

ISSN: 1300-3747



**Çukurova Üniversitesi İktisadi ve İdari
Bilimler Fakültesi**



**Cukurova University Faculty of Economics
and Administrative Sciences**

**ÇUKUROVA ÜNİVERSİTESİ İKTİSADİ VE
İDARİ BİLİMLER FAKÜLTESİ DERGİSİ**

**Journal of Çukurova University Faculty of
Economics and Administrative Sciences**

Cilt/Vol: 19 Sayı/No: 2 Yıl/Year: 2015

2015

ÇUKUROVA ÜNİVERSİTESİ
İKTİSADİ VE İDARİ BİLİMLER FAKÜLTESİ
DERGİSİ

Çukurova University
Journal of Faculty of Economics and Administrative Sciences

Danışma Kurulu/Advisory Board

Prof.Dr. Güneri AKALIN (İstanbul Aydın Üniversitesi)
Prof.Dr. Ömer Baybars TEK (Dokuz Eylül Üniversitesi)
Prof.Dr. Ahmet Burçin YERELİ (Hacettepe Üniversitesi)
Prof.Dr. Birol YEŞİLADA (Portland Eyalet Üniversitesi)
Prof.Dr. Asaf Savaş AKAT (Bilgi Üniversitesi)
Prof.Dr. Ahmet Fazıl Özsoylu (Adana Bilim ve Teknoloji Üniversitesi)

Yayın Kurulu/ Board of Editors

Prof.Dr.Erkut DÜZAKIN (Editör)
Prof.Dr.Fikret DÜLGER
Doç.Dr.Mehmet ÖZMEN
Yar.Doç.Dr. Hakkı ÇİFTÇİ
Yar.Doç.Dr. Mert DEMİRCİOĞLU

Ç.Ü.İktisadi ve İdari Bilimler Fakültesi Dergisi yılda 2 kez yayınlanır. Dergide yayınlanan yazılar yazarların kişisel görüşleri olup kaynak gösterilerek kullanılabilir.

Sürekliliği sağlamak için Fakülte Dergimiz geçmiş yılların cilt ve numarasını izlemektedir.

Yazışma Adresi

Ç.Ü.İktisadi ve İdari Bilimler Fakültesi
Dergi Yayın Kurulu Başkanlığı
Adana/TÜRKİYE

Telefon: (0 322) 3387266
Fax: (0 322) 3387283-3387284

Phone: +90 (322) 3387266
Telefax:+90 (322) 3387283-3387284

Journal of Faculty of Economics and Administrative Sciences is
Published one issue per year,
Articles published in the Journal reflects personal views and may be
referred by source.

For correspondence

The Editor, Cukurova University
Faculty of Economics and Administrative Sciences
Adana/TURKEY

Dergimiz



tarafından taranmaktadır.

Dergimiz

DergiPark
AKADEMİK

üyesidir.

ÇUKUROVA ÜNİVERSİTESİ

İKTİSADİ VE İDARİ BİLİMLER FAKÜLTESİ DERGİSİ

ISSN: 1300-3747		
Cilt: 19	Sayı: 2	Yıl: 2015
Volume: 19	No: 2	Year: 2015

<i>İÇİNDEKİLER</i>		
F.Merve PARLAKYILDIZ	Makro Ekonomik ve Politik İstikrarsızlığın Ekonomik Performans Üzerine Etkisi: Latin Amerika Örneği.....	1
H.Bilgehan YAVUZ	Avrupa Birliği ve Türkiye’de Kurumların İşgücü Piyasalarına Etkileri.....	13
Erkan GÜNEŞ Burhan KABADAYI	Türkiye Turizm Talebini Açıklamaya Yönelik Bir Panel Çekim Modeli Analizi.....	31
Murat ÇOKGEZEN Oyun-Erdene ERDENE	Gelişmekte Olan Ülkelerde Yaygın Eğitimin Yoksulluğu Azaltma Üzerindeki Etkisi.....	47
H.Ediz ATMACA Duygu TURĞUT	Kargo Şirketi Seçimine Yönelik Kriterlerin Belirlenmesinde Türkiye Genelinde Bir Saha Araştırması.....	65
Almila Burgaç ÇİL	Balassa-Samuelson Hipotezinin İçsel Aktarım Mekanizmasının Türkiye Ekonomisi İçin Test Edilmesi.....	81
H.Bilgehan YAVUZ	Avrupa Birliği İstihdam Politikaları.....	101
Mehmet DEMİRAL Harun BAL	Ticaret Performansı Ölçümlerine Çok Boyutlu Bir Yaklaşım: Seçilmiş Ülke ve Sektörlere İlişkin Karşılaştırmalı Analizler.....	115

Almila Burgaç ÇİL	Cari İşlemler Açığının Sürdürülebilirliğinin Çoklu Yapısal Kırılmalı Eşbütünleşme Yöntemi ile Sınanması.....	135
Recep KÖK Ramazan EKİNCİ A.Elif Ay YALÇINKAYA	Ülke Riski Bileşenlerinin Bankacılık ve Reel Sektör Üzerine Etkileri: Türkiye Örneği, 1993-2015.....	151
Hakkı ÇİFTÇİ	Doğrudan Yabancı Sermaye Yatırım İkliminin Oluşturulmasını Belirleyen Faktörler.....	173

BU SAYIDA HAKEMLİK YAPAN ÖĞRETİM ÜYELERİ

Prof.Dr.Muammer Tekeođlu
Prof.Dr.Murat Dođanlar
Prof.Dr.Mehmet Balcılar
Prof.Dr.Fatih Cin
Prof.Dr.Murat Çokgezen
Prof.Dr.Harun Bal
Prof.Dr.Fikret Dölger
Doç.Dr.Mehmet Özmen
Doç.Dr.Neşe Algan
Yar.Doç.Dr.Hakkı Çiftçi
Yar.Doç.Dr.Mert Demirciođlu
Yar.Doç.Dr.Erhan İşcan

HAKEMLİK TEKLİFLERİMİZİ KABUL EDEREK

KATKILARINI ESİRGEMEYEN DEĞERLİ ÖĞRETİM ÜYELERİNE

TEŞEKKÜR EDERİZ

Makro Ekonomik ve Politik İstikrarsızlığın Ekonomik Performans Üzerine Etkisi: Latin Amerika Örneği

The Effects of Macroeconomic and Political Instability on Economic Performance: The Case of Latin America

F.Merve PARLAKYILDIZ¹

ÖZET

Bu çalışmanın amacı, Latin Amerika ülkeleri için 1999-2013 yılları arasındaki 15 yıllık dönemde enflasyon oranı, işsizlik oranı ve politik istikrarsızlık seviyesinin ekonomik performans üzerindeki etkisini analiz etmektir. Panel veri analizinin kullanıldığı çalışmada ulaşılan sonuçlar işsizlik oranı ve politik istikrarsızlık seviyesinin ekonomik performansını negatif etkilediğini ancak enflasyon oranının ekonomik performans üzerinde hiçbir etkisi olmadığını ifade etmektedir.

Anahtar Kelimeler: Enflasyon, işsizlik, politik istikrarsızlık, panel veri analizi

ABSTRACT

The purpose of this study is to analyze the impact of inflation rate, unemployment rate and political instability level on economic performance in the 15-year period from 1999 to 2013 for Latin American countries. Using panel data analysis, the results indicate that unemployment rate and political instability level negatively affect economic performance, but inflation rate has no impact on the economic performance.

Keywords: Inflation, unemployment, political instability, panel data analysis.

¹ Araş.Gör., Çukurova Üniversitesi, İktisadi ve İdari Bilimler Fakültesi, İktisat Bölümü, mparlakyildiz@cu.edu.tr

1.Giriş

Ekonomik performans kavramı, ülkelerin gelişmişlik seviyesini yansıtan bir kavramdır. Ancak ekonomik performansı etkileyen değişkenlerin neler olduğuna dair literatürde bir uzlaşma söz konusu değildir (Beşkaya & Manan, 2009). Gelişmekte olan ülkeler için özellikle önem arz eden ekonomik performansa etki eden birçok değişken söz konusudur. Bu değişkenlerden özellikle makro ekonomik ve politik değişkenler ön plana çıkmaktadır. Makro ekonomik ve politik değişkenlerdeki istikrarsızlık, ekonomik performansa da etki etmektedir.

Makro ekonomik istikrarsızlık göstergeleri olarak, konuya ilişkin literatürde birçok farklı değişkenin kullanıldığı gözlenmektedir. İşsizlik, enflasyon, büyüme hızı, faiz oranları, dış ticaret açığı bu göstergelerden bazılarıdır (Güran & Tosun, 2005). Özellikle OECD'nin büyüme elması (magic diamond) diye nitelendirdiği ve ülkelerin ekonomik performansını yansıtan yaklaşım, ilgili literatürde sıklıkla kullanılmaktadır (Moesen & Cherchye, 1998). Bu yaklaşıma göre işsizlik oranı, enflasyon oranı, büyüme oranı ve cari işlemler açığının GSYİH içindeki payı bir ekonominin performansını yansıtan en önemli değişkenlerdir (OECD Economic Outlook, 1987, 2015).

Bu çalışmada ise makro ekonomik istikrarsızlık göstergesi olarak, verilerin mevcudiyet durumuna göre yalnızca işsizlik ve enflasyon oranları tercih edilmiştir. İşsizlik ve enflasyon oranlarının yüksek olmasının ekonomik performansı negatif etkilediği bilinmektedir (Bittencourt, 2010; Muscatelli & Tirelli, 2001). Ülkelerin ekonomik performansını etkileyen bir diğer önemli unsur ise politik istikrardır. Politik istikrarın söz konusu olmadığı ülkelerde, başka bir ifadeyle politik istikrarsızlık yaşayan ülkelerde oluşan belirsizlik yatırım, üretim ve istihdam gibi birçok ekonomik karar alma sürecini sektöre uğratmaktadır (Karahana & Karagöl, 2014). Bu nedenle bu üç değişkenin gelişmekte olan ülke ekonomileri üzerindeki etkisi yadsınamaz.

Bu çalışmada tercih edilen ülkeler Latin Amerika ülkeleridir. Latin Amerika ülkeleri Dünya Bankası (WB, 2015a) ülke gruplamasına göre gelişmekte olan ülkeler kategorisindedir. Politik istikrarsızlığın çok sık yaşandığı, aynı zamanda yüksek enflasyon ve işsizlik oranlarının söz konusu olduğu bu ülkelerde ekonomik performansın nasıl etkilendiğinin belirlenmesi çalışmanın esas konusunu oluşturmaktadır. Bu amaçla 1999-2013 yılları arasındaki 15 yıllık dönem panel veri analizi ile incelenmiştir. Çalışmada öncelikle işsizlik ve enflasyon oranları ile politik istikrarsızlığın ekonomik performans üzerindeki etkisine ilişkin literatür incelemesine yer verilmekte, sonrasında panel veri analizine ilişkin metodolojik bilgilere değinilmektedir. Model ve veri setinin tanımlanmasının ardından, elde edilen ampirik bulguların yorumlanması ile çalışma sonlanmaktadır.

2.Literatür İncelemesi

Enflasyon oranı, işsizlik oranı ve politik istikrarsızlık seviyesinin ekonomik performans ya da ekonomik büyüme üzerine etkilerinin araştırıldığı çalışmaların çoğunluğunda bu

değişkenlerin negatif etkileri üzerine vurgu yapılmaktadır. Ancak literatürde farklı etkilerin olduğunu belirten çalışmalar da mevcuttur.

Alesina vd. (1996), 1950-1982 yılları arasında 113 ülkeyi inceledikleri çalışmada, OLS ve GLS yöntemlerinin kullanmışlardır ve politik istikrarsızlığın ekonomik büyümeyi önemli ölçüde negatif etkilediği sonucuna ulaşmışlardır.

Asteriou ve Price (2001), 1961-1997 yılları arasında politik istikrarsızlığın İngiltere'nin ekonomik büyüme oranları üzerindeki etkisini incelemişlerdir. Politik istikrarsızlık ve ekonomik büyüme arasında güçlü bir ilişki olduğunu savunan yazarlar, bu ilişkinin negatif olduğunu vurgulamışlardır.

Balck vd. (2001), ABD'deki 48 eyalet için yaptıkları çalışmalarında iki farklı periyot ele almışlardır. 1963-1989 ve 1989-1994 periyotlarının incelendiği çalışmada, hem yatay kesit hem de panel veri analizi kullanılmıştır. Yazarlar, 1980'li yıllarda enflasyon ve ekonomik büyüme arasında pozitif bir ilişki olduğunu, 1960'lı ve 1970'li yıllarda ise enflasyon ve ekonomik büyüme arasında negatif bir ilişki olduğunu belirtmişlerdir.

Muscatelli ve Tirelli (2001), işsizlik ve ekonomik büyüme ilişkisini OECD ülkeleri için incelemişlerdir. Yapısal zaman serisi ve VAR analizlerini kullanan yazarlar, 1955-1990 dönemini ele almışlardır. Ele alınan dönemde OECD ülkeleri için işsizlik ve ekonomik büyüme arasında negatif bir ilişki olduğu sonucuna ulaşmışlardır.

Berber ve Artan (2004), enflasyonun ekonomik büyüme üzerindeki etkisini analiz etmişlerdir. Zaman serisi analizini kullanan yazarlar, 1987-2003 yılları arasında Türkiye'de enflasyon oranlarının ekonomik performansı ve büyümeyi azalttığı sonucuna ulaşmışlardır.

Bittencourt (2010), çalışmasında panel veri analizi ile 1970-2007 yılları arasında dört Latin Amerika ülkesini (Arjantin, Bolivya, Brezilya, Peru) incelemiştir. Bu ülkelerin yüksek enflasyon oranları nedeniyle zayıf makro ekonomik performansa sahip olduğunu ifade eden yazar, enflasyonun incelenen ülkeler için ekonomik büyüme üzerinde negatif etkisi olduğu sonucuna ulaşmıştır.

Şanlısoy ve Kök (2010), zaman serisi analizi kullandıkları çalışmalarında 1987-2006 yılları arasında Türkiye'de politik istikrarsızlık ve ekonomik büyüme ilişkisini araştırmışlardır. Yazarların ulaştığı temel sonuç, incelenen dönemde politik istikrarsızlığın ekonomik büyümeyi azalttığı yönündedir.

Arslan (2011), çalışmasında politik istikrarsızlık ve ekonomik performans arasındaki ilişkiyi incelemiştir. 1987-2007 yılları arasında Türkiye'yi ele alan yazar, eşbütünleşme testi ve hata düzeltme modeli kullanmıştır. Yazar, politik istikrarsızlık ve ekonomik performans arasında uzun dönemli bir ilişki olduğu ve ekonomik performanstan politik istikrarsızlığa doğru tek yönlü bir nedensellik ilişkisi olduğu sonucuna ulaşmıştır.

Gür ve Akbulut (2012), politik istikrarın ekonomik büyüme üzerindeki etkisini araştırmışlardır. Yazarlar, 19 gelişmekte olan ülkeyi 1986-2003 yılları arasında

incelemişlerdir. Panel veri analizinin kullanıldığı çalışmada, politik istikrarın ekonomik performans ve büyüme üzerinde pozitif etkisi olduğunu sonucuna ulaşılmıştır. Ancak, incelenen Latin Amerika ülkeleri için panel veri analizi çerçevesinde elde edilen birim etki katsayılarının negatif olduğu gözlenmiştir. Bu durum Latin Amerika ülkeleri için politik unsurların ekonomik performans üzerinde negatif etkisi olduğu şeklinde yorumlanmaktadır.

Kanca (2012), Türkiye için 1970-2010 yılları arasında işsizlik ve ekonomik büyüme ilişkisini analiz etmiştir. Granger nedensellik ve eşbütünleşme testlerini kullanan yazar, ekonomik büyümeden işsizliğe doğru tek yönlü bir nedensellik ilişkisi bulmuştur. Bu nedenle işsizlik oranlarının ekonomik büyüme üzerinde herhangi bir etkisi olmadığı sonucuna ulaşılmıştır.

Das ve Loxley (2015), çalışmalarında 1971-2010 yılları arasında Asya, Latin Amerika ve Karayipler ve Sahra-altı Afrika ülkelerinden oluşan 54 gelişmekte olan ülkeyi incelemişlerdir. Yazarlar, belirli bir enflasyon oranı seviyesine kadar enflasyon ve ekonomik büyüme arasında pozitif bir ilişki olduğu sonucuna ulaşılmışlardır.

3. Metodoloji

Bu çalışmada tercih edilen ekonometrik yöntem panel veri analizidir. Panel verisi zaman serisi ve yatay kesit verilerinin birleştirilmesinden oluşur (Gujarati & Porter, 2009, s.591). Bu çerçevede panel verisi bireyler, hane halkları, firmalar, ülkeler gibi farklı örnek birimlerine ilişkin belirli bir zaman dilimindeki gözlemleri içerir (Hill, Griffiths & Lim, 2011, s.538). Genel bir panel veri modeli denklem 1'deki gibi ifade edilebilir:

$$Y_{it} = \alpha + \beta_1 X_{1it} + \beta_2 X_{2it} + \dots + \beta_k X_{kit} + \varepsilon_{it} \quad (1)$$

$$\varepsilon_{it} = \mu_i + \lambda_t + v_{it} \quad (2)$$

$$i = 1, \dots, N; t = 1, \dots, T$$

Denklem 1'de Y bağımlı değişkeni, X_k bağımsız değişkenleri, α sabit terimi, β katsayıları ise eğim parametrelerini göstermektedir. i altsimgesi hane halkları, firmalar, ülkeler gibi birimleri; t altsimgesi ise gün, ay ya da yıl gibi zaman dilimini ifade etmektedir. Başka bir deyişle i altsimgesi panel verisinin yatay kesit boyutunu, t altsimgesi panel verisinin zaman boyutunu belirtmektedir. Denklem 2 ise μ_i gözlenemeyen birim etkilerinden, λ_t gözlenemeyen zaman etkilerinden ve v_{it} stokastik hata teriminden oluşmaktadır. Gözlenemeyen birim etkiler, eğer birimler bireylerden oluşuyorsa cinsiyet, yetenek, tecrübe, eğitim, kişilik özellikleri; eğer birimler firmalardan oluşuyorsa yönetici özellikleri, yönetim kalitesi; eğer birimler ülkelerden oluşuyorsa dil, din, ırk gibi birimlere özgü olan, birimden birime değişen ancak zamana göre değişmeyen ve regresyona dahil edilmeyen etkilerdir. Gözlenemeyen zaman etkileri ise ele alınan zaman dilimine özgü etkileri içeren, zamana göre değişen ancak birimlere göre değişmeyen ve regresyona dahil edilmeyen etkilerdir. Örneğin, üretimi

etkileyen grev yılları, petrol arzını ve fiyatını etkileyen ambargo dönemi gözlenemeyen zaman etkileridir (Baltagi, 2005, s.11-33).

Bir panel veri modelinin tahmininde kullanılan üç tahminci vardır. Bu tahminciler Havuzlandırılmış En Küçük Kareler (HEKK) Tahmincisi, Sabit Etkiler (SE) Tahmincisi ve Tesadüfi Etkiler (TE) Tahmincisi'dir. HEKK Tahmincisi, panel verisinin panel olma özelliğini göz ardı eden bir tahmin yöntemidir. Bir diğer ifadeyle örnek birimlerinin heterojen değil, homojen olduğu yani birim ve zaman etkilerinin olmadığı varsayımı altında tahmin söz konusudur (Asteriou & Hall, 2007, s.345). SE Tahmincisi, gözlenemeyen birim ve/veya zaman etkilerinin tahmin edilecek sabit birer parametre varsayıldığı bir tahmin yöntemidir (Baltagi, 2005, s.12). TE Tahmincisi, gözlenemeyen birim ve/veya zaman etkilerinin tahmin edilecek sabit birer parametre olmadıklarını, tesadüfi/rassal olarak belirlendiklerini ve tesadüfi birer parametre olduklarını varsaymaktadır (Asteriou & Hall, 2007, s.347).

Üç farklı tahminci ile tahmin edilen bir panel veri model için uygun tahmincinin seçimine yönelik testler mevcuttur. F Testi, HEKK ve SE Tahmincileri arasında tercih yapmak için kullanılan bir testtir. Breusch-Pagan LM Testi, HEKK ve TE Tahmincileri arasında tercih yapmak için kullanılan ve hata terimlerine ilişkin olan bir testtir (Greene, 2008, s.197-205). Hausman Testi ise, SE ve TE Tahmincileri arasında tercih yapmak için kullanılan bir testtir (Asteriou & Hall, 2007, s.348-349).

Panel veri modelinde uygun tahmincinin belirlenmesinin ardından, temel varsayımlar olan hata teriminin sabit varyanslı (homoskedastik) ve otokorelasyonsuz olup olmadığının test edilmesi gerekmektedir. Bu çerçevede değişen varyans olup olmadığı araştırılırken LM_h Testi, otokorelasyon olup olmadığına ilişkin de (SE tahmincisi ile tahmin yapılıyorsa) LM_p Testi ya da (TE tahmincisi ile tahmin yapılıyorsa) $LM_{\mu p}$ Testi kullanılmaktadır (Baltagi ve Li, 1991,1995; Greene, 2003, s.326-329).

4.Model, Veri Seti ve Ampirik Bulgular

Model

Panel veri analizi ile tahmin edilecek olan modelde hem μ_i birim etkileri hem de λ_t zaman etkilerinin olduğu varsayılmış ve bu çerçevede oluşturulan model 'Çift Yönlü Model' olarak nitelendirilmiştir. Makro ekonomik istikrarsızlık göstergeleri olan enflasyon ve işsizlik oranları ile politik istikrarsızlık endeksinin ekonomik performans üzerindeki etkisinin araştırıldığı bu çalışmada kullanılan ekonometrik model şu şekilde ifade edilmektedir:

$$EKOPER_{i,t} = \alpha + \beta_1 ENFLASYON_{i,t} + \beta_2 İŞSİZLİK_{i,t} + \beta_3 POLİİST_{i,t} + \mu_i + \lambda_t + v_{it}$$

Enflasyon ve ekonomik performans-büyüme ilişkisinin incelendiği literatürde, enflasyon ve ekonomik performans-büyüme arasında negatif ilişkinin olduğunu

vurgulayan çalışmaların çoğunlukta olduğu gözlenmektedir (Fischer,1993; Barro, 1995; Andres & Hernando, 1997). Bu nedenle β_1 katsayısının negatif olması beklenmektedir.

Okun (1962), Hoon ve Phelps (1997), Villaverde ve Maza (2009) çalışmalarında işsizlik oranının ekonomik büyümeyi negatif etkilediği sonucuna ulaşmışlardır. Bu çalışmada da β_2 katsayısının negatif olması beklenmektedir.

Politik istikrarsızlığın ekonomik performans-büyüme üzerinde negatif etkisinin olduğu literatürde vurgulanan bir unsurdur (Easterly & Levine, 1997; Jong-A-Pin, 2009; Demirgil, 2011). Bu nedenle bu çalışmada politik istikrarsızlık endeksinin ekonomik performans üzerindeki etkisini ifade eden β_3 katsayısının negatif olması beklenmektedir.

Veri Seti

Çalışmada 25 Latin Amerika ülkesi (Arjantin, Bahamalar, Barbados, Belize, Bolivya, Brezilya, Dominik Cumhuriyeti, Ekvador, El Salvador, Guatemala, Honduras, Jamaika, Kolombiya, Kosta Rika, Küba, Meksika, Nikaragua, Panama, Paraguay, Peru, Saint Lucia, Şili, Trinidad ve Tobago, Uruguay, Venezuela) için 1999-2013 dönemini kapsayan yıllık veriler kullanılmıştır.

Ekonomik performans göstergesi olarak doğal logaritmik formda GSYİH verileri kullanılmıştır. GSYİH, enflasyon ve işsizlik oranları verileri Dünya Bankası (WB / WDI, 2015b) veri tabanından elde edilmiştir. GSYİH EKOPER, enflasyon oranı ENFLASYON ve işsizlik oranı İŞSİZLİK biçiminde ifade edilmiştir. Politik istikrarsızlık seviyesini ifade etmek içinse literatürde sıklıkla kullanılan Banks ve Wilson (2014)'ın oluşturduğu Cross National Time Series Veri Arşivi'nden elde edilen Yurtiçi Çatışma Verileri kullanılmıştır. Endeks, bir ülkede yaşanan yurtiçi çatışmaları sekiz alt kategoriye ayırarak ölçeklemektedir. Bu kategoriler suikastlar, genel grevler, gerilla savaşları, hükümet krizleri, tasfiyeler, ayaklanmalar, devrimler ve hükümet karşıtı gösterilerdir. Her alt kategori farklı oranlarda ölçeklenerek ortalama bir endeks değeri oluşturulmuştur. Bir ülke için endeks değerinin yüksek olması, o ülke için politik istikrarsızlığın yoğun olduğu anlamına gelmektedir (Banks & Wilson, 2014). Politik istikrarsızlık endeksi, ampirik analizde POLİİST biçiminde ifade edilmiş ve çok büyük değerler içerdiği için belirli oranda küçültülerek kullanılmıştır.

Ampirik Bulgular

25 Latin Amerika ülkesinin 1999-2013 yılları arasında panel veri analizi çerçevesinde incelenmesiyle elde edilen ampirik sonuçlar Tablo 1 – Tablo 4'de özetlenmiştir.

Tablo 1: Tahmin Sonuçları

<i>EKOPER</i>	TAHMİNCİLER		
	HEKK	SE	TE
<i>ENFLASYON</i>	0.060*** (0.010)	-0.003** (0.001)	-0.003** (0.001)
<i>İŞSİZLİK</i>	-0.137*** (0.018)	-0.041*** (0.003)	-0.042*** (0.003)
<i>POLİİST</i>	0.295*** (0.047)	-0.020*** (0.007)	-0.019*** (0.007)
<i>SABİT</i>	24.677*** (0.184)	24.090*** (0.049)	24.091*** (0.287)
<i>F</i>	39.04***	138.90***	-
χ^2	-	-	2272.61***
R^2	0.239	0.876	-

*** %1, ** %5, * %10 düzeyinde anlamlılığı ifade etmektedir. Standart hatalar parantez içerisinde belirtilmiştir.

Tablo 1, EKOPER bağımlı değişkeni üzerinde, ENFLASYON, İŞSİZLİK ve POLİİST bağımsız değişkenlerinin etkilerini analiz etmektedir. HEKK tahmincisine göre bağımsız değişkenlerin %1 düzeyinde anlamlı olduğu gözlenmektedir. SE ve TE tahmincilerine göre ENFLASYON %5, İŞSİZLİK ve POLİİST %1 düzeyinde anlamlıdır. Bağımsız değişkenlerin birlikte bağımlı değişken üzerindeki anlamlılığını ifade eden F ve Wald χ^2 Testi istatistikleri üç tahminci için de %1 düzeyinde anlamlıdır.

Tablo 2: F, LM_{BP} ve Hausman Test Sonuçları

	İstatistik Değeri	Olasılık Değeri	Tahminci Tercihi
<i>F Testi</i>	1028.36	0.000	SE Tahmincisi
<i>LM_{BP} Testi</i>	1704.05	0.000	TE Tahmincisi
<i>Hausman Testi</i>	17.58	0.000	SE Tahmincisi

Tablo 2, panel veri tahmincilerine yönelik tercih testleri sonuçlarını özetlemektedir. HEKK ve SE Tahmincileri arasında tercih yapmak için kullanılan F Testi sonucuna göre uygun tahminci SE Tahmincisidir. HEKK ve TE Tahmincileri arasında tercih yapmak için kullanılan LM_{BP} Testi sonucuna göre uygun tahminci TE Tahmincisidir. SE ve TE Tahmincileri arasında tercih yapmak için kullanılan Hausman Testi sonucuna göre uygun tahminci SE Tahmincisidir. Sonuç olarak F, LM_{BP} ve Hausman Testlerine göre; oluşturulan model için uygun tahmincinin SE Tahmincisi olduğu gözlenmektedir.

Uygun tahmincinin SE Tahmincisi olduğuna karar verdikten sonra, SE Tahmincisiyle tahmin edilen modelde değişen varyans ve otokorelasyon olup olmadığının test edilmesi gerekmektedir. Bu doğrultuda Tablo 3, LM_n ve LM_p Test sonuçlarını özetlemektedir:

Tablo 3: Değişen Varyans ve Otokorelasyon Varlığının Sınanmasına İlişkin Test Sonuçları

	İstatistik Değeri	Olasılık Değeri
<i>LM_h Testi</i>	107.08	0.000
<i>LM_p Testi</i>	166.31	0.000

LM_h ve LM_p Test sonuçlarına göre modelde hem otokorelasyon hem de değişen varyans olduğu sonucuna ulaşılmıştır. Değişen varyans ve otokorelasyon içeren bir model, değişen varyans ve otokorelasyona dirençli (robust) standart hatalar elde edilecek biçimde yeniden tahmin edilmelidir (Yerdelen Tatoğlu, 2013,s.241). Arellano (1987), Froot (1989) ve Rogers (1993) SE Tahmincisi ile tahmin edilen bir modelde değişen varyans ve otokorelasyonun birlikte söz konusu olması durumunda parametre tahminlerini değiştirmeyen ancak robust standart hatalar elde etmeye olanak tanıyan bir tahminci geliştirmişlerdir. Bu çerçevede oluşturulan model, Arellano (1987), Froot (1989) ve Rogers (1993) tahmincisi ile yeniden tahmin edilmektedir. Tablo 4, SE tahmincisi için değişen varyans ve otokorelasyon varlığı altındaki tahmin sonuçlarını özetlemektedir:

Tablo 4: Değişen Varyans ve Otokorelasyon Varlığı Altında Tahmin Sonuçları

<i>EKOPER</i>	SABİT ETKİLER TAHMİNCİSİ		
	Katsayı	t İstatistiği	Olasılık Değeri
<i>ENFLASYON</i>	-0.003 (0.002)	-1.13	0.271
<i>İŞSİZLİK</i>	-0.041*** (0.006)	-6.37	0.000
<i>POLİİST</i>	-0.020** (0.007)	-2.65	0.014
<i>SABİT</i>	24.090*** (0.079)	303.51	0.000
<i>F</i>		168.99***	0.000
<i>R²</i>		0.876	

*** %1, ** %5, * %10 düzeyinde anlamlılığı ifade etmektedir. Dirençli (robust) standart hatalar parantez içerisinde belirtilmiştir.

Ekonometrik analize ilişkin nihai sonuçları özetleyen Tablo 4'de görüldüğü üzere ekonomik performans üzerinde işsizlik oranının ve politik istikrarsızlığın negatif etkisi vardır. İşsizlik oranı %1, politik istikrarsızlık endeksi ise %5 düzeyinde anlamlıdır. Enflasyon oranının ise ekonomik performansı etkilemediği gözlenmektedir. İşsizlik oranlarındaki %1'lik bir artış ekonomik performansı %0.04, politik istikrarsızlık endeksindeki %1'lik bir artış ise ekonomik performansı %0.02 azaltmaktadır. Sıklıkla politik istikrarsızlık yaşayan Latin Amerika ülkeleri için ulaşılan bu sonuç, şaşırtıcı değildir. Ulaşılan bu sonuçlar literatürdeki pek çok çalışma ile de uyumludur.

