

SST1 Übungsstunde 12

Matteo Dietz

December 2025

- **Diskrete Fouriertransformation (DFT)**

Herleitung, Visualisierung, Matrixdarstellung

- **Lineare und Zyklische Faltung**

Zirkulante Matrizen

Anwendungen der DFT auf LTI-Systeme

Aufgaben für diese Woche

123, 124, 125, 126, 127, 128, 130, 131

Die fettgedruckten Übungen empfehle ich, weil sie wesentlich zu eurem Verständnis der Theorie beitragen und/oder sehr prüfungsrelevant sind.

Die DFT ist **sehr wichtig**! Es kommt immer eine ganze Aufgabe dazu an der Prüfung. (25 / 100 Punkte)

DFT: Herleitung

- Wir betrachten ein Signal $x[n]$ endlicher Länge N .
- Die DTFT des Signals ist

$$\hat{x}(\theta) = \sum_{n=-\infty}^{\infty} x[n]e^{-2\pi i\theta n} = \sum_{n=0}^{N-1} x[n]e^{-2\pi i\theta n}$$

- $\hat{x}(\theta)$ ist kontinuierlich. Wir tasten $\hat{x}(\theta)$ im Frequenzbereich ab.

$$\hat{x}[k] := \hat{x}\left(\frac{k}{N}\right) = \sum_{n=0}^{N-1} x[n]e^{-2\pi i \frac{k}{N} n}$$

Diskrete Fouriertransformation (DFT)

$$\text{(DFT)} \quad \hat{x}[k] = \sum_{n=0}^{N-1} x[n] \omega_N^{kn} \quad \hat{x}[k + N] = \hat{x}[k]$$

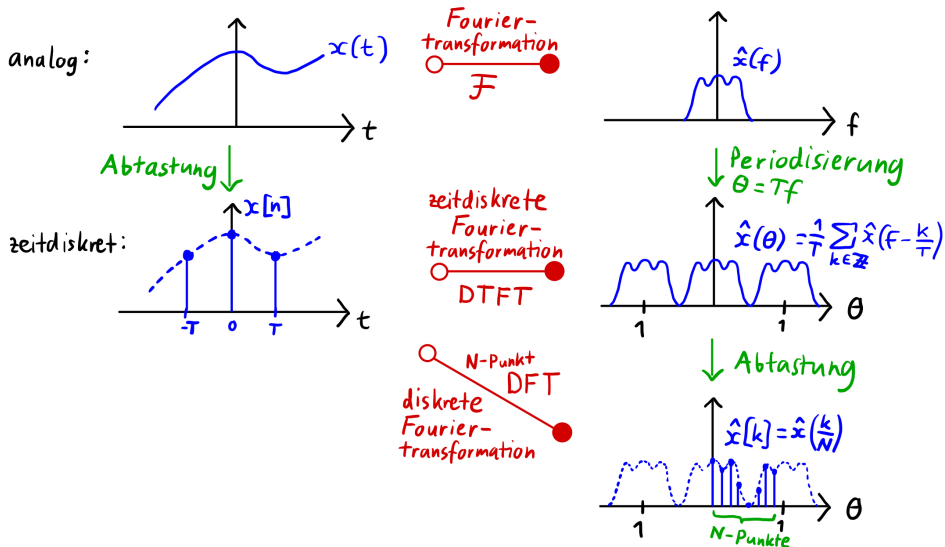
$$\text{(IDFT)} \quad x[n] = \frac{1}{N} \sum_{k=0}^{N-1} \hat{x}[k] \omega_N^{-kn} \quad x[n + N] = x[n]$$

wobei $\omega_N = e^{-\frac{2\pi i}{N}}$

DFT: Bemerkungen

- 1 ω_N^l ist N -periodisch, denn:
$$\omega_N^{l+N} = e^{-\frac{2\pi i}{N}(l+N)} = e^{-\frac{2\pi i l}{N}} e^{-2\pi i} = \omega_N^l$$
- 2 Es folgt: $\hat{x}[k + N] = \hat{x}[k]$. **Die DFT-Signale sind als N -periodisch zu interpretieren!**
- 3 **Abtastung im Frequenzbereich entspricht Periodisierung im Zeitbereich.**

