

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.

| Этап освоения компетенции | Показатель оценивания | Критерий оценивания |
|---------------------------|---|---|
| ПК-9.У | способен готовить аналитические материалы для оценки мероприятий в области принятия решений в области кредитно-денежной политики, управлением поведением экономических агентов при принятии стратегических решений на макроуровне | понимает и объясняет макроэкономические модели, выбирает и обосновывает применение моделей в зависимости от условий, проводит самостоятельные расчеты |

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. -