

不变分布

遗传学中的马尔可夫链及哈代-温伯格定律

例子

第 19 讲 不变分布

不变分布

遗传学中的马尔可夫链及哈代-温伯格定律

例子

不变分布

遗传学中的马尔可夫链及哈代-温伯格定律

例子

设 P 是马氏链 $\{X_n\}$ 的转移概率矩阵, 给定 X_0 的概率分布

$$\boldsymbol{\pi}^{(0)} = [\pi_1, \pi_2, \cdots].$$

我们知 X_n 的概率分布

$$\boldsymbol{\pi}^{(n)} = [\pi_1^{(n)}, \pi_2^{(n)}, \cdots],$$

其中 $\pi_j^{(n)} = P(X_n = j)$, 满足

$$\boldsymbol{\pi}^{(n)} = \boldsymbol{\pi}^{(n-1)}P = \boldsymbol{\pi}^{(0)}P^n, \quad n \geq 1.$$

命题 1.1

如果 $\pi^{(1)} = \pi^{(0)}$, 则 $\pi^{(n)} = \pi^{(0)}$.

上面命题说明只要 $\pi^{(1)} = \pi^{(0)}$, 则 X_n 和 X_0 同分布. 概率分布 $\pi^{(1)} = \pi^{(0)}$ 等价于 $\pi^{(0)} = \pi^{(0)}P$. 也等价于

$$\sum_{j \in I} \pi_j = 1, \pi_j = \sum_{k \in I} \pi_k p_{kj} \geq 0, j \in I. \quad (1.1)$$

定义 1.2

如果 $\pi = [\pi_1, \pi_2, \dots, \dots]$ 满足 (1.1), 或等价地满足

$$\sum_{j \in I} \pi_j = 1, \quad \pi = \pi P, \quad (1.2)$$

则称 π 是马氏链 $\{X_n\}$ 或转移矩阵 P 的不变分布.

定理 1.3

设 C^+ 是马氏链 $\{X_n\}$ 的所有正常返状态, $i \in C^+$.

(1) 如果 C^+ 是遍历等价类, 则

$$\pi_j = \lim_{n \rightarrow \infty} p_{ij}^{(n)} = 1/\mu_j, j \in I$$

是唯一不变分布.

(2) 如果 C^+ 是周期为 d 的等价类, 则

$$\pi_j = \frac{1}{d} \lim_{n \rightarrow \infty} p_{ij}^{(nd)} = \lim_{n \rightarrow \infty} \frac{1}{d} \sum_{s=1}^d p_{ij}^{(nd+s)} = \lim_{n \rightarrow \infty} \frac{1}{n} \sum_{k=1}^n p_{ij}^{(k)}, j \in I$$

是唯一不变分布, 且 $\pi_j = 1/\mu_j$;

(3) 若 C^+ 非空, 则 $\{X_n\}$ 有唯一不变分布的充分必要条件是 C^+ 是等价类;

(4) $\{X_n\}$ 有不变分布的充分必要条件是 C^+ 非空;

(5) 状态有限的马氏链必有不变分布.

不变分布

遗传学中的马尔可夫链及哈代-温伯格定律

例子

证明.

只对 C^+ 是有限集合的情形给出证明.

(1) 我们知

$$\pi_j = \lim_{n \rightarrow \infty} p_{ij}^{(n)} = \begin{cases} 0, & j \notin C^+, \\ 1/\mu, & j \in C^+. \end{cases}$$

因为质点从 i 出发不能走出 C^+ , 所以有

$$\sum_{j \in I} p_{ij}^{(n)} = \sum_{j \in C^+} p_{ij}^{(n)} = 1.$$

令 $n \rightarrow \infty$, 得到 $\sum_{j \in I} \pi_j = \sum_{j \in C^+} \pi_j = 1$. 再利用 K-C 方程得到

$$\begin{aligned} \pi_j &= \lim_{n \rightarrow \infty} p_{ij}^{(n)} = \lim_{n \rightarrow \infty} \sum_{k \in C^+} p_{ik}^{(n-1)} p_{kj} \\ &= \sum_{k \in C^+} \pi_k p_{kj}, \end{aligned}$$

上述等式说明 $\{\pi_j\}$ 是不变分布.

不变分布

遗传学中的马尔可夫链及哈代-温伯格定律

例子

证明.

