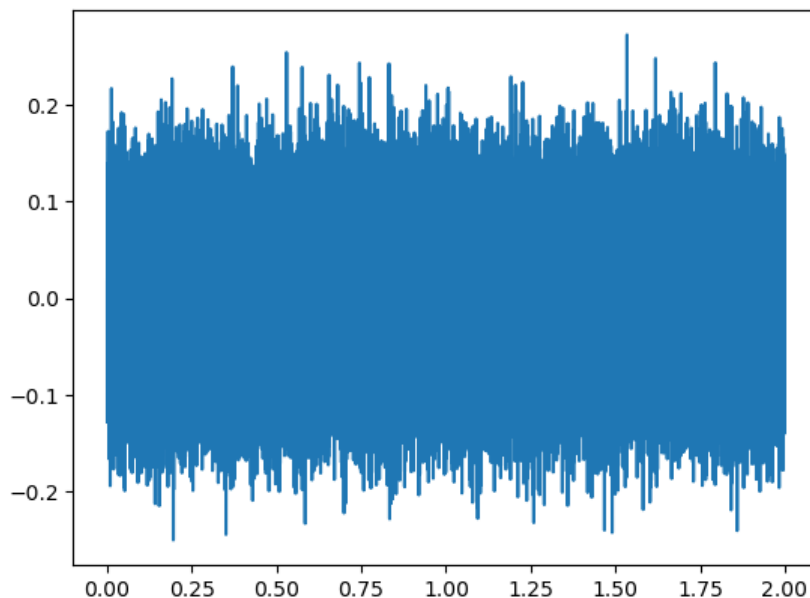
```
In [11]: # Cálculo da variância do ruído amostrado:
var_ruído = Potencia_sinal / 10^(10/10) # Do enunciado, SNR(dB) = 10 dB
```

```
Out[11]: 0.0039048886338914368
```

Conhecida a variância σ^2 do ruído (**denotada pela variável `var_ruído`**), podemos construir o vetor **ruído** que representará o ruído branco. Para tanto, utilizaremos a função **randn**, que permite gerar uma sequência de valores extraídos de uma distribuição normal. Tal função considera média nula e variância 1; para obter variância igual a σ^2 , basta multiplicar por $\sqrt{\sigma^2}$.

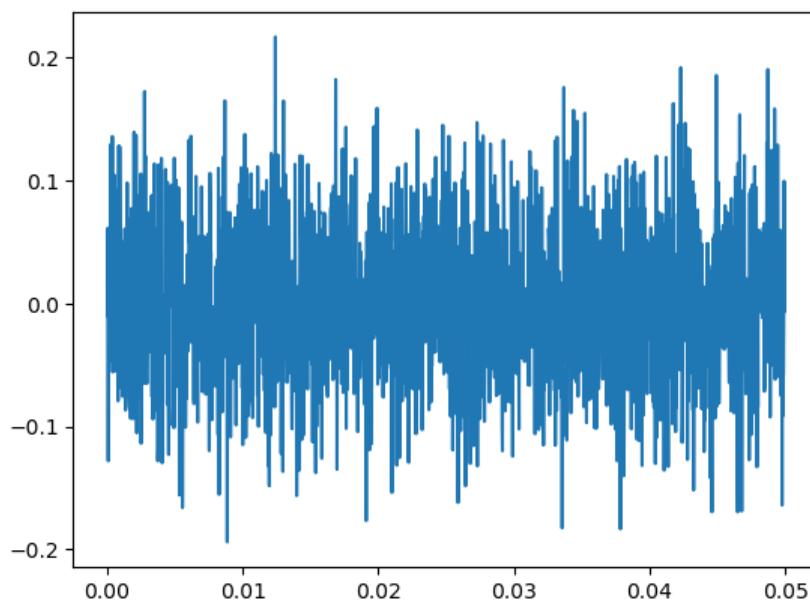
```
In [12]: ruído = sqrt(var_ruído)*randn(length(seq));
```

```
In [60]: plot(seq,ruído);
```



Abaixo, é plotado um trecho do gráfico do ruído.

```
In [13]: plot(seq[1:2000], ruído[1:2000]);
```



O sinal ruidoso $x[n]$ é a soma do sinal original $x_0[n]$ com o ruído:

