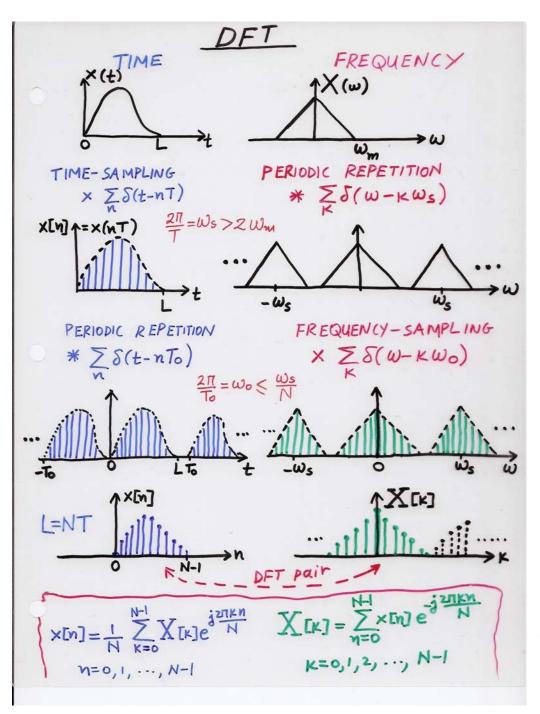
ΣΗΜΑΤΑ και ΣΥΣΤΗΜΑΤΑ

Σχολη ΗΜ&ΜΥ, ΕΜΠ Καθηγητης Πετρος Μαραγκος

Διακριτος Μετ/σμος Fourier DISCRETE FOURIER TRANSFORM (DFT)



1. Fourier Transform:

Συνεχης Χρονος Συνεχης Συχνοτητα

2. DTFT:

Διακριτος Χρονος Συνεχης Συχνοτητα, περιοδικη

DFS (Discrete Fourier Series): Διακριτος Χρονος, περιοδικη Διακριτη Συχνοτητα, περιοδικη

3. DFT:

Διακριτος Χρονος, Ν δειγματα Διακριτη Συχνοτητα, Ν δειγματα

Περιοχες Εφαμογων του DFT

- Φασματικη αναλυση:
 - Υπολογισμος DTFT με frequency sampling.
 - Υπολογισμος STFT: Φασματογραφημα (spectrogram)
 - Φασματική Αναλυσή με DFT παραθυρωμένου σηματός
- Υπολογισμος Συνελιξης (με πολ/σμο DFTs):
 - Υλοποιηση ΓΧΑ διακριτων φιλτρων στην συχνοτητα.
 - Block convolution: τμηματικό φιλτραρισμά μακρών σηματών
- Αναπαρασταση / Προσεγγιση / Συμπίεση Σηματος με Ορθογωνιους Μετ/σμούς (DFT, DCT)
- Ταχεις Αλγοριθμοι (FFT Fast Fourier Transform):
 - Πολυπλοκοτητα DFT N-σημειων: $O(N^2)$
 - Πολυπλοκοτητα FFT N-σημειων: *O*(*N* log, *N*)

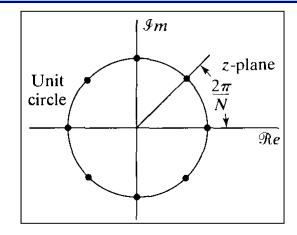
Λημμα

Συνθεση σηματος απο DFT:

$$x[n] = \frac{1}{N} \sum_{k=0}^{N-1} X[k] \exp\left(j \frac{2\pi kn}{N}\right)$$

Γραμμικος Συνδυασμος Αρμονικων

Μιγαδικων Ημιτονων Διακριτου Χρονου

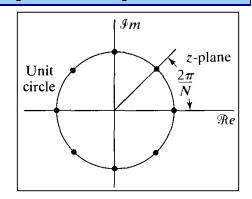


$$p[n] = \frac{1}{N} \sum_{k=0}^{N-1} \exp\left(j\frac{2\pi kn}{N}\right) = \begin{cases} 1, & n = rN \\ 0, & \alpha\lambda\lambda o v \end{cases} = \sum_{r=-\infty}^{\infty} \delta[n-rN]$$

Ιδιοτητες Αρμονικών Μιγαδικών Ημιτονών Διακριτού Χρονού

Περιοδικοτητα ως προς χρονικο δεικτη η

$$e_k[n] = e^{j(2\pi/N)kn} = e_k[n+rN]$$



Περιοδικοτητα ως προς φασματικο δεικτη **k**

$$e_{k+\ell N}[n] = e^{j(2\pi/N)(k+\ell N)n} = e^{j(2\pi/N)kn}e^{j2\pi\ell n} = e^{j(2\pi/N)kn} = e_k[n]$$

Ορθογωνιοτητα αρμονικης k και αρμονικης r

$$\frac{1}{N} \sum_{n=0}^{N-1} e^{j(2\pi/N)(k-r)n} = \begin{cases} 1, & k-r = mN, \quad m \text{ an integer,} \\ 0, & \text{otherwise.} \end{cases}$$

Discrete Fourier Series (DFS)

για Περιοδικα Σηματα Διακριτου Χρονου

Περιοδικό Σημα: $\tilde{x}[n] = \tilde{x}[n+N]$

$$\tilde{x}[n] \stackrel{\mathcal{DFS}}{\longleftrightarrow} \tilde{X}[k]$$

Analysis equation:
$$\tilde{X}[k] = \sum_{n=0}^{N-1} \tilde{x}[n]W_N^{kn}$$
.

$$W_N = e^{-j(2\pi/N)}$$

Analysis equation:
$$\tilde{X}[k] = \sum_{n=0}^{N-1} \tilde{x}[n]W_N^{kn}$$
. $W_N = e^{-j(2\pi/N)}$
Synthesis equation: $\tilde{x}[n] = \frac{1}{N} \sum_{k=0}^{N-1} \tilde{X}[k]W_N^{-kn}$

