

# MANAŽERSKÉ ROZHODOVÁNÍ V PODMÍNKÁCH RIZIKA A NEURČITOSTI

J. Erbes

Ústav řízení a marketingu PEF VŠZ v Brně, Zemědělská 5,  
662 65 Brno, Fax 67 83 48

## **Anotace:**

Príspevek provádí klasifikaci rozhodovacích situací. Zvláštní pozornost je věnována rozhodování při částečné a omezené informovanosti rozhodovatele - rozhodování za rizika a neurčitosti. Hlavním předmětem je specifikace příčin rizikovosti rozhodnutí manažerů působících v současném českém agrárním sektoru.

## **Summary:**

The different kinds of decision situations are described at the article. Special attention is paid to decisions with the partial and limited information - decisions under risk and uncertainty. The main goal is specification of reasons uncertainty of decision makers at present Czech agribusiness.

## **Klíčová slova:**

teorie rozhodování, rozhodovací proces, riziko, neurčitost, informace a rozhodnutí

## **Key words:**

decision theory, decision process, risk, uncertainty, information and decision

V teorii rozhodování jsou rozhodovací situace zpravidla rozdělovány do tří kategorií: rozhodování za jistoty, rizika a neurčitosti. Klasifikačním klíčem tohoto členění je množství informace, kterou má rozhodovatel v okamžiku přijetí rozhodnutí k dispozici. Rozhodování za jistoty je pak charakterizováno úplnou informovaností rozhodovatele, tj. stavem, kdy hodnoty neřiditelných proměnných (faktory vnitřního a vnějšího prostředí neovlivnitelné rozhodovatelem) jsou jednoznačně definované. Je třeba ovšem poznamenat, že řídicí pracovník se s touto situací setkává zcela vyjimečně. Jen zřídka se pohybuje v deterministickém prostředí a přijímá rozhodnutí na základě úplné znalosti informací pomocí známých a ověřených algoritmů.

## *Terminologická poznámka.*

V anglické terminologii (viz. např. lit./1/) jsou pro tři typy rozhodovacích situací zavedeny pojmy *certainty* (jistota), *risk* (riziko), *uncertainty* (nejistota). Chápeme-li však nejistotu jako komplementární doplněk jistoty, zahrnuje v sobě i rozhodování za rizika. Proto upřednostňuji pro třetí typ rozhodovací situace český termín *neurčitost* a termín *nejistota* používám v dalším jako společný pojem pro označení rozhodovacích situací za rizika a neurčitosti. (tedy s odvoláním na předcházející poznámku rozhodování za nejistoty)

## **Charakteristika rozhodovacích situací za rizika a neurčitosti.**

Pro rozhodování za rizika a neurčitosti je charakteristické, že alespoň jedna z neřiditelných proměnných není definovatelná jedinou hodnotou, ale konečnou množinou hodnot, jichž může nabývat. Tato množina je popsána buď výčtem hodnot (v krajním případě pouze minimální a

maximální hodnotou) nebo nějakou funkcí. Kartézský součin množin hodnot všech neřiditelných proměnných definuje úplnou množinu stavů okolí. Znovu je třeba poznamenat, že okolí je v tomto případě popsáno nejen vnějšími faktory, ale i faktory vnitřními, rozhodovatelem neovlivnitelnými. Podmínkou použitelnosti takových rozhodovacích technik, jako jsou rozhodovací tabulky, stromy a sítě je pak konečnost množiny stavů okolí a schopnost ocenění (ohodnocení, výplat) důsledku každého rozhodnutí.

Podmínkou, aby rozhodovací situace mohla být považována za rozhodování za rizika (v kontrastu rozhodování za neurčitosti) je znalost pravděpodobností výskytu jednotlivých stavů okolí. Tyto pravděpodobnosti mohou mít objektivní nebo subjektivní povahu.

### **Faktory ovlivňující míru nejistoty rozhodovací situace**

Míru nejistoty ovlivňují dva globální faktory:

1. Sama podstata řízeného procesu a jeho vnitřního i vnějšího prostředí. Má-li proces a prostředí stochastický charakter, je míra nejistoty přímo úměrná úrovni variability neřiditelných proměnných.
2. Množství a kvalita informace, kterou má rozhodovatel k dispozici. Nedostatečné množství informace zvyšuje nejistotu.

