

# TABLE DES MATIÈRES

---

<b>1 QUELQUES ÉLÉMENTS MATHÉMATIQUES .....</b>	<b>15</b>
1.1 Introduction.....	15
1.2 Notions sur l'intégrale de Riemann .....	15
1.3 Notions sur l'intégrale de Lebesgue .....	16
1.4 Intégrale en partie principale de Cauchy .....	17
1.5 Espace fonctionnel .....	18
1.6 Les distributions au sens de Laurent Schwartz .....	18
1.6.1 Distributions associées aux fonctions localement intégrables.....	18
1.6.2 La distribution de Dirac .....	19
1.6.3 Opérations sur les distributions .....	19
<b>2 CLASSIFICATION DES SIGNAUX.....</b>	<b>21</b>
2.1 Introduction.....	21
2.2 Classification déterministe-aléatoire.....	21
2.2.1 Déterministes .....	21
2.2.2 Aléatoires .....	21
2.3 Classification énergétique.....	21
2.4 Autres types de signaux .....	22
2.4.1 La distribution de Dirac .....	22
2.4.2 Le peigne de Dirac.....	23
2.4.3 Les signaux nuls à gauche .....	23
2.5 Classification continu/discret.....	24
2.6 Représentation vectorielle des signaux .....	24
2.6.1 L'intérêt d'une représentation vectorielle.....	24
2.6.2 Espace vectoriel des signaux .....	25
2.6.3 Développement en série de fonctions orthogonales .....	25
2.6.4 Théorème de Parseval .....	27
<b>3 SÉRIES DE FOURIER .....</b>	<b>29</b>
3.1 Introduction.....	29
3.2 Décomposition dans une base vectorielle de fonctions orthogonales.....	29
3.3 Énergie du signal.....	32
3.4 Conditions de convergence .....	32
3.5 Simplifications .....	34
3.6 Phénomène de Gibbs.....	34
<b>4 TRANSFORMATION DE FOURIER.....</b>	<b>39</b>
4.1 Introduction.....	39
4.2 Des séries de Fourier à la transformée de Fourier .....	39
4.3 Les fonctions Rect et Tri.....	40
4.4 La distribution de Dirac .....	45
4.5 Échantillonnage par une fonction rectangulaire .....	45
4.6 L'intégrale de convolution .....	46
4.7 Le peigne de Dirac .....	51

---

4.8 L'échelon unité de Heaviside.....	52
4.9 La symétrie.....	52
4.10 Quelques transformées de Fourier de base .....	52
4.11 Le théorème de Parseval .....	57
4.12 Cas des signaux périodiques .....	58
4.13 Cas des fonctions qui n'appartiennent pas à L <sub>2</sub> .....	64
<b>5 LE FILTRAGE LINÉAIRE.....</b>	<b>67</b>
5.1 Introduction.....	67
5.2 Le filtre linéaire.....	67
5.2.1 La transformation est linéaire .....	67
5.2.2 La transformation est homogène dans le temps.....	67
5.2.3 Les caractéristiques d'un filtre linéaire.....	68
5.2.4 Filtre sans distorsion à phase linéaire .....	70
5.2.5 Filtre passe-bas idéal.....	71
5.2.6 Filtre passe-haut idéal .....	71
5.2.7 Filtre passe-bande idéal .....	72
5.2.8 Réponse d'un filtre à une impulsion rectangulaire .....	72
5.2.9 Effet de la suppression de composantes basses fréquences sur un signal rectangulaire .....	73
<b>6 THÉORÈME DE L'ÉCHANTILLONNAGE .....</b>	<b>79</b>
6.1 Introduction.....	79
6.2 L'échantillonnage .....	79
6.3 Conséquences de l'échantillonnage .....	82
6.4 Filtre anti-repliement .....	85
<b>7 LES SIGNAUX ALÉATOIRES (RAPPELS DE STATISTIQUE).....</b>	<b>89</b>
7.1 Introduction.....	89
7.2 Notions de base .....	89
7.3 Introduction aux moments temporels et statistiques .....	91
7.4 Les moments temporels, les relations de base .....	91
7.4.1 Moyenne temporelle .....	91
7.4.2 Auto-corrélation temporelle.....	91
7.5 Les moments statistiques, les relations de base .....	91
7.5.1 Moyenne statistique .....	91
7.5.2 Moment d'ordre 2 .....	92
7.6 Variance .....	92
7.7 Fonction d'auto-corrélation .....	93
7.8 Fonction d'inter-corrélation .....	93
7.9 Stationnarité au sens strict .....	93
7.10 Suite aléatoire stationnaire au second ordre.....	93
7.11 Processus aléatoire stationnaire au second ordre .....	94
7.12 Relation entre convolution et corrélation.....	95
7.13 Relations entre fonctions de corrélation et d'inter-corrélation .....	95
7.14 Ergodicité .....	97

