

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

(МАКРОЭКОНОМИКА)

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.nrfie.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.Whinston, 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.Whinston, 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.

Тема 3. Макроэкономика

3.1.1. 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.

3.1.2. 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.

3.1.3. 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.

3.1.4. 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

3.2.1. Совокупное предложение и совокупный спрос.

Различные теории совокупного предложения: новая классическая теория и новое кейнсианство. Различия между долгосрочным и краткосрочным периодами.

Основная литература

Mankiw, N. Gregory, Macroeconomics, 8th edition, Worth Publishers 2012, гл. 10.
Jeffrey D. Sachs, Felipe Larrain B., Macroeconomics in the Global Economy, Prentice-Hall, Inc., 1993, гл. 3.

3.2.2. Моделирование выпуска в закрытой экономике.

Модель IS-LM для закрытой экономики и эффекты фискальной и монетарной политик.

Основная литература

Jeffrey D. Sachs, Felipe Larrain B., Macroeconomics in the Global Economy, Prentice-Hall, Inc., 1993, гл. 12.

Дополнительная литература

Mankiw, N. Gregory, Macroeconomics, 8th edition, Worth Publishers 2012, гл. 11-12.

3.2.3. Моделирование выпуска в открытой экономике.

Модель IS-LM для открытой экономики с фиксированным и плавающим валютными курсами и эффекты фискальной и монетарной политик.

Основная литература

Jeffrey D. Sachs, Felipe Larrain B., Macroeconomics in the Global Economy, Prentice-Hall, Inc., 1993, гл. 13-14.

Дополнительная литература

Mankiw, N. Gregory, Macroeconomics, 8th edition, Worth Publishers 2012, гл. 13.

3.2.4. Инфляция, инфляционный налог и сеньораж.

Государственный бюджет, рост денежной массы и инфляция, дефицит государственного бюджета.

Основная литература

Jeffrey D. Sachs, Felipe Larrain B., Macroeconomics in the Global Economy, Prentice-Hall, Inc., 1993, гл. 9, 11.

3.2.5. Инфляция и безработица.

Экономическая политика и кривая Филипса.

Основная литература

Jeffrey D. Sachs, Felipe Larrain B., Macroeconomics in the Global Economy, Prentice-Hall, Inc., 1993, гл. 15.

Дополнительная литература

Mankiw, N. Gregory, Macroeconomics, 8th edition, Worth Publishers 2012, гл. 14.

3.3.1. Модель Солоу в непрерывном времени

Основные принципы построения моделей в непрерывном времени, фазовые диаграммы, модель с человеческим капиталом.

Основная литература

Acemoglu, Daron, Introduction to modern economic growth, Princeton Univ. Press, 2009, chapter

2, 10.3.

3.3.2. Неоклассическая модель роста.

Решение задачи планировщика, сбалансированная траектория роста, децентрализованное равновесие.

Основная литература

Acemoglu, Daron, Introduction to modern economic growth, Princeton Univ. Press, 2009, chapter 8.

3.3.3. Модель перекрывающихся поколений

Рост в модели перекрывающихся поколений, динамическая неэффективность, деньги и пузыри.

Основная литература

Acemoglu, Daron, Introduction to modern economic growth, Princeton Univ. Press, 2009, chapter 9.

Дополнительная литература

Blanchard, O.J., and S. Fischer (1989), Lectures on Macroeconomics, MIT Press, chapters 3-5.

3.4.1. Потребление.

Теория жизненного цикла и гипотеза постоянного дохода. Потребление в условиях неопределенности: гипотеза случайного блуждания. Эмпирические приложения: избыточная гладкость и избыточная чувствительность потребления. Расширения: сбережения по мотивам предосторожности, ограничения заимствования (ликвидности), формирование привычек, товары длительного пользования, динамически несостоятельные предпочтения.

