

Документ подписан простой электронной подписью
Информация о владельце:
ФИО: Суворов Антон Дмитриевич
Должность: Ректор
Дата подписания: 20.01.2025 21:30:30
Уникальный программный ключ:
a39bdb15d680d3b0adbfc0af5c1efb14747dc0



УТВЕРЖДАЮ
Ректор НОУ ВО РЭШ
А.Д. Суворов
«20» января 2025 г.

Негосударственное образовательное
учреждение высшего образования
«Российская экономическая школа» (институт)

Программа
вступительных испытаний при приеме
на обучение по программе подготовки научных
и научно-педагогических кадров в аспирантуре
в 2025 году

ФОРМА ОБУЧЕНИЯ: очная
СРОК ОБУЧЕНИЯ: 3 года

(МИКРОЭКОНОМИКА)

Москва
2025

Тема 1. Эконометрика

1.1. Введение в эконометрику

Введение: функция условного математического ожидания и наилучший линейный предиктор. Модель простой регрессии. Метод наименьших квадратов.

Основная литература

Wooldridge, J.M., *Introductory Econometrics: A Modern Approach* (6th edition), South-Western Cengage Learning, 2016, гл. 1-2.

Дополнительная литература

1) Angrist, J.D., and J.-S. Pischke, *Mostly Harmless Econometrics: An Empiricist's Companion*, Princeton University Press, 2009.

2) Heiss, F., *Using R for Introductory Econometrics*, <http://www.urfie.net>

1.2. Множественный регрессионный анализ

Метрики качества подгонки. Нерелевантные переменные. Смещение вследствие пропущенной переменной. Мультиколлинеарность. Ошибки в спецификации модели. Теорема Гаусса-Маркова. Тестирование гипотез. Доверительные интервалы. Тестирование множественных линейных ограничений. F и t статистики. Состоятельность. Асимптотическая нормальность. Асимптотическая эффективность. Статистика множителя Лагранжа. Качество подгонки и выбор регрессоров. Предсказание. Бинарные переменные. Линейная модель вероятности.

Основная литература

Wooldridge, J.M., *Introductory Econometrics: A Modern Approach* (6th edition), South-Western Cengage Learning, 2016, гл. 3-7.

Дополнительная литература

1) Angrist, J.D., and J.-S. Pischke, *Mostly Harmless Econometrics: An Empiricist's Companion*, Princeton University Press, 2009.

2) Heiss, F., *Using R for Introductory Econometrics*, <http://www.urfie.net>

1.3. Гетероскедастичность

Гетероскедастичность. Тестирование на гетероскедастичность. Тест Уайта. Обобщенный метод наименьших квадратов. Статистический вывод, робастный к гетероскедастичности. Ошибка в спецификации функциональной формы. Прокси-переменные. Ошибка измерения. Пропущенные данные.

Основная литература

Wooldridge, J.M., *Introductory Econometrics: A Modern Approach* (6th edition), South-Western Cengage Learning, 2016, гл. 8-9.

Дополнительная литература

1) Angrist, J.D., and J.-S. Pischke, *Mostly Harmless Econometrics: An Empiricist's Companion*, Princeton University Press, 2009.

2) Heiss, F., *Using R for Introductory Econometrics*, <http://www.urfie.net>

1.4. Регрессионный анализ временных рядов

Временные ряды. Стациональность. Предсказание с использованием моделей авторегрессии (AR) и авторегрессионного распределенного лага (ADL). Оценка

динамических причинно-следственных эффектов. Стандартные ошибки, робастные к гетероскедастичности и автокорреляции (HAC).

Основная литература

Wooldridge, J.M., *Introductory Econometrics: A Modern Approach* (6th edition), South-Western Cengage Learning, 2016, гл. 10-12, 18.

Дополнительная литература

1) Angrist, J.D., and J.-S. Pischke, *Mostly Harmless Econometrics: An Empiricist's Companion*, Princeton University Press, 2009.