Εξισωσεις αναλυσης & συνθεσης \rightarrow ακολουθιες $N-\pi$ εριοδικες:

Αναλυση: X[k] = X[k+N]

Συνθεση: $\tilde{x}[n] = \tilde{x}[n+N]$

Περιοδικοτητα DFS

$$\tilde{X}[k] = \sum_{n=0}^{N-1} \tilde{x}[n]e^{-j(2\pi/N)kn}$$

$$\tilde{X}[k+N] = \sum_{n=0}^{N-1} \tilde{x}[n]e^{-j(2\pi/N)(k+N)n}$$

$$= \left(\sum_{n=0}^{N-1} \tilde{x}[n]e^{-j(2\pi/N)kn}\right)e^{-j2\pi n} = \tilde{X}[k]$$

Παραδειγμα 1: DFS Περιοδικης Κρουστικης Παλμοσειρας

Περιοδικο Σημα

$$\tilde{x}[n] = \sum_{r=-\infty}^{\infty} \delta[n-rN] = \begin{cases} 1, & n=rN, r \text{ any integer,} \\ 0, & \text{otherwise,} \end{cases}$$

DFS
$$\tilde{X}[k] = \sum_{n=0}^{N-1} \delta[n] W_N^{kn} = W_N^0 = 1$$

Συνθεση σηματος απο DFS

$$\tilde{x}[n] = \sum_{r=-\infty}^{\infty} \delta[n - rN] = \frac{1}{N} \sum_{k=0}^{N-1} W_N^{-kn} = \frac{1}{N} \sum_{k=0}^{N-1} e^{j(2\pi/N)kn}$$

Discrete Fourier Transform (DFT) απο DFS

$$x[n] = \begin{cases} \tilde{x}[n], & 0 \le n \le N - 1 \\ 0, & \text{otherwise.} \end{cases} \qquad \tilde{x}[n] = \sum_{r = -\infty}^{\infty} x[n - rN].$$

$$\tilde{x}[n] = \sum_{r=-\infty}^{\infty} x[n-rN]$$

Περιοδική από επαναλήψη βασικής περιόδου: $\tilde{x}[n] = x[(n \text{ modulo } N)] = x[((n))_N]$

$$X[k] = \begin{cases} \tilde{X}[k], & 0 \le k \le N - 1 \\ 0, & \text{otherwise,} \end{cases} \quad \tilde{X}[k] = X[(k \text{ modulo } N)] = X[((k))_N]$$

$$\tilde{X}[k] = X[(k \text{ modulo } N)] = X[((k))_N]$$

Το ζευγος DFT προκυπτει απο τις βασικες περιοδους του ζευγους DFS

Analysis equation:
$$X[k] = \sum_{n=0}^{N-1} x[n] W_N^{kn}$$
, $x[n] \stackrel{\mathcal{DFJ}}{\longleftrightarrow} X[k]$

$$x[n] \stackrel{\mathcal{DFJ}}{\longleftrightarrow} X[k]$$

Synthesis equation:
$$x[n] = \frac{1}{N} \sum_{k=0}^{N-1} X[k] W_N^{-kn}$$
.

Παραδειγμα 1: DFT Μοναδιαίου Κρουστικού Παλμού

Σημα πεπερασμενης διαρκειας Ν δειγματων:

$$x[n] = \begin{cases} 1, & n = 0 \\ 0, & 1 \le n \le N-1 \end{cases} = \underbrace{\left(u[n] - u[n-N]\right)}_{\text{παραθυρο } N} \sum_{\delta \text{ eighaton}}^{\infty} \delta[n-rN]$$

DFT:
$$X[k] = \sum_{n=0}^{N-1} \delta[n] \exp\left(-j\frac{2\pi kn}{N}\right) = 1, \quad k = 0, ..., N-1$$

Συνθεση σηματος απο DFT:

$$x[n] = \frac{1}{N} \sum_{k=0}^{N-1} X[k] \exp\left(j \frac{2\pi kn}{N}\right) = \begin{cases} 1, & n = 0 \\ 0, & 1 \le n \le N-1 \end{cases}$$

Παραδειγμα 2: Κρουστικη Παλμοσειρα στη Συχνοτητα (Δυϊσμος των DFS)

$$\tilde{Y}[k] = \sum_{r=-\infty}^{\infty} N\delta[k-rN]$$

Συνθεση περιοδικου σηματος απο DFS

$$\tilde{y}[n] = \frac{1}{N} \sum_{k=0}^{N-1} N \delta[k] W_N^{-kn} = W_N^{-0} = 1$$

Παραδειγμα 2: Inverse DFT Μοναδιαιας Κρουστικης στη Συχνοτητα

DFT *N* δειγματων:

$$X[k] = \begin{cases} N, & k = 0 \\ 0, & 1 \le k \le N - 1 \end{cases} = \underbrace{\left(u[k] - u[k - N]\right)}_{\text{paraburo }N} \sum_{r = -\infty}^{\infty} \delta[k - rN]$$

Inverse DFT: Συνθεση σηματος απο DFT:

$$x[n] = \frac{1}{N} \sum_{k=0}^{N-1} N \delta[k] \exp\left(j \frac{2\pi kn}{N}\right) = 1, \quad n = 0, ..., N-1$$