5.SONUÇ

1999-2013 yılları arasında 25 Latin Amerika ülkesinin araştırıldığı bu çalışmada, ele alınan dönemde işsizlik oranları ve politik istikrarsızlık endeksinin ekonomik performans üzerinde negatif etkisi olduğu sonucuna ulaşılmıştır. Enflasyon oranlarının ise ekonomik performans üzerinde hiçbir etkisinin olmadığı gözlenmiştir. Latin Amerika ülkelerinin sahip olduğu ekonomik-politik-toplumsal ilişkiler göz önünde bulundurulduğunda ulaşılan bu sonuçlar, sürpriz değildir. Sıklıkla askeri müdahaleler yaşan ve politik istikrar konusunda zayıf olan Latin Amerika ülkeleri için enflasyon oranlarından ziyade istihdam ve politik istikrar kavramlarına daha fazla önem verilmesi gerektiği, çalışmanın ulaştığı temel sonuçtur.

KAYNAKÇA

- Alesina, A., Özler, Ş., Roubini, N. & Swagel, P. (1996). Political instability and economic growth. *Journal of Economic Growth* 1(2), 189-211.
- Andres J. & Hernando, I. (1997). Does inflation harm economic growth? Evidence for the OECD. *NBER Working Paper*, 6062, 1-42.
- Arslan, A. (2011). Siyasi istikrarsızlık ve ekonomik performans: Türkiye örneği. *Ege Akademik Bakış*, 11(1), 73-80.
- Arellano, M. (1987). Computing robust standart errors for within group estimators. *Oxford Bulletin of Economics and Statistics*, 49(4), 431-434.
- Asteriou, D. & Hall, S.G. (2007). *Applied econometrics* (Rev. ed.). New York: Palgrave Macmillan.
- Asteriou, D. & Price, S. (2001). Political instability and economic growth: UK time series evidence. *Scottish Journal of Political Economy*, 48(4), 383-399.
- Baltagi, B.H. (2005). *Econometric analysis of panel data* (3rd edition). Chichester: John Wiley & Sons Ltd.
- Baltagi, B.H. & Li, Q. (1991). A joint test for serial correlation and random individual effects. *Statistics & Probability Letters*, 11, 277-280.
- Baltagi, B.H. & Li, Q. (1995). Testing AR(1) against MA(1) disturbances in an error component model. *Journal of Econometrics*, 68, 133-151.
- Banks, A.S. & Wilson, K.A. (2014). *Cross-national time-series data archive*. Databanks International, Jerusalem, Israel.
- Barro, R.J. (1995). Inflation and economic growth. *NBER Working Paper*, 5326, 1-22.

- Berber, M. & Artan, S. (2004). Enflasyon ve ekonomik büyüme ilişkisi: Türkiye örneği. *Turkish Economic Association Discussion Paper*, 21, 1-14.
- Beşkaya, A. & Manan, Ö. (2009). Ekonomik özgürlükler ve demokrasi ile ekonomik performans arasındaki ilişkinin zaman serileri ile analizi: Türkiye örneği. *ZKÜ, Sosyal Bilimler Dergisi*, 5(10), 47-76.
- Bittencourt, M. (2010). Inflation and economic growth in Latin America: Some panel time-series evidence. *University of Pretoria Department of Economics, Working Paper Series*, 11, 1-20.
- Black, D.C., Dowd, M.R. & Keith, K. (2001). The inflation/growth relationship: Evidence from state panel data. *Applied Economic Letters*, 8, 771-774.
- Das, A. & Loxley J. (2015). Non-linear relationship between inflation and growth in developing countries. *Economic & Political Weekly*, 1(37), 59-64.
- Demirgil, H. (2011). Politik istikrarsızlık, belirsizlik ve makroekonomi: Türkiye örneği (1970-2006). *Marmara Üniversitesi, İ.İ.B.F. Dergisi*, 31(2), 123-144.
- Easterly, W. & Levine, R. (1997). Africa's Growth Tragedy: Policies and Ethnic Divisions. *The Quarterly Journal of Economics*, 112(4), 1203-1250.
- Fischer, S. (1993). The role of macro economic factors in growth. *NBER Working Paper*, 4565, 1-36.
- Froot, K.A. (1989). Consistent covariance matrix estimation with cross-sectional dependence and heteroskedasticity in financial data. *Journal of Financial and Quantitative Analysis*, 24(3), 333-355.
- Greene, W.H. (2003). *Econometric analysis* (5th edition). New Jersey: Prentice Hall.
- Greene, W.H. (2008). *Econometric analysis* (6th edition). New Jersey: Pearson Prentice Hall.
- Gujarati, D.N. & Porter, D.C. (2009). *Basic econometrics* (5th edition). New York: McGraw-Hill Irwin.
- Gür, T.H. & Akbulut, H. (2012). Gelişmekte olan ülkelerde politik istikrarın ekonomik büyüme üzerine etkisi. *Sosyo-Ekonomi*, 1, 281-300.
- Güran, M.C. & Tosun, M.U. (2005). Türkiye ekonomisinin makro ekonomik performansı: 1951-2003 dönemi için parametrik olmayan bir ölçüm. *Ankara Üniversitesi SBF Dergisi*, 60(4), 89-115.
- Hill, R.C., Griffiths, W.E. & Lim, G.C. (2011). *Principles of econometrics* (4th edition). USA: John Wiley & Sons Inc.

- Hoon H.T. & Phelps, E.S. (1997). Growth, wealth and the natural rate: Is Europe's jobs crisis a growth crisis? *European Economic Review*, 41, 549-557.
- Jong-A-Pin, R. (2009). On the measurement of political instability and its impact on economic growth. *European Journal of Political Economy*, 25, 15-29.
- Kanca, O.C. (2012). Türkiye'de işsizlik ve iktisadi büyüme arasındaki nedenselliğin ampirik bir analizi. *Ç.Ü. Sosyal Bilimler Enstitüsü Dergisi*, 21(2), 1-18.
- Karahan, H. & Karagöl, E.T. (2014). Ekonomik performansın temel taşı: Siyasi istikrar. *Seta Perspektif*, 41, 1-5.
- Moesen, W. & Cherchye, L. (1998). The macroeconomic performance of nations measurement and perception. *Catholic University of Leuven, Center for Economic Studies, Discussion Paper Series*, 98(22), 1-23.
- Muscattelli, V.A. & Tirelli P. (2001). Unemployment and growth: Some empirical evidence from structural time series models. *Journal of Applied Econometrics*, 33, 1083-1088.
- OECD (1987). *Economic Outlook*, 41. Paris.
- OECD (2015). *Economic Outlook*, 1. Paris.
- Okun, A.M. (1962). Potential GNP: Its Measurement and Significance. *American Statistical Association Proceedings of the Business and Economic Statistics Section*, 98-104.
- Rogers, W.H. (1993). Regression standard errors in clustered samples. *Stata Technical Bulletin*, 13, 19-23.
- Şanlısoy, S. & Kök, R. (2010). Politik istikrarsızlık-Ekonomik büyüme ilişkisi: Türkiye örneği (1987- 2006). *Dokuz Eylül Üniversitesi İktisadi ve İdari Bilimler Fakültesi Dergisi*, 25(1), 101-125.
- Villaverde, J. & Maza, A. (2009). The robustness of Okun's law in Spain, 1980-2004 Regional evidence. *Journal of Policy Modelling*, 31, 289-297.
- Yerdelen Tatoğlu, F. (2013). *Panel veri ekonometrisi, stata uygulamalı* (2.bs.). İstanbul: Beta Basım.
- World Bank (2015a). *Latin America & Caribbean*. Retrieved August 8, 2015, from <http://data.worldbank.org/region/LAC>
- World Bank (2015b). *World development indicators*. Retrieved August 8, 2015, from <http://data.worldbank.org/indicator>

Avrupa Birliği ve Türkiye’de Kurumların İşgücü Piyasalarına Etkileri¹*Effects of Institutions on the Labour Markets in European Union and Turkey*H.Bilgehan YAVUZ²**ÖZET**

Bu makalede, Avrupa Birliği ve Türkiye’de işgücü piyasalarını etkileyen kurumlar tespit edilerek, bu kurumların işsizliğe etkisi test edilmiştir. Kurumsal İktisadın öngörülerini kullanarak yapılan çalışmada panel veri analizi kullanılmıştır. İşsizliğin bağımsız değişken olarak test edildiği analizde, kurumsal iktisat bakış açısıyla tespit edilen üç makro ekonomik değişken ve beş kurumsal değişkenin işsizliğe etkileri ölçülmeye çalışılmıştır. Çalışmada, 2003-2013 dönemi için seçilmiş 22 Avrupa ülkesi ve Türkiye’ye ilişkin veriler kullanılmıştır. Yapılan analiz sonuçlarına göre, değişkenlerden bazılarının işsizliğe etkisi istatistiksel olarak anlamlı iken, bazı değişkenlerin istatistiksel olarak anlamlı bir ilişki ortaya koymadığı ancak kurumsal etkileşimin, çıktıları değiştirdiği sonucu ortaya çıkmıştır.

Anahtar Kelimeler: Avrupa Birliği, Türkiye, panel veri analizi, kurumsal değişim, işsizlik

ABSTRACT

In this essay, it is identified and tested what are the institutions effecting the labour markets in European Union and Turkey and affects of these institution to unemployment. In the study done by the use of providences of institutional economics, panel data analysis has been used. In the analysis, which the unemployment has been tested as an independent variable, three macro economic and five institutional variables impacts on unemployment, which were determined by the institutional point of view, have been tried to be measured. In the study, the data related to twenty two European countries and Turkey which were chosen for 2003-2013 period has been used. According to the results of the analysis, it’s been found out that some variables of the impact of unemployment are statistically significant, on the other hand, others doesn’t make any meaningful relation. However, institutional interaction has changed the output.

Keywords: European Union, Turkey, panel data analysis, institutional changes, unemployment

¹ Çukurova Üniversitesi Sosyal Bilimler Enstitüsü İktisat Anabilim Dalı Doktora tez çalışmasından üretilmiştir. Tüm hata ve eksiklikler bana ait olmak üzere, çalışmanın danışmanlığını yürüten Sn. Prof. Dr. M. Fatih CİN’e teşekkürü borç bilirim.

² Dr., bilgehanyavuz@hotmail.com

1. Giriş

Kurumlar; her türlü ekonomik, sosyal ve toplumsal ilişkiyi düzenleyen aile, sendika, firma, dil, trafik kuralları, görgü kuralları, yasal mevzuatlar, örfler, gelenekler, yazılı ve yazılı olmayan kuralları ifade eden, toplumun çoğunluğu tarafından kabul görmüş yaygın düşünce alışkanlıkları olarak tanımlanabilir.

Her türlü ekonomik aktiviteyi şekillendiren kurumlar, istihdam ve işsizlik üzerinde de önemli etkiye sahiptir. Bu etki ekonomik olmanın yanı sıra sosyal maliyetler açısından da geçerlidir. Sanayi devrimi ile birlikte hemen bütün ülkelerde görülen işsizlik olgusu, gelişmiş ve gelişmekte olan bütün ülkelerin en önemli sosyal problemlerinden birini oluşturmaktadır. Bu ülkelerde teknolojiye yaşanan gelişmeler ve hızlı nüfus artışıyla birlikte sürekli artan işgücüne yeterli istihdam olanakları sağlamak, ülkelerin ciddi problemlerinin başında gelmektedir.

İşsizlik problemi, yarattığı sosyal sorunlar sebebiyle en fazla gelişmiş ve gelişmekte olan ülkelerde hissedilen bir sorun olarak karşımıza çıkar. Bu sorunlarla baş edebilmek için 1970-1980’ler boyunca ekonomik aktivitede yaşanan değişiklikler, pek çok Avrupa ülkesinde önemli yapısal değişikliklere gidilmesine sebep olmuştur. Bu yapısal değişiklikler, her ülke için ayrı uygulama alanı bulduğundan, ülkelerin istihdam performansları da farklı olmuştur.

Kurumların gelişiminin iktisadın ana inceleme konularından biri haline gelmesi Kurumsal İktisat yazını ile olmuştur. Kurumsal iktisadın, Neoklasik ve Keynesyen İktisatta olduğu gibi istihdamla ilgili belirli bir teorisi bulunmamaktadır. Ekonomik aktivitenin diğer alanlarında olduğu gibi iş ilişkilerinin de kurumsal yapılarla ve kurumsal işleyiş ile düzenleneceğini ileri sürer. Bu kurumlar yeni istihdam alanları oluşturmanın yanında, işçilerin vasıflandırılması, yönlendirilme gibi konuları da içerir.

Çalışma bu kısa giriş dışında beş bölümden meydana gelmektedir. İkinci bölümde Avrupa Birliđi ülkelerindeki işgücü piyasalarının, üçüncü bölümde ise Türkiye işgücü piyasalarının özelliklerine değinilmiştir. Dördüncü bölümde işgücü piyasalarını etkileyen kurumlar tespit edilerek, beşinci bölümde bu kurumların işgücü piyasalarına etkilerinin ekonometrik analizi yapılmıştır.

2. Avrupa Birliđi İşgücü Piyasalarının Özellikleri

İşsizlik Avrupa’da, tarihsel olarak genelde düşük seviyelerde seyretmiştir. II. Dünya Savaşından sonra Avrupa’daki yeniden yapılanma süreci, sermaye kıtlığı ve sürekli artan işgücü talebi koşullarında gerçekleşmiştir (Eichengreen & Iversen, 2013). Savaş sonrası dönemde düşük olarak seyreden işsizlik, 1970’lerde artmaya başlamış ve 1990’larda pek çok Avrupa ülkesinde işsizlikte keskin artışlar olmuştur. Bununla beraber uygulanan sıkı para politikaları ile enflasyon kontrol altına alınmış ve faiz oranlarındaki düşmeyle birlikte yatırımlar artıp işsizlik azalma trendine girmiştir.

Kısaca řoklardan sonra işsizlik artmış, genişleyici maliye politikaları ile bu artış kontrol altına alınmıştır (Avila & Usabiaga, 2009).

2000’li yıllara gelindiğinde, Avrupa’da işsizlik oranları, sabit enflasyon ile beraber seyretmiştir. Alışılmış olandan yüksek bir enflasyonun varlığı, Avrupa Merkez Bankasının enflasyonu hedefleyen politikalar uygulamasına ve işsizliği göz ardı etmesine sebep olmuştur. Blanchard (2006) çalışmasında; bu politikayı yanlış bularak yükselen işsizliđin doğal oranını düşürmek için öncelikle işgücü piyasası reformları yapılması gerektiğini vurgulamıştır. Bugün hala Avrupa’da işsizlik yüksek değerlerde ve ülkeler arasında heterojen bir yapıdadır (Blanchard, 2006).

Avrupa Birliđi, üye ülkelerin veya aday ülkelerin istihdamla ilgili ulaşılmaması gereken hedeflerini belirttiđi Avrupa İstihdam Stratejisinde; işsizlik stratejisi gibi pasif tedbirlerin yanında, niteliksiz işgücünün niteliklerinin artırılması, nitelikli işgücünün ise günün koşullarına uygun olarak güncellenmesi amacını güden aktif planların ön plana çıkarılması amaçlanmaktadır. Avrupa İstihdam Stratejisini oluşturan dört önemli politika hedefi vardır (Kaya, 2014). Bu hedefleri Tablo 1 ile gösterecek olursak;

Tablo 1: *Avrupa İstihdam Stratejisi Politika Hedefleri*

No	Politika Hedefi	Politika Kapsamı
1	İstihdam Edilebilirlik	Eđitim ve danışmanlık hizmetleri yoluyla iş arayanların yeteneklerinin artırılması çalışmalarını kapsar.
2	Giriřimcilik	Kendi işini kuracak kişilerin desteklenmesi ve KOBİ’lerin önündeki engellerin kaldırılması konularında çalışma yapılmasını önerir.
3	Uygulanabilirlik	Sürekli deđişip gelişen iş piyasası şartlarına, çalışanların ve şirketlerin kendilerini uydurması için gerekli önlemlerin alınmasını ister.
4	Eşit Fırsatlar	Özürlüler, kadınlar gibi dezavantajlı grupların işgücü piyasasına entegrasyonun için tedbirler öngörür.

Kaynak: Yazarın kendi sonuçlarıdır.

Avrupa İstihdam Stratejisi ile Avrupa ölçeğinde yenilikçi ve niteliksel bir istihdam stratejisi önerilmiştir. Bu kapsamda çalışma süreleri yeniden düzenlenmiş ve istihdam çeşitliliğinin artırılması için işgücü piyasalarının büyütülüp, istihdam yoğunluğunun artırılması gerektiđi belirtilmiştir. Bu amaçla; ev işleri, eğitim, kültür hayatı ya da kazançlı mesleki faaliyetlere daha fazla zaman ayırmak için çalışma saatlerine esneklik kazandırılması planlanmıştır. Bunun dışında eğitim ve istihdam arasındaki geçişler için kurumsal düzenlemeler yapılarak işgücü piyasalarına geçiři ya da hareketliliđi teşvik etmek gerekmektedir (Gunter, 1998).

Avrupa işgücü piyasalarının özelliklerine baktığımızda: İstihdamın korunması ve işsizlere belirli bir yaşam standardını sağlayacak gelirin verilmesi açısından bazı

kurumsal katılıklara sahip olduđu görülmektedir. Bu Kurumsal katılıklar Avrupa’da yaşanan yüksek işsizlik oranlarının da en önemli sebebi olarak gösterilmektedir. Özellikle benzer özelliklere sahip olan ABD işgücü piyasaları ile yapılan karşılaştırmalarda, kurumsal yapıdaki bu katılık sebebiyle Avrupa’da işsizliđin daha yüksek olduđu söylenmektedir. Bunun yanı sıra, bir diđer kurumsal katılık sebebi olan yüksek miktardaki işsizlik yardımları, Avrupa’da işsizliđin uzun dönemler boyunca görülmesine sebep olduđu belirtilmektedir. İşgücü piyasaları bu açıdan incelendiğinde hangi kurumsal yapıların mutlak katılıklara yol açtıđının tespit edilmesi gerekmektedir (Nickell, 1997).

Siebert (1997) çalışmasında Avrupa işgücü piyasalarını etkileyen dört farklı unsurun varlıđından söz etmiştir. Bunlar:

1. Piyasa süreçlerinin Avrupa’ya özgü nitelikleri,
2. Etkili düzenleyici kurallar ve kurumlar,
3. Hukuk sistemi ve ücret oluşum süreçleri,
4. İşsizlik ödemesi sistemidir.

3. Türkiye İşgücü Piyasalarının Özellikleri

Küreselleşme süreci ile birlikte uygulanan ekonomik politikalar, özelleştirmeler, sendikaların güçsüzleşmesi, çokuluslu şirketlerin ucuz işgücü arayışında olması gibi etmenler yüzünden, tüm dünyada işsizlik oldukça önemli bir sorun haline gelmiştir. Türkiye’de bu gelişmelerden etkilenmiş ve (Güney, 2010) Türkiye’ye özgü, hızlı nüfus artışı ve şehirleşme hareketleriyle birlikte işsizlik ve işsizlerin istihdamı sorunu, 1950’li yıllardan itibaren Türkiye’nin de gündeminde yer almaya başlamıştır (Yılmaz, 2005).

Türkiye’de işsizlik olgusu, ekonomik ve sosyal yapıdaki deđişiminin başlangıcı sayılan 1980 yılından sonra hissedilen en temel problemlerin başında gelmiştir. 1980 sonrası Türkiye “ithal ikameci sanayileşme politikalarını” terk ederek “ihracata dayalı büyüme stratejisini” ortaya koymuştur. 1980’lerde artan ihracat, genelde kurulu kapasitenin yüksek oranda kullanımı ve iç talebin bastırılması yoluyla sağlanmış, bu nedenle istihdam yaratıcı ve işsizliđi azaltıcı rolü kısıtlı kalmıştır (Bekirođlu, 2010).

1980’li yıllarda, henüz tarım toplumundan sanayi toplumuna geçiş süreci tamamlanamamışken hizmetler sektörüne dođru yapısal dönüşüm sağlama çabaları, Türkiye’nin sanayileşme anlamında geri kalmasında etkili olmuştur. Bu durumunun en önemli etkisinin gelir dağılımı üzerinde hissedildiđi söylenebilir. Gelir dağılımında yaşanan eşitsizlikler orta ve alt sınıfların güçlenmesini, dolayısıyla istihdamın lokomotif olabilecek hizmet sektörünün gelişimini de engellemiştir (Sapançalı, 2007). Gelir dağılımı eşitsizliđi ile asgari ücretlerde yaşanan düşüşler, 1980’li yıllarda ihracatın

artmasını sağlamıştır. Bu ihracat artışının önemli bir kısmı gelirlerdeki azalma ile beraber iç talebin azalması ile mümkün olmuştur. Ancak gelir daraltıcı bu politikalar ile iç talebin azalması aynı zamanda yatırım ve üretimin de azalarak işsizliđin artmasına sebep olmuştur (Onaran, 2007).

Türkiye İşgücü piyasalarında, Nüfusun işgücü durumu ile ilgili aşağıda verilen Tablo 2 incelendiğinde; son on yılda Türkiye’nin nüfusu ortalama yıllık binde 14 oranında artarak 2013 yılı sonu itibariyle 76.667.864’e ulaştığı görülür. Toplam nüfusun % 73’ ü 15 yaş üstü olup bu nüfusun % 48’i işgücünü oluşturmaktadır. Nüfus ve aktif nüfusta gerçekleşen artış, işgücü ve istihdama aynı oranda yansımamıştır.

Tablo 2: Türkiye İşgücü Piyasalarında, Nüfusun İşgücü Durumu

Yıllar	Toplam Nüf.	15 üstü vastaki nüfus	İşgücü	İstihdam edilenler	İşsiz	İşgücünde olmayan ..c	İşgücüne katılma (%)	İşsizlik (%)	Tarım dışı işsizlik (%)	İstihdam (%)
2005		48.356	21.691	19.633	2.058	26.665	44,9	9,5	12,0	40,6
2006		49.275	21.913	19.933	1.980	27.362	44,5	9,0	11,1	40,5
2007	70.286	50.177	22.253	20.209	2.044	27.925	44,3	9,2	11,2	40,3
2008	71.517	50.982	22.899	20.604	2.295	28.083	44,9	10,0	12,3	40,4
2009	72.561	51.833	23.710	20.615	3.095	28.124	45,7	13,1	16,0	39,8
2010	73.722	52.904	24.594	21.858	2.737	28.310	46,5	11,1	13,7	41,3
2011	74.724	53.985	25.594	23.266	2.328	28.391	47,4	9,1	11,3	43,1
2012	75.627	54.964	26.141	23.937	2.204	28.820	47,6	8,4	10,3	43,6
2013	76.667	55.982	27.046	24.601	2.445	28.936	48,3	9,0	10,9	43,9

Kaynak: TUIK (Bin kişi)

Türkiye işgücü piyasalarının en belirgin sorunları arasında; tarımsal istihdamın orantısız büyüklüğü, işgücü arzı fazlalığı, işgücünün çoğunluğunun genç ve nitelsiz oluşu, işgücü piyasalarının kurumsallaşamaması, toplam istihdam içinde ücretlilerin sayısının az olması gibi sorunlar sayılabilir (Güney, 2009).

Türkiye işgücü piyasalarında üç önemli özellik dikkat çekmektedir. Bu özelliklerden bir tanesi, 1950’lerden sonra başlayan kırsal kesimden kente göç sürecinin hala devam etmesidir. Kırsaldan kentlere geçiş, tarımdan tarım dışı sektörlerle işgücü göçünü ve tarım dışı sektörlerde yüksek miktarda istihdam yaratılması gerekliliđini beraberinde getirmektedir. İkinci özellik: Kırsaldan kentlere göç süreci, eğitimsiz ve dolayısıyla verimsiz bir kent nüfusunun oluşmasına yol açmıştır. Üçüncü özellik: Kadınların işgücüne katılım oranının düşük olmasıdır. Bütün bunlar birlikte değerlendirildiğinde Türkiye’nin demografik özelliklerinin yapısal olan işsizlik sorununu derinleştirdiđi ileri sürülmüştür (Ay, 2012).

Türkiye’de bilinçli ve yaygın bir işsizlikle mücadele programı uzun yıllar boyunca uygulanamamıştır. İstihdam politikaları, ilk olarak kalkınma programları içerisinde yer almış olmasına rağmen uygulama alanı bulamamış ve plan metinlerinde yer almaktan öteye gidememiştir. Son yıllarda AB’ye üyelik sürecinin de etkisiyle ülkemizin aktif istihdam politikalarına daha yoğun biçimde yönelmiş olmasıyla beraber, ülkemizde planlı dönemden bugüne kadar kapsamlı bir ulusal istihdam politikasının belirlenemediđi ve hayata geçirilemediđi söylenebilir. Bu kapsamda İSKUR 2002 yılı mali programlaması kapsamında, Aktif işgücü Piyasası Programları Projesini uygulamaya başlayarak Avrupa İstihdam Stratejisi’ne uygun etkin istihdam tedbirleri ile hizmetlerin planlanması, geliştirilmesi ve uygulanması konularında çalışmalar yapmaya başlamıştır (Eser & Terzi, 2008).

4. İşgücü Piyasalarını Etkileyen Kurumlar

İşgücü piyasası kurumları ile ekonomik performans arasında güçlü bir bağlantı vardır. Ülkelerin işgücü piyasası performanslarının farklı olmasının sebebi kurumsal yapılarıdır. Özellikle işgücü piyasası esnekliđini sağlayan kurumlar, piyasaların işleyişinde farklılık doğurmaktadır (Taymaz & Özer, 2004).

Kurumsal düzenlemeler üç şekilde işgücü piyasalarını etkiler. Birincisi: Ücretleri arttırarak işgücü talebini zayıflatır, İkincisi: İşgücü arzını çarpıtır, Üçüncüsü ise; piyasa mekanizmasının dengeleme fonksiyonunu bozar. Bu etkiler genellikle birbirleriyle ilişkilidir. Çünkü tek bir kurumsal düzenlemenin genellikle önemli bir etkisi yoktur. Ancak kurumsal düzenlemeler birbiriyle etkileşim içerisinde anlamlı sonuçlar doğurur. Örneğin işçiyi işten çıkarmayı zorlaştıran bir düzenleme yapılırsa, firma krize girdiğinde işçi çıkaramayacak ve ücret düşüşü yapamayacağından işler daha da zor olacaktır (Siebert, 1997).

İşsizliđin önemli belirleyicilerinden biri olan İşgücü piyasası kurumlarının ülkeler çapında farklılıklarını veya miktarlarını ölçmek zordur. Bunun için pek çok çalışmada sabit etkiler üzerinde durulmuştur (Daveri, Tabellini, Bentolilo & Huizingo, 2000). Kurumsal farklılıklar ülkeler arası işsizlik farklarını açıklarken dönemlerarası işsizlik farklarını açıklamada yetersiz kalmaktadır. Yüksek işsizliđi, sadece kurumlara dayanılarak açıklamaya çalışan modellerde deneysel bir problemin varlığından bahsedilir. Çünkü işsizliđe sebep olan veya herhangi bir ekonomik şok sonrası meydana

gelen işsizliđi tedavi edemeyen kurumların pek çođu, işsizliđin düşük olduđu zamanlarda da mevcut olduđu belirtilmiştir. Bu mevcudiyet kurumlarla ilgili kesin yargılara varılmasını engeller. Çünkü hem iyi sonuçların alındıđı dönemlerde, hem de kötü sonuçların alındıđı dönemlerdeki kurumların aynı olması çelişkili bir durumdur. Tam bu noktada karşımıza kurumlar arası etkileşim kavramı çıkmaktadır (Nickell, Nunziata & Ochell, 2005).

İşgücü piyasası kurumları ile ilgili belirtilmesi gereken bir diđer özellik de; genellikle çok boyutlu olarak tanımlanmış olmalarıdır. Şöyle ki; işgücü piyasası kurumları, sadece istihdamı etkilemez, bu kurumların işleyişi veya etkileşimleri, işgücü piyasalarının yanı sıra sermayeyi, ücretleri, faiz oranlarını ve bunlara bađlı diđer ekonomik deđişkenleri de etkiler (Blanchard, 2006).

Burada işgücü piyasalarını etkileyen iki temel deđişkendten bahsedebiliriz. Bunlardan birincisi: Makro ekonomik deđişkenlerdir. Oluşturduğumuz modelde işsizliđi etkileyen makro ekonomik deđişkenler olarak; enflasyon oranı (CPI), verimlilik (PRO), Büyüme (GRW), ve çıktı boşluđu (GAP) bağımsız deđişken olarak alınmıştır. İkincisi ise; kurumsal faktörlerdir. Burada genelde; yasalar, anayasalar, tüzükler, yönetmelikler, anlaşmalar, davranış kalıpları, alışkanlıklar, toplumsal ritüeller, inanç sistemleri, ahlak kuralları, piyasa, dil, para birimi, organizasyonel yapılar gibi ekonomik aktiviteyi düzenleyen her türlü yapı kurum olarak tanımlanmıştır.

Özel olarak literatür taramasında gözlemlenen işsizliđi veya istihdamı etkileyen kurumlar olarak: İstihdamı Koruma Mevzuatı (EPL), Asgari Ücret Düzeyi (MIN WAGE), Ücret Belirlenme Süreçleri, Sendikaların Yođunluđu (UNION), Sendikaların Pazarlık Sürecindeki Koordinasyonu, Ücret Belirleme Süreçlerinin Merkezileşmesi, Toplu Pazarlık, Toplu Sözleşme, Ücret Vergilendirme Sistemleri (TAX), Aktif İşgücü Piyasası Politikaları (ALMP), Pasif İşgücü Piyasası Politikaları, İşsizlik Yardımlarının Varlıđı, İşsizlik Yardımlarının Miktarı (RR), İşsizlik Yardımlarının Süresi, Toplam Talep Şokları, Para Ve Maliye Politikaları, Faiz Oranı belirlenmiştir.

Ekonometrik uygulama bölümünde yukarıda sayılan deđişkenlerden, çalışmada etkisi test edilmiş olanlar hakkında kısaca bilgi verilecektir.

5. Belirlenen Deđişkenlerin İşsizliđe Etkisinin Ekonometrik Analizi

Çalışmada kullanılan model Scarpetto (1996) çalışmasında tanımlanan modeldir. Panel veri analizi uygulanmış olan modelimizde açıklayıcı deđişkenler eklenerek aşıđıdaki indirgenmiş biçimdeki denklem tahmin edilmiştir.

$$U_{it} = \mu_0 + \mu_i X_{it} + \beta_i Z_{it} + \varepsilon_{it}$$

Burada:

U_{it} ; i ülkesinde, t zamanda ölçülen işsizliđi göstermek üzere,

X_{it} ; Enflasyon (CPI), çıktı boşluđu (GAP), verimlilik (PRO), gibi makro ekonomik deđişkenler vektörünü,

Z_{it} ise; İstihdamı Koruma Mevzuatı (Employment Protection Legislation-EPL), Aktif İşgücü Piyasası Politikaları (Active Labour Market Policy-ALMP), Sendikal yoğunluk (Union Density-UNION), Ücret üzerinden alınan vergiler (Tax Wage-TAX), İşsizlik yardımları (Yerine koyma oranı, Replecement Rate-RR) gibi kurumsal faktörleri ifade etmektedir.

Çalışmada; Avusturya, Belçika, Çek Cumhuriyeti, Danimarka, Estonya, Finlandiya, Fransa, Almanya, Yunanistan, Macaristan, İrlanda, İtalya, Hollanda, Norveç, Polonya, Portekiz, Slovakya, Slovenya, İspanya, İsveç, İsviçre, İngiltere ve Türkiye’ye ait 2003-2013 dönemi verileri kullanılarak bu yedi kurumsal faktörün istihdam üzerindeki etkileri panel veri analizi ile test edilmiştir.

