Программа учебной дисциплины «Эмпирический анализ отраслевых рынков»

Утверждена
Академическим советом ООП «Экономика»
Протокол № 1 от «31»августа 2017 г.

Автор	Леонова Людмила Аркадьевна
Число кредитов	4
Контактная работа (час.)	40
Самостоятельная работа (час.)	112
Курс	2
Формат изучения дисциплины	Без использования онлайн курса

I. ЦЕЛЬ, РЕЗУЛЬТАТЫ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ И ПРЕРЕКВИЗИТЫ

Целями освоения дисциплины «Эмпирический анализ отраслевых рынков» является углубление знаний студентов по анализу отраслевых рынков и проведению эмпирического анализа прикладных экономических вопросов; освоение ими методологии и инструментария анализа процессов и явлений, затрагивающих функционирование и взаимодействие фирм.

В результате освоения дисциплины студент должен:

- Знать круг вопросов и практических проблем, изучаемых эмпирическими методами в теории отраслевых рынков.
- Уметь использовать инструментарий эконометрического анализа для исследования функционирования отраслевых рынков и моделирования поведения фирм.
- Иметь навыки обработки статистической информации для получения основных показателей теории отраслевых рынков.

Изучение данной дисциплины базируется на следующих дисциплинах:

- Микроэкономика
- Макроэкономика
- Теория отраслевых рынков
- Эконометрика
- Эконометрика (продвинутый уровень)

Для освоения учебной дисциплины, студенты должны владеть следующими знаниями и компетенциями:

- Знать теоретические основы микроэкономического анализа
- Владеть навыками публичной и научной речи
- Иметь навыки самостоятельно проведения прикладного эконометрического анализа

Основные положения дисциплины должны быть использованы в дальнейшем в процессе научно-исследовательской работы магистрантов, при выполнении магистерской диссертации, в профессиональной деятельности.

II. СОДЕРЖАНИЕ УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ

Тема 1. Эмпирические исследования теории отраслевых рынков: основные понятия и направления изучения

Необходимость эмпирических исследований в теории отраслевых рынков. Эволюция подходов в эмпирических исследованиях отраслевых рынков. Основные понятия теории отраслевых рынков. Эконометрические методы, применяемые при анализе отраслевых рынков: постановка и методы оценивания. Применение теории игр в теории отраслевых рынков.

Тема 2. Структурные модели

Различие структурных и неструктурных моделей. Сравнение структурных моделей с другими видами эконометрических моделей. Оценка структурных моделей. Примеры использования структурных моделей в теории отраслевых рынков при исследовании рыночной власти, дифференциации продуктов, аукционов, регулирования рынков.

Тема 3. Моделирование спроса и предложения в теории отраслевых рынков

Спрос и предложение. Рыночное равновесие. Эмпирическое моделирование спроса и предложения. Одновременные уравнения. Проблемы эконометрической оценки уравнений спроса и предложения. Выбор инструментальных переменных.

Тема 4. Динамические модели

Случаи применения динамических моделей. Краткосрочный и долгосрочный периоды. Анализ динамики одного агента. Динамические игры (случай нескольких агентов). Эконометрические модели временных рядов в приложении теории отраслевых рынков.

Тема 5. Оценка производственной функции

Понятие производственной функции. Проблема эндогенности. Особенности, достоинства и недостатки эконометрических методов, используемых при эмпирической оценке производственной функции: МНК, метод инструментальных переменных, оценки с использованием панельных данных, обобщенный метод моментов для динамических панельных данных.

III. ОЦЕНИВАНИЕ

В рамках текущего контроля оценивается аудиторная работа студентов на семинарских занятиях: активность студентов в дискуссиях, правильность решения задач на семинаре, презентация по результатам изучения научных статей и т.д.

Оценки по всем формам текущего контроля выставляются по 10-ти балльной шкале.

Письменный экзамен проводится в конце курса в присутствии преподавателя и предполагает краткий ответ на открытые вопросы, а также решение 1-2 задач. Вопросы составляются с учетом материалов, пройденных как на лекционных, так и на семинарских занятиях.