2) Heiss, F., *Using R for Introductory Econometrics*, <http://www.urfie.net>

Тема 2. Микроэкономическая теория

2.1. Теория потребителя

Отношения предпочтения, существование функции полезности. Функции выбора, многозначные отображения выбора. Слабая аксиома выявленных предпочтений, отношение выявленного предпочтения. Связь между отношениями предпочтения и отображениями выбора. Введение в теорию потребителя: товары, бюджетные множества, функции спроса. Свойства предпочтений, максимизация полезности, спрос по Вальрасу (маршалловский спрос), косвенная функция полезности. Минимизация расходов, спрос по Хиксу (компенсированный спрос), функция расходов. Декомпозиция Слуцкого. Измерение изменений в благосостоянии потребителя: компенсирующая и эквивалентная вариация, потребительский излишек. Рационализуемость потребительского выбора.

Основная литература

A.Mas-Collel, M.D.Winston, J.R.Green, *Microeconomic Theory*, New York, Oxford University Press, 1995, главы 1-4.

Дополнительная литература

1. Kreps, D. A Course in Microeconomic Theory, Princeton University Press, 1990.

2. Varian H., *Microeconomic Analysis*, 3rd edition. W.W.Norton & Company, New York, London, 1992.

3. Rubinstein, A., *Lecture Notes in Microeconomic Theory*, Princeton University Press, 2006.

2.2. Выбор в условиях неопределенности и обмен рисками

Теория ожидаемой полезности: понятие лотереи, составной лотереи, предпочтения на пространстве лотерей, существование функции ожидаемой полезности (фон Неймана - Моргенштерна). Отношение к риску, меры абсолютного и относительного отвращения к риску. Приложения: спрос на страховку и спрос на рисковый актив. Цена информации. Отношения стохастического доминирования первого и второго порядка. Функции полезности, зависящие от состояния мира. Объективная и субъективная неопределенность.

Основная литература

A.Mas-Collel, M.D.Winston, J.R.Green, *Microeconomic Theory*, New York, Oxford University Press, 1995, глава 6.

Дополнительная литература

1. Kreps, D. A Course in Microeconomic Theory, Princeton University Press, 1990.

2. Varian H., *Microeconomic Analysis*, 3rd edition. W.W.Norton & Company, New York, London, 1992.

3. Rubinstein, A., *Lecture Notes in Microeconomic Theory*, Princeton University Press, 2006.

2.3. Моделирование индивидуального поведения фирмы

Способы описания технологий: производственные множества, производственные функции. Свойства производственных множеств и производственных функций. Задача максимизации прибыли и свойства функции прибыли. Задача минимизации издержек и свойства функции издержек. Восстановление производственной функции исходя из спроса на факторы производства. Агрегирование в теории производства.

Основная литература

A.Mas-Collel, M.D.Whinston, J.R.Green, Microeconomic Theory, New York, Oxford University Press, 1995, глава 5.

Дополнительная литература

1. Kreps, D. *A Course in Microeconomic Theory*, Princeton University Press, 1990.
2. Varian H., *Microeconomic Analysis*, 3rd edition. W.W.Norton & Company, New York, London, 1992.
3. Snyder S., Nicholson W. *Microeconomic Theory. Basic Principles and Extensions*, 10th edition. 2008.

2.4. Моделирование поведения фирм в рыночных структурах

Предложение конкурентной фирмы. Модель совершенной конкуренции, частичное равновесие. Прикладной анализ частичного равновесия в модели совершенной конкуренции. Монополия и монополистическая конкуренция. Ценовая дискриминация. Монопольное производство долговечных товаров. Олигополия. Модель ценовой конкуренции Бертрана. Модель количественной конкуренции Курно. Модель конкуренции при информационной асимметрии Штакельберга. Модель дифференцированных товаров с линейным спросом. Модель пространственной конкуренции Хотеллинга. Несовершенные рынки и неоптимальность.

Основная литература

A.Mas-Collel, M.D.Whinston, J.R.Green, Microeconomic Theory, New York, Oxford University Press, 1995, глава 12.

Дополнительная литература

1. Kreps, D. *A Course in Microeconomic Theory*, Princeton University Press, 1990.
2. Varian H., *Microeconomic Analysis*, 3rd edition. W.W.Norton & Company, New York, London, 1992.
3. Snyder S., Nicholson W. *Microeconomic Theory. Basic Principles and Extensions*, 10th edition. 2008.

2.5. Общее экономическое равновесие и благосостояние

Модель экономики обмена с двумя товарами и двумя потребителями. Модель экономики с одним потребителем и одной фирмой. Модель малой открытой экономики с двумя фирмами и двумя факторами производства. Существование общего равновесия. Основные свойства равновесия: оптимальность по Парето, первая и вторая фундаментальные теоремы экономики благосостояния. Равновесие в условиях неопределенности: контингентные блага, равновесие Эрроу-Дебре, последовательные рынки. Полные и неполные рынки ценных бумаг. Несовершенная информация.

