

Утверждена на заседании
Ученого совета МШЭ МГУ
14 сентября 2011 г.

**МОСКОВСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ
им. М.В. ЛОМОНОСОВА**

МОСКОВСКАЯ ШКОЛА ЭКОНОМИКИ

ПРОГРАММА

**вступительного экзамена в аспирантуру
по специальности 08.00.01
«Экономическая теория»**

**Москва
2011**

Раздел 1 Микроэкономика

1. Модель поведения потребителя.

Задача максимизации полезности потребителя. Бюджетное ограничение, предпочтения и функции полезности, условия оптимальности выбора потребителя при заданных ценах и доходе, маршаллианский спрос и его свойства. Теория выявленных предпочтений.

2. Модель поведения производителя

Задача минимизации издержек, задача максимизации прибыли. Условия оптимальности в задаче минимизации издержек. Условия оптимальности в задаче максимизации прибыли. Реакция условного и безусловного спроса на факторы производства на изменение цен факторов производства. Реакция выпуска на изменение цены готовой продукции. Прибыль и излишек производителя.

3. Общее равновесие.

Понятие частичного и общего равновесия. Модель Эрроу-Дебре. Закон Вальраса. Условия существования равновесия. Понятие Парето-оптимальности. Первая и вторая теорема благосостояния. Экономика обмена и ее графическое представление в случае двух товаров и двух потребителей (ящик Эджворта).

4. Теория монополии и олигополии.

Ценообразование в условиях монопольного положения производителя. Неэффективность монополии и способы ее измерения. Виды дискриминации. Ценовая дискриминация (первой, второй и третьей степени). Сравнение эффективности распределения ресурсов при дискриминации.

Модели олигополии Курно и Бертрана. Олигополия по Штакельбергу

Сравнение выпусков олигополии при сговоре и при конкуренции по Курно, Бертрану и Штакельбергу.

5. Провалы рынка в экономике с экстерналиями.

Примеры экстерналий. Трагедия общины. Типы экстерналий. Экстерналии и неэффективность. Подходы к решению проблемы неэффективности в экономике с экстерналиями: нормативы выбросов, налоги (субсидии) Пигу, рынки экстерналий, интернизация внешнего воздействия; внешние эффекты и права собственности.

6. Экономика с общественными благами.

Условия эффективности экономики с общественными благами. Равновесие Линдаля и его эффективность.

Добровольное финансирование общественных благ. Проблема безбилетника при добровольных вкладах в финансирование общественных благ (в равновесии по Нэшу).

7. Модель чистого обмена в условиях неопределенности.

Функция ожидаемой полезности. Понятие склонности к риску. Склонный/несклонный к риску агент и связь с функцией полезности. Индивидуальный выбор в условиях неопределенности.

Концепция контингентного блага. Потребительский выбор в условиях неопределенности (бюджетное множество в пространстве контингентных благ, предпочтения в пространстве контингентных благ). Равновесие в экономике чистого обмена в условиях неопределенности.

Основная литература:

1. Х. Вэриан. Микроэкономика. Промежуточный уровень. Современный подход. ЮНИТИ. Москва. 1997.
2. В. П. Бусыгин, Е. В. Желободько, А. А. Цыплаков. Микроэкономика — третий уровень. НГУ, 2003.
3. Р. Пиндайк. и Д.Рубинфельд Микроэкономика «Дело», М., 2000

Дополнительная литература:

1. A.Mas-Colell, M. D. Whinston, J.R. Green Microeconomic Theory. Oxford University Press, 1995
2. D.Kreps. Course in Microeconomic Theory Pearson Higher Education. 1990.

Раздел 2 Макроэкономика

ТЕМА 1. Введение в макроэкономику. Основные макроэкономические показатели.

Основные макроэкономические проблемы. Макроэкономическая политика. Методы макроэкономического анализа. Номинальные и реальные величины. Потоки и запасы. Краткосрочный, среднесрочный и долгосрочный анализ в макроэкономике. Основные макроэкономические потоки. Основное макроэкономическое тождество.

Валовой внутренний продукт (ВВП), показатели валового национального дохода, чистого национального дохода, личного дохода и располагаемого дохода. Номинальный и реальный ВВП. Фактический и потенциальный ВВП.

Дефлятор ВВП и индекс потребительских цен. Темп инфляции. Уровень безработицы. Номинальная и реальная ставки процента.

Мультипликаторы государственных расходов, налогов (аккордных и подоходных), трансфертов.

ТЕМА 2. Рынок денег и его равновесие.

Деньги: виды и функции. Количественная теория денег и транзакционный спрос на деньги. Теория предпочтения ликвидности и спекулятивный мотив спроса на деньги. Модель спроса на наличные деньги Баумоля-Тобина. Функция спроса на деньги.

Государственные расходы, их виды и воздействие на экономику. Налоги и их роль в экономике. Бюджетное ограничение правительства: операционный дефицит и его финансирование. Фискальная политика и государственный долг.

