

第二节离散信号的频域分析

项基

Department of System Science and Engineering
College of Electrical Engineering, Zhejiang University
<http://person.zju.edu.cn/jxiang>
Email: jxiang@zju.edu.cn

April 30, 2019

目录

1 非周期信号的频域分析

- 从 DFS 到 DTFT
- DTFT 的性质

2 离散傅里叶变换 (DFT)

- DFT 的物理意义
- 主值序列
- DFT 的性质

非周期信号的频域分析

- 非周期序列可以看做周期无穷大的周期序列。
- 对长度有限的非周期序列，类似连续信号，以 N 为周期，将 $x(n)$ 延拓为周期信号 $x_N(n)$ 。

$$x_N(n) = \sum_{m=-\infty}^{\infty} x(n - mN)$$

当 $N \rightarrow \infty$ 时， $x_N(n) = x(n)$ 。

- 周期为无穷大时的 DFS \implies 离散时间傅里叶变换 (Discrete Time Fourier Transformation, DTFT)

回顾周期序列的 DFS 为

$$x(n) = \sum_{k=0}^{N-1} X(k\Omega_0)e^{jk\Omega_0 n}, \quad X(k\Omega_0) = \frac{1}{N} \sum_{n=0}^{N-1} x(n)e^{-jk\Omega_0 n}$$

$N \rightarrow \infty$ 时, $\Omega_0 = 2\pi/N \rightarrow d\Omega, k\Omega_0 \rightarrow \Omega, \sum_{k=0}^{N-1} \rightarrow \int_0^{2\pi}$ 。

当 $N \rightarrow \infty$, $X(k\Omega_0)$ 趋向无穷小, 为避免在无穷小量上讨论频域特性, 如同连续信号一样, 考虑频谱密度

$$\begin{aligned} X(\Omega) &= \lim_{N \rightarrow \infty} NX(k\Omega_0) = \lim_{N \rightarrow \infty} \sum_{n=-N/2}^{N/2} x(n)e^{-jk\Omega_0 n} \\ &= \sum_{n=-\infty}^{\infty} x(n)e^{-j\Omega n} \end{aligned}$$

$$x(n) = \lim_{N \rightarrow \infty} \sum_{k=0}^{N-1} X(k\Omega_0) e^{jk\Omega_0 n} = \lim_{N \rightarrow \infty} \sum_{k=0}^{N-1} \frac{1}{N} (NX(k\Omega_0)) e^{jk\Omega_0 n}$$

$$\stackrel{\frac{2\pi}{N} = d\Omega}{=} \frac{1}{2\pi} \int_0^{2\pi} X(\Omega) e^{j\Omega n} d\Omega \quad [N\Omega_0 = 2\pi]$$

DTFT

$$X(\Omega) = \sum_{n=-\infty}^{\infty} x(n) e^{-j\Omega n}$$

$$x(n) = \frac{1}{2\pi} \int_0^{2\pi} X(\Omega) e^{j\Omega n} d\Omega$$

$$x(n) \stackrel{DTFT}{\longleftrightarrow} X(\Omega)$$

DTFT 的物理意义

已知时域采样信号 $x_s(t) = x(t) \sum_{n=-\infty}^{\infty} \delta(t - nT_s)$, 利用傅立叶变换的线性性质和 $\delta(t - nT_s) \xleftrightarrow{\mathcal{F}} e^{-j\omega nT_s}$, 可得