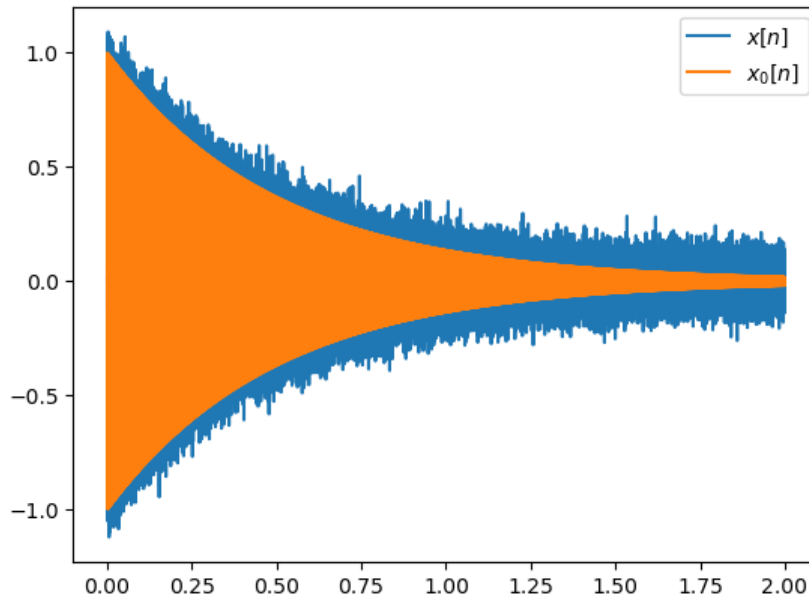
```
In [14]: x = x0 .+ ruído;
```

Para escutar o sinal ruidoso:

```
In [15]: wavplay(x, 40_000)
```

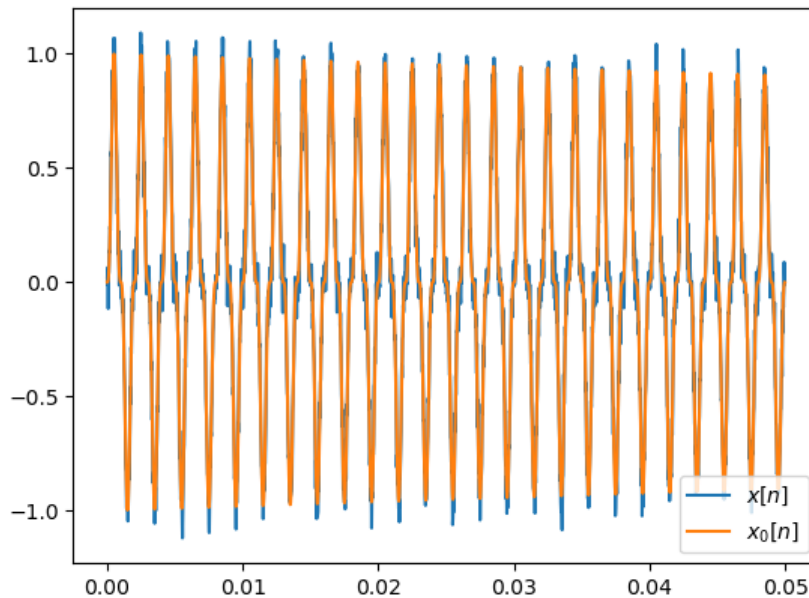
No gráfico abaixo, são plotados $x_0[n]$ e $x[n]$:

```
In [16]: plot(seq,x, label=L"x[n]")
         plot(seq,x0,label=L"x_0[n]")
         legend();
```



Considerando um trecho menor do sinal, para melhor visualização:

```
In [17]: plot(seq[1:2000],x[1:2000], label=L"x[n]");
plot(seq[1:2000],x0[1:2000],label=L"x_0[n]")
legend();
```



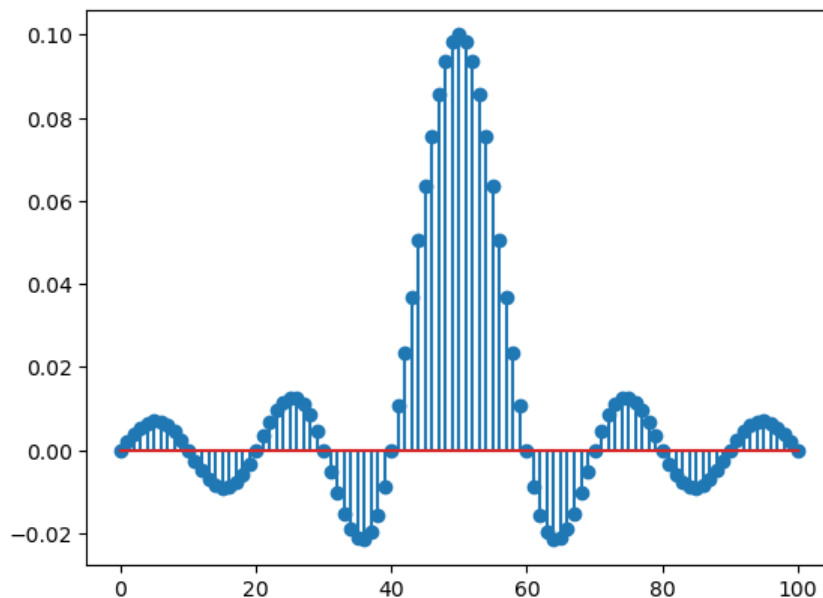
Resolução do item c)

