



Lineární a adaptivní zpracování dat

5. Lineární filtrace: Z-transformace, stabilita



Daniel Schwarz

Co nás čeká ještě v Bio440

P5: lineární filtrace, lineární časově invariantní, kauzální filtry, impulzová odezva, FIR, IIR. Z-transformace, přenosová funkce vs. frekvenční charakteristika. Nuly, póly. Stabilita.

P6: lineární filtrace – pokračování. Zmínka o časových řadách – AR, MA, ARMA – překryvy s IIR, FIR.

P7: odhad signálu v šumu, zprůměrování. SNR

P8: odhad signálu v šumu – pokračování / procvičování

P9: adaptivní filtry a identifikace. Obecné schéma adapt. Filtru. LMS, RLS.

P10: lineární predikce pomocí LMS

P11: adaptivní filtrace / lineární predikce – pokračování / procvičování

P12: časově-frekvenční a vlnková analýza.

Lineární filtrace obecně

Filtrace=?.....

viz 3. přednáška o LTI systémech a jejich popisu ve frekvenční oblasti

Lineární filtrace obecně

Filtrace = zpracování sloužící k výběru jistých složek ze směsi více signálů a k potlačení složek jiných.

Složky signálu =?.....

Lineární filtrace obecně

Filtrace = zpracování sloužící k výběru jistých složek ze směsi více signálů a k potlačení složek jiných.

Složky signálu = **harmonické komponenty** ve frekvenční oblasti, jejichž amplitudy a fáze se s filtrací pozmění.



Jak vystihujeme tuto změnu?

.....?.....

Lineární filtrace obecně

Filtrace = zpracování sloužící k výběru jistých složek ze směsi více signálů a k potlačení složek jiných.

Složky signálu = **harmonické komponenty** ve frekvenční oblasti, jejichž amplitudy a fáze se s filtrací pozmění.



Jak vystihujeme tuto změnu?

dvěma frekvenčními charakteristikami:

- amplitudovou
- a fázovou.



Čeho??.....

Lineární filtrace obecně

Filtrace = zpracování sloužící k výběru jistých složek ze směsi více signálů a k potlačení složek jiných.

Složky signálu = **harmonické komponenty** ve frekvenční oblasti, jejichž amplitudy a fáze se s filtrací pozmění.



Jak vystihujeme tuto změnu?

dvěma frekvenčními charakteristikami:

- **amplitudovou**
- **a fázovou.**



Čeho? **Filtru.**

Lineární filtrace obecně

Filtr=?.....

Lineární filtrace obecně

Filtr = systém nebo algoritmus (program), který mění požadovaným způsobem spektrum vstupního signálu.

Příklady aplikace: potlačení rušivých vlivů, frekvenční analýza

Popis filtru: frekvenční charakteristika $H(f)$, impulsní charakteristika $h(n)$, diferenční rovnice (definice), přenosová funkce $H(z)$.

je?..... vzhledem k diskrétnímu charakteru signálů.

Lineární filtrace obecně

Filtr = systém nebo algoritmus (program), který mění požadovaným způsobem spektrum vstupního signálu.

Příklady aplikace: potlačení rušivých vlivů, frekvenční analýza

Popis filtru: frekvenční charakteristika $H(f)$, impulsní charakteristika $h(n)$, diferenční rovnice (definice), přenosová funkce $H(z)$.

↓
je **periodická** vzhledem k diskrétnímu charakteru signálů.

↓
s periodou **..?..** v případě frekvence, **...?.** v případě normované frekvence,
..?.. v případě kmitočtu a **...?.** v případě normovaného kmitočtu.

Lineární filtrace obecně

Filtr = systém nebo algoritmus (program), který mění požadovaným způsobem spektrum vstupního signálu.

Příklady aplikace: potlačení rušivých vlivů, frekvenční analýza

Popis filtru: frekvenční charakteristika $H(f)$, impulsní charakteristika $h(n)$, diferenční rovnice (definice), přenosová funkce $H(z)$.

↓
je **periodická** vzhledem k diskrétnímu charakteru signálů.

↓
s periodou: $1/T_s$ v případě frekvence, **1** v případě normované frekvence, $2\pi/T_s$ v případě kmitočtu a **2π** v případě normovaného kmitočtu.

Z transformace

Transformace Z je důležitý nástroj pro reprezentaci a manipulaci s diskrétními posloupnostmi. Můžeme ji považovat za zevšeobecnění Fourierovy transformace pro diskrétní soustavy a signály.

$$Z\{x_n\} = X(z) = \sum_{n=-\infty}^{\infty} x_n \cdot z^{-n}$$

- z je komplexní proměnná.
- nejčastěji uvažujeme jednostrannou transformaci: sumace od $n=0$.

