

ANNALES  
UNIVERSITATIS MARIAE CURIE-SKŁODOWSKA  
LUBLIN—POLONIA

VOL. XVIII, 2

SECTIO H

1984

---

Katedra Ekonomii Politycznej  
Wydział Ekonomiczny UMCS

Wacław GRZYBOWSKI

**Le risque et les expériences à la gestion de l'économie nationale**

Ryzyko i eksperymenty w zarządzaniu gospodarką narodową

Риск и эксперименты в управлении народным хозяйством

LE FOND ET LES TRAITS CARACTÉRISTIQUES DU RISQUE

La plupart des économistes polonais et des économistes d'autres pays socialistes ont accepté la définition du risque et de l'incertitude formulée par F. Knight dans l'ouvrage bien connu: *Le risque, l'incertitude et le profit*, Boston, 1926.<sup>1</sup> Selon F. Knight le risque est une éventualité de la déviation de l'état attendu qui peut être comptée par le calcul des probabilités; l'incertitude, par contre, existe lorsque l'éventualité de la déviation n'est pas possible à mesurer à priori étant donné que l'on ne peut pas se servir de la probabilité de cette déviation.

F. Knight limite le risque aux déviations causées par les événements de destin dont la source est la nature et la technique, tandis que le phénomène de l'incertitude se rapporte aux déviations causées par la dynamique du développement économique.<sup>2</sup> Pour l'entrepreneur, le risque constitue une sorte d'élément des frais de son activité, naturellement, s'il s'assure dans une compagnie d'assurances. D'autre part, les effets négatifs réduisent le bénéfice de l'entrepreneur.

Les définitions de F. Knight ont été généralement acceptées dans la littérature économique des pays anglo-saxons et constituent une base de

---

<sup>1</sup> Dans l'article présenté, j'ai profité de ce livre édité à Londres, en 1971.

<sup>2</sup> *Risk, Uncertainty and Profit (Le risque, l'incertitude et le profit)*, Londres 1971, p. 19—20.

la plupart des ouvrages concernant les problèmes du risque et de l'incertitude de même que la théorie de l'entreprise capitaliste. Il faut souligner tout de même que la popularité de la théorie de F. Knight est dûe avant tout au fait qu'elle est utilisée pour justifier l'appropriation du bénéfice par l'entrepreneur. Celui-ci, acceptant l'incertitude et l'éventualité de la perte, obtient automatiquement le droit de l'appropriation du bénéfice. C'est ainsi que l'incertitude devient la source du profit.

Une certaine modification dans la théorie du risque et de l'incertitude a été apportée par G. L. S. Shackle.<sup>3</sup> Shackle accepte, en principe, les définitions formulées par F. Knight, mais il prend en tant que base pour différencier le risque de l'incertitude le critère de l'expérience. G. Shackle distingue les expériences divisibles et ceux qui ne se divisent pas. Par une expérience qui se divise, il comprend une série de changements analogiques dont le nombre est suffisamment grand et dont l'effet peut être prévu plus ou moins exactement par le calcul des probabilités. Tandis que par une expérience qui ne se divise pas, il comprend des changements analogiques qui se produisent dans de différentes conditions ou bien des changements uniques. Dans ce cas, le calcul des probabilités ne peut pas être appliqué. Le sens de l'argumentation de G. Shackle ne s'écarte donc point de la possibilité ou de l'impossibilité d'appliquer le calcul des probabilités, critère adopté par F. Knight.

Dans la littérature économique polonaise, on essaie d'élargir et d'affermir l'argumentation de F. Knight et de G. Shackle. Le livre de W. Samecki, mentionné ci-dessus, en est la preuve. W. Samecki joint à l'incertitude un élément de la surprise dont est dépourvu le phénomène du risque.<sup>4</sup> L'élément de la surprise résulte sans doute du fait que l'on ne peut pas appliquer le calcul des probabilités dans le cas de l'incertitude. Pour ce qui est du risque, l'éventualité des déviations est prévue à priori et, comme il existe des possibilités de s'assurer dans une compagnie d'assurances, elle est incluse dans les frais. D'autre part, s'il s'agit de l'incertitude, la surprise se révèle comme perte impossible à prévoir ou bien comme bénéfice supplémentaire.

W. Samecki, se rendant compte des difficultés de distinguer dans la pratique économique l'incertitude et le risque, est pour une large examination du risque et distingue, tout comme F. Knight, trois types de probabilités et notamment: 1) probabilité mathématique 2) probabilité statistique et 3) probabilité estimée.<sup>5</sup>

<sup>3</sup> G. L. S. Shackle: *Uncertainty in Economics (L'incertitude en économie)*, Londres 1955.

<sup>4</sup> *Ryzyko i niepewność w działalności przedsiębiorstwa przemysłowego (Le risque et l'incertitude à l'activité de l'entreprise industrielle)* Varsovie 1967, p. 30.

<sup>5</sup> *Ibid.*, p. 12—14.

Les possibilités d'utilisation des probabilités ne sont pas cependant strictement définies. Elles dépendent, dans une large mesure, des éléments subjectifs, tels que p. ex. les prédispositions personnelles de celui qui estime la réalité de l'entreprise. D'ailleurs, même le mot „estimation” comprend la suggestion que nous agissons avec les informations approximatives et le résultat d'un tel calcul ne peut être qu'une approximation. Prenons un exemple: les deux directeurs, ayant la même connaissance de profession, et, de l'expérience, peuvent estimer d'une façon tout à fait différente les effets de la même entreprise. Les deux estimations ne seront pas identiques, même lorsque les deux directeurs auront les prédispositions personnelles pareilles p. ex. quand ils seront tous les deux optimistes ou pessimistes. D'autre part, on peut graduer le pessimisme et l'optimisme d'estimation et c'est pourquoi nous distinguons des estimations plus ou moins optimistes ou plus ou moins pessimistes.