Финансовый рынок и его структура. Финансовые посредники и финансовые инструменты. Предложение денег. Денежные агрегаты. Современная банковская система и ее структура. Банки как финансовые посредники. Резервы банков и их виды. Норма обязательных резервов. Роль коммерческих банков в создании денег. Банковский (депозитный) мультипликатор. Центральный банк и его функции. Денежная база и денежная масса. Денежный мультипликатор.

Монетарная политика, ее цели и промежуточные ориентиры. Инструменты монетарной политики. Стимулирующая и сдерживающая монетарная политика. Механизм денежной трансмиссии. Равновесие денежного рынка и механизм его установления. Равновесная ставка процента и равновесная денежная масса.

Монетарная политика и инфляция. Таргетирование инфляции. Инфляция спроса и инфляция предложения. Инфляция и инфляционные ожидания. Реальные эффекты инфляции.

ТЕМА 3. Открытая экономика.

Макроэкономические показатели в открытой экономике. Платежный баланс и его структура. Счет текущих операций. Счет движения капитала. Официальные валютные резервы. Состояние платежного баланса.

Равновесие на валютном рынке. Номинальный и реальный валютный курс. Паритет покупательной способности. Факторы, влияющие на реальный валютный курс. Режимы валютного курса. Фиксированный и плавающий валютный курс.

ТЕМА 4. Безработица и инфляция.

Рынок труда и безработица. Уровень и виды безработицы. Естественный уровень безработицы. Последствия безработицы. Закон Оукена. Кривая Филлипса. Кривая Филлипса и макроэкономическая политика: выбор между инфляцией и безработицей.

Инфляция и ожидания: гипотеза адаптивных и рациональных ожиданий. Влияние инфляционных ожиданий на заработную плату, требуемую работниками. Модифицированная кривая Филлипса (с учетом ожиданий).

ТЕМА 5. Базовые модели экономического роста.

Модель Солоу.

Неоклассическая производственная функция и ее свойства. Уравнение динамики. Стационарные режимы в модели и их устойчивость. «Золотое правило» в модели Солоу. Реакция стационарного режима на изменение нормы накопления. Конвергенция в модели Солоу.

Литература: D. Romer, Ch.1

Модель Рамсея-Касса-Купманса.

Централизованная и децентрализованная формулировка модели и их эквивалентность. Стационарный режим в модели. Фазовая диаграмма. Модифицированное золотое правило. Шоки в модели Рамсея-Касса-Купманса. Влияние государственных расходов. Фискальная политика и рикарданская эквивалентность.

Литература: D. Romer, Ch.2, part A,

O. Blanchard 2.1-2.2

M. Wickens Ch. 1, 4

Модель перекрывающихся поколений.

Формулировка модели (функция полезности и бюджетное ограничение репрезентативного агента). Стационарные режимы в модели. Динамика модели в случае изменения ставки дисконтирования. Динамическая неэффективность.

Литература: D. Romer, Ch.2, part B.

Тема 6. Модели с деньгами и инфляция.

Модель перекрывающихся поколений с деньгами.

Введение денег в модель OLG. Функция спроса на деньги. Стационарное состояние в модели. Нейтральность денег.

Литература: O. Blanchard 4.1

Модель Сидрауского с деньгами.

Функция полезности и бюджетное ограничение домашнего хозяйства в модели. Условие оптимального распределения между денежными балансами и потреблением. Стационарное состояние в модели. Супернейтральность денег. Уравнение спроса на деньги и эластичность спроса по процентной ставке.

Литература: С.Е. Walsh, 2.2.

Инфляция и сеньораж.

Понятие сеньоража. Зависимость между величиной сеньоража и темпом роста денежной массы. Модель гиперинфляции Кейгана.

Литература: D. Romer, 10.8

Тема 7. Модели реального делового цикла.

Предназначение моделей реального делового цикла. Общее описание простейшей модели.

Литература: D. Romer, 4.1-4.3,

M. Wickens 14.1 – 14.3.2.

Основная литература:

1. Агапова Т.А., Серегина С.Ф. Макроэкономика. М., Маркет ДС, 2009.
2. Romer D. (2006) *Advanced Macroeconomics*. 3d ed. McGraw Hill Book Company: London.
3. Wickens M. *Macroeconomic Theory: A Dynamic General Equilibrium Approach*. Princeton University Press (January 3, 2008)
4. С.Е. Walsh. *Monetary theory and policy*. The MIT Press, 2nd ed, 2003.
5. Blanchard O.J., Fischer S. (1989) *Lectures on Macroeconomics*. MIT Press: Cambridge.

Дополнительная литература:

6. Мэнкью Г. *Макроэкономика*, - М.: МГУ, 1996
7. Бланшар О. *Макроэкономика*. М: ГУ-ВШЭ, 2010

Раздел 3**Эконометрика**

1. Классическая модель линейной парной регрессии. Исходные предположения классической модели. Оценка параметров регрессии методом наименьших квадратов (МНК). Теорема Гаусса-Маркова. Свойства МНК - оценок параметров.

