FACULTAD DE INGENIERÍA

SEÑALES Y SISTEMAS
Clase 10

Carlos H. Muravchik

13 de Abril de 2020

Habíamos visto:

- Sistemas en general
- Sistemas Lineales: linealidad, incr. lineales. Invariancia.

Y se vienen hoy:

- Sistemas Lineales.
  - Convolución discreta.
  - Convolución continua.
  - Invariancia, causalidad,
  - Estabilidad EA/SA.
  - Representacion de SLIT.

Convolución discreta 1

Ingredientes:

- Sistemas lineales discretos (manejan SVID) con operador $\mathcal{H}$ que satisface el principio de superposición. Tanto para SLID como SLVD.
- Representación de SVID en términos de impulsos

$$x[n] = \sum_{k=-\infty}^{\infty} x[n-k]\delta[k] = \sum_{k=-\infty}^{\infty} x[k]\delta[n-k]$$

- Aplicando $\mathcal{H}$, en la igualdad de la derecha se puede interpretar a $x[k]\delta[n-k]$ como una secuencia con un impulso en k de amplitud $x[k]$.

$$y[n] = \mathcal{H}\left\{ \sum_{k=-\infty}^{\infty} x[k]\delta[n-k] \right\}[n] = \sum_{k=-\infty}^{\infty} x[k]\mathcal{H}_k\{\delta[\cdot]\}[n]$$

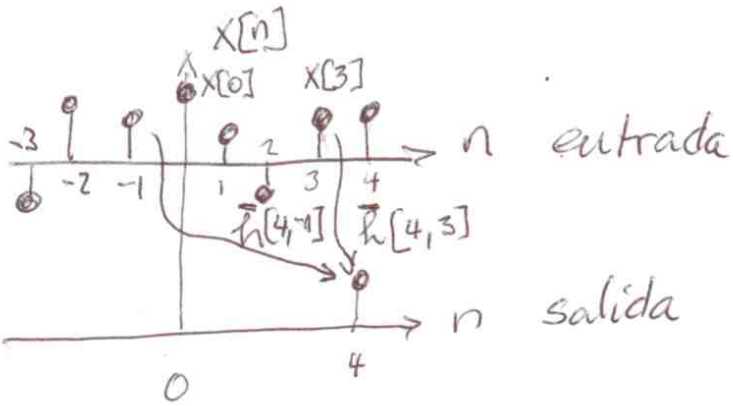
Usamos superposición en una suma de “infinitos” términos. $\mathcal{H}$ debe cumplir ciertos requisitos técnicos

Convolución discreta 2

$$y[n] = \sum_{k=-\infty}^{\infty} x[k]\mathcal{H}_k\{\delta[\cdot]\}[n] = \sum_{k=-\infty}^{\infty} x[k]\bar{h}[n,k]$$

donde $\bar{h}[n,k]$ es la respuesta impulsional:
la respuesta observada en el instante n de la salida a un impulso (de Kronecker) aplicado en el instante k.

Interpretación



Forma alternativa: $\bar{\bar{h}}[n,m]$ pero m representa cuántas unidades *antes* de n se aplicó el impulso. En el caso anterior $m = n - k$

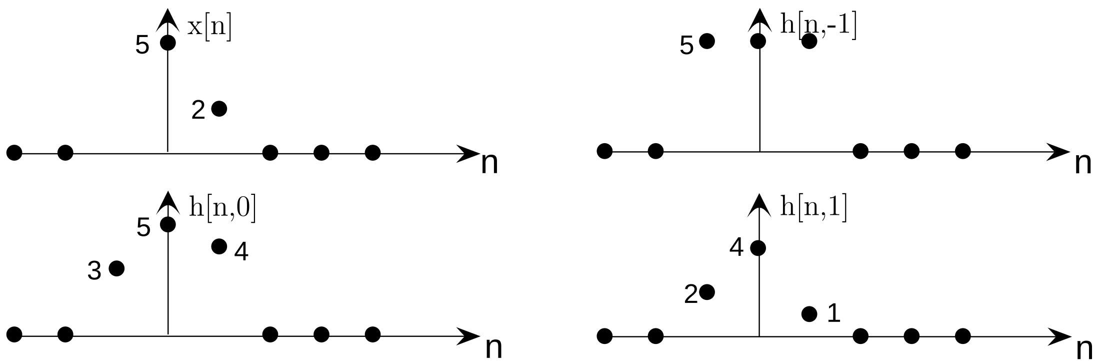
Convolución discreta SLVT

La operación convolución y la respuesta impulsional describen completamente el comportamiento de los SL

Ejemplo:

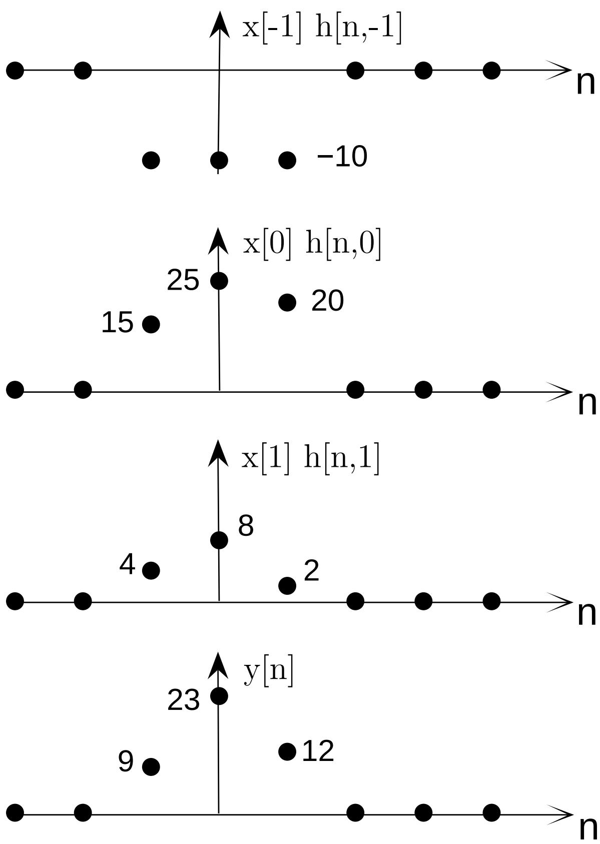
$x[n] = \sum_{k=-1}^{1} x[k]\delta[n-k]$ con $x[-1] = -2$, $x[0] = 5$, $x[1] = 2$

$$y[n] = \sum_{k=-1}^{1} x[k]\bar{h}[n,k]$$



Convolución discreta SLVT

$$y[n] = \sum_{k=-1}^{1} x[k]\bar{h}[n,k]$$



Especialización a SLID:

Operador básico para todo SL: convolución.

SLVD: Convolución discreta - recordar:

$$y[n] = \sum_{k=-\infty}^{\infty} x[k]\mathcal{H}_k\{\delta[\cdot]\}[n] =$$
$$= \sum_{k=-\infty}^{\infty} x[k]\bar{h}[n,k]$$

SLID:

$$\bar{h}[n,k] = \bar{h}[n-1,k-1] = \bar{h}[n-k,0] \triangleq h[n-k]$$

$$y[n] = \sum_{k=-\infty}^{\infty} x[k]h[n-k] = \sum_{m=-\infty}^{\infty} x[n-m]h[m]$$

Notación: SLID $\boxed{y[n] = \{x * h\}[n]}$

Convolución gráfica

Papeles deslizantes

$$y[n] = \sum_{k=-\infty}^{\infty} x[k]h[n-k]$$

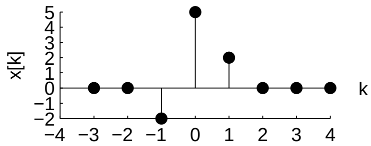
1. Dibujar $x[k]$ y dejar fija.
2. Obtener $h[\cdot]$.
3. Reflejar $h[\cdot]$.
4. Desplazar el origen de h al punto de observación n.
5. Multiplicar muestra a muestra y sumar, da $y[n]$.
6. Repetir 4) y 5) hasta tener todos los puntos deseados.

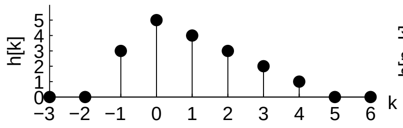
Notar: roles intercambiables de x y h

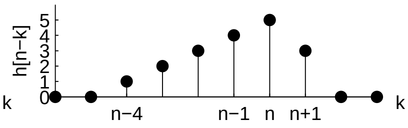
$$y[n] = \sum_{m=-\infty}^{\infty} x[n-m]h[m]$$

