

Федеральное государственное автономное образовательное учреждение
высшего профессионального образования
«Национальный исследовательский университет «Высшая школа экономики»
Санкт-Петербургский филиал

Программа

вступительного экзамена по экономике для магистерских программ

«Финансы» и «Прикладная экономика и математические методы»

Вступительный экзамен по экономике для магистерских программ «Финансы» и «Прикладная экономика и математические методы» проводится в письменной форме, продолжительность экзамена 180 минут. При проведении вступительного экзамена оценка выставляется по 100-балльной системе.

Неудовлетворительной оценкой является оценка от 1 до 20 баллов.

Содержание программы

Раздел «Микроэкономика»

Тема 1. Теория поведения потребителя

Предпочтения потребителей. Примеры предпочтений. Свойства предпочтений.

Полезность. Функция полезности. Построение функции полезности на основе кривых безразличия; примеры функций полезности. Предельная полезность и предельная норма замещения.

Бюджетное ограничение. Бюджетное множество и его границы; изменение бюджетного ограничения при изменении цен и дохода; учет налогов, субсидий и рациионирования.

Условие оптимального выбора потребителя. Задача максимизация полезности при заданном бюджетном ограничении. Оптимальный выбор для основных типов предпочтений.

Функции спроса. Потребительский выбор при изменении дохода и цен. Нормальные и инфериорные блага. Кривые «доход-потребление» и кривые Энгеля. Кривые «цена-потребление».

Эффект дохода и эффект замещения при изменении цены (по Хиксу и по Слуцкому). Компенсированный спрос (по Хиксу). Уравнение Слуцкого.

Влияние изменение цен на изменение благосостояния потребителей, его измерение. Эквивалентная и компенсирующая вариация дохода. Излишек потребителя.

Альтернативный подход к моделированию потребительского выбора: выявленные предпочтения. Принцип выявленных предпочтений; слабая аксиома выявленных предпочтений; индексы цен, сильная аксиома выявленных предпочтений.

Поведение потребителя при наличии натурального дохода. Понятия «чистый» продавец и «чистый» покупатель. Модификация уравнения Слуцкого для случая наличия натурального дохода. Пример: индивидуальное предложение труда. Пример: многопериодный выбор.

Тема 2. Теория производства

Способы описания технологий и примеры технологий. Свойства технологий. Предельная норма технологического замещения. Производственные функции. Краткосрочный и долгосрочный период в деятельности фирмы.

Минимизация издержек. Условный спрос на факторы производства. Функция издержек. Связь между долгосрочными и краткосрочными кривыми издержек.

Максимизация прибыли и предложение конкурентной фирмы. Анализ сравнительной статистики в задаче максимизации прибыли.

Прибыль производителя и излишек производителя; графическое представление прибыли фирмы и излишка производителя.

Тема 3. Общее равновесие и эффективность

Общее равновесие и обмен. Ящик Эджворта. Парето-эффективное (Парето-оптимальное) распределение в модели с двумя потребителями и двумя благами.

Равновесие по Вальрасу. Закон Вальраса.

Равновесие и оптимальность в экономике обмена. Первая теорема благосостояния, вторая теорема благосостояния.

Общее равновесие в производстве товаров. Условие Парето-эффективного размещения ресурсов.

Парето-оптимальные распределения в экономике с производством.

Тема 4. Рыночные структуры

Монополия. Максимизация прибыли монополистом. Монополия и потери общественного благосостояния. Естественные монополии их регулирование.

Ценовая дискриминация.

Модели олигополии Курно и Штакельберга. Модели олигополии Бертрана и ценового лидерства. Картель.

Тема 5. Рынок капитала и инвестиционное поведение на финансовых рынках

Особенности экономического выбора на рынках капитала. Межвременной выбор индивида. Финансовые посредники в модели межвременного выбора.

Основы инвестирования: анализ инвестиционных проектов. Дисконтирование. Текущая ценность (приведенная стоимость, present value). Критерий чистой приведенной стоимости (NPV) и внутренней нормы доходности (IRR) в принятии инвестиционных решений.

Портфельный анализ. Модель Марковица. Выбор рискованного портфеля и диверсификация. Оптимизация портфеля из N ценных бумаг. Модель оценки капитальных активов CAPM. Коэффициент бета. Ставка процента в экономическом анализе.

Тема 6. Провалы рынка

Асимметричная информация. Неблагоприятный отбор (adverse selection). Рынок «лимонов». Риск безответственности контрагента («моральный риск», moral hazard). Рыночные сигналы.

Внешние эффекты (экстерналии). Распределение ресурсов в условиях внешних эффектов. Интернализация внешних эффектов. Налоги Пигу. Права собственности. Теорема Коуза.

Общественные блага. Спрос на общественные блага. Эффективный уровень общественных благ. Проблема «безбилетника».

Основная литература

1. Вэриан Х.Р. Микроэкономика. Промежуточный уровень. Современный подход. – М.: Юнити, 1997.
2. Пиндайк Р.С., Рубинфельд Д.Л. Микроэкономика. – М.: Дело, 2000.