Z transformace

Transformace Z je důležitý nástroj pro reprezentaci a manipulaci s diskrétními posloupnostmi. Můžeme ji považovat za zevšeobecnění Fourierovy transformace pro diskrétní soustavy a signály.

$$Z\{x_n\} = X(z) = \sum_{n=-\infty}^{\infty} x_n \cdot z^{-n}$$

- z je komplexní proměnná.
- nejčastěji uvažujeme jednostrannou transformaci: sumace od $n=0$.

z v polárních souřadnicích: $z = r \cdot e^{j\omega T}$:

$$X(r \cdot e^{j\omega T}) = \text{.....?.....}$$

Z transformace

Transformace Z je důležitý nástroj pro reprezentaci a manipulaci s diskrétními posloupnostmi. Můžeme ji považovat za zevšeobecnění Fourierovy transformace pro diskrétní soustavy a signály.

$$Z\{x_n\} = X(z) = \sum_{n=-\infty}^{\infty} x_n \cdot z^{-n}$$

- z je komplexní proměnná.
- nejčastěji uvažujeme jednostrannou transformaci: sumace od $n=0$.

z v polárních souřadnicích: $z = r \cdot e^{j\omega T}$:

$$X(r \cdot e^{j\omega T}) = \sum_{n=-\infty}^{\infty} x_n \cdot [r \cdot e^{j\omega T}]^{-n} = \dots\dots\dots? \dots\dots\dots$$

Z transformace

Transformace Z je důležitý nástroj pro reprezentaci a manipulaci s diskrétními posloupnostmi. Můžeme ji považovat za zevšeobecnění Fourierovy transformace pro diskrétní soustavy a signály.

$$Z\{x_n\} = X(z) = \sum_{n=-\infty}^{\infty} x_n \cdot z^{-n}$$

- z je komplexní proměnná.
- nejčastěji uvažujeme jednostrannou transformaci: sumace od $n=0$.

z v polárních souřadnicích: $z = r \cdot e^{j\omega T}$:

$$X(r \cdot e^{j\omega T}) = \sum_{n=-\infty}^{\infty} x_n \cdot [r \cdot e^{j\omega T}]^{-n} = \sum_{n=-\infty}^{\infty} x_n r^{-n} \cdot e^{-jn\omega T}$$

Z transformace

Transformace Z je důležitý nástroj pro reprezentaci a manipulaci s diskretními posloupnostmi. Můžeme ji považovat za zevšeobecnění Fourierovy transformace pro diskretní soustavy a signály.

$$Z\{x_n\} = X(z) = \sum_{n=-\infty}^{\infty} x_n \cdot z^{-n}$$

$$X(r \cdot e^{j\omega T}) = \sum_{n=-\infty}^{\infty} x_n \cdot [r \cdot e^{j\omega T}]^{-n} = \sum_{n=-\infty}^{\infty} x_n r^{-n} \cdot e^{-jn\omega T}$$

Pro $r=1$ platí, že

Z transformace

Transformace Z je důležitý nástroj pro reprezentaci a manipulaci s diskrétními posloupnostmi. Můžeme ji považovat za zevšeobecnění Fourierovy transformace pro diskrétní soustavy a signály.

$$Z\{x_n\} = X(z) = \sum_{n=-\infty}^{\infty} x_n \cdot z^{-n}$$

$$X(r \cdot e^{j\omega T}) = \sum_{n=-\infty}^{\infty} x_n \cdot [r \cdot e^{j\omega T}]^{-n} = \sum_{n=-\infty}^{\infty} x_n r^{-n} \cdot e^{-jn\omega T}$$

Pro $r=1$ platí, že Z transformace na jednotkové kružnici $|z|=1$ je shodná s Fourierovou transformací DTFT.

Z transformace - příklady

Jednotkový impuls: {1,0,0,...}

$$x_n = \delta_n$$

$$X(z) = 1$$

Jednotkový skok: {1,1,1,...}

$$x_n = u_n$$

$$X(z) = \sum_{n=0}^{\infty} z^{-n} = \frac{1}{1 - z^{-1}}$$

Exponenciální signál:

$$x_n = c^n$$

$$X(z) = \sum_{n=0}^{\infty} c^n z^{-n} = \frac{1}{1 - cz^{-1}}$$

pro $n \geq 0$ a $x_n = 0$ pro $n < 0$

Z transformace – definiční obor

ROC – Region Of Convergence

– vyšetřuje se poloměr konvergence mocninných řad v $X(z)$.

$$\text{ROC} = \left\{ z = re^{j\omega} \quad \text{kde} \quad \sum_{n=-\infty}^{\infty} |x[n]r^{-n}| < \infty \right\}$$

ROC zahrnuje všechna komplexní čísla, pro něž je řada absolutně sumovatelná.

