

**МОСКОВСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ ИМЕНИ М.В. ЛОМОНОСОВА  
МОСКОВСКАЯ ШКОЛА ЭКОНОМИКИ**

**РАБОЧАЯ ПРОГРАММА УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ  
«ЭКОНОМИКА И УПРАВЛЕНИЕ НАРОДНЫМ ХОЗЯЙСТВОМ»**

**Направление подготовки научно-педагогических кадров высшей квалификации**

38.06.01 – Экономика

**Направленность (профиль)**

Экономика и управление народным хозяйством

**1. Наименование дисциплины-**Экономика и управление народным хозяйством

**2. Уровень высшего образования** – подготовка научно-педагогических кадров в аспирантуре.

**3. Направление подготовки**38.06.01 «Экономика»

Направленность программы08.00.05Экономика и управление народным хозяйством»

**4. Место дисциплины (модуля) в структуре ООП:**относится к вариативной части Блока 1 ООП;дисциплина по специальности обязательна для освоения , 3 з.е.

**5. Планируемые результаты обучения по дисциплине (модулю), соотнесенные с планируемыми результатами освоения образовательной программы (компетенциями выпускников)**

Формируемые компетенции (код компетенции)	Планируемые результаты обучения по дисциплине (модулю), характеризующие этапы формирования компетенций
ОПК-1: способность самостоятельно осуществлять научно-исследовательскую деятельность в соответствующей профессиональной области с использованием современных методов исследования и информационно-коммуникационных технологий	ВЛАДЕТЬ: современными методами, инструментами и технологией научно-исследовательской и проектной деятельности в определенных областях экономической науки Шифр: В1 (ОПК-1)
	ВЛАДЕТЬ: навыками публикации результатов научных исследований, в том числе полученных лично обучающимся, в рецензируемых научных изданиях Шифр: В2 (ОПК-1)
	УМЕТЬ: находить (выбирать) наиболее эффективные (методы) решения основных типов проблем (задач), встречающихся в избранной сфере научной деятельности Шифр: У1 (ОПК-1)
	УМЕТЬ: обобщать и систематизировать передовые достижения научной мысли и основные тенденции хозяйственной практики Шифр: У2 (ОПК-1)
	УМЕТЬ: анализировать, систематизировать и усваивать передовой опыт проведения научных исследований Шифр: У3 (ОПК-1)
	УМЕТЬ: собирать, отбирать и использовать необходимые данные и эффективно применять количественные методы их анализа Шифр: У4 (ОПК-1)

	<p>УМЕТЬ: выделять и обосновывать авторский вклад в проводимое исследование, оценивать его научную новизну и практическую значимость при условии уважительного отношения к вкладу и достижениям других исследователей, занимающихся (занимавшихся) данной проблематикой, соблюдения научной этики и авторских прав Шифр: У5 (ОПК-1)</p>
	<p>ЗНАТЬ: Знать основной круг проблем (задач), встречающихся в избранной сфере научной деятельности, и основные способы (методы, алгоритмы) их решения Шифр 31 (ОПК-1)</p>
	<p>ЗНАТЬ: Знать основные источники и методы поиска научной информации Шифр 32 (ОПК-1)</p>
<p>ПК-1: Владение методологией теоретических и экспериментальных исследований в области научной специальности (направленности образовательной программы)</p>	<p>ЗНАТЬ: теоретические основания, актуальные проблемы и тенденции развития соответствующей научной области и области профессиональной деятельности Код 31 (ПК-1)</p>
	<p>ЗНАТЬ: результаты новейших исследований и публикации в ведущих профессиональных журналах в выбранной сфере специализации Код 32 (ПК-1)</p>
	<p>ЗНАТЬ: существующие междисциплинарные связи и возможности использования экономического инструментария при проведении исследований на стыке наук Код 33 (ПК-1)</p>
	<p>УМЕТЬ: применять различные методы и инструменты при проведении исследований в определенных областях экономической науки Код У1 (ПК-1)</p>
	<p>УМЕТЬ: создавать собственные аналитические модели и применять их к решению различных задач Код У2 (ПК-1)</p>
	<p>ВЛАДЕТЬ: навыками анализа и синтеза передовых достижений в области научной специализации на базе целостного системного научного мировоззрения Код В1 (ПК-1)</p>