$$X_s(\omega) = \sum_{n=-\infty}^{\infty} x(nT_s) e^{-j\omega nT_s}$$

让 $\Omega = \omega T_s$, n 代替 nT_s , 即有

$$X(\Omega) = \sum_{n=-\infty}^{\infty} x(n) e^{-j\Omega n}$$

序列的离散时间傅立叶变换即是采样信号的连续傅立叶变换

$X(\Omega)$ 是周期为 2π 的连续时间周期信号

DTFT 的性质

表 3-1 DTFT 的性质

性 质	序 列	离散时间傅里叶变换(DTFT)
定义	$x(n) = \frac{1}{2\pi} \int_0^{2\pi} X(\Omega) e^{j\Omega n} d\Omega$	$X(\Omega) = \sum_{n=-\infty}^{\infty} x(n) e^{-j\Omega n}$
线性	$ax(n) + by(n)$	$aX(\Omega) + bY(\Omega)$
时域平移	$x(n - n_0)$	$e^{-j\Omega n_0} X(\Omega)$
频域平移	$e^{j\Omega_0 n} x(n)$	$X(\Omega - \Omega_0)$
时间翻转	$x(-n)$	$X(-\Omega)$
共轭对称	$x^*(n)$	$X^*(-\Omega)$

时域卷积(卷积和)	$x(n) * y(n)$	$X(\Omega)Y(\Omega)$
频域卷积	$x(n)y(n)$	$\frac{1}{2\pi} \int_{-\pi}^{\pi} X(\lambda)Y(\Omega - \lambda)d\lambda$
调制	$x(n)\cos\Omega_0 n$	$\frac{1}{2}[X(\Omega + \Omega_0) + X(\Omega - \Omega_0)]$
频域微分	$nx(n)$	$j \frac{dX(\Omega)}{d\Omega}$
帕斯瓦尔公式	$\sum_{n=-\infty}^{\infty} x(n) ^2 = \frac{1}{2\pi} \int_{-\pi}^{\pi} X(\Omega) ^2 d\Omega$	

时域卷积(卷积和)	$x(n) * y(n)$	$X(\Omega)Y(\Omega)$
频域卷积	$x(n)y(n)$	$\frac{1}{2\pi} \int_{-\pi}^{\pi} X(\lambda)Y(\Omega - \lambda)d\lambda$
调制	$x(n)\cos\Omega_0 n$	$\frac{1}{2}[X(\Omega + \Omega_0) + X(\Omega - \Omega_0)]$
频域微分	$nx(n)$	$j \frac{dX(\Omega)}{d\Omega}$
帕斯瓦尔公式	$\sum_{n=-\infty}^{\infty} x(n) ^2 = \frac{1}{2\pi} \int_{-\pi}^{\pi} X(\Omega) ^2 d\Omega$	

与傅里叶变换不同

没有对偶性，多了频域微分，频域卷积是周期卷积

思考

DTFT 的对偶性存在吗？即 $X(n) \xleftrightarrow{DTFT} 2\pi x(-\Omega)$?

$X(\Omega)$ 连续周期信号, 其周期为 $T = 2\pi$, 基波频率 $\omega_0 = 2\pi/T = 1$. 用 t 代替 Ω , 则有

$$X(\Omega) = \sum_{m=-\infty}^{\infty} x(m)e^{-j\Omega m} \xrightarrow{\Omega \mapsto t} X(t) = \sum_{m=-\infty}^{\infty} x(m)e^{-jmt}$$

定义 $X(t)$ 的连续时间傅立叶级数系数为 $\bar{X}(n\omega_0)$,

$$\begin{aligned} \bar{X}(n\omega_0) &= \frac{1}{T} \int_T X(t)e^{-jn\omega_0 t} dt \stackrel{\omega_0=1}{=} \frac{1}{T} \int_T \sum_{m=-\infty}^{\infty} x(m)e^{-jmt} e^{-jnt} dt \\ &= \sum_{m=-\infty}^{\infty} x(m) \frac{1}{T} \int_T e^{-j(m+n)t} dt = x(-n) \end{aligned}$$

$$x(n) \xleftrightarrow{DTFT} X(\Omega), \quad X(t) \xleftrightarrow{CFS} x(-n)$$