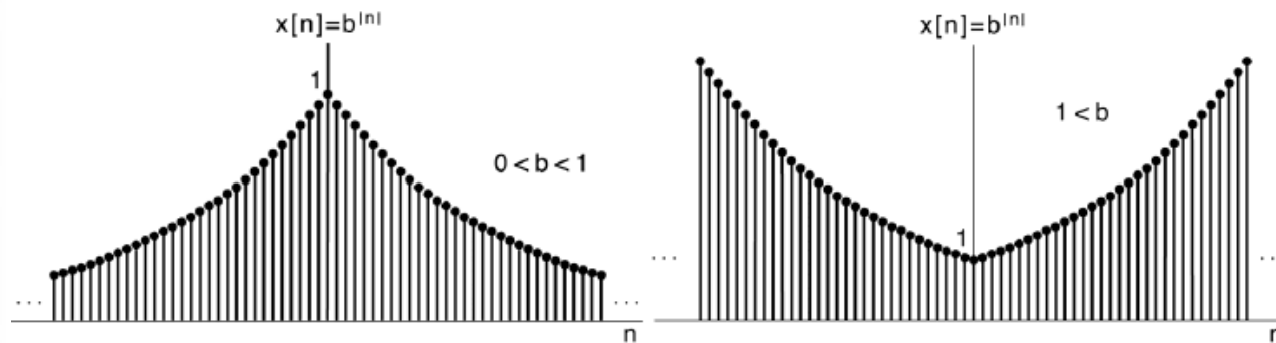
Z transformace – definiční obor

ROC – Region Of Convergence

– vyšetřuje se poloměr konvergence mocninných řad v $X(z)$.

Příklad:

$$x[n] = b^{|n|}, \quad b > 0$$



$$x[n] = b^n u[n] + b^{-n} u[-n - 1]$$

$$b^n u[n] \longleftrightarrow \frac{1}{1 - bz^{-1}}, \quad |z| > b$$

$$b^{-n} u[-n - 1] \longleftrightarrow \frac{-1}{1 - b^{-1}z^{-1}}, \quad |z| < \frac{1}{b}$$

Z transformace – definiční obor

ROC – Region Of Convergence

– vyšetřuje se poloměr konvergence mocninných řad v $X(z)$.

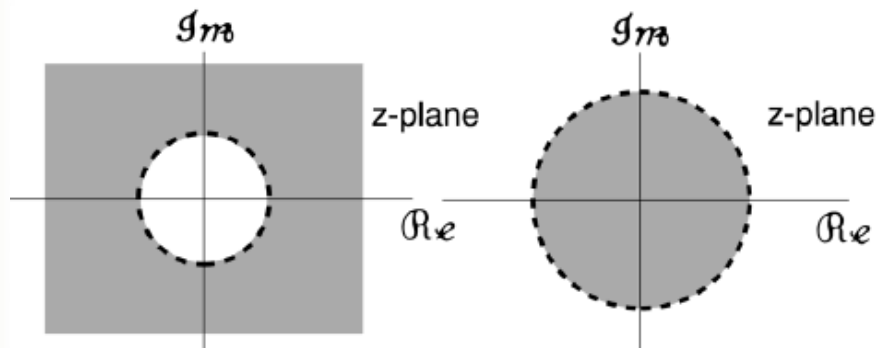
Příklad:

$$x[n] = b^{|n|}, \quad b > 0$$

$$x[n] = b^n u[n] + b^{-n} u[-n - 1]$$

$$b^n u[n] \longleftrightarrow \frac{1}{1 - bz^{-1}}, \quad |z| > b$$

$$b^{-n} u[-n - 1] \longleftrightarrow \frac{-1}{1 - b^{-1}z^{-1}}, \quad |z| < \frac{1}{b}$$



right-sided

left-sided

Z transformace – definiční obor

ROC – Region Of Convergence

– vyšetřuje se poloměr konvergence mocninných řad v $X(z)$.