Для получение максимального балла студент должен дать правильные и исчерпывающие ответы на все предложенные ему вопросы по курсу «Эмпирический анализ отраслевых рынков».

При выполнении письменной контрольной работы, а также экзаменационной работы студент должен продемонстрировать знание теоретического материала соответствующего раздела курса, уметь правильно применять его к решению конкретных задач, соблюдать логику решения задачи и грамотно формулировать ответ.

Результатом проверки работы является оценка, выставляемая по 10-ти балльной шкале в соответствии со следующими критериями:

- высшая оценка в 10 баллов выставляется при отличном выполнении задания, то есть при наличии полных (с детальными пояснениями и культурой выкладок),

оригинальных и правильных решений задач, дополненных при необходимости документами, полученными в результате реализации (проверки) решения в компьютерной вычислительной среде, верных ответов и высококачественного оформления работы.

- оценка в 7-8-9 баллов выставляется при наличии решений задач и правильных ответов, но при отсутствии какого-либо из выше перечисленных отличительных признаков, как, например: детальных выкладок или пояснений, качественного оформления, представления алгоритма или последовательности решения задач.
- Оценка в 6 баллов выставляется при наличии отдельных неточностей в ответах (включая грамматические ошибки) или неточностях в решении задач непринципиального характера (описки и случайные ошибки арифметического характера).
- Оценка в 5 баллов выставляется в случаях, когда в ответах и в решениях задач имеются неточности и ошибки, свидетельствующие о недостаточном понимании вопросов и требующие дополнительного обращения к тематическим материалам.
- Оценка в 4 балла выставляется при наличии серьезных ошибок и пробелов в знаниях по контролируемой тематике.
- Оценка в 3 балла выставляется при наличии лишь отдельных положительных моментов в представленной работе.
- Оценка в 2 балла выставляется при полном отсутствии положительных моментов в представленной работе.

Оценка в 1 или 0 баллов выставляется в случаях, когда небрежные записи, неправильные ответы и решения, кроме того, сопровождаются какими-либо демонстративными проявлениями безграмотности или неэтичного отношения к изучаемой теме и предмету в целом.

Преподавателем оценивается презентация научных статей, обсуждение научных статей, решение задач на семинарских и практических занятиях и выставляется оценка по 10-ти балльной шкале - $O_{аудиторная}$.

Преподаватель оценивает самостоятельную работу студентов путем оценки правильности выполнения домашних работ, наличия и полноты подготовленных скриптов для эконометрических пакетов, оценкой уровня владения и освоения эконометрического инструментария для оценки задач анализа отраслевых рынков в рамках выполненного проекта. Оценки за самостоятельную работу студента преподаватель выставляет в рабочую ведомость. Оценка по 10-ти балльной шкале за самостоятельную работу определяется перед завершающим контролем - $O_{сам\cdot работа}$.

Накопленная оценка по дисциплине рассчитывается по формуле:

$$O_{накопленная} = 0{,}5 * O_{к/р} + 0{,}3 * O_{аудиторная} + 0{,}2 * O_{сам.работа},$$

где $O_{к/р}$- оценка за контрольную работу.

Переписывание контрольных работ не допускается.

Результирующая оценка за дисциплину выставляется по следующей формуле, где $O_{экзамен}$ – оценка за работу непосредственно на экзамене:

$$O_{результ} = 0{,}4 \cdot O_{экзамен} + 0{,}6 \cdot O_{накопл}\ .$$

Результирующая оценка округляется арифметическим способом. Результирующая оценка выставляется в диплом.

На экзамене студент может получить дополнительный вопрос, ответ на который оценивается в 1 балл.

IV. ПРИМЕРЫ ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ

Тематика заданий текущего контроля

Формулировка структурных моделей в теории отраслевых рынков, моделирование спроса и предложения, производственная функция, обобщенный метод наименьших квадратов, обобщенный метод моментов, метод инструментальных переменных, системы одновременных уравнений, модели с фиксированными и случайными эффектами, временные ряды.

