



浙江大学
Zhejiang University

数学建模

浙江大学数学系 谈之奕

tanzy@zju.edu.cn



浙江大学
Zhejiang University

基本数学模型

传染病模型

传染病

- **传染病**（infectious diseases）是由各种病原体引起的，能在人与人、动物与动物、人与动物之间互相传播的一种疾病
- 传染病得以在某一人群中发生和传播，必须具备**传染源**、**传播途径**和**易感人群**三个基本环节
- **流行病学**（epidemiology）是研究疾病在人群中发生、发展和分布规律的科学
- **地方病**（endemic diseases）指局限在某些地方发生的疾病

传染病模型

- 自1927年起，英国数学家、流行病学家 William Ogilvy Kermack (1898–1970) 和 Anderson Gray McKendrick (1876–1943) 在 *Proceedings of the Royal Society of London A* 上先后发表三篇论文，提出了揭示传染病传播规律的仓室 (compartment) 模型
 - A Contribution to the Mathematical Theory of Epidemics, 115, 700-721, 1927
 - II. The Problem of Endemicity, 138, 55-83, 1932
 - III. Further Studies of the Problem of Endemicity, 141, 94-122, 1933



创刊于1800年，1854年改用现名。Maxwell 电磁场理论，DNA双螺旋结构等重要论文均发表在该刊上

基本假设

- 人群分类
 - 易感者 (Susceptible) : 易受疾病感染但尚未发病
 - 感染者 (Infective) : 已感染且具传染性
- 在疾病传播期内所考察地区总人数 N 保持不变
- t 时刻易感者和感染者人数所占比例分别为 $S(t)$ 和 $I(t)$, $S(t) + I(t) = 1$
- 每个感染者单位时间内可使数量为 βN 的人受到感染, 其中易感者数量为 βS , β 称为有效接触率



SI模型



浙江大学

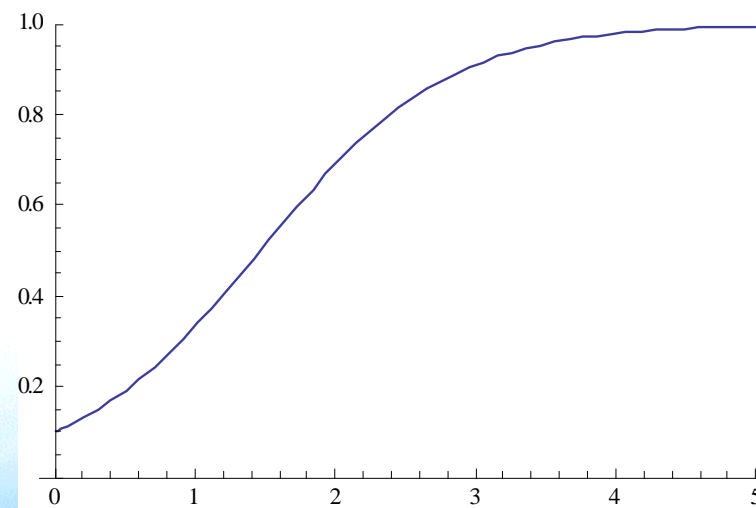
Zhejiang University

数学建模

$$N \frac{dI}{dt} = \beta N S I \Rightarrow \frac{dI}{dt} = \beta I (1 - I) \Rightarrow \frac{1}{I(1-I)} dI = \beta dt$$

$$S(t) + I(t) = 1 \quad I(0) = I_0$$

$$I(t) = \frac{1}{1 + \left(\frac{1}{I_0} - 1 \right) e^{-\beta t}}$$



模型分析

- $I(t)$ 单调增加, $\lim_{t \rightarrow \infty} I(t) = 1$, 所有人最终都将被感染
- 当 $I(t) = \frac{1}{2}$, 即 $t_m = \frac{1}{\beta} \ln \left(\frac{1}{I_0} - 1 \right)$ 时, $\frac{dI}{dt}$ 达到最大值, 该时刻为感染者增加最快时刻, t_m 与 β 成反比
- 传染病防治水平越高, β 越小, 传染病高峰达到时刻越晚

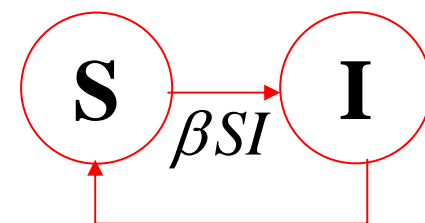
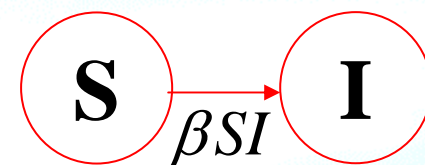
$$\frac{dI}{dt} = \beta I(1 - I)$$

$$\frac{d^2 I}{dt^2} = \beta(1 - 2I) \frac{dI}{dt}$$

$$\frac{dI}{dt} = \frac{\beta e^{-\beta t} \left(\frac{1}{I_0} - 1 \right)}{\left(1 + \left(\frac{1}{I_0} - 1 \right) e^{-\beta t} \right)^2}$$