Modelde belirtilen deđişkenlere ilişkin verilerden; Ücret üzerinden alınan vergiler (TAX) deđişkenine ait veriler EUROSTAT veri tabanından, İstihdamı Koruma Mevzuatı (EPL), Aktif İşgücü Piyasası Politikaları (ALMP), Sendikal Yoğunluk (UNION) ve İşsizlik Yardımları (RR), Enflasyon (CPI), Çıktı Boşluđu (GAP) ve Verimlilik (PRO) deđişkenlerine ait veriler OECDSTAT veri tabanından, Türkiye’ye ilişkin ALMP verileri ise İŞKUR istatistik raporlarından alınmıştır.

Deđişkenlere ilişkin açıklamalar

Enflasyon¹ (CPI): Enflasyon veya ücret-fiyat hareketleri işsizliđi etkileyen önemli bir deđişkendir. Makro ekonomik performansı en iyi ölçen iki deđişken enflasyon ve işsizliktir. Phillips eğrisi ilişkisinde enflasyon ile işsizlik arasında bir deđiş tokuş bulunmaktadır. Bu ilişkiye göre enflasyon deđişkeninin katsayısının negatif çıkması beklenmektedir.

Çıktı Boşluđu² (GAP): Verilerin alındığı OECDSTAT veri tabanında yapılan tanımlamaya göre; Çıktı boşluđu = Cari GSYİH - Potansiyel GSYİH dir. Cari GSYİH’nin artması, ekonominin büyüdüđü anlamına gelerek çıktı boşluđunu arttıracaktır. Çıktı boşluđunun artması, ekonominin büyüdüđü dolayısıyla işsizliđin azaldığı anlamına gelecektir. Ekonomik büyüme ile işsizlik arasındaki ilişki “Okun Yasası” ile ortaya koyulmaktadır. Ancak literatür taramasında, istihdam edilebilir nüfusun, GSYİH büyümesinden daha fazla arttığı görülmektedir. Ayrıca özellikle gelişmekte olan ülkelerde üretim arttırılmadan ya da ihracata yönelik sektörlerde gelişme sağlanmadan,

¹ Beklentilerle uyumlu bir şekilde Auteiro (2007) ve Nickell (1997) çalışmalarında negatif katsayı bulmuştur.

² Beklentilerle uyumlu bir şekilde Lehman ve Muravyev (2012), Freeman ve Nickell (1988), Daveri ve diđerleri (2000), Bassanini ve Duval (2009) çalışmalarında negatif katsayı bulmuştur.

finansal sektörlerin etkisiyle büyüme sağlandığı, bu büyümenin de istihdam artışı yaratmadığı sorunsalı görülmektedir. Böyle bir büyüme, yeni iş imkanları yaratmadığı için, istihdam üzerinde olumlu bir katkısı da olmamaktadır. Çalışmada çıktı boşluğu değişkeninin negatif katsayı alması beklenmektedir.

Verimlilik³ (PRO): Mevcut işgücünün saat başı çalışması ile elde edilen çıktıyı göstermektedir. İşgücü üretim sürecinde önemli bir girdi olarak kabul edilmektedir. İşgücünün verimliliğinin yüksek olması, firmalar açısından, daha az işgücü talebi ve daha düşük maliyetle daha fazla ürün üretmek olacaktır. Verimlilik arttıkça işgücü talebi azalacağından işsizliğin artması beklenmektedir. Ancak verimliliğin artması aynı zamanda ekonomik büyüme sağlayacağından yeni iş imkanları açılacak ve uzun dönemde işsizlik azalacaktır. Bu nedenle negatif katsayı beklenmektedir.

İstihdamı Koruma Mevzuatı⁴ (EPL): OECD tarafından çalışanların işe alınması ve işten çıkarılmasını belirleyen, toplu iş sözleşmeleri, içtihatlar, yönetmelikler, yetkililerin karar ve tavsiyeleri gibi yasal mevzuat incelenerek işe alma-çıkarma maliyetleri belirlenmiştir. Her yıl Ocak ayında, yukarıda belirtilen konularda, 21 öge dikkate alınarak açıklanan endekste; işten çıkarma konusundaki prosedür engelleri, ihbar süresi ve kıdem tazminatı ile bireysel ve toplu işten çıkarma zorlukları dikkate alınır. OECD tarafından bu konuda iki endeks belirlenmiştir. EPL endeks 1; düzenli ve geçici sözleşme koşullarını dikkate alırken, EPL endeks 2; toplu işten çıkarma prosedürlerini de ekleyerek bulunur. 1 ile 6 arasında değer verilerek bulunan endekste; yüksek değer sıkı korumayı, düşük değer ise, esnek mevzuat ile liberal işe alma ve çıkarma prosedürlerini ifade eder. Çalışmada EPL değişkeninin katsayısının negatif çıkması beklenmektedir.

Aktif İşgücü Piyasası Politikaları⁵ (ALMP): ALMP programları; iş bulmayı kolaylaştırarak verimliliği ve dolayısıyla işçilerin potansiyel kazançlarını arttıracak programlardır. Bu programlar kapsamında: Yerleştirmeyi ve fayda yönetimini sağlayan kamu istihdam hizmetleri, çıraklık eğitimini de kapsayan her türlü meslek edindiren ve geliştiren eğitim faaliyeti, istihdam teşvikleri, doğrudan iş yaratma teşvikleri, işsizlik yardımları ve erken emeklilik programları gibi programları içerir. Bu programlar kapsamında hazırlanan veri tabanında çalışma alanımızdaki bütün ülkelere ait harcama verileri bulunmaktadır. Ancak Türkiye için ALMP harcamaları verileri bulunmadığından, bu veriyi; ALMP programlarından faydalanan kişi sayısının/Toplam işgücüne oranı olarak alınmış bulunmaktadır. Diğer bir deyişle mevcut işgücünün % kaçının kurumsal eğitim, işyeri eğitimi, alternatif çıraklık eğitimi, meslek edindirme kursları gibi ALMP faaliyetlerine katıldığı ile ilgili bir veri kullanılmıştır. Teorik

³ Beklentilerle uyumlu bir şekilde Auteiro (2007), Nickell ve diğerleri (2005) çalışmalarında negatif katsayı bulmuştur.

⁴ Beklentilerle uyumlu bir şekilde Auteiro (2007), Nickell (1997), Daveri ve diğerleri (2000), Fitoussi ve diğerleri (2000), Bassanini ve Duval (2009) çalışmalarında negatif katsayı bulmuştur.

⁵ Beklentilerle uyumlu bir şekilde Lehman ve Muravyev (2012), Fialova ve Schneider (2008), Nickell (1997), Scarpetto (1996) çalışmalarında katsayı negatif bulunmuştur.

çalışmalarla uyumlu bir şekilde çalışmada ALMP deđişkeni ile ilgili negatif katsayı beklenmektedir.

Sendika Yođunluđu⁶ (UNION): Çalışan işçilerin ne kadarlık kısmının sendikalara üye olduğunu gösteren bir orandır. Bu veride bazı ülkelerde sendika yođunluđu çok düşük olsa bile, yapılan pazarlık sonucunda oluşan ücretten bütün işçilerin faydalanması söz konusudur. Çalışmada UNION deđişkeni ile ilgili pozitif katsayı beklenmektedir.

Ücret üzerinden alınan vergi⁷ (TAX): İşçilerin çalışma sonucu elde ettiđi brüt ücretten, vergi ve sosyal güvenlik primi çalışan katkısı çıkarılıp aile yardımı eklenerek net ücret bulunur. İşçilerin net ücretleri bireysel durumlarına bađlıdır. Evli olup olmaması, kaç çocuklu olduđu gibi. Çalışmada kullanılan veri brüt ücret üzerinden alınan vergi oranıdır. Ulusal düzeyde alınan veriler, EUROSTAT veri tabanında Euro’ya dönüştürülmüş ve fiyat farklılıklarını gidermek için satın alma gücü paritesi kullanılmıştır. Bu deđişken ile ilgili pozitif katsayı beklenmektedir.

İşsizlik yardımları⁸ (Yerine koyma oranı) (RR): Bu veri tam saatlik çalışan bir işçinin elde ettiđi gelirin ne kadarlık kısmının işsiz kaldıktan sonra da elde edildiđini gösteren bir oran olarak alınmıştır. Bu oran çalışma teşviđi açısından oldukça önemlidir. Çalışmama durumunda elde edilen gelir, çalışma durumunda elde edilen gelire ne kadar yakınsa, işçiler çalışmamayı tercih edecektir. Bunun gibi bir hanede birden fazla kişinin çalışması durumunda vergi oranlarının belli bir sınırı aşması veya çocuklu ailelerin çocuk bakım maliyetlerinin yükselmesi, istihdam engelleri olarak görülmektedir. RR deđişkeninin katsayısı pozitif olarak beklenmektedir.

Makro ekonomik ve kurumsal deđişkenler kullanılarak oluşturulan numaralı denklem ile belirlenen model, bu deđişkenlerin ülkelere etkilerinin ölçülmesi için test edilmiştir. Bu amaçla öncelikle enflasyon, büyüme ve verimlilik gibi makro ekonomik deđişkenler kullanılarak model en basit biçimde oluşturulmuş ve EKK tahminleri yapılmıştır. Daha sonra belirlenen her bir kurumsal faktör modele eklenerek, modelin yeni tanımlamaları test edilmiştir.

Modeli tahmin ederken sabit etkiler modelinin mi rassal etkiler modelinin mi geçerli olduğunu anlamak üzere yapılan Hausman testi sonuca göre geçerli model olarak sabit etkiler modeli seçilmiştir. Modelin tahmininden elde edilen sonuçlar aşıđıdaki gibidir:

⁶ Beklentilerle uyumlu bir şekilde Lehman ve Muravyev (2012), Freeman ve Nickell (1988), Nickell (1997), Nickell ve diđerleri (2005), Blanchard ve Wolfers (2000), Fitoussi ve diđerleri (2000), Scarpetto (1996), Stockhammer ve Klör (2010) çalışmalarında katsayı pozitif bulunmuştur.

⁷ Beklentilerle uyumlu bir şekilde Lehman ve Muravyev (2012), Fialova ve Schneider (2008), Auteiro (2007), Freeman ve Nickell (1988), Nickell (1997), Nickell ve diđerleri (2005), Blanchard ve Wolfers (2000), Daveri ve diđerleri (2000), Stockhammer ve Klör (2010), Bassanini ve Duval (2009) çalışmalarında pozitif katsayı bulunmuştur.

⁸ Beklentilerle uyumlu bir şekilde Fialova ve Schneider (2008), Auteiro (2007), Nickell (1997), Blanchard ve Wolfers (2000), Fitoussi ve diđerleri (2000), Scarpetto (1996), Stockhammer ve Klör (2010), Bassanini ve Duval (2009) çalışmalarında pozitif katsayı bulunmuştur.

Tablo 2: Sabit Etkiler Modeli Tahmin Sonuçları

	1	2	3	4	5	6
Sabit	7.960 (0.000)	20.747 (0.000)	11.356 (0.004)	10.536 (0.012)	28.426 (0.002)	28.660 (0.002)
CPI	-0.087 (0.279)	-0.088 (0.253)	-0.103 (0.169)	-0.102 (0.175)	-0.104 (0.162)	-0.100 (0.180)
GAP	-0.566 (0.000)	-0.526 (0.000)	-0.503 (0.000)	-0.501 (0.000)	-0.504 (0.000)	-0.502 (0.000)
PRO	0.019 (0.410)	-0.007 (0.732)	0.050 (0.065)	0.048 (0.084)	0.062 (0.026)	0.064 (0.023)
EPL		-4.498 (0.000)	-4.512 (0.000)	-4.609 (0.000)	-4.263 (0.000)	-4.268 (0.000)
UNION			0.234 (0.000)	0.018 (0.000)	0.307 (0.000)	0.313 (0.000)
RR				0.018 (0.557)		
TAX					-0.513 (0.041)	-0.530 (0.037)
ALMP						0.174 (0.559)
Gözlem sayısı	253	253	253	253	253	253
Ülke Sayısı	23	23	23	23	23	23
	F(3.227) = 106.16	F(4.226) = 90.91	F(5.225) = 79.63	F(6.224) = 66.22	F(6.224) = 68.00	F(7.223) = 58.16
Prob > F	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000
Deđiştirilmiş Walt Testi(p- deđeri)	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000
Otokorelasyo n için Wooldridge Testi (p- deđeri)	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000

Tablo 2 de parantez içerisinde p deđerleri verilmiştir. Tablo-2’nin birinci sütunu: Kurumsal faktörler olmadan modelin tahmin sonuçlarını vermektedir. Buna göre; enflasyon ve çıktı boşluđu deđişkenlerinin negatif, verimlilik deđişkeninin ise pozitif katsayıya sahip olduđu görülmektedir. Ancak enflasyon deđişkeninin modelin bütün tanımlamalarında, verimlilik deđişkeninin ise son iki tanımlama hariç olmak üzere istatistiksel olarak anlamlı olmadığı, çıktı boşluđunun (GAP) ise işsizlik ile negatif bir ilişkisinin olduđu görülmektedir. Yani; GAP’ın artması, işsizlik üzerinde azaltıcı bir etki doğuracaktır. Bunun anlamı, GSYİH trend büyüme deđerinin üzerinde büyümesi işsizlik üzerinde azaltıcı bir etkiye sahiptir. Modele EPL kurumsal deđişkenini

ekleyerek yeniden tahmin gerçekleştirildiğinde, birinci sütundaki sonuçlarla uyumlu biçimde GAP değişkeninin anlamlı, CPI ve PRO değişkenlerinin istatistiksel olarak anlamsız olduğu görülmektedir. EPL değişkeni ise anlamlı ve negatif ilişki ifade etmektedir. Yani istihdamı koruma mevzuatı katılaştıkça (endeks değeri yükseldikçe) işten çıkarmalar zorlaştığı için işsizlik azalacaktır. Bu sonuç teorik beklentilere uygun olmamakla birlikte, toplam etki olarak değerlendirildiğinde açıklanabilir bir durumdur. Şöyle ki; İstihdamı Koruma Mevzuatı; mevcut istihdamı yani içeridekileri koruyan bir mevzuattır. Mevcut çalışanların işten çıkarılmasını zorlaştıran veya işten çıkarmanın firma açısından maliyetli olmasını sağlayan düzenlemelerdir. Sadece bu yönüyle firmalar dönemselleşen talep değişimleri karşısında maliyetlerini işçi çıkararak değil diğer faktörlerden tasarruf ederek yapmakta, dolayısıyla istihdamı arttıran bir durum ortaya çıkmaktadır. Oysa aynı düzenlemeler, dışarıdakilerin de iş bularak istihdama dahil olmasını engellemektedir. Dolayısıyla EPL endeksinin katılığı kayıt dışı istihdamı teşvik edecek ve endeks katılaştıkça istihdam azalacaktır.

Modele UNION değişkeni eklenerek uygulanan üçüncü tanımlamada; yine GAP değişkeninin anlamlı, CPI ve PRO değişkeninin anlamsız olduğu görülmektedir. EPL değişkeni ise anlamlı ve negatif ilişki ifade ederken, UNION değişkeninin anlamlı olduğu ve pozitif ilişki ifade ettiği görülmektedir. Sendikalaşma arttıkça işsizlikte artacaktır. Ancak yüksek sendikalaşma, ücretlerin merkezi olarak (bütün işçiler için) belirlendiği durumlarda işsizliği azaltıcı etkisinden bahsedilebilir.

Dördüncü tanımlamada modele RR değişkeni eklenerek yeniden tahmin yapılmıştır. Sonuçlara göre; GAP, EPL ve UNION değişkenleri istatistiksel olarak anlamlı, CPI, ve PRO ve RR değişkenleri istatistiksel olarak anlamsızdır. RR değişkeninin, tüm değişkenler kullanılarak yeniden bir tahmin yapıldığında da istatistiksel olarak anlamsız olması sebebiyle sonraki tanımlamalarda modelden çıkarılmıştır.

Buna göre yapılan beşinci tanımlamada; TAX değişkeni eklenmiş ve CPI dışındaki bütün değişkenlerin anlamlı olduğu görülmüştür. Ayrıca TAX ile işsizlik arasında negatif ilişki tespit edilmiştir. Bu sonuç teorik beklentilerimize uymamakla birlikte, vergi oranlarındaki artışla birlikte işçiler uğradıkları gelir kayıplarını telafi etmek için kayıt dışı sektörlerde ek işler yaparak istihdamı arttırdıkları yorumu yapılabilir. Literatürde bu durum; vergi artışlarının işverenler tarafından üstlenilerek işçilere yansıtılmadığı ve emek talebindeki azalma sebebiyle işsizliği arttığı şeklinde yorumlar bulunmaktadır. Bu durumun maliyetleri artırarak, mal fiyatlarını arttıracığı sonucu göz ardı edilmemelidir.

Son olarak ALMP değişkeni eklenerek yapılan altıncı tanımlamada; ALMP ve CPI değişkenlerinin istatistiksel olarak anlamsız olduğu, diğer değişkenlerin ise istatistiksel olarak anlamlı olduğu sonucu görülmektedir. Teorik beklentilere uygun bir şekilde ALMP değişkeninin katsayısı negatif bulunmuştur.

Sabit etkiler modelini tahmin ederken, zaman sabitlerinin etkisine ihtiyaç duyulup duyulmayacağı test edilmiştir. Bunun için F testi kullanılmıştır. Bu test ile, tüm yığınlar için dummy değişkenlerinin 0 a eşit olup olmadığı, yani zaman sabitleri etkilerine

ihtiya duyulup duyulmadıđı test edilmiřtir. Her bir tanımlama iin bu test yapılmıřtır. Btn tanımlamalar iin, tm zaman katsayıları birleřik olarak sıfıra eřitir boř hipotezi reddedilmektedir. Dolayısıyla zaman sabitlerinin etkisi modele dahil edilmiřtir.

Sabit etkiler modeli ile ilgili diagnostik testler yapılmıřtır. Heteroskedasite sorunu olup olmadıđını anlamak iin yapılan Deđiřtirilmiř Wald testi sonularına gre modelde Heteroskedasite sorunu olduđu grlmřtir.

Otokorelasyon sorunu olup olmadıđını anlamak iin yaptığımız Wooldridge testi sonucunda $\text{prob}>F = 0.000$ bulunmuřtur. Bu sonu bize modelin tm tanımlamalar iin otokorelasyon sorunu olduđunu gsterir.

oklu dođrusallık sorunu olup olmadıđını tespit etmek iin Deđiřtirilmiř Walt testi uygulanmıřtır. Modelin btn tanımlamalarında oklu dođrusallık sorunu tespit edilmiřtir. Ayrıca Otokorelasyon sorunu tespit edilmiřtir. Otokorelasyon sorunu, katsayıların standart hatalarının gerekten daha fazla olmasına ve daha yksek R^2 deđerlerinin oluřmasına sebep olmaktadır.

Sabit etkiler tahmin edicisi kullanılarak elde edilen sonulardaki Heteroskedasite, otokorelasyon ve birimler arası korelasyon sorunlarının varlıđı sebebiyle model bu kez de Parks Kmenta tahmin edicisi ile yeniden tahmin edilmiřtir. Bylece en gvenilir katsayılara ve standart hatalara ulařmak hedeflenmiřtir.

Tablo 3: Parks Kmenta Tahmin Edicisi Sonuçları (Otokorelasyon olduğu durumda)

	1	2	3	4	5	6
Sabit	12.644 (0.000)	14.067 (0.000)	14.352 (0.000)	17.337 (0.000)	15.547 (0.000)	15.616 (0.000)
CPI	-0.102 (0.000)	-0.110 (0.000)	0.056 (0.053)	-0.070 (0.004)	-0.033 (0.284)	-0.124 (0.000)
GAP	-0.357 (0.000)	-0.356 (0.000)	-0.354 (0.000)	-0.370 (0.000)	-0.358 (0.000)	-0.377 (0.000)
PRO	-0.088 (0.000)	-0.089 (0.000)	-0.053 (0.001)	-0.035 (0.009)	-0.045 (0.013)	-0.055 (0.000)
EPL		-0.541 (0.150)	-0.756 (0.011)	-0.558 (0.167)	-0.884 (0.001)	-0.293 (0.628)
UNION			-0.046 (0.021)	-0.046 (0.051)	-0.044 (0.015)	-0.028 (0.205)
RR				-0.063 (0.000)		
TAX					-0.033 (0.604)	-0.048 (0.642)
ALMP						0.535 (0.015)
Gözlem sayısı	253	253	253	253	253	253
Ülke Sayısı	23	23	23	23	23	23
Prob > F	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000

Not: İstatistiksel olarak anlamlı bulunan sonuçlar koyu renk yazılmıştır

Otokorelasyon olduğu durumda yapılan Parks Kmenta tahmin edicisi sonuçlarını sabit etkiler modeli ile karşılaştırdığımızda; CPI ve PRO değişkenlerinin sabit etkiler modelinden farklı olarak birinci ve ikinci tanımlamada istatistiksel olarak anlamlı ve negatif katsayıya sahip olduğu görülmektedir.

İkinci tanımlamada EPL değişkeni sabit etkiler modelinde anlamlı ve negatif iken, Parks Kmenta tahmin edicisinde anlamsız olarak bulunmuştur.

Üçüncü tanımlamada; sabit etkiler modelinde; PRO değişkeni anlamsız iken Parks Kmenta tahmin edicisinde anlamlı ve negatif bulunmuş, UNION değişkeni anlamlı ve pozitif iken, 3. ve 5. tanımlamalarda anlamlı ve negatif olarak bulunmuştur.

Sabit etkiler modelinde istatistiksel olarak anlamsız olan CPI, PRO ve RR değişkenleri dördüncü tanımlamada anlamlı ve negatif bulunmuştur.

Beşinci tanımlamada TAX değişkeni anlamlı ve negatif katsayıya sahipken istatistiksel olarak anlamsız bulunmuştur.

Son olarak altıncı tanımlamada TAX değişkeni anlamsız iken istatistiksel olarak anlamlı ve pozitif katsayı bulunmuştur.

6. Sonuç

Kurumsal İktisadın öngöröleri kullanılarak tespit edilen makro ekonomik ve kurumsal faktörlerin işgücü piyasalarına etkilerinin test edildiđi çalışmanın bulgularına göre; makro ekonomik deđişkenlerden çıktı boşluđu (GAP) deđişkeni ile işsizlik arasında her uygulamada negatif ve anlamlı bir ilişki bulunmuştur. Böylece çıktı boşluđu arttıkça, bir diđer deyişle ekonomik büyüme sağlandıkça, yaratılacak yeni iş imkanları sebebiyle işsizliđin azalacađı söylenebilir. Bunun yanı sıra kurumsal deđişkenlerden istihdamı koruma mevzuatı (EPL) deđişkeni istatistiksel olarak anlamlı ve negatif bir ilişki ortaya koymaktadır. Bu sonuca göre; istihdamı koruma mevzuatı katılaştıkça, yani endeks deđeri büyüdükçe işsizlik azalacaktır. İstihdamı Koruma Mevzuatı; mevcut istihdamı yani içeridekileri koruyan, işçi çıkarmanın engellendiđi ya da maliyetli hale getirildiđi bir mevzuattır. Ancak bu düzenlemeler aynı zamanda dışarıdakilerin de iş bularak istihdama dahil olmasını engellemektedir. Bu istihdamı azaltan bir unsurdur. Burada toplam etki açısından deđerlendirme yapılarak istihdamın yüksek olduđu ekonomilerde veya dönemlerde katı EPL endeksinin varlıđı, istihdamın düşük olduđu ekonomilerde veya dönemlerde ise esnek bir EPL endeksinin varlıđı daha olumlu sonuçlar verecektir.

Aktif istihdam politikalarının (ALMP) etkisi konusunda teorik beklentimize uygun olmayan pozitif katsayı bulunmuştur. Aktif istihdam politikalarının etkileri ölkelerin demografik özelliklerine göre deđişmektedir. ALMP politikaları diđer kurumsal deđişkenlerle etkileşim halinde istihdam sağlamak konusunda olumlu etki yapabileceđini söyleyebiliriz.

Sonuç olarak, toplumsal ve ekonomik farklılıklar göz önüne alınarak, işgücü piyasalarına ilişkin kurumsal düzenlemelerin de her bir ekonomik yapıya uygun olacak şekilde farklı gerçekleştirilmesi gerekmektedir. Bu çerçevede İstihdamı koruma mevzuatı ile ilgili yapılacak düzenlemelerin, işsizlik oranının yüksek veya düşük olduđu durumlarda farklı yapılması gerekmektedir.

KAYNAKÇA

- Autiero, G. (2007). Labour market coordination system and unemployment performance in some OECD countries. *The journal of socio economics*, 37 (2008) 1846-1855.
- Avila, D.R. & Usabiaga, C. (2009). The unemployment paradigms revisited: A comparative analysis of U.S. State and European unemployment. *Contemporary Economic Policy*, 27(3), 321-334.
- Ay, S. (2012). Türkiye’de işsizliđin nedenleri: İstihdam politikaları üzerine bir Deđerlendirme. *Yönetim ve Ekonomi Dergisi*, 19(2).

- Bassanini, A. & Duval, R. (2009). Unemployment, institutions and reform complementarities: Re-assessing aggregate evidence for OECD countries. *Oxford Review Of Economic Policy*, 25 (1), 40-59.
- Bekirođlu, C. (2010). Türkiye’de işsizlik sorununun çözümlenmesinde uygulanan ekonomi politikalarının analizi. Yüksek Lisans Tezi, Kadir Has Üniversitesi, İstanbul.
- Blanchard, O. (2006). European Unemployment: The Evaluation of facts and ideas. *Economic Policy*, 5-59.
- Blanchard, O. & Wolfers, J. (2000). The role of shocks and institution in the rise of European unemployment. The aggregate evidence. *The Economic Journal, Conference Papers*, 110(462), C1-C33.
- Daveri, F., Tabellini, I G., Bentolilo, S. & Huizingo, L. (2000). Unemployment, Growth and taxation in industrial countries. *Economic Policy*, 15(30), 47-104.
- Eichengreen, B. & Iversen, T. (2013). Institutions and economic performance: Evidence from the labour market. *Oxford Review Of Economic Policy*, 15(4).
- Eser, B.Y. Ve Terzi, H. (2008). Türkiye’de işsizlik sorunu ve Avrupa İstihdam Stratejisi. *Erciyes Üniversitesi İktisadi ve İdari Bilimler Fakültesi Dergisi*, 30, 229-250.
- Fialova, K. & Schneider, O. (2008). Labour market institution and their effect on labour market performance in the new EU members countries. *CESIFO Working Paper*, 2421.
- Fitoussi, J.P., Jestoz, D., Phelps, E.S. & Zoego, G. (2000). Roots of the recent recoveries: Labour reform or private sector forces? *Breakings Paper on Economic Activity*.
- Freeman, R.B. & Nickell, S. (1988). Labour market institution and economic Performance. *Economic Policy*, 3(6), 63-80.
- Gunter, S. (1998). Transitional labour market: A new European employment strategy. *Leibniz Information Centre For Economics*, Fs I 98206.
- Güney, A. (2009). İşsizlik, nedenleri, sonuçları ve mücadele yöntemleri. *Kamu-İş*, 10(4).
- Güney, A. (2010). Türkiye’de geliştirilmiş İşsizlik oranları. *Çalışma ve Toplum Ekonomi ve Hukuk Dergisi*, 2010/1.

- Kaya, F. AB uyum sürecinde Avrupa İstihdam Stratejisi ve Türkiye. *Butçe dünyası*, Erişim:16.06.2014.
- Lehman, H. & Muravyev A. (2012). Labour market institution and labour market Performance. *Economics of Transition*, 20(2), 235-269.
- Nickell, S. (1997). Unemployment and labour market rigidities: Europe versus North America. *The Journal Of Economic Perspective*, 11(3), 55-74.
- Nickell, S., Nunziata, L. & Ochell, W. (2005). Unemployment in the OECD since 1960’s. What do we know? *The Economic Journal*, 115(500), 1-27.
- Onaran, Ö. (2007). İşsizlik ve alternatif politikalar. *DISK, Türkiye’de işsizliđin çözüm yolları ve sendikalar çalıştayı*, 14 Nisan 2007.
- Scarpetto, S. (1996). Assessing the role of labour market policies and institutional settings on unemployment: A cross-country study. *OECD Economic Studies*, 26 1996/1.
- Siebert, H. (1997). Labour market rigidities: AT the root of unemployment in Europe. *Journal Of Economic Perspective*, 11(3), 37-54.
- Stockhammer, E. & Klör E. (2010). Capital accumulation, labour market institution and unemployment in the medium run. *Cambridge Journal Of Economics*, 1 of 21 doi:10.1093/cje/beq020.
- Tatođlu, F.Y. (2013). Panel Veri Ekonometrisi. Beta Yayınları 2. Baskı, İstanbul.
- Taymaz, E. ve Özer Ş. (2004). Labour Market policies and EU accession: Problems and prospect for Turkey. *ERC Working Paper in Economic*, 04/05.
- Yılmaz, A. (2005). Türkiye’de işsiz nüfus. *Fırat Üniversitesi Sosyal Bilimler Dergisi*, 15(1), 43-56.

Türkiye Turizm Talebini Açıklamaya Yönelik Bir Panel Çekim Modeli Analizi¹

A Panel Gravity Model Describing Tourism Demand Towards Turkey

Erkan GÜNEŞ²
Burhan KABADAYI³

ÖZET

Bu çalışmada Türkiye'ye yönelik turizm talebi panel çekim modelleri vasıtasıyla incelenmiştir. Türkiye'ye gelen yabancı ziyaretçi sayıları Türkiye'ye yönelik turizm talebi olarak dikkate alınmıştır. Türkiye turizm talebini etkileyen faktörler ise Türkiye'ye gelen ziyaretçilerin kişi başına GSYİH'ları, nüfus sayıları, buldukları ülkelerin başkentlerinin İstanbul'a mesafesi ve bazı kukla değişkenler olarak belirlenmiştir. Türkiye ile diğer ülkeler arasında dinsel, etniksel, politik ve asker ilişkilerin etkileri talep fonksiyonuna kukla değişkenlerle dahil edilmiştir. Her kukla değişken için çift yön tesadüfi etkiler panel veri analizi kullanılmıştır. İstatistiksel olarak anlamlı ve teorik olarak beklenen parametreler ve işaretleri elde edilmiştir.

Anahtar Kelimeler: Turizm talebi, çekim modelleri, tesadüfi etkiler panel veri analizi, eş-bütünleşme analizi

ABSTRACT

In this study, tourism demands towards Turkey were analyzed by gravity models. The numbers of foreign visitors were taken considered as tourism demand towards Turkey. The variables that affecting tourism demand were identified as GDP per capita of the visitors, the distance from the visitors' countries capital cities to Istanbul, the population and some of dummies. The effects of religious, ethnicity, politic and military relationships between Turkey and the rest of the World were included the demand function towards Turkey. The two way random effects models were regressed for each dummy. Statistically significant and theoretically expected parameters and their signs were obtained.

Keywords: Tourism demand, gravity model, two way random effects panel data analysis, co-integration

¹ Bu çalışma 26 Mayıs 2013 tarihinde Bosna -Hersek'te 14. Uluslararası Ekonometri, Yöneylem Araştırması ve İstatistik Kongresinde sunulmuştur ve çalışma sadece özet olarak yayınlanmıştır.

