МОСКОВСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ
имени М.В.ЛОМОНОСОВА

МОСКОВСКАЯ ШКОЛА ЭКОНОМИКИ (факультет)

Учебная программа утверждена
решением Ученого совета МШЭ МГУ
Протокол №_____ от «__» _____ 20__ г.

Рабочая программа дисциплины

«Макроэкономика - IV»

Направление подготовки 38.04.01 Экономика (уровень магистратуры)
для подготовки студентов – магистров очного отделения

Учебная программа утверждена
решением кафедры _____МШЭ МГУ
Протокол №_____ от «__» _____ 20__ г.

Цели и задачи дисциплины:

Учебная программа по курсу «Макроэкономика-4» разработана в соответствии с требованиями Государственного образовательного стандарта высшего профессионального образования Министерства образования и науки Российской Федерации.

Рабочая программа соответствует учебному плану подготовки магистров по направлению 38.04.01 «Экономика».

Изучение курса «Макроэкономика-4» предназначено для формирования и усвоения знаний, умений и навыков в области экономической теории и практики, которые необходимы для работы в государственных и частных структурах, а также развития профессиональных качеств, компетенций, необходимых для выполнения функциональных обязанностей в сфере экономики.

Основные задачи преподавания дисциплины:

- анализ поведения финансовых рынков и компонентов агрегированного спроса, таких как потребление и инвестиции в макроэкономических моделях
- ознакомление студентов с основами эмпирической проверки гипотез современной макроэкономической теории

В результате изучения дисциплины студент должен:

- ***Знать*** основные модели современной макроэкономической теории финансов;
- ***Уметь*** грамотно пользоваться аналитическими инструментами, используемыми в современной макроэкономике с целью их применения в исследовательской деятельности.
- ***Владеть*** основными инструментами математического аппарата моделирования макроэкономических процессов.
- ***Иметь представление*** об актуальных направлениях макроэкономических исследований.

Место дисциплины в структуре ООП:

А. Информация об образовательном стандарте и учебном плане:
— тип образовательного стандарта и вид учебного плана: ОС МГУ
— направление подготовки (в соответствии с образовательным стандартом) 38.04.01 «Экономика» (магистратура)

Б. Информация о месте дисциплины в образовательном стандарте и учебном плане:
— вариативная часть;

В. Перечень дисциплин, которые должны быть освоены для начала освоения данной дисциплины;

Макроэкономика III, Эконометрика III

Г. Общая трудоемкость (в ак. часах и зачетных единицах); 72 часа, 2 зачетных единиц.

Д. Форма промежуточной аттестации – экзамен;

Формы проведения:

А. Для дисциплин:
— форма занятий с указанием суммарной трудоемкости по каждой форме:
Лекции – 8 часов

практические занятия (семинары) 20 часов
самостоятельная работа 44 часа;

— формы текущего контроля – контрольные работы и домашние задания;

Распределение трудоемкости по разделам и темам, а также формам проведения занятий с указанием форм текущего контроля и промежуточной аттестации:

№ Тем	Название раздела, темы	Всего часов		
		Лек-ции	Семи нары	Само-стоятель-ная работа
1	*Моделирование рациональных ожиданий*	2	6	11
2	*Потребление*	2	6	11
3	*Инвестиции*	2	4	11
4	*Финансовые и кредитные рынки*	2	4	11
Всего по курсу – 72:		**8**	**20**	**44**

Краткое содержание курса

Тема 1. *Моделирование рациональных ожиданий.* Революция рациональных ожиданий, R 5.2, B 5. Межвременные предпочтения и цена неопределённости, [9] 3.

Тема 2. *Потребление.* Введение в теории жизненного цикла и перманентного дохода. R 7.2. Парадоксы потребления: излишняя гладкость и излишняя чувствительность, R 7.2-7.4. Сбережения из предосторожности [1] 16-17, гиперболическое дисконтирование [7], и формирование привычек, R 7.6.

