

#### Motivação



- Uma das preocupações mais importantes sobre qualquer doença infecciosa é sua capacidade de invadir uma população.
- Muitos modelos epidemiológicos têm um equilíbrio livre de doença (ELD) no qual a população permanece na ausência de doença. Esses modelos geralmente têm um parâmetro de limiar, conhecido como número básico de reprodução, R<sub>0</sub>, tal que
  - Se  $R_0 < 1$ , então o ELD é localmente assintoticamente estável e a doença não pode invadir o população;
  - Mas se  $R_0 > 1$ , então o ELD é instável e a invasão é sempre possível.
- ▶ Diekmann et al. [1] definem R<sub>0</sub> como o raio espectral da matriz de próxima geração (vamos entender em detalhes). O conteúdo desta aula é baseado no trabalho de van den Driessche e Watmough [2].
- [1] O. Diekmann, J. Heesterbeek, and J. Metz. On the definition and the computation of the basic reproduction ratio R<sub>0</sub> in models for infectious diseases in heterogeneous populations. *Journal of Mathematical Biology*, 28(4), 1990.
- [2] P. van den Driessche and J. Watmough. Reproduction numbers and sub-threshold endemic equilibria for compartmental models of disease transmission. Mathematical Biosciences, 180(1-2):29–48, 2002.

#### Motivação



- Até agora, calculamos os números de reprodução seguindo os casos secundários causados por um único infeccioso introduzido em uma população.
- No entanto, se houver subpopulações com diferentes suscetibilidades à infecção, é necessário seguir as **infecções secundárias nas subpopulações** *separadamente*.
- ▶ É necessário termos uma abordagem mais geral ao significado do número de reprodução, e isso é feito através do **método da matriz de próxima geração**.
- Assumimos que a população pode ser dividida em compartimentos, de modo que os indivíduos em um determinado compartimento sejam indistinguíveis uns dos outros.
- Os parâmetros podem variar de compartimento para compartimento, mas são idênticos para todos os indivíduos dentro de um determinado compartimento.
- Primeiro vamos ver em detalhes um modelo geral de transmissão de doenças compartimental adequado para populações heterogêneas que pode ser modelado por um sistema de equações diferenciais ordinárias.
- Em seguida vamos derivar uma **expressão para a matriz de próxima geração** para este modelo e examinarmos o limite  $R_0 = 1$  em detalhes.



- Considere uma população heterogênea cujos indivíduos são distinguíveis por idade, comportamento, posição espacial e/ou estágio da doença, mas podem ser agrupados em n compartimentos homogêneos.
- ▶ Seja  $x = (x_1, ..., x_n)^\top$ , com cada  $x_i \ge 0$ , o número de indivíduos em cada compartimento.
- ▶ Para maior clareza, vamos classificar os compartimentos de modo que os primeiros *m* compartimentos correspondam a **indivíduos infectados**.
- A distinção entre compartimentos infectados e não infectados deve ser determinada a partir da interpretação epidemiológica do modelo e não pode ser deduzida apenas da estrutura das equações.
- ▶ É plausível que mais de uma interpretação seja possível para alguns modelos.
- Vamos definir X<sub>s</sub> como sendo o conjunto de todos os estados livres de doença, com

$$\mathbf{X}_{s} = \{x \geqslant 0 \mid x_{i} = 0, i = 1, ..., m\}$$



- Para calcular  $\Re_0$ , é importante **distinguir novas infecções** de todas as outras mudanças na população.
  - $ightharpoonup \mathcal{F}_i(x)$ : taxa de aparecimento de **novas infecções** no compartimento i;
  - $\triangleright$   $V_i^+(x)$ : taxa de transferência de indivíduos **para** o compartimento *i* por todos os outros meios;
  - $\mathcal{V}_{i}^{-}(x)$ : taxa de transferência de indivíduos **para fora** do compartimento i.
- Assume-se que cada função é continuamente diferenciável pelo menos duas vezes em cada variável.
- O modelo de transmissão da doença consiste em condições iniciais não negativas juntamente com o seguinte sistema de equações:

$$\dot{x}_i = f_i(x) = \mathcal{F}_i(x) - \mathcal{V}_i(x), \quad i = 1, \dots, n$$
(1)

onde  $V_i = V_i^- - V_i^+$  e as funções **satisfazem** as suposições (A1)–(A5) descritas a seguir.