Conforme o enunciado, vamos construir um filtro com resposta ao impulso dada por $h[n] = 0,1 \cdot \text{sinc}(0,1 \cdot (n - 50))$, para $0 \leq n \leq 100$, e zero caso contrário.

```
In [18]: h = 0.1 * sinc(0.1*((0:100) - 50));
```

Abaixo, é apresentada a **resposta ao impulso** do filtro:

```
In [19]: stem(0:100,h);
```



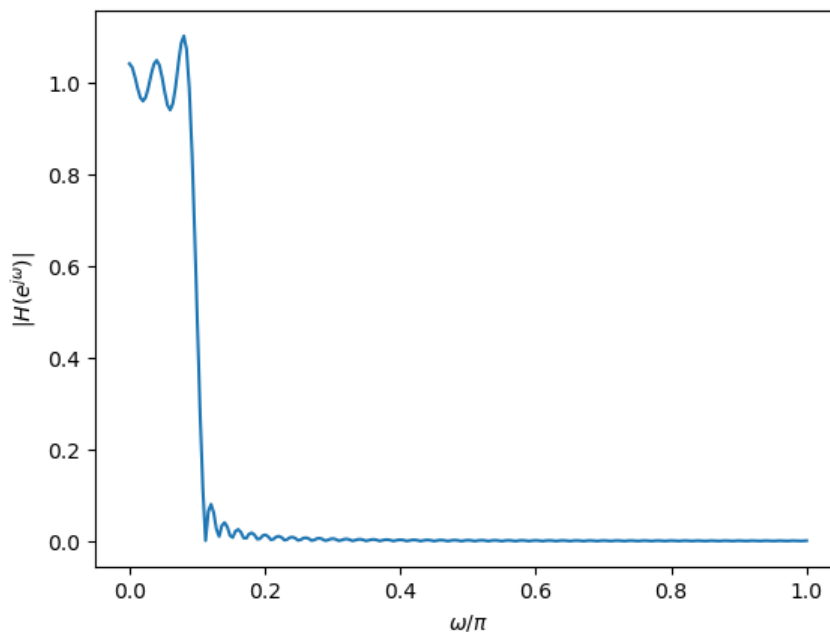
```
In [20]: h_filtro = PolynomialRatio(h,[1.0]);

omega_filtro= range(0, stop=pi, length = 250);
H_filtro = freqz(h_filtro, omega_filtro);

#H_filtro, omega_filtro = freqresp(h_filtro);
```

Abaixo, é apresentada a **resposta em frequência** do filtro:

```
In [21]: plot(omega_filtro/pi, abs.(H_filtro));
xlabel(L"\omega/\pi");
ylabel(L"|H(e^{j\omega})|");
```



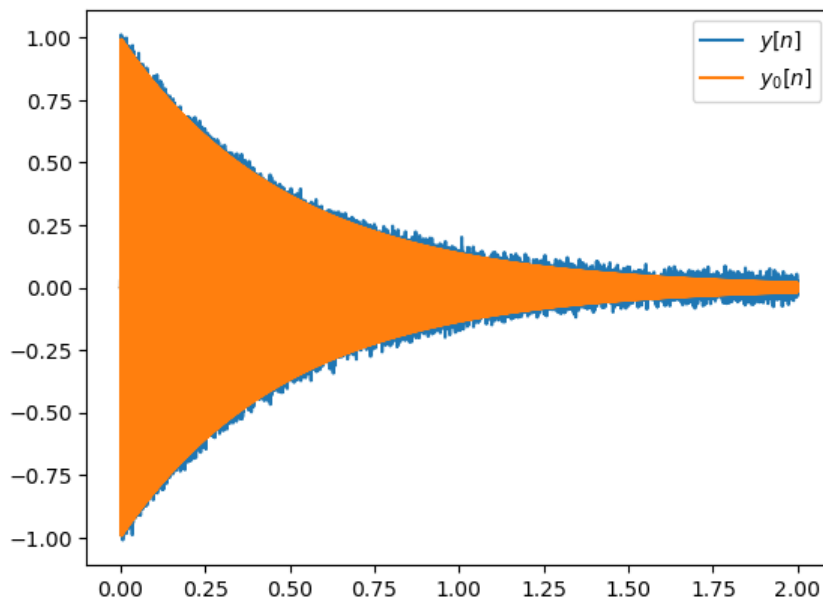
Resolução do item d)