再证明唯一性. 如果 $\{\pi'_j\}$ 也是不变分布, 则对于 $j \notin C^+$, 我们有 $p_{kj}^{(n)} \rightarrow 0$. 由于 $\sum_{j \in I} \pi'_j = 1$, 我们知对任意 $\varepsilon > 0$ 存在有限集 I' 使得 $\sum_{j \notin I'} \pi'_j < \varepsilon$. 同时存在 $N \in \mathbb{N}$ 使得当 $n > N$ 时有对于任意 $k \in I'$, $p_{kj}^{(n)} < \varepsilon$. 于是

$$\pi'_j = \sum_{k \in I} \pi'_k p_{kj}^{(n)} = \sum_{k \in I'} \pi'_k p_{kj}^{(n)} + \sum_{k \notin I'} \pi'_k p_{kj}^{(n)} < 2\varepsilon.$$

于是 $\pi'_j = 0 = \pi_j$. 对于 $j \in C^+$, 由于

$$\pi'_j = \sum_{k \in I} \pi'_k p_{kj}^{(n)} = \sum_{k \in C^+} \pi'_k p_{kj}^{(n)} \rightarrow \left(\sum_{k \in C^+} \pi'_k \right) \pi_j = \pi_j,$$

所以 $\pi'_j = \pi_j$.

证明.

(2) 当 $j \notin C^+$ 时, 我们知道这 3 个极限都是 0. 当 $j \in C^+$ 时, 我们知这三个极限都是 $1/\mu_j$, 于是

$$\pi_j = \begin{cases} 0, & j \notin C^+, \\ 1/\mu_j, & j \in C^+. \end{cases}$$

我们先验证 π_j 是不变分布. 注意 $i \in C^+$, 我们有

$$\begin{aligned} \pi_j &= \lim_{n \rightarrow \infty} \frac{1}{d} \sum_{s=1}^d p_{ij}^{(nd+s)} \\ &= \lim_{n \rightarrow \infty} \sum_{s=1}^d \frac{1}{d} \sum_{k \in C^+} p_{ik}^{(nd+s-1)} p_{kj} \quad (\text{用 } K-C \text{ 方程}) \\ &= \sum_{k \in C^+} \lim_{n \rightarrow \infty} \frac{1}{d} \sum_{s=1}^d p_{ik}^{(nd+s-1)} p_{kj} \\ &= \sum_{k \in C^+} \pi_k p_{kj} = \sum_{k \in I} \pi_k p_{kj}. \end{aligned}$$

不变分布

遗传学中的马尔可夫链及哈代-温伯格定律

例子

证明.

又由 $\sum_{j \in C^+} p_{ij}^{(nd+s)} = 1$, 我们有

$$\sum_{j \in I} \pi_j = \sum_{j \in C^+} \pi_j = \sum_{j \in C^+} \lim_{n \rightarrow \infty} \frac{1}{d} \sum_{s=1}^d p_{ij}^{(nd+s)} = \lim_{n \rightarrow \infty} \frac{1}{d} \sum_{s=1}^d \sum_{j \in C^+} p_{ij}^{(nd+s)} = 1.$$

由上我们知 $\{\pi_j\}$ 是不变分布.

证明.

下面证明唯一性. 如果 $\{\pi'_k\}$ 也是不变分布, 则对于 $j \notin C^+$, 由命题 ?? 我们有

$$\pi'_j = \sum_{k \in I} \pi'_k p_{kj}^{(nd+s)} \rightarrow 0, \quad n \rightarrow \infty,$$

于是 $\pi'_j = \pi_j = 0$. 于是 $j \in C^+$, 我们有

$$\pi'_j = \sum_{k \in I} \pi'_k p_{kj}^{(nd+s)} = \sum_{k \in C^+} \pi'_k p_{kj}^{(nd+s)}, \quad s = 1, 2, \dots, d.$$

两边对 s 求平均后, 令 $n \rightarrow \infty$ 我们有

$$\pi'_j = \sum_{k \in C^+} \pi'_k \frac{1}{d} \sum_{s=1}^d p_{kj}^{(nd+s)} \rightarrow \sum_{k \in C^+} \pi'_k \pi_j = \pi_j.$$

故 $\pi'_j = \pi_j$.

不变分布

遗传学中的马尔可夫链及哈代-温伯格定律

例子

证明.