ПК-2: Владение культурой научного исследования в области научной специальности, в том числе с использованием новейших информационно-коммуникационных технологий	ЗНАТЬ: основные базы данных, электронные библиотеки и др. электронные ресурсы, необходимые для реализации научных проектов, организации исследовательской, проектной и иной деятельности, соответствующей научной области и области профессиональной деятельности Код 31 (ПК-2)
	УМЕТЬ: презентовать свои разработки широкой научной и профессиональной аудитории Код У1 (ПК-2)
	УМЕТЬ: осуществлять взаимодействие (сотрудничество) с авторитетными научно-исследовательскими или образовательными центрами Код У2 (ПК-2)
	ВЛАДЕТЬ: навыками общения с российскими и зарубежными коллегами в избранной сфере научных исследований, в том числе выступления на международных научных конференциях Код В1 (ПК-2)
ПК-4: способность адаптировать результаты современных экономических исследований для целей решения экономических проблем, возникающих в деятельности организаций и государственной политики	ЗНАТЬ: актуальные проблемы и тенденции развития соответствующей научной области и области профессиональной деятельности Код 31 (ПК-4)
	УМЕТЬ: сопоставлять достижения современной экономической мысли с реалиями хозяйственной практики Код У1 (ПК-4)
	УМЕТЬ: выработать свою точку зрения в профессиональных вопросах и отстаивать ее во время дискуссии со специалистами и неспециалистами Код У2 (ПК-4)
ПК-5: способность использовать результаты исследований, знание закономерностей и тенденций развития для совершенствования организационно-экономических механизмов, методов управления, разработки стратегий деятельности предприятий, организаций, комплексов отраслей	ЗНАТЬ: Основные подходы к оптимизации систем управления на микро-, мезо- и макроэкономическом уровне Код 31 (ПК-5)
	ЗНАТЬ: основные источники и методы поиска информации, необходимой для разработки программ совершенствования организационно-экономических механизмов, методов управления, разработки стратегий деятельности предприятий, организаций, комплексов отраслей Код 32 (ПК-5)

	<p>УМЕТЬ: разрабатывать порученные разделы, следуя выбранным методологическим и методическим подходам, представлять разработанные материалы, вести конструктивное обсуждение, дорабатывать материалы с учетом результатов их обсуждения Код У1 (ПК-5)</p>
	<p>УМЕТЬ: проводить экспертизы организационно-экономических механизмов, методов управления, программ развития предприятий, организаций, комплексов отраслей Код У2 (ПК-5)</p>
	<p>ВЛАДЕТЬ: навыками подготовки аналитических материалов, необходимых для совершенствования организационно-экономических механизмов, методов управления, разработки стратегий деятельности предприятий, организаций, комплексов отраслей Код В1 (ПК-5)</p>

**6. Объем дисциплины (модуля) в зачетных единицах с указанием количества академических или астрономических часов, выделенных на контактную работу обучающихся с преподавателем (по видам учебных занятий) и на самостоятельную работу обучающихся:**

Объем дисциплины (модуля) составляет 3 зачетных единицы, всего 108 часов, из которых 72 часа составляет контактная работа аспиранта с преподавателем (54 часа занятия лекционного типа, 10 часов занятия семинарского типа (семинары, научно-практические занятия, лабораторные работы и т.п.), 4 часа индивидуальные консультации, 0 часа мероприятия текущего контроля успеваемости, 4 часа мероприятия промежуточной аттестации), 36 часов составляет самостоятельная работа аспиранта.

**7. Входные требования для освоения дисциплины, предварительные условия:** «Теория стратегии и методология стратегирования»; «Стратегические аспекты региональной и пространственной экономики»

**8. Образовательные технологии:** программы финансового анализа, Excel, проектор и компьютер с возможностью проведения презентаций

**9. Содержание дисциплины (модуля), структурированное по темам (разделам) с указанием отведенного на них количества академических или астрономических часов и виды учебных занятий:**

Наименование и краткое содержание разделов и тем дисциплины (модуля),  форма промежуточной аттестации по дисциплине (модулю)	Всего (часы)	В том числе								
		Контактная работа (работа во взаимодействии с преподавателем), часы из них					Самостоятельная работа обучающегося, часы из них			
		Занятия лекционного типа	Занятия семинарского типа	Групповые консультации	Индивидуальные консультации	Учебные занятия, направленные на проведение текущего контроля успеваемости коллоквиумы, практические контрольные занятия и др)*	Всего	Выполнение домашних заданий	Подготовка рефератов и т.п..	Всего
Тема 1. Методологические основы науки стратегирования	18	6	2			8	3	3	6	
Тема 2. Система разработки и реализации стратегии	20	6	2		1	9	3	3	6	
Тема 3. Современная мировая финансовая система	12	6	1			2	9	2	4	
Тема 4. Методы и инструменты	12	6	1		1	2	10	2	4	

стратегического финансового анализа										
Тема 5. Экономические модели несовершенной конкуренции	10	6	1				7	2	2	4
Тема 6. Эффективность применения фискальной и монетарной политики	10	8	1		1		10	2	2	4
Тема 7. Методология разработки и реализации региональных стратегий	12	8	1				9	2	2	4
Тема 8. Методы эконометрического анализа в процессах стратегирования	12	8	1		1		10	2	2	4
<b>Промежуточная аттестация: кандидатский экзамен</b>			4							
<b>Итого</b>	<b>108</b>	54	10		4	4	<b>72</b>			<b>36</b>

### **Тема 1. Методологические основы науки стратегирования**

Подходы и стадии процесса стратегического мышления. Характеристика и оси стратегического мышления. Анализ стратегий конкурентов. Проведение OTSW-анализа, определение возможностей, угроз, сильных и слабых сторон экономического развития региона. Время как стратегический фактор. Сравнительная эффективность симметричных и ассиметричных стратегий. SWOT и OTSW,

сравнительный анализ этих подходов как стратегических инструментов. Экономические факторы ограничения при разработке и реализации стратегии. Процесс и факторы формирования стратегических приоритетов. Выбор стратегических приоритетов по анализу конкурентных преимуществ. Определяющие характеристики и критерии страны с формирующимся рынком.