Como cada função  $\mathcal{F}_i(x)$ ,  $\mathcal{V}_i^+(x)$  e  $\mathcal{V}_i^-(x)$  representa uma transferência direcionada de indivíduos, todas elas são **não negativas**.



- ▶ (A1) se  $x \ge 0$ , então  $\mathcal{F}_i, \mathcal{V}_i^+, \mathcal{V}_i^- \ge 0$  para i = 1, ..., n.
- ▶ Se um compartimento estiver **vazio**, não poderá haver transferência de indivíduos para fora do compartimento por morte, infecção ou qualquer outro meio. Isso leva à próxima condição.
- ▶ (A2) se  $x_i = 0$  então  $V_i^- = 0$ . Em particular, se  $x \in \mathbf{X}_s$  então  $V_i^- = 0$  para i = 1, ..., m.
- Considere o modelo de transmissão da doença dado por (1) com  $f_i(x)$ , para  $i=1,\ldots,n$ , satisfazendo as condições (A1) e (A2). Se  $x_i=0$ , então  $f_i(x)\geqslant 0$ .
- A próxima condição surge do simples fato de que a incidência de infecção para compartimentos não infectados é zero.
- ▶ (A3)  $\mathcal{F}_i = 0$ , se i > m.
- Para garantir que o subespaço livre de doença seja **invariante**, assumimos que se a população estiver livre de doença, então a população permanecerá livre de doença.
- Ou seja, não há imigração (independente da densidade) de infectantes. Esta condição é declarada da seguinte forma:
- ▶ (A4) se  $x \in \mathbf{X}_s$ , então  $\mathfrak{F}_i(x) = 0$  e  $\mathcal{V}_i^+(x) = 0$  para i = 1, ..., m.



- ▶ A condição restante é baseada nas derivadas de *f* perto de um ELD.
- ightharpoonup Vamos definir um ELD de (1) como uma solução de equilíbrio estável (localmente assintoticamente) do modelo livre de doença, ou seja, (1) restrito a  $X_s$ .
- Considere uma população próxima ao ELD, denotado como  $x_0$ . Se a população permanecer próxima ao ELD (ou seja, se a introdução de alguns indivíduos infectantes não resultar em epidemia), a população retornará ao ELD de acordo com o sistema linearizado

$$\dot{x} = Df(x_0)(x - x_0) , \qquad (2)$$

onde  $Df\left(x_{0}\right)$  é a derivada  $\left[\partial f_{i}/\partial x_{j}\right]$  avaliada no ELD,  $x_{0}$  (isto é, a matriz Jacobiana).

- ▶ (A5) Se  $\mathcal{F}(x)$  for igual a zero, então todos os autovalores de  $Df(x_0)$  têm partes reais negativas.
- Para compreendermos a suposição (A5), precisamos recordar o teorema abaixo.

#### **Teorema**

A equação  $\dot{\mathbf{x}}(t) = \mathbf{A}\mathbf{x}(t)$  é assintoticamente estável se, e somente se, todos os autovalores de A têm parte real negativa.



As condições (A1)–(A5) nos permitem particionar a matriz  $Df(x_0)$  conforme mostrado pelo lema a seguir.

#### Lema 1

Se  $x_0$  é um ELD de (1) e  $f_i(x)$  satisfaz (A1)–(A5), então as derivadas  $D\mathcal{F}(x_0)$  e  $D\mathcal{V}(x_0)$  são particionadas como

$$D\mathcal{F}(x_0) = \begin{pmatrix} F & 0 \\ 0 & 0 \end{pmatrix}, \quad D\mathcal{V}(x_0) = \begin{pmatrix} V & 0 \\ J_3 & J_4 \end{pmatrix},$$

onde F e V são as matrizes  $m \times m$  definidas por

$$F = \left[ \frac{\partial \mathcal{F}_i}{\partial x_j} \left( x_0 \right) \right] \quad \text{e} \quad V = \left[ \frac{\partial \mathcal{V}_i}{\partial x_j} \left( x_0 \right) \right], \quad \text{com} \quad 1 \leqslant i, j \leqslant m.$$

Além disso, F é não negativo, V é uma matriz M não singular e todos os autovalores de  $J_4$  têm parte real positiva.