- (3) 如果 C^+ 是一个正常返等价类, 由 (1) 和 (2) 我们知不变分布存在且唯一. 如果 C^+ 至少有两个正常返等价类 C_1, C_2 . 在马氏链的分解中 C_1, C_2 对应的矩阵分别是 P_1, P_2 , 则按照本定理的 (1) 和 (2), 有分布列 π_1 和 π_2 使得

$$\pi_1 = \pi_1 P_1, \quad \pi_2 = \pi_2 P_2.$$

对于任意 $p = 1 - q \in [0, 1]$, 定义

$$\pi = [p\pi_1, q\pi_2, 0, \dots, 0], \quad (1.3)$$

回顾

$$\begin{array}{c} C_1 \\ C_2 \\ \vdots \\ C_m \\ T \end{array} \begin{pmatrix} C_1 & C_2 & \cdots & C_{m-1} & C_m & T \\ \left(\begin{array}{cccccc} P_1 & 0 & \cdots & 0 & 0 & 0 \\ 0 & P_2 & \cdots & 0 & 0 & 0 \\ \vdots & \vdots & & \vdots & \vdots & \vdots \\ 0 & 0 & \cdots & 0 & P_m & 0 \\ R_1 & R_2 & \cdots & R_{m-1} & R_m & Q_T \end{array} \right) \end{pmatrix} = P. \quad (1.4)$$

证明.

则对于 (1.4) 定义的 P , 我们有

$$\begin{aligned}
 \pi P &= [p\pi_1, q\pi_2, 0, \dots, 0] \begin{pmatrix} C_1 & P_1 & 0 & \cdots & 0 & 0 & 0 \\ C_2 & 0 & P_2 & \cdots & 0 & 0 & 0 \\ \vdots & \vdots & \vdots & & \vdots & \vdots & \vdots \\ C_m & 0 & 0 & \cdots & 0 & P_m & 0 \\ T & R_1 & R_2 & \cdots & R_{m-1} & R_m & Q_T \end{pmatrix} \\
 &= [p\pi_1 P_1, q\pi_2 P_2, 0, \dots, 0] \\
 &= [p\pi_1, q\pi_2, 0, \dots, 0] \\
 &= \pi.
 \end{aligned}$$

这说明任何组合 (1.3) 都是不变分布, 即不变分布有无穷个.

证明.

- (4) 当 C^+ 非空时, 它就至少有一个正常返等价类, 由 (3) 我们知不变分布存在. 如果 C^+ 是空集, 那么我们知对任意 $i, j \in I$, 有 $p_{kj}^{(n)} \rightarrow 0$. 设 π 是不变分布, 则由 $\pi = \pi P$ 得到 $\pi = \pi P^{(n)}$, 从而得到

$$\pi_j = \sum_{k \in I} \pi_k p_{kj}^{(n)} \rightarrow 0, \quad n \rightarrow \infty.$$

这与 $\sum_{j \in I} \pi_j = 1$ 矛盾.

- (5) 有限状态马氏链至少有一个正常返状态, 由 (4) 我们知不变分布必然存在. □

命题 1.4

设 $P = (P_1, P_2, \dots, P_m)$ 是马氏链的一步转移概率矩阵, P_j 是 P 的第 j 列, 则方程组

$$\pi = \pi P, \quad \sum_{j=1}^m \pi_j = 1 \quad (1.5)$$

和

$$[\pi_1, \pi_2, \dots, \pi_{m-1}] = \pi(P_1, P_2, \dots, P_{m-1}), \quad \sum_{j=1}^m \pi_j = 1 \quad (1.6)$$

有相同的解.

证明.

(1.5) 的方程数比 (1.6) 多一个, 所以 (1.5) 的解也是 (1.6) 的解. 如果 π 满足 (1.6), 对 $j = 1, 2, \dots, m-1$ 有 $\pi_j = \pi P_j$, 于是由

$$\sum_{j=1}^m \pi_j = 1, \quad \sum_{j=1}^m P_j = \mathbf{1}, \quad \pi \mathbf{1} = 1,$$

其中 $\mathbf{1}$ 表示元素都是 1 的向量, 我们得到

$$\pi P_m = \pi \left(\mathbf{1} - \sum_{j=1}^{m-1} P_j \right) = 1 - \sum_{j=1}^{m-1} \pi P_j = 1 - \sum_{j=1}^{m-1} \pi_j = \pi_m,$$