**А. Основная литература:**

1. The Global Emerging Market: Strategic Management and Economics. – New-York and London: Routledge, 2009. - pp.488 (КвинтГФР: СУиЭ) [www.routledge.com](http://www.routledge.com) (use 20% code BUS73825)
2. Брейли, Р., Майерс, С. Принципы корпоративных финансов. Олимп-Бизнес. 1997. гл. 16.
3. Росс, С. Основы корпоративных финансов. БИНОМ. 2000. Гл. 16.
4. Grinblatt M., Titman S. Financial Markets and Corporate Policy. McGraw-Hill. 1998, ch.15, 18, 19 (19.4)
5. Пайк Р., Нил Б. Корпоративные финансы и инвестирование: Пер. с англ. – СПб.: Питер, 2006. – Гл.14,15,16.
6. Ченг Ф. Ли, Джозеф И. Финнерти. Финансы корпораций: теория, методы и практика: Пер. с англ. – М.: ИНФРА-М, 2000. – Гл.18,19,20,21.
7. Copeland N. and V. Antikarov. (2001), Real Options – A Practitioner’s Guide. Texere. Ch. 3 - 8.
8. Kahneman, Daniel and Amos Tversky (1979): “Prospect Theory: An Analysis of Decision under Risk,” *Econometrica*, Vol. 47, No. 2, pp. 263-291.
9. Kreps, David (1988): Notes on the Theory of Choice, in *Underground Classics in Economics*, Westview Press: Boulder and London, Chapters 4-9, 12.

**Б. Дополнительная литература:**

1. Журнал “Economist”
2. Газета “FinancialTimes”
3. Журнал “The International Journal of Emerging Markets”



4. Rabin, Matthew (2000): “Risk Aversion and Expected-Utility Theory: A Calibration Theorem,” *Econometrica*, Vol. 68, No. 5, Sections 1-3 only (pp. 1281-1289).
5. Starmer, Chris (2000): “Developments in Non-Expected Utility Theory: The Hunt for a Descriptive Theory of Choice under Risk,” *Journal of Economic Literature*, Vol. 38, No. 2, pp. 332-382.
6. Tversky, Amos and Daniel Kahneman (1992): “Advances in Prospect Theory: Cumulative Representation of Uncertainty,” *Journal of Risk and Uncertainty*, Vol. 5, No. 4, pp. 297-323.

## **Тема 2. Система разработки и реализации стратегии**

Стратегия как система. Стратегия входа. Стратегия выхода. Взаимосвязь между прогнозированием, стратегированием и планированием. Выбор стратегического сценария, тактики и политики. Связь между прогнозированием и разработкой стратегии. Основные этапы разработки стратегии. Принципы формулирования целей и задач в стратегии. Анализ внешней среды при разработке стратегии. Анализ внутренней среды при разработке стратегии. Глобальный формирующийся рынок: стратегические тенденции. Миссия и видение как элементы стратегии. Процесс внедрения стратегии. Характеристика и оси стратегического мышления.

### **А. Основная литература:**

1. The Global Emerging Market: Strategic Management and Economics. – New-York and London: Routledge, 2009. - pp.488 (КвинтГФР: СУиЭ) [www.routledge.com](http://www.routledge.com) (use 20% code BUS73825)
2. Брейли, Р., Майерс, С. Принципы корпоративных финансов. Олимп-Бизнес. 1997. гл. 16.
3. Росс, С. Основы корпоративных финансов. БИНОМ. 2000. Гл. 16.
4. Grinblatt M., Titman S. Financial Markets and Corporate Policy. McGraw-Hill. 1998, ch.15, 18, 19 (19.4)
5. Пайк Р., Нил Б. Корпоративные финансы и инвестирование: Пер. с англ. – СПб.: Питер, 2006. – Гл.14,15,16.
6. Ченг Ф. Ли, Джозеф И. Финнерти. Финансы корпораций: теория, методы и практика: Пер. с англ. – М.: ИНФРА-М, 2000. – Гл.18,19,20,21.
7. Copeland N. and V. Antikarov. (2001), Real Options – A Practitioner’s Guide. Texere. Ch. 3 - 8.

8. Kahneman, Daniel and Amos Tversky (1979): "Prospect Theory: An Analysis of Decision under Risk," *Econometrica*, Vol. 47, No. 2, pp. 263-291.
9. Kreps, David (1988): Notes on the Theory of Choice, in *Underground Classics in Economics*, Westview Press: Boulder and London, Chapters 4-9, 12.

**Б. Дополнительная литература:**

1. Журнал "Economist"
2. Газета "FinancialTimes"
3. Журнал "The International Journal of Emerging Markets"
4. Rabin, Matthew (2000): "Risk Aversion and Expected-Utility Theory: A Calibration Theorem," *Econometrica*, Vol. 68, No. 5, Sections 1-3 only (pp. 1281-1289).
5. Starmer, Chris (2000): "Developments in Non-Expected Utility Theory: The Hunt for a Descriptive Theory of Choice under Risk," *Journal of Economic Literature*, Vol. 38, No. 2, pp. 332-382.
6. Tversky, Amos and Daniel Kahneman (1992): "Advances in Prospect Theory: Cumulative Representation of Uncertainty," *Journal of Risk and Uncertainty*, Vol. 5, No. 4, pp. 297-323.

