外交学院金融硕士学位论文撰写规范

# 一、毕业论文总体要求

## （一）定位、基本要求与形式

学位论文是金融硕士教学的重要组成部分，是培养学生综合应用所学的金融学理论和知识技能分析实际问题的重要途径。金融硕士学位论文既是每位金融硕士学习和研究成果的总结，也是评审金融硕士学生专业水平，决定是否授予其金融硕士学位的重要依据。通过学位论文写作，培养学生收集文献资料、分析论证实际问题并能准确表达自己观点的综合性应用能力。

学位论文基本要求：运用基本理论阐述并研究、解决与金融实践相关的问题；论文论据充分，逻辑严密，力求创新，严禁抄袭。

论文的基本形式主要有：案例分析、金融产品设计、金融实践问题解决方案、调研报告、量化策略以及实证分析。

## （二）选题与篇幅

论文选题应是金融话题，紧密结合实践问题和现实需要，**不提倡纯基础理论或方法探讨类型的研究选题**。

学位论文**不少于2.5万字**。

## （三）撰写要求

论文必须用A4（210×297mm）标准大小的白纸打印，可以用不褪色的复制本，应便于阅读、复制和拍摄缩微制品。正文宜用小四号字体，1.5倍行距，段落首行2字符缩进。

论文在打字或印刷时，要求纸的四周留足空白边缘，以便装订、复制和读者批注。每一面的上方（天头）、下方（地脚）、左侧（订口）和右侧（切口）应分别留边25 mm以上。

## （四）撰写格式

1. 论文章、节、目的编号，采用汉字序号分级编号。例如：一、…（一）…1、…

2. 论文的构成包括：前置部分（含封面、版权声明、摘要、关键词、序或前言、目次页等）；主体部分（含引言或绪论、正文、注释、参考文献等）；附录部分（如有必要）。

## （五）前置部分

1. 封面

封面可包括下列内容：

（1）左上角注明“外交学院20XX届硕士研究生学位论文”

（2）论文题名，用小一号字体标注于明显位置

（3）专业及方向名称，系指学位论文作者主修专业及方向的名称

（4）责任者姓名，包括论文的作者及导师（含职称）

2. 题名

（1）题名是以最恰当、最简明的词语反映报告、论文中最重要的特定内容的逻辑组合；

（2）题名所用每一词语必须考虑到有助于为选定关键词和编制题录、索引等二次文献提供检索的特定实用信息；

（3）题名应该避免使用不常见的缩略词、首字母缩写字、字符、代号等；

（4）题名一般不宜超过20字。

2. 下列情况可以有副题名：

题名语意未尽，用副标题名补充说明报告论文中的特定内容。

3. 序或前言

序或前言并非必要。论文的序或前言，一般是作者对本篇基本特征的简介，如说明研究工作缘起、背景、主旨、目的、意义、编写体例等；也可以评述和对相关问题研究阐发。这些内容也可以在正文引言中说明。

4. 摘要

（1）摘要是对论文内容不加注释和评论的简短陈述。

（2）论文一般均应有中英文摘要。

（3）摘要应具有独立性和自含性，即不阅读论文的全文，就能获得必要的信息。摘要中需有数据、有结论，是一篇完整的短文，可以独立使用，可以引用。摘要的内容应包含与论文同等量的主要信息，供读者确定有无必要阅读全文，也供文摘等二次文献采用。摘要一般应说明研究工作目的、方法、最终结论等，而重点是结论。

（4）中文摘要一般不宜超过500字；外文摘要不宜超过300个实词。如遇特殊需要，字数可以略多。

（5）论文的摘要用另页置于题名页之后、正文之前。

5. 关键词

关键词是为了文献标引工作，从论文中选取出来用以表示全文主题内容信息款目的单词或术语。 每篇论文选取3～5个词作为关键词，以显著的字符另起一行，排在摘要的下方。同时，应标注与中文对应的英文关键词。

6. 目次页

目次页由论文的章、节、目、附录等的序号、名称和页码组成，另页排在序或前言（无序或前言则排在摘要）之后。

## （六）主体部分

1. 格式

主体部分的编写格式可由作者自定，但一般由引言（或绪论）开始，以结论结束。

主体部分必须由另页右页开始。每一章（或部分）必须另页起。全部论文的每一章、节、目的格式和版面安排，均要求划一，层次清楚。每一章或（部分）应有一段引导性的文字。

2. 序号

（1）论文中的图、表、注释等，一律用阿拉伯数字分别依序连续编排序号。图、表序号可以就全篇论文统一按出现先后顺序编码，也可以分章依序编码。其标注形式应便于互相区别，可以分别为：图1、图2.1；表2、表3.2等。注释应采用脚注方式，且每页重新编码，编号格式为①…。