DFT: Visualisierung



DFT: Matrixdarstellung

Wir haben $\hat{x}[k] = \sum_{n=0}^{N-1} x[n] \omega_N^{kn}$, $k \in \{0, 1, \dots, N-1\}$ Somit:

$$\underbrace{\begin{bmatrix} \hat{x}[0] \\ \hat{x}[1] \\ \hat{x}[2] \\ \vdots \\ \hat{x}[N-1] \end{bmatrix}}_{=:\hat{\mathbf{x}}} = \underbrace{\begin{bmatrix} 1 & 1 & 1 & \dots & 1 \\ 1 & \omega_N & \omega_N^2 & \dots & \omega_N^{N-1} \\ 1 & \omega_N^2 & \omega_N^4 & \dots & \omega_N^{2(N-1)} \\ \vdots & \vdots & \vdots & \ddots & \vdots \\ 1 & \omega_N^{N-1} & \omega_N^{2(N-1)} & \dots & \omega_N^{(N-1)^2} \end{bmatrix}}_{\text{DFT-Matrix } F_N} \underbrace{\begin{bmatrix} x[0] \\ x[1] \\ x[2] \\ \vdots \\ x[N-1] \end{bmatrix}}_{\mathbf{x}}$$

DFT: Matrixdarstellung

Somit erhalten wir:

DFT

$$\hat{\mathbf{x}} = F_N \mathbf{x}$$

IDFT

$$\mathbf{x} = \frac{1}{N} F_N^H \hat{\mathbf{x}}$$

Die Spalten von F_N sind orthogonal aufeinander: $\langle \mathbf{f}_r, \mathbf{f}_s \rangle = \delta_{r,s}$

Es gilt $F_N F_N^H = N I_N$

DFT: Entwicklung in eine ONB

Die DFT entspricht einer Entwicklung des Vektors \mathbf{x} in eine orthonormale Basis (ONB) in \mathbb{C}^N :

$$\mathbf{x} = \underbrace{\frac{1}{N} \mathbf{F}_N^H \mathbf{F}_N}_{\mathbf{I}_N} \mathbf{x} = \frac{1}{N} \begin{bmatrix} \mathbf{f}_0 & \mathbf{f}_1 & \cdots & \mathbf{f}_{N-1} \end{bmatrix} \begin{bmatrix} \mathbf{f}_0^H \\ \mathbf{f}_1^H \\ \vdots \\ \mathbf{f}_{N-1}^H \end{bmatrix} \mathbf{x} = \frac{1}{N} \sum_{l=0}^{N-1} \langle \mathbf{x}, \mathbf{f}_l \rangle \mathbf{f}_l$$

DFT: Beispiel

Was ist die 2-Punkte DFT von $\mathbf{x} = \begin{bmatrix} x[0] \\ x[1] \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 1 \\ 1 \end{bmatrix}$

$$F_2 = \begin{bmatrix} 1 & 1 \\ 1 & \omega_2 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 1 & 1 \\ 1 & -1 \end{bmatrix}, \quad \text{weil } \omega_2 = e^{-\frac{2\pi i}{2}} = -1, \quad \text{dann:}$$

$$\hat{\mathbf{x}} = \begin{bmatrix} \hat{x}[0] \\ \hat{x}[1] \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 1 & 1 \\ 1 & -1 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} 1 \\ 1 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 2 \\ 0 \end{bmatrix}$$

Aufgabe 123

Zyklische Faltung

$$x_3[l] = \sum_{n=0}^{N-1} x_1[n]x_2[l - n] = \sum_{n=0}^{N-1} x_1[l - n]x_2[n]$$

