

Программа учебной дисциплины

Деловые циклы

Утверждена

Академическим советом ООП «Экономика»

Протокол №2.9.1-12/16 от 15.05.2018

Автор	Малаховская Оксана Анатольевна
Число кредитов	5
Контактная работа (час.)	64
Самостоятельная работа (час.)	126
Курс	4 курс бакалавриата
Формат изучения дисциплины	Без использования онлайн курса

I. ЦЕЛЬ, РЕЗУЛЬТАТЫ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ И ПРЕРЕКВИЗИТЫ

Целями освоения дисциплины Деловые циклы является ознакомление студентов с современными представлениями о причинах циклических колебаний в экономике, методами их моделирования, развитие необходимых навыков макроэкономического структурного анализа для проведения исследований, а также обучение работе со специальным программным обеспечением (Matlab, Dynare).

II. СОДЕРЖАНИЕ УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ

Тема 1. Эволюция теорий деловых колебаний

Классическая модель. Великая депрессия. Кейнсианская модель деловых колебаний. Базовая кривая Филлипса. Монетаристская теория деловых колебаний. Модифицированная кривая Филлипса. Новая классическая теория деловых колебаний. Гипотеза рациональных ожиданий. Критика Лукаса. Шоки предложения. Теория RBC и ее критика. Новая кейнсианская теория делового цикла. Новый кейнсианский подход к монетарной политике.

Тема 2. Введение в Матлаб

Командное окно. Получение помощи. Арифметические операции. Общие сведения. Векторы и матрицы. Решение уравнений. Случайные величины. Скрипты. Циклы. Условия. Построение графиков. Функции.

Тема 3. Совокупный спрос

Кейнсианская теория потребления. Гипотеза перманентного дохода(РІН). Следствия РІН и эмпирические факты. Ограничения гипотезы перманентного дохода. Взаимосвязь предельной склонности к потреблению и фискальных мультипликаторов. Оценки мультипликатора госзакупок. Макроэкономический подход к инвестициям. Динамическая задача фирмы. Q-Тобина. Кривая IS.

Тема 4. Совокупное предложение и правило центрального банка

Моделирование реальной и номинальной жесткости на товарном рынке и рынке труда. Инфляционное таргетирование. Предпочтения центрального банка. Стабилизация в условиях различных шоков (шок спроса, инфляционный шок). Нулевая граница номинальных ставок. Ловушка дефляции.

Тема 5. Модель IS – PC - MR

Кривая Филлипса. Правило центрального банка. Стабилизация в условиях различных шоков (шок спроса, инфляционный шок). Нулевая граница номинальных ставок. Ловушка дефляции. Пример применения модели на практике: мировой финансовый кризис.

Тема 6. Детерминистические модели в Dynare

Программное обеспечение Dynare: общие сведения. Детерминистические и стохастические модели. Запись модели в Dynare. Объявление экзогенных и эндогенных переменных. Объявление параметров модели. Запись детерминистической модели. Начальные значения. Анализ временных и перманентных детерминистических изменений.

Тема 7. Модель AD-ERU-BT в открытой экономике

Валютный курс и непокрытый паритет процентных ставок. Модель WS-PS в открытой экономике. Кривая равновесия рынка труда – ERU. Совокупный спрос и торговый баланс. Краткосрочное, среднесрочное и долгосрочное равновесия. Отражение политики спроса в модели AD-ERU-BT.

Тема 8. Модель IS-PC-MR в открытой экономике

Шоки спроса в экономиках с различными валютными режимами. Монетарная политика при плавающем курсе. Шок предложения. Шок внешней торговли. Влияние шоков в среднесрочной перспективе. Реакция участников валютного рынка: кривая RX. Перелет валютного курса. Пример применения модели на практике: антиинфляционная политика Великобритании.

Тема 9. Базовые принципы DSGE моделирования

DSGE в исторической перспективе. Микроэкономические обоснования. Задача домашнего хозяйства. Производственный сектор. Конкурентное равновесие. Задача центрального планировщика. Стохастические шоки. Стационарное состояние. Логлинеаризация. Методы решения систем уравнений с рациональными ожиданиями. Метод Бланшара-Кана.

Тема 10. Базовая RBC-модель

RBC-модель в форме пространства состояний. Решение модели. Калибровка модели. Измерение технологических шоков. Функции импульсного отклика. Волатильность основных переменных в базовой модели.

