

АННОТАЦИЯ РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ ДИСЦИПЛИНЫ МИКРОЭКОНОМИКА (ПРОДВИНУТЫЙ УРОВЕНЬ)

Автор: Орлова Е.В.

Код и наименование направления подготовки, профиля: 38.04.01 Экономика («Системы больших данных в экономике»)

Квалификация (степень) выпускника: Магистр

Форма обучения: очная

Цель освоения дисциплины:

Сформировать компетенции в сфере аналитической работы в области экономики и финансов, обработки и анализов данных.

План курса:

Тема 1. Поведение потребителя и производителя

Предпочтения потребителя и их свойства. Рациональные предпочтения. Необходимое и достаточное условие существования функции полезности. Связь между свойствами предпочтений и свойствами функции полезности.

Задача максимизации полезности, свойства решений задачи потребителя, условия Куна-Таккера для задачи максимизации полезности, неявная функция полезности и ее свойства. Связь задачи максимизации полезности и задачи минимизации расходов. Соотношения двойственности. Свойства функции расходов и функции компенсированного спроса. Лемма Шепарда, тождество Роя, связь между функциями компенсированного и некомпенсированного спроса.

Технологическое множество и его свойства. Связь между свойствами технологического множества и свойствами производственной функции. Задача максимизации прибыли. Закон предложения. Задача минимизации издержек.

Тема 2. Общее равновесие.

Допустимые распределения. Парето-оптимальные распределения. Равновесие по Вальрасу. Равновесие с трансфертами. Первая и вторая теоремы благосостояния. Экономика чистого обмена. Ящик Эджуорта. Задача поиска Парето-оптимального распределения, решение задачи и Парето-оптимальность, соотношения, характеризующие Парето-оптимальное распределение. Понятие блокирующей коалиции, понятие ядра, ядро в коробке Эджуорта в случае двух потребителей, связь ядра и равновесного по Вальрасу распределения.

Частичное равновесие.

Тема 3. Выбор в условиях неопределенности

Лотереи, предпочтения на множестве лотерей, аксиома независимости. Функция ожидаемой полезности Неймана-Моргенштерна. Свойство линейности, теорема об ожидаемой полезности, единственность функции ожидаемой полезности с точностью до аффинного преобразования. Парадокс Алле.

Отношение к риску. Концепция денежного эквивалента; модель спроса на страховку; модель спроса на рисковый актив; коэффициент абсолютной несклонности к риску Эрроу-Пратта; сравнение отношения к риску между агентами-рискофобами с различными элементарными функциями полезности: определения и эквивалентность определений. Индивидуальное отношение к риску при различных уровнях богатства; убывающая абсолютная несклонность к риску. Коэффициент относительной несклонности к риску; возрастающий коэффициент относительной несклонности к риску и оптимальная доля богатства, инвестированная в рисковый актив.

Стохастическое доминирование первой и второй степени.

Тема 4. Асимметричная информация

Асимметрия информации и неблагоприятный отбор. Модель сигналов на рынке труда. Анализ разделяющих равновесий, анализ объединяющих равновесий, наилучшее разделяющее равновесие, возможность достижения Парето-улучшения.

Модель скрининга. Отсутствие объединяющих равновесий, анализ разделяющих равновесий, возможность разбиения разделяющего равновесия.

Проблема принципала-агента. Моральный риск. Модель со скрытыми действиями. Оптимальный контракт в случае наблюдаемых усилий и ненаблюдаемых усилий, потери в благосостоянии собственника.

Аудиторные часы: 64

Формы текущего контроля и промежуточной аттестации: опросы, контрольная работа, экзамен.

Основная литература:

1. Джейли Дж. А., Рени Ф. Дж. Микроэкономика. Продвинутый уровень. Пер. с англ. под науч. ред. В. П. Бусыгина, М. И. Левина, Е. В. Покатович. - М. : ГУ ВШЭ, 2011. - 733 с.
2. Е.А. Левина и Е.В. Покатович. Микроэкономика. Задачи и Решения. Издательский дом ГУ-ВШЭ, 2010.