

FFT

関西学院大学・理工学部・情報科学科 西谷滋人

2006.12.8

1 FFTの応用

Fast Fourier Transformation(FFT) 高速フーリエ変換 (あるいはデジタル (離散) フーリエ変換 (DFT)) は, 周波数分解やフィルターを初め, 画像処理などの多くの分野で使われている. 基本となる考え方は, 直交基底による関数の内挿法である. 最初にその応用例を見た後, どのような理屈で FFT が動いているかを解説する.

FFT の応用例 Maple スクリプトを参照

周波数分解

高周波フィルター

2 FFTの動作原理

このように便利な FFT であるが, どのような理屈で導かれるのか? Fourier 変換法は, この課題だけでも何回ものコマ数が必要なほどの内容を含んでいる. ここでは, その基本となる考え方 (のひとつ) だけを提示する.

1. 関数の内挿で導入した基底関数を直交関数にする. ところが, 展開係数を逆行列で求める手法では計算が破綻.
2. 直交関係からの積分による係数決定.
3. 選点直交性による計算の簡素化.
4. 高速フーリエ変換アルゴリズムによる高速化.

2.1 関数内挿としての Fourier 関数系

一連の関数系による関数の内挿は，基底関数を $\phi_n(x)$ として

$$F(x) = \sum_{n=1}^N a_n \phi_n(x) \quad (1)$$

で得られることを見た．

Fourier 変換では基底関数として $\phi_n(x) = \sin(2\pi nx), \cos(2\pi nx)$ をとる．関数の内挿法で示したように，この x_i での値 $f_i, i = 1 \cdots M$ と，近似の次数 (N) とでつくる，

$$A = \begin{pmatrix} \phi_0(x_0) & \phi_1(x_0) & \cdots & \phi_N(x_0) \\ & & \vdots & \\ \phi_0(x_M) & \phi_1(x_M) & \cdots & \phi_N(x_M) \end{pmatrix} \quad (2)$$

とした係数行列を求めて，係数 a_i とデータ点 f_i をそれぞれベクトルと考えると，

$$A \cdot \mathbf{a} = \mathbf{f} \quad (3)$$

から，通常 of 逆行列を求める手法で係数を決定することもできる．しかし，この強引な方法はデータ数，関数の次数が多い，フーリエ変換が対象としようとする問題では破綻する．もっといい方法が必要で，それが直交関数系では存在する．

2.2 直交関係からの積分による係数決定

関数の直交関係は，

$$\int_a^b \phi_n(x) \phi_m(x) dx = \delta_{mn} C_n = \begin{cases} C_m & m = n \\ 0 & m \neq n \end{cases} \quad (4)$$

である．

$$\int_a^b F(x) \phi_m(x) dx \quad (5)$$

を考える．先程の (1) 式をいれると

$$\int_a^b F(x) \phi_m(x) dx = \int_a^b \sum_{n=1}^N a_n \phi_n(x) \phi_m(x) dx = \begin{cases} a_m C_m & m = n \\ 0 & m \neq n \end{cases} \quad (6)$$

となる．こうして，係数 a_n が

$$a_n = \frac{1}{C_n} \int_a^b F(x) \phi_n(x) dx \quad (7)$$

と決定される．

2.3 選点直交性による計算の簡素化

ところが，実際に積分しては，時間がかかりすぎる．直交関数の選点直交性を使うとより簡単になる． n 次の直交多項式は，

$$\phi_n(x) = 0 \quad \text{at} \quad x = x_1, x_2, \dots, x_n \quad (8)$$

である．それ以下の次数 (m, l) では，

$$\sum_{i=1}^n \phi_l(x_i) \phi_m(x_i) = \delta_{ml} C_m \quad (9)$$

が成り立つ．これは，直交関係と違い積分でないことに注意．証明は略．
先程の直交関数展開

$$F(x) = \sum_{l=1}^N a_l \phi_l(x) \quad (10)$$

の両辺に $\phi_m(x_i)$ を掛けて i について和をとれば，

$$\begin{aligned} \sum_{i=1}^n F(x_i) \phi_m(x_i) &= \sum_{i=1}^n \sum_{l=1}^N a_l \phi_l(x_i) \phi_m(x_i) \\ &= \sum_{l=1}^N a_l \sum_{i=1}^n \phi_l(x_i) \phi_m(x_i) \\ &= \sum_{l=1}^N a_l \delta_{ml} C_m = a_m C_m \end{aligned} \quad (11)$$