Ο DFT Δειγματοληπτει τον DTFT

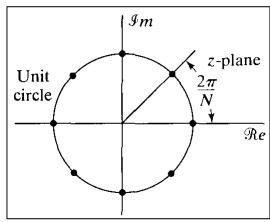
Σημα πεπερασμενης διαρκειας Ν δειγματων:

$$x[n], \quad n = 0, 1, ..., N-1$$

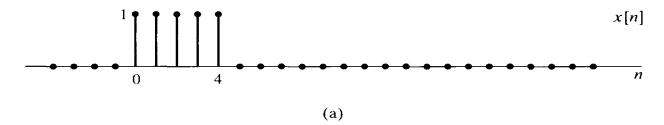
DTFT:
$$X(\Omega) = \sum_{n=0}^{N-1} x[n] \exp(-j\Omega n), -\pi \le \Omega < \pi$$

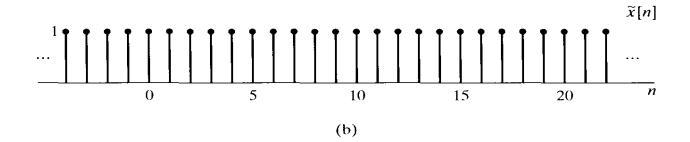
DFT:
$$X[k] = \sum_{n=0}^{N-1} x[n] \exp\left(-j\frac{2\pi kn}{N}\right), \quad k = 0,...,N-1$$

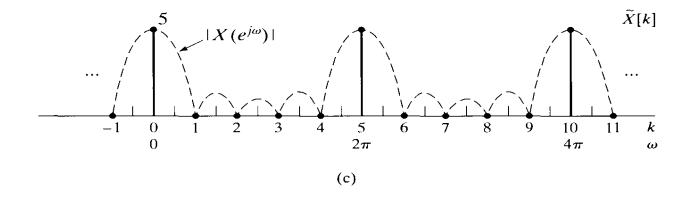
$$= X(\Omega)|_{\Omega = 2\pi k/N}$$

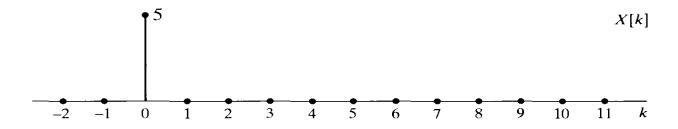


Ορθογωνιος Παλμος 5 σημειων -> DFT N= 5 σημειων

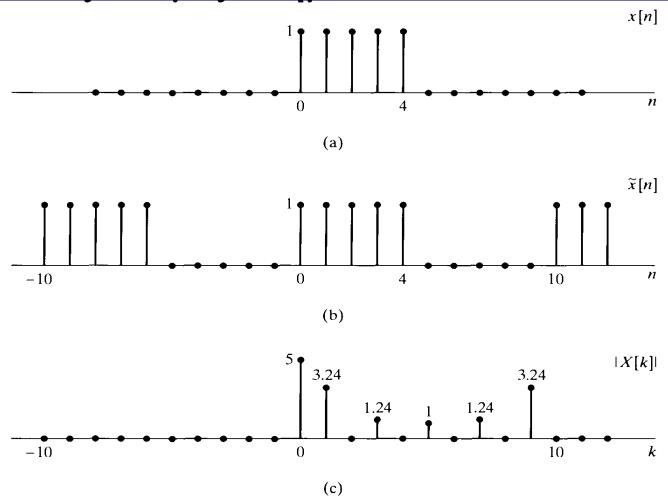


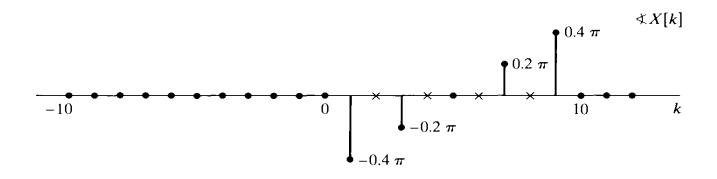






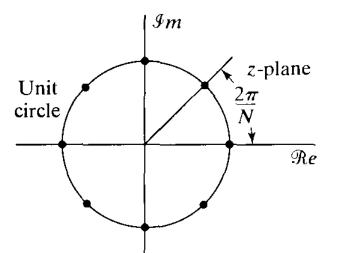
Ορθογωνιος Παλμος 5 σημειων > DFT N= 10 σημειων





Δειγματοληψια DTFT → Περιοδικη Επαναληψη σε Χρονο

DTFT Μη- περιοδικου σηματος
$$x[n]$$
: $X(\Omega) \triangleq \sum_{m=-\infty}^{+\infty} x[m]e^{-j\Omega m}$



Δειγματα Φασματος

$$|X[k] = X(\Omega)|_{\Omega=2\pi k/N} = X\left(\frac{2\pi k}{N}\right)$$

$$\widetilde{x}[n] = \frac{1}{N} \sum_{k=0}^{N-1} X[k] e^{j2\pi kn/N} = \frac{1}{N} \sum_{k=0}^{N-1} \left(\sum_{m=-\infty}^{+\infty} x[m] e^{-j2\pi km/N} \right) e^{j2\pi kn/N}$$

$$\tilde{x}[n] = x[n] * \sum_{r=-\infty}^{\infty} \delta[n - rN] = \sum_{r=-\infty}^{\infty} x[n - rN]$$

1.
$$x[n]$$

2.
$$x_1[n], x_2[n]$$

3.
$$ax_1[n] + bx_2[n]$$

4.
$$X[n]$$

5.
$$x[((n-m))_N]$$

6.
$$W_N^{-\ell n}x[n]$$

7.
$$\sum_{m=0}^{N-1} x_1(m) x_2[((n-m))_N]$$

8.
$$x_1[n]x_2[n]$$

9.
$$x^*[n]$$

10.
$$x^*[((-n))_N]$$

11.
$$\mathcal{R}e\{x[n]\}$$

12.
$$j\mathcal{J}m\{x[n]\}$$

13.
$$x_{ep}[n] = \frac{1}{2} \{x[n] + x^*[((-n))_N] \}$$

14.
$$x_{\text{op}}[n] = \frac{1}{2} \{x[n] - x^*[((-n))_N] \}$$

Properties 15–17 apply only when x[n] is real.