（2）论文一律用阿拉伯数字连续编页码，位置为页面底端，对齐方式为居中。页码由打印的首页开始，作为第1页，并为右页另页。封面、封二、封三和封底不编入页码。可以将题名页、序、目次页等前置部分单独编排页码。页码必须标注在每页的相同位置，便于识别。

力求不出空白页，如有，仍应以右页作为单页页码。

（3）论文的附录依序用大写正体A, B, C, …编序号，如附录A。

（4）附录中的图、表、式、参考文献等另行编序号，与正文分开，也一律用阿拉伯数字编码，但在数码前冠以附录序码，如：图A1；表B2；式（B3）；文献[A5]等。

3. 引言（或绪论）

引言（或绪论）简要说明研究工作的目的、范围、文献综述、理论基础和分析、研究设想、研究方法和框架结构、预期创新点以及难点等。应言简意赅，不要与摘要雷同，不要成为摘要的注释。

由于学位论文需要反映出作者具有开阔的科学视野，对研究方案作了充分论证，因此，有关历史回顾和前人工作的综合评述，以及理论分析等，需单独成章，用足够的文字叙述。

4. 正文

论文的正文为核心部分，占主要篇幅。

正文应按照研究对象的逻辑展开,应实事求是，结构合理，客观真切，准确完备，合乎逻辑，层次分明，简练可读。

论文中出现的符号和缩略词可采纳有关规定。如不得不引用某些不是众所周知的、且又不易为同行读者所理解的、或系作者自定的符号、记号、缩略词、首字母缩写字等时，均应一一在第一次出现时加以说明，给以明确的定义。

5. 结论

论文的结论是最终的、总体的结论，不是正文中各段小结的简单重复。结论应该准确、完整、明确、精炼。可以在结论或讨论中提出建议、进一步研究的设想和尚待解决的问题等。

如果不可能导出应有的结论，也可以没有结论，仅进行必要的讨论。

6. 参考文献

列于正文之后，外文用原文不必译成中文。中文文献一般不需标注引文具体页码。按先中文文献后外文文献排列，文献类型顺序为著作、文集或期刊、杂志文章、报纸文章、网页资料等。中文参考文献要用阿拉伯数字依序连续编排序号，如[1]…，外文按作者姓名字母排列，可紧跟中文参考文献连续排序。**参考文献必须在论文正文中能够对应**。

参考文献范例如下：

[1] 刘奕、夏杰长，《全球价值链下服务业集聚区的嵌入与升级——创意产业的案例分析》，《中国工业经济》，2009年第12期；

[2]习近平，《共同构建人类命运共同体——在联合国日内瓦总部的演讲》，《人民日报》，2017年1月20日第002版；

[3] Knox, Colin, and Paul Carmichael. “Whither a Shared Future?” Fortnight, no. 457, Fortnight Publications Ltd., 2008, pp. 4–5.

7. 致谢

可以在参考文献后对下列方面致谢：

资助研究工作的奖学金、单位、组织或个人；

协助完成研究工作和提供便利条件的组织或个人；

在研究工作中提出建议和提供帮助的人；

给予转载和引用权的资料、图片、文献、研究思想和设想的所有者；

其他应感谢的组织和个人。

## （七）附录

附录是作为论文主体的补充项目，并不是必需的。

1. 下列内容可以作为附录编于论文后，也可以另编成册：

（1）为了整篇论文的完整，但编入正文又有损于编排的条理和逻辑性的一类材料（包括比正文更为详尽的信息、研究方法和技术更深入的叙述）；建议阅读的参考文献题录；对了解正文内容有用的补充信息等；

（2）由于篇幅过大或取材于复制品而不便于编入正文的材料；

（3）不便于编入正文的罕见珍贵资料；

（4）对一般读者并非必要阅读，但对本专业同行有参考价值的资料；

（5）某些重要的原始数据、统计表等。

2. 附录与正文连续编页码。

3. 每一附录均另页起。

## （八）注释

1. 注释的目的

（1）标明作者在文章中所直接或间接引用的任何其他人的语句的出处。

（2）标明文章中不常见的史实或事实的出处。如系众所周知的事实则不必作注。

（3）标明文章中借用他人的理论、论断、思想、观点或意见的出处。

**上述三类注释如系转引自第二手材料，出处应注明为转引的第二手材料，而不能根据所转第二手材料中的注释，将出处注为原材料（第一手材料），除非作者亲自查阅并核对了原材料。严禁不标明出处或来源便借用、甚至大段录用上述内容**。

（4）对文章中的某些观点进行资料性的补充说明，这种补充如写入正文，可能打断正文中行文的流畅，使文章脉络不清。

（5）对文章中的某些观点、不常见的专用名词、术语做必要的解释，这种解释如写入正文，可能打断正文中行文的流畅，造成读者理解上的困难。

2. 注释的类型

论文注释要求一般应为页末注（脚注）。

# 二、案例分析

**※ 案例分析类论文中的案例必须是金融硕士研究生入学后发生或入学时尚未结束的金融案例！！！**

## （一）基本要求

案例分析是学生运用所学的金融理论知识对金融事件进行分析并解决问题的一种论文写作形式。学生应结合自己感兴趣的专业方向在相关领域精心选题，但应重视新颖性、重要性、务实性，要有分析价值，包括理论价值和应用价值。