Le cercle des connaissances s'augmente, se change sans cesse, même par suite de l'amélioration du système d'information qui signifie l'élargissement des possibilités d'utiliser des probabilités de l'estimation. D'après nous, ce n'est pas l'argument qui met en valeur l'utilité de la définition de F. Knight et de ses dérivés. Par contre, l'élargissement de l'application des probabilités de l'estimation fait qu'il devient de plus en plus difficile de délimiter l'incertitude et le risque dans la conception susmentionnée. Le domaine du risque augmente toujours. Il suffit donc qu'une possibilité d'appliquer les probabilités de l'estimation existe et l'incertitude se transforme en risque. Si nous y ajoutons une réduite application de cette définition dans la pratique économique, la nécessité de prendre un autre critère de différencier le risque et l'incertitude est justifiée.

C'est pour ce motif qu'une partie des économistes représentent une autre interprétation des phénomènes du risque et de l'incertitude. Selon eux l'incertitude et le risque ne sont pas synonymes, bien qu'ils signifient une possibilité des déviations de l'état prévu. Il existe entre eux des différences très importantes. On peut, p. ex., appliquer l'idée de l'incertitude à chaque situation que l'on ne peut pas décrire d'une façon absolument précise sans prendre égard au fait, si cette situation peut provoquer des déviations négatives. L'idée de l'incertitude est appliquée à la critique socio-économique de l'activité des hommes aussi bien des groupes que des personnes particulières.

L'idée du risque ne peut pas être utilisée si largement, car elle peut être appliquée aux situations ou aux états qui sont menacées par l'existence de la déviation négative ou dans lesquelles la déviation est une des alternatives possibles.

Prenons par exemple le jeu dans lequel existent de différentes possi-

bilités de gagner, mais il n'y a pas de possibilités de perdre la somme déposée (quote-part) parce que le plus petit profit est égal à la somme déposée. La participation dans le jeu provoque des situations de l'incertitude, car le volume de profit est pour nous inconnu. On connaît seulement le volume minimal du profit qui est égal ou plus grand que la somme déposée.

$$Q - P \leq G$$

Q — P — la valeur de la quote-part

G — la valeur du gain attendu

Le jeu susmentionné est un cas particulier parce que la participation ne provoque pas la perte effective ou la perte d'une partie ou de la totalité de la quote-part déposée a priori. On ne peut pas traiter en tant que perte effective les probabilités d'avoir le profit plus grand ou le profit moyen, parce que le joueur peut être content seulement de ce qu'il a pris part dans le jeu. Le joueur peut atteindre le profit plus petit que le profit moyen en estimant ses chances de la manière pessimiste. La participation dans le jeu ne peut pas avoir exclusivement pour but des motifs économiques, mais elle peut être motivée aussi par une prédilection pour le hasard.

Dans l'activité économique le hasard ne peut pas avoir le rôle essentiel. Dans le cas où le joueur peut perdre la somme déposée en total ou une partie de celle-ci, le risque est évident, parce que le risque ne signifie pas la perte du profit qui n'était pas attendu par le joueur.

On se demande, s'il existe le jeu où la perte de la somme déposée n'est pas possible. La vente aux enchères de l'adjudication où la participation dépend d'un certain apport d'argent (vadium) peut être l'exemple d'un tel jeu.

L'examen du risque, tenant compte de l'éventualité de la perte comme une des alternatives possibles de l'état prévu, mais sans prendre en considération la possibilité d'appliquer le calcul des probabilités en tant que mesure des déviations éventuelles, augmente considérablement l'application de cette idée à l'activité économique. L'aspect de rapprochement de la pratique économique est très important dans l'économie socialiste.

Dans la littérature économique, la possibilité de s'assurer contre la perte est considérée comme un des traits caractéristiques du risque.<sup>6</sup> On ne peut pas se mettre d'accord avec cette thèse, à moins que l'assurance

<sup>6</sup> Voir W. Warkallo: *Ubezpieczenia majątkowe (Les assurances de propriété. L'ouvrage collectif)*, Varsovie 1965, p. 133—134.

ne soit pas comprise plus largement et n'embrasse pas toutes les formes possibles de l'activité.

On peut s'assurer contre la perte causée par le risque soit dans une compagnie d'assurances soit par le moyen d'une réserve économique d'objets ou d'argent, créée dans l'entreprise elle-même ou à l'échelle plus haute. Ajoutons que la possibilité de s'assurer dans une compagnie d'assurances n'existe que dans le cas de l'entreprise. Elle ne concerne pas l'économie entière du pays, car du point de vue macroéconomique, toute perte matérielle provoque la diminution du produit global et, elle ne peut pas être compensée par les moyens financiers.

Pour l'entreprise, cependant, il existe une importante différence entre le fait de s'assurer dans une compagnie d'assurances et celui de créer sa réserve matérielle. Dans le premier cas, l'entreprise qui verse sa cotisation s'assure contre l'influence défavorable des événements du sort sur l'effet financier de son activité. Les cotisations versées par l'entreprise sont traitées comme les frais de la transmission des résultats négatifs du risque à la compagnie d'assurances. Il faut s'y demander, si l'entreprise, évitant par le fait de s'assurer l'influence défavorable des événements du sort, subit le risque. W. Warkalło répond que oui parce que l'entreprise verse sa cotisation proportionnelle aux probabilités d'une éventuelle perte économique. La même opinion est présentée par R. Peretiatkowicz qui soutient que la différence entre l'assurance contre le risque dans une compagnie d'assurances et par une réserve financière ou matérielle est seulement une méthode de cacher la perte. Ce n'est pas toutefois l'opinion générale. O. Jenni, qui étudie la question du risque dans l'entreprise, constate que l'entreprise subit le risque, lorsque les pertes éventuelles sont incluses dans le calcul économique, autrement, si les pertes sont à la charge de l'entreprise.