7.15 Le principe d'incertitude.....	98
7.16 Fonction génératrice d'une variable aléatoire.....	101
7.17 Fonction caractéristique d'une variable aléatoire .....	103
7.18 La deuxième fonction caractéristique .....	104
7.19 La deuxième fonction caractéristique modifiée .....	105
7.20 La distribution de Poisson.....	106
7.20.1 Calcul des moments de la loi de Poisson (méthode classique).....	107
7.20.2 Calcul des moments de la loi de Poisson (par la fonction génératrice).....	108
7.20.3 Calcul de la fonction de corrélation du processus de Poisson .....	109
<b>8 PROPRIÉTÉS SPECTRALES .....</b>	<b>111</b>
8.1 Introduction.....	111
8.2 Approche de la puissance, de l'énergie et de la densité spectrale d'une réalisation particulière.....	111
8.3 Théorème de Wiener-Kinchine.....	112
8.4 Formules de filtrage et formule des interférences (inter-spectres) .....	115
8.5 La densité spectrale de puissance .....	117
8.6 Propriétés de la fonction de corrélation .....	118
8.7 Exemples.....	118
8.8 Fonction d'auto-corrélation d'un processus dérivé.....	123
8.9 Le bruit blanc .....	124
8.9.1 Filtrage adapté .....	126
8.9.2 Filtre adapté physiquement réalisable .....	128
8.10 La transformée de Laplace .....	129
8.10.1 Quelques transformées de Laplace .....	129
8.10.2 Fonction de transfert opérationnelle .....	130
8.10.3 Stabilité du système .....	133
8.10.4 Équation différentielle correspondant à la fonction de transfert.....	134
<b>9 LA TRANSFORMATION DE HILBERT .....</b>	<b>135</b>
9.1 Introduction.....	135
9.2 Signal analytique.....	135
9.3 La transformée de Hilbert .....	136
9.4 Quelques propriétés .....	140
9.4.1 La double transformation de Hilbert.....	140
9.4.2 Le produit de convolution.....	141
9.4.3 L'inter-corrélation.....	141
9.4.4 L'auto-corrélation .....	141
9.5 Propriétés du signal analytique .....	142
9.5.1 Fonction d'auto-corrélation .....	142
9.5.2 Densité spectrale .....	142
9.6 Enveloppe complexe d'un signal de type passe-bande.....	143
9.6.1 Densité spectrale de l'enveloppe complexe.....	145