16.
$$x_{ep}[n] = \frac{1}{2} \{x[n] + x[((-n))_N] \}$$

17.
$$x_{\text{op}}[n] = \frac{1}{2} \{x[n] - x[((-n))_N] \}$$

$$X_1[k], X_2[k]$$

$$aX_1[k] + bX_2[k]$$

$$Nx[((-k))_N]$$

$$W_N^{km}X[k]$$

$$X[((k-\ell))_N]$$

$$X_1[k]X_2[k]$$

$$\frac{1}{N} \sum_{\ell=0}^{N-1} X_1(\ell) X_2[((k-\ell))_N]$$

$$X^*[((-k))_N]$$

$$X^*[k]$$

$$X_{\rm ep}[k] = \frac{1}{2} \{ X[((k))_N] + X^*[((-k))_N] \}$$

$$X_{\text{op}}[k] = \frac{1}{2} \{ X[((k))_N] - X^*[((-k))_N] \}$$

$$\mathcal{R}e\{X[k]\}$$

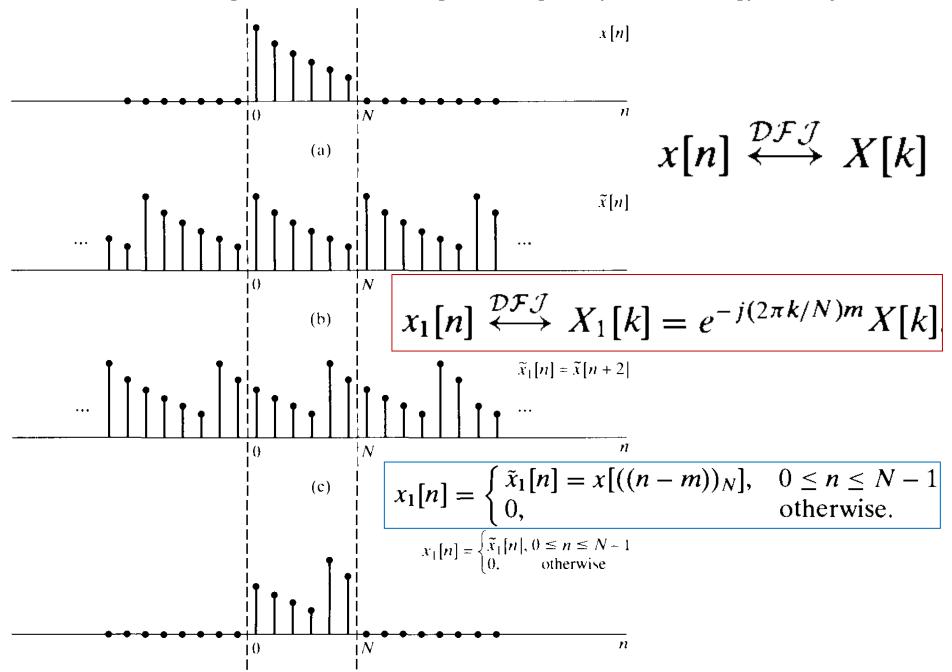
$$j\mathcal{J}m\{X[k]\}$$

$$\begin{cases} X[k] = X^*[((-k))_N] \\ \mathcal{R}e\{X[k]\} = \mathcal{R}e\{X[((-k))_N]\} \\ \mathcal{J}m\{X[k]\} = -\mathcal{J}m\{X[((-k))_N]\} \\ |X[k]| = |X[((-k))_N]| \\ < \{X[k]\} = - < \{X[((-k))_N]\} \end{cases}$$

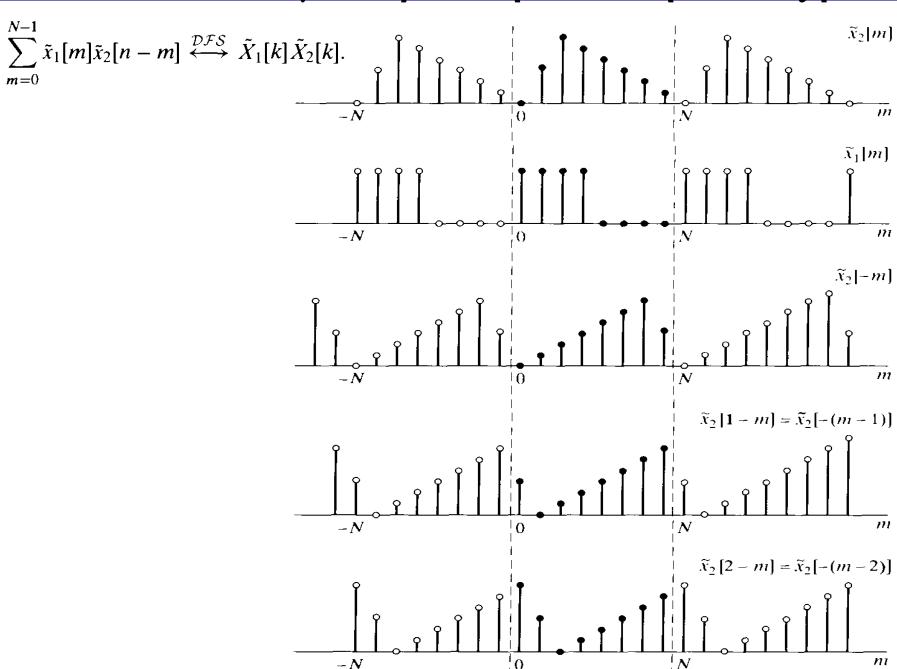
$$Re\{X[k]\}$$

$$j\mathcal{J}m\{X[k]\}$$

Κυκλικη Μετατοπιση Πεπερασμενου Σηματος



Διαδικασια για Περιοδικη-Κυκλικη Συνελιξη



Πολλαπλασιασμος DFS <-> Κυκλικη Συνελιξη

$$\tilde{x}_3[n] = \sum_{m=0}^{N-1} \tilde{x}_2[m] \tilde{x}_1[n-m].$$

$$\tilde{X}_3[k] = \sum_{n=0}^{N-1} \left(\sum_{m=0}^{N-1} \tilde{x}_1[m] \tilde{x}_2[n-m] \right) W_N^{kn}$$