Тема 3. *Инвестиции*. Неоклассическая модель инвестиций с выпуклыми издержками приспособления, R 8.1-8.5. Невыпуклые издержки приспособления, R 8-6. Инвестиции при неопределенности, кредитное рационирование, B 9.6. Теорема Модильяни-Миллера. Несовершенства финансовых рынков, роль асимметрии информации.

Тема 4. *Финансовые и кредитные рынки*. Полнота рынков и Парето эффективность, [1] 8, [8] 15. Модель оценки финансовых активов CAPM и модель CCAPM, основанная на потреблении, R 7.5, B 10.1. Модель Лукаса ценообразования акций, B 10.1. Стоимость акций; пузыри, B 5.2. Временная структура процентных ставок, R 9.3.

Перечень компетенций, формируемых в результате освоения дисциплины – по видам компетенций:

владение современными методами и инструментами исследования социально-экономических процессов, сравнительного анализа национальных моделей экономики (М-ИК-2);

способность оценивать институциональные изменения, динамику социально-экономических показателей и индикаторов развития общества (М-СК-5);

способность разрабатывать стратегии поведения экономических агентов на различных рынках (М-ПК-6);

способность готовить аналитические материалы для оценки мероприятий в области экономической политики и принятия стратегических решений на микро- и макроуровне (М-ПК-7);

Способность применять фундаментальные знания к решению макроэкономических проблем, с которыми сталкиваются экономические агенты (СПК-6);

Способность применять основные математические методы для моделирования экономических явлений, интерпретировать полученные результаты (СПК-8);

Используемые образовательные, научно-исследовательские и научно-производственные технологии:

А. Образовательные технологии
Б. Научно-исследовательские технологии:
В. Научно-производственные технологии;

Учебно-методическое обеспечение самостоятельной работы студентов, оценочные средства контроля успеваемости и промежуточной аттестации:

А. Учебно-методические рекомендации для обеспечения самостоятельной работы студентов. Чтение и анализ рекомендованной литературы, подготовка к семинарским занятиям, работа в малых группах над решением конкретных задач;

Б. Фонд оценочных средств: Письменный экзамен (4 часа). Итоговая оценка за курс исчисляется как среднее оценок за письменный экзамен и промежуточную контрольную работу.

В. Примерный список заданий для проведения текущей и промежуточной аттестации (темы для рефератов);

Задачи 1.4; 1.6; 2.1; 2.17; 9.2; 9.6; 9.7 из учебника [1].

Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины:

Основная:

(В) Бланшар О., Фишер С. Лекции по макроэкономике, Издательский дом «Дело» РАНХиГС, Москва 2014 (Blanchard, O.J. and S.Fisher, Lectures on Macroeconomics. Cambridge, MA.: MIT Press, 1992).

(R) Ромер, Д., Высшая макроэкономика, Издательский дом Высшей школы экономики, Москва 2014 (Romer D. Advanced macroeconomics. Fourth Edition. McGraw-Hill, New York, NY, 2012).

Дополнительная:

1. Ljungqvist, Lars & Sargent, Thomas J., Recursive Macroeconomic Theory, The MIT Press, 2nd ed., 2004

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

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

4. Campbell, John Y., Asset Prices, Consumption and the Business Cycle, in J.B. Taylor & M. Woodford (eds.), Handbook of Macroeconomics, Elsevier Science, 1999

5. Shiller, Market Volatility (Cambridge, MA: MIT Press, 1989)

6. Campbell, Lo, and MacKinlay, The Econometrics of Financial Markets (Princeton, NJ: Princeton University Press, 1997)

7. Farzin Y.H., Wendner R. On Hyperbolic Discounting https://congres.sfc.unistra.fr/download/D91_Wendner_Ronald.pdf

8. Stokey, Nancy L., Robert E. Lucas, Jr. and Edward C. Prescott. Recursive Methods in Economic Dynamics. Cambridge, MA: Harvard University Press, 1989

9. Lucas, Robert E., Jr. Models of Business Cycles. Reprint ed. Malden, MA: Blackwell, 1987.