

Документ подписан простой электронной подписью
Информация о владельце:
ФИО: Суворов Антон Дмитриевич
Должность: Ректор
Дата подписания: 01.11.2022 19:11:06
Уникальный программный ключ:
a39bdb15d680d3b0adbfc0af5c1efb14747dc0



УТВЕРЖДАЮ
Ректор НОУ ВО РЭШ
А.Д. Суворов
«27» октября 2022 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 2023 году

НАУЧНАЯ СПЕЦИАЛЬНОСТЬ: 5.2.1. Экономическая теория
ФОРМА ОБУЧЕНИЯ: Очная
СРОК ОБУЧЕНИЯ: 3 года

(ЭКОНОМИКА)

Москва
2022

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.Winston, 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.