となる．つまり，

$$a_m = \frac{1}{C_m} \sum_{i=1}^n F(x_i) \phi_m(x_i) \quad (12)$$

となり，単純な関数の代入とかけ算で係数が決定される．

2.4 高速フーリエ変換アルゴリズムによる高速化

オイラーの関係を使うと，

$$\exp(2\pi I/N) = \cos(2\pi/N) + I \sin(2\pi/N) \quad (13)$$

と変換できる．これを使うと，

$$c_k = \sum_{n=0}^{N-1} \exp(-2\pi I n/N) \quad (14)$$

となる． $N = 8$ の場合を実際に計算すると， $z = \exp(-2\pi I/N)$ として， $z^8 = 1, z^9 = z, \dots$ を使うと，

$$\begin{pmatrix} c_0 \\ c_1 \\ c_2 \\ c_3 \\ c_4 \\ c_5 \\ c_6 \\ c_7 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 1 & 1 & 1 & 1 & 1 & 1 & 1 & 1 \\ 1 & z & z^2 & z^3 & z^4 & z^5 & z^6 & z^7 \\ 1 & z^2 & z^4 & z^6 & 1 & z^2 & z^4 & z^6 \\ 1 & z^3 & z^6 & z & z^4 & z^7 & z^2 & z^5 \\ 1 & z^4 & 1 & z^4 & 1 & z^4 & 1 & z^4 \\ 1 & z^5 & z^2 & z^7 & z^4 & z & z^6 & z^3 \\ 1 & z^6 & z^4 & z^2 & 1 & z^6 & z^4 & z^2 \\ 1 & z^7 & z^6 & z^5 & z^4 & z^3 & z^2 & z^1 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} F_0 \\ F_1 \\ F_2 \\ F_3 \\ F_4 \\ F_5 \\ F_6 \\ F_7 \end{pmatrix} \quad (15)$$

となる．この行列計算を素直に実行すると， $N \times N = 64$ 回の演算が必要となる．これを減らせないかと考えたのが，高速フーリエ変換の始まりである．

この行列をよく見ると同じ計算を重複しておこなっていることが分かる．そこで，行列の左側と右側で同じ計算をしている部分をまとめると，

$$\begin{pmatrix} c_0 \\ c_1 \\ c_2 \\ c_3 \\ c_4 \\ c_5 \\ c_6 \\ c_7 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 1 & 1 & 1 & 1 & 0 & 0 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 0 & 1 & z & z^2 & z^3 \\ 1 & z^2 & z^4 & z^6 & 0 & 0 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 0 & 1 & z^3 & z^6 & z \\ 1 & z^4 & 1 & z^4 & 0 & 0 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 0 & 1 & z^5 & z^2 & z^7 \\ 1 & z^6 & z^4 & z^2 & 0 & 0 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 0 & 1 & z^7 & z^6 & z^5 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} F_0 + F_4 \\ F_1 + F_5 \\ F_2 + F_6 \\ F_3 + F_7 \\ F_0 - F_4 \\ F_1 - F_5 \\ F_2 - F_6 \\ F_3 - F_7 \end{pmatrix} \quad (16)$$

とすることができる．ここで， $z^4 = -1$ などを使っている．右側のベクトルの計算でロスするが，行列の中の計算の回数を半分に減らすことができる．再度できあがった行列を見れば，同じ計算をさらにまとめることができそうである．こうして，次々と計算回数を減らしていくことが可能で，最終的に行列部分の計算が一切なくなる．残るのは，右側のベクトルの足し算引き算だけになる．

このベクトルの組み合わせは，一見相当複雑そうで，その条件分岐で時間がかかりそうに思われる．しかし，よく調べてみれば，単純なビット演算で処理することが可能であることが判明した．こうして，2の整数乗のデータの組に対しては，極めて高速にフーリエ変換を実行することが可能となった．

FFTでの演算回数は，データ数を N とすると

$$N \log_2 N \quad (17)$$

となる．単純な場合の N^2 と比較すると，

N	N^2	$N \cdot \log_2(N)$	ratio
4	16	8	0.50000
8	64	24	0.37500
16	256	64	0.25000
32	1024	160	0.15625
64	4096	384	0.09375
128	16384	896	0.05469
256	65536	2048	0.03125
512	262144	4608	0.01758
1024	1048576	10240	0.00977
2048	4194304	22528	0.00537
4096	16777216	49152	0.00293

となり，いかに高速化されているかが理解されよう．