Дополнительная литература

1. Кац М., Роузен Х. Микроэкономика. – Мн.: Новое знание, 2004.
2. Тарасевич Л.С., Гребенников П.И., Леусский А.И. Микроэкономика. 7-е изд. – М.: Юрайт, 2012; а также прежние издания.
3. Чеканский А.Н., Фролова Н.М. Микроэкономика. Промежуточный уровень. – М.: ИНФРА-М, 2005.
4. Франк Р.Х. Микроэкономика и поведение. – М.: ИНФРА-М, 2000.

Раздел «Макроэкономика»

Тема 1. Реальный сектор экономики

Основные показатели деятельности реального сектора. Система национальных счетов. Валовой внутренний продукт (ВВП), показатели валового национального дохода, чистого национального дохода, личного дохода и располагаемого дохода. Номинальный и реальный ВВП.

Дефлятор ВВП и индекс потребительских цен. Уровень инфляции. Уровень безработицы. Номинальная и реальная ставки процента. Эффект Фишера.

Основная макроэкономическая модель (модель AD-AS).

Рынок товаров и услуг. Потребительские расходы и их структура. Функция потребления. Функция сбережений. Инвестиционные расходы и их виды. Функция инвестиций. «Кейнсианский крест». Условия равновесия товарного рынка. Причины и виды неравновесных состояний. Эффект мультипликатора. Парадокс сбережений.

Государственные расходы, их виды и воздействие на экономику. Налоги и их роль в экономике. Бюджетное ограничение правительства: операционный дефицит и его финансирование. Фискальная политика и государственный долг.

Мультипликаторы государственных расходов, налогов (аккордных и подоходных), трансфертов, сбалансированного бюджета. Фискальная политика и ее инструменты. Виды фискальной политики. Встроенные (автоматические) стабилизаторы.

Тема 2. Денежный сектор в экономике

Общая структура финансового рынка. Сущность и функции денег. Виды денег. Денежные агрегаты. Денежная масса и денежная база.

Современная банковская система: структура и функции банковской системы. Центральный банк и коммерческие банки, их функции и взаимоотношения. Денежная эмиссия. Основные инструменты политики Центрального банка. Способность банков увеличивать денежную массу. Принцип мультипликативного расширения депозитов.

Спрос на деньги. Основные факторы (мотивы) спроса на деньги. Количественная теория денег. Ликвидность. Норма процента как цена денег.

Тема 3. Равновесие на денежном и товарном рынках

Денежно-товарное равновесие, Модель IS-LM как модель совместного равновесия товарного и денежного секторов.

Модель IS-LM как модель совокупного спроса.

Воздействие государственной политики в модели IS-LM.

Фискальная политика и ее эффективность. Эффект вытеснения. Бюджетный дефицит и государственный долг. Макроэкономические последствия бюджетного дефицита. Последствия инфляционного финансирования бюджетного дефицита. Последствия неинфляционного финансирования бюджетного дефицита. Долгосрочные последствия фискальной политики. Кривая Лаффера. Теорема эквивалентности Барро-Рикардо. Дискреционная политика, ее последствия и проблема временных лагов. Недискреционная политика. Активная и пассивная политика по правилам. Проблема непоследовательности политики во времени.

Сравнительная эффективность фискальной и монетарной политики. Мультипликатор фискальной и монетарной политики.

Тема 4. Неоклассическая макроэкономическая модель

Основные черты экономики классического типа. Микроэкономические основы неоклассической модели. Формирование совокупного предложения. Рынок труда. Спрос на труд. Предложение труда. Установление равновесия на рынке труда.

Формирования совокупного спроса. Потребление в неоклассической модели. Модель межвременного выбора. Модель жизненного цикла. Модель перманентного дохода. Инвестиционный спрос. Модель рентной цены капитала и теория q Тобина. Общее равновесие в реальном секторе.

Денежный сектор в классической модели. Роль и функции денег в экономике классического типа. Классическая дихотомия. Нейтральность денег. Спрос на деньги в классической теории. Модель Баумоля-Тобина. Установление равновесия в денежном секторе.

Общее экономическое равновесие в неоклассической модели. Закон Вальраса. Государственная политика в неоклассической модели.

Тема 5. Неокейнсианская макроэкономическая модель

Основные черты экономики, описываемой кейнсианской моделью. Кейнсианская модель реального сектора. Жесткость цен. Принятие решений в условиях жесткости цен. Экономика спроса. Микроэкономические основы неокейнсианской модели. Формирования совокупного предложения. Рынок труда. Эффективный спрос на труд. Формирование заработной платы в условиях неполной занятости. Кривая предложения труда. Краткосрочная кривая совокупного предложения.

Формирования совокупного спроса. Потребительский спрос. Инвестиционный спрос. Концепция предельной эффективности капитала. Инвестиционная функция.

Равновесие товарного рынка в условиях жесткости цен. Гипотеза двойственного решения. Эффективный спрос. Равновесие в реальном секторе.