案例分析需要根据选题特点，利用相应的调查工具和方法收集相关资料，并进行整理分析，在此基础上以报告的形式表达出来。

学位论文中案例情景叙述部分不超过总字数的20%。

## （二）论文架构

**第一部分：绪论**

内容一般包括研究背景和意义（包括案例的典型性和代表性说明）、相关研究综述、研究方法、创新点、论文的结构。

**第二部分：案例介绍**

介绍概况、历史沿革，与选题相关内容的现状。案例介绍是案例中一段既定的历史，即在案例写作之前已经发生的事实，包括问题本身及已经采取的解决办法等。

**第三部分：案例存在的问题和原因分析**

案例资料是案例分析的基石。案例资料的获取可以通过文件、档案记录、访谈、直接观察、参与性观察和实物证据等。资料收集过程中，要尽量使用多种数据来源，并注意及时记录和整理相关资料，原则上要求原创性资料（一手资料）比例不少于60%。

在已获得充实资料的基础上选用适合的方法进行分析，如图表分析、因果分析和对比分析等，运用相关金融理论和知识找出案例的启示及存在的问题。

**第四部分：解决问题和改进建议**

# 三、金融产品设计

## （一）基本要求

金融产品设计是一个创造性的综合信息处理过程，它将金融需要与设计者的意图转成为一种具体的金融产品或工具，把一种计划、规划设想、问题解决的方法通过学位论文形式表达出来。

产品设计反映着一个时代的经济、技术和文化发展状况，是金融创新的前沿，设计过程尤其需要具有可行性理念，要全面确定整个产品的策略、结构、功能。具有市场竞争力的金融产品设计必须要满足：社会发展的要求、风险与收益匹配的要求、使用的要求、金融创新的要求。

## （二）论文架构

**第一部分：产品方案基本概念和设计理念**

介绍产品的核心特征、功能。金融产品的设计理念，要求在全面的风险和收益分析上体现产品的创新之处。

**第二部分：设计方案**

方案设计主要包括产品功能与特点介绍、产品的风险与收益、产品创新点分析、产品市场分析。具体内容有：

（1）市场创新点、市场接纳度、当前市场空白与客户内在需求、客户心理分析等；（2）产品的详细功能；（3）产品的参考基准、基本参数、主要指标；（4）风险和收益分析，市场空白原因分析；（5）产品获利的原因分析，产品的适用性，风险控制，潜在客户购买因素分析。

**第三部分：产品优势**

主要反映在:成本收益比较、与类似产品的优劣比较、符合市场趋势等方面。具体可通过以下几个方面进行分析：国内外同类产品收益比较；同类产品的水平分析比较(国内外同类型产品主要性能、结构、特征等的详细比较说明；同类产品的优势和劣势及其原因分析)；对国内同类产品的补充和创新及其可行性分析；该产品未来的竞争能力、供给能力等。

**第四部分：产品推广策略**

新产品推广方式和经费估算；产品推广策略。

# 四、金融实践问题解决方案

## （一）基本要求

金融实践问题解决方案是针对金融实践领域已经出现的或者可能出现的问题所提出的创新性解决方案。

## （二）论文架构

金融实践问题解决方案写作上一般包括以下四方面内容，也可以参考金融产品设计的写作要求进行论文写作。

**第一部分：问题描述**

对金融实践问题进行描述、介绍问题产生的背景。

**第二部分：分析问题**

金融实践问题的现状、产生的原因、问题的发展趋势分析、解决问题的必要性与现实价值、国内外类似问题及其解决方案情况。

**第三部分：问题解决方案设计**

方案设计的理念、方案设计的条件、方案设计的具体内容、方案的特点与创新点、方案实施的核心点、设计方案存在的风险分析。

**第四部分：方案的合理性论证以及实施途径**

设计方案的可行性分析、成本收益分析、方案实施中可能出现的问题及其应对措施。

# 五、调研报告

## （一）基本要求

调研报告是对某一行业、某一事件或问题，经过在金融实践中对其客观实际情况的调研，将调查了解到的全部情况和材料进行分析研究，揭示出其本质，寻找出规律，最后以书面形式陈述出来的一种论文形式。