Na základě rozboru těchto dvou faktorů lze hledat odpověď na otázku, s jakou mírou nejistoty se setkává manažer působící v dnešní době v agrárním sektoru.

V tomto sektoru je výrazným zdrojem nejistoty převážně biologický charakter zemědělské výroby. Turbulentnost tohoto procesu je však dnes doprovázena silnou turbulentností vnitřního i vnějšího podnikatelského prostředí. Tržní ekonomika ve srovnání s ekonomikou direktivně řízenou sama vykazuje větší proměnlivost řady faktorů. Konkurenční prostředí vyvolává časté změny v nabídce a poptávce a z toho odvozené pohyby cen. Internacionalizace agrárního trhu, různá úroveň jeho státních regulací pak často vyvolávají silné a velmi obtížně předpověditelné výkyvy vnitřních i vnějších faktorů. S touto skutečností se musí vyrovnávat každý manažer působící v agrárním sektoru. V současných podmínkách České republiky jsou však tyto výkyvy zesíleny zejména:

- postupně se vytvářejícím konkurenčním prostředím; v nedokonalé konkurenci jsou důsledky rozhodnutí silně odvislé na často zcela subjektivních rozhodnutích konkurentů
- teprve se formujícími zásadami agrární politiky státu
- nedostatečnou a velmi pomalu se prosazující podnikatelskou a organizační kulturou; manažer se často setkává s proměnností těch faktorů, které by měly být neměnné - porušení dohodnutých pravidel, nedodržení smluv, neplnění závazků

K tomu přistupuje druhý zdroj nejistoty - množství a kvalita informací, které má rozhodovatel k dispozici. Nutno poznamenat, že i tato skutečnost je podmíněna subjektivními a objektivními příčinami. K objektivním příčinám patří nedostatečně rozvinuté informační systémy, a to jak po technické tak především po obsahové stránce. Nedostatečná je rovněž institucionální podpora informačních systémů projevující se v malém počtu poradenských a specializovaných marketingových firem, v krátké době činnosti plodinové burzy agrární komory a dalších institucí a organizací. Nepřípravenost řídicích pracovníků k působení v silně proměnném rizikovém prostředí je pak subjektivní příčinou jejich nedostatečné informační vybavenosti.

Manažer působící v agrárně potravinářském sektoru je v současných podmínkách České republiky vystaven ve své rozhodovací činnosti vlivům způsobujícím vysokou nejistotu. Přitom míra nejistoty převyšuje úroveň obvyklou pro vyspělé tržní ekonomiky a ostatní národohospodářská odvětví. Lze pouze doufat, že míra nejistoty začíná překračovat kulminační bod. V kontrastu s touto charakteristikou vystupuje nízká úroveň připravenosti větší části řídicích pracovníků na působení v těchto podmínkách. Jen ojediněle využívají takové kvantitativní metody, které dokážou analyzovat míru rizika a přijímat taková rozhodnutí, která toto riziko snižují.

Význam těchto metod a technik však nelze přeceňovat. Velmi významnou roli zde hraje vlastní osobnost rozhodovatele. Výstižně to charakterizují autoři knihy *Dynamická výroba* (viz. lit./3/ str. 37):

"... v podnikání je často důležité nebýt příliš racionální. Zcela racionální lidé nezačínají podnikat v nových oblastech, neútočí na největší firmy v průmyslovém odvětví a nesnaží se s omezenými zdroji dosáhnout vedoucí pozice v průmyslu."

V této souvislosti autoři citují Keynesův výrok z r. 1936: "Velká část našich pozitivních aktivit závisí spíše na spontánním optimismu než na (matematické logice) ... Když je živočišný duch tlumen a spontánní optimismus ochabuje a nám nezbývá než se spoléhat jen na logiku, firma bude chřadnout a zanikne."

#### **Literatura:**

1. Turban, E. - Meredith, J.R. : *Fundamentals of Management Science*. Irwin, Homewood, Illinois 1988
2. Bierman, H. - Bonini, Ch.P. - Hausman, W.H. : *Quantitative Analysis of Business Decisions*. Irwin, Homewood, Illinois 1986
3. Hayes, R.H. - Wheelwright, S.C. - Clark, K.B. : *Dynamická výroba*. Victoria Publishing, Praha 1993