Le fait que l'entreprise paie sa cotisation d'assurance ne signifie point qu'elle subit le risque, parce que le montant de cette cotisation ne dépend pas, en effet, de la perte réelle. Admettons qu'au cours d'une année, aucune perte causée par les événements du sort  $X$  ne se produira. Dans ce cas, le profit sera tiré non par l'entreprise qui paie la cotisation, mais par la compagnie d'assurances. Le risque économique fait penser donc non seulement à la perte éventuelle, mais aussi au profit éventuel. En outre, on ne peut pas séparer le risque du problème de la responsabilité. On pourrait réfléchir à cette occasion sur quelques problèmes qui comptent parmi les plus importantes: qui tire le profit du risque, qui est responsable des pertes économiques?

Abstraction faite des différences entre l'assurance dans une compagnie d'assurances et par une réserve économique, il faut remarquer que la deuxième forme de s'assurer est possible non seulement lorsque les

déviations éventuelles des sommes prévues peuvent être estimées par le calcul des probabilités, mais aussi dans les situations contraires qui, selon F. Knight et les autres, sont liées à l'incertitude. C'est pourquoi les entreprises profitent de ces possibilités et traitent les réserves en tant qu'élément de la stratégie de leur activité. On peut avancer la thèse que la création des réserves n'élimine pas l'éventualité de la perte. Cependant, il est évident que la création d'une importante réserve augmente la chance du succès dans la réalisation du programme économique et diminue en même temps la probabilité de la perte. Le succès du programme dépend non seulement du montant de la réserve, mais aussi de la façon de l'utiliser.

Il faut constater en conclusion que l'impossibilité de se servir du calcul des probabilités ne peut pas être liée à la possibilité ou l'impossibilité de s'assurer. Ce jugement demande une explication. Il faut souligner une régularité suivante: le fait de s'assurer est beaucoup plus facile et les résultats de celui-ci sont considérablement plus efficaces lorsque la probabilité de la déviation négative est connue.

En revenant à la question de la définition de l'incertitude et du risque, nous pouvons remarquer que l'incertitude est un phénomène plus complexe, lié au temps de l'activité. Appliquée à l'activité économique, l'incertitude se rapporte toujours au but que nous proposons d'atteindre tout en entreprenant de diverses actions. Si par le but nous comprenons l'effet final des actions, l'incertitude concerne toujours des effets et exprime la possibilité de la réalisation ou de la non-réalisation de ce but. Autrement, elle caractérise l'échelle des possibilités d'obtenir des résultats de l'activité économique ( $a_1, a_2 \dots, a_n$ ) dans une période ( $t_n$ ).

L'incertitude de la réalisation complète des buts plus ou moins probables oblige d'engager de différents moyens matériels et l'énergie humaine. Le risque économique, tous les risques en général, résultent de l'incertitude. Le risque n'existe pas dans le cas où les effets des actions sont déterminés.

Notre constatation est la suivante: le risque résulte de l'incertitude. De plus, l'incertitude peut aussi signifier la déviation positive et dans ce cas elle n'occasionne pas le risque. Les situations pareilles sont tout à fait réelles p. ex. l'incertitude résultant du fait de dépasser le plan. Il n'y a aucun risque si l'éventualité de la perte est exclue. Il est certainement injuste donc d'identifier l'activité économique dont les conditions sont marquées par l'incertitude avec celle qui est réalisée dans les conditions du risque. On ne peut pas non plus remplacer l'idée de l'incertitude par l'idée du risque.

On contesterait aussi la vérité du jugement suivant: l'incertitude peut se manifester également par l'éventualité de la déviation exclusive-

ment positive. Ce qui justifie notre opinion, c'est que cette déviation positive n'influence aucunement la réalisation du but d'entreprise, car, en effet, le résultat final soit égalera sa valeur envisagée, soit la dépassera. La question de la réalisation ou de la non-réalisation des buts à atteindre reste toujours ouverte. Il est bien difficile de calculer, dans quelle mesure les effets obtenus vont s'écarter de notre plan. Prenons un exemple: la finalisation d'une activité économique quelconque peut avoir pour son effet:  $a_1, a_2, a_3, (a_1, a_2, a_3)$ , la probabilité étant la même pour ces trois éventualités. Si nous mettons maintenant dans notre plan économique l'effet  $a_1$ , cela ne signifie pas qu'il sera atteint, même s'il est le plus réel à atteindre. On peut avoir aussi, avec la même probabilité, les résultats  $a_2$  et  $a_3$ . Il est bien naturel que les résultats  $a_2$  et  $a_3$ , étant plus grands que  $a_1$ , comprennent le résultat  $a_1$ , mais parfois la réalisation de  $a_2$  et de  $a_3$  peut être également désavantageuse.

Prenons un autre exemple. Admettons que la réalisation d'un plan aboutit à l'alternative:  $a_1, < a_2, < a_3$  les conditions étant les mêmes  $a_1 < a_2 < a_3$ , mais dans le plan nous adoptons  $a_2$ . Supposons ensuite que:

$$a_2 - a_1 = a_3 - a_2$$

Les éventualités de la déviation négative  $a_2 - a_1$  et  $a_3 - a_2$  sont égales. Les deux déviations sont donc égales. Ce n'est que par des signes qu'elles diffèrent.

Quelle est donc l'incertitude de la réalisation de l'alternative planifiée  $a_2$ ? Si nous évitons dans notre calcul l'éventualité de la déviation en plus, l'incertitude sera causée exclusivement par la déviation en moins, ce qui n'est pas vrai. Si on évite les autres solutions qui consistent en compensation des déviations en plus ou en moins, dans l'exemple examiné, il n'y aura pas d'incertitude ce que paraît également pas vrai. L'effet planifié  $a_2$  n'est que probable, de même que les effets  $a_1$  et  $a_3$ .