Convolución gráfica

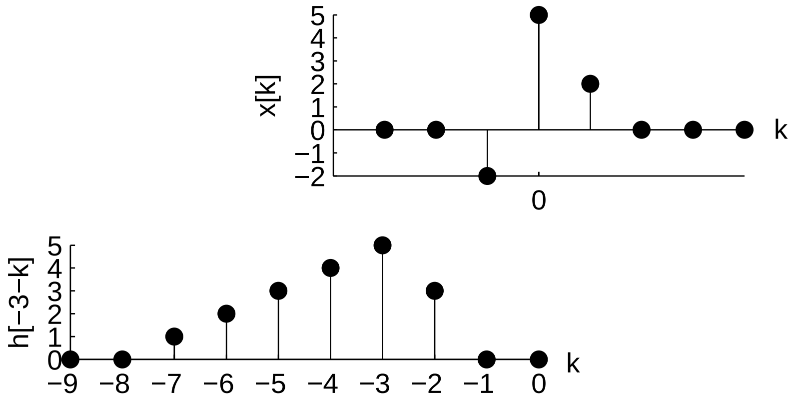
Ejemplo: x y h







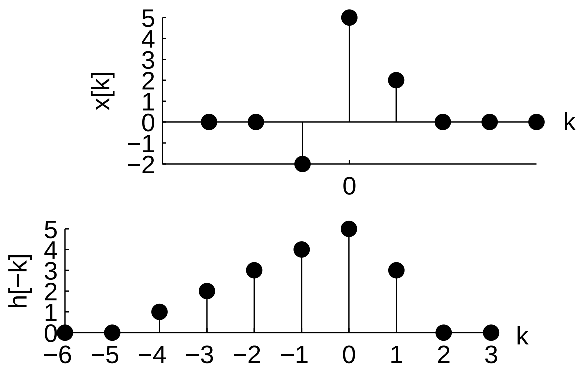
Por ejemplo, queremos $y[-3]$



➡ y[−3]=0

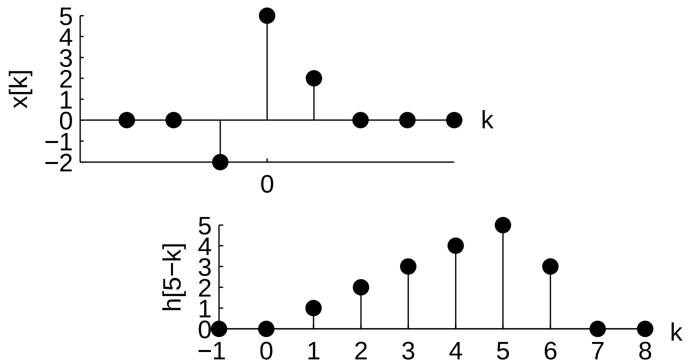
Convolución gráfica – cont.

Si queremos $y[0]$



➡ y[0]=23

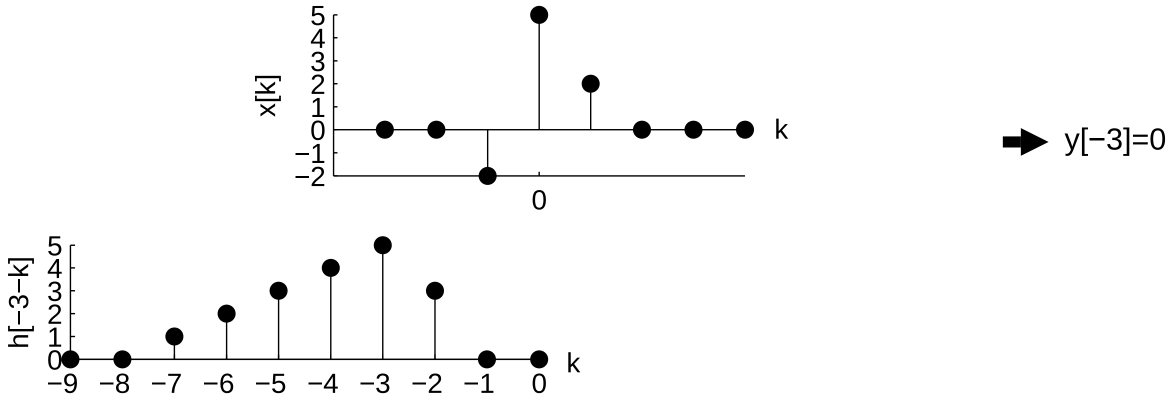
Si queremos $y[5]$



➡ y[5]=2

Duración

x y h de duración finita;



Duración de y: duración de x más duración de h menos 1.

Causalidad

Aplicando $\delta[n]$ (impulso en cero); la respuesta es $h[n] = 0;\ n < 0$. El SLID es causal $\Leftrightarrow$ respuesta impulsional *unilateral a derecha*.

$$y[n] = \sum_{m=-\infty}^{\infty} x[n-m]h[m] = \sum_{m=0}^{\infty} x[n-m]h[m]$$

$$= \sum_{m=-\infty}^{\infty} h[n-m]x[m] = \sum_{m=-\infty}^{n} h[n-m]x[m]$$

Si además, $x[n]$ fuera unilateral a derecha ($x[n] \equiv 0;\ n < 0$)

$$y[n] = \sum_{m=0}^{n} h[n-m]x[m]$$

Convolución continua

Ingredientes:

- Sistemas lineales continuos (manejan SVIC) con operador $\mathcal{H}$ que satisface el principio de superposición. Tanto para SLIT como SLVT.
- Representación de SVIC en términos de impulsos

$$x(t) = \int_{-\infty}^{\infty} x(\sigma)\delta(t-\sigma)d\sigma$$

- Aplicando $\mathcal{H}$ se puede interpretar a $x(\sigma)\delta(t-\sigma)$ como una señal con un impulso (Dirac) en σ de área $x(\sigma)$

$$y(t) = \mathcal{H}\{x(\cdot)\}(t) = \mathcal{H}\left\{\int_{-\infty}^{\infty} x(\sigma)\delta(t-\sigma)\,d\sigma\right\}(t)$$

- Más hipótesis adicionales, definiendo $\bar{h}(t,\sigma) = \mathcal{H}_\sigma\{\delta(\cdot)\}(t)$.