Задание (из Aguirregabiria V. Econometric Issues and Methods in the Estimation of Production Functions // Munich Personal RePEc Archive. 2009)

Suppose that firms in our sample operate in the same markets for output and inputs. These markets are competitive. Output and inputs are homogeneous products across firms. For simplicity, consider a PF *(Production Function)* with only one input, say labor. The model can be described in terms of two equations. The production function:

$$yi = \alpha_L li + \omega i + ei$$

and the condition for profit maximization, i.e., marginal product is equal to the real wage (the firm's profit maximization problem depends on output $\exp\{y^e_i\}$ without the measurement error e_i):

$$\alpha_L \frac{\exp\{y_i^e\}}{\exp\{l_i\}} = W$$

where W represents the real wage. Note that W is the same for all the firms because, by assumption, they operate in the same competitive output and input markets. The reduced form equations of this structural model are:

$$y_i = \frac{\omega_i}{1-\alpha_L} + e_i$$

$$l_i = \frac{\omega_i}{1-\alpha_L}$$

Выпишите и найдите значение для предела по вероятности оценки по методу наименьших квадратов $\hat{\alpha}_L$: $p\lim\limits_{N\to\infty} \hat{\alpha}_L$.

Примерные вопросы для письменной экзаменационной работы

- Источники и примеры баз данных для проведения эмпирического анализа отраслевых рынков.
- Структурные и приведенные модели в теории отраслевых рынков.
- Этапы построения структурной модели.
- Эволюция подходов эмпирической оценки отраслевых рынков.
- Стохастический компонент в экономических моделях.
- Особенности оценивания модели «спрос-предложение».
- Статический и динамический анализ. Типичные предметы анализа в области теории отраслевых рынков в статическом и динамическом случае.
- Предпосылки в статических моделях и последствия их введения для эконометрического анализа.
- Применение теории игр при моделировании входа на рынок.
- Эконометрические методы, используемые при анализе ценовой дискриминации.
- Эмпирическое исследование моделей аукционов.
- Использование моделей дискретного выбора в теории отраслевых рынков.

Итоговый контроль осуществляется в виде экзамена, на котором проверяется степень владения материалом. Оценка итогового контроля выставляется по 10-бальной системе. Итоговый контроль – письменный экзамен.

V. РЕСУРСЫ

5.1 Основная литература

Розанова Н.М.Теория отраслевых рынков: в 2-х томах [Электронный ресурс]: учебник / Н.М. Розанова; ЭБС Юрайт. – М.: Издательство Юрайт, 2015. - 798 с. - ISBN 978-5-9916-4929- 2, 978-5-9916-4930-8, 978-5-9916-4931-5. – Режим доступа:

https://www.biblio-online.ru/viewer/teoriya-otraslevyh-rynkov-v-2-t-385397#page/1

– Загл. с экрана

5.2 Дополнительная литература

1 Вербик М. Путеводитель по современной эконометрике. М: Научная книга, 2008.