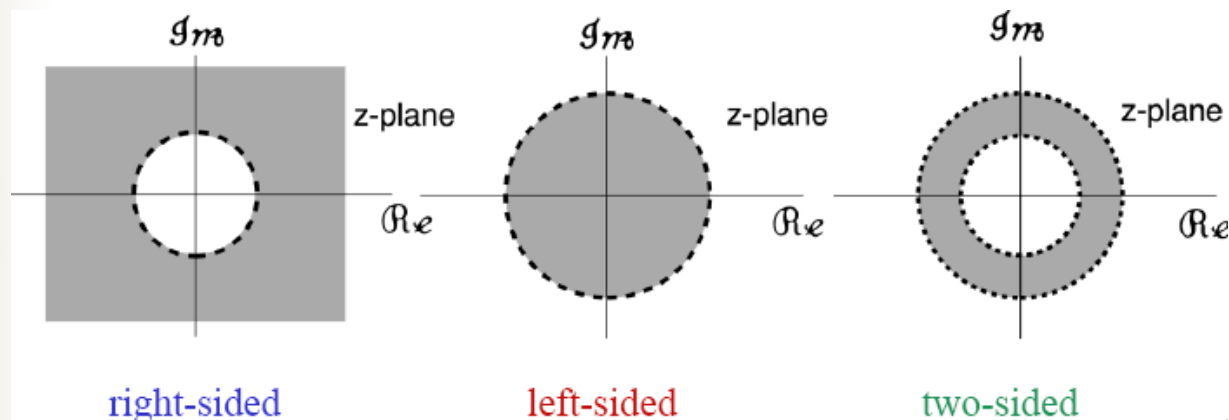
Příklad:

$$x[n] = b^{|n|}, \quad b > 0$$

$$x[n] = b^n u[n] + b^{-n} u[-n - 1]$$

$$b^n u[n] \longleftrightarrow \frac{1}{1 - bz^{-1}}, \quad |z| > b$$

$$b^{-n} u[-n - 1] \longleftrightarrow \frac{-1}{1 - b^{-1}z^{-1}}, \quad |z| < \frac{1}{b}$$



Z transformace – definiční obor

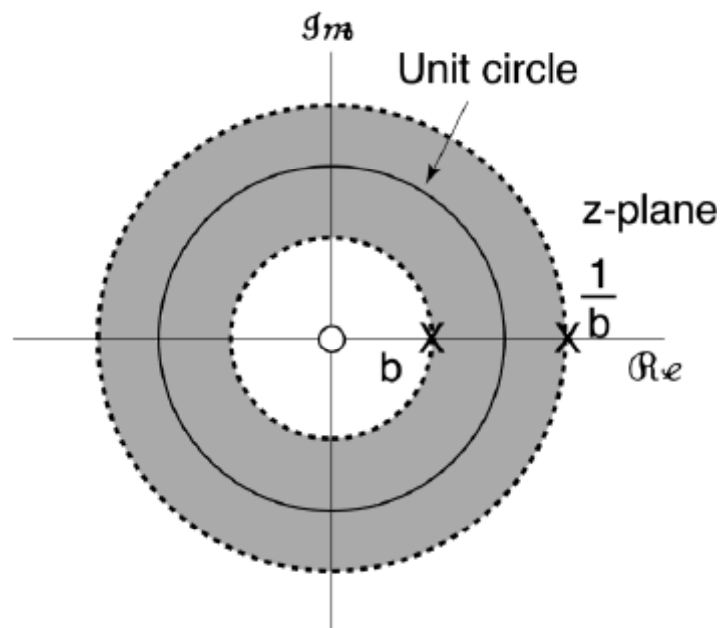
ROC – Region Of Convergence

– vyšetřuje se poloměr konvergence mocninných řad v $X(z)$.

Příklad:

$$x[n] = b^{|n|}, \quad b > 0$$

$$X(z) = \frac{1}{1 - bz^{-1}} + \frac{-1}{1 - b^{-1}z^{-1}}, \quad b < |z| < \frac{1}{b}$$



Z transformace - vlastnosti

Linearita:

$$Z(a \cdot x_n + b \cdot y_n) = a \cdot X(z) + b \cdot Y(z)$$

Posun:

$$Z(x_{n-k}) = z^{-k} \cdot X(z)$$

Útlum:

$$Z(a^{-n} \cdot x_n) = X(a^{-1} \cdot z)$$

Konvoluce:

$$Z\{y_n\} = Z\left\{\sum_{i=-\infty}^{\infty} x_i \cdot h_{n-i}\right\} = \sum_{n=-\infty}^{\infty} \left[\sum_{i=-\infty}^{\infty} x_i \cdot h_{n-i} \right] \cdot z^{-n} = \sum_{i=-\infty}^{\infty} x_i \cdot \left[\sum_{n=-\infty}^{\infty} h_{n-i} \right] \cdot z^{-n}$$

Subst: $m=n-i$

$$\sum_{i=-\infty}^{\infty} x_i \cdot \left[\sum_{m=-\infty}^{\infty} h_m \cdot z^{-m} \right] \cdot z^{-i} \Rightarrow Y(z) = X(z) \cdot H(z)$$