Il y a donc des arguments qui autoriseraient l'étude de l'incertitude aussi large que possible, l'incertitude causée par les déviations en plus et en moins. Si l'éventualité de la déviation en plus peut être le signe de l'incertitude, tout en admettant l'éventualité simultanée de la déviation en moins, pourquoi donc la même éventualité pourrait être traitée autrement quand il n'y a pas d'éventualité de la déviation en moins? L'éventualité ce n'est toujours que la possibilité dont la probabilité est plus ou moins grande, mais ce n'est pas la certitude.

C'est pourquoi il ne faut pas identifier l'incertitude avec l'effet économique défini (p.ex. avec l'éventualité de la perte) parce qu'elle peut être liée aussi aux avantages supplémentaires. Seulement, le risque s'identifie avec la déviation négative, étant donné que c'est elle qui fait

penser à la perte. Supposons p.ex. qu'il y a des possibilités des déviations in plus et in minus. Si on admettait par la suite que les déviations éventuelles pourraient varier de  $-3\%$  à  $+5\%$ , le risque égalerait la déviation in minus ( $5\%$ ). L'incertitude serait alors plus grande que le risque.

On peut dire que la thèse avancée s'oppose à la constatation ultérieure qui dit que le risque causant la perte doit créer en même temps la chance d'augmenter le profit qui dépasserait ou bien égalerait l'équilibre prévu. D'après nous, cette contradiction n'existe pas ou n'est qu'apparante, car pour obtenir le succès, il faut tout d'abord éliminer l'éventualité de la perte économique. Cela est possible lorsque les conditions réelles de l'activité économique sont les mêmes que celles que nous avons prévues ou bien lorsque les effets négatifs sont nivelés par les effets positifs. Le montant du risque éventuel sera toujours mesuré aussi par la déviation en moins. La déviation négative, c'est la différence entre la déviation en plus et la déviation en moins. Le risque n'existe que dans le cas où la déviation négative est plus grande que la déviation positive. C'est le plus important argument motivant la mise en question de la définition du risque formulée par F. Knight. Le risque concerne l'activité qui vise à éliminer l'éventualité de la déviation négative, tout cela pour causer la déviation positive. Le risque suppose donc l'attitude active de l'agissant et c'est pourquoi on doit comprendre le risque en tant qu'élément qui rend le procès économique plus dynamique. Le risque, en menaçant de la perte, peut apporter du profit.

Après toutes ces observations, nous pouvons passer à formuler des conclusions. L'incertitude c'est la possibilité des déviations in plus et in minus des effets planifiés. Le risque signifie, à son tour, l'engagement des fonds économiques et de l'énergie humaine — le travail des hommes et des machines — pour réaliser des entreprises causant la possibilité de la déviation négative qui est une perte économique.

L'incertitude se caractérise par l'effet final et la possibilité de sa réalisation, le risque, au contraire, c'est une activité humaine visant à obtenir l'effet envisagé et deuteux.

L'incertitude présente tout simplement l'échelle des échanges possibles dans la formation de l'effet planifié. Si nous admettons que l'effet planifié égale 1, l'incertitude peut comprendre les possibilités des déviations de 0,95 à 1,05, tandis que le risque, compris entre 0,95 et 1, sera plus petit que la moitié. Le risque est donc strictement lié à l'éventualité de la perte quant à l'exploitation des hommes et des machines. Nous comprenons ici par la perte la non-obtention d'une partie ou de la totalité de l'effet planifié, indépendamment du fait si l'effet planifié a été bien prévu et calculé. Il est question, bien sûr, de la régularité du calcul ex ante et non ex poste.

L'incertitude constituera donc l'échelle des effets possibles d'une activité exercée dans le temps  $t_n$ , tandis que le risque marquera l'activité dans la période  $t_0-t_n$  qui vise l'effet  $q$ .

Si nous représentons donc l'échelle des effets possibles comme l'ensemble fini  $Q_n = q_1 < q_2 < q_3 \dots q_n$ , en admettant comme le résultat envisagé  $q_k$  et  $k < n$ , le risque égalera  $r_k$ . Si nous admettons  $q_m$  comme le résultat espéré, et  $m < k$ , le risque égalera  $r_m$  et il sera plus petit par rapport à  $r_k$ . Il faut remarquer que l'échelle de l'incertitude n'a pas changé: le résultat  $q_k$  et celui  $q_m$  appartiennent à l'ensemble  $Q_m$ .

$$k \in (1 ; n)$$

$$k \in (1 ; n)$$

La constatation d'E. Kulwicki est entièrement juste. D'après lui, l'incertitude a le caractère d'un phénomène statistique étant donné qu'elle représente l'état possible donc probable au moment final.<sup>7</sup> Alors que le risque porte les traits d'une catégorie dynamique, parce qu'il marque l'activité qui, tenant compte du résultat satisfaisant dans le moment  $t_0$ , peut finir par le fiasco. Le fiasco, à son tour, va se manifester par un simple fait que le résultat envisagé dans le temps  $t_0$  sera plus grand que celui qui se produira dans le temps  $t_n$ .

La valeur de la déviation de l'effet final au moment  $t_n$  démontre les capacités de celui qui organise l'activité de l'entreprise dans le moment  $t_0$ . Si l'on peut s'y servir du calcul des probabilités, l'échelle des déviations du résultat envisagé constituera l'intervalle fermée. Cependant, aux déviations novatrices, le calcul des probabilités ne s'applique pas.

Il existe deux genres des déviations: les déviations in plus, dans ce cas le résultat obtenu dépasse le résultat estimé, et les déviations in minus, qui font baisser la valeur du résultat estimé. Les déviations in plus ne sont pas toujours positives et souhaitées. Il en est de même quant aux déviations in minus. Lorsque les limites d'investigation sont dépassés, on les qualifie de négatives, dans le cas contraire (le but envisagé est atteint sans que les limites soient épuisées) nous les appelons positives.