治愈

- 感染者经治疗后可以痊愈，重新成为易感者
- 单位时间内被治愈的感染者占总数的比例为 α



$$N \frac{dI}{dt} = \beta NSI - \alpha NI \Rightarrow \frac{dI}{dt} = \beta I(1 - I) - \alpha I$$

$$\sigma = \frac{\beta}{\alpha} \Rightarrow \frac{dI}{dt} = -\beta I \left(I - \left(1 - \frac{1}{\sigma} \right) \right)$$

SIS模型

$$\begin{cases} \frac{dI}{dt} = \beta I(1-I) - \alpha I \\ I(0) = I_0 \end{cases} \quad \left(\frac{\beta}{(\beta - \alpha) - \beta I} + \frac{1}{I} \right) dI = (\beta - \alpha) dt$$

$$I(t) = \begin{cases} \left(\left(\frac{1}{I_0} - \frac{1}{1 - \frac{1}{\sigma}} \right) e^{-(\beta - \alpha)t} + \frac{1}{1 - \frac{1}{\sigma}} \right)^{-1}, & \beta \neq \alpha \\ \frac{I_0}{\beta t I_0 + 1}, & \beta = \alpha \end{cases} \quad \sigma = \frac{\beta}{\alpha}$$
$$\lim_{t \rightarrow \infty} I(t) = \begin{cases} 1 - \frac{1}{\sigma} & \sigma > 1 \\ 0 & \sigma \leq 1 \end{cases}$$

SIS模型

- $\sigma > 1$ 时
 - $I_0 < 1 - \frac{1}{\sigma}$ 时, $I(t)$ 单调递增
 - $I_0 > 1 - \frac{1}{\sigma}$ 时, $I(t)$ 单调递减
- $\sigma \leq 1$ 时, $\frac{dI}{dt} \leq 0$, $I(t)$ 单调递减
- 为遏制传染病, 必须减小 σ 值
 - 增大 α 值, 提高医疗水平, 加快治愈进程
 - 减少 β 值, 提高防治水平, 控制传播途径

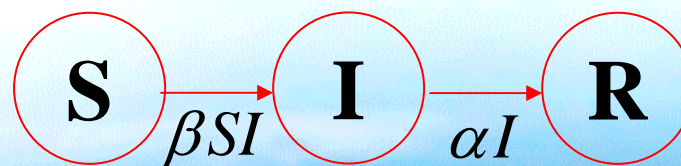
$$\frac{dI}{dt} = -\beta I \left(I - \left(1 - \frac{1}{\sigma} \right) \right)$$

$$\sigma \leq 1$$
$$\beta > \alpha$$

移出

- 某些传染病治愈后会产生免疫力，形成既非易感者，也非感染者的群体，称为移出者（**Removed**）
 - 移出的原因包括发病后隔离、死亡等
- 记 t 时刻移出者所占比例为 $R(t)$

$$N \frac{dR}{dt} = \alpha NI$$



SIR模型



浙江大学
Zhejiang University

数学建模

$$\begin{cases} \frac{dS}{dt} = -\beta SI \\ \frac{dI}{dt} = \beta SI - \alpha I \\ \frac{dR}{dt} = \alpha I \end{cases}$$

$$\begin{cases} \frac{dS}{dt} = -\beta SI \\ \frac{dI}{dt} = (\beta S - \alpha)I \end{cases}$$

$$S(0) = S_0, I(0) = I_0, R(0) = R_0$$

一阶非线性常微分方程组

$$S(t) + I(t) + R(t) = 1$$

定性理论



浙江大学
Zhejiang University

数学建模

- 微分方程解的分析方法
 - 求方程的解析解
 - 利用数值方法求方程的数值解
 - 对解的性状作定性分析
- 19世纪末，**Poincaré**和**Lyapunov**分别创立了常微分方程定性理论和稳定性理论



**Jules Henri
Poincaré**
(1854—
1912)

法国数学家、
物理学家



**Aleksandr
Mikhailovich
Lyapunov**
(1857—
1918)

苏联数学家、
物理学家

自治系统

- 记 $\mathbf{x} = (x_1, x_2)^T$, $\mathbf{F}(t, \mathbf{x}) = (f_1(t, \mathbf{x}), f_2(t, \mathbf{x}))^T$, 一阶常微分方程组 $\frac{d\mathbf{x}}{dt} = \mathbf{F}(t, \mathbf{x})$ 称为自治 (autonomous) 的, 若 $\mathbf{F}(t, \mathbf{x})$ 不显含 t
 - \mathbf{x} 所属空间 \mathbb{R}^2 称为相空间
 - 方程组的解在平面上对应的曲线称为相轨线, 并按 t 增加的方向定义正向
 - 全体轨线所构成的图称为相图
 - 满足 $\mathbf{F}(\mathbf{x}) = \mathbf{0}$ 的点称为奇点