Z transformace - vlastnosti



$$H(z) = \frac{1}{z - a}, \quad |z| > a$$

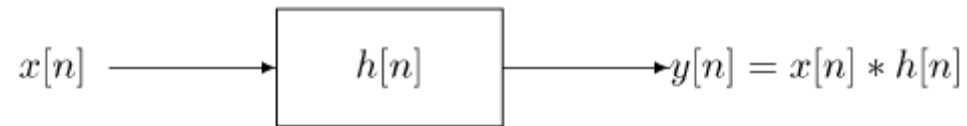
$$X(z) = z - a, \quad z \neq \infty$$

$$Y(z) = 1 \quad \text{ROC...všechna } z$$

$$H(z) = \sum_{n=-\infty}^{\infty} h[n]z^{-n}$$

PŘENOSOVÁ (SYSTÉMOVÁ) FUNKCE

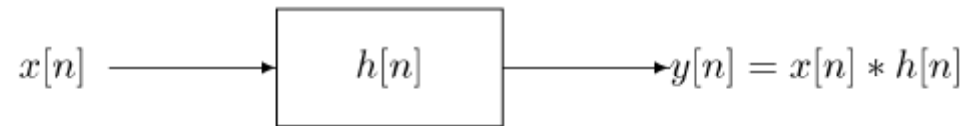
Z transformace – přenosová funkce



$$H(z) = \frac{Y(z)}{X(z)} = Z\{h_n\} = \sum_{n=0}^{\infty} h_n \cdot z^{-n}$$

pro $z = e^{j\omega T}$ platí, že $H(z) = \dots\dots\dots?$

Z transformace – přenosová funkce



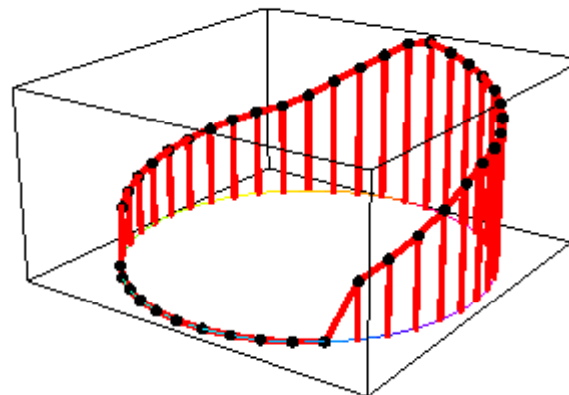
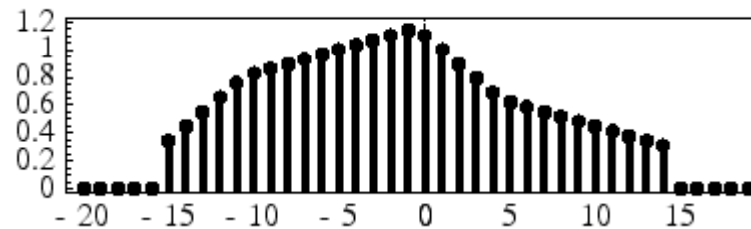
$$H(z) = \frac{Y(z)}{X(z)} = Z\{h_n\} = \sum_{n=0}^{\infty} h_n \cdot z^{-n}$$

pro $z = e^{j\omega T}$ platí, že $H(z) = H(j\omega)$

Přenosová (systémová) funkce vyjadřuje na jednotkové kružnici $|z|=1$ kmitočtovou charakteristiku diskrétní soustavy.
Viz popis vztahu Z transformace a Fourierovy transformace.

Z transformace – přenosová funkce

Přenosová (systémová) funkce vyjadřuje na jednotkové kružnici $|z|=1$ kmitočtovou charakteristiku diskrétní soustavy. Viz popis vztahu Z transformace a Fourierovy transformace.



Z transformace – přenosová funkce

$H(z)$ vyjádřená pomocí racionálně lomené funkce:

$$H(z) = \frac{Y(z)}{X(z)} = \frac{\sum_{i=0}^M a_i \cdot z^{-i}}{\sum_{i=0}^L b_i \cdot z^{-i}} = \frac{A \cdot \prod_{i=1}^M (1 - z_i \cdot z^{-1})}{\prod_{i=1}^L (1 - p_i \cdot z^{-1})} \quad , \quad A = a_0/b_0.$$

z_i jsou?.....

p_i jsou?.....