Le fait de lier le risque à la perte ou à l'insuccès ne signifie aucunement que l'activité qui porte en soi le risque n'occasionne pas la réussite ou le succès. La conception du risque discutée par nous fait penser à l'activité dont le but est d'atteindre le résultat souhaité. Elle doit regrouper donc des éléments qui freineraient la perte éventuelle. Lorsque ces éléments agissent d'une façon satisfaisante, l'éventualité de l'insuccès est exclue. Autrement, l'éventualité devient la réalité. On peut

<sup>7</sup> *Przyczynek do teorii niepewności i ryzyka w gospodarce planowej* (La contribution à la théorie de l'incertitude et du risque dans l'économie planifiée), Folia Oeconomica Cracoviensia, vol. IX, Cracovie 1970, pp. 113—115.

en tirer la conclusion suivante: le risque, ce n'est pas uniquement l'activité elle-même, c'est aussi le perfectionnement de l'activité. C'est alors qu'elle se manifestera la plus efficace. Le risque peut être qualifié du phénomène de dynamique avant tout, parce qu'il permet de développer et d'améliorer l'action de l'entrepreneur.

#### LE RISQUE ET LES EXPÉRIENCES ÉCONOMIQUES

Autant nous associons au risque l'insuccès, autant l'expérience a pour son but de produire le phénomène voulu ou de le changer dans les conditions créées exprès. A l'expérience ainsi conçue s'associe l'éventualité de la perte, car l'expérience peut aussi bien finir par la réussite que par le fiasco et occasionner, dans ce dernier cas, l'échec — conséquence toute naturelle du fiasco.

Les expériences, quant à elles, sont utilisées dans les sciences naturelles et socio-économiques. Le premier groupe (appliqué dans les sciences physiques et chimiques) se distingue par la possibilité de les répéter plusieurs fois dans les conditions pareilles ou changées plus ou moins. Ce genre d'expérience permet d'éliminer tous les éléments négatifs afin d'aboutir à une généralisation.

Ce schéma est impossible à adopter à l'expérience utilisée dans les sciences socio-économiques ainsi qu'aux procès qui ont lieu dans les conditions déterminées partiellement par le niveau et la vitesse du changement des forces productrices. En physique, chimie et mécanique les expériences s'effectuent aux laboratoires dont les sciences socio-économiques de même que l'activité du pays sont dépourvues. C'est pourquoi, il semble que les possibilités d'y utiliser les expériences en tant que méthodes d'études et de changements dans l'activité réelle du pays sont beaucoup plus restreintes par rapport à leur large exploitation dans le domaine des sciences exactes. Cette restriction est due, en pratique, aux règles strictes dans le fonctionnement des entreprises et des institutions ainsi qu'aux capacités bien limitées de s'opposer au fiasco économique.

Les méthodes expérimentales, ayant pour but d'améliorer le mécanisme du fonctionnement de l'économie ont été plusieurs fois utilisées en Pologne. Au début, on ne s'en servait que dans des entreprises choisies, puis dans des unions des entreprises, enfin on a élargi leur champ et on les a appliquées aux différentes branches de l'économie.

On a changé également, proportionnellement aux besoins et préférences de développement, quelques éléments dans le fonctionnement des entreprises, soumises à l'expérience qui, au fait, n'aboutissaient que parfois au plein succès. Quantités de nouveautés ont été adoptées par l'économie entière. Plusieurs d'entre elles, cependant, étaient employées sans se rendre compte des résultats que l'on obtenait, ainsi que de leur utilité.

Cela ne fait penser qu'au manque de décision de la part des autorités centrales quant au procès d'expérimenter ou bien suggère le fait que l'expérience doit remplacer le besoin des changements dans l'administration de l'économie, ressenti universellement.

Pourtant, l'influence des résultats des expériences sur l'orientation des recherches, sur le plan des méthodes et des moyens de l'amélioration du fonctionnement de l'économie est la plus importante. En effet, on a considéré comme des expériences économiques les changements introduits dans le secteur de l'industrie au cours des années 1958—1971.

Les modifications dans le système de gouverner l'économie du pays, répandues dans les années 1973—1980, quoique ne pas comptées officiellement parmi les expériences, présentaient quelques traits propres à ce genre de méthodes. Celles-ci se faisaient voir à travers le nombre bien limité d'entreprises appelées initiatrices à qui se rapportaient ces changements, de même qu'à travers de différentes résolutions systématiques quant au critère de l'estimation, formules de compter les moyens de paiement, quant aux droits des entreprises, des unions d'entreprises enfin de l'industrie entière.

En synthétisant, par l'expérience économique on comprendra une sorte de méthodes d'amélioration visant le mécanisme du fonctionnement de l'économie qui réside dans le fait suivant: avant que de nouvelles solutions s'étendent sur l'économie entière soit sur une branche choisie (une entreprise choisie), il est nécessaire de les soumettre à un examen qui avait lieu dans le cadre économique bien restreint. L'expérience économique peut être très bien utilisée pour rendre meilleur le système d'administration à l'intérieur d'une entreprise, bien sûr si celle-ci est en mesure de réaliser des actions expérimentales, et ceci se trouve conditionné par l'étendue des droits quant à la décision acquise après la mise à exécution des principes de la réforme économique.

Le mot „expérience”, employé dans la formule, doit être compris dans le sens différent de celui qu'il l'a en sciences naturelles. Les phénomènes économiques soumis à l'expérience sont déterminés par toute une série de conditionnements socio-économiques. Ils peuvent être partiellement modifiés, mais jamais abstraits d'un complexe procès économique.

#### LES ÉLÉMENTS QUI RESTREIGNENT DES POSSIBILITÉS D'UTILISER EN PRATIQUE LES MÉTHODES EXPÉRIMENTALES DANS LE PROCÈS D'ADMINISTRER LE PAYS

Le fait qu'il y a une possibilité quant à l'utilisation des méthodes expérimentales dans l'administration du pays ne signifie pas que les restrictions y n'ont pas lieu. Parmi les plus importantes, on trouve:

- a) l'influence du champ de l'expérience sur les conditions de l'activité d'une unité économique,
- b) les capacités de l'expérience,
- c) le risque qui se lie inséparablement aux expériences économiques.