调研报告的核心是调查和研究，包括计划、实施、收集、整理等一系列过程，其目的是提供调查结果、战略性建议及结论供以后决策参考。

要精心选择调研对象。调研对象要有分析价值，包括理论价值和应用价值。调研和分析后得出的结论建议要尽可能实现从个别到一般的提升，避免就事论事。

## （二）论文架构

调研报告主要包括三个部分：调查、研究、提出对策。

**调查**，应该深入实际，获取详细资料，准确地反映客观事实，不凭主观想象，按本来面目了解调查对象。

**研究**，即在掌握客观事实的基础上，认真分析，透彻地揭示调研对象。在调查、研究的基础上提出对策。

**对策**的制定是一个深入、复杂、综合的研究过程。检验对策是否有效，可以进行预评估。

正文部分为作者所要论述的主要事实和观点，包括介绍调研针对的问题、目的和意义、相关背景、时间、地点、人员、调查手段，以及对实践活动中得到的结论的详细叙述。

写作上要求能够体现金融理论的思想路线，有新观点、新思路；要理论联系实际，必须以实证的材料、数据、统计等为支撑，对实际工作有指导作用和借鉴作用，能提出建设性意⻅和建议：内容观点鲜明，重点突出，结构合理，逻辑清晰，文字通畅、精炼。

**正文的逻辑结构形式主要有：**

（1）现状——问题——解决方案——建议

多用于反映、解决问题的报告

（2）成果——具体做法——经验

多用于总结经验的报告

（3）事件过程——事件性质——处理意见

多用于揭示是非的报告

结论：对调研活动进行归纳和总结，包括总结实践过程中发现的问题，并提出相应的解决办法。

# 六、量化投资策略

## （一）基本要求

量化投资策略是利用量化的方法，进行金融市场的分析、判断和交易的策略、算法的总称。

量化就是通过海量的据客观分析决策，利用模型捕捉价差，获得持续稳定的收益，从而避免了人为主观因素干扰。

## （二）论文架构

量化投资策略写作上一般包括以下四方面内容：

**第一部分：策略逻辑**

介绍策略的设计理念、理论基础与对应模型、指标或因子选择的理论依据等。策略的设计理念，要求在全面的风险和收益分析上体现策略的创新之处。

**第二部分：策略设计与优化**

策略设计主要包括策略方案介绍、策略的风险与收益分析。具体内容有：样本与数据选择、开仓（或股票入池）条件设置、止盈止损条件设定、平仓（或换仓）条件、换仓周期、收益分析、风险分析（最大回撤、夏普指数）、胜率分析等等。

策略优化主要是根据已经设计策略的收益风险分析结果，不断调整相关参数（指标或因子的取值范围、平仓条件等），使得策略收益和风险在一定程度上达到最优匹配。

**第三部分：策略检验**

一个量化策略是否有效，必须对其进行检验。策略检验主要包括：（1）样本外检验；（2）换仓周期检验；（3）开（调）仓延时检验；（4）样本选择检验。

换仓周期检验：是对换仓时间进行调整后的策略回测检验。

开（调）仓延时检验：是将开（调）仓时间延后1天或2天后的策略回测检验。

样本选择检验：是调整样本选择（比如创业板股票、大盘股票、不同行业股票、美股、港股，等等）后的策略回测检验。

**第四部分：结论与风险提示**

针对策略检验结果给出相应的策略适用条件、策略的优缺点等结论，并给出相应的风险提示。

# 七、实证分析

## （一）基本要求

实证分析是利用计量等实证分析方法，对实践中的重要问题进行分析的总称。

## （二）论文架构

实证分析在写作上一般包括以下五方面内容：

**第一部分：前言**

介绍所研究问题的背景，重点介绍其在实践中的重要意义，及其与相关实践问题与政策的联系。

**第二部分：文献综述**

国内外对此问题的研究进展，不能局限于问题本身，而是包括与解决此问题相关的研究，重点剖析当前研究的共识、分歧。

**第三部分：理论分析**

介绍解决此问题的备选理论和文中解决此问题的理论，并采用相关理论分析。原则上，文中解决此问题的理论应当是前沿的或具有高度共识的理论。

避免写成教科书式的的理论介绍，而是对文中所使用的理论的详细介绍，重点写作者自己的理论推导与理论分析，**不要写成理论或术语的名词解释**。

**第四部分：实证分析**

采用适当的计量分析工具进行分析，包括变量的采纳依据、数据来源、计量方法介绍、计量结果展示、计量结果的分析与小结。

**严禁伪造数据或分析结果。**

**第五部分：结论与政策建议**

需与实证分析结果对应。