SIR模型



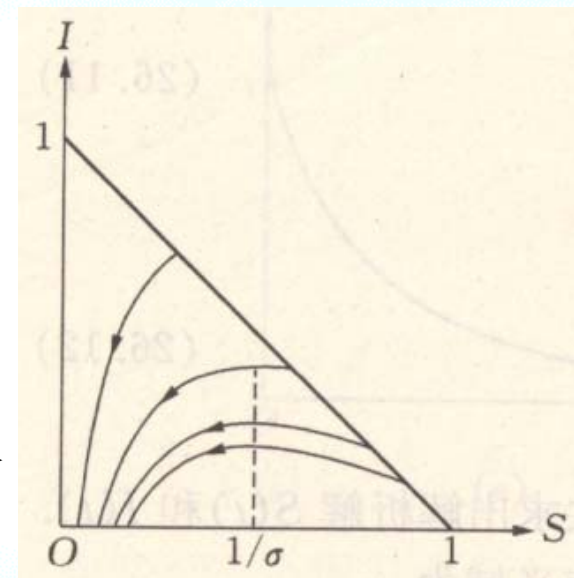
浙江大学
Zhejiang University

数学建模

$$\begin{cases} \frac{dS}{dt} = -\beta SI \\ \frac{dI}{dt} = (\beta S - \alpha)I \end{cases} \Rightarrow \frac{dI}{dS} = \frac{1}{\sigma S} - 1$$

$$D = \{(S, I) \mid S \geq 0, I \geq 0, S + I \leq 1\}$$

$$I(t) = S_0 + I_0 - S(t) + \frac{1}{\sigma} \ln \frac{S(t)}{S_0}$$



SIR模型

- $\lim_{t \rightarrow \infty} I(t) = 0$, 即不论初始条件为何, 感染者终将消失
 - 由 $S(t) \geq 0, \frac{dS}{dt} \leq 0, \lim_{t \rightarrow \infty} S(t)$ 存在, 记为 S_{∞}
 - 由 $R(t) \leq 1, \frac{dR}{dt} \geq 0, \lim_{t \rightarrow \infty} R(t)$ 存在
 - 由 $S(t) + I(t) + R(t) \equiv 1, \lim_{t \rightarrow \infty} I(t)$ 存在, 记为 I_{∞}
 - 若 $I_{\infty} = \varepsilon > 0$, 则对充分大的 $t, \frac{dR}{dt} > \alpha \frac{\varepsilon}{2}, \lim_{t \rightarrow \infty} R(t) = \infty$
矛盾

$$\begin{cases} \frac{dS}{dt} = -\beta SI \\ \frac{dI}{dt} = \beta SI - \alpha I \\ \frac{dR}{dt} = \alpha I \end{cases}$$

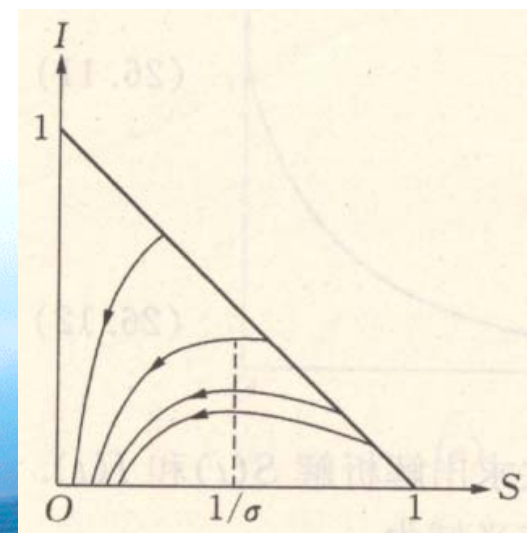


SIR模型

- 若 $S_0 > \frac{1}{\sigma}$, 由 $\frac{dI}{dt} = \beta(S - \frac{1}{\sigma})I$
 - $\frac{1}{\sigma} < S(t) < S_0$ 时, $I(t)$ 单调增加, 在 $S(t) = \frac{1}{\sigma}$ 时达到最大值
- $S(t) < \frac{1}{\sigma}$ 时, $I(t)$ 单调减小至 0

$$I(t) = S_0 + I_0 - S(t) + \frac{1}{\sigma} \ln \frac{S(t)}{S_0}$$

$$\begin{cases} \frac{dS}{dt} = -\beta SI \\ \frac{dI}{dt} = (\beta S - \alpha)I \end{cases}$$



SIR模型

- 若 $s_0 \leq \frac{1}{\sigma}$, $I(t)$ 单调减小至 0, $S(t)$ 单调减小至 S_∞

- S_∞ 为最终未被感染的比例, 为方程

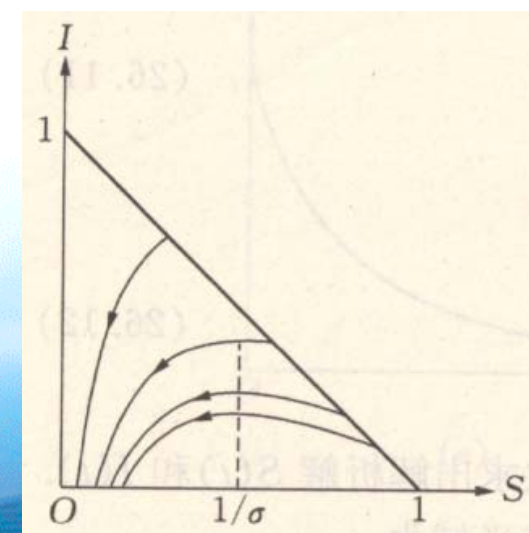
$$S_0 + I_0 - S_\infty + \frac{1}{\sigma} \ln \frac{S_\infty}{S_0} = 0$$