表 3-2 一些常见离散序列的 DTFT

序列	离散时间傅里叶变换(DTFT)
$\delta(n)$	1
$\delta(n-n_0)$	$e^{-j\Omega n_0}$
1	$2\pi\delta(\Omega)$
$e^{j\Omega_0 n}$	$2\pi\delta(\Omega-\Omega_0)$
$a^n u(n), a < 1$	$\frac{1}{1-ae^{-j\Omega}}$
$-a^n u(-n-1), a > 1$	$\frac{1}{1-ae^{-j\Omega}}$
$(n+1)a^n u(n), a < 1$	$\frac{1}{(1-ae^{-j\Omega})^2}$
$\cos \Omega_0 n$	$\pi\delta(\Omega+\Omega_0) + \pi\delta(\Omega-\Omega_0)$

$$a^{(n-n_0)} u(n-n_0) \xleftrightarrow{DTFT} \frac{e^{-j\Omega n_0}}{1-ae^{-j\Omega}}$$

Example

设 $y(n)$ 满足零初始条件, 且 $x(n) = \delta(n)$, 求解如下线性差分方程

$$y(n] - 0.25y(n - 1) = x(n) - x(n - 2)$$

解: 对上式进行 DTFT 运算有

$$Y(\Omega) - 0.25e^{-j\Omega}Y(\Omega) = X(\Omega) - e^{-2j\Omega}X(\Omega)$$

又 $X(\Omega) = 1$, 所以

$$Y(\Omega) = \frac{1 - e^{-2j\Omega}}{1 - 0.25e^{-j\Omega}} = \frac{1}{1 - 0.25e^{-j\Omega}} - \frac{e^{-2j\Omega}}{1 - 0.25e^{-j\Omega}}$$

利用

$$z(n) = (0.25)^n u(n) \overset{DTFT}{\longleftrightarrow} \frac{1}{1 - 0.25e^{-j\Omega}}$$

和时域平移性质，得

$$y(n) = z(n) - z(n - 2) = (0.25)^n u(n) - (0.25)^{n-2} u(n - 2)$$

DTFT 性质的应用

Example

已知 $x(n)$ 是实序列，且其离散时间傅里叶变换可表示为 $X(\Omega) = X_R(\Omega) + jX_I(\Omega)$ ，试求 $X_R(\Omega)$ 的反 DTFT 变换

解：由共轭对称特性， $X(\Omega) = X^*(-\Omega) = X_R(-\Omega) - jX_I(-\Omega)$

所以 $X_R(-\Omega) = X_R(\Omega)$ ， $X_I(-\Omega) = -X_I(\Omega)$

由翻转特性 $x(-n) \xrightarrow{DTFT} X(-\Omega) = X_R(-\Omega) + jX_I(-\Omega)$

由线性特性可得 $x(n) + x(-n) \xrightarrow{DTFT} 2X_R(\Omega)$

故所求 $X_R(\Omega)$ 的反 DTFT 变换对应的序列为 $[x(n) + x(-n)]/2$

离散傅里叶变换 (DFT)

离散信号的傅立叶变换 DTFT，它是 Ω 的连续周期函数，尽管在理论上有重要意义，但在实际中往往难于计算。为此我们需要一种时域和频域都离散的傅里叶变换对，这就是离散傅里叶变换 (Discrete Fourier Transformation)，简称 **DFT**

回顾 DTFT, 频谱

$$X(\Omega) = \sum_{n=-\infty}^{\infty} x(n)e^{-j\Omega n}$$

以 2π 为周期。设离散化后的频谱为一周期内 N 个点, 即 $[0, 2\pi)$ 内 N 个点, 间隔频率为 $\Omega_0 = \frac{2\pi}{N}$, 每个采样点的的频谱用 $X(k)$ 来表示, 则

$$\begin{aligned} X(k) &= X(\Omega)|_{\Omega=k\Omega_0} = \sum_{n=-\infty}^{\infty} x(n)e^{-jk\Omega_0 n} \\ &= \sum_{n=-\infty}^{\infty} x(n)e^{-jk\frac{2\pi}{N}n} \quad \left(e^{-jk\frac{2\pi}{N}n} = e^{-jk\frac{2\pi}{N}(n+rN)} \right) \\ &= \sum_{n=1}^{N-1} \left(\sum_{r=-\infty}^{\infty} x(n+rN) \right) e^{-jk\frac{2\pi}{N}n} = \sum_{n=1}^{N-1} x_p(n)e^{-jk\frac{2\pi}{N}n} \end{aligned}$$