Vamos obter as saídas $y_0[n]$ e $y[n]$ do filtro, considerando que o sinal de entrada é $x_0[n]$ e $y[n]$, respectivamente :

```
In [22]: y0 = filt(h_filtro, x0);
y = filt(h_filtro, x);
```

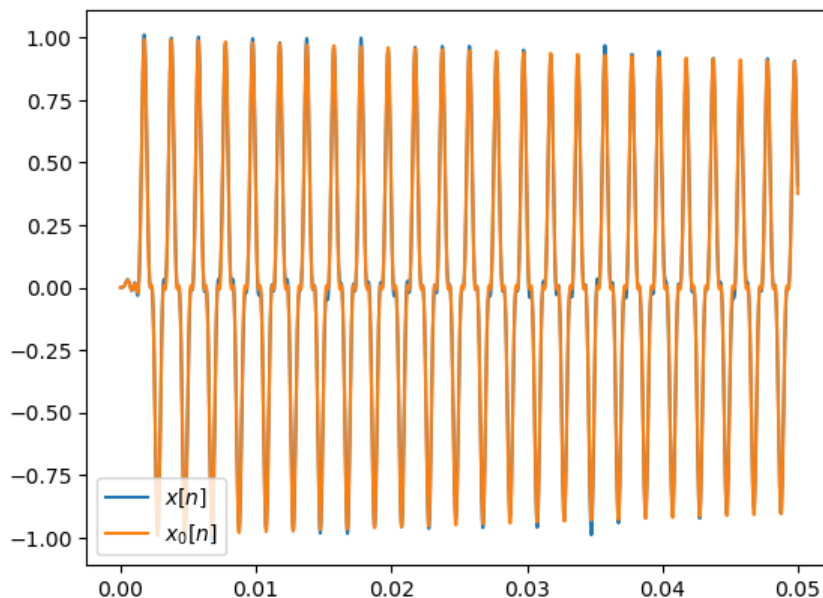
No gráfico abaixo, são plotados $y_0[n]$ e $y[n]$:

```
In [23]: plot(seq,y, label=L"y[n]");
plot(seq,y0, label=L"y_0[n]");
legend();
```



Considerando um trecho menor do sinal, para melhor visualização:

```
In [24]: plot(seq[1:2000],y[1:2000],label=L"x[n]");
plot(seq[1:2000],y0[1:2000],label=L"x_0[n]")
legend();
```



Para escutar os sinais $y_0[n]$ e $y[n]$:

```
In [25]: wavplay(y0, 40_000)
```

```
In [26]: wavplay(y, 40_000)
```

Resolução do item e)

Vamos explicar por qual motivo $x[n]$ e $y[n]$ não são estacionários em nenhum sentido:

O sinal de entrada $x_0[n]$ é determinístico, enquanto $x[n]$, que é o sinal afetado por ruído, pode ser visto como um processo estacionário $X[n]$. A média do ruído $v_x[n]$ é nula (conforme mostrado abaixo). O valor do sinal $x_0[n]$ varia conforme o instante n , de modo que o valor esperado de $X[n]$ é dado por $E\{X[n]\} = x_0[n] + E\{V_x[n]\} = x_0[n] + 0 = x_0[n]$, para cada n .

Como a média de $X[n]$ não é constante, resulta que esse processo **não** é estacionário no sentido amplo, ou seja: **não é estacionário em nenhum sentido**.

Por outro lado, a partir de um argumento similar (também baseado no fato que $E\{V_x[n]\} = 0$), concluímos que a média do processo $Y[n]$ não é constante, e, portanto, $y[n]$ também **não** é estacionário em nenhum sentido.