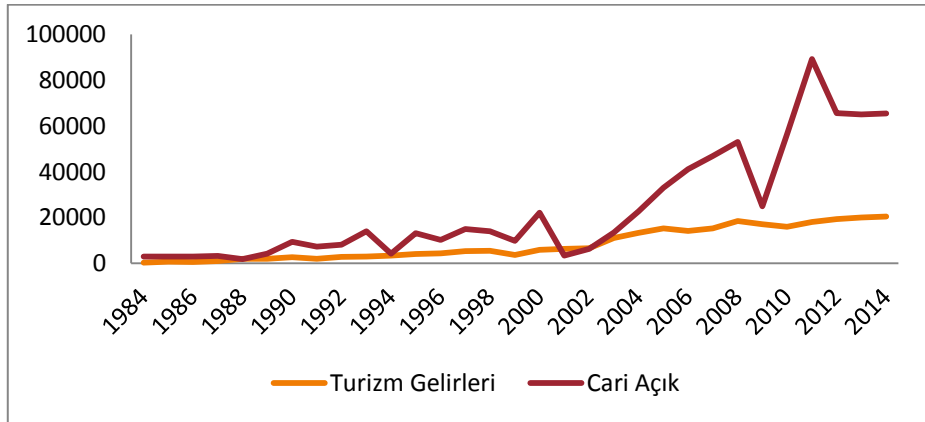
² Öğr.Gör., Erzincan Üniversitesi, Turizm ve Otelcilik MYO, erkangunes24@gmail.com

³ Doç.Dr., Erzincan Üniversitesi, İİBF, burhankabadayi@gmail.com

1.Giriş

24 Ocak 1980 kararlarından sonra ithal ikameci kalkınma modelinden vazgeçip ihracata dayalı kalkınma modelini benimseyen Türkiye, 1980 yılından itibaren ekonomisini liberalize etmiş ve dışa açık ve Dünya Ekonomileriyle entegre bir konum benimsemiştir. Üretimde karşılaştırmalı üstünlüğe sahip olmadığı ürünleri ithalat yoluyla temin etmiş ve karşılaştırmalı üstünlüklere sahip olduğu veya gelecekte sahip olabileceği sektörlerde ise iç üretimde yoğunlaşmıştır. Ancak dışa açılmayla birlikte ithalatın parasal değerleri, ihracatın parasal değerinden her zaman fazla olmuştur. Günümüzde de sıkça tartışılan gelen dış açık artık kronik dış açık olarak adlandırılmaya başlamıştır.

Kronik olarak adlandırılan dış açık ise dış borç stokunu arttırmakta ve Türkiye'yi borçlu ülkeler sınıflandırmasına sokmaktadır (Dünya Bankası, 2011). Dış borçlar ise Türkiye Ekonomisindeki kırılganlıkları özellikle kriz dönemlerinde arttırmakta ve uluslararası yatırım piyasalarında riskli duruma getirmektedir. Dış borçların en önemli kaynağı olan dış ticaret açığını önlemede tartışılan çözümler ithalatı kısma veya ihracatı artırma konusunda odaklanmaktadır. Tartışılan konular dış açığı kapatmada etkilidir ancak turizmin dış açığı kapamadaki rolü tartışma götürmez bir konudur. Şekil 1'de Türkiye'nin 1984 yılından beri dönemlere göre cari açık ve turizm gelirleri birlikte verilmiştir. Şekil incelendiğinde açıkça görülecektir ki Türkiye 1984 yılından beri cari açık vere gelmiş ve Turizm ise kısmen cari açığı finanse etmektedir.



Şekil 1: Cari Açık ve Turizm Gelirleri

Turizmin ekonomik öneminden hareketle bu çalışmada Türkiye'ye yönelik turizm talebi çekim modeli çerçevesinde bir kısım değişkenler vasıtasıyla incelenmiştir. Çalışmada ilkin konuyla alakalı literatür taraması gerçekleştirilmiş ardından Türkiye'ye yönelik turizm talebini etkileyen faktörler panel veri analizleri yöntemiyle incelenmiştir. Sonuç olarak Dünya Ülkelerinin gelir seviyesi ve nüfus potansiyelinin Türkiye'ye yönelik turizm talebi üzerinde pozitif etkileri bulunmuştur. Ülke mesafeleri ise olumsuz

etkilidir. Türkiye'nin dini, etnik, siyasi ve askeri yönde ilişkileri olan ülkelerden daha fazla turist çektiği gözlenmiştir.

2.Literatür Taraması

Turizm sektörü, bugün dünyada en hızlı gelişen sektörlerin başında yer alırken, millî gelirin de önemli bir bölümünü oluşturmaktadır. Harcanabilir kişisel gelirlerden tatil ve turizme ayrılan payın artması, teknolojik gelişmeler ile beraber iletişim ve ulaşım hizmetlerindeki iyileşmeler neticesinde insanların şimdiye kadar görmedikleri ve merak ettikleri yerleri ziyaret etme eğilimlerini arttırmıştır(Dilber, 2007:205).1960'lı yıllarla beraber dünya genelinde; teknolojiye, iletişime ve ulaşım sistemlerinde önemli değişim ve gelişmeler yaşanmıştır. Bu gelişmeler turizm sektörünü de doğrudan veya dolaylı olarak etkilemiştir. Özellikle iletişim teknolojisindeki hızlı gelişmeler ile ulaşım araçlarındaki hız, konfor, kapasite ve fiyat faktörlerindeki gelişmeler uluslararası turizmin gelişmesine büyük katkı sağlamıştır. Uluslararası turizm dünya genelinde çok önemli bir yere sahiptir. Ülkeler açısından önemli gelir kaynağı sunan turizm sektörü, uluslararası ticaretin gelişmesi ve insanların yaşam standartlarının yükselmesi ile beraber seyahat etme eğiliminin artması ile önemli gelişmeler kaydetmiştir(Çeken, Dalgın ve Karadağ, 2009:22).

İkinci Dünya Savaşı'ndan sonra turizm, dünya ekonomisinde en hızlı büyüyen ve etkisini arttıran sektörlerden birisi olmuştur. Turizm sektörünün gelir sağlama, istihdamı artırma, iş ve gelir vergisi oluşturma, ödemeler dengesine katkı sağlama gibi önemli rol ve katkıları bulunmaktadır. Özellikle de gelişmekte olan ekonomiler için döviz girdisi sağlama ve emek yoğun bir sektör olması sonucunda, istihdama sağladığı katkı nedeni ile büyük önem taşımaktadır(Muchapondwa ve Pimhidzai, 2011:71). Bu nedenle turizm, genellikle bölgesel ve ulusal kalkınma için bir araç olarak kullanılmıştır(Çimat ve Bahar, 2003:2). Günümüzde ekonomik, sosyal ve kültürel bir olgu durumuna gelen turizm sektörünün, ülke ekonomileri üzerinde olumlu etkileri daha fazla ön plana çıkmaktadır. Özellikle cari açığı dengelemede önemli katkısı ve oluşturduğu ekonomik hareketlilik ve üretilen mal ve hizmetlerin yabancı turistler tarafından tüketilmesi ile elde edilen gelir nedeniyle pek çok ülke ekonomileri için turizm hayati önem taşımaktadır ve bu durum turizmi ülkeler için cazip ve vazgeçilmez hale getirmiştir(Çuhadar vd., 2009:100, Chu, 2009:740).

Uluslararası turizm son çeyrek yüzyılda bir patlama yaşadı ve günümüzde dünyanın en büyük endüstrilerinden birisi oldu. Mevcut durumdaki büyümesine ve gelişimine rağmen turizm hareketleri her yıl düzensiz olarak değişmiştir. Bazı ülkelerde turizm sürekli artış gösterirken bazılarında ise dalgalanmalar olmuştur. Bu şartlar altında turizmin her zaman artış göstereceğini beklemek yanlış olur. Bu nedenle ülkelerin turizm talebini iyi bilmesi ve turizm talebini oluşturan turistlerin özelliklerinin araştırılması gerekmektedir.

İkinci Dünya Savaşından sonra havacılık sektöründe yaşanan gelişmelerle beraber hızlı, güvenilir ve konforlu seyahatler sayesinde uluslararası turizm doğdu ve her geçen gün

katılımcı sayısı arttı. Günümüzde uluslararası turizm hareketlerine katılanların istatistikleri sayesinde, araştırmacılar uluslararası turizm hareketleri hakkında çalışmalar yapabilmektedirler(Chu, 2008:78).

2.1.Turizm Talebi

Turizm, son çeyrek yüzyılda birçok ülke için açıkça en önemli ekonomik gelir sağlayıcısı konumundadır. Birçok araştırma ve çalışmalar gösteriyor ki turizmin bu dinamik ve hızlı büyüyen yapısı devam edecektir. Bu dinamik yapısı ve ülkelere sağladığı önemli katkılar nedeni ile turizmi geliştirme ve talebi artırıcı çalışmalar yapmak gerekmektedir(Goh ve Law, 2002:499). Özellikle turizm planlamasının ve turizm kararlarının daha etkin ve verimli olması için turizm talebinin ne, kim ve ne gibi özelliklerden oluştuğunun bilinmesi gerekmektedir.

Kısaca turizm talebine değinirsek, turizm talebi, belirli bir hedef doğrultusunda, belirli bir dönemde turizm mal ve hizmetlerini satın almak için istekli olan kişiler toplamıdır. Turizm talebi kavramı, ekonomi disiplindeki klasik talep kavramından üretilmiş ve “turizm ile ilgili mal ve hizmetleri satın alabilme ve kullanabilme gücüne sahip olma” olarak tanımlanmıştır(Song vd., 2010:63-64).Turizm talebi ekonomi disiplini açısından tanımlandığında, yeterli satın alma gücüne ve boş zamana sahip, belirli bir zaman ve belirli bir hedef doğrultusunda turistik mal ve hizmetlerden faydalanan ya da yararlanmak isteyen kişi ya da kişiler topluluğudur(Kozak vd., 2011:59).

Turizm talebi, belirli fiyatta satışa veya turizm hareketlerine katılanların faydalanmasına sunulan turistik mal ve hizmetleri satın alan veya bunlardan faydalanan insanlar toplamıdır(Olalı, 1979:165).

Tanımlarda belirtilen özelliklere ve seyahat etme isteğine sahip olup ancak, çeşitli nedenlerle (kişisel nedenler, alışkanlıklar, iklim ya da arz kaynaklı sorunlar) turizm hareketlerine doğrudan katılamayan kimselerinde göz önünde bulundurulması gerekmektedir. Turizm talebinin bu yönü, potansiyel turizm talebini oluşturmaktadır. Turizm sektörüne özgü talep kavramından söz edebilmek için(Kozak vd., 2011:59);

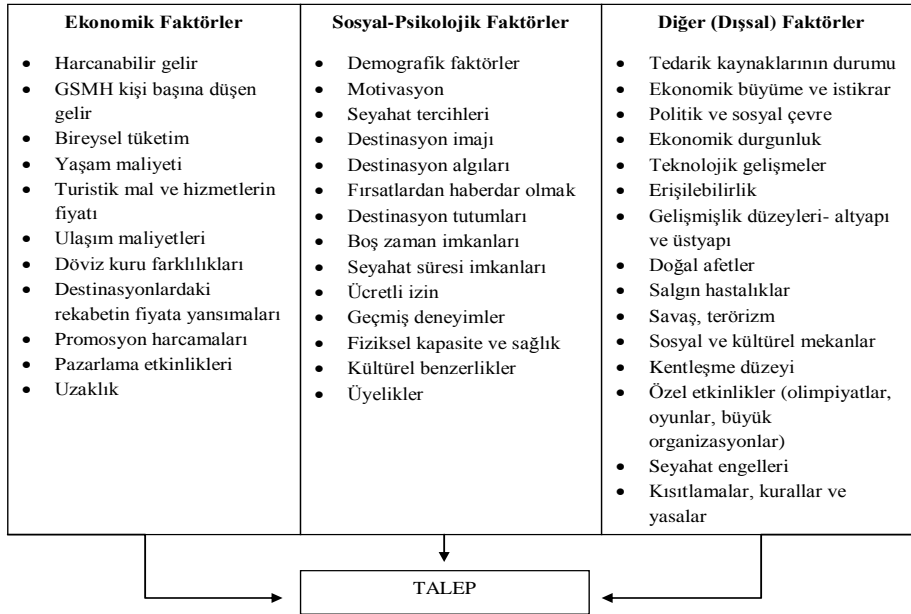
- Tüketim ile ilgili zamanın kesin sınırlarının çizilmiş olması,
- Tüketimde bulunacak kimsenin belirli gelir ve boş zaman sahip olması,
- Turistik mal ve hizmetlerin belirli bir piyasada ve fiyatta turistlerin hizmetine sunulmuş olması,
- Tüketicinin bu hizmetlerden yararlanmak için isteğinin olması gerekmektedir.
-

Turizm talebinin genel özellikleri şu şekilde sıralanabilir(Tandoğan, 1998:146, Kozak vd., 2011:60):

- Turistik talep, ticari ya da mesleki amaçlarla seyahat edenleri kapsamamaktadır.
- Turistik tüketimde kişisel gelir kullanılmaktadır.

- Turistik talep belli zamanlarda yoğunlaşmaktadır.
- Turizm talebi bağımsız bir taleptir.
- Turizm talebi çok yönlü ve karmaşık bir özelliğe sahiptir.
- Turizm talebi aşırı esneklik.
- Turizm ürünleri arasında aşırı rekabet vardır.
- Turizm talebi mevsimlik özellik taşır.
- Ülkelerin gelişmişlik düzeyine göre değişiklik gösterir.

Genel anlamda bu özelliklerden ticari ve mesleki amaçla seyahat edenler ve bu nedenlerle giderlerini kendi hesaplarından ödemeyenler turist olarak nitelendirilmemektedir.



Şekil 2: Turizm Talebini Etkileyen Faktörler

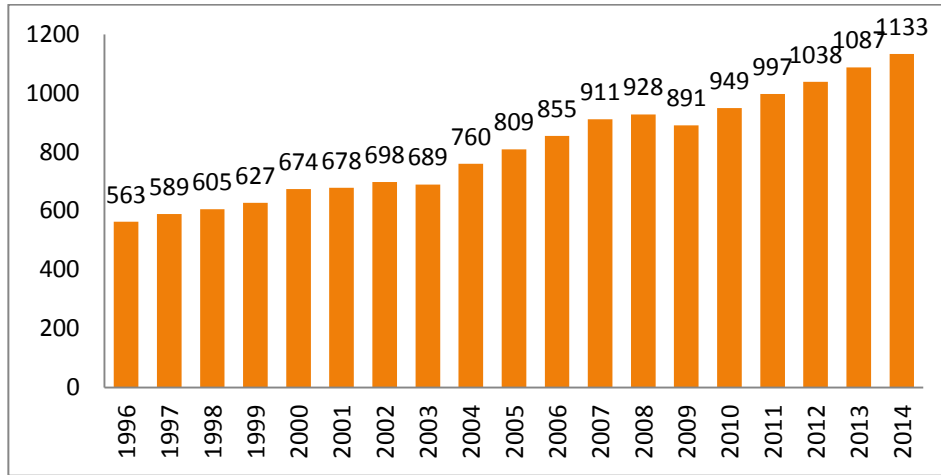
Kaynak: Uysal, Muzaffer. The Economic Geography of The Tourist Industry, 1998: 87

Turizm talebi ile ilgili literatüre bakıldığında turizm talebi genellikle; ulaşım, fiyat, turizm üreten ülkelerde gelir ve nüfus, maliyet gibi belirleyicileri üzerine odaklanmaktadır(Hanafiah, vd., 2011:1). Turizm talebini etkileyen birden çok faktör bulunmaktadır. Turizm talebini etkileyen faktörler birden çok başlık altında toplanabilir. Ancak öne çıkan faktörler; ekonomik, sosyal ve psikolojik ve diğer (dışsal) faktörler olarak başlıklar altında toplanabilir(Şekil 2).

2012 yılı itibari ile dünya genelinde 260 milyonu aşkın kişiye istihdam sağlayan (küresel istihdamın % 8,7 si) turizm sektörü, dünyadaki en büyük sektörlerden biridir ve küresel ekonomiye güçlü bir ivme kazandırmaktadır. Sektör 2011 yılında 6.346 milyar

ABD doları hacme ulaşmıştır. Bu rakam 2011 yılı dünya GSYİH'sinin % 9,1'ine karşılık gelmektedir. 2012 yılında ise turizm sektörü 6.526 milyar ABD doları hacme ulaşması tahmin edilmekteydi ve bu rakam 2012 dünya GSYİH'sinin % 9,2'sine denk gelmektedir(Travel & Tourism Economic Impact, 2012:3-4).

Dünya genelinde 1996-2014 yılları arasında turist sayılarının gelişimine baktığımızda 1996 yılında 563 milyon olan turist sayısı, 2000 yılında 674 milyona, 2008 yılında 928 milyon kişiye yükselmiştir. 2008 yılının ikinci yarısından itibaren hissedilen küresel ekonomik kriz, turizm sektörünü de olumsuz bir şekilde etkilemiş, 2009 yılında turist sayısı 891 milyon kişiye düşmüştür(Yorgun, 2013:9). Ancak turizm hareketleri son beş yılda sürekli bir artış göstererek 2012 yılından itibaren 1 milyar kişinin üzerine çıkmış ve 2014 yılı itibari ile 1 milyar 133 milyon kişi uluslararası turizm hareketlerine katılmıştır(Şekil 3).



Şekil 3: Uluslararası Turizm Hareketleri (milyon kişi)

Kaynak: 2012 International Tourism Results and Prospects for 2013, World Tourism Organization (UNWTO) <http://mkt.unwto.org/en/barometer>, Erişim Tarihi: 22.03.2013 ve UNWTO Tourism Highlights, 2015 Edition, Erişim Tarihi: 11.09.2015

2.2. Türkiye Turizm Talebi

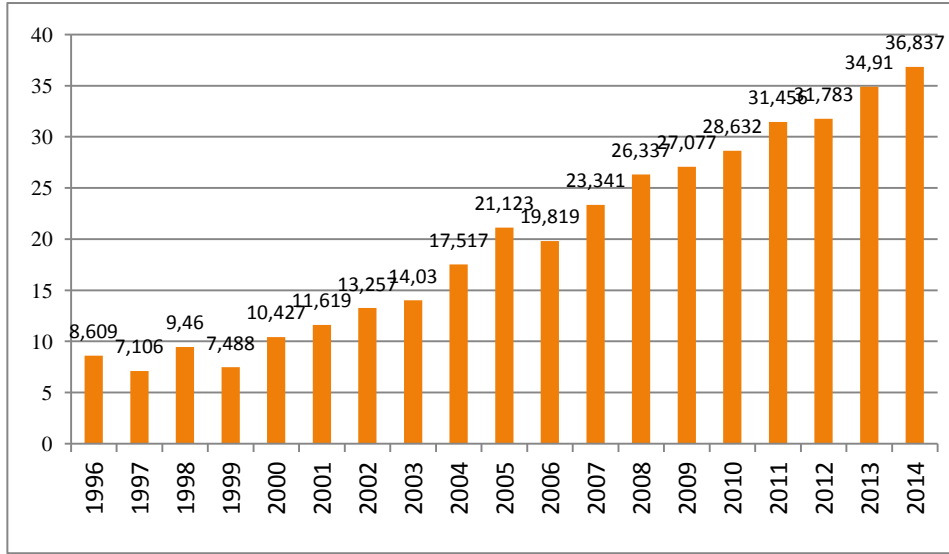
Türkiye sahip olduğu doğal güzellikleri, tarihi mekânları, arkeolojik ören yerleri, gelişmekte olan turistik altyapısı ve kültürel özellikleri ile dünyada en çok tercih edilen turizm destinasyonlarından biridir. Turizm sektörü yeni istihdam olanakları sağlaması, GSYİH ve ödemeler dengesine katkı sağlaması gibi özellikleri ile ülkemiz için ekonomik kalkınmanın en önemli ayaklarından biri olmuştur(Türkiye Turizm Sektörü Raporu).

Türkiye için turizm endüstrisi, önemi anlaşılmış ve kabul edilmiş olması ile beraber geliştirilmesi için de çaba sarf edilen, ödemeler dengesine katkı sağlayan ekonomik,

sosyal ve kültürel faaliyetlerdir. Ancak turizm, ülkemiz ekonomik hayatında 1980’li yıllara kadar istenileni verememiştir. Bu dönemde turistik arzı çok fazla önem vermesi ile gelen turist sayısını ve turizm gelirlerini arttırarak 1990’lı yıllarda dünyada önemli destinasyonların arasına girmeyi başarmıştır. 2000’li yıllarda artık Türkiye, turist sayısı ve turizmden elde edilen gelirlerle sıralamalarda ilk on ülke arasında yer almaktadır (Gülbahar, 2009:94).

Türkiye sahip olduğu turistik potansiyele rağmen dünya genelinde turizmden aldığı pay düşüktür. Dünya üzerinde turizm odak noktalarından birini oluşturan Türkiye, gelen turist sayısı bakımından istenilen düzeyde değildir. İstenilen düzeyi yakalayabilmek için turizmde talep koşullarının ve turizm talebinin iyi analiz edilmesi gerekmektedir (İşler, 2009:62). Ülkemizin turizm talep koşulları turizm hareketlerine katılanlar için çekici gelmektedir. Bu nedenle ülkemiz ekonomisinde turizmin önemli payı vardır. Özellikle 1980’li yıllarla beraber sektörün değeri anlaşıldıktan sonra elde edilen turizm gelirlerinde artış olmuştur.

Ülkemizi ziyaret eden yabancı ziyaretçilerin 1996-2012 yılları arasındaki gelişimine bakıldığında 1996 yılında ülkemize gelen turist sayısı 8 milyon 609 bin kişi iken bu sayı 2000 yılında 10 milyon kişiyi aşmıştır. 2005 yılında 20 milyondan fazla turist çeken ülkemiz 2010 yılı itibari ile 28 milyon yabancı ziyaretçi tarafından tercih edilirken, 2014 yılında 36 milyon 837 bin yabancı turist ülkemizi tercih etmiştir (Şekil 4).



Şekil 4: Türkiye’yi Ziyaret Eden Yabancı Ziyaretçi Sayısı (bin kişi)

Kaynak: T.C. Kültür ve Turizm Bakanlığı, <http://www.kultur.gov.tr/> Erişim tarihi: 22.02.2013, Türkiye Seyahat Acentaları Birliği, <http://www.tursab.org.tr/>, Erişim tarihi: 22.02.2013, <http://yigm.kulturturizm.gov.tr/> Erişim tarihi: 11.09.2015,

2.3.Çekim Modeli

Çekim Modeli Newton'un kütle çekim kanunundan esinlenerek oluşturulmuş ve iktisat literatüründe de kendine yer bulmuş önemli modellerden birisidir. Bilindiği üzere kütle çekim kanununa göre iki cisim birbirini kütleleriyle doğru orantılı ve aralarındaki mesafenin karesiyle negatif orantılı etkilemektedir. Çekim Modeli iktisat literatüründe ilk kez Tinbergen (1962) tarafından kullanılmış ve ülkeler arası uluslararası mal ticareti ilişkileri incelenmiştir. Ülkeler arası mesafe artmasıyla taşıma ve kargo maliyetlerinin artacağından yabancı malların talebi de azalacaktır. Gelir ise yabancı malların talebini arttıran ve mesafeye göre zıt etkili bir faktördür. Böylece Newton'un kütle çekim modelinde olduğu gibi iktisat biliminde iki zıt etki bir olguyu açıklamak için kullanılmıştır. Çekim modelleri benzer mantıkla turizm talebi için de kurgulanabilir. Bireylerin gelir düzeyleri turizm talebini olumlu etkileyen bir faktörken ülkeler arası mesafe negatif etkili bir faktördür. Literatürde çekim modelleri ile turizm talebi açıklanmaya çalışılmıştır. Örneğin Seetanah ve Khadaroo, 2008; Karagöz, 2008 ve Yavuz, vd. 2014 çalışmalarında çekim modelleri vasıtasıyla turizm talebi fonksiyonu oluşturmuşlardır.

3.Veriler ve Ampirik Analiz

Çalışmanın amacı Türkiye turizm sayısını etkileyen faktörleri çekim modeli vasıtasıyla incelemektir. Türkiye turizm talebini model çerçevesinde ifade etmek için Türkiye'ye gelen turist sayısı kullanılmıştır. Çekim modeli çerçevesinde Türkiye turizm talebini etkileyen faktörler; gelir seviyesi, turistlerin buldukları ülkelerin Türkiye'ye olan mesafesi, yabancıların geldikleri ülkelerin turizm potansiyelini göstermek için nüfus sayıları kullanılmıştır. Ayrıca Türkiye turizm talebini etkileyen bazı nitel değişkenler, kukla değişkenler vasıtasıyla ifade edilip çekim modeline dahil edilmiştir. Çalışmada kullanılan seriler, Türkiye'ye gelen yabancılar sayısı 1996 yılından itibaren TÜİK tarafından paylaşıldığından 1996-2014 yılları arası dönemi kapsamaktadır ve seriler yıllık veri cinsinden elde edilmiştir. Veriler Türkiye İstatistik Enstitüsü (TÜİK), Dünya Bankası ve <http://www.timeanddate.com> internet adresinden temin edilmiştir. Çalışmanın yatay kesit örnekleme ise 89 ülkeden oluşmaktadır.

Çalışmada kullanılan model şu şekilde ifade edilmiştir:

$$LTOUR_{i,t} = \beta_0 + \beta_1 LGDPPC_{i,t} + \beta_2 LPOP_{i,t} + \beta_3 LDIST_{i,t} + \beta_4 DUM_{i,t} + u_{i,t}$$

Ki, $i = 1, \dots, 89$ ve $t = 1996, \dots, 2014$ (1)

Modelde kullanılan veriler logaritmik değerlerle ifade edilmiştir. LTOUR Türkiye'ye gelen yabancı sayısının logaritmik değerlerini ifade etmektedir. LGDPPC ülkeye gelen yabancıların buldukları ülkenin ABD doları cinsinden kişi başına GSYİH değerlerinin logaritması, LPOP ülkeye gelen yabancıların buldukları ülkenin nüfus sayısının logaritmik değeri, LDIST yabancıların buldukları ülkenin başkentinin İstanbul'a olan uzaklıklarının logaritması, DUM ise kukla değişkenleri ifade etmektedir.

Kukla değişken olarak Türkiye ile dinsel bağları olan ülkeler (DUM1¹), Türkiye ile etnik bağı olan ülkeler (DUM2), AB'ye üye olan ülkeler (DUM3) ve NATO'ya üye olan ülkeler (DUM4) şeklinde sınıflandırılmıştır. Bazı ülkelerin NATO ve AB üyelikleri 1996 yılı sonrası döneme rast geldiğinden üyelik süreci başlangıcından 2014 yılı dönemine kadarki süre dikkate alınmıştır.

Çalışmada kullanılan seriler, ilk önce birinci nesil birim kök testlerinden Levin, Lin, Chu (LLC) ve Im, Pesaran, Shin (IPS) (Levin, Lin ve Chu 2002; Im, Pesaran ve Shin 2003) testleriyle sınanmış ve sonuçlar Tablo 1'de gösterilmiştir.

Tablo 1: Birinci Nesil Birim Kök Testleri

Değişkenler	LLC		IPS	
	Sabit	Sabit ve Trendli	Sabit	Sabit ve Trendli
LTOUR	-0,608	-7,207 ^A	6,771	-4,607 ^A
LGDPCC	-4,943 ^A	-7,315 ^A	6,223	-0,029
LPOP	-11,590 ^A	-1,874 ^B	4,666	-14,508 ^A
Δ LTOUR	-19,278 ^A	-16,714 ^A	-19,937 ^A	-15,690 ^A
Δ LGDPCC	-16,195 ^A	-13,009 ^A	-11,080 ^A	-6,928 ^A
Δ LPOP	-3,501 ^A	-32,061 ^A	-13,403 ^A	-19,839 ^A

Not: Birim kök testlerinde Schwartz bilgi kriteri dikkate alınmıştır. Maksimum gecikme 11 seçilmiştir. B ve A sırasıyla %5 ve %1 önem düzeyini belirtir. Δ birinci dereceden fark operatörüdür.

Çalışmanın LLC birim kök testleri dikkate alındığında serilerin trend içerecek biçimde düzey değerinde durağan yani I(0) olduğu gözlenmektedir. IPS testi sonuçlarına göre sabit ve trendli LGDPCC değişkeni düzey değerinde durağan değil diğer değişkenler ise düzey değerinde durağan olduğu gözlenmiştir.

Çalışmada kullandığımız serilerin birim etkiler içerip içermediği ise Score ve LR testleri vasıtasıyla tetkik edilmiştir². Her iki testin sonucuna göre modelimizin birim etkiler içermediği sıfır hipotezi reddedilmiştir. Yani model birim etkiler içermektedir. Zaman etkilerin testi için en çok olabilirlik yöntemi kullanılmıştır³. Modelin zaman etkiler içermediği sıfır hipotezi de reddedilmiştir. Sonuç olarak modelimiz hem birim etki hem de zaman etkiler içermektedir. Bu nedenle modelimizde klasik panel veri

¹ Nüfusunun %50'sinden fazlası Müslüman olan ülkeler DUM1 kukla değişkeniyle belirtilmiştir.

Ülkelerin inanç yapısı CIA, The World Factbook'tan temin edilmiştir.

² LR testi istatistiği 2638.92 bulunmuş ve %1 önem düzeyinde istatistik bakımdan anlamlıdır. Score testi istatistiği ise 2.1e+06 bulunmuş ve %1 önem düzeyinde istatistik bakımdan anlamlıdır.

³ En çok olabilirlik yöntemi istatistiği 77.68 bulunmuş ve %1 önem düzeyinde istatistik bakımdan anlamlıdır

modellerinden ziyade çift yönlü sabit veya tesadüfi etkiler modelinin kullanılmasına karar verilmiştir.

Birim Etkiler Hipotezi:

$$\begin{aligned} H_0: \mu &= 0 \\ H_1: \mu &\neq 0 \end{aligned}$$

Zaman Etkiler Hipotezi:

$$\begin{aligned} H_0: \lambda &= 0 \\ H_1: \lambda &\neq 0 \end{aligned}$$

Çift yönlü model yani eğim parametresi sabit, sabit parametrenin ise birimlere ve zamana göre değişken olduğu model aşağıda belirtilmiştir.

$$LTOUR_{i,t} = \beta_{0it} + \beta_1 LGDPPC_{i,t} + \beta_2 LPOP_{i,t} + \beta_3 LDIST_{i,t} + \beta_4 DUM_{i,t} + \mu_i + \lambda_t + u_{i,t}$$

Ki, $i = 1, \dots, 89$ ve $t = 1996, \dots, 2014$

(2)

Çalışmanın örnekleme seçilirken herhangi bir kısıtlamaya gidilmemiş ve spesifik bir ülke grubu dikkate alınmamıştır. Modelin örnekleme seçimi dikkate alındığında tesadüfi etkilerin kullanılması sabit etkiler modeline göre daha uygun bir karar olacaktır (Baltagi, 2008: 14 ve Tatoğlu, 2012: 79). Ayrıca çalışmada kullanılan değişkenlerden LDIST (ülkelerin başkentlerinin İstanbul'a uzaklığı) zamana göre sabit değişkendir. Sabit etkiler modeli bu değişkenle analiz yapmaya imkan vermezken tesadüfi etkilerle bu model tahmin edilebilir. Sabit etkiler modelinde zaman sabiti değişkenler (mesafe gibi) modelden dışlanmaktadır.