 $<sup>^1</sup>$ A classe de matrizes Z são aquelas matrizes cujas entradas fora da diagonal principal são menores ou iguais a zero, isto é, as matrizes da forma  $Z=(z_{ij})$ , onde  $z_{ij}\leq 0$  para  $i\neq j$ . Por sua vez, uma matriz M é uma matriz Z com autovalores cujas partes reais são não negativas.



- Vamos entender agora alguns aspectos deste lema (afirmações provenientes da prova do lema).
- ▶ Lembre-se: queremos uma solução assintoticamente estável.
- Por (A3) e (A4),  $\left(\partial \mathcal{F}_i/\partial x_j\right)(x_0) = 0$  se i > m ou j > m.
  - (A3) a incidência de infecção para compartimentos não infectados é zero; (A4) se a população estiver livre de doença, então a população permanecerá livre de doença, então não há imigração de infectantes.
  - ightharpoonup os primeiros m compartimentos correspondem a **indivíduos infectados**.
- ▶ Da mesma forma, por (A2) e (A4), se  $x \in X_s$  então  $V_i(x) = 0$  para  $i \leq m$ .
  - (A2) Se um compartimento estiver vazio, não poderá haver transferência de indivíduos para fora do compartimento por morte, infecção ou qualquer outro meio.
  - X<sub>s</sub> é o conjunto de todos os estados livres de doença.
- Portanto,  $\left(\partial \mathcal{V}_i/\partial x_j\right)(x_0) = 0$  para  $i \leq m$  e j > m.
- ► A não negatividade de *F* segue de (A1) e (A4).
  - (A1) Como cada função representa uma transferência direcionada de indivíduos, todas elas são não negativas.



Sejam  $\{e_j\}$  os vetores de base euclidiana, ou seja,  $e_j$  é a j-ésima coluna da matriz identidade  $n \times n$ . Então, para  $j = 1, \dots, m$ ,

$$\left(\frac{\partial \mathcal{V}_i}{\partial x_j}\right)(x_0) = \lim_{h \to 0^+} \left(\frac{\mathcal{V}_i\left(x_0 + he_j\right) - \mathcal{V}_i\left(x_0\right)}{h}\right) .$$

Para mostrar que V é uma matriz M não singular, observe que se  $x_0$  é um ELD, então por (A2) e (A4),  $V_i(x_0) = 0$  para i = 1, ..., m, e se  $i \neq j$ , então o componente i de  $x_0 + he_j = 0$  e  $V_i(x_0 + he_j) \leq 0$ , por (A1) e (A2).

- Portanto,  $\partial V_i/\partial x_i \leq 0$  para  $i \leq m$  e  $j \neq i$  e V tem o padrão de sinal Z.
- ightharpoonup Adicionalmente, por (A5), todos os autovalores de V têm partes reais positivas.
- Essas duas condições implicam que *V* é uma matriz M não singular.
- ▶ A condição (A5) também implica que os autovalores de *J*<sub>4</sub> têm parte real positiva.

 $<sup>^2</sup>$ Uma matriz A possui padrão de sinal Z sempre que  $a_{ij} \le 0$  para todo  $i \ne j$ , ou seja, todas as suas entradas fora da diagonal principal são menores ou iguais a zero.



- ▶ O número básico de reprodução, denotado por  $\Re_0$ , é "o número esperado de casos secundários produzidos, em uma população completamente suscetível, por um indivíduo infectante típico".
- Se R₀ < 1, então, em média, um indivíduo infectado produz menos de um novo indivíduo infectado ao longo de seu período infeccioso e a infecção não pode crescer.</p>
- Por outro lado, se  $\Re_0 > 1$ , então cada indivíduo infectado produz, em média, **mais de uma nova infecção**, e a doença pode invadir a população.
- Para o caso de um único compartimento infectado,  $\mathcal{R}_0$  é simplesmente o produto da taxa de infecção e a duração média da infecção.
- No entanto, para modelos mais complicados com vários compartimentos infectados, esta simples definição heurística de R<sub>0</sub> é insuficiente.
- Um número básico de reprodução mais geral pode ser definido como o número de novas infecções produzidas por um indivíduo infeccioso típico em uma população em um ELD.