---

9.6.2 Propriétés des composantes de Rice .....	146
<b>10 NOTIONS DE MODULATION ET DÉTECTION SYNCHRONE .....</b>	<b>151</b>
10.1 Introduction : intérêt de la modulation.....	151
10.2 Principe .....	151
10.3 La modulation d'amplitude.....	152
10.4 Densité spectrale du signal modulé en amplitude.....	154
10.5 La démodulation synchrone .....	156
10.6 La détection synchrone .....	160
<b>11 LES SYSTÈMES NUMÉRIQUES .....</b>	<b>165</b>
11.1 Introduction.....	165
11.2 Les systèmes à réponse invariante et variante dans le temps.....	166
11.2.1 Linéarité .....	166
11.2.2 Causalité .....	167
11.3 Réponse d'un système numérique (LIT) à des impulsions de Dirac .....	167
11.3.1 Réponse impulsionnelle d'un système numérique (LIT).....	168
11.3.2 Les systèmes à réponse impulsionnelle de durée finie (RIF) et à réponse impulsionnelle de durée infinie (RII) .....	169
11.4 Les systèmes numériques récursifs et non-récurifs.....	169
11.5 Corrélation des signaux discrets .....	170
11.6 Auto-corrélation de signaux discrets .....	171
11.7 La transformée en z.....	171
11.7.1 La transformée en z directe.....	172
11.7.2 La transformée en z inverse .....	173
11.7.3 Propriétés de la transformée en z .....	175
11.7.4 Quelques transformées en z .....	177
11.7.5 Fonction de transfert d'un système numérique (LIT).....	178
11.7.6 Relation entre la transformée en z et la transformée de Fourier .....	179
11.8 Analyse fréquentielle des systèmes discrets .....	181
11.8.1 Puissance moyenne et égalité de Parseval .....	181
11.8.2 Énergie de la séquence.....	182
11.9 Synthèse d'un filtre numérique .....	182
11.9.1 Synthèse d'un filtre numérique par la méthode des dérivées .....	183
11.9.2 Synthèse d'un filtre numérique par la transformation bilinéaire .....	185
11.10 Méthode de l'invariance de la réponse impulsionnelle.....	193
11.10.1 Validité de la transformation .....	194
11.11 Conception des filtres RIF .....	196
11.11.1 Cas où $h(n)$ est symétrique .....	199
11.11.2 Cas où $h(n)$ est antisymétrique .....	199
11.11.3 Choix d'une réponse $h(n)$ symétrique ou antisymétrique .....	200
11.12 Utilisation du fenêtrage.....	200
11.12.1 Effet du fenêtrage sur un signal .....	200
11.12.2 Effet du fenêtrage avec un filtre RIF .....	204

<b>12 TRANSFORMATION EN ONDELETTES .....</b>	<b>215</b>
12.1 Introduction.....	215
12.2 La transformée de Fourier à fenêtre.....	215
12.2.1 Localisation temps-fréquence .....	218
12.2.2 Influence du fenêtrage sur la résolution et la dynamique .....	219
12.3 La transformée continue par ondelettes .....	219
12.3.1 Principe comparé des analyses temps-fréquence .....	220
12.3.2 Admissibilité .....	222
12.3.3 Filtre inverse .....	224
12.3.4 Démonstration de la formule de reconstruction et de la condition d'admissibilité.....	226
12.4 Exemples d'ondelettes .....	227
12.5 Exemple d'application .....	230
12.6 La décimation et le sous-échantillonnage .....	232
12.7 Les filtres miroirs en quadrature .....	236
12.7.1 Synthèse des filtres à reconstruction parfaite .....	239
12.7.2 Synthèse des filtres miroirs conjugués .....	240
12.8 La multirésolution .....	241
12.8.1 Construire une multirésolution .....	244
12.8.2 L'équation d'échelle .....	244
12.8.3 Conditions de quadrature sur la fonction d'échelle .....	246
12.8.4 L'ondelette associée.....	247
12.8.5 Ondelettes et filtres à reconstruction parfaits .....	248
12.8.6 Détails et approximations .....	250
12.8.7 Conditions nécessaires sur les ondelettes .....	251
12.8.8 Les ondelettes à support compact de Daubechies [14] .....	255
<b>13 LE BRUIT : APPROCHE GÉNÉRALE .....</b>	<b>271</b>
13.1 Introduction.....	271
13.2 Le bruit de quantification.....	271
13.3 Le rapport signal à bruit du codeur .....	273
13.3.1 Cas d'un signal sinusoïdal .....	273
13.3.2 Amélioration du rapport signal à bruit.....	273
13.3.3 Cas d'un signal gaussien.....	275
13.4 Formule de Hartley .....	276
13.5 Le bruit thermique (ou bruit Johnson) .....	277
13.6 Fluctuations de tension et de courant dans une résistance .....	278
13.7 Bande équivalente de bruit.....	282
13.7.1 Filtre passe-bas du premier ordre.....	283
13.7.2 Circuit du deuxième ordre .....	283
13.7.3 Filtre de Butterworth.....	284
13.8 Bruit de grenade (Bruit Schottky ou shot noise) .....	285
13.8.1 Les théorèmes de Campbell.....	285
13.8.2 Généralisation du théorème de Campbell.....	288