### **Тема 3. Современная мировая финансовая система**

Принципы функционирования двухуровневой банковской системы, основные этапы становления банковской системы современной России. Финансовая стратегия, и стратегические риски коммерческого банка, организация и методы управления рисками. Денежный оборот и его структура. Наличный денежный оборот. Безналичный денежный оборот и система безналичных расчетов. Методы государственного регулирования денежного обращения. Денежно-кредитная политика и ее инструменты. Инфляция: сущность и формы проявления. Антиинфляционная стратегия и политика. Методы антиинфляционного регулирования. Эволюция мировой валютной системы. Система золотого стандарта и ее разновидности. Бреттон-Вудская валютная система. Ямайская валютная система.

#### **А.Основная литература:**

1. Деньги, кредит, банки: учебник / под ред. О.И. Лаврушина.- 6-е изд. стер. – М.: КНОРУС. – 2007.
2. Мишкин Ф.С. Экономическая теория денег, банковского дела и финансовых рынков. М.: ООО «И.Д. Вильямс», 2006.
3. Селищев А.С. Деньги, кредит, банки.- СПб.: Питер, 2007.
4. Ежеквартальные доклады Центрального банка РФ «О денежной-кредитной политике».
5. «Основные направления единой государственной денежно-кредитной политики на 2011 год и период 2012 и 2013 годов» и аналогичные доклады ЦБ РФ на последующие годы / <http://www.cbr.ru/>
6. «Обзор финансовой стабильности за 2010 год» и аналогичные обзоры ЦБ РФ за последующие годы. / <http://www.cbr.ru/>

#### **Б.Дополнительная литература:**

1. Андрюшин С.А., Кузнецова В.В. Трансмиссионный механизм денежно-кредитной политики центральных банков в условиях глобального финансового кризиса // Бизнес и банки. 2010. №23.
2. Головнин М.Ю. Основные направления развития мировой валютной системы и денежно-кредитная политика России // Международная экономика. 2011. №2.

3. Головнин М.Ю. Теоретические основы денежно-кредитной политики в условиях глобализации. М.: Институт экономики РАН, 2008. Серия «Теоретическая экономика».
4. Моисеев С.Р. Денежно-кредитная политика: теория и практика. М.: Экономистъ, 2005.
5. Некипелов А.Д., Головнин М.Ю. Стратегия и тактика денежно-кредитной политики в условиях мирового экономического кризиса // Вопросы экономики. 2010. №1.

## 8.2. Журналы

1. «Деньги и кредит»
2. «Вопросы экономики»
3. «Финансы» и др.

## 8.3. Интернет-источники:

<http://www.cbr.ru/> - сайт Центрального Банка России

<http://www.economy.gov.ru> – сайт Минэкономразвития

<http://www.government.ru> - Интернет портал Правительства России

<http://www.minfin.ru/ru> - сайт Минфина России

<http://www.gks.ru/> - сайт Федеральной службы государственной

статистики

#### **Тема 4. Методы и инструменты стратегического финансового анализа**

Использование биномиальных деревьев для оценки стоимости опционов. Форвардная цена и стоимость форвардного контракта. Стратегический анализ различий между продажей опциона «колл» и покупкой опциона «пут». Критерии оценки эффективности инвестиционных проектов. Модель CAPM. Системные и специфические риски. Слияния и поглощения: оценка стоимости и эффективности сделок. Принятие инвестиционных решений на основе критерия IRR: ординарные и неординарные денежные потоки. Источники и структура капитала компании. Инфраструктура осуществления инвестиций. Участие России в международных финансовых организациях. Виды облигаций. Оценка стоимости облигации. Хеджирование рисков с помощью производных финансовых инструментов. Сущность операций хеджирования, спекуляций и арбитража на фондовых рынках. Оценка и выбор инвестиционных проектов на основе критерия NPV: достоинства и недостатки. Оценка инвестиционных проектов разной продолжительности. Оценка и выбор инвестиционных проектов на основе критерия «Период окупаемости»: достоинства и недостатки

##### **А. Основная литература – с выделением подразделов (по прилагаемой форме);**

1. Гражданский кодекс Российской Федерации. Часть первая. 30 ноября 1994г. № 51 – ФЗ. Часть вторая. 26 января 1996г. № 14 – ФЗ (с изменениями и дополнениями).
2. Налоговый кодекс Российской Федерации. Часть 1. 31 июля 1998 г. № 146 ФЗ. Часть 2. 5 августа 2000 г. № 117 – ФЗ (с изменениями и дополнениями).
3. О бухгалтерском учете. Федеральный закон от 21 ноября 1996 г. № 129 – ФЗ
4. О рынке ценных бумаг. Федеральный закон от 22 апреля 1996 г. № 39 - ФЗ (с изменениями и дополнениями).
5. Об акционерных обществах. Федеральный закон от 26 декабря 1995 г. № 208 – ФЗ ( с изменениями и дополнениями).
9. Брейли Р., Майерс С. Принципы корпоративных финансов. М.: «Олимп-Бизнес», 2008.
10. Дамодаран А. Инвестиционная оценка. М.
11. Росс С. Основы корпоративных финансов. БИНОМ. 2000.
12. Grinblatt M., Titman S. Financial Markets and Corporate Policy. McGraw-Hill. 1998

