

绝密★启封并使用完毕前

2014 年同等学力人员申请硕士学位
学科综合水平全国统一考试

管理科学与工程试卷



考生填写：

姓 名	
考 号	

考生须知

1. 本试卷满分 100 分。
2. 请考生务必将本人姓名和考号填写在本页方框内。
3. 单项选择题的答案一律用 2B 铅笔填涂在指定的答题卡上，写在试卷上或答题纸上的答案一律无效。
4. 在答题卡上正确的填涂方法为：在代表答案的字母上划线，如[A] [B] [C] [D]。
5. 第二至第四题的答案一律用蓝色或黑色墨水笔在答题纸指定位置上按规定要求作答，未做在指定位置上的答案一律无效。
6. 监考员收卷时，考生须配合监考员验收，并请监考员在准考证上签字（作为考生交卷的凭据），否则，若发生答卷遗失，责任由考生自负。

一、单项选择题（每小题 1 分，共 16 分）

- 下列样本统计量中受奇异点的影响最小的是_____。
A. 均值
B. 方差
C. 标准差
D. 中位数
- 下面图形工具中可以用来分析两个变量之间的相关性的是_____。
A. 直方图
B. 散点图
C. 茎叶图
D. 饼状图
- 有一种领导理论，它将领导方式分为四类，即命令式、说服式、参与式和授权式。这种领导理论是_____。
A. 管理方格理论
B. 权变理论
C. 领导的生命周期理论
D. 特质理论
- 企业管理层次的差异决定了目标体系的垂直高度。这样，企业目标就成了一个有层次的体系和网络，即是目标的_____。
A. 层次性
B. 多重性
C. 变动性
D. 组织性
- 明茨伯格认为，战略是由 5 种规范的定义阐明的。5Ps 是_____。
A. 计划 (Plan)，价格 (Price)，模式 (Pattern)，定位 (Position)，和观念 (Perspective)
B. 计划 (Plan)，渠道 (Place)，模式 (Pattern)，定位 (Position)，和观念 (Perspective)
C. 计划 (Plan)，产品 (Product)，模式 (Pattern)，定位 (Position)，和观念 (Perspective)
D. 计划 (Plan)，计策 (Ploy)，模式 (Pattern)，定位 (Position)，和观念 (Perspective)
- 一个好的战略目标要达到的 4 条标准是：一是要有明确而具有挑战性的目标；二是要简洁易懂；三是要基于对未来 5 年市场、行业、公司发展的分析做出；四是要_____。
A. 有崇高的意义
B. 有创新性
C. 有行业规范性
D. 有领先指标
- 战略实施的任务之一是创建一种支持企业战略管理的企业文化和_____。
A. 外部因素
B. 工作环境
C. 社会文化
D. 政府政策
- 腾讯控股有限公司（简称腾讯）专注于通过互联网服务提升人类生活品质，产品有 IM 软件、网络游戏、门户网站以及相关增值产品，最近还持股大众点评网和京东商城。从企业发展战略而言，腾讯采取的是_____。
A. 低成本战略
B. 差异化战略
C. 专业化战略
D. 多元化战略
- 对于产品生命周期处于成熟期的产品，市场策略可采用_____。
A. 双低策略
B. 选择性渗透策略
C. 市场转移策略
D. 逐步替代策略
- 战略制定和战略实施这两个重要的战略行为不断地互相作用，从而影响经理

