

## Расчетное задание 1

**Влияние монетарного шока на поведение макроэкономических показателей в базовой неокейнсианской модели денежно-кредитной политики.** Рассмотрите поведение базовой НК модели, рассмотренной на лекции под воздействием простого правила (Тейлора)  $i_t = \rho + \varphi_\pi \pi_t + \varphi_y \tilde{y}_t + v_t$ , где  $v_t = \rho_v v_{t-1} + \varepsilon_t^v$ ,  $\rho_v \in [0,1)$  - экзогенный шок монетарной политики, для базовой калибровки:  $\beta = 0.99$ ,  $\nu = \sigma = 1$ ,  $\varphi = 1$ ,  $\alpha = 1/3$ ,  $\varepsilon = 6$ ,  $\eta = 4$ ,  $\theta = 2/3$ ,  $\varphi_\pi = 1.5$ ,  $\varphi_y = 0.5/4$ ,  $\rho_v = 0.5$ ,  $\rho_a = 0.9$  (Калибровка базовой неокейнсианской модели денежно-кредитной политики, представленной в тех же обозначениях, что и на лекции, взята из главы 3 учебника Джорди Гали для экономики США (60-80х годов 20 века)) под воздействием

временного монетарного шока (если технологический шок равен нулю) с  $\varepsilon_1^v = 0.25$ ,  $\varepsilon_t^v = 0, t > 1$  на устойчивое состояние. Постройте для 15-20 периодов графики поведения (в терминах отклонений от устойчивого состояния) производственного разрыва, ВВП на душу населения, инфляции, номинальной процентной ставки, (подразумеваемой) реальной процентной ставки, темпа прироста денежной массы и самого монетарного шока. Сравните полученный результат с результатом Гали. (Используйте для стартовых значений переменных устойчивое состояние при нулевой инфляции.) Сравните полученные результаты с теоретическими предсказаниями, полученными на лекции.

Все необходимые расчеты, поясняющие код, должны быть предоставлены отдельно с четкими комментариями.