Тема 11. Стохастические модели в Dynare

Объявление шоков модели. Запись стохастической модели. Тайминг. Стохастические симуляции. Функции импульсного отклика. Декомпозиция дисперсии ошибки. Структуры M_{\cdot} и oo_{\cdot} .

Тема 12. Отклонения от РИ

Привычки в потреблении: общее представление. Введение привычек в модель. Модификация базовой модели. Решение и калибровка модели с привычками. Сравнение функций импульсного отклика в модели с привычками и без них. Сравнение функций импульсного отклика в модели с привычками и без них. Нерикарданские агенты: общее представление. Введение в модель нерикарданских агентов. Агрегирование. Решение и модели с нерикарданскими агентами. Сравнение функций импульсного отклика в модели с рикарданскими агентами и без них.

Тема 13. Монополистическая конкуренция в модели общего равновесия

Предпосылки модели с монополистической конкуренцией. Сектор конечной продукции. Сектор промежуточной продукции. Задачи определения цен и объемов производства. Функции импульсного отклика и волатильность переменных в моделях с монополистической и совершенной конкуренцией.

Тема 14. Монетарная политика в NK DSGE модели.

Базовая новая кейнсианская модель. Сектор домашних хозяйств. Сектор конечной продукции. Сектор промежуточной продукции. Условия первого порядка. Правило центрального банка. Определение эффективного выпуска. Основное макроэкономическое тождество. Нелинейная и линеаризованная системы. Новая кейнсианская кривая Филлипса. Динамическая кривая IS. Калибровка. Реакция основных переменных модели на шоки. Возможные расширения базовой модели.

III. ОЦЕНИВАНИЕ

Дисциплина предполагает контрольную работу и домашнее задание после изучения первых 7 тем и экзамен в конце модуля, в который включаются задания по всем темам курса. И контрольная работа, и экзамен содержат теоретическую и практическую часть, баллы за которые учитываются в общей оценке за контрольную работу и экзамен с равным весом. Блокирующих элементов нет.

Итоговая оценка определяется по формуле:

$$\text{Оит.} = 0,24 \text{ Окр} + 0,16 \text{ Одз} + 0,6 \text{ Оэкз},$$

где Окр – это оценка за контрольную работу, Одз – это оценка за домашнее задание, Оэкз – это оценка за экзамен.

Пересдачи (и первая, и вторая) проводятся по формату экзамена, в них включаются все темы курса.

IV. ПРИМЕРЫ ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ

В задания контрольной работы включены короткие вопросы по лекциям, а также открытый вопрос. Открытый вопрос представляет собой описание реального исторического события (обычно экономического шока или политику), последствия которого нужно проанализировать с помощью изученных в курсе моделей. На экзамене студенты работают с моделью общего равновесия. При этом на практической части экзамена студенты решить должны задачу в Dynare, получить и проинтерпретировать вторые моменты эндогенных переменных, а также функции импульсного отклика.

V. РЕСУРСЫ

1. Основная литература

Knoop, T. (2015) Business Cycles Economics: Understanding Recessions and Depressions from Boom to Bust, Praeger (электронный учебник, доступ через подписку ebrary)
Romer, D. (2001) Advanced Macroeconomics, New York: McGraw-Hill (или более поздние издания)

2. Дополнительная литература

Houcque, D. Introduction to Matlab for Engineering Students.

<https://www.mccormick.northwestern.edu/documents/students/undergraduate/introduction-to-matlab.pdf>

Carlin, W. and D. Soskice (2005) The 3-equation New Keynesian model: Graphical Exposition
http://www.ucl.ac.uk/~uctpa36/3equation_2005_withtitle.pdf

3. Программное обеспечение

№ п/п	Наименование	Условия доступа
1.	Matlab	Из внутренней сети университета (договор)
2.	Dynare	Свободный доступ

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

№ п/п	Наименование	Условия доступа
-------	--------------	-----------------

	<i>Профессиональные базы данных, информационно-справочные системы</i>	
1.	Электронно-библиотечная система Юрайт	URL: https://biblio-online.ru/
	<i>Интернет-ресурсы (электронные образовательные ресурсы)</i>	
1.	Открытое образование	URL: https://openedu.ru/

2. Материально-техническое обеспечение дисциплины

Учебные аудитории для лекционных занятий по дисциплине обеспечивают использование и демонстрацию тематических иллюстраций, соответствующих программе дисциплины в составе:

- ПЭВМ с доступом в Интернет (операционная система, офисные программы, антивирусные программы);
- мультимедийный проектор с дистанционным управлением.