Para determinar o **destino** de um indivíduo infectante *típico* introduzido na população, consideramos a dinâmica do sistema linearizado (2) sem reinfecção, ou seja, o sistema

$$\dot{x} = -D\mathcal{V}(x_0)(x - x_0) . \tag{3}$$

- Pela condição (A5), o ELD é localmente assintoticamente estável neste sistema.
- Assim, (3) pode ser usado para determinar o destino de um pequeno número de indivíduos infectados introduzidos em uma população livre de doença.
- Seja  $\psi_i(0)$  o número de indivíduos infectados inicialmente no compartimento i e seja  $\psi(t) = (\psi_1(t), \dots, \psi_m(t))^{\top}$  o número desses indivíduos inicialmente infectados que permanecem nos compartimentos de infectados após t unidades de tempo.
- O vetor  $\psi$  são os primeiros m componentes de x.
- O particionamento de  $DV(x_0)$  implica que  $\psi(t)$  satisfaz  $\psi'(t) = -V\psi(t)$ , que tem a **solução única**  $\psi(t) = \mathrm{e}^{-Vt}\psi(0)$ .



- ▶ Pelo Lema 1, V é uma matriz M não singular e, portanto, é invertível e todos os seus autovalores possuem partes reais positivas.
- Assim, integrando  $F\psi(t)$  de zero ao infinito dá o **número esperado de novas infecções produzidas pelos indivíduos inicialmente infectados**,

$$FV^{-1}\psi(0)$$

- ▶ Já que F é não-negativo e V é uma matriz M não-singular,  $V^{-1}$  é **não-negativo** assim como  $FV^{-1}$ .
- Para interpretar as entradas de  $FV^{-1}$  e desenvolver uma definição significativa de  $\mathcal{R}_0$ , considere o **destino de um indivíduo infectado** introduzido no compartimento k de uma população livre de doença.
- A entrada (j,k) de  $V^{-1}$  é o tempo médio que esse indivíduo **passa no compartimento** j durante sua vida, supondo que a população permaneça próxima ao ELD e salvo reinfecção.
- A entrada (*i*, *j*) de *F* é a taxa na qual indivíduos infectados no compartimento *j* **produzem novas infecções** no compartimento *i*.
- Assim, a entrada (i,k) do produto  $FV^{-1}$  é o número esperado de novas infecções no compartimento i produzidas pelo indivíduo infectado originalmente introduzido no compartimento k.



#### Matriz de próxima geração

Chamamos  $FV^{-1}$  de matriz de próxima geração para o modelo e definimos

$$\mathcal{R}_0 = \rho \left( FV^{-1} \right),\tag{4}$$

onde  $\rho(A)$  denota o raio espectral de uma matriz A.

- ▶ O ELD,  $x_0$ , é localmente assintoticamente estável se todos os autovalores da matriz  $Df(x_0)$  tiverem partes reais negativas e instável se qualquer autovalor de  $Df(x_0)$  tem uma parte real positiva.
- Pelo Lema 1, os autovalores de  $Df(x_0)$  podem ser particionados em dois conjuntos correspondentes aos compartimentos **infectado** e **não infectado**.

#### **Teorema**

Considere o modelo de transmissão da doença dado por (1) com f(x) satisfazendo as condições (A1)–(A5). Se  $x_0$  é um ELD do modelo, então  $x_0$  é localmente assintoticamente estável se  $\mathcal{R}_0 < 1$ , mas instável se  $\mathcal{R}_0 > 1$ , onde  $\mathcal{R}_0$  é definido por (4).

 $<sup>^3</sup>$ Sejam  $\lambda_1, \ldots, \lambda_n$  os autovalores (reais ou complexos) de uma matriz  $A \in \mathbb{C}^{n \times n}$ . Então seu raio espectral  $\rho(A)$  é definido como:  $\rho(A) = \max\{|\lambda_1|, \ldots, |\lambda_n|\}$ .