---

13.8.3 Expression du bruit de grenaille .....	288
13.9 Autres sources de bruits (exemple : le bruit en 1/f ou flicker noise) .....	289
13.10 Le facteur de bruit.....	290
13.10.1 Cas d'un quadripôle isolé .....	290
13.10.2 Cas de quadripôles en cascade.....	291
<b>14 LE BRUIT DANS LES TRANSISTORS BIPOLAIRE ET À EFFET DE CHAMP.....</b>	<b>293</b>
14.1 Introduction.....	293
14.2 Le transistor bipolaire .....	293
14.2.1 Modèle de base du transistor bipolaire .....	294
14.2.2 Modèle plus complet du transistor bipolaire .....	296
14.2.3 Modèles du transistor bipolaire avec les sources de bruit .....	299
14.2.4 Calcul du bruit après filtrage .....	306
14.3 Le transistor à effet de champ.....	307
14.3.1 Schéma équivalent du transistor à effet de champ.....	307
14.3.2 Comparaison bipolaire-FET .....	310
14.3.3 Calcul du bruit après filtrage .....	310
14.3.4 FET et bruit en 1/f.....	311
<b>15 APPLICATION DU BRUIT IMPULSIONNEL EN PHYSIQUE .....</b>	<b>313</b>
15.1 Introduction.....	313
15.2 La fonction de pondération .....	313
15.3 Traitement statistique des impulsions de bruit.....	314
15.3.1 Application du théorème de Campbell .....	315
15.3.2 Le filtre optimum qui minimise .....	318
15.4 Le signal équivalent au bruit.....	320
15.5 Prise en compte de l'empilement en tant que bruit.....	323
15.6 Exemples de filtrage .....	325
15.6.1 Exemple d'une réponse impulsionnelle triangulaire .....	325
15.6.2 Réponse impulsionnelle définie par des morceaux de paraboles .....	325
15.6.3 Approche fréquentielle du filtre gaussien.....	332
15.7 Densité spectrale et bruit.....	334
<b>16 PROBLÈMES LIÉS À LA CAPACITÉ DU DÉTECTEUR .....</b>	<b>339</b>
16.1 Introduction.....	339
16.2 Calcul de la répartition des charges .....	339
16.3 Cas d'une capacité détecteur importante .....	340
16.4 La suppression du pôle zéro.....	342
<b>17 MESURES TEMPORELLES .....</b>	<b>345</b>
17.1 Introduction.....	345
17.2 Exemple de la technique du temps de vol (TOF) .....	345
17.3 Technique de la discrimination.....	349
17.4 Pente du signal et l'instant de basculement d'un comparateur .....	350
17.5 Influence de la dispersion (Jitter) sur l'instant de basculement.....	351