Основная литература

A.Mas-Collel, M.D.Winston, J.R.Green, Microeconomic Theory, New York, Oxford University Press, 1995, главы 15-17, 19.

Дополнительная литература

1. Kreps, D. A Course in Microeconomic Theory, Princeton University Press, 1990.
2. Varian H., Microeconomic Analysis, 3rd edition. W.W.Norton & Company, New York, London, 1992.
3. Kreps D., Microeconomic Foundations 1: Choice and Competitive Markets, Princeton University Press, 2012.

2.6. Теория игр

Игры с нулевой суммой и максиминимизация. Игры в нормальной форме: доминирующие стратегии, смешанные стратегии, равновесие Нэша. Существование равновесия Нэша. Игры в развернутой форме: дерево игры, равновесие, совершенное по подыграм, метод обратной индукции, критика обратной индукции. Неполная информация: равновесие Байеса-Нэша. Несовершенная информация: слабое секвенциальное равновесие, секвенциальное равновесие, равновесие дрожащей руки. Повторяющиеся игры и народные теоремы. Торги Нэша.

Основная литература

1. *D. Fudenberg, J. Tirole, Game Theory, MIT Press, 1991, главы 1, 3, 6, 8.*
2. *M.J. Osborne, An Introduction to Game Theory, Oxford University Press, 2003, главы 11, 14, 16.*
3. *A.Mas-Collel, M.D. Whinston, J.R.Green, Microeconomic Theory, New York, Oxford University Press, 1995, главы 7-9.*

Дополнительная литература

1. Barron E.N., Game Theory: An Introduction, Wiley Series in Operations Research, 2013.
2. Osborne M.J., Rubinstein A., A Course in Game Theory, MIT Press, 1994.

Прочая литература

Nisan N. et al. (eds), Algorithmic Game Theory, Cambridge University Press, 2007.

2.7. Фиаско рынков при наличии экстерналий и общественных благ

Экстерналии и неэффективность. Подходы к решению проблемы: нормативы, налоги (субсидии) Пигу, торгуемые разрешения на выбросы, интернализация внешнего воздействия; внешние эффекты и права собственности: теорема Коуза. Общественные блага. Условие эффективности, проблема безбилетника. Подходы к решению проблемы. Фиаско рынков при асимметрии информации. Ненаблюдаемые характеристики и проблема неблагоприятного отбора. Варианты решения.

Основная литература

A.Mas-Collel, M.D.Winston, J.R.Green, Microeconomic Theory, New York, Oxford University Press, 1995, глава 11.

Дополнительная литература

1. Kreps, D. A Course in Microeconomic Theory, Princeton University Press, 1990.
2. Varian H., Microeconomic Analysis, 3rd edition. W.W.Norton & Company, New York, London, 1992.
3. Kreps D., Microeconomic Foundations 1: Choice and Competitive Markets, Princeton University Press, 2012.

2.8. Информационная асимметрия

Классификация задач с асимметричной информацией. Информационная асимметрия и провалы рынка. Сигнализирование с асимметричной информацией: модель образования Спенса, модель "дешевой болтовни" (cheap talk) Кроуфорда и Собеля. Скрининг на рынках: модель конкурентного скрининга. Проблема принципала-агента со скрытой информацией: модель монопольного скрининга. Проблема принципала-агента со скрытыми действиями: оптимальные контракты, скрытые действия в командах, карьерные (репутационные) соображения.

Основная литература

1. P. Bolton, M. Dewatripont, *Contract Theory*, MIT Press, 2004, главы 3, 8, 10.
2. J. Laffont, D. Martimort, *The Theory of Incentives: The Principal - Agent Model*, Princeton University Press, 2002, главы 1-5.
3. A. Mas-Collel, M.D. Whinston, J.R. Green, *Microeconomic Theory*, New York, Oxford University Press, 1995, главы 13-14.

Дополнительная литература

1. Salanie, B., *The Economics of Contracts: A Primer*, MIT Press, 2005.
2. Kreps, D. *A Course in Microeconomic Theory*, Princeton University Press, 1990.