从而得证. □

不变分布

遗传学中的马尔可夫链及哈代-温伯格定律

例子

- ▶ 考察一个包含很多个体的总体, 每个个体有一对特殊的基因, 其中的单个基因分别为 A 型与 a 型.
- ▶ 假定基因对是 AA, aa 或 Aa 的个体的比例分别为 p_0 , q_0 和 r_0 ($p_0 + q_0 + r_0 = 1$). 当两个个体交配时, 每一个个体随机地选取自己基因中的一个遗传到后代.
- ▶ 假定交配是随机发生的, 即每个个体等可能地与其他任意一个个体交配, 我们想要确定下一代中基因为 AA, aa 或 Aa 的个体的比例.
- ▶ 令此比例为 p , q 和 r , 它们容易由下述途径得到: 通过观察下一代的一个个体, 并确定其基因对的概率.

首先, 随机地选取一个亲本, 然后随机地选取它的一个基因, 这等价于随机地从全部基因中选取一个基因. 以该亲本的基因对为条件, 我们有一个随机选取的基因是 A 型的概率是

$$P(A) = P(A|AA)p_0 + P(A|aa)q_0 + P(A|Aa)r_0 = p_0 + r_0/2.$$

类似地, 它为 a 型的概率是

$$P(a) = q_0 + r_0/2.$$

因此, 在随机交配下, 一个随机选取的下一代成员为 AA 型的概率是 p , 其中

$$p = P(A)P(A) = (p_0 + r_0/2)^2.$$

类似地, 随机选取的成员为 aa 型的概率为

$$q = P(a)P(a) = (q_0 + r_0/2)^2.$$

为 Aa 型的概率为

$$r = 2P(A)P(a) = 2(p_0 + r_0/2)(q_0 + r_0/2).$$

由于下一代成员每个个体独立地以概率 p, q, r 为这三种基因型中的一种, 因此下一代成员是 AA, aa 或 Aa 型的百分比分别为 p, q 和 r .

如果我们考虑下一代的整体基因库, 那么基因 A 的比例为

$$\begin{aligned} p + r/2 &= (p_0 + r_0/2)^2 + (q_0 + r_0/2)^2 + 2(p_0 + r_0/2)(q_0 + r_0/2) \\ &= (p_0 + r_0/2)(p_0 + r_0/2 + q_0 + r_0/2) \\ &= p_0 + r_0/2 = P(A). \end{aligned}$$

因此, 在基因库中, A 和 a 的比例和初始代的相同. 由此推出在随机交配的情况下, 在初始代以后的所有相继的代中, 基因对为 AA , aa 或 Aa 的个体在总体中的百分比仍为 p , q 和 r , 这称为**哈代-温伯格定律**.

现在假设基因对总体已经稳定在百分比 p, q, r . 我们考虑单个个体的后代的基因型. 对于一个给定的个体, 设 X_n 为其第 n 代后代的基因型. 我们知 X_n 构成一个马氏链, 转移概率为

$$\begin{array}{c} AA \\ aa \\ Aa \end{array} \begin{array}{ccc} AA & aa & Aa \\ \left(\begin{array}{ccc} p + \frac{r}{2} & 0 & q + \frac{r}{2} \\ 0 & q + \frac{r}{2} & p + \frac{r}{2} \\ \frac{p}{2} + \frac{r}{4} & \frac{q}{2} + \frac{r}{4} & \frac{p}{2} + \frac{q}{2} + \frac{r}{2} \end{array} \right) \end{array} \quad (2.1)$$

显然, 这个马氏链的极限概率为 p, q 和 r . 实际上这个马氏链是不可约, 正常返的, 且不难验证 (p, q, r) 是它的不变分布.

不变分布

遗传学中的马尔可夫链及哈代-温伯格定律

例子

例 3.1

设马氏链的状态空间是 $I = \{1, 2\}$, 转移矩阵是

$$P = \begin{pmatrix} 3/4 & 1/4 \\ 5/8 & 3/8 \end{pmatrix}.$$

- (1) 计算不变分布 π 和极限 $\lim_{n \rightarrow \infty} P^n$;
- (2) 计算状态 1, 2 的期望返回时间 μ_1, μ_2 .

解.