17.6 Inconvénient du comparateur classique .....	352
17.7 Utilisation d'un discriminateur à fraction constante.....	353
17.7.1 Réalisation pratique .....	354
17.7.2 Schéma complet.....	356
17.8 Différents modes de fonctionnement .....	356
17.8.1 Fonctionnement en mode ARC (Amplitude and Rise time Compensated).....	357
17.8.2 Fonctionnement en mode TCF (True Constant Fraction).....	358
17.8.3 Estimation de la pente au point de passage par zéro.....	359
17.8.4 Influence de la dispersion (Jitter) dans les modes ARC et TCF .....	360
<b>18 NOTION DE TEMPS MORT .....</b>	<b>363</b>
18.1 Introduction.....	363
18.2 La logique de déclenchement.....	363
18.3 Les 2 types de temps morts .....	364
18.3.1 Le temps mort cumulatif.....	364
18.3.2 Le temps mort non-cumulatif .....	365
18.4 Traitement statistique du temps mort.....	366
18.5 Notion de temps mort généralisé .....	367
18.6 Notion de file d'attente .....	369
18.6.1 File d'attente de longueur 1 .....	369
18.6.2 File d'attente de longueur n .....	370
18.7 Quel taux de temps mort est acceptable ? .....	373
18.8 Évaluation du temps mort .....	373
18.8.1 Cas d'une source radioactive .....	375
18.8.2 Cas d'une source de photons .....	376
18.8.3 Étude de la répartition temporelle des événements .....	377
18.9 Méthode pour éviter le temps mort.....	377
<b>19 ÉLECTRONIQUE ASSOCIÉE AUX CALORIMÈTRES .....</b>	<b>381</b>
19.1 Introduction.....	381
19.2 Les contraintes .....	382
19.3 Le pré-amplificateur de charges.....	382
19.4 Le pré-amplificateur de courant (transimpédance) .....	383
19.5 L'amplificateur de courant - charges : étude détaillée .....	384
19.5.1 En boucle ouverte (sans contre réaction).....	384
19.5.2 En boucle fermée .....	385
19.5.3 L'amplificateur de charges à transistors à effet de champ en entrée .....	387
19.5.4 Cas de l'amplificateur de courant .....	389
<b>20 RÉSOLUTION DANS LES PHOTO-MULTIPLICATEURS .....</b>	<b>391</b>
20.1 Introduction.....	391
20.2 Les paramètres fondamentaux d'un photo-multiplicateur .....	391

---

20.3 Cas de deux événements en cascade .....	394
20.4 Le photo-multiplicateur d'un point de vue statistique .....	395
20.4.1 Le bruit de la photo-émission .....	395
20.4.2 Influence de l'ensemble des dynodes .....	397
20.5 Résolution en énergie et le spectre du photoélectron.....	398
20.6 Le facteur de bruit.....	402
20.6.1 Principe d'évaluation de certains paramètres .....	403
20.6.2 Mesure du gain global .....	403
20.6.3 Mesure du gain du multiplicateur .....	404
20.6.4 Mesure du rendement quantique effectif .....	404
20.6.5 Mesure du rendement quantique.....	404
20.7 Fluctuations temporelles dans un photo-multiplicateur .....	404
20.8 Démonstrations .....	406
20.8.1 Variance de la différence des temps de transit entre deux dynodes du photo-multiplicateur .....	406
20.8.2 Variance de la différence des temps de transit après l'amplification par une dynode.....	407
20.8.3 Variance de la largeur de l'impulsion après plusieurs multiplications en cascade .....	409
20.8.4 Variance de la position du centre de gravité du signal .....	410
20.8.5 Variance de la position du centre de gravité du signal pour le photo-multiplicateur complet .....	411
20.9 Utilisation des signaux d'anode et de dynode.....	412
<b>21 INTRODUCTION AUX PHOTODÉTECTEURS À TRANSFERT DE CHARGES .....</b>	<b>413</b>
21.1 Introduction.....	413
21.2 L'effet photo-électrique .....	413
21.3 La capacité MOS (Metal Oxyde Semiconductor).....	414
21.4 Le transfert de charges .....	415
21.4.1 Principe général .....	415
21.4.2 Le transfert de charges entre deux cellules.....	416
21.4.3 Le transfert de charges dans le CCD .....	417
21.5 L'étage de sortie.....	419
21.6 Les sources de bruit .....	421
21.6.1 Le bruit de Reset.....	421
21.6.2 Le bruit blanc .....	422
21.6.3 Le bruit en 1/f (le modèle standard).....	422
21.6.4 Le bruit en 1/f (le modèle non-stationnaire) .....	423
21.7 Les techniques de lecture .....	425
21.7.1 Le double échantillonnage corrélé.....	425
21.7.2 Puissance du bruit en sortie du corrélateur .....	429
21.7.3 Le circuit clamp and sample .....	431
21.7.4 Le circuit de clamping (verrouillage sur un potentiel continu) .....	432
21.7.5 Comparaison des méthodes .....	436