的根。若忽略 I_0 , 则 $\sigma \approx \frac{\ln S_0 - \ln S_\infty}{S_0 - S_\infty}$

该式可用于在某次传染期结束后估计 σ 的值

$$I(t) = S_0 + I_0 - S(t) + \frac{1}{\sigma} \ln \frac{S(t)}{S_0}$$

$$\begin{cases} \frac{dS}{dt} = -\beta SI \\ \frac{dI}{dt} = (\beta S - \alpha)I \end{cases}$$



预防免疫

- 当 $S_0 < \frac{1}{\sigma}$ 时, $I(t)$ 不会增加, 可以认为传染病没有蔓延
- 忽略 I_0 , 则 $R_0 \geq 1 - \frac{1}{\sigma}$ 时, 传染病不会蔓延, 提高 R_0 可通过预防免疫来实现
 - 现有数据显示, 天花的 σ 值较小, 麻疹等传染病的 σ 值较大, 目前全世界已消灭天花疾病

模型验证

- 孟买某岛（1905.12.17-1906.7.21）
（Kermack, McKendrick, 1926）

- 该岛上80%—90%的感染者死亡，

$\frac{dS}{dt} = -\sigma S \Rightarrow S(t) = S_0 e^{-\sigma R(t)}$

$$\frac{dR}{dt} = \alpha \left(1 - R(t) - S_0 e^{-\sigma R(t)} \right)$$

$$\begin{cases} \frac{dS}{dt} = -\beta SI \\ \frac{dI}{dt} = \beta SI - \alpha I \\ \frac{dR}{dt} = \alpha I \end{cases}$$

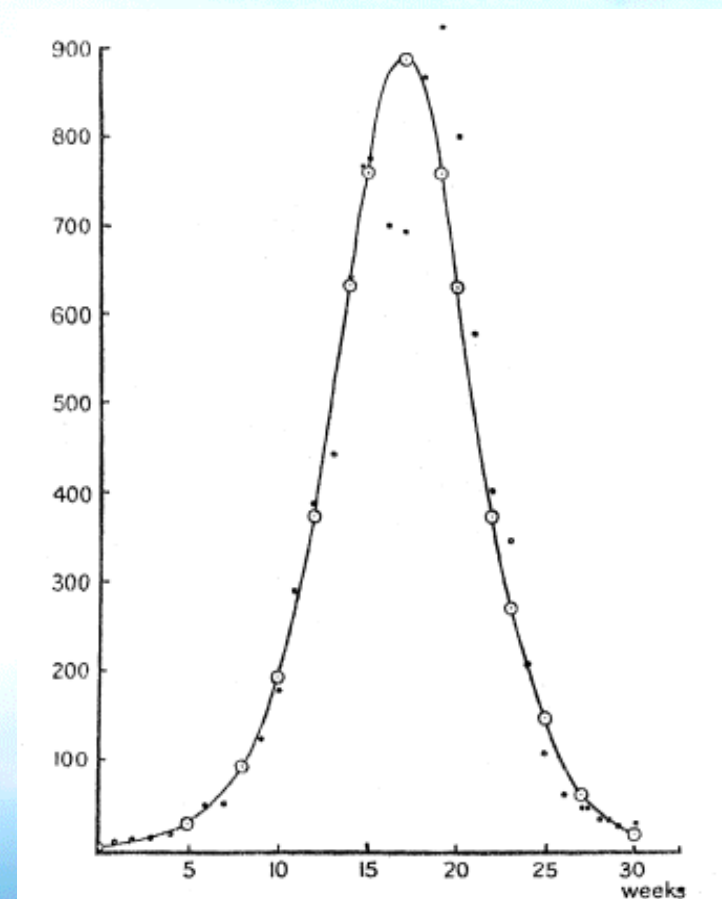
1903年，印度广大地区发生瘟疫，死亡60万人，1904—1905年，死亡100万人。1906—1907年，死亡167.27万人



模型验证

- 当 $\sigma R(t) \ll 1$ 时，将 $e^{-\sigma R(t)}$ 用 **Taylor** 展开，取前三项，求解常微分方程，选定参数，作图并与现实数据比较

$$\frac{dR}{dt} = \alpha (1 - R - S_0 e^{-\sigma R})$$



模型推广

- 潜伏期、对已确诊感染者进行隔离等更多种类人群划分
- 因出生、死亡、迁徙等原因造成的总人口变动
- 具有时滞效应、考虑年龄结构的传染病模型
- 与传染病传播相似问题的建模与分析