DFT

$$\hat{x}_3[k] = \hat{x}_1[k] \cdot \hat{x}_2[k]$$

Zyklische Faltung: Bemerkungen

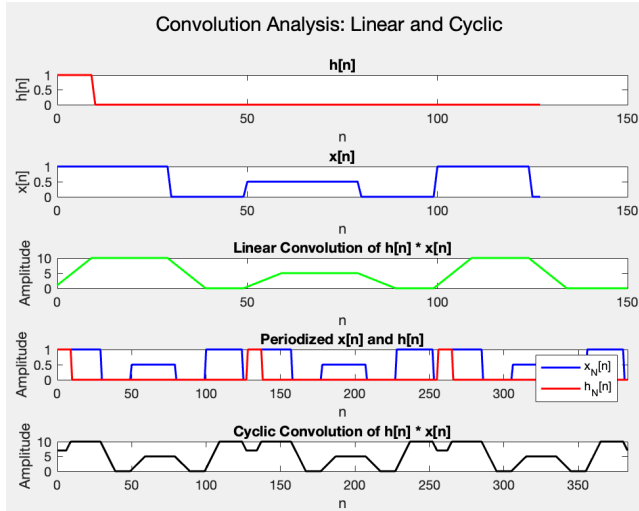
- 1 Elementweise Multiplikation im Frequenzbereich entspricht einer zyklischen Faltung im Zeitbereich
- 2 $x_1[n]$, $x_2[n]$, $x_3[n]$ werden N -**periodisch fortgesetzt**, d.h. $x_2[l - n] = x_2[l - n + N] \neq 0$ ist möglich
- 3 Zyklische Faltungen können schnell mittels FFT berechnet werden.

Lineare Faltung

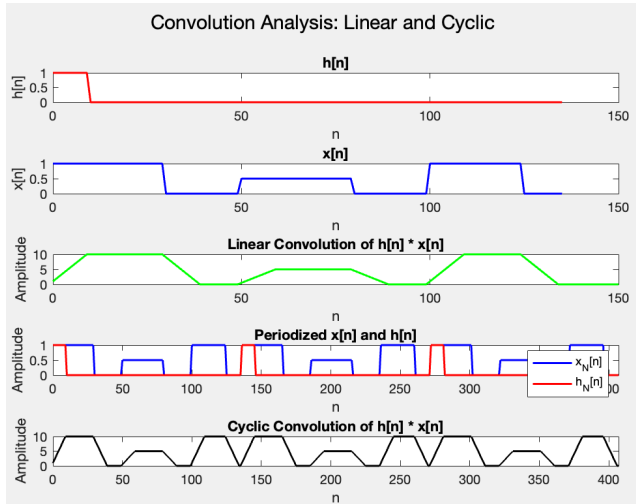
$x_1[n]$ hat Länge L und $x_2[n]$ hat Länge P . Wir wollen berechnen:

$$x_3[n] = \sum_{l=-\infty}^{\infty} x_1[l] \cdot x_2[n-l] = \sum_{l=0}^{L-1} x_1[l] \cdot x_2[n-l]$$

Lineare vs Zyklische Faltung: Aliasing



Lineare vs Zyklische Faltung: kein Aliasing



Lineare Faltung: Kochrezept

- 1 Zero-Padding (mit Nullen auffüllen) der Signale $x_1[n]$ und $x_2[n]$ auf die Länge $N \geq P + L - 1$
- 2 Berechnen der **N-Punkte** DFT $\hat{x}_1[k]$ und $\hat{x}_2[k]$
- 3 Berechnen des punktweisen Produktes $\hat{x}_3[k] = \hat{x}_1[k] \cdot \hat{x}_2[k]$
- 4 Inverse N-Punkte DFT von $\hat{x}_3[k]$
Wir erhalten $\tilde{x}_3[n]$, die periodische Fortsetzung von $x_3[n]$