Convolución continua 2

Resulta la convolución para SLVT:

$$\boxed{y(t) = \{x * h\}(t) = \int_{-\infty}^{\infty} x(\sigma)\bar{h}(t,\sigma)d\sigma}$$

- Para SLIT: $\bar{h}(t,\sigma) \triangleq h(t-\sigma)$ luego

$$y(t) = \int_{-\infty}^{\infty} x(\sigma)h(t-\sigma)d\sigma = \int_{-\infty}^{\infty} h(\lambda)x(t-\lambda)d\lambda$$

- Agregando Causalidad: $h(t) \equiv 0;\ t < 0$ luego

$$y(t) = \int_{-\infty}^{t} x(\sigma)h(t-\sigma)d\sigma = \int_{0}^{\infty} h(\lambda)x(t-\lambda)d\lambda$$

- Si además la señal de entrada se aplica en cero, o sea es unilateral a derecha desde $t = 0$, $x(t) \equiv 0;\ t < 0$

$$y(t) = \int_{0}^{t} x(\sigma)h(t-\sigma)d\sigma = \int_{0}^{t} h(\lambda)x(t-\lambda)d\lambda$$

SLIT - Convolución gráfica

Papeles deslizantes

$$y(t) = \int_{-\infty}^{-\infty} x(\sigma)h(t-\sigma)d\sigma$$

1. Dibujar $x(t)$ y dejar fija.
2. Obtener $h(\cdot)$.
3. Reflejar $h(\cdot)$.
4. Desplazar el origen de h al punto de observación t.
5. Multiplicar punto a punto e integrar, da $y(t)$.
6. Repetir 4) y 5) hasta tener todos los puntos deseados.

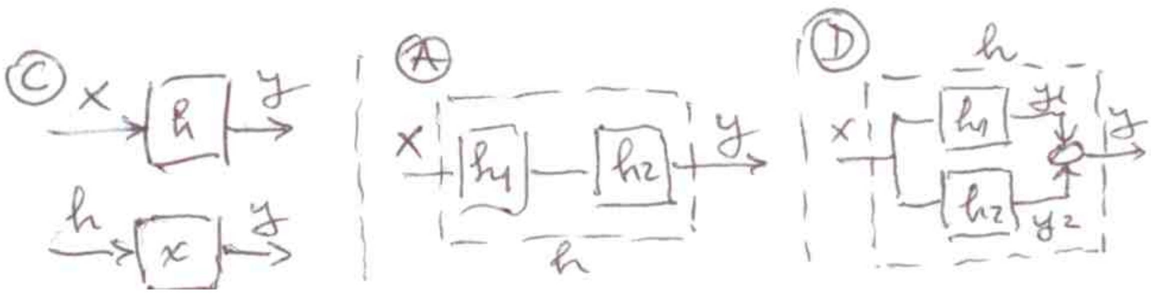
Notar: roles intercambiables de x y h

$$y(t) = \int_{0}^{\infty} h(\sigma)x(t-\sigma)d\sigma$$

Propiedades de la Convolución y Combinaciones

Válidas tanto para SLIT como SLID (con los cambios obvios):

- **Conmutativa:** $y = \{x * h\} = \{h * x\}$. Intercambiabilidad entre respuesta impulsional y entrada.
- **Asociativa:**
  $y_2 = \{x * h_1 * h_2\} = \{\underbrace{\{x * h_1\}}_{y_1} * h_2\} = \{x * \underbrace{\{h_1 * h_2\}}_{h}\}$.
  $h = h_1 * h_2 = h_2 * h_1$ es el sistema equivalente a uno serie.
- **Distributiva:** $y = \{x * \underbrace{\{h_1 + h_2\}}_{h}\} = \underbrace{\{x * h_1\}}_{y_1} + \underbrace{\{x * h_2\}}_{y_2}$.
  $h = h_1 + h_2$ es el sistema equivalente a un paralelo.



Y llegó!!! 5 minutos de intervalo

Estabilidad de SLID 1

Teorema: Un SLID es estable en sentido EA/SA sii su respuesta impulsional es *absolutamente sumable*; es decir

$$\text{existe } 0 < K_h < \infty \text{ tal que } \sum_{k=-\infty}^{\infty} |h[k]| \leq K_h$$

Demostración: 1) "ida" y 2) "vuelta".

1) h abs. sumable es suficiente:

Sea una entrada acotada por $0 < K_e < \infty$, o sea $|x[n]| \leq K_e$ para todo n. El módulo de la salida es

$$|y[n]| = \left| \sum_{k=-\infty}^{\infty} x[k]h[n-k] \right| \leq \sum_{k=-\infty}^{\infty} |x[k]||h[n-k]| \leq$$

$$\leq K_e \left(\sum_{k=-\infty}^{\infty} |h[n-k]| \right) \leq K_e K_h$$

tomando $K_y = K_e K_h$ la salida resulta acotada.

Estabilidad de SLID 2

2) h abs. sumable es necesaria: sistema EA/SA $\Rightarrow$ h es abs. sumable.

$\Leftrightarrow$ h NO es abs. sumable $\Rightarrow$ sistema NO es EA/SA.

Mostraremos una entrada acotada que, suponiendo que h NO es abs. sumable, dará $y[n]$ no acotada.