对频谱离散化，得到了变换

$$X(k) = \sum_{n=0}^{N-1} x_p(n) e^{-jk\Omega_0 n}$$

那么反变换呢？如何得到 $x_p(n)$ 从 $X(k)$ ？

注意到 $x_p(n)$ 是个周期序列，回顾 DFS

$$X_p(k\Omega_0) = \frac{1}{N} \sum_{n=0}^{N-1} x_p(n) e^{-jk\Omega_0 n}, \quad x_p(n) = \sum_{k=0}^{N-1} X_p(k\Omega_0) e^{jk\Omega_0 n}$$

可见， $X(k) = N X_p(k\Omega_0)$ ，故有

$$x_p(n) = \frac{1}{N} \sum_{k=0}^{N-1} X(k) e^{jk\Omega_0 n}$$

对于周期为 N 的序列 $x(n)$ ，定义其从 $n = 0$ 到 $N - 1$ 范围为**主值区间**，在主值区间的序列为**主值序列**。

对 $X(k)$ 和 $X_p(N)$ 都取主值序列，并用 $x(n)$ 表示时域序列，则得**DFT**变换对。

DFT

$$X(k) = \sum_{n=0}^{N-1} x(n)e^{-jk\Omega_0 n}$$
$$x(n) = \frac{1}{N} \sum_{k=0}^{N-1} X(k)e^{jk\Omega_0 n}$$

$$x(n) \stackrel{DFT}{\longleftrightarrow} X(k)$$

- DFS

$$X(k\Omega_0) = \frac{1}{N} \sum_{n=0}^{N-1} x(n)e^{-jk\Omega_0 n}, \quad x(n) = \sum_{k=0}^{N-1} X(k\Omega_0)e^{jk\Omega_0 n}$$

- DTFT

$$X(\Omega) = \lim_{N \rightarrow \infty} NX(k\Omega_0) = \sum_{n=-\infty}^{\infty} x(n)e^{-j\Omega n}$$

$$x(n) = \lim_{N \rightarrow \infty} \frac{1}{N} \sum_{k=0}^{N-1} NX(k\Omega_0)e^{jk\Omega_0 n} = \frac{1}{2\pi} \int_0^{2\pi} X(\Omega)e^{j\Omega n} d\Omega$$

- DFT

$$X(k) = NX(k\Omega_0) = \sum_{n=0}^{N-1} x(n)e^{-jk\Omega_0 n}$$

$$x(n) = \frac{1}{N} \sum_{k=0}^{N-1} NX(k\Omega_0)e^{jk\Omega_0 n} = \frac{1}{N} \sum_{k=0}^{N-1} X(k)e^{jk\Omega_0 n}$$

DFT 的物理意义

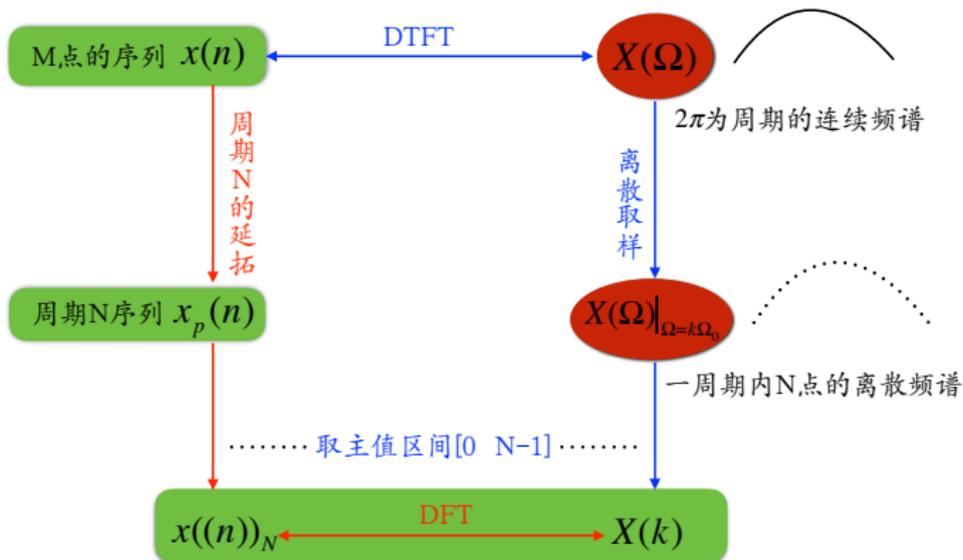
$$X(k) = X(\Omega)|_{\Omega=k\Omega_0} = X\left(k\frac{2\pi}{N}\right) = \sum_{n=-\infty}^{\infty} x(n)e^{-j\left(k\frac{2\pi}{N}\right)n}$$