浙江大学
Zhejiang University

基本数学模型

种间关系

种群

- **种群** (**population**) 指同种生物在一定空间范围内同时生活着所有个体的集群
- 种间关系
 - **竞争** (**competition**)：两物种个体为争夺共同资源而相互施加不利影响
 - **捕食** (**predation**)：一种生物以另一种生物为食
 - **共生** (**symbiosis**)：两种不同生物个体之间任何形式的共同生活



Volterra和D'Ancona

- 二十世纪二十年代，意大利生物学家Umberto D'Ancona观察到Trieste鱼市上鲨鱼和食用鱼所占比例的波动情况，这一数据基本反映了Adriatic海中两类鱼的比例
- 在第一次世界大战期间，捕鱼量大幅下降，数据显示对作为捕食者的鲨鱼更为有利

年份	1914	1915	1916	1917	1918	1919	1920	1921	1922	1923
鲨鱼比例(%)	11.9	21.4	22.1	21.2	36.4	27.3	16.0	15.9	14.8	10.7



浙江大学
Zhejiang University

数学建模

Volterra和D'Ancona

- D'Ancona将此问题求教于Volterra, 后者建立了数学模型, 对这一现象作出了解释
- 稍早时, 美国数学家Alfred James Lotka (1880-1949) 也给出了相同的模型, 这一模型现被称作Lotka-Volterra模型



Nature (No 2983,
12-13, 1927) 上
Lotka和Volterra关
于模型的通信

Vito Volterra
(1860—
1940)
意大利数学家

捕食者—食饵系统

- 记 $x(t), y(t)$ 分别为 t 时刻鲨鱼（捕食者）和食用鱼（食饵）的种群数量
 - 由于海洋资源丰富，食用鱼独立生存时以**常数**增长率增长；鲨鱼的存在使食用鱼增长率减少，程度与鲨鱼数量呈正比
 - 鲨鱼缺乏食用鱼时死亡率为**常数**；食用鱼的存在使鲨鱼死亡率降低，程度与食饵数量呈正比

$$\frac{dx}{dt} = rx - axy \quad \frac{dy}{dt} = -dy + bxy$$

相轨线



浙江大学
Zhejiang University

数学建模

$$\frac{dx}{dt} = rx - axy \quad \frac{dy}{dt} = -dy + bxy$$

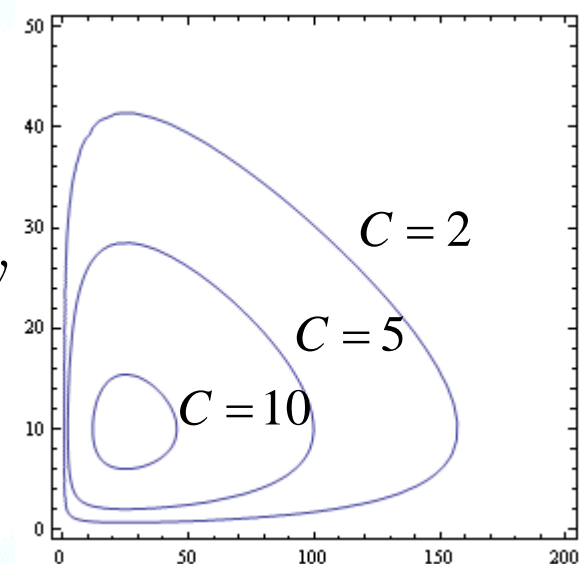
$$\frac{dx}{dy} = \frac{x(r - ay)}{y(-d + bx)} \Rightarrow \frac{-d + bx}{x} dx = \frac{r - ay}{y} dy$$

$$\Rightarrow -d \ln x + bx = r \ln y - ay + c$$

$$\Rightarrow (x^d e^{-bx})(y^r e^{-ay}) = C$$

- 若 $x(0) = x_0, y(0) = y_0$, 则

$$C = (x_0^d e^{-bx_0})(y_0^r e^{-ay_0})$$



$$r = 1, d = 0.5$$

$$a = 0.1, b = 0.02$$



浙江大学

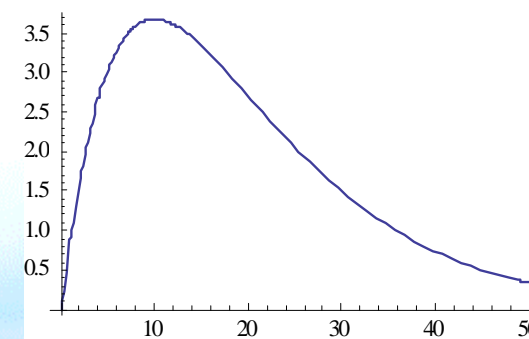
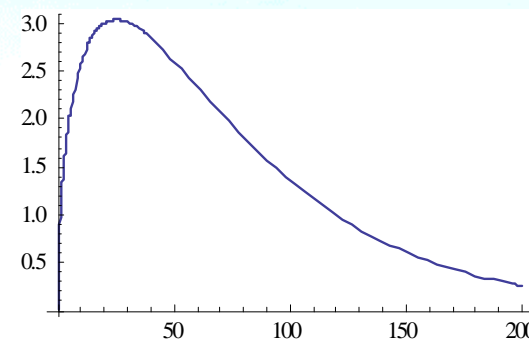
Zhejiang University