Vamos mostrar que o ruído $v_x[n]$ é estacionário no sentido amplo:

O ruído $v_x[n] = x[n] - x_0[n]$ consiste na realização de um processo estocástico $V_x[n]$, onde $V_x \sim N(0; \sigma^2)$, isto é, a função distribuição de probabilidade de $V_x[n]$ é dada por:

$$f_{V_x[n]}(x; n) = \frac{1}{\sqrt{2\pi\sigma^2}} \cdot \exp\left(-\frac{x^2}{2\sigma^2}\right)$$

O **valor esperado** de $V_x[n]$ é: $E\{V_x[n]\} = 0 = \text{constante}$, para todo instante n .

Além disso, levando em conta que $V_x[n]$ é *i.i.d.* calculamos a sua **autocorrelação** como segue:

$$r_{V_x}[n_1, n_2] = E\{V_x[n_1] \cdot V_x[n_2]\} = E\{V_x[n_1]\} \cdot E\{V_x[n_2]\} = 0 \cdot 0 = 0, \text{ se } n_1 \neq n_2$$

e

$$r_{V_x}[n_1, n_2] = E\{V_x[n_1] \cdot V_x[n_1]\} = E\{V_x^2[n_1]\} = \sigma^2 + E^2\{V_x[n_1]\} = \sigma^2 + 0 = \sigma^2, \text{ se } n_1 = n_2. \text{ Podemos escrever, então, } r_{V_x}[n_1, n_2] = \sigma^2 \cdot \delta[n_1 - n_2] = \sigma^2 \cdot \delta[\tau], \text{ para quaisquer dois instantes } n_1 \text{ e } n_2. \text{ Observamos que a autocorrelação depende apenas da diferença } \tau = n_1 - n_2 \text{ entre os instantes considerados.}$$

Nota-se, assim, que ficam satisfeitas as duas condições que caracterizam o processo como estacionário em sentido amplo.

Agora, vamos explicar por qual motivo o ruído $v_y[n]$ é estacionário no sentido amplo (desconsiderando transitórios):

O filtro $H(z)$ implementado consiste em um **sistema linear e invariante no tempo (SLIT)**. O ruído $v_y[n]$ de saída consiste, portanto, no sinal obtido ao se aplicar o ruído $v_x[n]$ na entrada do sistema. Como sabemos, se a entrada de um SLIT é um processo estocástico no sentido amplo, então sua saída também o é, como mostrado nas páginas 59 e 60 da apostila do curso. Concluimos, assim, que o ruído $v_y[n]$ é estacionário no sentido amplo.

Resolução do item f)

Sejam $S_{V_x}(\omega)$ e $S_{V_y}(\omega)$ as densidades espectrais de potência do ruído na entrada e saída do filtro, respectivamente. Determinemos as expressões teóricas de tais funções.

Função densidade de probabilidade do ruído na entrada do filtro:

Temos

$$S_{V_x}(\omega) = \sum_{\ell=-\infty}^{\infty} [r_{V_x}[\ell] \cdot \exp(-j\omega\ell)]$$

A partir do exposto no item **e)**, podemos escrever: $r_{V_x}[\ell] = \sigma^2 \cdot \delta[\ell]$. Daí, segue que

$$S_{V_x}(\omega) = \sum_{\ell=-\infty}^{\infty} [(\sigma^2 \cdot \delta[\ell]) \cdot \exp(-j\omega\ell)] = \sigma^2 \cdot \delta[0] \cdot \exp(-j\omega \cdot 0) = \sigma^2 \cdot 1 \cdot \exp(0)$$

isto é:

$$S_{V_x}(\omega) = \sigma^2$$

para todo ω .

Função densidade de probabilidade do ruído na saída do filtro:

Como se sabe (página 62 da apostila do curso), a densidade de probabilidade $S_{V_y}(\omega)$ do ruído depois do filtro será igual ao produto entre o módulo da resposta em frequência do filtro e $S_{V_x}(\omega)$:

$$S_{V_y}(\omega) = |H(e^{j\omega})| S_{V_x}(\omega)$$

Como a resposta ao impulso do filtro é $h[n] = 0, 1 \cdot \text{sinc}(0, 1 \cdot (n - 50))$, temos

$$H(e^{j\omega}) = \frac{0, 1}{0, 1} \cdot \text{rect}\left(\frac{\omega}{2\pi \cdot 0, 1}\right) \cdot e^{-j\omega \cdot 50} = \text{rect}\left(\frac{\omega}{0, 2\pi}\right) \cdot e^{-j\omega \cdot 50}$$

onde $\text{rect}(x)$ vale 1 para $|x| \leq 1/2$, e vale 0 para $|x| > 1/2$.