**Б.** Дополнительная литература – с выделением подразделов (по прилагаемой форме);

1. Гохан П. Слияния, поглощения и реструктуризация компаний. М: Альпина Бизнес Букс, 2004.
2. Оценка бизнеса. Под ред. Грязновой А.Г., Федотовой М.А. Москва: Финансы и статистика, 2-ое издание, 2004
3. Квинт В.Л. Глобальный формирующийся рынок: стратегическое управление и экономика (The Global Emerging Market: Strategic Management and Economics). – Нью-Йорк – Лондон. – Routledge. – 2009.
4. Коупленд Т., Муррин Дж. Стоимость компании: оценка и управление. М.: Олимп-бизнес, 2008.
5. Модильяни Ф., Миллер М. Сколько стоит фирма? М.: Дело.1999.
6. Пайк Р., Нил Б. Корпоративные финансы и инвестирование: Пер. с англ. – СПб.: Питер, 2006.
7. Стоимость капитала. Расчёт и применение / Пратт Ш.П. Пер. с англ. 2-е изд. – М.: ИД «Квинто-консалтинг», 2006.
8. Рудык Н.Б. Структура капитала корпораций. Теория и практика. М., Дело.2004.
9. Рэй К. Рынок облигаций. Торговля и управление рисками. М.: Дело. 1999.
10. Уэст Т., Джонс Д. Пособие по оценке бизнеса. Пер. с англ. М.: Квинто-Консалтинг, 2003.
11. Фостер Рид Стэнли, Лажу Александра Рид. Искусство слияний и поглощений. М: Альпина Бизнес Букс, 2004.
12. Ченг Ф. Ли, Джозеф И. Финнерти. Финансы корпораций: теория, методы и практика: Пер. с англ. – М.: ИНФРА-М, 2000.
13. Эванс Ф., Бишоп Д. Оценка компаний в слияниях и поглощениях. Создание стоимости в частных компаниях. Перевод с англ. Москва. Альпина Паблишер. 2004
14. Крупнейшие слияния и поглощения в 2018 году, ежемесячный аналитический журнал «Слияния и поглощения» (<http://www.ma-journal.ru/>)
15. М&А технологии // Слияния и Поглощения. 2004-2006. (<http://www.ma-journal.ru/>)

## **Тема 5. Экономические модели несовершенной конкуренции**

Сравнительный анализ стратегического взаимодействия фирм в моделях Курно и Штакельберга. Стратегическое взаимодействие лидера и ведомых фирм в модели ценового лидера. Стратегическое взаимодействие фирм в модели Бертрана. Сговор. Использование ценовой дискриминации 3-го типа при разработке стратегии монополистом. Экономические стратегии предоставления общественных благ. Добровольное финансирование. Равновесие Линдаля. Экономические стратегии предоставления общественных благ. Эффективные состояния и условие Самуэльсона. Выбор потребителя в условиях неопределенности. Стратегии инвестора (с учетом типа инвестора) при выборе оптимального портфеля. Стратегический подход к решению проблем внешних эффектов. Решение проблемы неэффективности: права собственности (теорема Коуза), интернализация, налог Пигу. Международная торговля. Парадокс Леонтьева. Модель Хекшира-Олина.

### **А. Основная литература**

1. Квинт В.Л. Концепция стратегирования. Т.1. – СПб.: СЗИУ РАНХиГС, 2019.
2. Квинт В.Л. Стратегическое управление и экономика на глобальном формирующемся рынке. – М.: Типография КЭМ, 2012.
3. Kvint V.L. Strategy for the Global Market. Theory and Practical Applications. N.-Y.; L.: Routledge, 2015, 2016.
4. Мас-Конел, А., Уинстон М., Грин Д. Микроэкономическая теория. – М. 2016.
5. Джеффри А., Джейли и Филипа Дж. Рени. Микроэкономика: продвинутый уровень. М. 2011

### **Б. Дополнительная литература**

1. Диксит А. Теория игр. Искусство стратегического мышления в бизнесе и жизни. М. 2018.

## **Тема 6. Эффективность применения фискальной и монетарной политики**

Эффективность применения и варианты фискальной политики для стабилизации закрытой экономики (автаркии): основные инструменты и цели, варианты политики, дискуссия о воздействии, критерии эффективного применения. Возможности и ограничения применения монетарной политики для стабилизации открытой экономики при различных режимах валютного курса. Общее и различное в

стабилизации закрытой и открытой экономики: цели, задачи, методы. Проблема монетарного финансирования дефицита государственного бюджета. Платежный баланс, его роль для стабилизации экономики.

### **Тема 7. Методология разработки и реализации региональных стратегий**

Мониторинг и прогнозирование внутренней и внешней среды региона в процессе разработки стратегий. Проведение OTSW-анализа, определение возможностей, угроз, сильных и слабых сторон экономического развития региона. Микроинструменты реализации региональной и местной экономической стратегии. Кластерные инициативы. Государственно-частное партнерство. Методы анализа региональной экономики. Типологии регионов и критерии их выделения. Стратегическая оценка базовых экономических факторов регионального развития. Оценка эффективности развития экономики региона. Стратегическая оценка базовых экономических факторов регионального развития. Отраслевая структура экономики региона.