人_____。

- A. 选择组织的结构
- B. 确定组织的使命
- C. 明确组织的愿景
- D. 制定组织的目标

11. 下列不属于三个基本经济问题的是_____。

- A. 生产什么与生产多少
- B. 如何生产
- C. 在哪生产
- D. 为谁生产

12. 在短期中, 厂商的总成本与总可变成本之差是_____。

- A. 随产量增加而增加
- B. 边际成本
- C. 随产量减少而减少
- D. 总固定成本

13. 一般情况下, 与商品需求的变动方向相反的变量是_____。

- A. 互补品的价格
- B. 收入水平
- C. 替代品的价格
- D. 预期通货膨胀率

14. 企业的停业点表示为_____。

- A. 价格等于边际成本
- B. 平均固定成本等于边际成本
- C. 平均可变成本等于边际成本
- D. 平均成本等于边际成本

15. 以下不包括在自动稳定器之内的是_____。

- A. 税收的自动变化
- B. 对农产品采用维持价格的政策
- C. 公开市场业务
- D. 政府的转移支付

16. 当厂商按照消费者购买商品的数量来确定价格的时候, 它实行的是_____。

- A. 一级差别定价
- B. 二级差别定价
- C. 三级差别定价
- D. 无级差别定价

二、简答题 (每小题 3 分, 共 30 分)

1. 在单样本 t 检验中, 影响所需要样本量大小的因素有哪些?
2. 群体决策的优势有哪些?
3. 影响组织设计的权变因素有哪些?
4. 主张企业承担社会责任的论据有哪些?
5. 为什么说差异化战略的优势是使企业能够成为在行业中赢得超常收益的可行战略?
6. 战略联盟的优势有哪些?
7. 什么是企业的核心能力?
8. 挤出效应的涵义是什么?
9. 货币工具包含哪些?
10. 某商品需求曲线为 $Q=960-8P-19P_y$, 其中 P_y 是相关商品的价格, 问相关商品是替代品还是互补品?

三、分析计算题 (共 3 小题, 共 34 分, 要求写出计算公式并算出结果)

1. (15 分) 假设某饮料罐装生产线罐装后饮料重量服从正态分布, 均值为 10, 标准差为 4。现随机从该生产线抽取一瓶测量重量, 请计算该瓶重量小于 8 的概率。

可供使用的部分正态分布表数值：

$$\begin{aligned} \Phi(0.0) &= 0.5000, \Phi(0.5) = 0.6915, \Phi(1.0) = 0.8413, \\ \Phi(1.5) &= 0.9332, \Phi(2.0) = 0.9772, \Phi(2.5) = 0.9938, \\ \Phi(3.0) &= 0.9987 \end{aligned}$$

2. (9分) 某企业拟开发新产品，现在有两个可行性方案需要决策。

方案一：开发新产品 A，需要追加投资 180 万元，经营期限为 5 年。此间，产品销路好可获利 170 万元；销路一般可获利 90 万元；销路差会亏损 6 万元。三种情况的概率分别为 30%，50%，20%。

方案二：开发新产品 B，需要追加投资 60 万元，经营期限为 4 年。此间，产品销路好可获利 100 万元；销路一般可获利 50 万元；销路差可获利 20 万元。三种情况的概率分别为 60%，30%，10%。

(1) 画出决策树 (6分)。

(2) 计算各点的期望值，并做出最优决策 (3分)。

3. (10分) 某完全竞争企业的短期总成本函数为 $TC=20+2Q+Q^2$ ，其产品价格 $P=6$ ，求：

(1) 短期均衡时的产量和利润 (6分)。

(2) 此时该厂商是否继续生产 (4分)。

四、案例分析题 (每小题 10 分，共 20 分)

案例 1 (10 分)

瑞银对自身风险缺乏监控

据说伏尔泰曾说过这么一句话：“如果你见到一个瑞士银行家从窗口跳出去，跟着他跳，肯定能赚钱。”如今，瑞士银行家的行为却再也不值得信任了。

瑞银 (UBS) 因有组织地操纵官方的伦敦银行间同业拆借利率 (Libor) 而被处以 14 亿瑞士法郎的罚款，这对许多银行都会是一次巨大的冲击。不过，过去 20 年瑞银一直在对投资银行部门实行罕见的糟糕管理。这次不过是上演了关于野心、无能和渎职的又一幕大戏。