Daí,

$$|H(e^{j\omega})| = \left| \text{rect}\left(\frac{\omega}{0, 2\pi}\right) \cdot e^{-j\omega \cdot 50} \right| = \text{rect}\left(\frac{\omega}{0, 2\pi}\right)$$

Logo,

$$S_{V_y}(\omega) = |H(e^{j\omega})| S_{V_x}(\omega) = \sigma^2 \text{rect}\left(\frac{\omega}{0, 2\pi}\right)$$

ou, ainda,

$$S_{V_y}(\omega) = \begin{cases} \sigma^2 & \text{se } |\omega| \leq 0,1\pi \\ 0 & \text{se } |\omega| > 0,1\pi \end{cases}$$

Potência média do ruído na entrada do filtro:

A potência (média) do ruído na entrada do filtro é dada por

$$\frac{1}{2\pi} \int_{-\pi}^{\pi} S_{V_x}(\omega) d\omega = \frac{1}{2\pi} \int_{-\pi}^{\pi} \sigma^2 d\omega = \frac{1}{2\pi} \cdot 2\pi \cdot \sigma^2 = \sigma^2$$

(tal resultado já havia sido utilizado no item **b**).

Potência média do ruído na saída do filtro:

A potência (média) do ruído na saída do filtro é dada por

$$\frac{1}{2\pi} \int_{-\pi}^{\pi} S_{V_y}(\omega) d\omega = \frac{1}{2\pi} \int_{-0,1\pi}^{0,1\pi} \sigma^2 d\omega = \frac{1}{2\pi} \cdot 0,2\pi \cdot \sigma^2 = 0,1 \cdot \sigma^2$$

Nota-se, portanto, que a potência do ruído na saída do filtro é inferior à potência do ruído na entrada.

Abaixo, calcula-se a potência média do ruído na entrada do filtro:

```
In [27]: Pot_Media_Vx_calculada = var_ruído
```

```
Out[27]: 0.0039048886338914368
```

Abaixo, calcula-se a potência média do ruído na saída do filtro:

```
In [28]: Pot_Media_Vy_calculada = 0.1*var_ruído
```

```
Out[28]: 0.0003904888633891437
```

Resolução do item g)

(a) Vamos começar pelo primeiro procedimento proposto, considerando:

$$r_{V_x}[0] \approx \frac{1}{L} \sum_{\ell=1}^L (v_x^{(\ell)}[n])^2$$

e

$$r_{V_y}[0] \approx \frac{1}{L} \sum_{\ell=1}^L (v_y^{(\ell)}[n])^2$$

Cálculo de $r_{V_x}[0]$ com $L = 1000$ e para todos os valores de n :

```
In [31]: L = 1000;
soma = zeros(length(seq));

for i in 1:L
    #Geracao do vetor de ruído na i-esima iteracao
    v_x = sqrt(var_ruído)*randn(length(seq));

    soma = soma .+ v_x.^2
end

Pot_Vx_estimada_A = (1/L) * soma
```



```
Out[31]: 80001-element Vector{Float64}:
 0.004014579168785768
 0.003904151681004828
 0.004427573404025718
 0.004194378516181004
 0.003796779144203173
 0.0038560223934413513
 0.004228344339059466
 0.0036892076153429306
 0.0038417401832813495
 0.004022247628705837
 0.0033441419731832086
 0.003718686696366693
 0.004052139725856822
 ⋮
 0.004042549516016283
 0.0039957355113176855
 0.004130349435189255
 0.004015495250549348
 0.004006074062236548
 0.0038101139625680703
 0.004087402461113508
 0.0037832084358373442
 0.00401048296330216
 0.003892652737393504
 0.003716315005769439
 0.003892209012267026
```

Vamos agora considerar $L = 10000$:

```
In [34]: L = 10000;
soma = zeros(length(seq));

for i in 1:L
    #Geracao do vetor de ruido na i-esima iteracao
    v_x = sqrt(var_ruido)*randn(length(seq));

    soma = soma .+ v_x.^2
end

Pot_Vx_estimada_A = (1/L) * soma
```

```
Out[34]: 80001-element Vector{Float64}:
 0.0039266426569090525
 0.0038618955455948377
 0.0038615703866958953
 0.0038799742736986037
 0.003922663401486416
 0.00391806250776194
 0.0038571469495275405
 0.003877806296651594
 0.0039400151991511295
 0.003798603570091412
 0.0038067363174205384
 0.0038798262780388604
 0.0037666749649288324
 ⋮
 0.00391563915590679
 0.003951020055571184
 0.003954799580050118
 0.003856075351170323
 0.0038263954866887013
 0.0039662930013545815
 0.0039779902952998564
 0.0037850905912219235
 0.003926517802529616
 0.003923145468319118
 0.003966531123533809
 0.0038793533135098664
```