Türkiye turizm talebini açıklamaya yönelik kurgulanan çekim modeli çift yön tesadüfi etkiler panel veri analizi yöntemiyle uygulanmıştır. Model her kukla değişken için ayrı ayrı gerçekleştirilmiştir. Sonuçlar Tablo 2'de verilmektedir.

Tablo 2: Çift Yön Tesadüfi Etkiler Panel Veri Analizi Sonuçları

Bağımlı Değişken: LTOUR								
Değişkenler	DUM1		DUM2		DUM3		DUM4	
	Kat Sayı	t istatistiği	Kat Sayı	t istatistiği	Kat Sayı	t istatistiği	Kat Sayı	t istatistiği
Sabit	-9,352 ^A	-3,707	-9,829 ^A	-5,002	-9,90 ^A	-4,127	-9,522 ^A	-4,038
LGDPPC	1,625 ^A	24,62	1,655 ^A	34,43	1,602 ^A	28,43	1,596 ^A	27,66
LDIST	-1,829 ^A	-6,357	-1,839 ^A	-7,142	-1,816 ^A	-6,214	-1,819 ^A	-6,372
LPOP	1,156 ^A	9,725	1,160 ^A	10,74	1,192 ^A	9,921	1,175 ^A	9,802
DUM1	0,013	0,027						
DUM2			2,778 ^A	8,003				
DUM3					0,248 ^A	2,680		
DUM4							0,187 ^B	2,072
R ²	0,419		0,433		0,438		0,421	
Düzeltilmiş R ^R	0,418		0,431		0,437		0,419	
F istatistiği	304,99 ^A		322,18 ^A		329,19 ^A		306,49 ^A	
DW Değeri	0,677		0,684		0,682		0,680	

A ve B sırasıyla %1 ve %5 önem düzeyini belirlemektedir. Modelde çift yön tesadüfi etkiler modeli robust tahmincisi kullanılmıştır. Çalışmada heterojenlik varsayımı ihmal edilmiştir. DW: Durbin Watson istatistiğini belirtmektedir.

Elde edilen sonuçlara göre LGDPPC ve LPOP değişkenleri her dört model için %1 önem düzeyinde istatistiki olarak anlamlı ve katsayısı pozitif bulunmuştur. LDIST değişkeni katsayısı ise %1 önem düzeyinde anlamlı ve negatif işaretli bulunmuştur. Modellerde elde edilen katsayılar şu şekilde yorumlanabilir: Türkiye'yi ziyaret eden turistlerin kişi başına gelirlerinde meydana gelecek %1'li bir artışa turizm talepleri %1'den fazla artışla karşılık vermektedir. Türkiye'nin turizm talebi esnekliği birden büyük yani turizmin gelir esnekliği elastik bulunmuştur. Bu durum Türkiye turizm gelirlerinin global ekonomik gelişmelerden oldukça etkilendiğini göstermektedir. Ülkelerin nüfus artışıyla turizm talebi arasındaki ilişkinin ise pozitif olması Türkiye turizm talebinin artış potansiyelini yansıtmaktadır. İlgili değişkenin istatistiki açıdan anlamlı olması ve 1'den büyük değer göstermesi turizm sektörünün geleceği hakkında iyimser ve pozitif bir yapı sergilemektedir. Türkiye'ye gelen yabancı ziyaretçilerin ülkelerinin Türkiye'ye olan mesafesi arttıkça turizm talebinin azaldığı gözlenmektedir. Bu yapı Türkiye'ye coğrafi olarak uzak olan bölgelere (Latin Amerika, Uzak Doğu Asya ve Okyanusya gibi) reklam ve ulaşımda teşvik gibi unsurlarla yaklaşılarak mesafenin dez avantajını minimize edilebileceğini ortaya koymaktadır.

Modellerde kullanılan kukla değişkenler ise Türkiye turizm talebi hakkında önemli bilgiler vermektedir. Türkiye ile yabancı ülkeler arasındaki dinsel bağları ifade eden

DUM1 değişkeni istatistiki bakımdan anlamsız ve katsayısı pozitifdir. Türkiye ile etnik yakınlığı bulunan ülkeler için oluşturulan DUM2 değişkeni ise %1 önem düzeyinde anlamlı ve katsayı işareti pozitifdir. AB ülkelerini temsilen oluşturulan DUM3 ve NATO üyelerini temsilen oluşturulan DUM4 değişkenleri de Türkiye'ye yönelik turizm talebi üzerinde pozitif etkili ve %1 önem düzeyinde anlamlı bulunmuştur. Mevcut kukla değişkenler içerisinde DUM2 görece en büyük katsayıya sahiptir. Özellikle Türkiye Cumhuriyetlerinden Türkiye'ye canlı bir turizm talebi bulunmaktadır. Bu canlılığın devamı ve daha da artırılması için bölgeye özgü teşvik ve reklam unsurları değerlendirilmelidir. Türkiye'ye AB ve NATO üyesi topluklardan gelen turistlerin sayıları DUM3 ve DUM4 değişkenlerinin katsayıları dikkate alındığında pozitif yönde ayrılmaktadır. Bu durum Türkiye'nin üyesi bulunduğu uluslararası siyasal, askeri ve ekonomik örgütlerin üyeleri tarafından Türkiye önemli turizm destinasyonları arasına girdiğini göstermektedir. Türkiye uluslararası örgütlerle daha sıkı ilişkiler kurması ve bu örgütlerin üyeleri ile diplomatik ilişkilerinin geliştirilmesi turizm talebine olumlu etkilerde bulunacağı kuvvetle muhtemeldir. DUM1 değişkeninin katsayısının anlamsızlığı göz önünde bulundurulduğunda özellikle Müslüman Arap Coğrafyasına yönelik inanç hassasiyetlerini dikkate alan alternatif turizm alt yapısının oluşturulması ve ilgili coğrafyaya yönelik reklam ve tanıtım faaliyetlerinde bulunulması Türkiye turizm gelirlerini arttırmada olumlu sonuçlar doğuracağı beklenir.

Tablo 2'de verilen regresyon sonuçlarına göre değişkenlerini birçoğunun anlamlı olması ve Durbin Watson istatistiği değerinin düşük olması değişkenler arasında sahte ilişkilerin olabileceği şüphesi uyandırmaktadır. Bu nedenle çalışmada kullanılan seriler arasındaki uzun dönemli ilişkilerin varlığı Engle-Granger Eşbütünleşme Testi ile incelenmek istenmiştir. 2 numaralı denklemin hata terimi elde edilerek her bir modelin kalıntılarının durağanlığı ADF (Genelleştirilmiş Dickey Fuller) testi ile sınanmıştır. Eğer her bir model için elde edilen hata terimleri düzey değerinde durağan ise serilerin eşbütünleşik olduğuna ve seriler arasında uzun dönemli ilişkilerin bulunduğu karar verilir (Gujarati, 2009: 726).

$$u_{i,t} = LTOUR_{i,t} - \beta_{0it} - \beta_1 LGDPPC_{i,t} - \beta_2 LPOP_{i,t} - \beta_3 LDIST_{i,t} - \beta_4 DUM_{i,t} - \mu_i - \lambda_t \quad (3)$$

Modellerin hata terimlerinin durağanlıkları Tablo 3'te verilmiştir.

Tablo 3: Engle-Granger Eş-bütünleşme Analizi Sonuçları

İstatistik	Model 1	Model 2	Model 3	Model 4
ADF Chi Kare İstatistiği	242,26 ^A	247,70 ^A	248,86 ^A	241,36 ^A
ADF-Choi Z istatistiği	-3,298 ^A	-3,559 ^A	-3,658 ^A	-3,29 ^A

Not: Birim kök testlerinde Schwartz bilgi kriteri dikkate alınmıştır. Maksimum gecikme 11 seçilmiştir. A sırasıyla %1 önem düzeyini belirtir.

Eş bütünleşme testi sonuçlarına göre her bir modelden elde edilen hata terimleri %1 önem düzeyinde durağan bulunmuştur yani seriler arasında uzun dönemli ilişkinin var olduğuna karar verilmiştir. Böylece Tablo 2’de değişkenler arasında verilen uzun dönemli ilişkilerin bulunduğu ve sahte regresyon problemiyle karşılaşılmadığı sonucuna ulaşılmıştır.

4.Sonuç

Çalışmada Türkiye’ye yönelik turizm talebini etkileyen faktörler çekim modeli taslağı altında incelenmiştir. Elde edilen sonuçlara göre; Türkiye’ye gelen ziyaretçilerin gelir seviyeleri ile ziyaretçilerin geldikleri ülkelerin nüfus potansiyeli Türkiye turizm talebini önemli ölçüde ve pozitif yönde etkilemektedir. Türkiye’ye yönelik turizm talebinin gelir esnekliği 1’den büyük yani elastik bulunmuştur. Elde edilen bu veriye göre global açıdan yaşanan olumlu ekonomik gelişmeler Türkiye turizm talebi üzerinde etkili sonuçlar doğuracaktır. Türkiye’yi ziyaret eden yabancıların gelirlerinde meydana gelecek %1’lik bir artışa turizm talepleri %1’den daha fazla artışla tepki gösterecektir. Ancak küresel ekonomik gelişmeler olumsuz yönde seyrettiğinde ise yukarıda bahsedilen pozitif gelişmeler tersine dönecektir. Yani yabancı gelirlerinde meydana gelen düşüslere turizm talebinin de aynı yönde ve daha fazla tepki göstermesi beklenir. Mikro iktisadi perspektiften hareket edildiğinde Türkiye’ye yönelik turizm talebi yabancılarca zorunlu değil lüks mal olarak addedilmektedir. Ülkelerin nüfus artışıyla turizm talebi arasındaki ilişkinin ise pozitif olması Türkiye turizm talebinin artış potansiyelini yansıtmaktadır. İlgili değişkenin istatistiki açıdan anlamlı olması ve 1’e yakın değer göstermesi turizm sektörünün geleceği hakkında iyimser ve pozitif bir yapı sergilemektedir.

Türkiye’nin ziyaretçi aldığı ülkelerin Türkiye’ye olan mesafesi ise turizm talebini olumsuz etkileyen önemli bir unsurdur. Türkiye’ye coğrafi olarak uzak olan bölgelerde (Latin Amerika, Uzak Doğu Asya ve Okyanusya gibi) kamu destekli reklam ve ucuz ulaşım (ucuz tarifeli THY uçuşları) gibi politikalarla turizm sektörü teşvik edilebilir. Böylece mesafenin dezavantajını minimize edilip turizmde pazar çeşitlenmesi sağlanabilir.

Yapılan ampirik analiz göstermiştir ki Türkiye’nin politik, kültürel, sosyolojik ve ekonomik yönden ilişkide bulunduğu ülkelerden daha fazla ziyaretçi almaktadır. Türkiye’nin etnik bağlarını temsilen oluşturulan DUM2, AB üyelerini temsilen oluşturulan DUM3 ve NATO üyesi ülkeleri temsilen oluşturulan DUM4 değişkenlerinin katsayıları pozitif ve istatistiki açıdan anlamlı bulunmuştur. Türkiye’nin siyasi, askeri, ekonomik ve etnik bağlarının bulunduğu ülkelerden daha fazla ziyaretçi çektiği göz önünde bulundurulursa, Türkiye tarafından uluslararası çevrede gerçekleştirilen her faaliyet turizmi olumlu yönde etkileyecektir. Özellikle Latin Amerika Ülkeleri, Uzak Doğu ve Okyanusya ülkeleriyle gerçekleştirilecek ekonomik ve siyasal ilişkiler turizmde uzak mesafenin olumsuz etkilerini minimize edip turizm gelirlerini arttıracığı beklenmektedir.

Kaynakça

- BALTAGİ, B. H. (2008). *Econometric Analysis of Panel Data*. İngiltere: John Wiley & Sons, Ltd
- CHU, FONG-LİN, (2008). A Fractionally Integrated Autoregressive Moving Average Approach to Forecasting Tourism Demand. *Tourism Management*. 29 (2008), 79-88.
- CHU, FONG-LİN, (2009). Forecasting Tourism Demand with ARMA-Based Methods, *Tourism Management*. Volume:30, Issue:5,740-751.
- ÇEKEN HÜSEYİN, DALGIN TANER VE LEVENT KARADAĞ, (2009). Küreselleşme ve Uluslararası Turizm Arasındaki İlişki, Muğla Üniversitesi. *Sosyal Bilimler Enstitüsü Dergisi*. Bahar 2009,(22),21-36.
- ÇİMAT ALİ, BAHAR OZAN, (2003). Turizm Sektörünün Türkiye Ekonomisi İçindeki Yeri ve Önemi Üzerine Bir Değerlendirme. *Akdeniz İ.İ.B.F. Dergisi*. (6),1-18.
- ÇUHADAR, MURAT, GÜNGÖR İBRAHİM VE ALİ GÖKSU, (2009). Turizm Talebinin Yapay Sinir Ağları İle Tahmini ve Zaman Serisi Yöntemleri İle Karşılaştırmalı Analizi: Antalya İline Yönelik Bir Uygulama. *Süleyman Demirel Üniversitesi, İ.İ.B.F. Dergisi*. 209,14,(1),99-114.
- DİLBER, İLKAY, (2007). Turizm Sektörünün Türkiye Ekonomisi Üzerindeki Etkisinin Girdi-Çıktı Tablosu Yardımıyla Değerlendirilmesi. *Yönetim ve Ekonomi*. 14(2),205-220.
- GOH, CAREY, ROB, LAW, (2002). Modeling and Forecasting Tourism Demand for Arrivals with Stochastic Nonstationary Seasonality and Intervention, *Tourism Management*. 23, (2002), 499-510.
- GUJARATI, DAMODAR (2009). Temel Ekonometri, Literatür Yayıncılık, İstanbul
- GÜLBAHAR, ONUR, (2009). 2000'li Yıllarda Türkiye'ye Gelen Yabancı Ziyaretçi Profili. *C.Ü. İktisadi ve İdari Bilimler Dergisi*. Cilt 10, Sayı 2, 93-112.
- HANAFİAH, MOHD HAFİZ MOHD, HARUN, MOHD FAUZİ VE MOHD RAZİFF JAMALUDDİN, (2011). Trade and Tourism Demand: A Case of Malaysia. *2010 International Conference on Business and Economic research*. Vol. 1, 1-4, IACSIT Pres, Kuala Lumpur, Malaysia.
- İŞLER, ÖZLEM, (2009). *Türkiye'de Turizm ve Havayolu Analizi*, Yayınlanmamış Yüksek Lisans Tezi, Kadir Has Üniversitesi, Sosyal Bilimler Enstitüsü, İstanbul.

- IM, K. L., PESARAN, M. H. VE SHİN, Y. (2003). Testing for Unit Roots in Heterogeneous Panels. *Journal of Econometrics*. 115: 53–74.
- KARAGÖZ, KADİR (2008), Türkiye'nin Turizm Potansiyeli: Çekim Modeli Yaklaşımı, *Anatolia: Turizm Araştırmaları Dergisi*, Cilt 19, Sayı 2, Güz: 149-156, 2008.
- KOZAK NAZMİ, MERYEM A. KOZAK VE METİN KOZAK, (2011). *Genel Turizm İlkeler-Kavramlar*. Detay Yayıncılık, 11. Baskı. Ankara.
- LEVİN, A., LİN, C. F. VE CHU, C. J. (2002). Unit Root Tests in Panel Data: Asymptotic and Finitesample Properties. *Journal of Econometrics*. 108: 1– 24.
- MUCHAPONDWA, EDWİN VE PİMİDZAI, OBERT, (2011). Modelling International Tourism Demand for Zimbabwe. *International Journal of Business and Social Science*. Vol.2, No.2,71-81.
- OLALI, HASAN, (1979). *Turizm ve Sanat Eğitimi Dersleri*. İstiklal Matbaası, İzmir.
- KHADAROO, JAMEEL VE SEETANAH, BOOPEN, (2008) The role of transport infrastructure in international tourism development: A gravity model approach, Volume 29, Issue 5, October 2008, p: 831-840
- SONG, HAIYAN, LI GANG, WITT, STAPHEN F., VE BAOGANG FEI, (2010). Tourism Demand Modelling and Forecasting: How Should Demand Be Measured?. *Tourism Economics*. 2010, 16 (1),63-81.
- TANDOĞAN, VEHBİ UĞUR, (1998). Dünya turizm talebi eğilimleri ışığında Türkiye'ye yönelik yat turizm talebinin değerlendirilmesi. *Balıkesir Üniversitesi, sosyal Bilimler Enstitüsü Dergisi*. (1),145-155.
- TATOĞLU, YERDELEN FERDA (2012), Panel Veri Ekonometrisi: Stata Uygulamalı, Beta Yayınevi, İstanbul
- TİNBERGEN, J. (1962) An Analysis of World Trade Flows, J.Tinbergen (ed):Shaping the World Economy, New York: The Twentieth Century Fund.
- TRAVEL & TOURİSM ECONOMIC IMPACT 2012, (2010). *World, World Travel & Tourism Council*. Türkiye Turizm Sektörü Raporu, 2010, Türkiye Cumhuriyeti Başbakanlık Yatırım Destek ve Tanıtım Ajansı, Ocak 2010.
- 2012 INTERNATIONAL TOURİSM RESULTS AND PROSPECTS FOR 2013, *World Tourism Organization* (UNWTO) <http://mkt.unwto.org/en/barometer>, Erişim Tarihi: 22.03.2013

- T.C. KÜLTÜR VE TURİZM BAKANLIĞI, <http://www.kultur.gov.tr/> Erişim tarihi: 22.02.2013
- UNWTO Tourism Highlights, 2015 Edition, <http://www.e-unwto.org/doi/pdf/> Erişim Tarihi: 11.09.2015
- UYSAL, MUZAFFER. (1998). *The Economic Geography of The Tourist Industry A Supply-side Analysis, The Determinants of Tourism Demand*, (Editors D.Çoannides and K Debbage), Routledge, London.
- YAVUZ, SELAHATTİN; KABADAYI, BURHAN; SAVAŞ, NURETTİN ve DOKER, ASLI CANSIN (2014), “Türkiye turizm talebi: bir çekim modeli uygulaması”, *Ekonomik ve Sosyal Araştırmalar Dergisi*, Cilt 10, Yıl 10, Sayı 2, 2014
- YORGUN, SAYIM. (2013). *Turizm Sektörü İstihdam Raporu*, Kocaeli Üniversitesi, İ.İ.B.F. Mart 2013.
- <http://www.tursab.org.tr>, Erişim tarihi: 22.02.2013
- <http://www.timeanddate.com/worldclock/distance.html>, Erişim tarihi: 14.09.2015
- <http://www.tuik.gov.tr>, Erişim tarihi: 22.02.2013
- <https://www.cia.gov/library/publications/the-world-factbook/>, Erişim tarihi: 14.09.2015
- <http://www.worldbank.org/>, Erişim tarihi: 14.09.2015
- <http://yigm.kulturturizm.gov.tr/>, Erişim tarihi: 11.09.2015

Gelişmekte Olan Ülkelerde Yaygın Eğitimin Yoksulluğu Azaltma Üzerindeki Etkisi

Impact of Non-Formal Education on Reduction of Poverty in Developing Countries

Murat ÇOKGEZEN¹
Oyun-Erdene ERDENE²

ÖZET

Son yıllarda hızla artan yoksulluk ile birlikte hem ulusal hem de uluslararası düzeyde yoksulluğu önlemek amacıyla çeşitli politikalar uygulanmaktadır. Bu politikalar içinde yaygın eğitim, avantajlarının ve özelliklerinin ülke yapısına uygun olması gereğiyle gelişmekte olan ülkelerde çok sık uygulanmaktadır.

Bu çalışma, yoksulluğu azaltıcı bir politika olarak yaygın eğitim ve gelişmekte olan ülkelerde yaygın eğitimin yoksulluğu azaltma üzerindeki etkisini inceleyen bir literatür taraması niteliğindedir. Konu ile ilgili yayınlanmış kitaplar, makaleler ve diğer veriler incelenmiş, elde edilen sonuçlar konu ile ilişkilendirilerek yorumlanmıştır. Sonuçlar, bazı aksaklıklar olsa da, yaygın eğitimin gelişmekte olan ülkelere uygun bir model olduğunu ve yoksulluğu azaltmada olumlu etkisinin olduğunu göstermektedir.

Anahtar Kelimeler: Yoksulluk, yaygın eğitim, gelişmekte olan ülkeler

ABSTRACT

In recent years, there are various policies to alleviate poverty in both nationally and internationally level. In these policies, non-formal education is suitable in developing country according to its features and advantages and is applied too often. The article has examined the impact on poverty reduction of non-formal education in developing countries as a policy to reduce poverty. In this research the method of literature has used. Books, articles and other data related to topic were analyzed. Moreover, five countries were selected and analyzed. The results of examples and studies show that non-formal education is suitable model for developing countries and its very effective on reducing poverty.

Keywords: Poverty, non-formal education, developing countries

¹Prof.Dr., Marmara Üniversitesi, İktisadi ve İdari Bilimler Fakültesi, İktisat Bölümü, mcokgez@marmara.edu.tr

²Marmara Üniversitesi, Sosyal Bilimler Enstitüsü, İktisat Teorisi Yüksek Lisans Öğrencisi, oyunerdene98@yahoo.com

1. GİRİŞ

Gelişmekte olan ülkelerin yanında gelişmiş ülkelerin de en önemli sorunlarından biri olan yoksulluk, insanlık tarihi kadar eski bir olgudur. Üzerinde görüş birliğine varılan bir tanımla bulunmamakla birlikte genel olarak yoksulluğu; insanların temel ihtiyaçlarını karşılayacak ödeme gücüne sahip olmaması durumu olarak tanımlayabiliriz. Dünyada toplam nüfusun 2.8 milyarı Dünya Bankası tarafından belirlenen 2\$ yoksulluk sınırının altında hayatını sürdürürken 1.2 milyarı ise 1\$ açlık sınırının altında yaşamaktadır. Güney Asya nüfusun %44'ü 1\$ yoksulluk sınırı altında yaşamakta ve günde binlerce çocuk sadece açlık nedeniyle yaşamını yitirmektedir. (Khan & B.Williams, 2006, s.5)

Yoksulluğun olumsuz etkilerini önlemek, gerek ulusal gerekse uluslararası kuruluşların en önemli çabalarını oluşturmaktadır. Yoksullukla mücadelede kullanılan ve son zamanlarda gelişmekte olan ülkelerin ilgisini çeken araçlardan biri ise yaygın eğitimidir. Yaygın eğitim, örgün eğitimin dışında ve yanında düzenlenen, örgün eğitimden yararlanamayan, dezavantajlı insanları hedef alan, örgün eğitime göre daha esnek bir eğitim sistemidir. Yaygın eğitimin amacı, okumamış, okulu bırakmış, işsiz ve yoksul insanlara ihtiyaç duyduğu alanlarda eğitim düzenleyerek onların bilgi ve becerisini yükseltmek, kazançlarını artırmak ve hayat standartlarını iyileştirmektir.

Çalışmada sadece gelişmekte olan ülkelerin yoksulluk ile mücadele politikalarından yaygın eğitim ele alınmıştır. Diğer ülkeler çalışmanın kapsamı dışında bırakılmıştır. Bu çerçevede makale, gelişmekte olan ülkelerde olan yoksulluğu azaltmada yaygın eğitimin rolünü incelemeyi hedeflemiştir. Bunu yaparken yoksulluğun ne olduğu, yoksulluk ile nasıl mücadele edildiği, yaygın eğitimin yoksulluğu azaltmada rolü, gelişmekte olan ülkelerde yaygın eğitim neden daha çok tercih edildiği ve bu ülkelerde yaygın eğitim yoksulluğu azaltmada nasıl etkili olduğu konular incelenmiştir.

Çalışmada yer alan gelişmekte olan ülkelerde uygulanmış yaygın eğitim programları konusuna ilişkin verilerin eksik olması, elde edilen verilerin birbirini tutmaması ve uygulanan yaygın eğitim programlarının verimliliğinin kesin olarak ölçülme imkanının bulunmaması çalışmanın sınırlılıklarını oluşturmaktadır. Bu sınırlar altında konu ile ilgili yayımlanmış kitaplar, makaleler ve diğer veriler incelenmiştir. Elde edilen veriler birbirleri ile ilişkilendirilerek yorumlanmaya çalışılmıştır. Bunun yanında beş ülke örneği seçilmiş ve yoksulluk ile ilgili yaygın eğitim arasındaki ilişkiler karşılıklı olarak değerlendirilmiştir.

Makale üç ana başlık şeklinde kurgulanmıştır. Buna göre çalışmanın ilk bölümünde, yoksulluğun ve eğitimin tanımı yapılmış, yoksulluk ile eğitim arasındaki ilişki incelenmiştir. Böylelikle yoksulluğun önemli bir sorun olduğu, yoksulluğu azaltmak için çeşitli politikaların üretilmesi gerektiği ve bu politikalar içinde eğitimin önemli bir araç olabileceği belirtilmiştir. İkinci bölüm, yaygın eğitim ve onun yoksulluğu azaltmadaki rolü üzerine durulmaktadır. Bu şekilde yaygın eğitimin neden örgün eğitime göre farklı, ne açıdan avantajlarının olduğu ve gelişmekte olan ülkelerde neden daha çok önerildiği iyi anlaşılacaktır. Son olarak ise gelişmekte olan ülkelerdeki bazı yaygın eğitim uygulamalarının sonuçları ve aksaklıklarını inceleyen çalışmalar ele

alınmıştır. Bu şekilde, yaygın eğitimin gelişmekte olan ülkelerde uygulandığı zaman hangi sonuçları doğurduğu, yoksulluğu azaltmada nasıl etkili olduğu, uygulama sırasında karşılaşılan aksaklıkların ne olduğu ve bunların nasıl giderilmesi gerektiği daha detaylı olarak incelenmiştir.

2. Temel Kavramlar: Yoksulluk ve Eğitim

2.1 Yoksulluk Tanımı

Yoksulluk farklı özelliklere sahip çok boyutlu karmaşık bir sorun olması nedeniyle tanımlama farklılıklarına yol açmaktadır. Yoksulluk birçok yazar tarafından farklı şekilde tanımlanmıştır. Yoksulluğun ilk anlamlı tanımı İngiliz iktisatçı Reebom Roventree tarafından yapılmıştır. Ona göre yoksulluk, insan varlığının devamı için gerekli olan yiyecek, içecek ve barınma gibi en temel ihtiyaçlarının karşılanamaması durumudur. (Field, 1983, s.51) Dünya Bankası ise yoksulluğu, maddi açıdan mahrumiyetler nedeniyle kaynaklara ve üretim faktörlerine ulaşamama, asgari bir yaşam düzeyi sürdürebilecek gelirden yoksun olma durumu olarak daha çok parasal açıdan tanımlamaktadır.

Yoksulluğun nasıl tanımlandığına bağlı olarak türleri de değişiklik göstermektedir. En kabul gören sınıflandırma ise yoksulluğu görel ve mutlak yoksulluk olarak ikiye ayırmaktadır. (Servaas, V.B, 2008, s.1) Buna göre mutlak yoksulluk, hanehalkının ya da bireyin asgari yaşam düzeyi sürdürebilecek için gıda, barınak ve yiyecek gibi en temel ihtiyaç maddelerini karşılayamaması durumudur. Mutlak yoksulluk sınırı, bu asgari düzeyi yakalamayanların toplam nüfusa oranıdır. Bu sınırın hesaplanmasında üç yaklaşım mevcuttur. Bunlar; 1) Kişilerin tüketmesi gereken günlük en az kalori miktarı, 2) Gelirinin gıdaya ayırdığı kesim (%40) ve 3) Dünya Bankası tarafından açıklanan günlük minimum dolar miktarıdır (1.\$, 2\$) ve bunlar mutlak yoksulluk sınırı olarak kabul edilmektedir. (Servaas, V.B, 2008, s.2)

Görel yoksulluk ise, insanların temel ihtiyaçlarını karşılayabilmesine rağmen kişisel kaynaklarının yetersizliği nedeniyle toplumun genel refah düzeyinin altında kalması durumudur. Mutlak yoksulluğun aksine görel yoksulluk toplum tarafından belirlenmektedir.

Mutlak yoksulluk daha çok açlık ve hastalık şeklinde gelişmekte olan ülkelerde görülürken, görel yoksulluk ise dışlanma ve eşitsizlik olarak gelişmiş ülkelerde ortaya çıkmaktadır. Başta Dünya Bankası olmak üzere uluslararası yardımcı kuruluşlar dikkatini, yoksulluğun daha yoğun yaşandığı gelişmekte olan ülkelere vermekte ve o ülkelerde yoksulluğu azaltmak için çeşitli politikalar üretmektedir.

2.2 Eğitim

Eğitim, doğum ile başlayıp hayat boyu devam eden ve sosyal, kültürel ve bireysel boyutları aynı anda içinde bulundurduğu için tanımlanması zor bir kavramdır. Yoksullukta olduğu gibi, eğitimin de herkesçe kabul edilen evrensel bir tanımı bulunmamaktadır. Her ne kadar görüş birliğine varılan tek bir tanımı olmasa da eğitimi genel olarak, kültürün genç kuşaklara aktarılması ve toplumun varlığını sürdürebilmesi için gerekli sosyal değişimleri yapabilecek yaratıcı kişilerin yetiştirilmesi olarak tanımlamak mümkündür.

Dar ve geniş anlamda olmak üzere eğitimi iki açıdan tanımlamak mümkündür. Dar anlamda eğitim, öğrenim ile eş anlamlıdır. Başka bir deyişle, okul ve kolej gibi planlı ve belirli bir amaca yönelik olarak kurulmuş eğitim kurumları aracılığıyla öğrenim görme süreci olarak tanımlanabilir. Dolayısıyla, bu süreç çocukların okula kayıt olması ile başlar, mezun olması ile biter. Geniş anlamda ise eğitim, hayat boyu devam eden bir süreçtir. (Kumar, s.4-5) Eğitim bu anlamda okul ile sınırlı mekanda, sınırlı zaman diliminde gerçekleşmez. Onun aksine insanların hayat boyu yaptığı seçim, hata ve tecrübelerden oluşan bir süreçtir. Dolayısıyla bu anlamda eğitimden tüm bireyler isteyerek veya istemeyerek hayatı boyunca yararlanmaktadır.

Eğitimin tek bir amacı yoktur, aksine sosyal, ekonomik ve toplumsal her alanda hizmet vermektedir. Topluma faydalı insan yetiştirmek, onları yönlendirmek, bilgilendirmek, davranışlarını biçimlendirmek, nitelikli işgücü hazırlamak, toplumsal düzeni kurmak, eşitsizlikleri azaltmak, sağlık şartlarını iyileştirmek ve ekonomik büyümeyi hızlandırmak eğitimin amaçları arasında sıralanabilir.

Eğitimi örgün eğitim, enformel eğitim ve yaygın eğitim olarak üçe sınıflandırmak mümkündür. (Fordham, 1993, s.2)

Örgün eğitim, eğitimin dar anlamda tanımlandığı gibi okul ve diğer eğitim kurumları aracılığıyla, daha önceden belli amaçlar doğrultusunda belirlenmiş ders programına göre işlenen süreçtir. Örgün eğitimin, ilkokul, ortaokul, lise ve üniversite gibi değişik aşamaları olmaktadır.

Enformel eğitim, eğitimin geniş anlamda tanımlandığı gibi hayat boyu süren faaliyetlerden ve tecrübelerden oluşmaktadır. Müze ziyareti, gezi, film izlemek, haber ve gazete okumak ve ziyarete gitmek gibi günlük aktiviteler enformel eğitimi oluşturmaktadır.