$$\tilde{X}_3[k] = \sum_{m=0}^{N-1} \tilde{x}_1[m] \left(\sum_{n=0}^{N-1} \tilde{x}_2[n-m] W_N^{kn} \right)$$

$$\sum_{n=0}^{N-1} \tilde{x}_2[n-m] W_N^{kn} = W_N^{km} \tilde{X}_2[k]$$

$$\tilde{X}_{3}[k] = \sum_{m=0}^{N-1} \tilde{x}_{1}[m] W_{N}^{km} \tilde{X}_{2}[k] = \left(\sum_{m=0}^{N-1} \tilde{x}_{1}[m] W_{N}^{km}\right) \tilde{X}_{2}[k] = \tilde{X}_{1}[k] \tilde{X}_{2}[k]$$

$$\sum_{m=0}^{N-1} \tilde{x}_1[m] \tilde{x}_2[n-m] \stackrel{\mathcal{DFS}}{\longleftrightarrow} \tilde{X}_1[k] \tilde{X}_2[k]$$

Πολλαπλασιασμος DFT < > Κυκλικη Συνελιξη

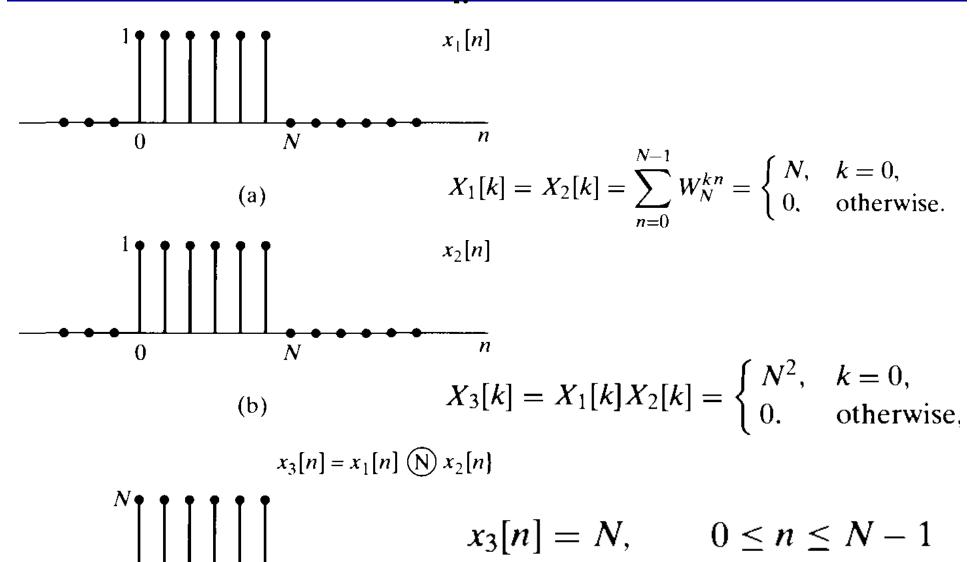
$$X_3[k] = X_1[k]X_2[k]$$

$$x_3[n] = \sum_{m=0}^{N-1} \tilde{x}_1[m]\tilde{x}_2[n-m], \qquad 0 \le n \le N-1,$$

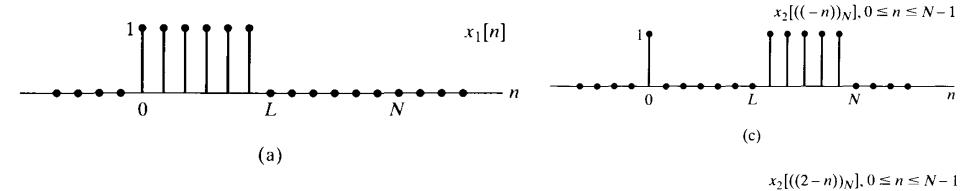
$$x_3[n] = \sum_{m=0}^{N-1} x_1[((m))_N]x_2[((n-m))_N], \qquad 0 \le n \le N-1$$

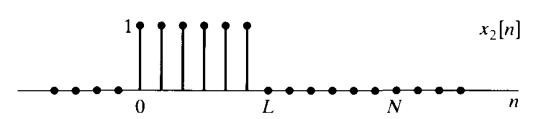
$$x_3[n] = \sum_{m=0}^{N-1} x_1[m] x_2[((n-m))_N], \qquad 0 \le n \le N-1$$
$$x_3[n] = x_1[n] \widehat{N} x_2[n]$$

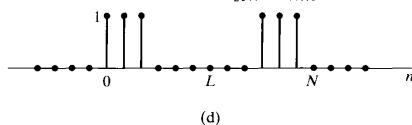
Κυκλικη Συνελιξη Περιοδου N= L Δυο Παλμων μηκους L σημειων