- 是连续的离散时间傅立叶变换频谱以 Ω_0 为间隔的取样。
- Ω_0 是任意整除 2π 的值, 设为 $\Omega_0 = \frac{2\pi}{N}$, 这里 N 决定了 DFT 的频域主值序列的长度, 即也决定了时域主值序列的长度。
- N 也决定了 $X(k)$ 的物理意义: $T_s X(k)$ 为连续时间信号在频率 $\omega = \frac{2\pi}{NT_s}$ 的 k 倍处的频谱, 但是 $k > \frac{N}{2}$ 时, 对应不是 k 次频谱, 而是 $k - N$ 次的频谱, 即负频率段的频谱,

$$\begin{cases} T_s X(k) = X_c\left(k\frac{2\pi}{NT_s}\right) & 0 \leq k \leq \frac{N}{2} \\ T_s X(k) = X_c\left((k-N)\frac{2\pi}{NT_s}\right) & \frac{N}{2} < k \leq N-1 \end{cases}$$

主值序列

对一个 M 点的序列 $x(n)$ ，要获得它 N 点的离散频谱，可以有两路线，蓝色的 DTFT 和红色的 DFT。



$x((n))_N$ 表示对序列 $x(n)$ 做周期 N 的延拓，并取主值区间，即为主值序列。

- 如果 $M = N$, 显然 $x((n))_N = x(n)$, 直接对序列做 DFT 即可。
- 如果 $M \neq N$, 即序列点数与 DFT 点数不一致时,
 - 当 $M < N$ 时, 在 $M - 1$ 点后补零, 以满足 DFT 的要求。
 - 当 $M > N$ 时, 即采样点数大于 DFT 的点数, 周期延拓出现叠加现象。

设 $N < M < 2N$ 时, 由 $X(\Omega) = \sum_{n=0}^M x(n)e^{-j\Omega n}$, 可知

$$\begin{aligned}
 X(k) &= \sum_{n=0}^{M-1} x(n)e^{-j(k\frac{2\pi}{N})n} = \sum_{n=0}^{N-1} x(n)e^{-j(k\frac{2\pi}{N})n} + \sum_{n=N}^{M-1} x(n)e^{-j(k\frac{2\pi}{N})n} \\
 &= \sum_{n=0}^{N-1} x(n)e^{-j(k\frac{2\pi}{N})n} + \sum_{n=0}^{M-1-N} x(N+n)e^{-j(k\frac{2\pi}{N})(N+n)} \\
 &= \sum_{n=0}^{M-1-N} (x(n) + x(n+N))e^{-j(k\frac{2\pi}{N})n} + \sum_{n=M-N}^{N-1} x(n)e^{-j(k\frac{2\pi}{N})n}
 \end{aligned}$$

计算 $x((n))_N$,

- ① 纵列 $\dots, x(n+N), x(n), x(n-N), \dots$
- ② 划定主值区间, 依据下标确定的 0 时刻
- ③ 在主值区间内, 纵向累加求和, 得 $x((n))_N$.