Sea $x[n] \triangleq h[-n]/|h[-n]|$ luego $|x[n]| \leq K_e = 1$ para todo n. La salida en $n = 0$ es

$$y[0] = \sum_{k=-\infty}^{\infty} x[k]h[-k] = \sum_{k=-\infty}^{\infty} h[-k]\frac{h[-k]}{|h[-k]|} =$$

$$= \sum_{k=-\infty}^{\infty} |h[-k]| \to \infty$$

que no está acotada por hipótesis. Luego y no está acotada y entonces el sistema no es EA/SA.

Estabilidad de SLIT 1

Paralelo a SLID:

Teorema: Un SLIT es estable en sentido EA/SA sii su respuesta impulsional es absolutamente integrable, es decir,

$$\text{existe un } 0 < K_h < \infty \text{ tal que } \int_{-\infty}^{\infty} |h(\tau)|\, d\tau \leq K_h$$

Demostración: similar a la de SLID.

Repase las ideas de la demostración para SLID, haciendo ésta para SLIT.

¿Y si el sistema fuera VT (tanto C como D)?

Ecuaciones diferenciales – 1

SLIT – ecns diferenciales ordinarias de coeficientes constantes (EDOLCC)

Forma general:

$$\sum_{i=0}^{N} a_i \frac{d^i y(t)}{dt^i} = \sum_{j=0}^{M} b_j \frac{d^j x(t)}{dt^j}$$

- Demuestre linealidad e invarianza en el tiempo.
- Restricciones técnicas $N \geq M$, vs. diferenciabilidad de $x(t)$.
- Aún si $x(t)$ es unilateral a derecha de t_0 la EDOLCC se integra para $t \geq t_0$ para causalidad.
- *PERO* también se *podrían* integrar para $t \leq t_0$.
- Condiciones iniciales CI $y(t_0)$, $\frac{dy}{dt}(t_0)$, $\frac{d^2y}{dt^2}(t_0)$, ..., $\frac{d^{N-1}y}{dt^{N-1}}(t_0)$

Ecuaciones diferenciales – 2

- La solución de las EDOLCC es $y(t) = y_{homogénea}(t) + y_{particular}(t) = y_h(t) + y_p(t)$
- la solución homomgénea $y_h \equiv 0$ si las CI son nulas.
- y_p es la solución particular, da el término forzado o sea la convolución de x con la respuesta impulsional h.
- Note que y_p incluye tanto régimen transitorio como régimen permanente.
- La respuesta impulsional $h(t)$ se obtiene resolviendo

$$\sum_{i=0}^{N} a_i \frac{d^i h(t)}{dt^i} = \sum_{j=0}^{M} b_j \delta^{(j)}(t)$$

  con condiciones iniciales nulas y $t > 0$: SLIT causales. Podrían haber soluciones para $t < 0$ o aún bilaterales, SLIT no-causales.
- Usando la transformada $\mathcal{L}$ de Laplace: $H(s) = \mathcal{L}\{h\}(s)$.
- Transferencia $H(s)$ *racional*, es decir $\frac{b(s)}{a(s)}$ con $a(\cdot)$, $b(\cdot)$ polinomios en la variable s. Para causal y no-causal.

Ecuaciones en diferencias – 1

SLID – ecns en diferencias lineales de coeficientes constantes (EDILCC)

Forma general:

$$\sum_{i=0}^{N} a_i y[n-i] = \sum_{j=0}^{M} b_j x[n-j]$$

- Demuestre linealidad e invarianza al deslizamiento.
- La EDILCC se “integra” para $n \geq n_0,\ n_0 \in \mathbb{Z}$ para causalidad. *PERO* también se pueden “integrar” para $n \leq n_0$ de modo no-causal.
- Condiciones iniciales CI $y[n_0-1],\ y[n_0-2],\ \ldots,\ y[n_0-N]$.
- La solución de las EDILCC es $y[n] = y_{homogénea}[n] + y_{particular}[n] = y_h[n] + y_p[n]$

Ecuaciones en diferencias – 2

- $y_h \equiv 0$ es la solución homogénea si las CI son nulas.
- y_p es la solución particular, da el término forzado o sea la convolución de x con la respuesta impulsional h.
- Note que y_p incluye tanto régimen transitorio como régimen permanente.
- La Respuesta Impulsional $h[n]$ se obtiene resolviendo

$$\sum_{i=0}^{N} a_i h[n-i] = \sum_{j=0}^{M} b_j \delta[n-j]$$

- Resolverla es muy "sencillo"!! Caso causal $h[n] = 0,\ n < 0$:

$$h[n] = \frac{1}{a_0}\left\{-\sum_{i=1}^{N} a_i h[n-i] + \sum_{j=0}^{M} b_j \delta[n-j]\right\}$$

note las CI nulas $h[-1] = 0,\ h[-2] = 0, \dots,\ h[-N] = 0$.