令人震惊的一个有象征意义的事实是，瑞银的名称“UBS”什么都不代表。1998 年瑞士银行公司和瑞士联合银行合并后，该集团的名称就仅仅是一串首字母。而为瑞银带来最大麻烦的投行部门，则是由华宝、普惠、迪伦里德几家银行拼凑而成的，始终缺乏一个统一的核心。

一次又一次的事件暴露出，瑞银高管们对下面发生了什么几乎一无所知：2008 年金融危机中，瑞银在信用衍生品上亏损了 380 亿美元；私人银行客户逃税的丑闻令瑞银不得不支付 7.80 亿美元罚金；流氓交易员奎库·阿多博利令瑞银亏损 23 亿美元，瑞银却无力阻止。

另一个意义更广泛的教训是，在投行这样瞬息万变的业务中，只有进行严格管理才能阻止 Libor 丑闻这类事件中的不当行为。然而，上世纪 90 年代起，瑞银领导的多家银行把资金交付到它手里，它却缺乏管控这些资金的专业技能。

值得称道的是，瑞银对 2008 年危机进行了长期而艰难的反思，在那次危机中，瑞银的董事会未能深刻认识到已持有过多的次级债务，结果不得不由瑞士央行出面纾困。为此

瑞银委托苏黎世大学教师托比亚斯·施特劳曼分析为何瑞银忽略了潜伏的金融灾难。施特劳曼的结论是：“由于无数的风险报告、内部审计以及外部审查总是得出正面结论，导致最高管理层太过自满，错误地相信一切都处于控制当中。瑞银并不缺少风险意识；它缺乏健康的怀疑精神、独立的判断能力以及强大的领导力。”

在施特劳曼的报告于2010年10月发表时，瑞银当时的董事长卡斯帕·维利热发誓情况已经改变，他告诉股东，投行内部的业务部门正被“严密监控”，并且已从交易转向了咨询及客户服务。“因此自营交易已经大幅减少。”

仅仅一个月之后，瑞银投行部新任首席执行官卡斯滕·肯格特表示，该部门需要为股票部门“重新装上涡轮增压系统”，而阿多博利所在的交易所交易基金（ETF）部被鼓励承担更多交易风险。正是同一时间，投行部的交易员们一直在操纵 Libor 直到年底。换句话说，在这家银行因其前任领导层的认识脱节而差点崩溃后，该行新领导层进行了一次彻底调查，改变了管理方式，实行了新的控制措施，却又一次落入了完全相同的陷阱。对于投行部所发生的事，该行领导层描述的情况（也许他们的确是这么认为的）和真实情况牛头不对马嘴。

这种现象并不是头一次发生。1998年，由于卷入亚洲金融危机，并且过度投资于注定失败的对冲基金——长期资本管理公司，瑞士联合银行被瑞士银行公司收购。从那之后，瑞银的全球野心就成为一大不稳定因素。正如施特劳曼指出的，这其中的问题在于，瑞银不愿意承认它的野心。该行“不是唯一一家，也不是第一家，相信自己能极大扩张资产负债表、而不必承担巨额风险增长的银行。”

即便是对高盛这样拥有悠久交易历史和富有凝聚力文化的老牌投行，监控其员工行为仍困难重重。而瑞银试图通过雇佣外来人员以及收购其他银行，尽可能赶上华尔街的步伐，其监控员工的难度远远超出了其能力范围。

鉴于瑞银屡次未能遵守自己作出的承诺，合理的解决办法是缩减业务。瑞银10月份正是这么做的，当时在监管机构以及更高资本标准的压力下，瑞银宣布将大幅裁减其固定收益（债券）部，正是这一部门导致了许多亏损。然而，投资银行的进入、管理（大量收入都被员工抽走）和退出成本都很高。今后三年瑞银打算裁减1万个工作岗位，并且将衍生品和债券方面的投资逐步减少数十亿美元。巴克莱分析师杰里米·西吉将瑞银面临的这一挑战比作“拆除一个正在运转的核电站”。