Z transformace – přenosová funkce

$H(z)$ vyjádřená pomocí racionálně lomené funkce:

$$H(z) = \frac{Y(z)}{X(z)} = \frac{\sum_{i=0}^M a_i \cdot z^{-i}}{\sum_{i=0}^L b_i \cdot z^{-i}} = \frac{A \cdot \prod_{i=1}^M (1 - z_i \cdot z^{-1})}{\prod_{i=1}^L (1 - p_i \cdot z^{-1})}, \quad A = a_0/b_0.$$

z_i jsou **NULY** racionálně lomené funkce

p_i jsou **PÓLY** racionálně lomené funkce

$$H(j\omega) = H(e^{j\omega T}) = \dots\dots\dots? \dots\dots\dots$$

Z transformace – přenosová funkce

$H(z)$ vyjádřená pomocí racionálně lomené funkce:

$$H(z) = \frac{Y(z)}{X(z)} = \frac{\sum_{i=0}^M a_i \cdot z^{-i}}{\sum_{i=0}^L b_i \cdot z^{-i}} = \frac{A \cdot \prod_{i=1}^M (1 - z_i \cdot z^{-1})}{\prod_{i=1}^L (1 - p_i \cdot z^{-1})}, \quad A = a_0/b_0.$$

z_i jsou **NULY** racionálně lomené funkce

p_i jsou **PÓLY** racionálně lomené funkce

$$H(j\omega) = H(e^{j\omega T}) = \frac{A \cdot \prod_{i=1}^M (1 - z_i \cdot e^{-j\omega T})}{\prod_{i=1}^L (1 - p_i \cdot e^{-j\omega T})} = \dots\dots\dots? \dots\dots\dots$$

Z transformace – přenosová funkce

$H(z)$ vyjádřená pomocí racionálně lomené funkce:

$$H(z) = \frac{Y(z)}{X(z)} = \frac{\sum_{i=0}^M a_i \cdot z^{-i}}{\sum_{i=0}^L b_i \cdot z^{-i}} = \frac{A \cdot \prod_{i=1}^M (1 - z_i \cdot z^{-1})}{\prod_{i=1}^L (1 - p_i \cdot z^{-1})}, \quad A = a_0/b_0.$$

z_i jsou **NULY** racionálně lomené funkce

p_i jsou **PÓLY** racionálně lomené funkce

$$H(j\omega) = H(e^{j\omega T}) = \frac{A \cdot \prod_{i=1}^M (1 - z_i \cdot e^{-j\omega T})}{\prod_{i=1}^L (1 - p_i \cdot e^{-j\omega T})} = A \cdot e^{j\omega(L-M)T} \cdot \frac{\prod_{i=1}^M (e^{j\omega T} - z_i)}{\prod_{i=1}^L (e^{j\omega T} - p_i)}$$

Z transformace – přenosová funkce


$$H(j\omega) = H(e^{j\omega T}) = \frac{A \cdot \prod_{i=1}^M (1 - z_i \cdot e^{-j\omega T})}{\prod_{i=1}^L (1 - p_i \cdot e^{-j\omega T})} = A \cdot e^{j\omega(L-M)T} \cdot \frac{\prod_{i=1}^M (e^{j\omega T} - z_i)}{\prod_{i=1}^L (e^{j\omega T} - p_i)}$$

$$|H(j\omega)| = |A| \cdot \frac{\prod_{i=1}^M |e^{j\omega T} - z_i|}{\prod_{i=1}^L |e^{j\omega T} - p_i|} = |A| \cdot \frac{n_1 \cdot n_2 \cdot \dots \cdot n_M}{r_1 \cdot r_2 \cdot \dots \cdot r_L}$$

?

Z transformace – přenosová funkce

$$H(j\omega) = H(e^{j\omega T}) = \frac{A \cdot \prod_{i=1}^M (1 - z_i \cdot e^{-j\omega T})}{\prod_{i=1}^L (1 - p_i \cdot e^{-j\omega T})} = A \cdot e^{j\omega(L-M)T} \cdot \frac{\prod_{i=1}^M (e^{j\omega T} - z_i)}{\prod_{i=1}^L (e^{j\omega T} - p_i)}$$

$$|H(j\omega)| = |A| \cdot \frac{\prod_{i=1}^M |e^{j\omega T} - z_i|}{\prod_{i=1}^L |e^{j\omega T} - p_i|} = |A| \cdot \frac{n_1 \cdot n_2 \cdot \dots \cdot n_M}{r_1 \cdot r_2 \cdot \dots \cdot r_L}$$


n – vzdálenosti mezi bodem ωT na jednotkové kružnici a NULAMI přenosové funkce.