Ecuaciones en diferencias – 3

- Hagamos $a_0 = 1$ por simplicidad
- Fácil, pero laborioso
$h[n] = -\sum_{i=1}^{N} a_i h[n-i] + \sum_{j=0}^{M} b_j \delta[n-j]$

$$\begin{aligned}
h[0] &= -0 + b_0 = b_0 \\
h[1] &= -a_1 b_0 + b_1 \\
h[2] &= -a_1(-a_1 b_0 + b_1) + b_2 = a_1^2 b_0 - a_1 b_1 + b_2 \\
&\dots\dots
\end{aligned}$$

y así siguiendo para $h[n],\ n \geq 0$...
- Veremos la transformada $\mathcal{Z}$ y calcularemos $H(z) = \mathcal{Z}\{h\}(z)$.
- $H(z)$ resultará la transferencia discreta del SLID y resulta *racional*, es decir $\frac{b(z)}{a(z)}$ donde $a(\cdot),\ b(\cdot)$ son polinomios en la variable z.

Ecuaciones en diferencias – 4

- La Respuesta Impulsional $h[n]$ caso anticausal $h[n] = 0,\ n > 0$; se obtiene, reacomodando la EDILCC y calculando

$$h[n] = \frac{1}{a_N}\left\{-\sum_{i=0}^{N-1} a_i h[n+N-i] + \sum_{j=0}^{M} b_j \delta[n+N-j]\right\}$$

  note las “CI” nulas $h[1] = 0,\ h[2] = 0, \dots,\ h[N] = 0$.

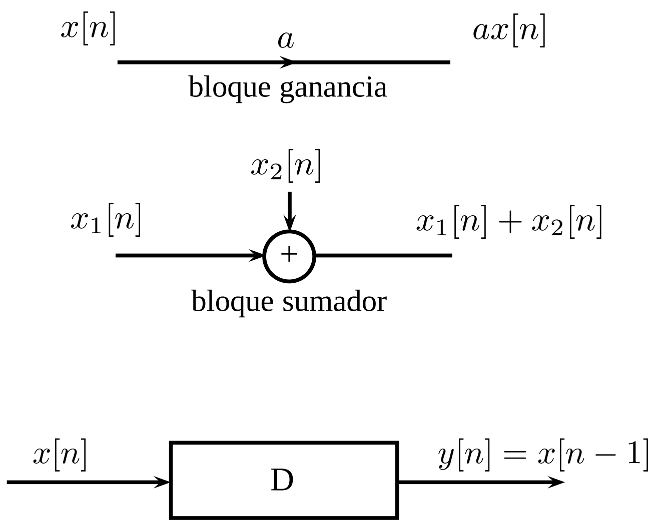
- $H(z)$ en este caso también resultará la transferencia discreta del SLID y será *racional* en $\mathcal{Z}$. Igualmente para SLIT no-causales en general.

Ecuaciones de estado

1. Para SLIT
$$\begin{cases} \dot{s}(t) = As(t) + Bx(t) \\ y(t) = Cs(t) + Dx(t) \end{cases}$$
   - con CI $s(t) = s_0$.
   - $s \in \mathbb{R}^N$ y A es de $N \times N$, B de $N \times 1$ y C de $1 \times N$.
2. Para SLID
$$\begin{cases} s[n+1] = Fs[n] + Gx[n] \\ y[n] = Hs[n] + Dx[n] \end{cases}$$
   - con CI $s[0] = s_0$.
   - con $p = \max\{N, M\}$, $s \in \mathbb{R}^p$ y F es de $p \times p$, G de $p \times 1$ y H de $1 \times p$.

Se usará muchísimo en Control Moderno y en Comunicaciones -posgrado-.
Note la clave: compacta separación entre presente y pasado

Diagramas en bloque - SLID – Elementos



D: "delay" o retardo

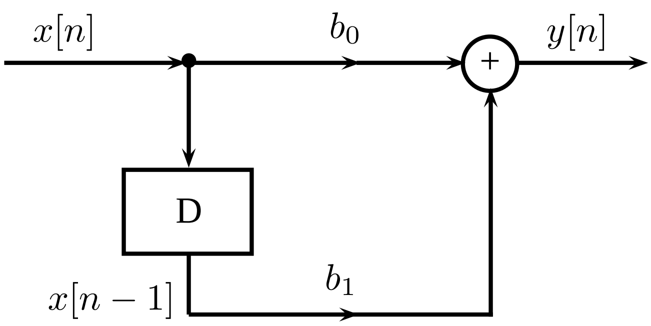
Diagramas en bloque - SLID – Ejemplo 1

Respuesta impulsional finita (en inglés FIR, por *finite impulse response*):

$$y[n] = b_0 x[n] + b_1 x[n-1]$$

Respuesta impulsional: $h[0] = b_0$; $h[1] = b_1$; $h[2] = 0$ y $h[n] = 0$; $n \geq 2$.