#### **А.Основная литература**

- Гранберг А.Г. Основы региональной экономики: учебник для вузов. 5-е изд. – М.: ГУ-ВШЭ, 2006.
- Квинт В.Л. Стратегическое управление и экономика на глобальном формирующемся рынке. М.: Бюджет, 2012.
- Региональная экономика и пространственное развитие. В 2 т. / под общ.ред. Л.Э.Лимонова. – М.: Юрайт, 2017.

#### **Б.Дополнительная литература**

- Горкин А. П. Территориальная организация промышленного производства в развитых странах в постиндустриальную эпоху. Учебное пособие. – М., 2012.
- Город, район, страна и мир. Развитие России глазами страноведа / А.И. Трейвиш. – М., 2009.
- Зубаревич Н. В. Регионы России: неравенство, кризис, модернизация. – М.: Независимый институт социальной политики, 2010.



- Кузнецова О.В. Экономическое развитие регионов. – М., 2009.
- Кузнецова О.В., Кузнецов А.В. Системная диагностика экономики региона. – М., 2012.
- Capello, R. Regional economics. Routledge, 2015.
- Capello, R., Nijkamp P., eds. Handbook of regional growth and development theories. Edward Elgar Publishing, 2010.
- Clark, G., et al., eds. The Oxford handbook of economic geography. Oxford University Press, 2003.
- Coe, N., Kelly, P., Yeung, H. Economic geography: a contemporary introduction. Oxford: Blackwell, 2007.
- Combes, P., Mayer, T., Thisse, J. Economic geography: The integration of regions and nations. Princeton University Press, 2008.
- Pike, A., Rodriguez-Pose, A., Tomaney, J. Local and Regional Development. Routledge, 2006.
- Sheppard, E., Barnes, T. A companion to economic geography. Blackwell publishing, 2011.
- Stimson, R., Stough, R., Roberts, B. Regional economic development: analysis and planning strategy. Springer Science & Business Media, 2006.

### **Тема 8. Методы эконометрического анализа в процессах стратегирования**

Понятие “фиктивная переменная”. Сколько фиктивных переменных в случае качественной переменной с  $m$  градациями (категориями) следует включить в модель регрессии? Почему введение фиктивных переменных повышает точность оценивания модели регрессии, используемой при разработке стратегии? Понятие автокорреляционной (АКФ) и частной (ЧАКФ) автокорреляционной функции для моделей временных рядов. Применение этих понятий на примере построения одномерной модели временного ряда для экономических показателей. Формулировка моделей авторегрессии первого и второго порядка. Теоретические структуры автокорреляционной и частной автокорреляционной функции для модели авторегрессии первого порядка. Понятия стационарности временного ряда в узком и широком смысле, стационарность в среднем, ковариационно-стационарный временной ряд. Применение этих понятий на примере построения одномерной модели временного ряда для экономических показателей.

## А. Основная литература

### **Раздел 1. Многомерный статистический анализ**

1. Айвазян С.А., Мхитарян В.С. (2001). Прикладная статистика и основы эконометрики. Издание 2-е. Том 1: Теория вероятностей и прикладная статистика. М.: Юнити. — 656 с.
2. Айвазян С.А., Мхитарян В.С. (2001). Прикладная статистика и основы эконометрики. Издание 2-е. Том 2: Основы эконометрики. М.: Юнити. — 432с.
3. Айвазян С.А., Мхитарян В.С. (2001). Прикладная статистика в задачах и упражнениях. — М.: Юнити. — 270 с.

### **Раздел 2. Системы одновременных уравнений**

1. Айвазян С.А., Мхитарян В.С. (2001). Прикладная статистика и основы эконометрики. Издание 2-е. Том 2: Основы эконометрики. М.: Юнити. — 432с.
2. Магнус Я.Р., Катышев А.К., Пересецкий А.А. (2005). Эконометрика. Начальный курс. 7-е издание. — М.: Дело. — 504 с.

## Б. Дополнительная литература:

1. Андерсон Т. (1963). Введение в многомерный статистический анализ. М.: Физматгиз.
2. Баум К.Ф. Эконометрика. Применение пакета Stata: учебник и практикум для вузов / К.Ф. Баум; пер. с англ. под науч. ред. Г.И. Пеникаса. — М.: Издательство Юрайт, 2016.
2. Берндт Э.Р. (2005). Практика эконометрики: классика и современность. — М.: ЮНИТИ, глава 10.
3. Hamilton J.D. (1994). Time Series Analysis. — Princeton University Press, Chapter 9.
4. Greene W.H. (2000). Econometric Analysis. (Fourth edition). — Prentice Hall International, Inc., Chapter 16.

#### **10. Учебно-методические материалы для самостоятельной работы аспирантов:**

-Перечень основной и дополнительной учебной литературы.

-Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет».

#### **11. Ресурсное обеспечение:**

- Перечень основной и дополнительной учебной литературы, а также перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет» представлен в каждой теме отдельно
- Перечень используемых информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса, включая программное обеспечение, информационные справочные системы (при необходимости):
  - презентации в формате PowerPoint, доступ к сети интернет, биржевые статистические данные.
- Описание материально-технической базы:
  - А. Помещения: лекционный зал, аудитории для проведения семинарских занятий;
  - Б. Оборудование: компьютер с подключением к сети Интернет, проектор для проведения презентаций; принтер для распечатки контрольных заданий
  - В. Иные материалы: писчая бумага, калькуляторы.