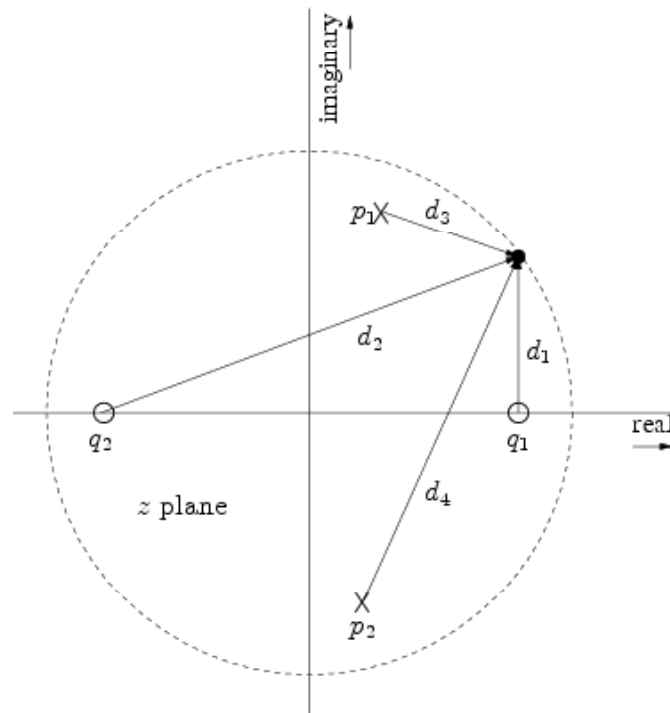
r – vzdálenosti mezi bodem ωT na kružnici a PÓLY přenosové funkce.

$|A|$ – zesílení systému

Z transformace – přenosová funkce

n – vzdálenosti mezi bodem ωT na jednotkové kružnici a NULAMI přenosové funkce.
 r – vzdálenosti mezi bodem ωT na kružnici a PÓLY přenosové funkce.

$$|H(j\omega)| = |A| \cdot \frac{\prod_{i=1}^M |e^{j\omega T} - z_i|}{\prod_{i=1}^L |e^{j\omega T} - p_i|} = \frac{n_1 \cdot n_2 \cdot \dots \cdot n_M}{r_1 \cdot r_2 \cdot \dots \cdot r_L} \cdot |A|$$



Z transformace – přenosová funkce

$$H(j\omega) = H(e^{j\omega T}) = \frac{A \cdot \prod_{i=1}^M (1 - z_i \cdot e^{-j\omega T})}{\prod_{i=1}^L (1 - p_i \cdot e^{-j\omega T})} = A \cdot e^{j\omega(L-M)T} \cdot \frac{\prod_{i=1}^M (e^{j\omega T} - z_i)}{\prod_{i=1}^L (e^{j\omega T} - p_i)}$$

$$\arg H(j\omega) = \sum_{i=1}^M \arg(e^{j\omega T} - z_i) - \sum_{i=1}^L \arg(e^{j\omega T} - p_i) + \arg A + (L - M) \cdot \omega \cdot T$$

Stabilita diskrétního systému

Stabilita =?.....

Stabilita diskretního systému

Stabilita = tendence systému reagovat přiměřeně na trvající podnět a po jeho zániku se vracet do výchozího stavu.

BIBO: bounded input -> bounded output

Kritérium v časové oblasti:

$$\sum_{n=-\infty}^{\infty} |h[n]| < \infty$$

Kritérium v obrazové oblasti:

Lineární diskretní systém (jehož obrazový přenos je racionální lomená funkce) je stabilní tehdy a jen tehdy, když všechny póly p_i jeho obrazového přenosu leží uvnitř jednotkové kružnice, $p_i < 1, \forall i$.

Zpětná Z transformace

$$x_n = \frac{1}{2\pi j} \oint_c X(z) \cdot z^{n-1} dz$$

- jen pro doplnění, bez odvození.

Z-transformace – příklady využití

- z-Transform method for deconvolution as applied to the renogram.
- Application of the chirp z-transform to MRI data.
- Use of the z-transform to investigate nanopulse penetration of biological matter.
- Image reconstruction from zeros of the z-transform.
- Modelling of anaerobic digestion in a fluidised bed with a view to control.

Neplést si
z-transform
s
z-score transform !

5. cvičení

1. Impulsní charakteristika diskrétního systému má tvar: $h[n]=0.5^n u[n]$.
Určete přenosovou funkci systému a ověřte, zda je systém stabilní.
2. Impulsní charakteristika diskrétního systému má tvar: $h[n]=1.5^n u[n]$.
Určete přenosovou funkci systému a ověřte, zda je systém stabilní.
3. Je dán systém s přenosovou funkcí $H(z) = K \frac{z+1}{z} = K(1+z^{-1})$

Nakreslete rozložení nulových bodů a pólů.