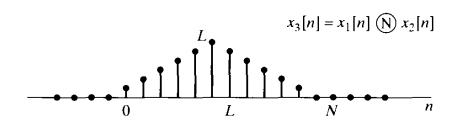


Κυκλικη Συνελιξη Περιοδου N= 2L Δυο Παλμων μηκους L σημειων

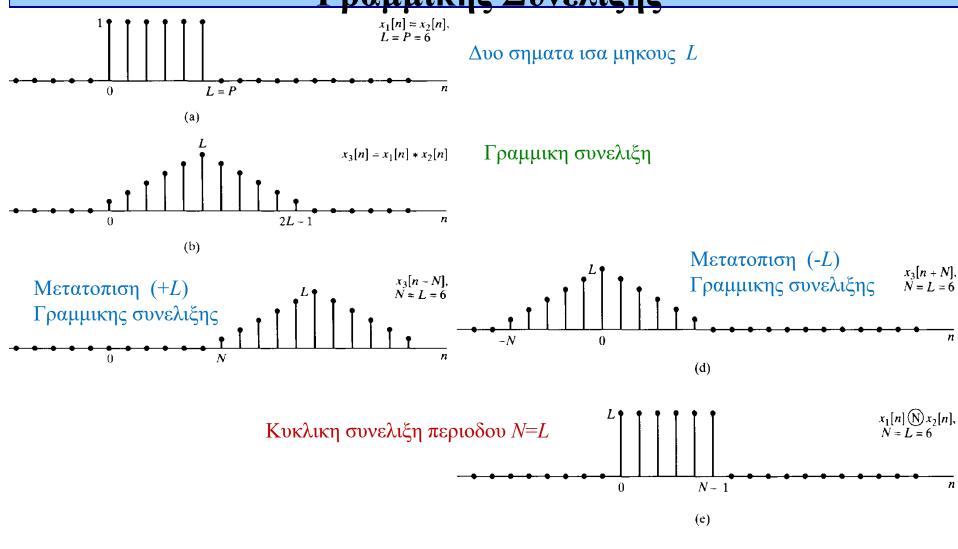


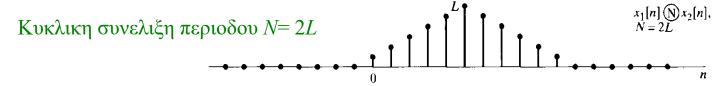






Παραδειγμα: Κυκλικη Συνελιξη απο Αναδιπλωση Γραμμικης Συνελιξης





Μερικες Εφαρμογες του DFT

DFT Αλγοριθμος Συνελιξης Δυο Πεπερασμενών Σηματών

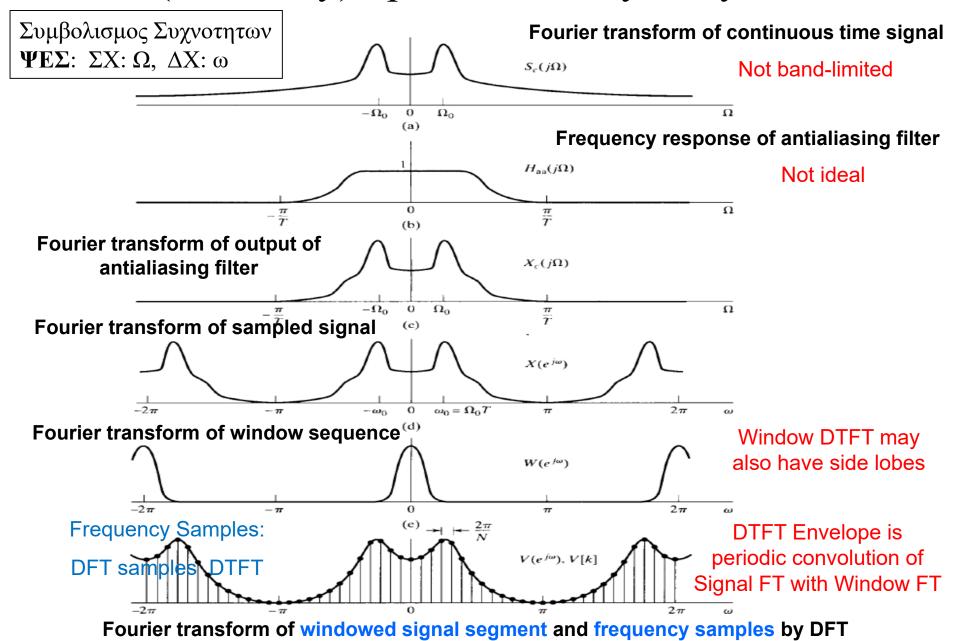
- 0. Σημα x[n] μηκους L σημειων, Σημα h[n] μηκους P σημειων.
- 1. Zero-pad τα δυο σηματα ωστε να εχουν μηκος N > L+P-2.
- 2. Υπολογισμός των δυό **DFT** μηκούς N σημείων: X[k], H[k]
- 3. Πολλαπλασιασμος των **DFT**: Y[k]=X[k]H[k], k=0,1,...,N-1.
- 4. Αντιστροφος DFT (Ν σημειων) του γινομενου:

IDFT
$$\{Y[k]\} \rightarrow y[n] = x[n] * h[n], n = 0,1,...,L + P-2.$$

Πολυπλοκοτητα Συνελιξης στον Χρονο:

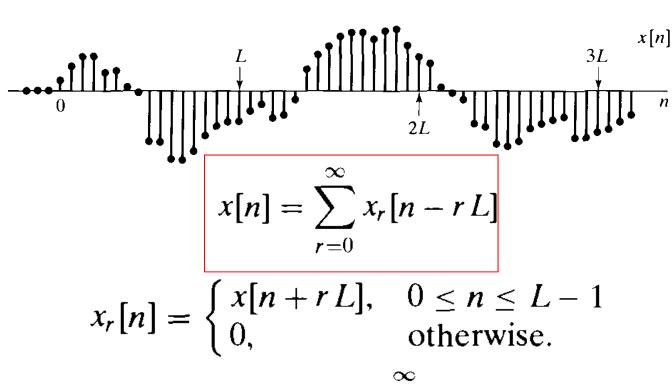
Πολυπλοκοτητα Συνελιξης μεσω DFT / FFT:

(stationary) Spectrum Analysis by DFT

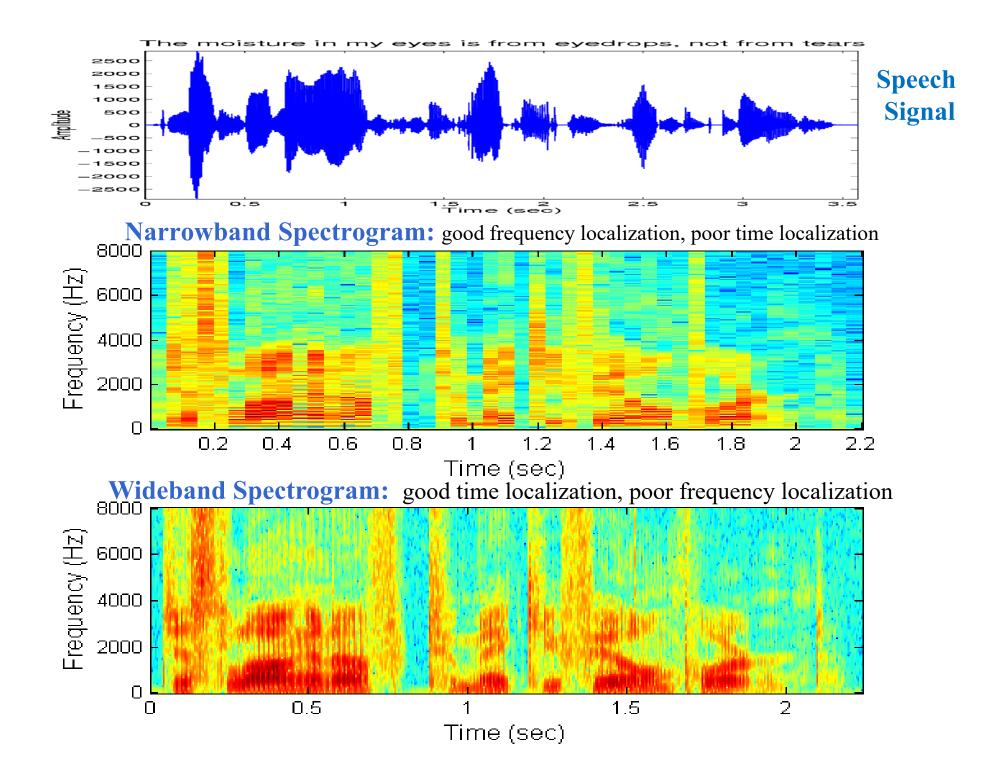


DFT Υλοποιηση ΓΧΑ Συστηματος ως Τμηματικη Συνελιξη





$$y[n] = x[n] * h[n] = \sum_{r=0}^{\infty} y_r[n - rL]$$
$$y_r[n] = x_r[n] * h[n]$$



Υπολογιστικη Πολυπλοκοτητα του DFT

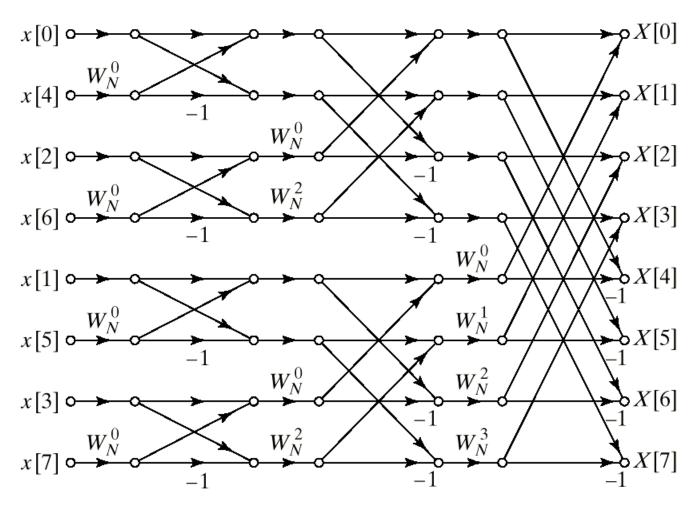
• DFT Ν σημειων:

$$X[k] = \sum_{n=0}^{N-1} x[n]W_N^{kn}, \quad k = 0, 1, \dots, N-1$$

• Αμεσος Υπολογισμος: N complex multiplications and N-I complex additions for each of the N DFT values $\Rightarrow \mu(N) = N^2$ complex multiplications.

$$N=1024 \Rightarrow \mu(N)\approx 10^6$$

FFT: Decimation in Time (Restructured)



 $\mu(N) = (N/2)\log_2 N$ complex multiplications

Ιδιοτητες του DFT

- Διακριτος και Περιοδικος στο Χρονο και Συχνοτητα
- Frequency sampling: (για υπολογισμο DTFT Φασματος)
 ← → περιοδικη επαναληψη σηματος στο χρονο
- Πολ/σμος DFTs (για υπολογισμο συνελιξης) ← → κυκλικη συνελιξη
- Ορθογωνιος Αλγοριθμος
- **Χρονο-συχνοτικη κατανομη** (υπολογισμος STFT)

Διακριτοι Ορθογωνιοι Μετασχηματισμοι

Εισοδος: Αρχικό σημα-διανύσμα: $\mathbf{x} = [x[0], x[1], ..., x[N-1]^T$

Εξοδος: Μετ/σμενο σημα-διανυσμα: $\mathbf{y} = [y[0], y[1], ..., y[N-1]]^T$

Ο NxN Πινακας Μετασχηματισμου $\mathbf{A} = [a[n,k]]$ ειναι Unitary

(Α ειναι Ορθογωνιος για Πραγματικους πινακες):

$$\mathbf{A}\mathbf{A}^H = \mathbf{I}$$

Γραμμικος Μετασχηματισμος (Πινακας x Διανυσμα εισοδου):

$$\mathbf{y} = \mathbf{A}^{H} \mathbf{x}$$
,
$$\begin{cases} y[k] = \sum_{n=0}^{N-1} a^{*}[k, n] x[n] \\ k = 0, 1, ..., N-1 \end{cases}$$