Zyklische Faltung: Matrixdarstellung

$$x_3[l] = \sum_{n=0}^{N-1} x_1[n]x_2[l-n] = \sum_{n=0}^{N-1} x_1[l-n]x_2[n]$$

$$\underbrace{\begin{bmatrix} x_3[0] \\ x_3[1] \\ \vdots \\ x_3[N-1] \end{bmatrix}}_{\mathbf{x}_3} = \begin{bmatrix} x_2[0] & x_2[-1] & \cdots & x_2[-N+1] \\ x_2[1] & x_2[0] & \cdots & x_2[-N+2] \\ \vdots & \vdots & \ddots & \vdots \\ x_2[N-1] & x_2[N-2] & \cdots & x_2[0] \end{bmatrix} \begin{bmatrix} x_1[0] \\ x_1[1] \\ \vdots \\ x_1[N-1] \end{bmatrix}$$

$$\stackrel{*}{=} \underbrace{\begin{bmatrix} x_2[0] & x_2[N-1] & \cdots & x_2[1] \\ x_2[1] & x_2[0] & \cdots & x_2[2] \\ \vdots & \vdots & \ddots & \vdots \\ x_2[N-1] & x_2[N-2] & \cdots & x_2[0] \end{bmatrix}}_{\mathbf{x}_2} \underbrace{\begin{bmatrix} x_1[0] \\ x_1[1] \\ \vdots \\ x_1[N-1] \end{bmatrix}}_{\mathbf{x}_1}$$

Zyklische Faltung: Matrixdarstellung

$$\begin{aligned}
 \frac{1}{N} \mathbf{F}_N \mathbf{X}_2 \mathbf{F}_N^H &= \frac{1}{N} \begin{bmatrix} \hat{x}_2[0] & \hat{x}_2[0] & \dots & \hat{x}_2[0] \\ \hat{x}_2[1] & \hat{x}_2[1]\omega_N & \dots & \hat{x}_2[1]\omega_N^{N-1} \\ \hat{x}_2[2] & \hat{x}_2[2]\omega_N^2 & \dots & \hat{x}_2[2]\omega_N^{2(N-1)} \\ \vdots & \vdots & \ddots & \vdots \\ \hat{x}_2[N-1] & \hat{x}_2[N-1]\omega_N^{N-1} & \dots & \hat{x}_2[N-1]\omega_N^{(N-1)^2} \end{bmatrix} \mathbf{F}_N^H \\
 &= \frac{1}{N} \begin{bmatrix} \hat{x}_2[0] & & & & \mathbf{0} \\ & \ddots & & & \\ \mathbf{0} & & \ddots & & \\ & & & \hat{x}_2[N-1] & \end{bmatrix} \underbrace{\begin{bmatrix} 1 & 1 & 1 & \dots & 1 \\ 1 & \omega_N & \omega_N^2 & \dots & \omega_N^{N-1} \\ 1 & \omega_N^2 & \omega_N^4 & \dots & \omega_N^{2(N-1)} \\ \vdots & \vdots & \vdots & \ddots & \vdots \\ 1 & \omega_N^{N-1} & \omega_N^{2(N-1)} & \dots & \omega_N^{(N-1)^2} \end{bmatrix}}_{\mathbf{F}_N} \mathbf{F}_N^H
 \end{aligned}$$

Zyklische Faltung: Matrixdarstellung

$$\begin{aligned} &= \frac{1}{N} \begin{bmatrix} \hat{x}_2[0] & & \mathbf{0} \\ & \ddots & \\ \mathbf{0} & & \hat{x}_2[N-1] \end{bmatrix} N\mathbf{I}_N = \begin{bmatrix} \hat{x}_2[0] & & \mathbf{0} \\ & \ddots & \\ \mathbf{0} & & \hat{x}_2[N-1] \end{bmatrix} \\ \text{Somit } \mathbf{X}_2 &= \frac{1}{N} \mathbf{F}_N^H \begin{bmatrix} \hat{x}_2[0] & & \mathbf{0} \\ & \ddots & \\ \mathbf{0} & & \hat{x}_2[N-1] \end{bmatrix} \mathbf{F}_N \end{aligned}$$