Les conditions de l'activité d'une unité économique se lient directement aux solutions utilisées dans le cadre du fonctionnement de l'économie. Le fait d'introduire d'autres solutions — résultats des expériences — a pour l'objectif le changement des conditions de l'activité. L'expérience, quant à elle, tout en changeant les conditions de l'activité des entreprises choisies, ne modifie pas, avant de les répandre, les règles générales de l'activité d'autres entreprises, ce qui peut influencer le processus même d'expérimenter, de même que les succès économique et sociologique de celui-ci. C'est pour cela que certains échecs dans la mise à réalisation de l'expérience peuvent résulter non de quelques irrégularités concernant des éléments qui constituent l'expérience, que de l'influence négative des règles créées auparavant, des façons de penser, des critères d'estimer.

Les mêmes chances et possibilités au point de départ ne garantissent pas les mêmes effets; ce qui est fréquent, c'est notamment de différentes capacités d'entreprendre le risque, si important pour le succès technique et commercial de l'entreprise. Le risque comprend également des inclinaisons à utiliser des nouveautés et des expériences économiques.

Les expériences concernant l'administration peuvent être analysées de deux points de vue: d'objets qu'elles concernent et de sujets qui s'en servent. Le premier s'explique par les tentatives de modifier les éléments choisis du mécanisme du fonctionnement de l'économie ainsi que par la modification des conditions d'entourage ou bien des méthodes de diriger l'activité économique des entreprises. Il est lié étroitement au second et on peut fort bien admettre une dépendance suivante: le cadre de l'activité s'élargit proportionnellement aux possibilités.

Il serait digne de mentionner que cette co-dépendance peut être partiellement nivelée par l'utilisation des réserves matérielles ou financières, accumulées au niveau central ou inférieur. Cette éventualité ne doit être comprise que comme un facteur de plus qui rend plus grande l'aptitude à utiliser les expériences. Les réserves sont pourtant limitées et c'est pour cela que leur influence sur les possibilités d'expérimenter est aussi limitée.

L'aptitude d'expérimenter ce n'est que l'ensemble de facteurs contribuant à tenter les expériences. Le rôle décisif appartient à deux éléments: l'initiative, autrement dit des inclinaisons à chercher des nouveautés et les possibilités de les étudier et répandre.

L'initiative doit être liée aux prédispositions personnelles de l'hom-

me — innées et acquises, bien qu'elle soit conditionnée par la faim sociale de nouveautés. Cela dépend, dans une large mesure, de la force de motivation des effets économiques obtenus par les entreprises, qui, chez nous, n'est pas grande en dépit des manques de produits. Dans la pratique, la motivation est limitée par les facteurs qui empêchent d'entreprendre et de répandre les innovations.

En généralisant le problème, dans le système socio-économique qui base sur la socialisation des moyens de production, doivent exister des facteurs qui favoriseraient toutes sortes d'innovations. La propriété commune des moyens de production et des résultats de la production devrait engager toute la société dans le procès de l'activité économique du pays.

Ce principe ne s'applique pas toujours à l'état réel de l'économie. Ce qui freine sa mise en pratique, ce sont notamment des initiatives qui font baisser considérablement le niveau de la participation créatrice à l'amélioration des méthodes et des effets du travail.

Incontestablement, il faut juger comme négative l'autonomie bien limitée des entreprises, soumises aux règles générales de l'économie du pays. C'est elle qui devrait créer des conditions particulièrement favorables à l'activité initiative: c'est alors que la pression de l'entourage occasionne plus d'initiative. Discipline, interdictions, directives ne peuvent que produire la situation inverse. Ce que l'on y juge donc ce n'est point l'initiative mais, tout au contraire, le fait d'utiliser dans la pratique des recommandations.

Il s'ensuit que le facteur analysé exerce une influence non seulement sur l'initiative en général, mais aussi sur la vitesse des changements dans le mécanisme du fonctionnement de l'économie.

Dès nos jours, les possibilités des innovations se manifestent par les expériences économiques qui concernent uniquement la direction centrale, politique et économiques du pays. Les entreprises réalisaient les expériences dont on les a obligées. Ce principe, qui résultait sans doute de la position socio-économique des entreprises, considérées toujours comme des parties composant l'organisme central, subordonnées à lui, était en usage jusqu'à présent. Il est vrai que ce statut ne domine pas des compétences des entreprises, néanmoins, dans la pratique économique et même parfois dans la théorie, on motivait le domaine si limité des entreprises non par le haut niveau des rendements des investissements que par les exigences de la planification centrale.

Les autorités centrales ne disposent pas du droit absolu, infini d'utiliser les expériences, ce qui nous a paru à première vue. Le risque tolérable est strictement défini. C'est pourquoi les autorités s'efforcent d'échapper au fiasco tout comme le font les unités économiques leur soumises. De cela vient l'aversion pour des nouveautés, donc aussi pour les expériences

dont le trait caractéristique est le risque beaucoup plus grand que dans le cas des actions déjà connues et plusieurs fois exercées.

La catégorie des changements qui ne se produisent qu'une seule fois regroupe toutes les modifications concernant le mécanisme du fonctionnement de l'économie. Le procès économique, complexe et se transformant d'une façon continue, exclut notamment le fait de prévoir le cours et les résultats des changements y introduits. La mise en pratique d'une nouvelle solution dans le domaine de la technique ou de l'organisation demande des expériences ultérieures dans les laboratoires, des études de modèle ou bien l'utilisation demi-technique — tout cela pour juger l'éventualité de l'appliquer à l'économie ultérieure. Les fonctions pareilles, quoique dans le domaine limité, remplissent les expériences économiques se rapportant aux changements dans le fonctionnement de l'économie. Un rôle semblable jouent les expériences des autres pays, si elles peuvent être adoptées par notre économie.