数学建模

相轨线

- 令 $f(x) = x^d e^{-bx}$, $f(x)$ 在 $x_m = \frac{d}{b}$ 处取得极大值 f_{\max} ; 令 $g(y) = y^r e^{-ay}$, $g(y)$ 在 $y_m = \frac{r}{a}$ 处取得极大值 g_{\max} ,
$$0 \leq C = f(x)g(y) \leq f_{\max} g_{\max}$$
- 若 $C = f_{\max} g_{\max}$, 则 $x = x_m, y = y_m$,
相轨线 \mathcal{L} 退化为点 (x_m, y_m)

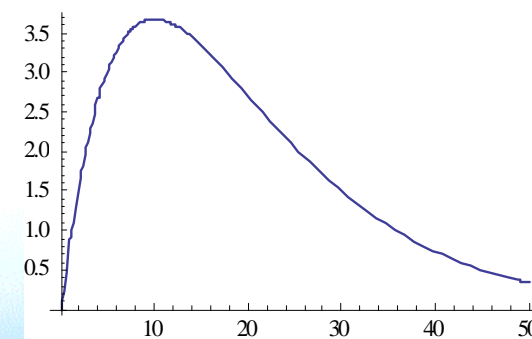
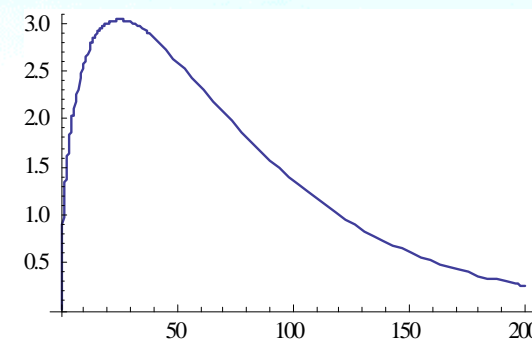
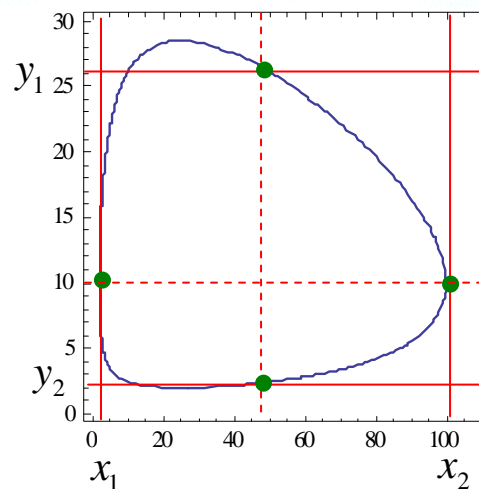
$$(x^d e^{-bx})(y^r e^{-ay}) = C$$





相轨线

- 任取 $0 < C < f_{\max} g_{\max}$,
记 $p = \frac{C}{g_{\max}} < f_{\max}$, 则
存在 $x_1, x_2, x_1 < x_m < x_2$
且 $f(x_1) = f(x_2) = p$, \mathcal{L}
通过点 $(x_1, y_m), (x_2, y_m)$
- 对任一 $x \in (x_1, x_2)$, $f(x) > p$. 记 $q = \frac{C}{f(x)}$,
则 $q = \frac{p g_{\max}}{f(x)} < g_{\max}$, 存在 $y_1, y_2, y_1 < y_m < y_2$,
且 $g(y_1) = g(y_2) = q$, \mathcal{L} 通过点 $(x, y_1), (x, y_2)$

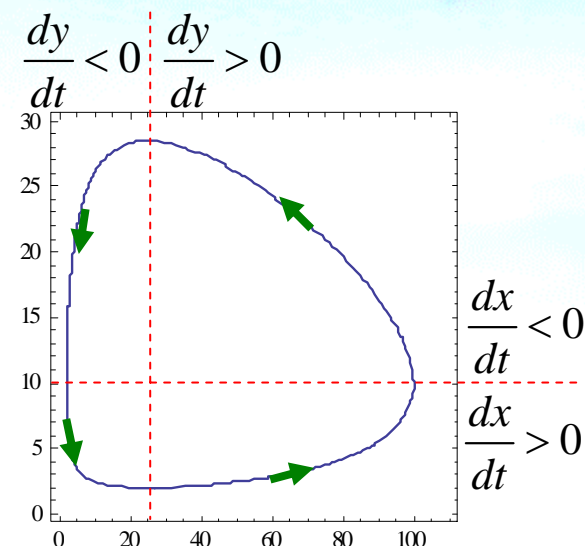


$$(x^d e^{-bx})(y^r e^{-ay}) = C$$



相轨线

- 对任意 C ，相轨线是一条封闭曲线。当 C 自 $f_{\max} g_{\max}$ 开始逐渐变小时，相轨线从点 (x_m, y_m) 开始不断向外扩展
- 直线 $x = x_m, y = y_m$ 将相轨线分为四段，各段的 $\frac{dx}{dt}$ 和 $\frac{dy}{dt}$ 符号不全相同，由此可确定轨线的方向