Vamos agora considerar $L = 100000$:

```
In [35]: L = 100000;
soma = zeros(length(seq));

for i in 1:L
    #Geracao do vetor de ruido na i-esima iteracao
    v_x = sqrt(var_ruido)*randn(length(seq));

    soma = soma .+ v_x.^2
end

Pot_Vx_estimada_A = (1/L) * soma
```

```
Out[35]: 80001-element Vector{Float64}:
 0.003892048324572692
 0.003904290072817606
 0.0039041874965764665
 0.003914219084761254
 0.003907480414520672
 0.0038961442336698858
 0.0039054094507821654
 0.003924176561147666
 0.003919395609262783
 0.003872170038743886
 0.003909274563408068
 0.003917943426107885
 0.0039029898649873204
 ⋮
 0.0038796085091919647
 0.00387374776278717
 0.003894555076286878
 0.003883134518212224
 0.0038856784491709036
 0.003913294343759801
 0.003926478707966195
 0.0038786837292263524
 0.003938230292451524
 0.0039016848327082685
 0.003890003982454634
 0.003912750142681772
```

Nota-se que os valores dos vetores calculados acima são aproximadamente constantes, e valem cerca de 0.0039. Tal valor é compatível com o calculado teoricamente: $P_{\text{ruído, entrada}} = \sigma^2 \approx 0,0039$, conforme o item **f**).

Nota-se uma melhora dos valores das estimativas, ao se aumentar L para 10000 e 100000. Ainda assim, tal melhora não é altamente significativa, uma vez que em todos os casos, os valores obtidos são próximos ao esperado.

Cálculo de $r_{V_y}[0]$ com $L = 1000$ e para todos os valores de n :

```
In [37]: L = 1000;
soma = zeros(length(seq));

for i in 1:L
    #Geracao do vetor de ruido na i-esima iteracao
    v_x = sqrt(var_ruido)*randn(length(seq));
    v_y = filt(h_filtro, v_x);

    soma = soma .+ v_y.^2
end

Pot_Vy_estimada_A = (1/L) * soma
```

```
Out[37]: 80001-element Vector{Float64}:
 0.0
 1.623183152413176e-8
 7.759969080574834e-8
 1.964070628147368e-7
 3.6425585347179814e-7
 5.542804024657695e-7
 7.408462736362166e-7
 8.785986367803201e-7
 9.593702676595434e-7
 9.849512708931517e-7
 9.87527807017577e-7
 1.0097548774888968e-6
 1.117289340960085e-6
 ⋮
 0.0003758351150988676
 0.00037882143210303683
 0.0003829455252656992
 0.00038720724303543887
 0.0003909398914158
 0.00039336335963120945
 0.00039474644705095877
 0.0003947207895138171
 0.0003934682960581493
 0.0003917182839102501
 0.0003896815436133828
 0.0003880356754495063
```

Vamos agora considerar $L = 10000$:

```
In [38]: L = 10000;
soma = zeros(length(seq));

for i in 1:L
```

```

#Geracao do vetor de ruido na i-esima iteracao
v_x = sqrt(var_ruido)*randn(length(seq));
v_y = filt(h_filtro, v_x);

soma = soma .+ v_y.^2
end

Pot_Vy_estimada_A = (1/L) * soma

```

Out[38]: 80001-element Vector{Float64}:

```

0.0
1.583581701359644e-8
7.447832596656689e-8
1.9052287516974362e-7
3.574077351942994e-7
5.476432326533744e-7
7.24185180121955e-7
8.559725755950742e-7
9.346540380116729e-7
9.639479859889405e-7
9.74561911986277e-7
1.0008320174974733e-6
1.0957863754217447e-6
:
0.00038290538265692357
0.00038267754742428016
0.0003833666507311688
0.00038480482235069577
0.0003867696555429959
0.0003885613890775101
0.0003898398873834539
0.0003904343954922608
0.00039034963415197
0.000389612695070423
0.00038855715792765775
0.0003875222064660847

```

Vamos agora considerar $L = 100000$:

```

In [39]: L = 100000;
soma = zeros(length(seq));

for i in 1:L
    #Geracao do vetor de ruido na i-esima iteracao
    v_x = sqrt(var_ruido)*randn(length(seq));
    v_y = filt(h_filtro, v_x);

    soma = soma .+ v_y.^2
end

Pot_Vy_estimada_A = (1/L) * soma