Основная литература

Romer, D. (2019), Advanced Macroeconomics, McGraw-Hill Irwin, 5th ed. - гл. 8

Blanchard, O.J., and S. Fischer (1989), Lectures on Macroeconomics, MIT Press - гл. 6.2

Дополнительная литература

Attanasio, Orazio P., Consumption, in J.B. Taylor & M. Woodford (eds.), Handbook of Macroeconomics, Elsevier Science, 1999

Attanasio & Weber, Consumption and Saving: Models of Intertemporal Allocation and Their Implications for Public Policy, JEL 48, 2010

Browning & Crossley, The Life-Cycle Model of Consumption and Saving, JEP 15-3, 2001

Carroll, A Theory of the Consumption Function, with and without Liquidity Constraints, JEP 15-3, 2001

3.4.2. Ценообразование активов

САРМ и САРМ на основе потребления. Модель ценообразования активов Лукаса. Временная структура процентных ставок. Цены акций и загадка премии за риск.

Основная литература

Romer, D. (2019), Advanced Macroeconomics, McGraw-Hill Irwin, 4th ed. - гл.8

Blanchard, O.J., and S. Fischer (1989), Lectures on Macroeconomics, MIT Press - гл. 10.1

Дополнительная литература

Campbell, John Y., Asset Prices, Consumption and the Business Cycle, in J.B. Taylor & M. Ljungqvist, Lars & Sargent, Thomas J., Recursive Macroeconomic Theory, The MIT Press, 2nd ed., 2004-гл. 13

Woodford (eds.), Handbook of Macroeconomics, Elsevier Science, 1999

3.4.3. Инвестиции.

Модель инвестиций с издержками приспособления, модель q-Тобина, её эмпирическое тестирование, условия Хаяши. Теорема Модильяни-Миллера. Расширения: невыпуклые издержки приспособления, фиксированные издержки приспособления. Инвестиции в

условиях неопределенности, невозвратные инвестиции и реальные опционы.

Основная литература

Romer, D. (2019), Advanced Macroeconomics, McGraw-Hill Irwin, 4th ed. - гл.9

Blanchard, O.J., and S. Fischer (1989), Lectures on Macroeconomics, MIT Press - гл. 6.3

Дополнительная литература

Caballero, Ricardo J., Aggregate Investment, in J.B. Taylor & M. Woodford (eds.), Handbook of Macroeconomics, Elsevier Science, 1999

3.5.1. Основные эмпирические факты о деловых циклах.

Тренд и деловой цикл: как их различать на практике? Циклическое поведение основных макроэкономических временных рядов.

Основная литература

Romer, D. (2019), Advanced Macroeconomics, McGraw-Hill Irwin, 5th ed.; earlier editions are also acceptable - гл. 5.1 - 5.2

Uribe, M., and S. Schmitt-Grohe, M. (2017), Open Economy Macroeconomics, Princeton University Press, chapter 1

Дополнительная литература

Stock, J., and M. Watson (1999), "Business Cycle Fluctuations in U.S. Macroeconomic Time Series", Chapter 1, Volume 1 A, Handbook of Macroeconomics, J. Taylor and M. Woodford eds, North Holland, pp. 3-64

Ng, S., and J.H. Wright (2013), "Facts and Challenges from the Great Recession for Forecasting and Economic Modeling," Journal of Economic Literature 51(4), 1120-1154

Stock, J.H., and M.W. Watson (2001), "Vector Autoregressions," Journal of Economic Perspectives 15(4), 101-115

Ramey, V.A. (2016), "Macroeconomic Shocks and Their Propagation," in Handbook of Macroeconomics, Volume 2A, Elsevier B.V.

Nakamura, E., and J. Steinsson (2018), "Identification in Macroeconomics," Journal of Economic Perspectives 32(3), 59-86

3.5.2. Теория реальных деловых циклов.

Шоки производительности как потенциальная движущая сила делового цикла.

Аналитически решаемая версия модели реальных деловых циклов. Решение лог-линеаризованной РДЦ модели в общем случае, импульсные отклики. Калибровка модели на данных и ограничения РДЦ модели.

Основная литература

Romer, D. (2019), Advanced Macroeconomics, McGraw-Hill Irwin, 5th ed.; earlier editions are also acceptable - гл. 5.3 - 5.10

Дополнительная литература

King, R., and S. Rebelo (1999), "Resuscitating Real Business Cycles", Chapter 14, Volume 1B, Handbook of Macroeconomics, J. Taylor and M. Woodford eds, North Holland, 927-1007

Prescott, E.C. (2016), "RBC Methodology and the Development of Aggregate Economic Theory" in Handbook of Macroeconomics, Volume 2B, Elsevier B.V.