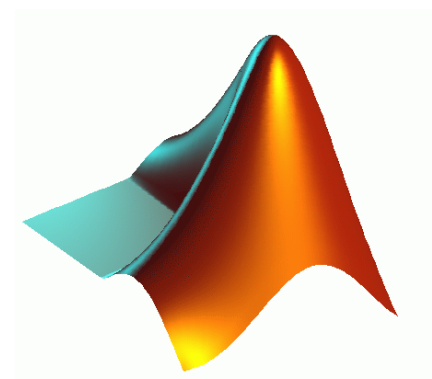
Odhadněte amplitudovou frekvenční charakteristiku.

Zjistěte diferenční rovnici systému.

Zjistěte impulsní charakteristiku systému.

Na závěr vše ověřte v MATLABu (fvtool, freqz).

O jaký filtr jde (HP, DP, PP) ?



5. cvičení

Geometrická řada

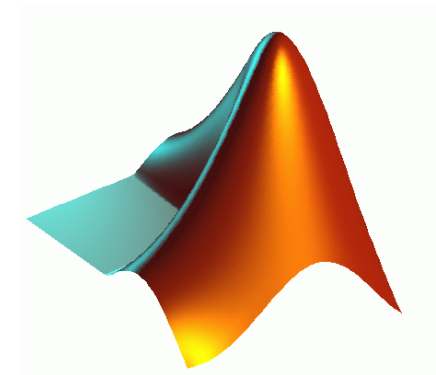
Součet členů geometrické posloupnosti je označován jako **geometrická řada**.

Součet geometrické řady je dán jako **limita** posloupnosti **n-tých částečných součtů**. Platí tedy

$$\lim_{n \rightarrow \infty} s_n = \lim_{n \rightarrow \infty} \frac{a_1}{1 - q} + \lim_{n \rightarrow \infty} \frac{a_1 \cdot q^n}{q - 1} \rightarrow \lim_{n \rightarrow \infty} s_n = \begin{cases} \frac{a_1}{1 - q} & \text{pro } |q| < 1 \\ +\infty, & \text{pro } |q| \geq 1 \end{cases}$$

Geometrická řada tedy **konverguje** pouze tehdy, je-li **absolutní hodnota** kvocientu q menší než 1.

$$X(z) = \sum_{n=0}^{\infty} c^n z^{-n} = \frac{1}{1 - cz^{-1}}$$



5. cvičení

1), 2)

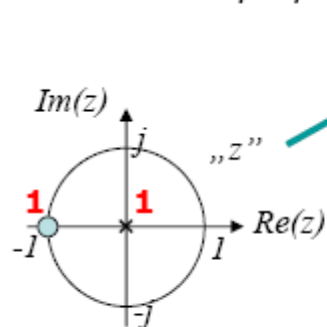
Pro exp. signál je Z transf. definována:

$$X(z) = \sum_{n=0}^{\infty} c^n z^{-n} = \frac{1}{1 - cz^{-1}}$$

$$X(z) = \frac{1}{1 - 0.5z^{-1}}$$

Jediný pól < 1 , tedy stabilní.
Pól nemá imaginární část.

5. cvičení



$$H(z) = K \frac{z+1}{z} = K(1+z^{-1})$$

Přenos na nulovém kmitočtu $H(e^{j0}) = K(1+e^{-j0}) = 2K$

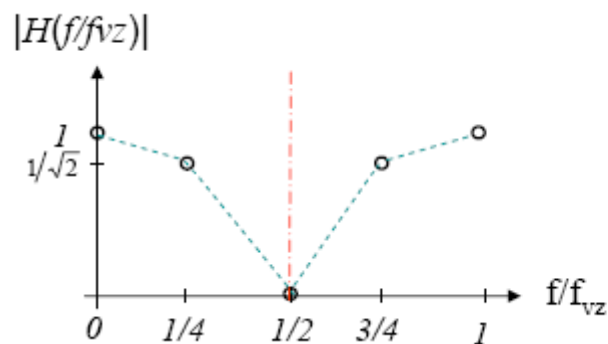
Chceme-li $H(e^{j0}) = 1 \Rightarrow K = 0,5$

$$0,5(1+z^{-1}) = \frac{Y(z)}{X(z)} \Rightarrow Y(z) = 0,5X(z) + 0,5z^{-1}X(z)$$



$$y(n) = 0,5x(n) + 0,5x(n-1)$$

Odhad frekvenční charakteristiky



Impulsní charakteristika

$$h(n) = \{0,5; 0,5\} = \{h(0); h(1)\}$$