**12. Язык преподавания:** русский

**13. Форма обучения:** очная и заочная

**14. Составитель:** д.э.н., профессор Владимир Львович Квинт, к.э.н. М.К. Алимуратов

**Оценочные средства для проведения текущего контроля и промежуточной аттестации.**

<b>ШКАЛА И КРИТЕРИИ ОЦЕНИВАНИЯ РЕЗУЛЬТАТА ОБУЧЕНИЯ по дисциплине (модулю)</b>				
<b>Оценка/Результат</b>	<b>2</b>	<b>3</b>	<b>4</b>	<b>5</b>
<b>Знания</b>	Отсутствие знаний в области экономики и управления народным хозяйством	Фрагментарные знания в области экономики и управления народным хозяйством	Общие, но не структурированные знания в области экономики и управления народным хозяйством	Сформированные систематические знания в области экономики и управления народным хозяйством
<b>Умения</b>	Отсутствие умений в области экономики и управления народным хозяйством	В целом успешное, но не систематическое умение в области экономики и управления народным хозяйством	В целом успешное, но содержащее отдельные пробелы умение в области экономики и управления народным хозяйством (допускает неточности не принципиального характера)	Успешное и систематическое умение в области экономики и управления народным хозяйством
<b>Навыки (владения)</b>	Отсутствие навыков, необходимых для управления народным хозяйством	Наличие отдельных навыков, необходимых для управления народным хозяйством	В целом сформированные навыки, необходимые для управления народным хозяйством, но не в активной форме	Сформированные навыки, необходимые для управления народным хозяйством, применяемые при решении задач

**Уровень освоения компетенций обучающимися оценивается на основе соответствующих карт компетенций, приведённых на сайте в разделе аспирантура**

## **Фонды оценочных средств, необходимые для оценки результатов обучения**

Необходимым условием допуска к сдаче устного экзамена является подготовка и представление реферата по теме своей Научно-квалификационной работы (диссертации), а также выступления на научном семинаре.

### **Критерии оценки реферата**

Подготовленный аспирантом реферат должен представлять собой критический и систематизированный обзор современной научной литературы по теме Научно-квалификационной работы (диссертации). Предполагается, что реферат может стать основой для одной из глав Научно-квалификационной работы (диссертации). В ходе подготовки реферата аспирант может получать индивидуальные консультации у преподавателей дисциплины.

При оценивании реферата учитываются следующие критерии:

- Полнота охвата и корректность описания содержательной проблематики по теме исследования
- Соответствие оформления реферата и стилистики текста общепринятым требованиям к научным работам

### **Критерии оценки выступления на научном семинаре**

Аспирант должен изложить промежуточные результаты подготовки своего реферата по данной дисциплине на одном из научных семинаров кафедры (по согласованию с научным руководителем), чтобы учесть комментарии коллег и сделать свой обзор более совершенным. При оценивании выступления на научном семинаре принимаются во внимание следующие критерии:

- Качество подготовки презентации и качество выступления
- Полнота охвата и корректность описания содержательной проблематики по теме исследования
- Качество научной дискуссии в ходе обсуждения на семинаре

## **Критерии оценки кандидатского экзамена**

Необходимым условием допуска к сдаче устного экзамена является подготовка и представление реферата по теме своей Научно-квалификационной работы (диссертации), а также выступления на научном семинаре.

Экзамен проводится в устной форме по билетам. В каждом билете по 3 вопроса.

Оценки выставляются по следующим критериям:

«Отлично» - получены полные ответы на 3 вопроса

«Хорошо» - один из трех вопросов раскрыт недостаточно в полном объеме

«Удовлетворительно» - два вопроса из трех раскрыты не в полном объеме

«Неудовлетворительно» - ответы на вопросы не раскрыты

## **Вопросы для экзамена**

### **Теория и практика стратегирования**

1. Подходы и стадии процесса стратегического мышления
2. Характеристика и оси стратегического мышления
3. Анализ стратегий конкурентов
4. Проведение OTSW-анализа, определение возможностей, угроз,
5. сильных и слабых сторон экономического развития региона.
6. Время как стратегический фактор.

7. Сравнительная эффективность симметричных и ассиметричных стратегий
8. SWOT и OTSW, сравнительный анализ этих подходов как стратегических инструментов.
9. Экономические факторы ограничения при разработке и реализации стратегии
10. Процесс и факторы формирования стратегических приоритетов
11. Выбор стратегических приоритетов по анализу конкурентных преимуществ.
12. Определяющие характеристики и критерии страны с формирующимся рынком
13. Стратегия как система
14. Стратегия входа
15. Стратегия выхода
16. Взаимосвязь между прогнозированием, стратегированием и планированием
17. Выбор стратегического сценария, тактики и политики.
18. Связь между прогнозированием и разработкой стратегии.
19. Основные этапы разработки стратегии.
20. Принципы формулирования целей и задач в стратегии.
21. Анализ внешней среды при разработке стратегии.
22. Анализ внутренней среды при разработке стратегии.
23. Глобальный формирующийся рынок: стратегические тенденции.
24. Миссия и видение как элементы стратегии
25. Процесс внедрения стратегии
26. Характеристика и оси стратегического мышления

## **Финансовая стратегия**

27. Принципы функционирования двухуровневой банковской системы, основные этапы становления банковской системы современной России.