5.3 Дополнительная литература для самостоятельного использования

1 Handbook of Econometrics, Volume 6, ed. by J.J.Heckman, E.E. Leamer. North Holland. Chapter 64 (C. Reiss, F. A. Wolak).
2 Aguirregabiria V. The Dynamics of Markups and Inventories in Retailing Firms // The Review of Economic Studies. 1999. Vol. 66, No. 2, pp. 275-308.
3 Aguirregabiria V. Econometric Issues and Methods in the Estimation of Production Functions // Munich Personal RePEc Archive. 2009.
4 Berry S.T. Estimation of a Model of Entry in the Airline Industry // Econometrica. 1992. Vol. 60, No. 4, pp. 889-917.
5 Berry S. T. Estimating Discrete-Choice Models of Product Differentiation // The RAND Journal of Economics. 1994. Vol. 25, No. 2, pp. 242-262.
6 Berry S., Levinsohn J., Pakes A. Automobile Prices in Market Equilibrium // Econometrica. 1995. Vol. 63, No. 4, pp. 841-890.
7 Borenstein S., Shepard A. Dynamic Pricing in Retail Gasoline Markets // The RAND Journal of Economics. 1996. Vol. 27, No. 3, pp. 429-451.
8 Bresnahan T. F., Reiss P. C. Entry in Monopoly Markets // The Review of Economic Studies.1990. Vol. 57, No. 4, pp. 531-553.
9 Christensen L. R., Greene W. H. Economies of Scale in U.S. Electric Power Generation // The Journal of Political Economy. 1976. Vol. 84, No. 4, Part 1, pp. 655-676.
10 Dunne T., Roberts M. J., Samuelson L. Patterns of Firm Entry and Exit in U.S. Manufacturing Industries // The RAND Journal of Economics. 1988. Vol. 19, No. 4, pp. 495-515.
11 Ellison G. Theories of Cartel Stability and the Joint Executive Committee // The Journal of Economics. 1994. Vol. 25, No. 1, pp. 37-57.
12 Evans D. S., Heckman J. J. A Test for Subadditivity of the Cost Function with an Application to the Bell System // The American Economic Review. 1984. Vol. 74, No. 4, pp. 615-623.
13 Pinelopi Koujianou Goldberg. Dealer Price Discrimination in New Car Purchases: Evidence from the Consumer Expenditure Survey // The Journal of Political Economy. 1996. Vol. 104, No. 3, pp. 622-654.
14 Haile P. A., Tamer E. Inference with an Incomplete Model of English Auctions // The Journal of Political Economy. 2003. Vol. 111, No. 1, pp. 1-51.
15 Nevo A. Measuring Market Power in the Ready-to-Eat Cereal Industry// Econometrica. 2001. Vol. 69, No. 2, pp. 307-342.

16 Olley G. S., Pakes A. The Dynamics of Productivity in the Telecommunications Equipment Industry // Econometrica. 1996. Vol. 64, No. 6, pp. 1263-1297.
17 Porter R. H. A Study of Cartel Stability: The Joint Executive Committee, 1880-1886 // The Bell Journal of Economics. 1983. Vol. 14, No. 2, pp. 301-314.
18 Porter R. H., Zona J. D. Detection of Bid Rigging in Procurement Auctions // The Journal of Political Economy. 1993. Vol. 101, No. 3, pp. 518-538.
19 Shepard A.. Price Discrimination and Retail Configuration // The Journal of Political Economy. 1991. Vol. 99, No. 1, pp. 30-53.
20 Slade M. E. Interfirm Rivalry in a Repeated Game: An Empirical Test of Tacit Collusion //The Journal of Industrial Economics. 1987.Vol. 35, No. 4, The Empirical Renaissance in Industrial Economics, pp. 499-516.
21 Verbeek, Marno (2012). A Gide to Modern Econometrics. Chichester-New York-Weinheirn-Brisbane-Toronto-Singapore: John Wiley & Sons, Ltd, 4ep edition.
22 Green, William H. (2011) Econometric Analysis. New York: Pearson Education International, 7th ed.

5.3 Программное обеспечение

№ п/п	Наименование	Условия доступа
1.	Stata /SE 11	*Из внутренней сети университета (договор)*
2	Microsoft Office2007 Prof+	*Из внутренней сети университета (договор)*

5.4 Профессиональные базы данных, информационные справочные системы, интернет-ресурсы (электронные образовательные ресурсы)

№ п/п	Наименование	Условия доступа
	Профессиональные базы данных, информационно-справочные системы	
1.	Электронно-библиотечная система Юрайт	Из внутренней сети университета URL: https://biblio-online.ru/
Интернет-ресурсы (электронные образовательные ресурсы)		
2.	Росстата - www.gks.ru Всемирного банка - www.worldbank.org	*Свободный доступ*

5.5 Материально-техническое обеспечение дисциплины

Занятия по дисциплине «Эмпирический анализ отраслевых рынков» проводятся в аудиториях, оборудованных видеопроекционным оборудованием для презентаций, экраном, компьютером, имеющим выход в Интернет. Для успешного освоения дисциплины используются электронные ресурсы библиотеки НИУ ВШЭ (http://library.hse.ru/e-resources/e-resources.htm). Некоторые разделы курса демонстрируются с помощью программы Microsoft Office PowerPoint.