Αντιστροφος Μετασχηματισμος (Αντιστροφος Πινακας x Διανυσμα Εξοδου):

$$\mathbf{x} = \mathbf{A}\mathbf{y}$$
,
$$\begin{cases} x[n] = \sum_{k=0}^{N-1} a[n,k]y[k] \\ n = 0,1,...,N-1 \end{cases}$$

Unitary Discrete Fourier Transform (DFT)

Αναλυση:
$$X[k] = \frac{1}{\sqrt{N}} \sum_{n=0}^{N-1} x[n] W_N^{kn}, \quad k = 0, 1, ..., N-1$$

Συνθεση:
$$x[n] = \frac{1}{\sqrt{N}} \sum_{k=0}^{N-1} X[k] W_N^{-kn}, \quad n = 0, 1, ..., N-1$$

Διανυσμα χρονικων δειγματων: $\mathbf{x} = [x[0],...,x[N-1]]^T$

Διανυσμα συχνοτικων δειγματων: $\mathbf{y} = \begin{bmatrix} X[0],...,X[N-1] \end{bmatrix}^T$

DFT Πινακας:
$$\mathbf{F} = \left[\frac{1}{\sqrt{N}}W_N^{-kn}\right], \quad k, n = 0, 1, ..., N-1$$

 \mathbf{F} ειναι Unitary ($\mathbf{F}\mathbf{F}^H = \mathbf{I}$) και Συμμετρικός ($\mathbf{F} = \mathbf{F}^T$)

Ευθυς: $\mathbf{y} = \mathbf{F}^H \mathbf{x}$, Αντιστροφος: $\mathbf{x} = \mathbf{F} \mathbf{y}$

Discrete Cosine Transform (DCT)

$$\mathbf{C} = \left[c[k, n] \right] = \begin{cases} \frac{1}{\sqrt{N}}, & k = 0, \ 0 \le n \le N - 1 \\ \sqrt{\frac{2}{N}} \cos\left[\frac{\pi k (2n + 1)}{2N}\right], \ 1 \le k \le N - 1, \ 0 \le n \le N - 1 \end{cases}$$

DCT διανυσματος $\mathbf{x} = [x[0], x[1], ..., x[N-1]]^T$:

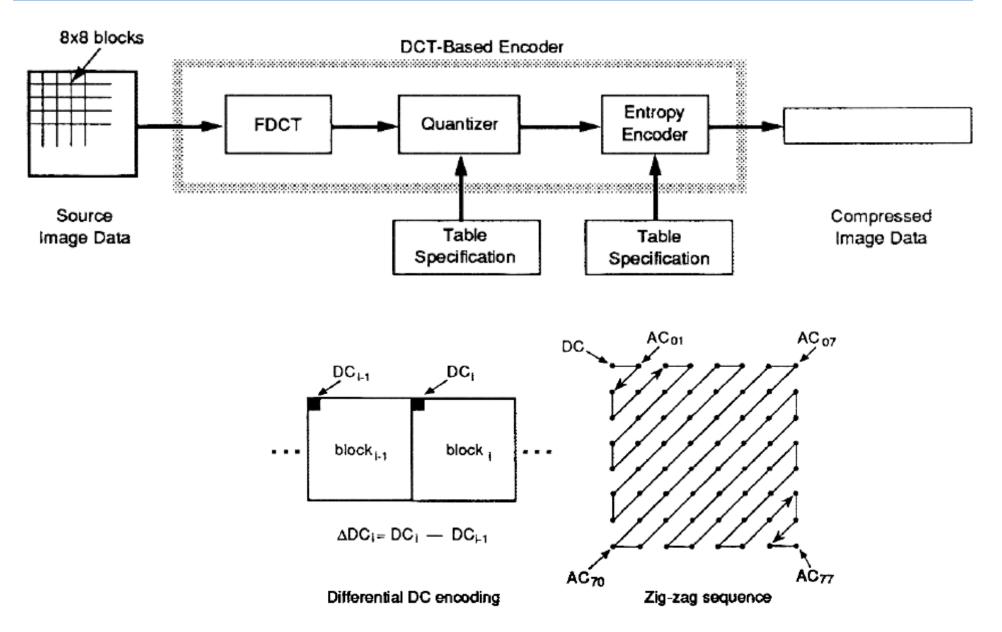
$$y[k] = \beta[k] \sum_{n=0}^{N-1} x[n] \cos\left[\frac{\pi k (2n+1)}{2N}\right], \quad 0 \le k \le N-1$$

$$\beta[0] = \sqrt{\frac{1}{N}}, \qquad \beta[k] = \sqrt{\frac{2}{N}} \qquad 1 \le k \le N-1$$

Αντιστροφος DCT:

$$x[n] = \sum_{\kappa=0}^{N-1} \beta[k] y[k] \cos \left| \frac{\pi k (2n+1)}{2N} \right|, \quad 0 \le n \le N-1$$

Εφαρμογη DCT: Συμπιεση Στατικών Εικόνων με προτυπο JPEG



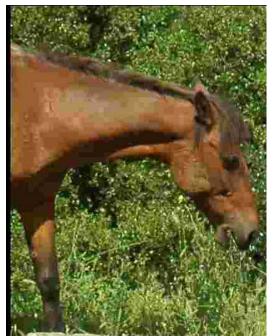
JPEG (Q=100)

JPEG (Q=25)

RAW

(→tiff)





JPEG (Q=10)