Денежный рынок в кейнсианской модели. Портфельная теория спроса на деньги. Структура портфеля. Мотивы, определяющие спрос на деньги. Модель денежного рынка. Установление равновесия на денежном рынке, Равновесие в неокейнсианской модели. Неокейнсианская модель и закон Вальраса. Государственная политика в неокейнсианской модели.

Тема 6. Инфляция, занятость, безработица

Безработица и ее экономические последствия. Население. Рабочая сила. Занятые и безработные. Показатель уровня безработицы. Экономические издержки безработицы. Закон Оукена. Инфляция и ее экономические последствия. Понятие инфляции. Измерение

инфляции. Виды и источники инфляции. Экономические издержки инфляции. Инфляция и реальный доход. Инфляция и экономическая активность. Взаимосвязь инфляции и безработица. Концепция альтернативы между инфляцией и безработицей. Кривая Филлипса и ее аналитические возможности. Выбор государственной политики на основе кривой Филлипса. Способы проведения антиинфляционной политики и ее экономические издержки.

Концепция адаптивных ожиданий. Рынок труда в экономике с адаптивными ожиданиями. Формирование заработной платы и уровня занятости в условиях адаптивности ожиданий. Модифицированная кривая Филлипса. Краткосрочная кривая совокупного предложения. Долгосрочная кривая совокупного предложения в условиях адаптивных ожиданий. Развитие инфляции в условиях адаптивных ожиданий. Государственная экономическая политика в условиях адаптивности ожиданий. Концепция рациональных ожиданий. Модель с рынка труда в условиях рациональности ожиданий. Краткосрочная кривая совокупного предложения Р. Лукаса. Долгосрочная кривая совокупного предложения в условиях рациональности ожиданий. Развитие инфляции в условиях рациональных ожиданий. Теория инфляции в экономике с рациональными ожиданиями. Последствия предсказуемых и непредсказуемых денежных шоков в экономике с рациональными ожиданиями в коротком и долгом периоде.

Государственная экономическая политика в условиях рациональности ожиданий. Правила стабилизационной политики и издержки борьбы с инфляцией при условии рациональности ожиданий.

Тема 7. Экономический рост

Экономический рост и экономический цикл в моделях кейнсианского типа. Неоклассическая теория экономического роста. Исследование экономического роста с помощью неоклассической производственной функции. Модель Р. Солоу. Динамика объема капитала и экономический рост. Устойчивый запас капитала. «Золотое правило» выбора уровня запаса капитала. Развитие базовой модели Солоу. Анализ различных источников роста. Макроэкономическая политика стимулирования экономического роста. Понятие эндогенного роста.

Тема 8. Макроэкономические проблемы в открытой экономике

Валютный курс. Мировая валютная система и основные этапы ее становления. Современный валютный рынок. Определение валютного курса. Номинальный и реальный валютный курс. Виды валютных курсов. Спрос, предложение и равновесие на валютном рынке. Факторы, влияющие на равновесие валютного рынка.

Платежный баланс. Платежный баланс, его структура и показатели. Счет текущих операций. Торговый баланс страны.

Влияние валютного курса на торговый баланс. Сальдо торгового баланса. Государственная политика при положительном и отрицательном сальдо торгового баланса. Внешняя торговля и распределение доходов. Счет финансовых операций с капиталом. Положительное и отрицательное сальдо счета и изменение валютных резервов. Воздействие фискальной и монетарной политики на платежный баланс.

Макроэкономическое равновесие в открытой экономике. Модель Манделла-Флеминга. Открытая экономика с фиксированным валютным курсом. Ее особенности. Факторы, определяющие валютный курс в такой экономике.

Фискальная и кредитно-денежная политика государства в условиях фиксированного валютного курса. Открытая экономика с гибким валютным курсом. Факторы, определяющие валютный курс в такой экономике. Фискальная и кредитно-денежная политика государства в условиях плавающего курса валюты.

Теория международной торговли. Причины международной торговли. Теория сравнительных преимуществ Рикардо.

Правила международной торговли на основе сравнительного преимущества. Спрос, предложение и ценообразование в международной торговле в условиях большой и малой открытой экономики. Оценка выгоды от специализации.

Основная литература

1. Абель Э., Бернанке Б. Макроэкономика. 5-е изд. – СПб.: Питер, 2012.
2. Бланшар О. Макроэкономика. 2-е изд. – М.: Изд. дом Высшей школы экономики, 2015.

Дополнительная литература

1. Бурда М., Виплош Ч. Макроэкономика: европейский текст. – СПб.: Судостроение, 1999.
2. Дорнбуш Р., Фишер С. Макроэкономика. – М.: ИНФРА-М, 1997.
3. Моисеев С.Р. Макроэкономика. – М.: Кнорус, 2012.
4. Тарасевич Л.С., Гребенников П.И., Леусский А.И. Макроэкономика. 9-е изд. – М.: Юрайт, 2012.
5. Шагас Н.Л, Туманова Е.А. Макроэкономика-2. – М.: изд-во МГУ, 2006.