Yaygın eğitim ise, örgün eğitimin yanında ve dışında düzenlenen, insanların istekleri ve ihtiyaçlarına odaklanarak faaliyette bulunan, önceden belirlenmiş bir eğitim programına ve belli amaçlara göre işlenen ve hayat boyu süren bir eğitim programıdır.

3. Yoksulluk ve Eğitim İlişkisi

Eğitim ile yoksulluk arasında kısır döngü şeklinde ilişki mevcuttur. Yoksulluk arttıkça eğitim imkanlara erişim azalmakta, eğitim düzeyi düştükçe de yoksulluk artmakta ve böylece çıkılmaz bir döngüye girilmektedir. Yoksulluk, kaynakların sınırlı olması, yetersiz beslenme, yüksek okul ücretleri ve yetersiz ebeveyn eğitimi gibi nedenlerle eğitime erişimini zorlaştırmakta, eğitim kalitesini düşürmektedir. Yoksulluğun nasıl ortaya çıktığına bağlı olarak eğitim üzerindeki etkileri de değişiklik gösterebilmektedir. Gelişmekte olan ülkelerde yaygın görülen mutlak yoksulluk durumu temel ihtiyaçlara erişememe, yetersiz beslenme ve kötü sağlık koşulları gibi nedenlerle ortaya çıkar, çocukların okula erişimini, okula devam etmelerini ve başarılı olmalarını olumsuz yönde etkiler. Buna karşın gelişmiş ülkelerde çocuklar, din, ırk, dil ve ekonomik statü farklılıkları nedeniyle yaşadığı toplumundan dışlanabilirler, sosyal ve ekonomik sürece etkin katılımları engellenebilirler. Bunlar çocukların öğrenme motivasyonunu ve ileride iyi bir iş sahibi olma ihtimalini olumsuz etkilemektedir. Bir ülkede eğitim seviyesinin yükselmesi bireysel ve toplumsal olarak birçok olumlu etki doğurmaktadır. Bireysel olarak eğitim seviyesinin artması, bireylerin bilgi, beceri ve verimliliği artırarak onların işsiz kalma riskini, işsizlik süresini azaltmakta, yaşam standardını iyileştirmekte, gelir ve kazançlarını artırarak onları "yoksul" olmaktan korumaktadır. Toplumsal olarak eğitim seviyesinin yükselmesi ise, sağlık, okullaşma oranı ve cinsiyet eşitliği üzerine olumlu etki yapmakta, suç, doğurganlık oranı ve çocuk ölüm oranlarını azaltmaktadır. (Servaas, V.B, 2008, s.1-18)

Boissiere ve Angus Maddison'un yaptığı çalışmalar 19. Yüzyıl başlarından günümüze Avrupa'da kişi başına düşen milli gelir ve büyüme oranının okullaşma süresi ile paralel geliştiğini göstermektedir. 1993 yılında Avrupa'da okula gitme süresi 6-7 yıl iken kişi başı GSYİH 3.473 dolardı. 2000 yılına gelindiğinde okula gitme süresi 10 yıla, kişi başı GSYİH 27.770 dolara yükselmiştir. Kişi başı GSYİH'da meydana gelen bu artış tamamen okula gitme süresinin artmasından kaynaklandığı anlamına gelmesi bile okula gitme süresi ile GSYİH arasında güçlü bir ilişki olduğunu göstermektedir. (Çokgezen, Terzi, 2008, s.3)

Eğitimin yoksulluk üzerinde etkilerini bireysel ve toplumsal olmanın yanında aynı zamanda dolaylı ve dolaysız olarak da ele alabiliriz. Dolaylı olarak eğitim, gelir ve kazancı artırarak gelir yoksulluğu üzerinde etkili olabilmektedir. Dolaysız olarak ise eğitim, geliri artırarak temel ihtiyaçlarının yerine getirilmesini sağlar, sağlık ve eğitim hizmetlerine erişimini kolaylaştırır dolayısıyla hayat standardını yükselterek insani yoksulluğu azaltır.

Yoksulluk ile eğitim arasındaki bu kısır döngüyü kırabilmek için birçok çalışma yapılmaktadır. Bu çalışmalar yoksulluğu azaltarak eğitime erişimini kolaylaştırmak amacıyla olabileceği gibi eğitim seviyesini yükselterek de yoksulluğun azalmasını hedeflemiş olabilmektedir. Bunun için öncelikle yoksulluğun analizi yapılmalıdır. Çünkü ülkenin ekonomik ve sosyal yapısına bağlı olarak uygulanacak eğitim politikaları değişiklik gösterebilmektedir. Bazı ülkeler örgün eğitime daha çok önem

verirken bazıları ise örgün eğitimin yanında yaygın eğitim politikasını da beraberinde uygulamaktadır.

4.Yaygın Eğitim ve Yaygın Eğitimin Yoksulluğu Azaltmada Rolü

4.1 Yaygın Eğitim

Yaygın eğitim, örgün eğitimin yanında ve dışında düzenlenen daha önceden planlanmış tüm eğitim aktivitelerinden oluşmaktadır. (Etlng, 1993, s.73) Yaygın eğitim, önceden belirlenmiş hedef doğrultusunda faaliyette bulunması açısından örgün eğitime benzemektedir. Ancak, yaygın eğitim örgün eğitimden yaş sınırlamasının olmaması, esnek bir yapıya sahip olması, daha geniş kitleyi kapsama kapasitesinin bulunması, katılımcıların istek ve ihtiyaçlarına uygun eğitim programlar düzenleniyor olması gibi birçok açıdan farklıdır.

Yaygın eğitimin amacı; okuma yazma bilmeyen, okula gitmeyen, okuldan geri kalan çocuklar, işsiz ve yoksul gençlere okuma yazma temel eğitim, mesleki eğitim ve gelir getirici aktiviteler gibi çeşitli eğitim programlar sunarak onların okula devam etmelerini, istihdam edilebilirliğini ve gelirlerini artırmak ve böylece işsizliği ve yoksulluğu azaltmada yardımcı olmaktır.

Gelişmekte olan ülkeler için önemli olan bu eğitimlerin yaygın eğitim ile verilmesinin daha uygun bir yöntem olabileceği konusunda tartışmalar günümüzde artmış durumdadır. Gelişmekte olan ülkelerde bu tür eğitimleri düzenlemede yaygın eğitimin örgün eğitime göre tercih edilmesinin birçok nedeni bulunmaktadır. İlk olarak, yaygın eğitim örgün eğitime göre maliyet açısından etkindir. Yaygın eğitim programlarda, ülkenin özelliklerine göre değişmekle birlikte, genelde radyo, televizyon, internet, CD, DVD, kitap ve dergi gibi araçlar kullanılmaktadır. Bu araçlar aynı anda geniş kitleye ulaşabilme kapasitesine sahip ve dolayısıyla maliyet açısından etkindir. Bu nedenle birçok ülke tarafından yaygın şekilde kullanılmaktadır. Yaygın eğitimin örgün eğitime göre maliyet açısından ne kadar etkin olduğunu iyi görebilmemiz için Nijerya örneği verilebilir. Nijerya'da ticaret sertifikasına sahip olmak isteyen kişilerin üç senelik ticaret lisesini bitirme zorunluluğu bulunmaktadır ve üç senelik ticaret lisesinin maliyeti toplam 2790\$'dır. Aynı eğitim programı Mesleki Geliştirme Merkezleri (MGM) tarafından yaygın eğitim yoluyla da sağlanabilmektedir. MGM tarafından verilen bu programın maliyeti ise üç senelik ticaret lisesi maliyetine göre neredeyse 27 kat daha ucuzdur. (Coombs, P.H & Ahmed, M. 1974, s.184)

İkinci olarak, yaygın eğitimin örgün eğitime göre daha esnek bir yapıya sahip olması öğrencilere istediği zaman istedikleri yerden eğitime erişebilme imkanı vermektedir. Yaygın eğitim programların çoğu, televizyon, radyo ve internet yoluyla, CD, DVD, gazete, dergi ve kitap kullanımı ile verilmekte ve bu durum kişilerin eğitim için zaman ayırması zorunluluğunu kaldırmakta, evden, işyerinden eğitime ulaşımı mümkün kılmaktadır. Böylece bir taraftan çalışanların işlerini aksatmadan eğitim alabilmeleri

sağlanmakta, diğer taraftan ise ulaşım, okul araç gereç, üniforma gibi parasal yükler azaldığı için birçok yoksula okuma fırsatı sunulmaktadır.

Üçüncü olarak, yaygın eğitim programları genellikle öğrencilerin istek ve ihtiyaçlarını göz önünde bulundurarak piyasasının ihtiyaç duyduğu alanlarda eğitim programları düzenlediği için piyasa ihtiyaçları ile örgün eğitim kurumları arasındaki uyumsuzluğu minimize edilebilmektedir. 1970'li yıllarda gelişmekte olan ülkelerde ciddi bir kriz yaşanmıştır. Bu kriz sadece finansal krizi değildi, aynı zamanda teknolojik ve ekonomik gelişmelere örgün eğitiminin cevap verememesi sonucu oluşan eğitim ile istihdam arasındaki ciddi uyumsuzluğu sonucu oluşan piyasa aksaklığıydı. (Cooms, P.H & Ahmed, M. 1974, s.3) Yaygın eğitim de bu uyumsuzluğun minimize edilmesinde seçilecek en uygun eğitim programıdır. Çünkü yaygın eğitim programları ile piyasanın ihtiyaç duyduğu alanlarda personel yetiştirilebilmekte, piyasada fazla bulunan mesleğe sahip kişi sayısı azaltılabilmekte ve böylece işsizlik sayısı düşmekte, piyasa verimliliği artmaktadır.

Son olarak yaygın eğitim yoluyla verilen eğitimler gelişmekte olan ülkelerin ihtiyacını karşılayabilme niteliktedir. Gelişmiş ülkelerde kolej ve üniversite gibi üst düzey eğitimler daha önemli iken, gelişmekte olan ülkelerde ise okuma yazma, temel eğitim, aile eğitimi gibi hayatın en temel konuları ile ilişkili eğitimler daha önemlidir. Gelişmiş ülkelerde talep edilen doktor, mühendis gibi yüksek eğitimin yaygın eğitim yoluyla verilmesi imkânsız iken, gelişmekte olan ülkelerde önemli olan, okuma yazma eğitimi, mesleki eğitim, aile planlama gibi eğitimlerin yaygın eğitiminin özelliğine uygun, yaygın eğitim yoluyla verilebilir olması, gelişmekte olan ülkelerde yaygın eğitimin tercih edilmesinin önemli bir nedenini oluşturmaktadır.

4.2 Yoksulluğu Azaltıcı Bir Politika Olarak Yaygın Eğitim

“Yaygın eğitimin örgün eğitime göre birçok avantajının bulunuyor olması, onun yoksulluğu azaltmada iyi bir araç olabileceği anlamına gelir mi?” veya “Yaygın eğitim yoksulluğun azaltılmasında nasıl etkili olur?”. Konu ile ilgili literatürde bu soruları cevaplamayı hedefleyen birçok çalışma bulunmaktadır. Coombs ve Ahmed ‘‘Attacking rural poverty, how non-formal education can help’’ başlıklı çalışmasında, gelişmekte olan ülkelerde nüfusun çoğunun kırsal bölgede yaşadığını, dolayısıyla o bölgelerde istihdam ihtiyacının daha fazla olduğu ve yaygın eğitimin bu ihtiyacı karşılamada en iyi yöntem olduğu belirtmiştir. Bu amaçla düzenlenen yaygın eğitim programları, mesleki eğitim, tarımsal eğitim, çiftçi eğitimi, dikiş ve el sanatları gibi konulardan oluşmaktadır. Çalışmada birçok ülkede kırsal bölgede uygulanan yaygın eğitimler incelenmiştir. Ülkelerden elde edilen sonuç, iyi planlanmış ve kırsal bölgelerde uygulanan yaygın eğitimlerin kırsal bölgenin gelişmesine, çiftçilerin gelirlerini ve verimliliklerini artırmasına önemli katkı sağladığını göstermektedir.

Başka bir çalışma Ruud Van Der Veen ve Julia Preece'nin ‘‘Yoksulluğu Azaltmak ve Yetişkin Eğitim’’ adlı çalışmasıdır. Bu çalışma yetişkin eğitiminin yoksulluğu azaltmada etkili bir yöntem olduğunu savunmaktadır. Günümüzde yetişkin eğitim politikasının daha çok okuma yazma ve temel eğitime odaklandığı görülmektedir. Ama yetişkin eğitimi okuma yazma ve temel eğitimden daha kapsamlı bir kavramdır ve

yoksulluğu azaltmak amacıyla uygulanan yetişkin eğitimlerinin okuma yazma ve temel eğitimin yanında, tarımsal destekleme faaliyetleri, vatandaşlık eğitimi ve mesleki eğitimi de kapsayarak uygulanması gerekmektedir. Bunlar sağlandığı zaman uygulanan yetişkin eğitim politikası yoksulluğu azaltmada başarılı bir sonuç alabilmektedir. (Veen & Prece, 2005, s.381-385)

Habibullah Khan ve Jeremy B. Williams'ın "Eğitime Erişimi Yoluyla Yoksulluğu Azaltmak: E-Öğrenme Buna Yardımcı Olur Mu?" adlı çalışması ise, yoksulluğu azaltmada e-öğrenimin iyi bir yöntem olduğunu savunmaktadır. Ekonomik ve teknolojik gelişmenin hızlı yaşandığı günümüz dünyasında internet ve iletişimin artık çok kolay olduğu ve bunların yardımı ile daha geniş kitleye uygun maliyetle eğitimi ulaştırılması mümkün olmuştur. E-öğrenme, insanlara zaman ve mekan sınırlamasına bağlı kalmadan istedikleri bilgiye, istediği yerden ulaşma imkanı tanımaktadır. Ayrıca maliyet açısından etkin, uygulamanın kolay ve daha geniş kitleyi kapsama kapasitesine sahip olması nedeniyle gelişmekte olan ülkelerde yoksulluğu azaltmak için uygulanması önerilmektedir. Gelişmekte olan ülkelerde internet ve bilgisayar gibi e-öğretim için gerekli araçların bulunmaması, e-öğrenmenin genişletilmesi ve geliştirilmesinin zor olması gerekçesiyle geleneksel eğitime göre daha maliyetli bir uygulama olduğu görünümü verebilir. Fakat yapılan çalışmalar bilgisayar ve internete yatırım yapılarak e-öğrenme yoluyla verilen eğitimin, eğitim tesisleri kurarak, öğretmen çalıştırarak verilen eğitim maliyetini %60 azalttığını göstermektedir. Bunun nedeni, her ne kadar e-öğrenmenin genişletilmesi ve geliştirilmesi ilk etapta maliyetli olsa da sistem oluşturulduktan sonra milyonlarca öğrenciye az maliyetle kolay yoldan eğitime erişebilme fırsatı sunmaktadır. Dolayısıyla daha az maliyetle daha çok kişiye ulaşma imkanı sağlanır ve yoksul ülkelerin de bu yöntemi kullanması kolaylaşır. Bu avantajı nedeniyle Dünya Bankası'nın yoksulluğu azaltmada bilgi ve haberleşme teknolojiye verdiği önem daha da artmış durumdadır. (Khan & B.Williams, 2006, s.1-14)

Tüm bu çalışmalar yaygın eğitimin yoksulluğu azaltmada önemli bir rol oynadığını ve birçok açıdan başarılı olduğunu göstermektedir. Ancak yaşanan bu başarılarının yanında bazı aksaklıkları da görülmektedir. Örneğin kırsal kesimde uygulanan mesleki eğitimler kalite açısından çoğu zaman zayıf kalmakta ve çok az sayıda kişiyi kapsayabilmektedir. Bunun yanında, birçok gelişmekte olan ülkede tarım sektöründeki işgücünün çoğunu kadınların oluşturmasına rağmen çiftçi eğitimleri kadınların önemini göz ardı etmekte, sınırlı sayıda kadını kapsamaktadır. Örneğin Asya'nın bazı bölgesinde pirinç ekiminin çoğunu kadınlar yapmakta ve Afrika'nın birçok yerinde kadınlar en az erkekler kadar veya bazen onlardan daha çok tarımda çalışmaktadır. Ayrıca birçok ülkede kadınlar tarımsal ürünleri depolama, pazarlama faaliyetlerde ve çiftlik yönetiminde erkeklerle göre daha çok görev üstlenmektedir. Dolayısıyla kızlar ve kadınlara tarımsal ürünleri ekme, muhafaza etme ve pazarlama gibi çeşitli konularda eğitim verilmesi gerekmektedir. Aksi takdirde tarımsal sektörde verimlilik düşük olabilmektedir. Bunun yanında kırsal kesimlerde tarım eğitimin yanında okul dışı kalan dezavantajlı gençlere yönelik genel eğitimler ve mesleki eğitimler çok nadir düzenlenmektedir. Uygulanan eğitimlerin çoğu ise insanların istek ve ihtiyaçları karşılayıcı nitelikte değildir. (Cooms, P.H & Ahmed, M, 1974, s.20)

Bir diğer aksaklık, tarım eğitimi ve yetenek geliştirici eğitimlerin çoğunun maliyetinin yüksek, finansmanın ise yetersiz olmasıdır. Finansmanın çoğu personel maaşları ve personelleri yetiştirmeye harcanmakta, programın birincil hedefi olan katılımcılara verilen eğitimlere, eğitimlerde kullanılan kaynaklara ise finansmanın çok az kısmı kalmaktadır. Bu durum eğitim kalitesini düşürmekte, katılımcıların istenen verimi programdan alamamasına neden olmaktadır. (Cooms, P.H& Ahmed, M, 1974, s.183) Gelişmekte olan ülkelere önerilen e-öğrenme eğitim programı temel ihtiyaçlarına bile ulaşamayan gelişmekte olan ülkelerde uygulanılmasının uygun olmaması nedeniyle eşitsizlikleri daha da artırabilmektedir. Shalti Gulati'ye göre, gelişmekte olan ülkelerde ileri teknoloji gerektiren eğitim programları yerine basılmış kaynaklar, radyo ve televizyon programları gelişmekte olan ülkelerde daha uygun bir yöntemdir. (Gulati, 2008, s.11-12)

Sonuç olarak yaygın eğitimin gelişmekte olan ülkeler için iyi bir model olduğu görüşünün birçok çalışma tarafından desteklendiğini, fakat hangi araçların kullanılacağı konusunda tartışmaların hala sürmekte olduğunu söyleyebiliriz. Bu yüzden yaygın eğitim programları, ülkenin özellikleri, ihtiyaçları göz önünde bulundurularak belirlendiği zaman başarılı olabilmektedir. Ülkenin bölgesel özelliği ve teknolojik gelişim seviyesinin yanında aynı zamanda ülkenin hangi alanda hangi mesleklere ihtiyacı olduğu, insanların neden eğitime erişemediği, onların eğitim alabilmeleri için nasıl bir yol izlenmesi gerektiği ve ülke yapısı için eğitimde hangi araçların kullanılmasının uygun olduğu da göz önünde bulundurulmalıdır.

4. 3. Ülke Örnekleri

Gelişmekte olan ülkelerde uygulanan yaygın eğitim projelerine örnek olmak üzere Gana, Uganda, Pakistan, Çin ve Bangladeş seçilmiştir. Bu ülkelerin seçilmesinin nedeni, hepsinin gelişmekte olan ülke olması ve dolayısıyla gelişmekte olan ülkelerde yoksulluk ve eğitim sektöründe yaşanan aksaklıkları, yaygın eğitimin bu sorunları nasıl etkilediğini daha somut biçimde görmemizi sağlayacaktır. Ayrıca verilen bu ülke örnekleri gelişmekte olan ülkelerde yaygın eğitimin iyi bir model olduğu görüşünü destekleyici niteliktedir.

4.3.1 Gana: Ulusal Fonksiyonel Okuma Yazma Eğitim Programı (World Bank, 2010, s 4-37)

Gana, Afrika kıtasında yer alan 25.9 milyon nüfusa sahip büyük bir ülkedir. Dünya Bankası kriterlerine göre Gana 1770\$ kişi başına GSYİH ile bu sıralamada düşük orta gelir ülke gurubunda yer almaktadır. (<http://www.worldbank.org/en/country/ghana>) Gana'da nüfusun yaklaşık dörtte biri yoksulluk içinde yaşamaktadır. Diğer önemli bir sorun ise, Gana'da okuryazarlık oranının çok düşük (%46) ve her bölgesinde farklı dil konuşuluyor olmasıdır. Ülke genelinde 15'ten fazla farklı dil bulunmaktadır, bu da beraberinde ortak dil sorununu getirmektedir.

Kapsamlı bir okuma yazma eğitimi ve yetişkin eğitimleri düzenleyerek okuma yazma bilmeyenlerin sayısını azaltmak, insanların fonksiyonel okuma yazma becerisini

geliştirmek amacıyla 1992 yılında Ulusal Fonksiyonel Okuma Yazma Programı-1 (UFOYP-1) başlatılmıştır. Program, 1998 yılına kadar en az bir milyon okuma yazma bilmeyen Gana'lıya okuma yazma öğretmeyi, okuma alışkanlığı oturtmayı ve edindiği bilgileri sürekli kullanacağı ortamı yaratmayı ve hayat kalitesini iyileştirmeyi hedeflemiştir. Proje kapsamında öğrencilere mesleki eğitim ve hayat becerileri, yurttaşlık eğitimi, çevre koruma, sağlık eğitimi ve aile planlama gibi eğitimler verilmiştir. Eğitimler basılmış kaynaklar ve radyo programların kullanımı ile verilmiş ve sınırlı sayıda yüz yüze eğitim de düzenlenmiştir. Programın maliyeti programı başarı ile tamamlayan her öğrenci için 43\$'dır.

Program sonunda ana hedef başarılı ile gerçekleşmiştir ve toplam 1.3 milyon kişi fonksiyonel okuma yazma becerisine sahip olmuştur. Program sadece insanlara okuma yazma eğitimi vermemiş, aynı zamanda programda kadınlara doğum öncesi süreçler, aşı yapma ve çocuk yetiştirme konusunda eğitimler de vermiştir. Bu durum doğurganlık ve çocuk ölüm oranının düşmesine, çocuk sağlığının iyileşmesine ve dolayısıyla yoksulluğun azalmasına katkıda bulunmuştur.

UFOYP-1'in 1998 yılında başarı ile sonuçlanmasının ardından 2000 yılında Gana'da programın devamı olan UFOYP-2 uygulanmaya başlamıştır. Çünkü ilk projenin bitmesinden sonra okuma yazma oranı hala düşüktü (%48) ve cinsiyetler arasında okuryazarlık oranı açısından hala büyük farklar görülmekteydi.

UFOYP-2'nin amacı, 2004 yılına kadar en az bir milyon okuma yazma bilmeyen kişiye okuma yazma ve temel eğitimi sağlamaktır. UFOYP-2 ilk programın devamı olduğu için uygulanış biçimi, eğitim teknikleri ve kapsadığı konular açısından ona benzemektedir. Eğitimde yine basılmış kaynaklar, radyo kullanımı ve sınırlı sayıda yüz yüze eğitim de düzenlenmiştir. Program kapsamında okuma yazma eğitimin yanında sağlık, hijyen, tarım teknikleri ve çocuk yetiştirme ile ilgili birçok eğitim düzenlenmiştir. Projenin maliyeti programı başarı ile tamamlayan her bir öğrenci için 101.1 \$'dır. Programın toplam maliyeti 46 milyon dolardır ve bunun 32 milyonu Dünya Bankası, 13.5 milyonu Gana Hükümeti ve geri kalan 0.5 milyonu ise diğer kurumlar tarafından sağlanmıştır.

Proje 2006 yılında sona erdiğinde belirlenen hedef başarı ile gerçekleşmiş, bir milyon insanı kapsama hedefi 1.195.000 olarak gerçekleşmiştir. Programın uygulandığı 2000-2007 yıllar arasında okuma yazma oranı Gana'da yüzde 55.8'den yüzde 65'e yükselmiştir. Bu artışın sadece program sayesinde gerçekleştiğini söylemek yanıltıcı olsa da programın uygulandığı yıllarda okuma yazma bilmeme sayısının bu kadar azalmış olmasında programın önemli katkısının olduğunu söylemek yanlış olmaz.

Daha önce bahsedildiği gibi program sadece katılımcıların fonksiyonel okuma yazma becerisini geliştirmekle kalmamış aynı zamanda sağlık, doğurganlık, çocuk bakımı, annelik ve çocukların eğitimi gibi konularda da olumlu gelişmeler göstermiştir. Yapılan çalışmalar, program sonunda katılımcıların çocuklarını okutmaya daha istekli ve teşvik edici olduğunu göstermektedir. Program sonunda katılımcıların %98'i çocuklarını

okutmaya teşvik ederken, programa katılmayanların ise %49'u (iki kat az) çocuklarını okutmaya teşvik ettiği gözlemlenmiştir.

Program, hedeflerine ulaşan başarılı bir uygulama olmasına rağmen bazı açıdan programın aksaklıkları bulunmaktadır. Öncelikle projeyi bırakan sayısının fazla olması nedebiyale kırsal bölgelerde ve kadınlarda okuma yazma bilmeyen sayısı hala yüksek kalmış ve dolayısıyla bölgeler ve cinsiyetler arasındaki eşitsizlik giderilmemiştir. İkinci olarak, okuma yazma temel eğitimler katılımcıların istek ve ihtiyaçlarını karşılamada yetersiz kalmış, ihtiyaç duyduğu bazı konularda eğitim düzenlenmemiştir. (Ghana s.6) Son olarak programın ana yürütücü olan YEM'nin daha yeni kurulmuş olması nedeniyle kapasitesi sınırlı, personeller arasında güvensizlik söz konusuydu.

4.3.2 Uganda: Sağlık Sektöründe Çalışanlara Yönelik Uygulanan Uzaktan Eğitim Programları (Siaciawena, 2000, s.92-113)

Uganda Afrika kıtasında yer alan 37.5 milyon nüfusa sahip bir ülkedir. Kişi başı GSYİH 600\$ ve düşük gelir ülke gurubunda yer almaktadır. (<http://www.go.worldbank.org/77LE4ON4V0>) Uganda'da nüfusun neredeyse dörtte biri yoksulluk içinde yaşamaktadır. Ayrıca Uganda refah göstergeleri, özellikle sağlık göstergeleri, açısından dünya ortalamasının çok altındadır. Ülkede ortalama yaşam beklentisi 45 yıl, doğurganlık oranı %73'tür ve erken ölümlerinin %75'ini en çok bilinen beş hastalık oluşturmaktadır. Bunlar; anne babaya ilişkin kalıtsal hastalıklar (%20.4), sıtma (%14.4), zatürre (%10.5), AIDS (%9.1) ve ishal (%8.4)'dır. Sağlık sektöründe çalışanların bilgi ve becerileri genellikle yetersiz, tanı ve tedavilerde eski teknikleri kullanması gibi sorunlar Uganda'nın sağlık sektörünün gelişmemiş olmasına neden olmaktadır.

Devlet, sağlık sektöründe yaşanan sorunları azaltmak ve hizmet kalitesini iyileştirmek amacıyla sağlık sektöründe çalışanlara uzaktan eğitim metodu ile eğitim vermeye başlamıştır. Sağlık sektöründe çalışanlara yönelik bu programlar 1989 yılından beri uygulanmaktadır. Programın asıl amacı, Uganda'da sağlık sektöründe çalışanların bilgi ve becerilerini geliştirecek eğitim programları düzenlemek suretiyle sağlık sektöründe yaşanan sorunları azaltmak, sağlık hizmetini iyileştirmektir. Program kapsamında çoğunlukla, çocuk sağlığı, toplum sağlığı, aşı yapma, çevre sağlığı, aile planlaması, çevre kullanımı, bulaşıkçı hastalıklar, ilaç kullanımı, reçete yazma ve okuma teknikleri ile ilgili eğitimler verilmiştir. Bu eğitimlerin çoğu mektuplaşma yoluyla ve radyo programlarının kullanımı ile gerçekleşmiştir. Bunun yanında sınırlı sayıda yüz yüze eğitimler de düzenlenmiştir. Radyo programları ile insanlar tecrübelerini birbiri ile paylaşarak yeni bilgiler edinebilmekte, unutulmuş bilgilerini hatırlayabilmektedir. Yüz yüze eğitimlerde ise insanlar öğrendiği bilgilerini nasıl kullanacakları konusunda pratik yapabilmektedir.

Program finansmanın % 95'i uluslararası yardım kuruluşları tarafından sağlanmaktadır. Her programın maliyeti, süresi ve konusuna bağlı olarak değişmekle beraber genel olarak geleneksel eğitime göre çok daha ucuzdur. Örneğin üç ile altı aylık programların her öğrenci için maliyeti 4\$ iken geleneksel eğitim maliyeti bunun neredeyse on kat daha fazladır.

Program birçok açıdan başarılı bir uygulama olmuştur. Program sayesinde sağlık sektöründe çalışan birçok kişi önemli ölçüde yeni bilgiler edinmiş, eski bilgilerini daha sağlam bilgiye dönüştürmüş, toplum ve çocuk sağlığı, aşı, hamilelik ve aile planlama gibi konularda toplumsal bilinç geliştirilmiş, böylece çocuk ölüm oranı ve doğurganlık oranı düşmüş ve aile sağlığı iyileşmiştir. Programın uygulanmaya başlamasından 1996 yılına kadar Uganda'nın sağlık sektöründe çalışanların %30'u (3297 kişi) programa katılmıştı ve bunun %70'i kırsal kesimden gelen katılımcılardan oluşmaktaydı. Bu veriler bize projenin ne kadar geniş ve başarılı bir uygulama olduğu konusunda bilgi vermektedir.

Projenin başarılı yönlerinin yanında aynı zaman bazı aksaklıkları da bulunmaktadır. Bu aksaklıkların başında, etkin olmayan finansman sistemi gelmektedir. Fonların zamanında toplanamaması nedeniyle programlar zamanında uygulanamamış ve bazı gecikmeler meydana gelmiştir. Diğer önemli bir sorun ise, öğrencilerin motivasyon eksikliği ve personel kıtlığıdır. Yetersiz öğretmen ve okula gitme isteği olmayan öğrenciler sebebiyle programı zamanında bitiremeyen öğrenci sayısı beklenenden fazla olmuştur. Zamanında bitiremem ortalamasının bu kadar yüksek olmasında denetim yetersizliğinin etkisi de yadsınamaz. Son olarak ise, eğitim kaynakların yetersiz olması, kaynaklarda mevcut olmayan veya yanlış referansların kullanılmış olması ve yenilenen kaynakların zamanında basılmamış olması programın diğer bir aksaklığını oluşturmaktadır. Dolayısıyla öğrenciler konuyu daha detaylı okumak istediği zaman gerçek kaynakları bulamama veya yanlış yerde arama gibi sorunlar yaşanmıştır.

4.3.3 Pakistan: Gençler İçin Mesleki Eğitim Projesi (World Bank, 2014)

Pakistan, Güney Asya'da yer alan 182.1 milyon nüfusa sahip kalabalık bir ülkedir. Kişi başı GSYİH 1360\$ ile düşük orta gelir ülke gurubunda yer almaktadır. (<http://data.worldbank.org/country/pakistan>) Nüfusun %12.4'ü yoksulluk içinde yaşamaktadır ve bu durum ülkenin büyük sorunlarından birini oluşturmaktadır. Bunun yanında başka bir önemli sorun ise okuryazarlık oranının düşük olması ve eğitim kurumları tarafından verilen eğitim ile piyasa ihtiyaçları arasında uyumsuzluk yaşanıyor olmasıdır. Bu uyumsuzluk yoksulluğun daha da artmasına neden olmaktadır. Pakistan Hükümeti, bu uyumsuzluğu gidererek işsizlik ve yoksulluk oranını azaltmak amacıyla 2011 yılında Gençler İçin Mesleki Eğitim Projesi'ni başlatmıştır.