L'expérience économique qui est toujours une innovation, est au fond une entreprise complexe. Les dépendances réciproques dans le mécanisme du fonctionnement occasionnent les changements immédiats des éléments provoqués par la modification de l'un d'eux. C'est ainsi que le risque qui marque toute expérience économique reste dans une corrélation proportionnelle entre sa valeur et le nombre de sujets qu'il concerne.

L'éventualité d'un échec partiel ou total, se manifestant par les résultats de plus en plus médiocres de l'activité économique, force à estimer si les changements entrepris peuvent réellement avoir lieu et s'ils sont suffisamment lucratifs. Les effets de l'échec concernent toute la société de même que la perte rend plus faible l'économie entière. Ce fait-là ne doit aucunement imposer à la société et à l'Etat l'attitude négative vis-à-vis du risque lié inséparablement à l'expérience, car il peut très bien apporter du profit. Cet aspect de l'expérience, utilisée pour perfectionner le mécanisme du fonctionnement de l'économie, est digne de souligner, lorsque le succès est dû aux frais relativement peu importants, l'insuccès est peu probable et n'occasionne pas de pertes considérables. L'éventualité de l'insuccès, bien qu'elle ne devienne pas la certitude, ne fait pas obstacle au perfectionnement du système économique du pays, autant la société entière que les unités économiques doivent être conscientes de la dépendance qui s'impose nettement et lie inséparablement le succès au risque. De cela résulte la nécessité d'admettre l'éventualité du risque pour accélérer le développement socio-économique.

Du point de vue macroéconomique les pertes dues à l'insuccès éventuel représentent une importance particulière, étant donné qu'elles ne peuvent pas être compensées et presque toujours font amoindrir le pro-

duit social. L'éventualité du profit plus grand y devrait l'emporter toutefois sur l'éventualité de la perte.

Il faut remarquer, à cette occasion, que toute sorte de risque est accueillie dans notre économie non sans réserve. Outre la crainte de la perte, elle est provoquée par les facteurs suivants:

— le manque d'enthousiasme, fréquent chez les réalisateurs des expériences, conservateurs pour la plupart;

— le manque de responsabilité quant au choix de la variante convenable et de son rendement;

— la nécessité d'adopter les conditions extérieures à de nouveaux principes de travail, autrement dit, la nécessité de créer les conditions qui favoriseraient les expériences;

— les difficultés liées au mécanisme central du gouvernement, s'aggravant avec le degré de la différenciation des principes de l'activité des entreprises;

— les difficultés d'organisation quant au sujet de l'expérience se manifestant surtout dans la phase de la mise en pratique des changements envisagés par l'expérience.

Les aspects de l'expérience dans le fonctionnement de l'économie discutés ci-dessus n'épuisent certainement pas toutes les questions qui s'y imposent, n'étudient pas à fond le sujet. On a fait attention uniquement à quelques problèmes capitaux qui s'articulent avec une possibilité d'utiliser les expériences comme l'une des méthodes d'influer les phénomènes économiques, avant tout par le fait de perfectionner le système du fonctionnement de l'économie.

#### LES EXPÉRIENCES ÉCONOMIQUES DANS LE MÉCANISME DE GOUVERNER L'ÉCONOMIE DU PAYS

Les règles du fonctionnement de l'économie socialiste s'expliquent par des solutions de système. Celles-ci, quoique choisies consciemment, doivent être adoptées aux conditions socio-économiques, propres à l'étape donnée du développement des forces productrices et des relations de production. Ce n'est pas pourtant une dépendance unilatérale. Le fonctionnement de l'économie peut stimuler ou freiner le développement du pays. Les règles générales ne décident pas arbitrairement du moyen de résoudre les problèmes particuliers quant à la sélection des instruments qui contrôlent l'activité des unités économiques. Le choix convenable de ces moyens peut déterminer dans la pratique la réussite ou la perte du travail exécuté.

Le rôle créateur des mécanismes économiques peut être réalisé lorsque ceux-ci sont perfectionnés constamment et on en distingue deux méthodes: la mise en pratique des changements concernant l'économie en général, et la mise en pratique des changements concernant le secteur particulier, ce processus ayant pour but de vérifier leur efficacité.

La première méthode peut suggérer que les changements sont introduits sans étudier les effets qu'ils peuvent produire, bien que les modifications précèdent l'analyse de l'état actuel et qu'elles soient documentées par des conclusions résultant de l'analyse précédente de même que par le degré de la co-existence des éléments nouveaux avec les éléments existant déjà et que les changements ne concernent pas. La justesse des changements introduits ainsi peut être jugée a priori, car ils doivent augmenter une logique intérieure du fonctionnement de même que l'unité de celui-ci.

Le motif principal quant à l'utilisation de la deuxième méthode, c'est avant tout la vérification de l'exactitude de nouvelles solutions que l'on peut répandre après les modifications nécessaires. Du point de vue théorique, la valeur de cette méthode, c'est le champ restreint qu'elle concerne; par cela, le risque d'un échec éventuel devient plus petit. Dans la pratique, l'insuccès lié au fait d'introduire les changements en adoptant cette méthode ne signifie pas nécessairement un faux choix de nouvelles solutions, il peut aussi être le résultat du manque de conséquence quant à leur mise en pratique ou du rapport négatif des unités économiques envers ces changements qui peuvent, à leur tour, constituer une menace pour des rapports existant dans l'économie; ils peuvent, enfin, occasioner une situation de l'incertitude en ce qui concerne la position d'une unité administrative dans un nouveau système de rapports à l'intérieur d'une branche, par exemple.

Vu le champ qu'ils concernent, les changements dans le mécanisme du fonctionnement de l'économie ont soit le caractère d'un ensemble — tous les-éléments — soit le caractère partiel — les éléments choisis.