考虑对序列 $x(n) = \{0, 1, 2, 3\}$, 进行周期 $N = 3$ 的延拓, 如下图所示

$$\begin{array}{cccc|ccc|cccc}
 x(n+N) & 0 & 0 & 1 & 2 & 3 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 \\
 x(n) & & & & & \underline{0} & 1 & 2 & 3 & 0 & 0 & 0 \\
 x(n-N) & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 1 & 2 & 3
 \end{array}$$

将所有的行加在一起, 并取两条红线之间的主值区间, 可得

$$x((n))_N = x_p(n)R_3(n) = \{3, 1, 2\}$$

类似, 可推知 $x((n))_2 = \{2, 4\}$

$$x(n) \begin{array}{cccc|cc|cccc} 0 & 0 & 1 & 2 & 3 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & \underline{0} & 1 & 2 & 3 & 0 & 0 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 1 & 2 & 3 & 0 & 0 \end{array}$$

这即对应了上述当序列长度 $M = 4$ 大于所求 DFT 长度 $N = 2$ 的情形

$$\begin{aligned} X(k) &= \sum_{n=0}^{M-1-2} (x(n) + x(n+N))e^{-j(k\frac{2\pi}{N})n} + \sum_{n=M-N}^{N-1} x(n)e^{-j(k\frac{2\pi}{N})n} \\ &= \sum_{n=0}^1 (x(n) + x(n+2))e^{-jk\pi n} + \sum_{n=2}^1 () \\ &= (x(0) + x(2)) + ((x(1) + x(3))e^{-jk\pi} \end{aligned}$$

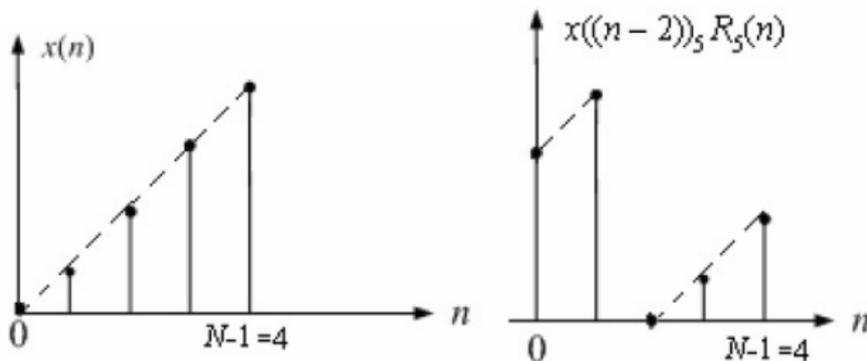
同样可得 $x(n) = \{0, 1, 2, 3\}$ 的滞后序列 $x(n-2)$ 进行周期 3 延拓后的主值序列为:

$$x((n-2))_3 = \{1, 2, 3\}$$

$x(n-2+2N)$	0	0	1	2	3	0	0	0	0	0	0
$x(n-2+N)$	0	0	0	0	0	<u>1</u>	2	3	0	0	0
$x(n-2)$	0	0	0	0	0	<u>0</u>	0	<u>0</u>	1	2	3

DFT 的周期延拓

需将序列补零后, 按 DFT 的长度 N 进行周期延拓, 混叠相加成新序列, 然后取主值区间, 进行 DFT 计算;
相应地, IDFT 计算所得的序列应为 $x((n))_N$, 而非原序列 $x(n)$ 。



$$x((n - m))_N \xleftrightarrow{DFT} e^{-j\Omega_0 m k} X(k)$$

同样地，频域若发生了圆周位移 $X((k - k_0))_N$ ，有

$$e^{j\Omega_0 k_0 n} x(n) \xleftrightarrow{DFT} X((k - k_0))_N$$

- 圆周卷积

$$x(n) \circledast h(n) \xleftrightarrow{DFT} X(k)H(k)$$

式中 $x(n) \circledast h(n)$ 表示序列 $x(n)$ 和 $h(n)$ 的圆周卷积，定义为

$$x(n) \circledast h(n) = \sum_{m=0}^{N-1} x(m)h((n-m))_N = \sum_{m=0}^{N-1} h(m)x((n-m))_N$$

Proof.