Projenin amacı, gençlere istekleri ve piyasa ihtiyaçlarına uygun eğitimler sağlamak suretiyle onların istihdam edilebilirliğini kolaylaştırarak, onların yaşanan yakıt, gıda fiyatları artışı ve finansal krizin olumsuz etkilerinden daha az etkilenmelerini sağlamaktır. Proje daha çok işsiz ve yoksul gençlere, ülkeye geri gelen göçmenlere eğitim vermeyi hedeflemiştir. Proje toplamda 5050 gence eğitim sağlamayı ve program tamamlandıktan sonra 3 ay içinde katılımcıların %35'inin işe yerleştirilmesini hedeflemiştir. Eğitimler belirli yerlerde toplanarak yüz yüze eğitim şeklinde düzenlenmiştir. Programa katılan gençlere, eğitime devam etmelerini sağlamak amacıyla program boyunca yemek ve barınma gibi temel ihtiyaçlarını karşılayacak miktarda (25\$) hibe verilmiştir. Ayrıca 75 kilometre ve daha uzak yerlerden katılan katılımcılara ulaşım yardımı (20\$-30\$) da ödenmiştir. Program bitiminde ise

katılımcıların belli kısmına işe yerleştirme hizmeti sunularak işe girmelerine yardımcı olmuştur.

Projenin finansmanı Japonya Sosyal Kalkınma Fonu tarafından sağlanmıştır. Program için toplam 1.627.208.97 \$ harcanmış ve 410\$ belirlenen kişi başı maliyet 238\$ olarak gerçekleşmiştir. Dolayısıyla programın maliyet açısından etkin bir uygulama olduğunu söyleyebiliriz.

Projenin başlangıçta belirlediği 5500 kişilik hedef başarı ile gerçekleşmiştir. Proje boyunca toplam 7318 kişi katılmış ve bunun 6176'sı eğitimi başarı ile tamamlamıştır. Proje sonunda katılımcıların %35'inin işe yerleştirilme hedefi de %37 olarak başarıyla gerçekleşmiştir. Bu durum işsizlik ve dolayısıyla yoksulluk oranının düşmesi, cinsiyet ayrımının azalması ve sosyal gelişimin sağlanması konusunda olumlu etki yapmıştır.

Projenin başarıları yanında diğer tüm projelerde olduğu gibi bazı açıdan aksaklıkları da bulunmaktadır. Örneğin, projenin başta belirlediği katılımcıların %40'nın kadınlardan oluşturulması hedefi gerçekleşmemiştir. Kadınların katılımını desteklemek için erkeklerden önce kayıt etmek, kendilerine en yakın eğitim tesislerine yerleştirme gibi birçok kolaylık sağlanmış olmasına rağmen sosyal sorunlar ve ulaşım zorlukları onların katılımının sınırlı olmasına neden olmuştur. Kadınların katılım oranı proje başlangıcında %28 iken proje bitiminde %27'e düşmüş ve proje başında belirlenen %40 hedefinin çok altında gerçekleşmiştir. Ayrıca öğrencilerin hibe ödenmesi konusunda bazı aksaklıklar yaşanmıştır. Katılımcıların %68'i hibenin hiçbir zaman zamanında ödenmediğinden şikayetçi olmuştur.

4.3.4 Çin: Kırsal Okullara Yönelik Uzaktan Eğitim Projesi (McQuaide, 2009 : 1-21)

Çin, Doğu Asya'da yer alan 1.357 milyar nüfusa sahip dünyanın en kalabalık ülkesi ve en büyük ekonomilerinden biridir. Kişi başı 6560\$ GSYİH ile üst orta gelir ülke grubunda yer almaktadır. (<http://data.worldbank.org/country/china>) Çin'de hızlı ekonomik büyüme ve sosyal gelişme yaşanıyor olmasına rağmen yoksulluk hala çözümlenmemiş ve en büyük sorunu teşkil etmektedir. Bölgeler arasında yoksulluk açısından çok fark görülmektedir. Batı bölgeleri Doğuya göre az gelişmiş ve nüfusun çoğu yoksulluk içinde yaşamaktadır. Yoksulluğun yüksek olduğu o bölgelerde eğitim kalitesi zayıf, okula erişim sınırlı ve dolayısıyla okuryazarlık oranı düşüktür. Çin hükümeti bu sorunu ortadan kaldırmak, kırsal kesimde eğitim kalitesini artırmak, bölgeler arası eğitim eşitliği sağlamak amacıyla 2003 yılında Kırsal Okullara Yönelik Uzaktan Eğitim Projesini (KOYUEP) başlatmıştır. Bu proje dünyada şimdiye kadar uygulanan benzer bilgi teknoloji projeleri arasında en başarılı ve en büyüğüdür.

(KOYUEP)'in asıl amacı eğitim kaynaklarını köy ve şehirlere daha adaletli dağıtmak, modern teknolojilerden yararlanmalarını sağlamaktır. Bu maksatla televizyon, konu anlatımlı DVD ve bilgisayar gibi araçları tüm okullara ulaştırılarak okullardaki eğitim kalitesinin yükseltilmesi, öğretmenlerin verimliliklerinin artırılması ve böylece eğitim eşitsizliğinin giderip sosyal adaletin sağlanması hedeflenmiştir. Proje kapsamında eğitimde en geniş kullanılan üç araç; DVD, televizyon ve internettir. Bunlar, hedef

bölgenin özellikleri ve öğrencilerin ihtiyaçları göz önünde bulundurularak farklı şekillerde kullanılmıştır. İlköğretim gibi daha üst düzey eğitimlerde CD ve DVD gibi basit araçlar kullanılmaktayken, lise ve yüksek eğitimlerde bilgisayar ve internet daha çok tercih edilmiştir.

Proje 2007 yılında sona ermiş ve üç yıllık uygulanma süresince ülke çapında önemli gelişmeler kaydetmiştir. Proje başında hesaplanan 12 milyar yuanın proje süresince 8 milyarı harcanmış, batı ve merkezi bölgelerde bulunan tüm ilk ve ortaokulların %80'i ve toplam 100 milyondan fazla öğrenci projenin sunduğu olanaklardan yararlanmış. Ayrıca kırsal kesimlerde ve şehirlerde okullar arasında eğitim kaynakları ve eğitimde kullanılan araçlar değişimi gerçekleştirilerek öğretmenlerin niteliği artırılmış ve eğitim eşitsizliği önemli ölçüde azaltılmıştır.

Projenin başarılı olmasını engelleyen en büyük sıkıntı finansman yetersizliğidir. Finansman yetersizliği projenin hedefine ulaşmasını zorlaştırmış, sürdürülebilirliğini olumsuz etkilemiştir. Örneğin, projenin altyapı yatırımı için toplam proje bütçenin üçte birinden az kısmı (12 milyar yuan) ayrılmıştır. Ama uluslararası deneyimlere bakıldığında zaman bunun proje bütçenin en büyük kısmı projenin sürekliliğini sağlayan altyapı yatırımlarına yapıldığı gözlemlenmiştir. Bir diğer önemli sorun ise, eğitim kaynaklarının toplum özellikleri ve öğrencilerin istekleri ile uyumsuz, esnek olmayan konservelenmiş bir yapıya sahip olmasıdır. Örneğin öğretmenlerin %79'u eğitimde kullanılan konservelenmiş kaynakların yerine daha esnek kaynaklar kullanmayı tercih ediyordu.

4.3.5. Bangladeş: İnsani Gelişim İçin Okuma Yazma Eğitimi Sonrası Sürekli Eğitim Projesi (World Bank, 2008)

Bangladeş Güney Asya'da yer alan 128 milyon nüfusa sahip bir ülkedir. 1010\$'lık kişi başı GSYİH ile düşük gelir ülke grubunda yer almaktadır. (<http://data.worldbank.org/country/bangladesh>) Nüfusun beşte dördü kırsal kesimde yaşamaktadır ve yarısı yoksuldur. Yoksulluk oranı ile Güney Asya'da birinci, dünyada ise Hindistan ve Çin'den sonra üçüncü sırada yer almaktadır. Yoksulluğun bu kadar yüksek olması okuryazarlık oranının da düşük olmasına neden olmaktadır. Bangladeş'te 15 yaş üstü yetişkinlerin okuma yazma bilmeme oranı %42 (1999) ile diğer Güney Asya ülke ortalamasının çok üstündedir. Yoksulluğun yüksek olması devletin eğitim için yaptığı harcamanın yetersiz olmasına ve dolayısıyla eğitim kalitesinin düşük olmasına neden olmaktadır. Diğer taraftan eğitim kalitesinin yetersizliği de yoksulluğun artmasında etkili olmaktadır. Eğitim ile yoksulluk arasındaki bu kısır döngüyü kırmak, eğitim kalitesini iyileştirmek amacıyla Yaygın Eğitim Müdürlüğü (YEM) tarafından uygulanan projelerden biri 2001 yılında başlatılan İnsani Gelişim İçin Okuma Yazma Eğitim Projesidir.

Projenin asıl amacı okumamış, dezavantajlı gençlere ve yetişkinlere okuma yazmayı öğretmek, programdan sonra katılımcılara sürekli eğitim düzenlemek ve onların bilgi ve becerilerini geliştirmek suretiyle hayat standartlarını iyileştirmek ve yoksulluğu azaltmaktır. Projenin hedefini dört ana başlık altında incelemek mümkündür. İlk olarak

kapsamlı ve geniş yaygın eğitim sisteminin geliştirilmesi hedeflenmiştir ve bu hedef için toplam 1.40 milyon dolar bütçe ayrılmıştır. İkinci olarak okuma yazma sonrası eğitim programlarının desteklemesi amaçlanmıştır. Devlet dışı ve diğer özel kuruluşlarla işbirliği ile okuma yazma eğitimi tamamlayanların edindikleri bilgileri ileride kullanabilmelerini ve geliştirmelerini sağlamak için girişimlerde bulunulmuştur ve bunun için \$14.20 milyon bütçe ayrılmıştır. Üçüncü olarak sürekli eğitim merkezi kurarak insanlara sürekli kendilerini geliştirecek ortamın sağlanması hedeflenmiştir. Bunun için bütçenin en büyük kısmı \$50.60 milyonu ayrılmıştır. Son olarak kurumsal kapasitelerin genişletilmesi amaçlanmıştır. Bu hedefin gerçekleşmesi için ayrılan bütçe ise \$5.40 milyondur. Bunun için çalışanların yeteneklerini artırmak, YEM'nin izleme, denetleme ve planlama faaliyetlerini geliştirmek gibi düzenlemeler planlanmıştır. Proje toplam 1.36 milyon kişiyi kapsamayı ve bunun yarısını kadınlardan oluşturmayı hedef olarak belirlemiştir. Kadınlara okuma yazma sonrası eğitim vermek, onların bilgi ve becerilerini arttırmak, gelir getirici aktiviteler düzenlemek ve dolayısıyla onların gelirlerini arttırmak ve cinsiyet eşitsizliği azaltmak projenin diğer bir önemli hedefler arasındadır.

Program okuma yazma sonrası eğitim ve sürekli eğitim şeklinde 15 çeşit eğitim programı sunmuştur. Bunlar; süt ürünleri, inek ve keçi yetiştirmek, sabun ve mum yapma, kumaş boyama ve çiçek ve sebze yetiştirme gibi hayatın en temel konuları kapsayan eğitim programlarından oluşmaktadır. Okuma yazma eğitimleri 3 ay, sürekli eğitim ise 6 ay sürmektedir. Her iki programda haftada 6 gün, günde 2 saat eğitim verilmektedir.

Projenin toplam bütçesi 71.57 milyon dolardır. Bunun 53.3'ü (%75) Dünya Bankası tarafından, 7 milyonu (%10) İsviçre Kalkınma ve İşbirliği Ajansı ve 11.24 milyonu (%15) ise borçlanma ile sağlanmıştır.

Proje 2007 yılında sona erdiğinde hedefin çoğu gerçekleşmişti. Öncelikle kapsamlı ve geniş yaygın eğitim sistemi geliştirme hedefi başarı ile gerçekleşmiş, yaygın eğitim sistemi daha sistemli hale gelmiştir. İkinci olarak okuma yazma sonrası eğitim programların desteklenmesi hedefi gerçekleşmiştir. 32 ilçede 6900 yaygın eğitim merkezi kurulmuş ve okuma yazma temel eğitimi tamamlayanların kullanabileceği birçok dergi, kitap ve diğer eğitim kaynakları ile donatılmış, sürekli eğitim ve okuma yazma sonrası eğitim programlar düzenlenmiştir. Bu durum okuma yazma temel eğitimini tamamlayan öğrencilere bu bilgilerini geliştirebilme imkanı sağlamıştır. 15 farklı konuda 8666 okuma yazma sonrası ve sürekli eğitim kursları uygulanması hedeflenmişti ve bu hedef 1000'nin üstünde gerçekleşmiştir. Üçüncü olarak sürekli eğitim merkezi kurarak insanlara sürekli kendilerini geliştirebilecek ortamı sağlaması hedefi başarı ile gerçekleşmiştir. Bu durum katılımcıların istihdam olanağını artırarak, gelir ve hayat standartlarını iyileştirerek yoksulluğun azalmasına katkıda bulunmuştur. Proje 2007 yılında sona erdiğinde katılımcıların istihdamı %6 artmış, kadınlar katıldığı ticaret, terziilik ve dokuma gibi eğitim faaliyetler sonunda aile gelirlerini yaklaşık %10-100 artırmıştır. Projenin 1.36 milyon kişiyi kapsama hedefi 972.900 kişi olarak (%73) gerçekleşmiştir.

Projenin birçok olumlu yönlerin yanında bazı aksaklıkları da gözlemlenmiştir. Öncelikle kapsamlı ve sistemli yaygın eğitim sistemin yoksunluğu yaşanmaktaydı. Okuma yazma bilmeyenlerin örgün eğitim dışında eğitim görebileceği kapsamlı bir eğitim sistemi yoktu. Projeye katılan okuma yazma bilmeyen birçok kişi vardı fakat proje kapsamında verilen eğitimlerin çoğu okuma yazma bilmeyen kişilere uygun değildi. Bu durum okuma yazma bilmeyen birçok kişinin projeden istediği verimi alamamasına ve projeyi tamamlamadan bırakmasına neden olmuştur. Ayrıca sürekli hükümet ve hedef değişikliğinin yaşanması projenin geç başlamasına ve aksamasına neden olmuştur. Proje planlanan tarihten bir buçuk sene gecikmeli başlamıştır. Bu durum projenin zamanında tamamlanmamasına, personelin işini yapmamasına veya projenin bitiminden önce işlerini terk etmesine neden olmuştur. Projede birçok devlet dışı kuruluş ve diğer özel kurum yer almasına rağmen çoğunun projeye katkısı sınırlı kalmış, etkin şekilde çalışmamışlardır. Proje bittiğinde yedi aşamanın tamamlanması gerekirken bunun beşi tamamlanmıştı ve altı ve yedinci aşamalar gerçekleşmemiştir.

Buraya kadar anlatılan örnekler ve yapılmış çalışmalardan yola çıkarak yaygın eğitimin gelişmekte olan ülkelerde uygun bir yöntem olduğu, ancak başarılı olduğu kadar bazı aksaklıkların da bulunduğu ve dolayısıyla bu aksaklıkların giderilmesi takdirde gelişmekte olan ülkelerde yoksulluğu azaltmada iyi bir model olabileceği sonucuna varabiliriz.

5. SONUÇ

Yoksulluk tüm ülkeleri ilgilendiren bir sorundur, ancak gelişmekte olan ülkeler bu sorunu daha derin bir şekilde yaşamaktadır. Gelişmekte olan ülkelerin yoksullaşmasının altındaki en önemli sebepler; kötü sağlık, yetersiz eğitim, istihdam olanakların sınırlı olması, eşitsizlik ve dışlanmadır. Bu sorunların kısa vadede giderilmesi zordur ve çaba sarf eden uzun bir süreci gerektirir. Başta Dünya Bankası olmak üzere uluslararası kuruluşların en çok üzerinde durduğu konu yoksulluk olmuş ve son yıllarda özellikle gelişmekte olan ülkelerde yoksulluğu azaltmak için yapılan müdahaleler artmış durumdadır.

Eğitim politikası, yoksulluğu azaltmada daha kapsamlı ve fonksiyonel çözümler getirdiği gerekçesi ile çok tercih edilmektedir. Eğitim seviyesi yükseldikçe bireyler daha yüksek beşeri sermaye donanımına sahip olur, daha çok vasıf gerektiren işlerde çalışır ve daha yüksek kazanç elde ederler. Eğitimin kişisel kazançları artırmak ve hayat standartları iyileştirmek suretiyle gelir ve insani yoksulluğu azaltıcı etkisi, yoksullukla mücadelede eğitimin önemli bir araç olmasına neden olmuştur.

Uygulanan eğitimler ülkelerin ekonomik, sosyal ve kültürel yapısına bağlı olarak değişmekle beraber genel olarak örgün ve yaygın eğitim olarak verilmektedir. Örgün ve yaygın eğitim ülkelere göre farklı şekillerde uygulanmakla birlikte son yıllarda yaygın eğitimin gelişmekte olan ülkelerde daha uygun bir eğitim modeli olduğu, yoksulluğu azaltmada önemli bir rol oynadığı ileri sürülmektedir. Gelişmekte olan ülkelerde yaygın eğitim daha çok okuma yazma eğitimi, temel eğitim, mesleki eğitim, gelir getirici

aktiviteler ve sağlık eğitimi gibi hayatın en temel konuları içeren programlardan oluşmaktadır. Yaygın eğitimin ucuz, geniş kitleye aynı anda ulaşabilme kapasitesine sahip olması ve esnek bir yapının bulunması yaygın eğitimin gelişmekte olan ülkelerde tercih edilmesinin en önemli nedenlerini oluşturmaktadır. Bu konuda yapılan çalışmaların çoğu yukarıdaki görüşü destekleyici yönündedir.

Ülkelerde uygulanan yaygın eğitim politikasını inceleme sonucunda yaygın eğitimin gelişmekte olan ülkelerin ekonomik ve sosyal yapısına uygun, birçok açıdan olumlu yönlerin olduğu, dolayısıyla uygulanan yaygın eğitimlerin yoksulluğu azaltmada önemli rol oynadığı görülmüştür. Her ne kadar yaygın eğitim bu ülkelerde birçok açıdan fayda sağlamasına rağmen uygulanan programın öğrencilerin istek ve ihtiyaçlarını karşılayıcı nitelikte olmaması, finansal yetersizliği nedeniyle programın aksamaması, çalışanların görevlerini yerine getirmemesi, hükümet ve yönetim değişikliği nedeniyle programın zamanında uygulanmaması ve öğrencilerin motivasyon eksikliği nedeniyle programı tamamlamadan bırakma oranının yüksek olması gibi birtakım aksaklıklar görülmüştür. Bu aksaklıklar giderildiği takdirde uygulanan yaygın eğitim programları daha iyi sonuç alabilmektedir. Bunun için öncelikle ülkenin ihtiyaçları ve istekleri değerlendirilip en doğru model seçilmelidir. Ardından hangi araçları kullanarak eğitimin verilebileceğine ülkenin ekonomik ve sosyal yapısı dikkate alınarak karar verilmelidir. Çünkü eğitimde kullanılan araçların ülke yapısına ve özelliklerine uygun olmaması programın uygulanabilirliğini zorlaştırmakta, program verimliliğini düşürmektedir. Programın başarılı sonuç almasını sağlayan en önemli unsurlardan bir diğeri de etkin bir denetim ve izleme sisteminin olmasıdır. Çünkü program finansmanın etkin kullanımı ve eğitimlerin verimli işleyişi ancak etkin bir denetleme ve izleme sistemi ile sağlanacaktır. Program sonunda yapılacak iyi bir değerlendirme sistemi aynı zamanda daha sonraki programlara yön vermesi açısından da önemlidir. Çünkü uygulanacak programların daha önce uygulanmış benzer çalışmalara bakarak ortak görülen sorunlardan ders alarak, onları giderecek şekilde uygulanması, istenilen sonuçların alınabilmesini kolaylaştıracaktır.

KAYNAKLAR

Berg, S. V. (2008), *Poverty and Education*, Education Policy Series, 1-8

Coombs, P.H. & Ahmed, M. (1974). *ATTACKING RURAL POVERTY, How Non Formal Education Can Help*, USA, 3-20, 143-193

Çokgezen, M. & Terzi, N. (2008). *Türkiye’de Devletin Eğitime Müdahalesinin Yeterli Gerekçesi Var mı?* s.3

Etlng, A. (1993). *What Is Non Formal Education?*, *Journal of Agriculture Education*, USA, 72-76

Field, F. (1983). *The Minimum Wage Policy Studies Institute*, London, 50-51

- Fordham, P.E. (1993) 'Informal, Non-Formal and Formal Education Programmes' in YMCA George Williams College ICE301 Lifelong Learning Unit 2, London: YMCA George Williams College, s.2
- Gulati, S. (2008) Technology-Enhanced Learning in Developing Nations: A Review, International Review of Research in Open and Distance Learning, Vol.9, No.1, s. 11-12
- Khan, H. & Willimas, J. B. (2006). Poverty Alleviation Through Access to Education: Can E-Learning Deliver?, U21 Global Working Paper, 1-14
- Kumar, S. & Ahmad, S. Meaning, Aims and Process of Education, 1-60
- McQuaide, S. (2009). Making Education Equitable in Rural China through Distance Learning, International Review of Research in Open and Distance Learning, 1-21
- Önder, H. & Şenses, F. (2005) Türkiye'de Yoksulluk ve Yoksulluk Düşüncesi, 4
- Siaciawena, R. (2000). Case Studies of Non Formal Education by Distance Education and Open Learning, Chapter 5, Uganda: Distance Education of the Ministry of Health, UK, 92-113
- Veen, R.V.D. & Preece, J. (2005). Poverty Reduction and Adult Education: Beyond Basic Education, International Journal of Lifelong Education, 381-391
- World Bank. (2010). Republic of Ghana, Second Phase of the Functional Literacy Project, Project Performance Report, 4-37
- World Bank. (1999). National Functional Literacy Program
- World Bank. (2014). Pakistan-Emergency Job Training for Vulnerable Youth, Implementation Completion and Result Report
- World Bank. (2008). The People of Bangladesh for A Post Literacy and Continuing Education for Human Development Project
- World Bank, World Development Indicator, www.worldbank.org , erişim tarihi 20.02.2015

Kargo Şirketi Seçimine Yönelik Kriterlerin Belirlenmesinde Türkiye Genelinde Bir Saha Araştırması

A Field Research in Overall Turkey About the Determination of Criteria for Selection of Cargo Companies

H.Ediz ATMACA¹
Duygu TURĞUT²

ÖZET

Günümüzdeki teknolojik gelişmeler ve globalleşme neticesinde, şirketler giderek artan rekabetle karşı karşıyadır. Şirketlerin iyi bir müşteri memnuniyeti sağlayıp, rakiplerinden daha önde olmaları etkin bir lojistik ağıyla mümkün olmaktadır. Lojistik hizmet sunucularının temel hizmet alanlarından birini de kargo taşımacılık hizmetleri oluşturmaktadır. Yapılan çalışmada, Türkiye’de hizmet vermekte olan kargo şirketlerinin seçimini etkileyen kriterler incelenmiştir. Bu amaçla, Türkiye genelinde bir saha araştırması yapılmış ve sonuçları IBM SPSS Statistics 20 Paket Programı ile değerlendirilmiştir. Değerlendirme neticesinde, müşteriler açısından kargo şirketi seçim kararında hangi kriterlerin önemli olduğu ve belirlenen kriterler çerçevesinde hangi kargo şirketinin seçilmesi gerektiği belirlenmiştir. Çalışma sonucunda, zorlu rekabet koşullarında hayatta kalmak ve/veya karlılıklarını artırmak isteyen kargo şirketlerine öneriler sunulmuştur.

Anahtar Kelimeler: Kargo sektörü, ilişki analizi, kriter seçimi.

ABSTRACT

As a result of today's technological advances and globalization, companies are facing with increasing competition. It is possible through an efficient logistics network to be ahead of its competitors by providing good customer satisfaction of the companies. Cargo services constitute one of the main areas of logistics service providers. In this study, the criteria that influence the choice of the shipping company which provides services in Turkey were examined. To this end, a field research is carried out in general of Turkey and the results are evaluated using IBM SPSS Statistics 20 software program. The evaluation result, according to customers, which criteria are important to choose the delivery company should be chose is determined. As a result, proposals were presented to cargo companies that want to survive in harsh competition and / or to increase their profitability.

Keywords: Cargo sector, correlation analysis, criteria selection.

¹ Gazi Üniversitesi, Mühendislik Fakültesi, Endüstri Mühendisliği Bölümü, hediz@gazi.edu.tr

² Gazi Üniversitesi, Mühendislik Fakültesi, Endüstri Mühendisliği Bölümü.

1. GİRİŞ

Günümüzde pek çok sektörde teknolojik gelişmeler ve küreselleşme gibi sebeplerden dolayı rekabet edebilirlik oldukça zorlaşmıştır. Şirketler, rakiplerinden bir adım önde olabilmek için lojistik ağlarında en iyiyi sağlamaya çalışmaktadırlar. Lojistik sektörü özellikle internet kullanımı ve e-ticaret yaygınlaştıkça son 30 yıl içinde dünyada en hızlı gelişme gösteren sektörlerin başında yer almaktadır ve diğer sektörlerden daha gençtir.

Türkiye'nin Asya ve Avrupa'yı birbirine bağlayan doğal köprü konumu, Türkiye'nin Asya, Avrupa ve Ortadoğu tarafından lojistik merkez olarak kullanılmasını zorunlu kılmaktadır. Bu zorunluluk Türkiye'nin lojistik kapasitesinin en güncel verilerle 60 Milyar dolar olmasını sağlamıştır. Fakat Türkiye lojistik sektöründe son 10 yılda gelişme göstermeye başlamıştır ve potansiyelinin sadece % 10'unu kullanabilmektedir. Gelecekte de lojistik sektörünün trilyon dolarları bulacak hacmi büyük ölçüde sektörde önde gelen 10 firmanın kullanımındadır (Lojistik Sektörü 2013 Raporu, MUSİAD, 2013).

Lojistik hizmet sunucularının temel hizmet alanlarından birini kargo taşımacılık hizmetleri oluşturmaktadır. Bu anlamda kargo taşımacılığı, temelde bir lojistik eylemi olarak düşünülmektedir. Kargo taşımacılığı bir taşımacılık hizmeti türüdür ve taşımacılık sektörüne yönelik yardımcı hizmetler grubunda bulunmaktadır. Kargo kelimesi, sözlük anlamı itibarıyla 'yük, hamule' anlamında kullanılmaktadır. Buna göre kargo taşımacılığı; herhangi bir yükün bir yerden başka bir yere ulaştırılması ile ilgili faaliyetler olarak tanımlanabilir. Kargo taşımacılığı, uluslararası literatürde ağırlığı, ebadı ve içeriği önemli olmaksızın herhangi bir yükün taşınması olarak kullanılsa da ülkemizde belirli bir ağırlığın altındaki yükler ve paketler kargo olarak adlandırılmaktadır. Diğer taraftan ülkemizde kargo taşımacılığı olarak adlandırılan faaliyetin karşılığı uluslararası literatürde 'paket dağıtımı' olarak geçmektedir. Yani, literatürde kargo taşımacılık hizmetlerinin bir alt bölümünü oluşturan paket dağıtım hizmetleri, ülkemizdeki uygulayıcıları tarafından kargo taşıma hizmetleri olarak adlandırılmaktadır. Lojistiğin tanımında, kargo 100 kilografa kadar olan bir ürünün bir noktadan alınıp diğer noktaya taşınması hizmeti olarak geçmektedir. Kömür, maden gibi çok hacimli ve ağır malzemelerin nakliyesi, 100 kilogramı geçen eşyalar ile büyük hacimli eşyaların taşınması kargonun kapsamına girmemektedir (globalkargo.com/kargo-tasimaciligi, 2015).

Spencer vd., 154 firma ile yaptığı anket çalışmaları sonucunda 3PL firması seçimi için 23 adet kriter belirlemişlerdir. Bunlar önem sıralarına göre; Tam zamanında performans, servis kalitesi, iyi iletişim, güvenilirlik, servis hızı, esneklik, müşteri desteği, kolay çalışılabilme, yönetim kalitesi, sorunların erken tespiti, fiyat, ulaşılabilir servis çeşitliliği, özel uzmanlık, teknik rekabet edebilirlik vb. (Spencer vd., 1994).

Murphy ve Daley, Amerika'daki The Council Logistics Management'ın 375 üyesi ile yaptıkları çalışma sonucunda uluslararası nakliye taşıyıcılarının seçiminde 12 kriter belirlenmiştir. Bunlar önem sırasına göre: uzmanlık, güvenilirlik, konu ile ilgili bilgiyi

sağlayabilme yeteneği, dikkat ve özen, itibar, fiyat, finansal durum, kullanıma uygunluk, hizmetler, coğrafik özelleştirme, ürün özelleştirme ve boyut (Murphy ve Daley, 1997).

Bhatnagar vd., Singapur'da 126 firma ile ilgili yaptığı çalışmalarda, 3PL sağlayıcı seçiminde en önemli kriterlerin fiyat ve servis kalitesi olduğunu belirlemişlerdir. Bu kriterleri, İtibar, hizmet yelpazesi ve konu ile ilgili geçmiş deneyimler izlemektedir (Bhatnagar vd.,1999).

Boyson vd., Amerika'da 463 şirket ile yaptıkları deneysel çalışmada, 3PL sağlayıcı seçiminde dikkat edilmesi gereken kriterleri şöyle belirlemişlerdir: finansal istikrar, müşteri hizmetleri yeterliliği, fiyat, problem çözmede yaratıcılık, bilgi sistemleri ve teknoloji yeterlilikleri, genel itibar vb. (Boyson vd., 1999).

Moberg ve Speh, Amerika'daki 155 şirket ile yaptıkları deneysel çalışmada, 3PL sağlayıcı seçiminde 12 önemli kriter belirlemişlerdir. Bunlar önem sırasına göre: hizmet taleplerine cevap verebilirlik, yönetim kalitesi, etik performans kayıtlarının izlenmesi, katma değerli hizmet verebilirlik, düşük fiyatlar, özel uzmanlık, pazar hakkında bilgi vb. (Moberg ve Speh, 2004).

Park vd., havayolu kargo şirketlerinin rekabetlerinin değerlendirdikleri çalışmalarında, doğruluk ve çabukluğun rekabette en etkili iki faktör olduğunu belirlemişlerdir. (Park vd., 2009)

Meng vd. çalışmalarında, lojistik, dış kaynak kullanımı ile müşteri memnuniyetini etkileyen faktörleri incelemişlerdir. Lojistik dış kaynak kullanımı ve müşteri memnuniyeti arasında güçlü bir ilişki tespit etmişlerdir. Müşteri memnuniyetini etkileyen dört temel faktör bulmuşlardır. Bunlar: Güvenilirlik, esneklik, çeviklik, özelleştirme (Meng vd., 2010).