# O número básico de reprodução Metodologia resumida



O procedimento geral para obtenção de  $\mathcal{R}_0$  pode ser resumido nos seguintes passos:

- 1. Identifique todos os *m* compartimentos de infectados;
- 2. Construa uma matriz  $m \times 1$ ,  $\mathcal{F}$ , que contenha expressões para todas as infecções completamente novas que entram em cada compartimento infectado;
- 3. Construa uma matriz  $m \times 1$ ,  $\mathcal{V}^-$ , que contenha expressões para todas as perdas de cada compartimento infectado;
- 4. Construa uma matriz  $m \times 1$ ,  $V^+$ , que contenha expressões para todos os ganhos em cada compartimento infectado que não representa novas infecções, mas transferências entre classes infecciosas;
- 5. Construa uma matriz  $m \times 1$ ,  $\mathcal{V} = \mathcal{V}^- \mathcal{V}^+$ ;
- 6. Gere duas matrizes jacobianas  $m \times m F$  e V que são as derivadas parciais de  $\mathcal{F}$  e  $\mathcal{V}$  com respeito para as variáveis de estado infeccioso;
- 7. Avalie as matrizes no equilíbrio livre de doença (ELD) e, finalmente;
- 8.  $\mathcal{R}_0$  é o maior autovalor de  $\mathbf{FV}^{-1}|_{\text{ELD}}$ .



- Considere a modelagem da tuberculose onde a população é dividida em quatro compartimentos, onde N = E + I + S + T:
  - ▶ indivíduos suscetíveis à tuberculose (*S*);
  - ▶ indivíduos expostos (E);
  - ▶ indivíduos infecciosos (I);
  - indivíduos tratados (T).
- Indivíduos suscetíveis e tratados entram no compartimento exposto com taxas  $\beta_1 I/N$  e  $\beta_2 I/N$ , respectivamente.
- Indivíduos expostos **progridem para o compartimento infeccioso** à taxa v.
- ▶ Todos os recém-nascidos são suscetíveis e todos os indivíduos morrem à taxa d > 0.
- Assim, o núcleo do modelo é um modelo SEI usando incidência padrão.
- ightharpoonup As **taxas de tratamento** são  $r_1$  para indivíduos expostos e  $r_2$  para indivíduos infecciosos.
- No entanto, apenas uma fração q dos tratamentos de indivíduos infecciosos são bem-sucedidos.
- ▶ Indivíduos infecciosos tratados sem sucesso reentram no compartimento exposto (p = 1 q).



O modelo de transmissão da doença consiste nas seguintes equações diferenciais juntamente com condições iniciais não negativas:

$$\begin{split} \dot{E} &= \beta_1 SI/N + \beta_2 TI/N \\ &- (d+v+r_1) \, E + p r_2 I \; , \\ \dot{I} &= v E - (d+r_2) \, I \; , \\ \dot{S} &= b(N) - dS - \beta_1 SI/N \; , \\ \dot{T} &= -dT + r_1 E + q r_2 I - \beta_2 TI/N \; . \end{split}$$

b(N)	Taxa de natalidade.	
d	Taxa de mortalidade por causas naturais.	
$\beta_1$	Taxa de infecção de suscetíveis.	
$\beta_2$	Taxa de infecção de tratados.	
v	Taxa em que expostos se tornam infecciosos.	
$r_1$	Taxa de tratamento de expostos.	
$r_2$	Taxa de tratamento de infecciosos.	
р	Tratamento sem sucesso de infecciosos.	
q	Tratamento bem-sucedido de infecciosos.	

A progressão de *E* para *I* e a falha no tratamento **não são consideradas novas infecções**, mas sim a progressão de um indivíduo infectado pelos vários compartimentos.



$$\mathcal{F} = \begin{pmatrix} \beta_1 SI/N + \beta_2 TI/N \\ 0 \\ 0 \\ 0 \end{pmatrix} \quad e \quad \mathcal{V} = \begin{pmatrix} (d+v+r_1) E - pr_2 I \\ -vE + (d+r_2) I \\ -b(N) + dS + \beta_1 SI/N \\ dT - r_1 E - qr_2 I + \beta_2 TI/N \end{pmatrix}$$

- Os compartimentos **infectados** são E e I, dando m=2.
- ▶ Uma solução de **equilíbrio** com E = I = 0 tem a forma  $x_0 = (0, 0, S_0, 0)^{\top}$ , onde  $S_0$  é qualquer solução positiva de  $b(S_0) = dS_0$ .
- Este será um ELD se e somente se  $b'(S_0) < d$ .
- ightharpoonup Sem perda de generalidade, suponha que  $S_0=1$  seja um ELD. Então,

$$F = \begin{pmatrix} 0 & \beta_1 \\ 0 & 0 \end{pmatrix}, \quad V = \begin{pmatrix} d+v+r_1 & -pr_2 \\ -v & d+r_2 \end{pmatrix}$$

O cálculo da matriz inversa de *V* resulta na expressão seguinte.