Kehoe, P. J., V. Midrigan, and E. Pastorino (2018), "Evolution of Modern Business Cycle Models: Accounting for the Great Recession," Journal of Economic Perspectives 32(3), 141-166

3.5.3. Несовершенная информация и реальные эффекты денег.

Свидетельства отсутствия нейтральности денег в краткосрочной перспективе.

Несовершенная информация о шоках совокупного спроса как возможная причина отсутствия нейтральности денег. Модель несовершенной информации Лукаса.

Стратегическая комплементарность и неполное подстраивание под новую информацию.

Калибровка монетарных моделей деловых циклов с несовершенной информацией.

Основная литература

Romer, D. (2019), Advanced Macroeconomics, McGraw-Hill Irwin, 5th ed.; earlier editions are also acceptable - гл.6

Дополнительная литература

Angeletos, G.-M., and C. Lian (2016), "Incomplete Information in Macroeconomics: Accommodating Frictions in Coordination," in Handbook of Macroeconomics, Volume 2A, Elsevier B.V.

3.5.4. Новое Кейнсианство (НКЕ).

Макро- и микроэкономические свидетельства жёсткости цен на товары и зарплат. Издержки меню как причина номинальных жёсткостей. Реальные жёсткости и стратегическая комплементарность. Модели жестких цен, основанные на времени (time-dependent) и на состояниях (state-dependent). Ново-Кейнсианская кривая Филипса: вывод и калибровка. Неразрешенные проблемы НКЕ моделей.

Основная литература

Romer, D. (2019), Advanced Macroeconomics, McGraw-Hill Irwin, 5th ed.; earlier editions are also acceptable - гл.7

Дополнительная литература

Taylor, J.B., "The Staying Power of Staggered Wage and Price Setting Models in Macroeconomics," in Handbook of Macroeconomics, Volume 2B, Elsevier B.V.

Walsh, C.E., Monetary Theory and Policy, MIT Press, 4th ed., 2017

Gali, J., Monetary Policy, Inflation, and the Business Cycle, Princeton University Press, 2nd ed., 2015

Gali, J. (2018), "The State of New Keynesian Economics: A Partial Assessment," Journal of Economic Perspectives 32(3), 87-112

Christiano, L.J., M.S. Eichenbaum, and M. Trabandt (2018), "On DSGE Models," Journal of Economic Perspectives 32(3), 113-140

Kaplan, G., and G.L. Violante (2018), "Microeconomic Heterogeneity and Macroeconomic Shocks," Journal of Economic Perspectives 32(3), 167-194

3.5.5. Несовершенства на рынках благ и факторов производства.

Рыночные несовершенства как возможный источник реальных жёсткостей. Издержки поиска на рынке труда и их последствия. Несимметричная информация на финансовых рынках и распространение шоков.

Основная литература

Romer, D. (2019), Advanced Macroeconomics, McGraw-Hill Irwin, 4th ed.; earlier editions are also acceptable - гл.10

Дополнительная литература

Mortensen, D.T., and C.A. Pissarides (1999), "Job Reallocation, Employment Fluctuations, and Unemployment," Chapter 18, Volume 1B, Handbook of Macroeconomics, J. Taylor and M. Woodford eds, North Holland, 1171-1228

Pissarides, C.A. (2000), Equilibrium Unemployment Theory, 2nd edition, MIT Press

Shimer, R. (2010), Labor Markets and Business Cycles, Princeton University Press

Brunnermeier, M.K., T.M. Eisenbach, and Y. Sannikov (2013), "Macroeconomics with Financial Frictions: A Survey," in D. Acemoglu, M. Arellano and E. Dekel (eds.), Advances in Economics and Econometrics, Tenth World Congress of the Econometric Society, Vol. II: Applied Economics, Cambridge University Press, New York, 4-94

3.5.6. Финансовый кризис 2007-2009 и состояние макроэкономики.

Как Великая Рецессия повлияла на современное макроэкономическое моделирование и мышление?

Основная литература

Gertler, M., and S. Gilchrist (2018), "What Happened: Financial Factors in the Great Recession," Journal of Economic Perspectives 32(3), 3-30

Mian, A., and A. Sufi (2018), "Finance and Business Cycles: The Credit-Driven Household Demand Channel." *Journal of Economic Perspectives* 32(3). 31-58