

# **АННОТАЦИЯ РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ ДИСЦИПЛИНЫ**

## **Прикладная эконометрика**

**Автор:** Девятков А.Е., Перевышин Ю.Н.

**Код и наименование направления подготовки, профиля:** 38.04.01 Экономика («Экономика и финансы»)

**Квалификация (степень) выпускника:** Магистр

**Форма обучения:** очная

**Цель освоения дисциплины:**

Углубить компетенции в сфере аналитической работы в области экономики и финансов, а также научно-исследовательской работы.

**План курса:**

**Тема 1.** Алгоритмы численного решения динамических макроэкономических моделей.

Численное решение задачи оптимального роста. Имплементация в пакете DYNARE.

**Тема 2.** Численная реализация базовых моделей монетарной экономики.

Построение модели Сидравского в среде Octave/Dynare. Симуляция траекторий ключевых макроэкономических переменных.

**Тема 3.** Цели и инструменты денежно-кредитной политики (ДКП).

Построение в DYNARE модели с ограничением «деньги вперед», получение функций импульсного отклика в ответ на шок денежно-кредитной политики. Экономическая интерпретация полученных результатов.

**Тема 4.** Модель реального делового цикла (РДЦ).

Построение модели и решение модели РДЦ в Octave и DYNARE. Симуляция траекторий макроэкономических переменных в ответ на шок совокупной факторной производительности. Проблема калибровки параметров модели РДЦ.

**Тема 5.** Неокейнсианская модель делового цикла

Линеаризация уравнений неокейнсианской модели делового цикла. Калибровка. Имплементация в пакете DYNARE. Шоки денежно-кредитной политики в неокейнсианских моделях.

**Контактные часы:** 16

**Формы текущего контроля и промежуточной аттестации:** домашнее задание, зачет.

**Основная литература:**

1. [Ромер] Ромер Д., Высшая макроэкономика: учебник / Ромер, Дэвид; пер. с англ. под науч. ред. В. М. Полтеровича; Национальный исследовательский ун-т "Высшая школа экономики". - М. : Издательский дом Высшей школы экономики, 2014. - 855 с. - Библиогр.: с. 783-825. - ISBN 978-5-7598-0406-2. - ISBN 0-07-231855-4(pbk) : 376-00.
2. [Туманова] Макроэкономика. Элементы продвинутого подхода: учебник: гриф МО / Е. А. Туманова, Н. Л. Шагас. - М. : ИНФРА-М, 2007. - 400 с. - (Учебники экономического факультета МГУ им. М. В. Ломоносова). - ISBN 5-16-001864-6 : 160-00.
3. [Уолш] Монетарная теория и монетарная политика: учебник / Уолш, Карл ; перевод с английского К. В. Ивановой [и др.] ; под науч. ред. М. Г. Карева ; РАНХиГС при Президенте РФ. - М. : Дело, 2014. - 630 с. -