(1) 马氏链互通, 是一个遍历等价类. 解方程

$$\begin{cases} p_1 = \frac{3}{4}p_1 + \frac{5}{8}p_2, \\ p_1 + p_2 = 1 \end{cases}$$

得到不变分布 $\pi = (5/7, 2/7)$. 由于马氏链是遍历的, 由定理 1.3 (1) 我们有

$$\lim_{n \rightarrow \infty} P^n = \lim_{n \rightarrow \infty} \begin{pmatrix} P_{11}^{(n)} & p_{12}^{(n)} \\ p_{21}^{(n)} & p_{22}^{(n)} \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} \pi_1 & \pi_2 \\ \pi_1 & \pi_2 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 5/7 & 2/7 \\ 5/7 & 2/7 \end{pmatrix}.$$

(2) 根据公式 $\pi_j = 1/\mu_j$ 我们有 $\mu_1 = 7/5$, $\mu_2 = 7/2$. □

例 3.2: Ehrenfest 模型

容器内有 $2a$ 个粒子, 一张薄膜将该容器分成对称的 A, B 两部分. 将粒子穿过薄膜时占用的时间忽略不计. 用 X_0 表示初始时 A 中的粒子数, X_n 表示有 n 个粒子穿过薄膜后 A 中的粒子数, X_n 表示有 n 个粒子穿过薄膜后 A 中的粒子数. 当所有粒子以相同的规律独立行动时, $\{X_n\}$ 是马氏链, 有状态空间 $I = \{0, 1, 2, \dots, 2a\}$. 设马氏链 $\{X_n\}$ 有转移概率

$$p_{ij} = \begin{cases} \frac{2a-i}{2a}, & 0 \leq i \leq 2a-1, j = i+1, \\ \frac{i}{2a}, & 1 \leq i \leq 2a, j = i-1, \\ 0, & \text{其他.} \end{cases}$$

计算该马氏链的不变分布.

不变分布

遗传学中的马尔可夫链及哈代-温伯格定律

例子

解.

从问题的背景知道这是一个正常返马氏链, 周期等于 2, 不变分布唯一存在.

补充定义 $\pi_{-1} = \pi_{2a+1} = 0$, 可将方程组 $\pi = \pi P$ 写成

$$\pi_i = \pi_{i-1}p_{i-1,i} + \pi_{i+1}p_{i+1,i}, \quad 0 \leq i \leq 2a.$$

于是有

$$\pi_{i+1} = \frac{\pi_i - \pi_{i-1}p_{i-1,i}}{p_{i+1,i}}.$$

解.

经过计算依次得到

$$\pi_1 = \frac{\pi_0}{p_{10}} = 2a\pi_0 = C_{2a}^1\pi_0,$$

$$\pi_2 = \frac{\pi_1 - \pi_0 p_{01}}{p_{21}} = (\pi_1 - \pi_0)2a/2 = (2a - 1)a\pi_0 = C_{2a}^2\pi_0,$$

$$\pi_3 = \frac{\pi_2 - \pi_1 p_{12}}{p_{32}} = (\pi_2 - \pi_1 p_{12})2a/3 = C_{2a}^3\pi_0,$$

.....

$$\pi_a = C_{2a}^{2a}\pi_0.$$

解.

利用 $\pi_0 + \pi_1 + \cdots + \pi_{2a} = 2^{2a}\pi_0 = 1$ 得到 $\pi_0 = 2^{-2a}$. 最后得到不变分布

$$\pi_i = C_{2a}^i \left(\frac{1}{2}\right)^i \left(\frac{1}{2}\right)^{2a-i}, \quad 0 \leq i \leq 2a.$$

这是二项分布 $B(2a, 1/2)$, 表明在不变分布下或时间充分长之后, 个粒子的位置是相互独立的, 每个粒子位于 A 中的概率是 $1/2$. \square