Diagrama en bloque:



Generalización: SLID con $N = 0$ y $M > 0$, se denota MA o de "promedios móviles" (en inglés)

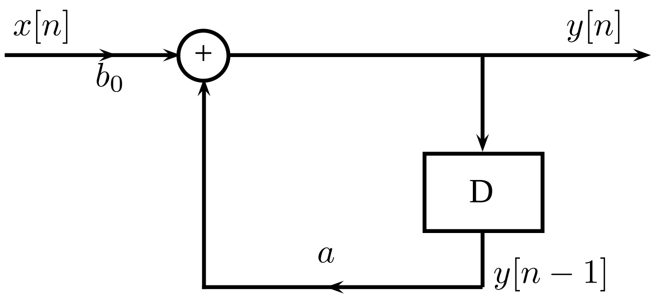
Diagramas en bloque - SLID – Ejemplo 2

Respuesta impulsional infinita (en inglés IIR, por *infinite impulse response*):

$$y[n] - ay[n-1] = b_0 x[n]$$

Respuesta impulsional: $h[0] = b_0;\ h[1] = ab_0;\ h[2] = a^2 b_0$ y $h[n] = a^n b_0;\ n \geq 0$.

Diagrama en bloque:



Generalización: SLID con $N > 0$ y $M = 0$, se denota AR o "auto-regresivo"

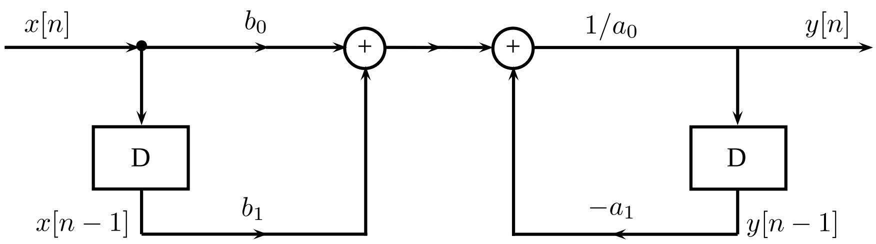
Diagramas en bloque - SLID – Ejemplo 3

Respuesta impulsional infinita (IIR):

$$a_0 y[n] + a_1 y[n-1] = b_0 x[n] + b_1 x[n-1] \ \Rightarrow$$
$$\Rightarrow \ y[n] = \frac{1}{a_0}\{-a_1 y[n-1] + b_0 x[n] + b_1 x[n-1]\}$$

Resp. impulsional: $h[0] = \frac{b_0}{a_0};\ h[1] = \frac{-a_1 b_0}{a_0^2} + \frac{b_1}{a_0};\ h[2] = \dots$

Diagrama en bloque:



Generalización: SLID con $N > 0$ y $M > 0$, se denota ARMA o "autorregresivo – promedios móviles" (en inglés).

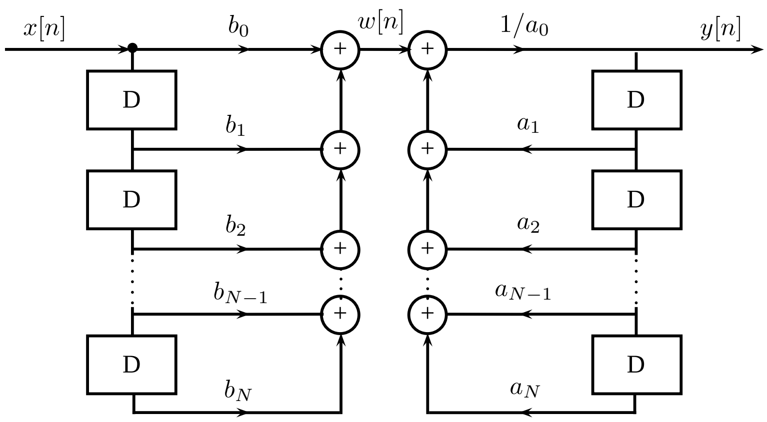
Diagramas en bloque - SLID – General 1

Respuesta impulsional infinita:

$$y[n] = \frac{1}{a_0}\left(\sum_{i=1}^{M} a_i y[n-i] + w[n]\right)$$

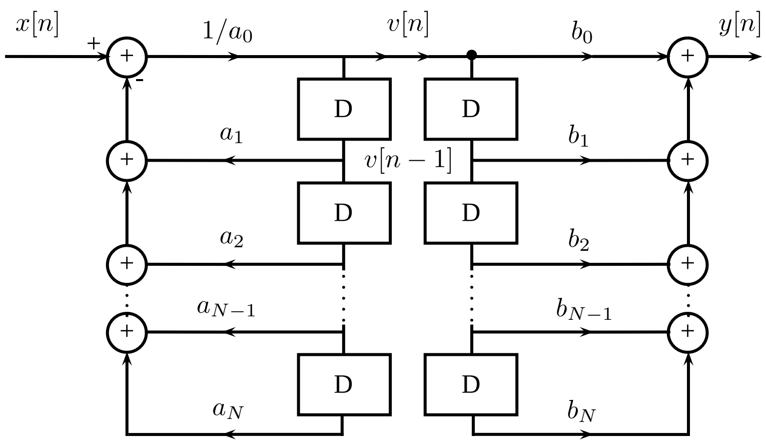
$$w[n] = \sum_{i=0}^{M} b_i x[n-i]$$

Diagrama en bloque: **Realización tipo I**



Diagramas en bloque - SLID – General 2

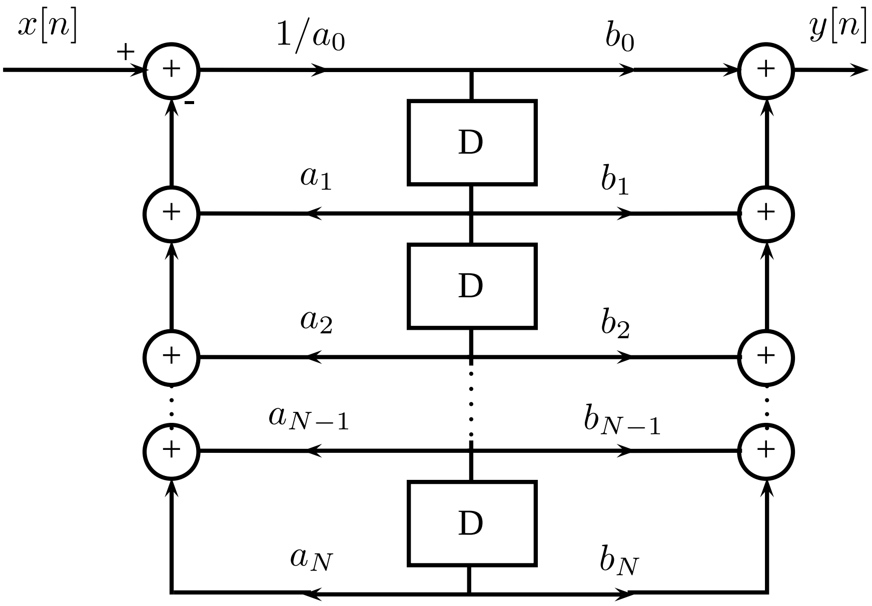
Usando conmutatividad



Los bloques correspondientes de cada columna llevan la misma señal: ¡juntémoslos!.

Diagramas en bloque - SLID – General 3

Realización tipo II



Menor número de retardos (estados).

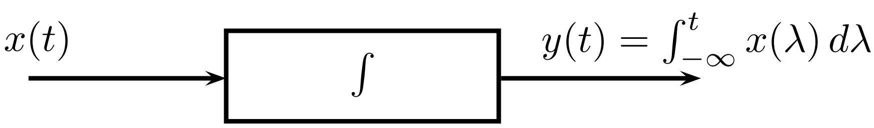
¿Es el mínimo? (a Control Moderno o postgrado).

Diagramas en bloque - SLIT

De manera totalmente similar con *sumas* y *multiplicadores* por constantes.

En lugar de retardos irían diferenciadores ⇒ pero son "ruidosos".

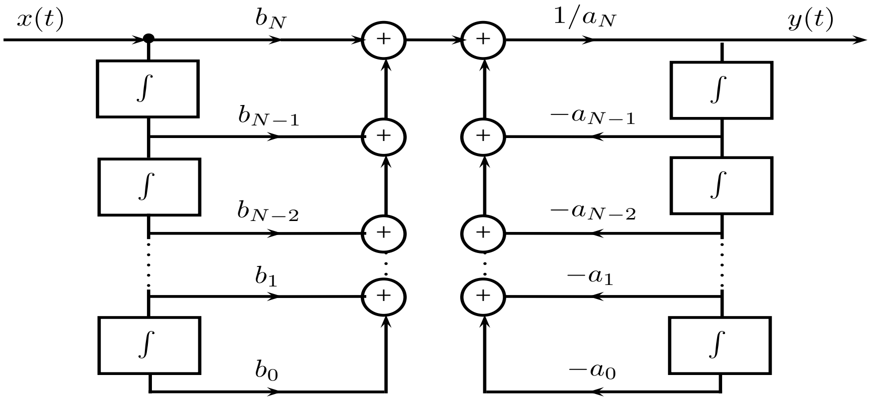
Se usan *integradores*



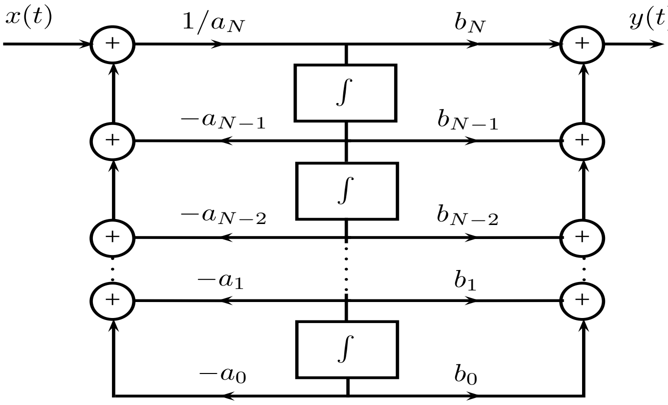
o sea

$$\dot{y}(t) = \frac{dy}{dt}(t) = x(t)$$

Diagramas en bloque - SLIT – General



(a) Realización directa tipo I.



(b) Realización directa tipo II.

Próximas Clases

- Sistemas Lineales con entradas aleatorias
- Análisis frecuencial: Transformada de Fourier. Inicio