

Kursplan för

Stationär och icke-stationär spektralanalys Stationary and Non-stationary Spectral Analysis

**FMSN35, 7,5 högskolepoäng, A
(Avancerad nivå)**

Gäller för: Läsåret 2016/17

Beslutad av: Utbildningsnämnd B

Beslutsdatum: 2016-03-28

Allmänna uppgifter

Undervisningsspråk: Kursen ges på engelska

Syfte

Kursen riktar sig till den som vill bredda och fördjupa sitt kunnande inom statistisk signalbehandling och utöka sin verktygslåda med mer avancerade tekniker. Den ligger i gränslandet mellan statistik och signalbehandling och bygger på de klassiska icke-parametriska metoder som är välkända och behandlas i, t.ex. Stationära stokastiska processer eller Optimal signalbehandling. Eftersom dessa metoder inte alltid räcker till behövs mer avancerade tekniker inom många tillämpningsområden, t.ex. inom kommunikation och medicin.

Kursen tar därför upp mer statistiskt robusta metoder som blivit vanligare under de senaste åren, bl.a. tids-frekvensanalys, som är ett modernt verktyg för undersökning av icke-stationära signaler och processer. Forskningen inom detta område har expanderat de senaste 20 åren, vilket gör att detta numera är på väg att bli ett vanligt verktyg för analys.

Flera tillämpningar kommer också att presenteras i kursen och deltagarna kommer att arbeta med data från verkliga problemställningar.

Mål

Kunskap och förståelse

För godkänd kurs skall studenten

- tolka och förstå parametriska och icke-parametriska spektralestimeringsmetoder.
- tolka och förstå spatial spektralanalys och klassiska estimeringstekniker av riktningar.
- tolka och förstå tidsfrekvensanalys och klassiska estimeringstekniker av icke-stationära spektrum.

Färdighet och förmåga

För godkänd kurs skall studenten

- kunna skatta klassiska parametriska och icke-parametriska spektralestimat.
- kunna skatta spektra av icke-uniformt samplade sekvenser.
- kunna använda klassiska tids-frekvensmetoder för skattning.

Kursinnehåll

Grundläggande definitioner. Fördjupat studium av AR (auto regressive), MA (moving average) och ARMA-processer. Linjespektrum och parametriska estimeringsmetoder. Underrumsbaserade tekniker. Icke-parametriska spektralskattare, data-adaptivtekniker och multifönstermetoder. Icke-uniform sampling. Orientering om cirkulära och icke-cirkulära processer. Spatial spektralanalys. Icke-stationära processer. Spektrogram. Wigner-Ville distribution. Cohen's klass. Ambiguity-spektrum. Multi-fönster tekniker för icke-stationära signaler. Orientering om bispektrum.

Kursens examination

Betygsskala: TH

Prestationsbedömning: Godkända inlämningsuppgifter och laborationsrapporter samt deltagande i alla obligatoriska moment. Slutbetyget avgörs av en sammanvägning av resultatet på inlämningsuppgifterna och laborationsrapporterna.

Delmoment

Kod: 0116. **Benämning:** Laborationer.

Antal högskolepoäng: 3. **Betygsskala:** UG. **Prestationsbedömning:**

Datorlaborationer med godkända laborationsrapporter

Kod: 0216. **Benämning:** Inlämningsuppgifter del 1.

Antal högskolepoäng: 1. **Betygsskala:** UG. **Prestationsbedömning:** Första inlämningsuppgiften

Kod: 0316. **Benämning:** Inlämningsuppgifter del 2.

Antal högskolepoäng: 3,5. **Betygsskala:** UG. **Prestationsbedömning:** Övriga inlämningsuppgifter

Antagningsuppgifter

Förkunskapskrav:

- FMSF10 Stationära stokastiska processer

Förutsatta förkunskaper: FMS051 Tidsserieanalys

Begränsat antal platser: Nej

Kursen överlappar följande kurser: MASM26

Kurslitteratur

- P. Stoica and R. Moses: Spectral analysis of signals. Prentice-Hall, 2005, ISBN: 0-13-113956-8.
- M. Sandsten: Lecture notes, Time-frequency analysis. 2011.

Kontaktinfo och övrigt

Kursansvarig: Prof Andreas Jakobsson,
andreas.jakobsson@matstat.lu.se

Kursansvarig: Prof Maria Sandsten, sandsten@maths.lth.se

Studierektor: Studierektor Anna Lindgren,
studierektor@matstat.lu.se

Hemsida: <http://www.maths.lth.se/matstat/kurser/masm26/>

Övrig information: Kursen ges även på naturvetenskaplig fakultet med kurskoden MASM26