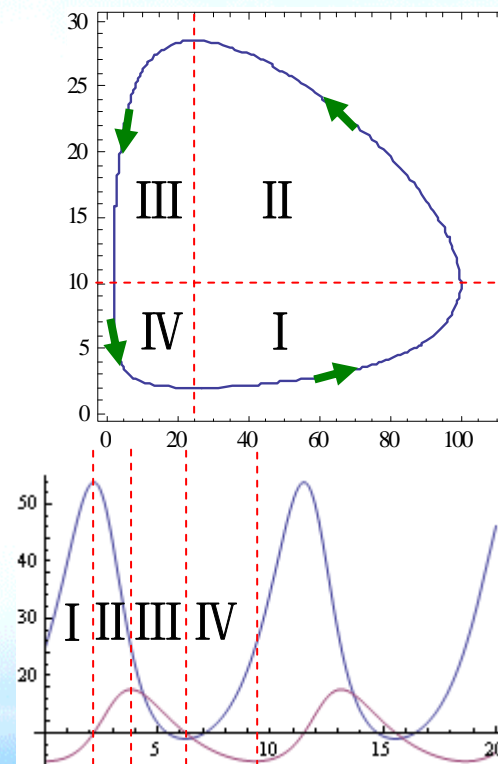


$$\begin{aligned}\frac{dx}{dt} &= x(r - ay) \\ \frac{dy}{dt} &= y(-d + bx)\end{aligned}$$



相轨线

- 由于相轨线是封闭曲线，函数 $x(t)$, $y(t)$ 均为周期函数，记周期为 T
- 周期 T 可相应分为四段，各段内 $x(t)$ 和 $y(t)$ 的增减性不全相同
- 在一个周期内食饵先于捕食者到达最大值或最小值





浙江大学

Zhejiang University

数学建模

平均值

$$x(t) = \frac{1}{by(t)} \frac{dy}{dt} + \frac{d}{b}$$

$$\begin{aligned}\bar{x} &= \frac{1}{T} \int_0^T x(t) dt = \frac{1}{T} \left(\frac{1}{b} \ln y(t) + \frac{d}{b} t \right) \Big|_0^T \\ &= \frac{1}{T} \left(\frac{\ln y(T) - \ln y(0)}{b} + \frac{d}{b} T \right) \Big|_0^T = \frac{d}{b}\end{aligned}$$

$$y(t) = -\frac{1}{ax(t)} \frac{dx}{dt} + \frac{r}{a}$$

$$\bar{y} = \frac{1}{T} \int_0^T y(t) dt = \frac{1}{T} \left(-\frac{1}{a} \ln x(t) + \frac{r}{a} t \right) \Big|_0^T = \frac{r}{a}$$

$$\begin{aligned}\frac{dx}{dt} &= x(r - ay) \\ \frac{dy}{dt} &= y(-d + bx)\end{aligned}$$

$$\begin{aligned}x_m &= \frac{d}{b} \\ y_m &= \frac{r}{a}\end{aligned}$$



浙江大学

Zhejiang University

数学建模

捕捞

- 设捕捞系数为 e ，即由于人为捕捞，食用鱼增长率由 r 下降为 $r - e$ ，鲨鱼死亡率由 d 上升为 $d + e$ ，则 $\bar{x}(e) = \frac{d + e}{b} > \bar{x}(0)$, $\bar{y}(e) = \frac{r - e}{a} < \bar{y}(0)$
- $\bar{x}(e)$ 为 e 的增函数， $\bar{y}(e)$ 为 e 的减函数。因此当捕捞系数减小时，鲨鱼所占比例增加
- 害虫和它的天敌益虫构成食饵—捕食者系统。如果一种杀虫剂杀死益虫和害虫的效力相当，长期使用将导致害虫增加