2.9. Дизайн механизмов

Теория общественного выбора: общественные предпочтения, функции общественного выбора. Теорема Эрроу о диктаторе. Однопиковые предпочтения и теорема о медианном избирателе. Примеры механизмов: аукционы, общественные блага, модель обмена. Механизмы в доминирующих стратегиях: принцип выявления, механизм Гровса-Кларка. Байесовы механизмы. Имплементация в равновесиях Нэша и других концепциях равновесия. Теорема об эквивалентности доходов. Теорема Майерсона-Саттертуэйта. Построение оптимальных механизмов. Задача о сделках, торговые решения, вектор Шепли. Двухсторонние мэтчинги.

Основная литература

1. A. Mas-Collel, M.D. Whinston, J.R. Green, *Microeconomic Theory*, New York, Oxford University Press, 1995, главы 21-23.
2. V. Krishna, *Auction Theory*, Elsevier, 2002.
3. A.E. Roth, M.A.O. Sotomayor, *Two-Sided Matching*, Cambridge University Press, 1990.
4. J. Moore, *Implementation, Contracts, and Renegotiation in Environments with Complete Information*, in: *Advances in Economic Theory, Sixth World Congress, Vol. 1*, Cambridge University Press, 1992.
5. H. Moulin, *Fair Division and Collective Welfare*, MIT Press, 2004.

Дополнительная литература

1. Kreps, D. *A Course in Microeconomic Theory*, Princeton University Press, 1990.
2. Kreps, D. *Microeconomic Foundations 1: Choice and Competitive Markets*, Princeton University Press, 2012.

Тема 3. Макроэкономика

3.1. Введение и учет национального дохода

Макроэкономические агрегаты. Счета национального дохода. Макроэкономические данные. Равновесие. Национальный доход: источники и использование.

Основная литература

Mankiw, N. Gregory, *Macroeconomics*, 8th edition, Worth Publishers 2012, гл. 1-3.

Дополнительная литература

1) Barro, Robert & Xavier Sala-i-Martin, *Economic Growth*, 2nd edition, Cambridge MA: MIT Press 2003.

2) Mishkin, Frederic S. & Eakins, Stanley G., *Financial Markets and Institutions*, 7th edition, Pearson 2012.

3.2. Деньги, инфляция, финансовая система

Экономическое определение денег. Количественная теория денег. Предложение денег. Спрос на деньги. Рынок денег. Процентные ставки. Инфляция.

Основная литература

Mankiw, N. Gregory, *Macroeconomics*, 8th edition, Worth Publishers 2012, гл. 4-5.

Дополнительная литература

1) Barro, Robert & Xavier Sala-i-Martin, *Economic Growth*, 2nd edition, Cambridge MA: MIT Press 2003.

2) Mishkin, Frederic S. & Eakins, Stanley G., *Financial Markets and Institutions*, 7th edition, Pearson 2012.

3.3. Открытая экономика: обменные курсы, торговля и потоки капитала

Платежный баланс. Сбережения и инвестиции в малой открытой экономике. Чистый экспорт. Реальный и номинальный обменные курсы. Паритет покупательской способности. Режимы обменного курса.

Основная литература

Mankiw, N. Gregory, *Macroeconomics*, 8th edition, Worth Publishers 2012, гл. 6.

Дополнительная литература

1) Barro, Robert & Xavier Sala-i-Martin, *Economic Growth*, 2nd edition, Cambridge MA: MIT Press 2003.

2) Mishkin, Frederic S. & Eakins, Stanley G., *Financial Markets and Institutions*, 7th edition, Pearson 2012.

3.4. Экономический рост

Модель Солоу. Накопление капитала. Уровень капитала, удовлетворяющий "золотому правилу". Рост населения. Технологический прогресс в модели Солоу. Политика стимулирования роста. Путь сбалансированного роста. Конвергенция. Теория эндогенного роста. Учет роста.

Основная литература

Mankiw, N. Gregory, *Macroeconomics*, 8th edition, Worth Publishers 2012, гл. 8-9.

Дополнительная литература

- 1) Barro, Robert & Xavier Sala-i-Martin, Economic Growth, 2nd edition, Cambridge MA: MIT Press 2003.
- 2) Mishkin, Frederic S. & Eakins, Stanley G., Financial Markets and Institutions, 7th edition. Pearson 2012