28. Финансовая стратегия, и стратегические риски коммерческого банка, организация и методы управления рисками.

29. Денежный оборот и его структура. Наличный денежный оборот. Безналичный денежный оборот и система безналичных расчетов.

Методы государственного регулирования денежного обращения.

30. Денежно-кредитная политика и ее инструменты.

31. Инфляция: сущность и формы проявления. Антиинфляционная стратегия и политика. Методы антиинфляционного регулирования.

32. Эволюция мировой валютной системы. Система золотого стандарта и ее разновидности. Бреттон-Вудская валютная система. Ямайская валютная система.

33. Использование биномиальных деревьев для оценки стоимости опционов

34. Форвардная цена и стоимость форвардного контракта

35. Стратегический анализ различий между продажей опциона «колл» и покупкой опциона «пут».

36. Критерии оценки эффективности инвестиционных проектов

37. Модель CAPM

38. Системные и специфические риски

39. Слияния и поглощения: оценка стоимости и эффективности сделок

40. Принятие инвестиционных решений на основе критерия IRR: ординарные и неординарные денежные потоки

41. Источники и структура капитала компании.

42. Инфраструктура осуществления инвестиций.

43. Участие России в международных финансовых организациях

44. Виды облигаций. Оценка стоимости облигации.



45. Хеджирование рисков с помощью производных финансовых инструментов.
46. Сущность операций хеджирования, спекуляций и арбитража на фондовых рынках.
47. Оценка и выбор инвестиционных проектов на основе критерия NPV: достоинства и недостатки
48. Оценка инвестиционных проектов разной продолжительности
49. Оценка и выбор инвестиционных проектов на основе критерия «Период окупаемости»: достоинства и недостатки

### **Микроэкономика (стратегические аспекты)**

50. Сравнительный анализ стратегического взаимодействия фирм в моделях Курно и Штакельберга.
51. Стратегическое взаимодействие лидера и ведомых фирм в модели ценового лидера.
52. Стратегическое взаимодействие фирм в модели Бертрана. Сговор.
53. Использование ценовой дискриминации 3-го типа при разработке стратегии монополистом.
54. Экономические стратегии предоставления общественных благ. Добровольное финансирование. Равновесие Линдаля.
55. Экономические стратегии предоставления общественных благ. Эффективные состояния и условие Самуэльсона
56. Выбор потребителя в условиях неопределенности. Стратегии инвестора (с учетом типа инвестора) при выборе оптимального портфеля
57. Стратегический подход к решению проблем внешних эффектов. Решение проблемы неэффективности: права собственности (теорема Коуза), интернализация, налог Пигу.
58. Международная торговля. Парадокс Леонтьева. Модель Хекшира-Олина

### **Макроэкономика (стратегические аспекты)**

59. Эффективность применения и варианты фискальной политики для стабилизации закрытой экономики (автаркии): основные инструменты и цели, варианты политики, дискуссия о воздействии, критерии эффективного применения.

60. Возможности и ограничения применения монетарной политики для стабилизации открытой экономики при различных режимах валютного курса

61. Общее и различное в стабилизации закрытой и открытой экономики: цели, задачи, методы.

62. Проблема монетарного финансирования дефицита государственного бюджета.

63. Платежный баланс, его роль для стабилизации экономики

### **Региональное стратегирование**

64. Мониторинг и прогнозирование внутренней и внешней среды региона в процессе разработки стратегий.

65. Проведение OTSW-анализа, определение возможностей, угроз,

66. сильных и слабых сторон экономического развития региона.

67. Микроинструменты реализации региональной и местной экономической стратегии. Кластерные инициативы. Государственно-частное партнерство.

68. Методы анализа региональной экономики. Типологии регионов и критерии их выделения

69. Стратегическая оценка базовых экономических факторов регионального развития. Оценка эффективности развития экономики региона.

70. Стратегическая оценка базовых экономических факторов регионального развития. Отраслевая структура экономики региона.

### **Эконометрика (стратегические аспекты)**

71. Понятие “фиктивная переменная”. Сколько фиктивных переменных в случае качественной переменной с  $m$  градациями (категориями) следует включить в модель регрессии? Почему введение фиктивных переменных повышает точность оценивания модели регрессии, используемой при разработке стратегии?

72. Понятие автокорреляционной (АКФ) и частной (ЧАКФ) автокорреляционной функции для моделей временных рядов. Применение этих понятий на примере построения одномерной модели временного ряда для экономических показателей.

73. Формулировка моделей авторегрессии первого и второго порядка. Теоретические структуры автокорреляционной и частной автокорреляционной функции для модели авторегрессии первого порядка.

74. Понятия стационарности временного ряда в узком и широком смысле, стационарность в среднем, ковариационно-стационарный временной ряд. Применение этих понятий на примере построения одномерной модели временного ряда для экономических показателей.