山猫与野兔



浙江大学

Zhejiang University

数学建模

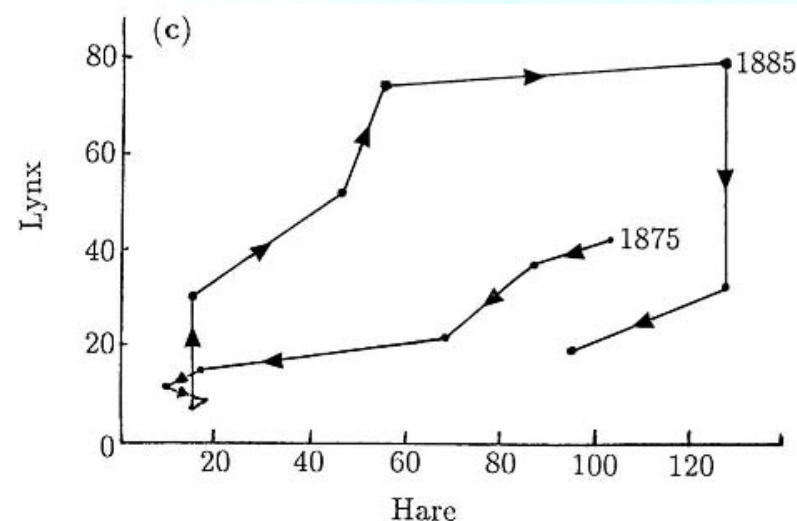
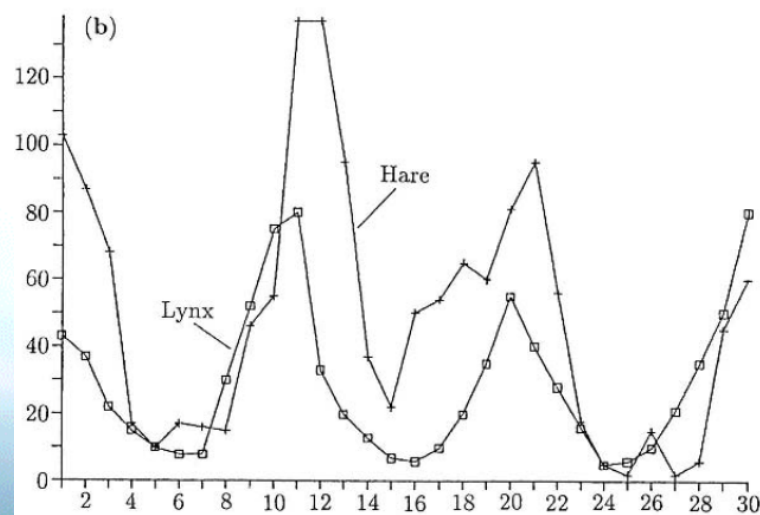
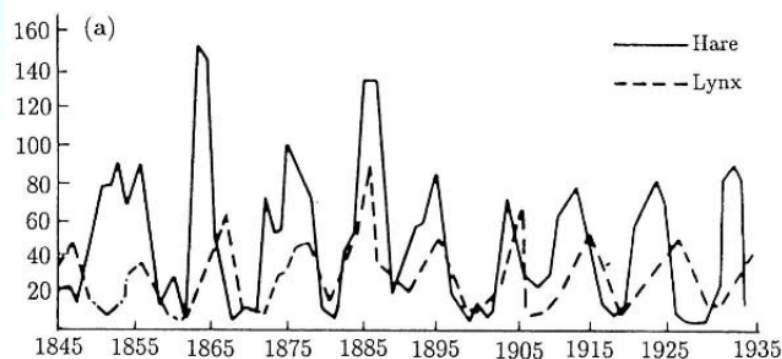
- 加拿大Hudson Bay Company长期从事皮毛贸易，存有1845—1930年在北美捕获的 *Lynx canadensis* 和 *Lepus americanus* (snowshoe hare) 两种动物的数量数据。这组数据常被用来分析捕食者—食饵系统





山猫与野兔

数学建模



顺时针！野兔吃山猫？

(a) 1845—1935年山猫，野兔一时间图

(b) 1875—1904年山猫，野兔一时间图

(c) 1875—1904年山猫—野兔图

(单位均为千只)

一般双种群模型

- $$\begin{cases} \frac{dx}{dt} = x(a_{10} + a_{11}x + a_{12}y) \\ \frac{dy}{dt} = y(a_{20} + a_{21}x + a_{22}y) \end{cases}$$
- $x(t), y(t)$ 分别表示种群 X 和 Y 在 t 时刻的数量
- a_{10}, a_{20} 分别表示种群 X 和 Y 的**增长率**（出生率与死亡率之差）
 - $a_{10} > 0$ 表示 X 可依靠系统外食物为生
 - $a_{10} < 0$ 表示 X 必须依赖 Y 为食才能生存

一般双种群模型

- a_{11}, a_{22} 分别表示种群 X 和 Y 的密度制约项
 - $a_{11} = 0$ 表示 X 是非密度制约的
 - $a_{11} < 0$ 表示 X 是密度制约的
- a_{12}, a_{21} 反映种群 X 和 Y 之间的关系
 - X 为食饵, Y 为捕食者 $a_{12} < 0, a_{21} > 0$
 - X 为寄主, Y 为寄生物 $a_{12} < 0, a_{21} > 0$
 - 相互竞争 $a_{12} < 0, a_{21} < 0$
 - 互惠共存 $a_{12} > 0, a_{21} > 0$

$$\begin{cases} \frac{dx}{dt} = x(a_{10} + a_{11}x + a_{12}y) \\ \frac{dy}{dt} = y(a_{20} + a_{21}x + a_{22}y) \end{cases}$$



浙江大学
ZheJiang University

谢 谢