```

Out[39]: 80001-element Vector{Float64}:

```

0.0
1.565565139236163e-8
7.497605847814117e-8
1.9184487647892676e-7
3.614620533440105e-7
5.575928066394993e-7
7.433302388597617e-7
8.848427102129436e-7
9.64045226718614e-7
9.874456535747567e-7
9.878937545908594e-7
1.0135582278191966e-6
1.1072778815948241e-6
:
0.00038596307123704417
0.00038586449043436714
0.00038573633246020983
0.0003856507260606789
0.0003855769836844321
0.0003854030460115337
0.0003851138992213447
0.00038473237179444884
0.00038426249620161003
0.00038371506237014005
0.00038316402350657046
0.0003826231869462962

```

Nota-se que, após o término dos transitórios, os valores do vetor calculado acima tornam-se aproximadamente constantes (e valem cerca de 0.00039, que é compatível ao valor previsto: $P_{\text{ruido, saída}} = 0,1 \cdot \sigma^2 \approx 0,00039$, conforme o item f).

Não se nota uma melhora altamente significativa das estimativas, ao se aumentar L para 10000 e 100000. Em todos os casos, os valores obtidos são próximos ao esperado.

(b) Vamos agora adotar o segundo procedimento proposto. Usando o fato de os ruídos serem ergódicos, vamos usar as expressões

$$r_{V_x}[0] \approx \frac{1}{N} \sum_{n=0}^{N-1} (v_x^{(\ell)}[n])^2$$

e

$$r_{V_y}[0] \approx \frac{1}{N} \sum_{n=0}^{N-1} (v_y^{(\ell)}[n])^2$$

Cálculo de $r_{V_x}[0]$ com N = comprimento do sinal:

```
In [43]: # Constrói-se uma realização do ruído na entrada:
v_x = sqrt(var_ruído)*randn(length(seq));

N = length(v_x);

# Em seguida, estima-se sua potência média pela fórmula indicada acima:
Pot_Vx_estimada_B = (1/N) * sum(v_x.^2)
```

```
Out[43]: 0.00390264124551737
```

Vamos agora considerar $N = 10000$:

```
In [45]: N = 10000;
v_x = sqrt(var_ruído)*randn(N);
Pot_Vx_estimada_B = (1/N) * sum(v_x.^2)
```

```
Out[45]: 0.0039831690298021945
```

Vamos agora considerar $N = 100000$:

```
In [46]: N = 100000;
v_x = sqrt(var_ruído)*randn(N);
Pot_Vx_estimada_B = (1/N) * sum(v_x.^2)
```

```
Out[46]: 0.003912593002332618
```

Nota-se que o valor "medido" da potência do ruído na entrada é compatível ao valor teórico: $P_{\text{ruído, entrada}} = \sigma^2 \approx 0,0039$. Não se nota uma melhora altamente significativa das estimativas, ao se aumentar N para 10000 e 100000. Em todos os casos, os valores obtidos são próximos ao esperado.

Cálculo de $r_{V_y}[0]$ com N = comprimento do sinal:

```
In [56]: # Constrói-se uma realização do ruído na saída:
v_y = filt(h_filtro, v_x);

# Em seguida, estima-se sua potência média pela fórmula indicada acima:
Pot_Vy_estimada_B = (1/N) * sum(v_y.^2)
```

```
Out[56]: 0.0003862275248672492
```

Vamos agora considerar $N = 10000$:

```
In [57]: N = 10000;
v_x = sqrt(var_ruído)*randn(N);
v_y = filt(h_filtro, v_x);

Pot_Vy_estimada_B = (1/N) * sum(v_y.^2)
```

```
Out[57]: 0.0003882977252964052
```

Vamos agora considerar $N = 100000$:

```
In [58]: N = 100000;
v_x = sqrt(var_ruído)*randn(N);
v_y = filt(h_filtro, v_x);

Pot_Vy_estimada_B = (1/N) * sum(v_y.^2)
```

```
Out[58]: 0.0003872999261858583
```

Nota-se que o valor "medido" da potência do ruído na saída é compatível ao valor teórico: $P_{\text{ruído, saída}} = 0,1 \cdot \sigma^2 \approx 0,00039$. Não se nota uma melhora altamente significativa das estimativas, ao se aumentar N para 10000 e 100000. Em todos os casos, os valores obtidos são próximos ao esperado.