设 $Y(k) = X(k)H(k)$, 则 $Y(k)$ 的 DFT 反变换为

$$\begin{aligned}
 y(n) &= \frac{1}{N} \sum_{k=0}^{N-1} Y(k) e^{jk\Omega_0 n} = \frac{1}{N} \sum_{k=0}^{N-1} X(k) H(k) e^{jk\Omega_0 n} \\
 &= \frac{1}{N} \sum_{k=0}^{N-1} \left[\sum_{m=0}^{N-1} x(m) e^{-jk\Omega_0 m} \right] H(k) e^{jk\Omega_0 n} \\
 &= \sum_{m=0}^{N-1} x(m) \frac{1}{N} \left[\sum_{k=0}^{N-1} H(k) e^{-jk\Omega_0 m} e^{jk\Omega_0 n} \right] \\
 &= \sum_{m=0}^{N-1} x(m) h((n-m))_N
 \end{aligned}$$



Example

已知 $x(n) = [2, 1, 2, 1]$, $h(n) = [1, 2, 3, 4]$, 计算两个序列的圆周卷积
 $y(n) = x(n) \circledast h(n)$

解: 由 DFT 变换有

$$X(k) = \sum_{n=0}^3 x(n)e^{-jk\Omega_0 n} = 2 + e^{-jk\frac{\pi}{2}} + 2e^{-jk\pi} + e^{-jk\frac{3\pi}{2}}$$

得

$$X(0) = 6, X(1) = 0, X(2) = 2, X(3) = 0$$

同理可得

$$H(0) = 10, H(1) = -2 + 2j, H(2) = -2, H(3) = -2 - 2j$$

则有 $Y(k) = X(k)H(k) = [60, 0, -4, 0]$, 应用 DFT 反变换, 可求得

$$y(n) = \frac{1}{4} \sum_{k=0}^3 Y(k)e^{jk\frac{2\pi}{4}n} = \frac{1}{4}(60 - 4e^{j\pi n})$$

表 3-4 DFT 的性质

性 质	序 列	离散时间傅里叶变换(DTFT)
线性	$ax(n) + by(n)$	$aX(k) + bY(k)$
周期性	$x(n) = x(n + N)$	$X(k) = X(k + N)$
时域圆周移位	$x((n - m))_N R_N(n)$	$e^{-j\Omega_0 m} X(k)$
频域圆周移位	$e^{j\Omega_0 k n} x(n)$	$X((k - k_0))_N R_N(k)$
时间翻转	$x(-n)$	$X(-\Omega)$
复共轭	$x^*(n)$	$X^*(N - k)$
时域圆周卷积	$x(n) \otimes h(n)$	$X(k)H(k)$
频域圆周卷积	$x(n)h(n)$	$\frac{1}{N} X(k) \otimes H(k)$
调 制	$x(n) \cos \Omega_0 n$	$\frac{1}{2} [X(\Omega + \Omega_0) + X(\Omega - \Omega_0)]$
圆周相关	$x(n) \otimes h^*(-n)$	$X(k)H^*(k)$
帕斯瓦尔公式	$\sum_{n=0}^{N-1} x(n) ^2$	$\frac{1}{N} \sum_{k=0}^{N-1} X(k) ^2$

作业 P187

- 9 ($Y(\Omega)$ 中的 $e^{-j2\omega}$ 应为 $e^{-j2\Omega}$, 另外, 提示虚部和实部分开讨论)
- 13
- 15
- 16
- 补充作业: 对信号 $x(t) = 2g_2(t) \cos(\pi t)$ 进行周期为 $T_s = 0.25$ 的采样,
 1. 求频率分辨率为 $\frac{\pi}{2}$ 的频谱分布 $X(k)$,
 2. 离散角频率 $(0, \pi)$ 所对应的连续时间信号的频谱段 D_ω 为多少。
 3. 计算信号 $x(t)$ 的频谱 $X(\omega)$,
 4. 画出 D_ω 区间上的来自离散傅立叶变换 $T_s X(k)$ 的频谱图和 $X(\omega)$ 的频谱图。

谢谢！