<b>22 LES LIGNES DE TRANSMISSION.....</b>	<b>437</b>
22.1 Introduction.....	437
22.2 La ligne de transmission idéale (sans perte) .....	437
22.3 L'impédance caractéristique de la ligne de transmission .....	438
22.4 Équations générales d'une ligne de transmission .....	439
22.5 Ligne sans perte .....	440
22.6 L'impédance caractéristique (équation générale) .....	441
22.7 Les réflexions.....	441
22.8 Pertes dans les lignes de transmission .....	443
22.9 L'effet de peau.....	444
22.9.1 Réponse d'un câble avec pertes à un échelon de tension .....	445
22.9.2 Expression de $T_{0.5}$ comme une fonction des pertes.....	447
22.10 Les différentes lignes de transmission .....	448
22.10.1 Le câble coaxial .....	448
22.10.2 La paire torsadée.....	449
22.10.3 Fil sur un plan de masse.....	449
22.10.4 La ligne microstrip.....	449
22.10.5 La ligne stripline .....	451
22.10.6 Matériaux et constantes diélectriques .....	451
22.11 Effet de chargement d'une ligne de transmission .....	452
22.12 Condition nécessaire pour adapter une ligne de transmission .....	452
22.13 Réponse à un échelon de tension .....	454
<b>23 LE FACTEUR DE FANO .....</b>	<b>457</b>
23.1 Introduction.....	457
23.2 La statistique de Fano .....	457
<b>24 APPROCHE DE LA COMPATIBILITÉ ÉLECTROMAGNÉTIQUE .....</b>	<b>461</b>
24.1 Introduction.....	461
24.2 Rappels sur le champ électromagnétique.....	461
24.3 La protection par écrans ou blindages .....	463
24.3.1 L'impédance de l'onde .....	464
24.3.2 Les pertes par absorption .....	466
24.3.3 Les pertes par réflexion.....	466
24.3.4 Remarques générales .....	467
24.4 Les couplages.....	468
24.4.1 Le couplage par impédance commune sur une liaison symétrique et asymétrique .....	468
24.4.2 Le couplage entre conducteurs par couplage capacitif .....	470
24.4.3 Le couplage magnétique (couplage inductif).....	471
24.5 La foudre.....	477
24.5.1 Les conséquences de la foudre.....	478
24.5.2 Le risque en conduction .....	478
24.5.3 Le risque lié au rayonnement.....	479

---

<b>25 TEST DES CONVERTISSEURS ANALOGIQUES-NUMÉRIQUES .....</b>	<b>481</b>
25.1 Introduction.....	481
25.2 Les caractéristiques de base .....	481
25.2.1 La non-linéarité différentielle .....	483
25.2.2 La non-linéarité intégrale.....	484
25.2.3 L'erreur de décalage .....	485
25.2.4 L'erreur de gain .....	486
25.3 Les tests dynamiques .....	487
25.3.1 La distorsion harmonique .....	487
25.3.2 La distorsion d'inter-modulation .....	488
25.3.3 Le rapport signal à bruit.....	489
25.3.4 Méthode statistique.....	490
25.3.5 Méthode par ajustement d'une sinusoïde .....	494
<b>26 SUR-ÉCHANTILLONNAGE DES CAN .....</b>	<b>497</b>
26.1 Introduction.....	497
26.2 La quantification différentielle [46].....	497
26.3 La prédition linéaire .....	498
26.3.1 Prédition linéaire à l'ordre 1 .....	498
26.3.2 Prédition linéaire à l'ordre p .....	499
26.4 Les modulateurs sigma-delta .....	501
26.4.1 Principe du modulateur sigma-delta d'ordre 1 .....	501
26.4.2 Principe du modulateur sigma-delta à l'ordre 2.....	505
26.4.3 Performances d'un système d'ordre n .....	507
26.5 Applications .....	509
26.5.1 Modulation d'un canal de transmission.....	509
26.5.2 Conversion Analogique-Numérique à grande dynamique.....	510
<b>27 LA PRÉDICTION ET L'ESTIMATION .....</b>	<b>511</b>
27.1 Introduction.....	511
27.2 Filtres d'innovation et de blanchiment .....	512
27.3 La matrice de corrélation .....	514
27.4 Cas discret.....	519
27.5 Les densités spectrales rationnelles .....	524
27.5.1 Processus AR .....	525
27.5.2 Processus MA .....	526
27.5.3 Processus ARMA.....	527
27.6 La prédition linéaire .....	528
27.7 La prédition avant .....	529
27.8 La prédition arrière.....	532
27.9 Relations entre les prédicteurs avant et arrière .....	535
27.10 Structure de filtre en treillis .....	537
27.10.1 L'algorithme de Levinson-Durbin .....	540
27.10.2 L'algorithme de Levinson-Durbin inverse .....	547
27.10.3 Les équations de Yule-Walker.....	548
27.11 Introduction aux algorithmes de filtrage adaptatif.....	552