Bemerkungen

- 1 Eigenvektoren einer zirkulanten Matrix = Spalten der normalisierten DFT-Matrix $\frac{1}{\sqrt{N}} \mathbf{F}_N^H$
Dazugehörige Eigenwerte sind durch die DFT der ersten Spalte der zirkulanten Matrix gegeben
- 2 Vgl. zeitkontinuierlicher Fall: $e^{2\pi i f_0 t}$ Eigenfunktionen von LTI-Systemen sind und $\hat{h}(f)$ die dazugehörigen Eigenwerte
- 3 **Die zyklische Faltung wird durch die DFT diagonalisiert.**

Anwendung DFT auf LTI-Systeme

$$\mathbf{y} = \mathbf{H}\mathbf{x} = \frac{1}{N} \mathbf{F}_N^H \begin{bmatrix} \hat{h}[0] & & \mathbf{0} \\ & \ddots & \\ \mathbf{0} & & \hat{h}[N-1] \end{bmatrix} \mathbf{F}_N \mathbf{x}$$

DFT



$$\mathbf{F}_N \mathbf{y} = \underbrace{\frac{1}{N} \mathbf{F}_N \mathbf{F}_N^H}_{\mathbf{I}_N} \begin{bmatrix} \hat{h}[0] & & \mathbf{0} \\ & \ddots & \\ \mathbf{0} & & \hat{h}[N-1] \end{bmatrix} \hat{\mathbf{x}} = \begin{bmatrix} \hat{h}[0] \hat{x}[0] \\ \hat{h}[1] \hat{x}[1] \\ \vdots \\ \hat{h}[N-1] \hat{x}[N-1] \end{bmatrix}$$

LTI-Systeme kommutieren

$$\begin{aligned}
 \mathbf{H}_1 \mathbf{H}_2 &= \frac{1}{N} \mathbf{F}_N^H \begin{bmatrix} \hat{h}_1[0] & & \mathbf{0} \\ & \ddots & \\ \mathbf{0} & & \hat{h}_1[N-1] \end{bmatrix} \underbrace{\mathbf{F}_N \frac{1}{N} \mathbf{F}_N^H}_{\mathbf{I}_N} \begin{bmatrix} \hat{h}_2[0] & & \mathbf{0} \\ & \ddots & \\ \mathbf{0} & & \hat{h}_2[N-1] \end{bmatrix} \mathbf{F}_N \\
 &= \frac{1}{N} \mathbf{F}_N^H \begin{bmatrix} \hat{h}_1[0] \hat{h}_2[0] & & \mathbf{0} \\ & \ddots & \\ \mathbf{0} & & \hat{h}_1[N-1] \hat{h}_2[N-1] \end{bmatrix} \mathbf{F}_N \\
 &= \frac{1}{N} \mathbf{F}_N^H \begin{bmatrix} \hat{h}_2[0] & & \mathbf{0} \\ & \ddots & \\ \mathbf{0} & & \hat{h}_2[N-1] \end{bmatrix} \underbrace{\mathbf{F}_N \frac{1}{N} \mathbf{F}_N^H}_{\mathbf{I}_N} \begin{bmatrix} \hat{h}_1[0] & & \mathbf{0} \\ & \ddots & \\ \mathbf{0} & & \hat{h}_1[N-1] \end{bmatrix} \mathbf{F}_N \\
 &= \mathbf{H}_2 \mathbf{H}_1
 \end{aligned}$$

Prüfungsaufgabe: Sommer 2020, Aufgabe 3.a) und b)