O cálculo da matriz inversa de *V* resulta na expressão seguinte.

$$V^{-1} = \frac{1}{(d+v+r_1)(d+r_2) - vpr_2} \begin{pmatrix} d+r_2 & pr_2 \\ v & d+v+r_1 \end{pmatrix}$$

ightharpoonup O produto  $FV^{-1}$  (a matriz de próxima geração) resulta em

$$\frac{1}{(d+r_2)(d+r_1+v)-pr_2v} \begin{pmatrix} 0 & \beta_1 \\ 0 & 0 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} d+r_2 & pr_2 \\ v & d+r_1+v \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} \frac{\beta_1v}{(d+r_2)(d+r_1+v)-pr_2v} & \frac{\beta_1(d+r_1+v)}{(d+r_2)(d+r_1+v)-pr_2v} \\ 0 & 0 \end{pmatrix}$$

O polinômio característico é

$$\lambda \left(\lambda - \frac{\beta_1 v}{(d+r_2)(d+r_1+v) - pr_2 v}\right) = 0$$



As duas soluções deste problema são  $\lambda_1 = 0$  e

$$\lambda_2 = \frac{\beta_1 v}{(d+r_2)(d+r_1+v) - pr_2 v}$$
.

Portanto, o número básico de reprodução  $(\mathcal{R}_0)$  deste problema é

$$\rho\left(FV^{-1}\right) = \frac{\beta_1 v}{(d+r_2)(d+r_1+v) - pr_2 v} , \quad \text{com } (d+r_2)(d+r_1+v) - pr_2 v \neq 0 ,$$

o raio espectral da matriz de próxima geração ( $\lambda_2 > \lambda_1$ ).

- Embora as condições (A1)–(A5) não restrinjam a decomposição de  $f_i(x)$  a uma única escolha para  $\mathcal{F}_i$ , apenas uma dessas opções é epidemiologicamente correta.
- ▶ Diferentes escolhas para a função  $\mathcal{F}$  levam a diferentes valores para o raio espectral de  $FV^{-1}$ , conforme mostrado na tabela a seguir.
- ▶ Na coluna (a), a falha no tratamento é considerada uma nova infecção e na coluna (b), tanto a falha no tratamento quanto a progressão para infecciosidade são consideradas novas infecções.



	(a)	(b)
F	$ \begin{pmatrix} \beta_1 SI/N + \beta_2 TI/N + pr_2 I \\ 0 \\ 0 \\ 0 \end{pmatrix} $	$\begin{pmatrix} \beta_1 SI/N + \beta_2 TI/N + pr_2 I \\ vE \\ 0 \\ 0 \end{pmatrix}$
ν	$\begin{pmatrix} (d+v+r_1)E \\ -vE+(d+r_2)I \\ -b(N)+dS+\beta_1SI/N \\ dT-r_1E-qr_2I+\beta_2TI/N \end{pmatrix}$	$\begin{pmatrix} (d+v+r_1)E\\ (d+r_2)I\\ -b(N)+dS+\beta_1SI/N\\ dT-r_1E-qr_2I+\beta_2TI/N \end{pmatrix}$
F	$\left( egin{array}{cc} 0 & eta_1+pr_2 \ 0 & 0 \end{array}  ight)$	$\left(egin{array}{cc} 0 & eta_1+pr_2 \ v & 0 \end{array} ight)$
V	$\begin{pmatrix} d+v+r_1 & 0 \\ -v & d+r_2 \end{pmatrix}$	$\left(\begin{array}{cc}d+v+r_1&0\\0&d+r_2\end{array}\right)$
$\rho\left(FV^{-1}\right)$	$\frac{\beta_1 v + p r_2 v}{\left(d + v + r_1\right)\left(d + r_2\right)}$	$\sqrt{\frac{\beta_1 v + p r_2 v}{(d+v+r_1)(d+r_2)}}$