2. Качество уравнения регрессии. Стандартные ошибки для коэффициентов регрессии. Тесты на равенство коэффициентов регрессии нулю («проверка на значимость»). Доверительные интервалы для коэффициентов регрессии. Коэффициент детерминации. Суть информационного критерия Шварца.

3. Мультиколлинеарность объясняющих переменных и последствия для оценок параметров регрессионной модели. Показатели мультиколлинеарности и методы борьбы с ней.

4. Регрессионно-неоднородные данные. Фиктивные переменные. Правила введения фиктивных переменных в уравнение регрессии.

5. Обобщенный метод наименьших квадратов и его свойства. Взвешенный МНК. Гетероскедастичность и ее экономические причины. Оценивание коэффициентов регрессии в условиях гетероскедастичности.

6. Автокоррелированность случайных ошибок, причины автокорреляции. Модель авторегрессии ошибок первого порядка. Диагностирование автокорреляции с помощью статистики Дарбина-Уотсона. Оценивание коэффициентов в условиях выявленной автокорреляции ошибок.

7. Временные ряды. Понятие стационарности ряда. Автокорреляционная функция. Модели авторегрессии и скользящего среднего. Выбор наилучшей модели. Векторная модель авторегрессии. Понятие коинтеграции. Модель коррекции ошибок. Интерпретация и применение модели.

8. Системы линейных регрессионных уравнений. Методы оценивания параметров.

9. Панельные данные. Обобщенная модель. Модели с фиксированными и случайными эффектами.
10. Методы классификации данных: кластерный и дискриминантный анализ.

Основная литература:

1. Айвазян С.А., Мхитарян В.С. Прикладная статистика и основы эконометрики. М.: ЮНИТИ, 1998.
2. Айвазян С. А. Методы эконометрики. Магистр: ИНФРА-М, 2010

Раздел 4

История экономической мысли

1. **Политическая экономия А. Смита.** Факторы роста богатства; разделение труда и границы рынка; бережливость. Труд как источник и «действительная мера» богатства; производительный и непроизводительный труд. Капитал как запас, виды капитала, деньги как элемент капитальных запасов, возмещение капитала и стоимость продукта («догма Смита»). Доход с капитала: соотношение прибыли и процента; ссудный и действительный капитал. Государство и экономика: аргументы против протекционизма; условия, при которых государственное регулирование оправдано.
2. **Политическая экономия после Смита.** Мальтус: закон народонаселения и его роль в классической политической экономии. Рикардо: трудовая теория стоимости, обратная зависимость между динамикой заработной платы и нормой прибыли; объяснение тенденции к понижению средней нормы прибыли. «Закон Сэя» и его критики.
3. **Политическая экономия Карла Маркса.** Закон стоимости и «товарный фетишизм». Теория прибавочной стоимости и капитала. Органическое строение капитала и средняя норма прибыли, стоимость и цена производства. Схемы воспроизводства общественного продукта, критика «догмы Смита».
4. **Маржиналистская революция.** Изменения в предмете и изменения в методе экономического анализа. Теория предельной полезности. Основные направления («школы») маржинализма: австрийская, лозаннская и англо-американская.
5. **Теория общего равновесия и экономическая теория благосостояния.**
Суть модели общего равновесия Л. Вальраса. Базисные понятия модели Вальраса: «аукционист», «нащупывание», *numeraire*.
Экономическая теория благосостояния. Теория благосостояния Пигу. Проблема межличностного сравнения полезности. Концепция оптимума Парето.
6. **Вклад Альфреда Маршалла в экономическую науку.** Метод частичного равновесия. Теория полезности и спроса. Эластичность и эффект отдачи от масштаба. Понятие репрезентативной фирмы.
7. **Теория циклов Н.Д. Кондратьева.**
Теоретическое наследие Н.Д. Кондратьева: статистический подход к теории равновесия; гипотеза больших циклов и ее дальнейшее развитие в мировой науке.
8. **Историческая школа и американский институционализм.** «Национальная экономия» Фридриха Листа и новое оправдание протекционизма. «Старая» и «новая» исторические школы. «Спор о методе» между Менгером и Шмоллером.
Т. Веблен: критика маржинализма, экономический эволюционизм, противопоставление индустрии и бизнеса. Понятие «демонстративного потребления»
9. **Дж.М. Кейнс.** Цели и новации «Общей теории занятости, процента и денег»: новый взгляд на рынки труда, денег и капитала; классическая и кейнсианская теории процента; временной горизонт теории; анализ с позиции спроса; проблема подвижности цен и количеств. Практические выводы из теории Кейнса.

10. Монетаризм. Общая характеристика и основания монетаризма. Механизм влияния денег на экономику; ожидания и их роль в монетаристских моделях. Кривая Филлипса и ее модификация Фридменом. Политические рекомендации монетаристов.

Основная литература

1. История экономических учений. Под ред. В. С. Автономова, О. И. Ананьина и Н. А. Макашевой. М., ИНФРА-М, 2000-2010.
2. Покидченко М.Г., Чаплыгина И.Г. История экономических учений. Учебное пособие. Инфра-М, 2010
3. Блауг М. Экономическая мысль в ретроспективе. М.: Дело. 1994.