27.11.1 Les méthodes d'optimisation les plus utilisées en filtrage adaptatif .....	553
27.12 Filtrage optimal au sens de Wiener.....	556
27.13 Filtre de Wiener à réponse impulsionale finie .....	557
27.14 Le principe d'orthogonalité.....	558
27.15 L'équation de Wiener-Hopf.....	559
27.15.1 Forme canonique de l'erreur quadratique moyenne .....	563
27.15.2 Inconvénients de la méthode .....	563
27.16 L'algorithme du gradient déterministe ou de la plus grande pente.....	563
27.16.1 Cas du filtrage de Wiener .....	564
27.16.2 Convergence de l'algorithme du gradient déterministe.....	565
27.17 L'algorithme du gradient stochastique.....	574
27.17.1 Convergence de l'algorithme du gradient stochastique.....	575
27.18 Le filtrage de Kalman .....	584
27.18.1 Modélisation dans l'espace d'état.....	584
27.18.2 La conception de l'observation.....	585
27.19 Le filtre de Kalman discret .....	586
27.19.1 Le principe d'orthogonalité revisité.....	587
27.19.2 Le processus d'innovation .....	589
27.19.3 La matrice de corrélation du processus d'innovation .....	590
27.19.4 La matrice de corrélation de l'erreur d'estimation de l'équation d'état et l'équation de Riccati .....	591
27.19.5 Le prédicteur de Kalman.....	591
27.19.6 L'équation de Riccati.....	595
27.19.7 Le filtrage.....	596
27.19.8 Mise en œuvre de l'algorithme de Kalman.....	597
<b>28 ESTIMATION SPECTRALE.....</b>	<b>601</b>
28.1 Introduction.....	601
28.2 Choix d'un estimateur.....	601
28.3 Le périodogramme .....	604
28.3.1 Estimateur non-biaisé de la fonction d'auto-corrélation.....	606
28.3.2 Estimateur biaisé de la fonction d'auto-corrélation .....	607
28.3.3 Estimation de la densité spectrale .....	609
28.4 Les méthodes non-paramétriques d'estimation .....	614
28.4.1 La méthode de Bartlett.....	614
28.4.2 La méthode de Welch .....	616
28.4.3 La méthode de Blackman et Tukey .....	619
28.4.4 Performances comparées des estimateurs non-paramétriques de la densité spectrale .....	620
28.5 Les méthodes paramétriques d'estimation de la densité spectrale.....	621
28.5.1 Les relations entre la fonction d'auto-corrélation et les paramètres du modèle.....	622
28.5.2 La méthode de Yule-Walker pour le modèle AR .....	623

28.5.3 La méthode de Burg.....	625
28.6 La méthode du minimum de variance de Capon .....	631
28.7 Décomposition en éléments propres de la matrice de corrélation .....	636
28.7.1 Introduction au modèle harmonique .....	636
28.7.2 Sinusoïdes entachées d'un bruit blanc .....	638
28.7.3 Généralisation avec une exponentielle complexe.....	641
28.7.4 Résumé de la décomposition en éléments propres .....	643
28.7.5 Méthode de décomposition harmonique de Pisarenko .....	644
28.7.6 Résumé de l'estimation selon la méthode de Pisarenko .....	647
28.7.7 La méthode MUSIC .....	651
<b>29 ANNEXES.....</b>	<b>655</b>
29.1 Les décibels.....	655
29.2 Spectre électromagnétique .....	657
29.3 Formulaire trigonométrique .....	659
<b>BIBLIOGRAPHIE.....</b>	<b>661</b>
<b>INDEX .....</b>	<b>663</b>