Le mécanisme du fonctionnement définit non seulement les principes, mais aussi les sujets c'est-à-dire des organes de l'économie (entreprises, associations des entreprises etc.) dont l'activité dépend de ces principes.

En adoptant une méthode des changements universels et simultanés on peut embrasser tous les organes de l'économie nationale ou bien ceux qui font partie d'un domaine choisi de l'activité p. ex. l'industrie, la construction, le commerce, l'agriculture. Les objets des changements, si on se réfère au mécanisme entier du fonctionnement de l'économie, auront alors le caractère partiel, même lorsque le changement concernera plusieurs éléments n'utilisés cependant que dans les branches particulières de l'économie nationale. Lorsque le changement touchera tous

les principes du fonctionnement dans l'économie entière, on parlera du caractère universel des changements.

Les expériences économiques servent à vérifier dans la pratique de nouvelles solutions. Deux traits particuliers se lient à ce fait: le champ restreint et la durée strictement définie. Les expériences doivent être aussi envisagées et avoir le but précis.

En général, les expériences sont une forme restreinte des changements qui concernent le mécanisme entier du fonctionnement de l'économie. On peut uniquement parler de leur champ plus ou moins limité et ce qui les caractérise, c'est une expérience visant soit l'objet soit le sujet. Ce qui est essentiel pour la réussite de l'expérience, c'est la durée, définie par le moyen de fixer la période de sa validité (dès le commencement jusqu'à la fin), ou bien par le fait de répandre progressivement des changements (après un temps d'expérimenter).

Le caractère expérimental des changements, si on parle de la deuxième façon de fixer le temps, aura lieu lorsqu'au début, les changements ne seront introduits que dans un groupe de branches appartenant à un secteur défini de l'activité économique p. ex. l'industrie, l'agriculture. Chacun d'eux constitue une unité autonome qui, dans le cadre de l'économie nationale, peut fonctionner d'après ses propres principes, différents quant à certains éléments. Le fait de répandre les changements dans toutes les branches d'une activité économique donnée peut signifier la fin de l'étape des expériences. Contrairement à celles-ci, les changements introduits universellement ne sont pas limités par le temps, autrement, ils sont valables jusqu'au changement suivant.

Les changements initiés et répandus administrativement dans le cadre du mécanisme du fonctionnement de l'économie — indépendamment de leur forme — sont des changements envisagés. Leur but fondamental, c'est la perfection des solutions existant déjà et par cela — l'amélioration des résultats de gouverner le pays. Dans le cas de l'expérience le but est plus éloigné dans le temps, parce qu'il sera réalisé après une éventuelle popularisation des effets dans un cadre plus large.

Excepté les changements administratifs, on utilisera les changements d'une valeur inférieure. On les introduit en vertu des droits accordés. Si le but est impossible à atteindre, sa probabilité égale zéro.

#### STRESZCZENIE

W pierwszej części opracowania omówiono istotę pojęcia ryzyka, jego treść i cechy charakterystyczne, nawiązując do najbardziej znanych w literaturze ekonomicznej definicji niepewności i ryzyka oraz prezentując własne ujęcie autora. Niepewność, w ujęciu prezentowanym w artykule, jest zjawiskiem statycznym, na-

tomiast ryzyko łączy się z decydowaniem i działaniem, czyli jest kategorią dynamiczną.

Zasadniczą cechą ryzyka jest ewentualność niepowodzenia. Ewentualność ta charakteryzuje również eksperymenty, które można traktować jako swoistą metodę wdrażania zmian do praktyki działań gospodarczych. Metoda ta jest szczególnie interesująca w sferze działań zmierzających do doskonalenia mechanizmów funkcjonowania gospodarstwa narodowego. Eksperymenty gospodarcze mogą być też wykorzystywane w procesach doskonalenia działalności przedsiębiorstw, o ile oczywiście posiadają one dostatecznie szeroki zakres samodzielności ekonomicznej.

Możliwości wykorzystywania metody eksperymentowania są w gospodarce narodowej dość ograniczone, gdyż w dotychczasowej praktyce zarządzania gospodarką zakres samodzielności przedsiębiorstw był stosunkowo wąski, co bezpośrednio ograniczało ich zdolność do podejmowania decyzji eksperymentalnych. Wąski zakres samodzielności przedsiębiorstw obniżał również możliwości podejmowania ryzyka obciążającego z reguły działalność eksperymentalną. Obawa przed ujemnymi skutkami podejmowanego ryzyka charakteryzuje przy tym nie tylko przedsiębiorstwa, ale również decydentów szczebla centralnego, co jeszcze bardziej pogłębia niechęć do ryzyka i inicjatywy gospodarczej.

#### РЕЗЮМЕ

В первой части настоящей статьи обсуждается сущность понятия риска, его содержание и характерные черты, с обращением к наиболее известным в экономической литературе определениям неуверенности и риска, а также с представлением точки зрения автора. Неуверенность понимается автором как статическое явление, риск же связан с действиями и приемом решений, следовательно, он является динамической категорией. Принципиальная черта риска — возможность неудачи. Она характерна также для экспериментов, которые могут считаться особым родом методом ввода изменений в экономическую практику. Этот метод особенно интересен в сфере действий, направленных на усовершенствование механизмов функционирования народного хозяйства. Экономические эксперименты могут также использоваться в процессах усовершенствования деятельности предприятий, разумеется, при условии их достаточной экономической самостоятельности.

Возможности использования метода эксперимента в народном хозяйстве ограничены, поскольку существующая до сих пор практика управления экономикой страны оставляла сравнительно узкий размер самостоятельности предприятий, что непосредственно ограничивало их способность принимать экспериментальные решения. Незначительная самостоятельность предприятий снижала также возможности идти на риск, связанный, как правило, с экспериментом. При этом опасения перед отрицательным результатом эксперимента свойственны не только предприятиям, но и хозяйственному центру, что еще усиливает нежелание подвергаться риску и проявлять экономическую инициативу.