结构分析中的鲁棒性检查

作者:Sylvain Catherine, Mehran Ebrahimian, David Sraer, David Thesmar

鲁棒性检查，如添加控制或样本分割，是简化形式实证研究的标准特征。由于重新估计备选模型的计算成本，它们在使用基于仿真的方法进行结构研究时不太常见。我们提出了一种简单的方法来绕过这种计算成本。我们的方法基于估计力矩和参数之间关系的灵活近似。它提供了一种计算成本较低的方法来运行此类稳健性检查所需的潜在大量结构估计。我们在经济学和金融学两个标准应用的背景下证明了该方法的有效性和有用性：（1）动态企业融资（2）生命周期内的投资组合选择。

**原文链接:**<https://www.nber.org/papers/w30443>