例 3.3

某农用拖拉机站每季度对拖拉机进行一次检查和维修. 根据零件磨损程度和运行率, 拖拉机可分成 5 种状态: $E = \{1, 2, 3, 4, 5\}$. 已知当拖拉机处于状态 1, 2, 3, 4, 5 时, 过去的三个季度拖拉机站可获利润分别为 5000 元, 4000 元, 3000 元, 2000 元, 0 元. 为了提高经济效益, 可以规定拖拉机处于状态 5, 或处于状态 5, 4 或处于状态 5, 4, 3 时要进行维修. 平均修理费用如下: 处于状态 3 时, 修理费用为 300 元; 处于状态 4 时, 修理费用为 500 元; 处于状态 5 时, 修理费用为 1000 元. 假定每次修理之后, 拖拉机可以恢复到状态 1. 根据过去资料, 拖拉机据状态转移概率矩阵为 (处于状态 5 时进行修理)

$$P = \begin{bmatrix} 0 & 0.6 & 0.2 & 0.1 & 0.1 \\ 0 & 0.3 & 0.4 & 0.2 & 0.1 \\ 0 & 0 & 0.4 & 0.4 & 0.2 \\ 0 & 0 & 0 & 0.5 & 0.5 \\ 1 & 0 & 0 & 0 & 0 \end{bmatrix} \quad (3.1)$$

- (1) 求运行若干季度后, 拖拉机处于各个状态的平稳分布;
- (2) 求拖拉机站每季度的平均利润;
- (3) 如何确定拖拉机的修理方案, 才能使拖拉机站每季度的平均修理费用最少?

不变分布

遗传学中的马尔可夫链及哈代-温伯格定律

例子

解.

下面考虑 3 种不同修理方案. (i) 假定拖拉机处于状态 5 时进行修理, 其他状态继续运行. 在这种方案下, 转移概率矩阵为 (3.1). 求解方程组

$$\begin{cases} \pi P = \pi, \\ \pi_1 + \pi_2 + \pi_3 + \pi_4 + \pi_5 = 1, \\ \pi_1, \pi_2, \pi_3, \pi_4, \pi_5 \geq 0, \end{cases}$$

得平稳分布

$$\pi = (0.199, 0.170, 0.180, 0.252, 0.199).$$

如果按照上述修理方案, 长期运行下去, 逐渐趋于平稳, 拖拉机站每季度的平均利润为

$$5000 \times 0.199 + 4000 \times 0.170 + 3000 \times 0.180 + 2000 \times 0.252 = 2719 \text{ (元)},$$

每季度的平均修理费用为

$$1000 \times 0.199 = 199 \text{ (元)}.$$

解.

(ii) 假定拖拉机处于状态 5, 4 时才进行修理, 其他状态继续运行. 在这种方案下, 转移概率矩阵为

$$P = \begin{bmatrix} 0 & 0.6 & 0.2 & 0.1 & 0.1 \\ 0 & 0.3 & 0.4 & 0.2 & 0.1 \\ 0 & 0 & 0.4 & 0.4 & 0.2 \\ 1 & 0 & 0 & 0 & 0 \\ 1 & 0 & 0 & 0 & 0 \end{bmatrix}$$

可以计算其平稳分布为

$$\pi = (0.266, 0.228, 0.241, 0.168, 0.097).$$

拖拉机站每季度的平均利润为

$$5000 \times 0.266 + 4000 \times 0.228 + 3000 \times 0.241 + 2000 \times 0.168 = 3301 \text{ (元)}.$$

每季度的平均修理费用为

$$1000 \times 0.097 + 500 \times 0.168 = 181 \text{ (元)}.$$

不变分布

遗传学中的马尔可夫链及哈代-温伯格定律

例子

解.

(iii) 假定拖拉机处于状态 5, 4, 3 时才进行修理, 其他状态继续运行. 在这种方案下, 转移概率矩阵为

$$P = \begin{bmatrix} 0 & 0.6 & 0.2 & 0.1 & 0.1 \\ 0 & 0.3 & 0.4 & 0.2 & 0.1 \\ 1 & 0 & 0 & 0 & 0 \\ 1 & 0 & 0 & 0 & 0 \\ 1 & 0 & 0 & 0 & 0 \end{bmatrix}$$

可以计算其平稳分布为

$$\pi = (0.350, 0.300, 0.190, 0.095, 0.065).$$

拖拉机站每季度的平均利润为

$$5000 \times 0.350 + 4000 \times 0.300 + 3000 \times 0.190 + 2000 \times 0.095 = 3710 \text{ (元)}.$$

每季度的平均修理费用为

$$1000 \times 0.065 + 500 \times 0.095 + 300 \times 0.19 = 169.5 \text{ (元)}.$$

综合上述讨论, 采用方案 (iii) 时拖拉机站每季度的平均利润最多, 平均修理费用最少. □

不变分布

遗传学中的马尔可夫链及哈代-温伯格定律

例子