即便瑞银能做到，它仍然需要摆脱某些一直为它带来失败的因素——它需要对其余业务加强控制。瑞银新任董事长、前德国央行行长埃克塞尔·韦伯表示，他希望在瑞银逐步培养起与德国央行类似的公众服务精神：“我们需要对企业更加关注，我们需要更多团队精神。”通过 Libor 丑闻的调查来判断，瑞银某些部门几乎毫无这种精神。相反，纵容个人主义疯狂滋长，交易员通过哄骗和贿赂其他内部交易员及外部经纪人，操纵官方合同价格以赚取最大收益。

回顾瑞银的过往，与其说它是一家腐败或欺诈性的银行，不如说是一家无知而疏忽大意的银行。为了获得行业中的竞争优势，瑞银走了太多捷径，而这个行业却偏偏需要极端小心。如今，瑞银终于到了不得不改变其旧有方式的时候了。

（伦敦银行同业拆借利率是英国银行家协会根据其选定的银行在伦敦市场报出的 10

种货币银行同业拆借利率的总称，对每一种货币利率进行取样并平均计算成为其各自基准利率，它们是目前国际间最重要和最常用的市场利率基准。如果一家或几家银行有意将其利率目标定高或定低，该利率就有可能被操纵，特别是上世纪 90 年代末当银行间拆借利率成为利率期货的一个重要基准后，更是如此。）

（选编自金融时报中文网，作者/英国《金融时报》专栏作家 约翰·加普，译者/简易，2012 年 12 月 28 日）

问题：

- (1) 请结合决策权配置、激励与绩效测评等理论分析瑞银存在的问题（5 分）。
- (2) 请根据金融业务的特点，结合相关激励理论讨论瑞银激励协调系统的改进设计（5 分）。

案例 2（10 分）

飞特公司

飞特公司是电子类产品的研发和制造商。主要产品有 5 类：IP/Cable 机顶盒、计算机背光组模、新型界面材料、印刷电路板、散热系统及组件。近几年，这 5 类产品的市场状况如下：

(1) 由于国内刚刚开始 IP/Cable 机顶盒类产品的生产，其消费在国内正处于增长期，该类产品的竞争程度也还不太激烈。作为先行一步的飞特公司，几乎没有什么可与之竞争的对手，2013 年的市场份额达到了 15.1%。在可以预期的未来，IP/Cable 机顶盒类产品还将保持较高的增长。

(2) 计算机背光组模类产品在国内的消费已经达到成熟期，市场竞争较为激烈。由于飞特公司进入该产品市场的时机较早、产品价格具有很强的竞争优势，2013 年计算机背光组模类产品给企业带来的收益占企业全部收益的 43%，但该产品的市场已经饱和了，在可以预期的未来，使其增长将不是容易的事情。

(3) 飞特公司是国内新型界面材料类产品研发和生产的第一家，在技术上具有一定的领先优势，该产品在国内刚刚开始消费，市场竞争程度较低。2013 年该类产品的国内消费增长达到了 300%，飞特公司该类产品的国内市场份额达到了 76%。在可以预期的未来，其在国内的消费增长还将保持翻番的速度，飞特公司的市场份额当然会保持在较高水平。

(4) 由于印刷电路板类产品技术含量不高、进入门槛低，其市场竞争程度越来越高。虽然国内印刷电路板的市场需求还会保持稳定的增长，虽然该产品还能年年为飞特公司带来利润，但未来飞特公司在印刷电路板类产品上可预期的市场份额会有所降低。

(5) 散热系统及组件类产品是飞特公司起家的产品，但因生产设备陈旧等原因，飞特公司的产品在国内已落后于主要竞争对手。2013 年其产品收入仅占飞特公司总收入的 5%。同时该产品的国内市场接近饱和，在可以预期的未来，飞特公司产品的市场份额将越来越低。

问题：

- (1) 作出飞特公司产品波士顿矩阵分析图（5 分）。
- (2) 根据波士顿矩阵分析图提出其每类产品的决策（5 分）。