Rajesh vd., Hindistan'daki Üçüncü Parti Lojistik Sağlayıcılarının hizmet tekliflerinin, müşterilerin performans göstergeleri üzerindeki etkilerini tespit etmek amacıyla anket çalışması yapmışlardır. Sonuçları çoklu regresyon analizi ile değerlendirmişlerdir ve müşterilerin, kendilerine yenilikçi iş modelleri teklif eden sağlayıcıları daha çok tercih edeceği sonucuna ulaşmışlardır (Rajesh vd., 2011).

Yu vd. çalışmalarında, e-perakendeciler ve ürün dağıtım hizmeti sağlayıcıları arasındaki ilişkileri anket analizleri yaparak incelemişlerdir ve esnekliğin bu ilişkiyi güçlendirecek temel kriter olduğunu belirlemişlerdir (Yu vd., 2015).

2. ARAŞTIRMANIN YÖNTEM BİLİMİ

2.1. Araştırmanın Konusu ve Amacı

Bu çalışma ile Türkiye genelindeki müşterilerin, kargo sektöründe hizmet vermekte olan ulusal ve uluslararası kargo şirketlerini seçerken hangi kriterleri göz önünde bulundurmaları gerektiğinin belirlenmesi amaçlanmıştır. Literatür taramaları ile belirlenmiş olan 17 adet kriteri birebir karşılayacak şekilde hazırlanan soruları içeren anket çalışması yapılarak kriterler ve bu kriterlere göre müşteri görüşleri baz alınarak değerlendirilme dahil edilen kargo şirketlerinin sıralaması yapılacaktır.

2.2. Araştırmanın Kapsamı

Türkiye’de yaşayan ve kargo şirketlerinden en az bir kere hizmet almış olan kişiler, araştırmanın ana külesini oluşturmaktadır. Ana kütle sayısının çok yüksek olması ve tam olarak bilinmemesi nedeniyle örneklem sayısı aşağıdaki formül ile hesaplanmıştır:

$$n = (P \times Q \times [Z\alpha]^2) / (\text{HATA PAYI})^2$$

P= Tahmin edilen ve istenen özellik oranı, 0,1 olarak alınmıştır.

Q= İstenmeyen özellik oranı, 0,9 olarak alınmıştır.

Hata Payı= Araştırmacı tarafından müsaade edilebilecek oran; 0,01 den 0,1 e kadar belirlenebilir. Çalışmada 0,05 olarak alınmıştır. $\alpha=0,05$ olarak alınmıştır.

[Z α]:Araştırmacının iki yönlü standart güven seviyesi; örneğin $\alpha=0,05$ ise $z=1-\alpha= 0.95$ ve bu durumda [Z α]’nın iki yönlü değeri z tablosundan 1.96 olarak bulunur. $n = (P \times Q \times [Z\alpha]^2) / (\text{HATA PAYI})^2$

$$n = 0,1 \times 0,9 \times (1,96)^2 / (0,05)^2$$

$$n = 138,29$$

Google Forms kullanarak hazırlanan “Türkiye’de Kargo Sektörünün Değerlendirilmesi” adındaki ankete cevap veren 225 kişi örnekleme oluşturmuştur.

Anket soruları hazırlanırken literatür taramaları yapılarak geçmişte yapılmış benzer çalışmalarda kullanılmış kriterler belirlenmiştir ve aralarından en çok kullanılmış olan ve bu çalışmanın konusuna en uygun olan kriterler bu çalışmada değerlendirmeye alınmıştır. Bunlar:

- Hizmet Fiyatı
- Şube Sayısı ve Ulaşılabilirlik
- Çalışan Sayısı Yeterliliği
- Kargo Teslimat Hızı
- Çalışma Saatleri Esnekliği
- Reklam Başarısı ve İtibar
- Firma Güvenilirliği
- Firmanın Deneyimi
- Firmanın Kalitesi

- Şikayetlere Cevap Verebilirlik
- Teknoloji Güncelliği ve Yeterliliği
- Firmanın Verdiği Güvencesi
- Firma Çevre Bilinci
- Acil Durum Yönetimi ve Çözüm Bulma Becerisi
- Firmanın Ekonomik Geçmişi Ve Finansal İstikrarı
- Firmanın Sosyal Sorumluluk Projeleri
- Kargo Takip Ara yüzünün Kullanışlılığı

Ayrıca ankete katılanların hangi yaş gruplarında olduklarına dair soru da sorulmuştur. Bunun amacı 18 yaş altının değerlendirmeye alınmak istenmemesi ve hizmet alımının en fazla olduğu yaş aralığının belirlenmek istenmesidir.

2.3. Araştırma Yöntemi

Önceki bölümde değinilen kriterlere birebir karşılık gelen soruları içeren bir anket Google Forms kullanılarak internet ortamında hazırlanmıştır. Kriterlere yönelik memnuniyet düzeylerinin ölçmek için katılımcılardan, her soruda “çok kötü, kötü, orta, iyi, çok iyi, fikrim yok” şıklarından birinin işaretlenmesi istenmiştir ve her bir kriter için tek bir yargı zorunluluğu konulmuştur.

Anket soruları şunlardır:

- 1) Firmanın hizmet fiyatlarını, verdiği hizmet ile karşılaştırdığınızda nasıl bir yorum yaparsınız?
- 2) Firmanın şube sayısı ve ulaşılabilirliği hakkında ne düşünüyorsunuz?
- 3) Firmanın çalışan sayısını yeterli buluyor musunuz?
- 4) Firmanın kargo teslimat hızı hakkında ne düşünüyorsunuz?
- 5) Firmanın çalışma saatlerini esnek buluyor musunuz? Günün her saati hizmet verebilir durumda mı?
- 6) Firmanın reklam başarısı ve itibarı hakkında ne düşünüyorsunuz?
- 7) Kargonuzu teslim ettiğiniz bu firmanın güvenilirliği hakkında ne düşünüyorsunuz?
- 8) Firmanın sektöründeki deneyimi ile ilgili ne düşünüyorsunuz?
- 9) Çalışanlarının davranışları ve verdiği hizmetler göz önüne alındığında firmanın genel kalitesi hakkında ne yorum yaparsınız?
- 10) Firmanın şikayetlere cevap verme durumu hakkında ne düşünüyorsunuz?
- 11) Firmanın kullandığı teknolojinin güncelliği ve yeterliliği hakkındaki görüşünüz nedir?
- 12) Firmanın oluşabilecek zararlarla ilgili verdiği güvence hakkında ne düşünüyorsunuz?
- 13) Firmanın çevreci faktörler ve çevreci ürün kullanım bilinci hakkında ne düşünüyorsunuz? (E-fatura, çevreci paketleme malzemeleri kullanımı vb.)
- 14) Firmanın beklenmeyen, acil durum yönetimi, bu durumlara çözüm bulma becerisi hakkında ne düşünüyorsunuz?
- 15) Firmanın ekonomik geçmişi ve finansal istikrarı hakkında ne düşünüyorsunuz?
- 16) Firmanın yaptığı veya katıldığı sosyal sorumluluk projelerini göz önüne aldığınızda projelerin başarısı ile ilgili ne düşünüyorsunuz?

Firmanın internetteki müşteri kargo takip ara yüzünün kullanılabilirliği hakkındaki fikriniz nedir?

Anketin güvenilirlik analizi sonucu Tablo 1’de verilmiştir.

Tablo 1: Anketin Güvenilirlik Analizi

Cronbach's Alpha	N of Items
,918	17

Tüm sorulardan elde edilen toplam güvenilirlik 0,9’dan büyük olduğu için anket yüksek güvenilirliğe sahiptir ve sorulardan herhangi birinin çıkartılmasına gerek yoktur.

2.4. Verilerin Analizi

Anket uygulamasından elde edilen veriler IBM SPSS Statistics Programı kullanılarak değerlendirilmiştir. Kargo firmalarının her bir kritere göre değerlendirilmesinde çapraz tablolardan yararlanılmıştır. Firmalar ile kriterler arasında istatistiksel olarak anlamlı bir ilişkinin olup olmadığını test ederken 5 den küçük beklenen sıklıkların sayısı toplam gözlem sayısının (n=225) %20’den (45) az olması sebebiyle Ki-Kare analizinin yapılmasının uygun olduğu belirlenmiş ve veriler Ki-Kare analizine tabi tutulmuştur. Firmalar ve kriterler arasındaki ilişkinin hangi şiddette olduğunu belirlemek için de Cramer's V ilişki katsayısından yararlanılmıştır.

2.5. Araştırma Bulguları ve Yorumlar

Türkiye geneline uygulanması amaçlanan ankete, Adana, Amasya, Ankara, Antalya, Bursa, Çorum, Denizli, Erzincan, Eskişehir, Gaziantep, Giresun, Hakkâri, Hatay, Mersin, İstanbul, İzmir, Kars, Kastamonu, Kayseri, Kırşehir, Kocaeli, Konya, Kütahya, Malatya, Kahramanmaraş, Muğla, Muş, Nevşehir, Niğde, Sakarya, Samsun, Sivas, Tekirdağ, Trabzon ve Yalova illerinden (35 il) toplam 225 kişi cevap vermiştir. Bu kişilerin hizmet aldıkları kargo şirketlerinin frekans dağılımları Tablo 2’de ve bu kişilerin yaş frekans dağılımları Tablo 3’te verilmektedir.

Tablo 2: Ankete Katılan Kişilerin Hizmet Aldıkları Kargo Şirketlerinin Frekans Dağılımları

Hangi kargo şirketlerinden hizmet aldınız?			
		Sıklık	Yüzde
Valid	PTT Kargo	42	18.7
	MNG Kargo	35	15.6
	Yurtiçi Kargo	90	40.0
	ARAS Kargo	30	13.3
	DHL Kargo	2	.9
	Sürat Kargo	14	6.2
	UPS Kargo	11	4.9
	FEDEX Kargo	1	.4
	Toplam	225	100.0

Tablo 2'ye göre örneklemin %18,7'si PTT Kargo'dan, %15,6'sı MNG Kargo'dan, %40'ı Yurtiçi Kargo'dan, %13,3'ü Aras Kargo'dan, % 9'u DHL Kargo'dan, %6,2'si Sürat Kargo'dan, %4,9'u UPS Kargo'dan, %4'ü FEDEX Kargo'dan hizmet almıştır.

Tablo 3: Ankete Katılanların Yaş Frekans Dağılımları

Yaşınız hangi aralıkta?			
		Sıklık	Yüzde
Valid	18-25 yaşları arası	27	12.0
	26-35 yaşları arası	109	48.4
	36-45 yaşları arası	30	13.3
	46-59 yaşları arası	52	23.1
	60 yaş üstü	7	3.1
	Toplam	225	100.0

Tablo 3'e göre 18- 25 yaş aralığındaki grup örneklemin %12'sini, 26-35 yaş aralığındaki grup örneklemin %48,4'ünü, 36-45 yaş aralığındaki grup örneklemin %13,3'ünü, 46-59 yaş aralığındaki grup örneklemin %23,1'ini, 60 üstü yaş aralığındaki grup örneklemin %3,1'ini oluşturmaktadır.

Kargo şirketleri ile firmanın hizmet fiyatlarını karşılaştıran, kargo şirketleri- hizmet fiyatı çapraz tablosu Tablo 4'te verilmektedir.

Tablo 4: Kargo Şirketleri- Hizmet Fiyatı Çapraz Tablosu

			Firmanın hizmet fiyatlarını, verdiği hizmet ile karşılaştırdığınızda nasıl bir yorum yaparsınız?						Total
			Hiçbir Fikrim Yok	Çok Kötü	Kötü	Orta	İyi	Çok İyi	
Hangi kargo şirketlerinden hizmet aldınız?	PTT Kargo	Count	0	6	5	8	9	14	42
		% within Hangi kargo şirketlerinden hizmet aldınız?	0,0%	14,3%	11,9%	19,0%	21,4%	33,3%	100,0%
		% within Firmanın hizmet fiyatlarını, verdiği hizmet ile karşılaştırdığınızda nasıl bir yorum yaparsınız?	0,0%	33,3%	22,7%	12,9%	10,3%	45,2%	18,7%
	MNG Kargo	Count	0	3	1	11	17	3	35
		% within Hangi kargo şirketlerinden hizmet aldınız?	0,0%	8,6%	2,9%	31,4%	48,6%	8,6%	100,0%
		% within Firmanın hizmet fiyatlarını, verdiği hizmet ile karşılaştırdığınızda nasıl bir yorum yaparsınız?	0,0%	16,7%	4,5%	17,7%	19,5%	9,7%	15,6%
	Yurtiçi Kargo	Count	4	4	9	26	40	7	90
		% within Hangi kargo şirketlerinden hizmet aldınız?	4,4%	4,4%	10,0%	28,9%	44,4%	7,8%	100,0%
		% within Firmanın hizmet fiyatlarını, verdiği hizmet ile karşılaştırdığınızda nasıl bir yorum yaparsınız?	80,0%	22,2%	40,9%	41,9%	46,0%	22,6%	40,0%
	ARAS Kargo	Count	0	3	3	10	13	1	30
		% within Hangi kargo şirketlerinden hizmet aldınız?	0,0%	10,0%	10,0%	33,3%	43,3%	3,3%	100,0%
		% within Firmanın hizmet fiyatlarını, verdiği hizmet ile karşılaştırdığınızda nasıl bir yorum yaparsınız?	0,0%	16,7%	13,6%	16,1%	14,9%	3,2%	13,3%
DHL Kargo	Count	0	0	0	1	0	1	2	
	% within Hangi kargo şirketlerinden hizmet aldınız?	0,0%	0,0%	0,0%	50,0%	0,0%	50,0%	100,0%	

Kargo Şirketi Seçimine Yönelik Kriterlerin Belirlenmesinde Türkiye Genelinde Bir Saha Araştırması

		% within Firmanın hizmet fiyatlarını, verdiği hizmet ile karşılaştırdığımızda nasıl bir yorum yaparsınız?	0,0%	0,0%	0,0%	1,6%	0,0%	3,2%	,9%
	Sürat Kargo	Count	0	1	3	3	4	3	14
		% within Hangi kargo şirketlerinden hizmet aldınız?	0,0%	7,1%	21,4%	21,4%	28,6%	21,4%	100,0%
		% within Firmanın hizmet fiyatlarını, verdiği hizmet ile karşılaştırdığımızda nasıl bir yorum yaparsınız?	0,0%	5,6%	13,6%	4,8%	4,6%	9,7%	6,2%
	UPS Kargo	Count	1	1	0	3	4	2	11
		% within Hangi kargo şirketlerinden hizmet aldınız?	9,1%	9,1%	0,0%	27,3%	36,4%	18,2%	100,0%
		% within Firmanın hizmet fiyatlarını, verdiği hizmet ile karşılaştırdığımızda nasıl bir yorum yaparsınız?	20,0%	5,6%	0,0%	4,8%	4,6%	6,5%	4,9%
	FEDEX Kargo	Count	0	0	1	0	0	0	1
		% within Hangi kargo şirketlerinden hizmet aldınız?	0,0%	0,0%	100,0%	0,0%	0,0%	0,0%	100,0%
		% within Firmanın hizmet fiyatlarını, verdiği hizmet ile karşılaştırdığımızda nasıl bir yorum yaparsınız?	0,0%	0,0%	4,5%	0,0%	0,0%	0,0%	,4%
Total		Count	5	18	22	62	87	31	225
		% within Hangi kargo şirketlerinden hizmet aldınız?	2,2%	8,0%	9,8%	27,6%	38,7%	13,8%	100,0%
		% within Firmanın hizmet fiyatlarını, verdiği hizmet ile karşılaştırdığımızda nasıl bir yorum yaparsınız?	100,0%	100,0%	100,0%	100,0%	100,0%	100,0%	100,0%

Tablo 4'e göre, PTT Kargo için katılımcıların % 33,3'ü hizmet fiyatlarını çok kötü, %22,7'si hizmet fiyatlarını kötü, %12,9'u hizmet fiyatlarını orta, %10,3'ü hizmet fiyatlarını iyi, %45,2'si hizmet fiyatlarını çok iyi bulmaktadır. PTT Kargo'nun hizmet fiyatlarını çok iyi bulan müşteri sayısı çoğunluktadır.

MNG Kargo için katılımcıların %16,7'si hizmet fiyatlarını çok kötü, % 4,5'i hizmet fiyatlarını kötü, %17,7'si hizmet fiyatlarını orta, %19,5'i hizmet fiyatlarını iyi, %9,7'i hizmet fiyatlarını çok iyi bulmaktadır. MNG Kargo'nun hizmet fiyatlarını iyi bulan müşteri sayısı çoğunluktadır.

Yurtiçi Kargo için katılımcıların % 80'i hiçbir fikir beyan etmemiştir, % 22,2'si hizmet fiyatlarını çok kötü, %40,9'u hizmet fiyatlarını kötü, %41,9'u hizmet fiyatlarını orta, %46'sı hizmet fiyatlarını iyi, %22,6'sı hizmet fiyatlarını çok iyi bulmaktadır. Yurtiçi Kargo'nun hizmet fiyatlarını orta seviyede bulan müşteri sayısı çoğunluktadır.

Aras Kargo için katılımcıların % 16,7'si hizmet fiyatlarını çok kötü, %13,6'sı hizmet fiyatlarını kötü, %16,1'i hizmet fiyatlarını orta, %14,9'u hizmet fiyatlarını iyi, %3,2'si hizmet fiyatlarını çok iyi bulmaktadır. Aras Kargo'nun hizmet fiyatlarının çok kötü olduğunun düşünen müşteri sayısı çoğunluktadır.

DHL Kargo için katılımcıların %1,6'sı hizmet fiyatlarını orta, %3,2'si hizmet fiyatlarını çok iyi bulmaktadır. DHL Kargo'nun hizmet fiyatlarının çok iyi olduğunu düşünen müşteri sayısı çoğunluktadır.

Sürat Kargo için katılımcıların % 5,6'sı hizmet fiyatlarını çok kötü, %13,6'sı hizmet fiyatlarını kötü, %4,8'i hizmet fiyatlarını orta, %4,6'sı hizmet fiyatlarını iyi, %9,7'si hizmet fiyatlarını çok iyi bulmaktadır. Sürat Kargo'nun hizmet fiyatlarının kötü olduğunu düşünen müşteri sayısı çoğunluktadır.

UPS Kargo için katılımcıların % 20'si hiçbir fikir belirtmemiştir, % 5,6'sı hizmet fiyatlarını çok kötü, %4,8'i hizmet fiyatlarını orta, %4,6'sı hizmet fiyatlarını iyi, %6,5'i hizmet fiyatlarını çok iyi bulmaktadır. UPS Kargo'nun hizmet fiyatlarını çok iyi bulan müşteri sayısı çoğunluktadır.

FEDEX Kargo için katılımcıların %4,5'i hizmet fiyatlarını kötü bulmaktadır.

Kargo Şirketleri ile hizmet fiyatları arasında bir ilişkinin olup olmadığı Ki-Kare Testi ile incelenmiştir. 5'ten küçük beklenen sıklıkların sayısı toplam gözlem sayısının (n=225) %20'sinden (45) az olduğu için ki-kare analizi yapılmış ve sonuçlar Tablo 5'de verilmiştir.

Tablo 5: Kargo Şirketleri- Hizmet Fiyatları İlişki Analizi Ki-Kare Testi Sonuçları

Chi-Square Tests			
	Value	df	Asymp. Sig. (2-sided)
Pearson Chi-Square	53,494 ^a	35	,024
Likelihood Ratio	50,381	35	,045
Linear-by-Linear Association	,824	1	,364
N of Valid Cases	225		
a. 35 cells (72,9%) have expected count less than 5. The minimum expected count is ,02.			

H_0 : Kargo Şirketleri İle Hizmet Fiyatı Arasında İlişki Yoktur.

H_1 : Kargo Şirketleri İle Hizmet Fiyatı Arasında İlişki Vardır.

[$\chi^2 = 53.494$, p-değeri=0.024] [$G^2=50.381$, p-değeri=0.045]

$\alpha=0.05$ alındığında p-değeri< α olduğundan H_0 hipotezi reddedilir.

%95 güvenle kargo şirketleri ile hizmet fiyatı arasında ilişki vardır.

Kargo şirketleri- hizmet fiyatları için Cramer's V ilişki katsayısı testi sonuçları Tablo 6'da verilmiştir.

Tablo 6: Kargo Şirketleri- Hizmet Fiyatları için Cramer's V İlişki Katsayısı Testi Sonuçları

Symmetric Measures			
		Value	Approx. Sig.
Nominal by Nominal	Cramer's V	,218	,024
N of Valid Cases		225	

Tablo 6'ya göre kargo şirketleri ile hizmet fiyatı arasında %21,8 lik orta şiddette bir ilişki olduğu söylenebilir.

Kargo şirketleri ve kriterler arasındaki anlamlı ilişki analizi sonuçları Tablo 7'de verilmiştir.

Tablo 7: Kargo Şirketleri ve Kriterler Arasındaki Anlamlı İlişki Analizi Sonuçları

Kargo Şirketleri/	Ki-Kare Değeri	P-Değeri	Sonuç
Hizmet Fiyatı	53,494	0,024	İlişki Var
Şube Sayısı ve Ulaşılabilirlik	44,775	0,125	İlişki Yok
Çalışan Sayısı Yeterliliği	41,37	0,212	İlişki Yok
Kargo Teslimat Hızı	37,598	0,351	İlişki Yok
Çalışma Saatleri Esnekliği	45,156	0,117	İlişki Yok
Reklam Başarısı Ve İtibar	42,445	0,181	İlişki Yok
Firma Güvenilirliği	25,342	0,885	İlişki Yok
Firmanın Deneyimi	35,998	0,422	İlişki Yok
Firmanın Kalitesi	32,147	0,607	İlişki Yok
Şikayetlere Cevap Verebilirlik	29,109	0,748	İlişki Yok
Teknoloji Güncelliği ve Yeterliliği	26,488	0,849	İlişki Yok
Firmanın Verdiği Güvencesi	44,49	0,131	İlişki Yok
Firma Çevre Bilinci	47,017	0,084	İlişki Yok
Acil Durum Yönetimi ve Çözüm Bulma Becerisi	51,816	0,033	İlişki Var
Firmanın Ekonomik Geçmişi ve Finansal İstikrarı	52,044	0,032	İlişki Var
Firma Sosyal Sorumluluk Projeleri	35,845	0,429	İlişki Yok
Kargo Takip Ara yüzünün Kullanışlılığı	23,553	0,93	İlişki Yok

Kargo şirketleri ve aralarında ilişki bulunan kriterler için Cramer's V ilişki katsayısı analizi sonuçları Tablo 8'de verilmiştir.

Tablo 8: Kargo Şirketleri ve Aralarında İlişki Bulunan Kriterler için Cramer's V İlişki Katsayısı Analizi Sonuçları

Kargo şirketleri/	Symmetric Measures		
		Value	Approx. Sig.
Acil Durum Yönetimi ve Çözüm Bulma Becerisi	Nominal by Cramer's V	,215	,033
	N of Valid Cases	225	
Ekonomik Geçmiş ve Finansal İstikrar	Nominal by Cramer's V	,215	,033
	N of Valid Cases	225	
Hizmet Fiyatları	Nominal by Cramer's V	,218	,024
	N of Valid Cases	225	

Tablo 7 ve Tablo 8'deki sonuçları bir arada değerlendirildiğinde, kriterlerden hizmet fiyatı ile kargo şirketleri arasında %21,8'lik orta şiddette bir ilişki, acil durum yönetimi ve çözüm bulma becerisi ile kargo şirketleri arasında %21,5'lik orta şiddette bir ilişki, firmanın ekonomik geçmişi ve finansal istikrarı ile kargo şirketleri arasında %21,5'lik orta şiddette bir ilişki bulunmuştur. Ki-Kare Testi sonuçlarına göre diğer kriterler ile kargo şirketleri arasında %95 güvenirlilikte istatistiksel olarak anlamlı bir ilişki bulunmamaktadır.

3. SONUÇ VE DEĞERLENDİRME

Yapılan çalışmada, Türkiye genelinde, müşterilerin, kargo sektöründe hizmet vermekte olan ulusal ve uluslararası kargo şirketlerini seçerken, hangi kriterlerin göz önünde bulundurulması gerektiği üzerine bir saha araştırması yapılmıştır. Literatür taramaları ile belirlenmiş olan 17 adet kriteri birebir karşılayacak şekilde hazırlanan soruları içeren anket çalışması hazırlanarak, kriterler ve bu kriterlere göre müşteri görüşleri baz alınarak değerlendirmeye dahil edilen kargo şirketlerinin sıralaması yapılmaya çalışılmıştır.

Kargo şirketlerinin müşteriler tarafından tercih edilmesinde en önemli hizmet özelliklerinin hangilerinin olduğu ve bu özelliklerin firmanın tercih edilmesiyle istatistiksel olarak anlamlı bir ilişkilerinin olup olmadığı analiz edilmiştir. Yapılan analizlerde Hizmet Fiyatı, Acil Durum Yönetimi Çözüm Bulma Becerisi ve Firmanın Ekonomik Geçmişi Finansal İstikrarı olmak üzere 3 adet kriter ile aralarında %95 güven aralığında istatistiksel olarak anlamlı ilişki olduğu tespit edilmiştir. Bu da bize müşterilerin kargo şirketleri tercihlerinde hizmet fiyatlarındaki ekonomik uygunluğu,

kargonun kaybolması, paketinin zarar görmesi vb. acil durumlarda firmanın müşteri sorunları ile etkin ve etkili bir şekilde ilgilenme potansiyelini ve firmanın geçmişindeki ekonomik istikrarıyla köklü bir şirket olması özelliğini ön planda tuttıklarını göstermektedir.

Müşterilerin görüşleriyle oluşturulan anket değerlendirmesi neticesinde, Türkiye genelinde en etkin hizmet veren ilk üç kargo şirketinin sırasıyla yüzdeleri ile birlikte, Yurtiçi Kargo (% 40) , PTT Kargo (%18.7) ve MNG Kargo (%15.6) olduğu belirlenmiştir. Ankete katılan müşterilerin yaş dağılımının % 48.4 ile en fazla 26-35 yaşları arasında olduğu tespit edilmiştir. Kargo şirketlerinin hedef kitlesinin en fazla bu yaş aralığında olduğu söylenebilir.

Hizmet fiyatları kriterine göre değerlendirme yapıldığında firmaların hizmet fiyatlarını çok iyi bulanların oranları; PTT Kargo için %45,2, MNG Kargo için %9,7, Yurtiçi Kargo için %22,6, Aras Kargo için %3,2, DHL Kargo için %3,2, UPS Kargo için %6,5 ve Sürat Kargo için %9,7'dir. Bu da göstermektedir ki hizmet fiyatlarının diğerlerinden çok daha uygun olduğu düşünülen kargo şirketi PTT Kargo'dur.

Acil durum yönetimi çözüm bulma becerisi kriterine göre değerlendirme yapıldığında firmaların acil durum yönetimlerini çok iyi bulanların oranları; PTT Kargo için %19, MNG Kargo için %19, Yurtiçi Kargo için %28,6, Aras Kargo için % 0, DHL Kargo için %4,8, UPS Kargo için %14,3 ve Sürat Kargo için %21,4'dür. Bu da göstermektedir ki acil durum yönetiminde diğerlerinden çok daha iyi olduğu düşünülen kargo şirketi Yurtiçi Kargo'dur.

Firmaların ekonomik geçmişi ve finansal istikrarlarına göre değerlendirme yapıldığında, firmaları bu konuda çok iyi bulanların oranları; PTT Kargo için %35,1, MNG Kargo için %13,5, Yurtiçi Kargo için %21,6, Aras Kargo için % 10,8, DHL Kargo için %2,7, UPS Kargo için %36,4 ve Sürat Kargo için %5,4'dür. Bu da göstermektedir ki ekonomik geçmişi ve finansal istikrarı göz önüne alındığında diğerlerinden çok daha iyi olduğu düşünülen kargo şirketi UPS Kargo'dur.

Sonuç olarak, bu çalışma, zorlu rekabet koşullarında kargo sektöründe hayatta kalmak ve/veya karlarını artırmak isteyen kargo şirketlerine ilk olarak hizmet fiyatlarını yeniden gözden geçirmeleri ve kampanyalarla destekleyebilecekleri uygun hizmet fiyatlarını müşterilere sunmaları önerisini getirmektedir. Ayrıca acil durum yönetimi sistemlerini geliştirmelerini, gerektiğinde müşterilere yardımcı olacak en iyi şekilde, etkili ve hızlı çözüm bulma becerisine sahip olmaları gerektiği önerisini de getirmektedir.

KAYNAKÇA

- Bhatnagar R, S. A. (1999). Third Party Logistics Services: A Singapore Perspective. *International Journal of Physical Distribution and Logistics Management*, s. 29(9):569–87.
- Boyson S, C. T. (1999). Managing Effective Third Party Logistics Relationships: What Does It Take? *Journal of Business Logistics*, s. 20(1):73–100.
- globalkargo.com/kargo-tasimaciligi*. (2015, Mart 19). GLOBAL KARGO: <http://www.globalkargo.com/kargo-tasimaciligi.aspx> adresinden alındı
- Meng S. M., L. G. (2010, September). Criteria for services of air Cargo Logistics Providers: How do they relate to client satisfaction? *Journal of Air Transport Management, Volume 16, Issue 5*, s. 284–286.
- Moberg C.R., S. T. (2004). Third-Party Warehousing Selection: A Comparison Of National And Regional firms. *American Journal Of Business*, s. 19(2):71–6.
- Murphy P.R., D. J. (1997). Investigating Selection Criteria For International Freight Forwarders. *Transportation Journal*, s. 37(1):29–36.
- MUSİAD. (2013). *Lojistik Sektörü 2013 Raporu*. MUSİAD (Müstakil Sanayici ve İş Adamları Derneği).
- Park, Y. C. (2009, March). Evaluating Competitiveness Of Air Cargo Express Services. *Transportation Research Part E: Logistics and Transportation Review, Volume 45, Issue 2*, s. 321–334.
- Rajesh R., P. S. (2011 , Mart). Hindistanda Müşteri Performansına 3PL Sağlayıcılarının Etkisi. *Transportation Research Part E: Logistics and Transportation Review, Volume 47, Issue 2*, s. 149–165.
- Spencer MS, R. D. (1994). JIT Systems And External Logistics Suppliers. *International Journal Of Operations And Production Management*, s. 60–74.
- YU J., . N. (2015, Ocak). Product Delivery Service Provider Selection and Customer Satisfaction in The Era of Internet of Things: A Chinese e-Retailers' Perspective. *International Journal of Production Economics, Volume 159*, s. 104-116.

Balassa-Samuelson Hipotezinin İçsel Aktarım Mekanizmasının Türkiye Ekonomisi İçin Test Edilmesi

Internal Mechanism of Balassa-Samuelson Hypothesis for the Turkish Economy

Almila Burgaç ÇİL¹

ÖZET

Bu çalışmanın amacı, Türkiye ekonomisi ve EU-27 bölgesi arasında Balassa-Samuelson (B-S) (1964) hipotezinin içsel aktarım mekanizmasını 2001:Q1-2014:Q1 dönemini kapsayan veri seti ile Gecikmesi Dağıtılmış Ardışık Bağımlı Modeller Analizi (ARDL) sınır testi yaklaşımını kullanılarak sınamaktır. Sonuçlar, B-S hipotezinin içsel aktarım mekanizmasını desteklemektedir. 2001 sonrasında, Türkiye ve EU-27 arasında, göreceli fiyat farklılığındaki artışın göreceli verimlilik farklılığındaki artıştan kaynaklandığı sonucuna ulaşılmıştır.

Anahtar kelimeler: Balassa-Samuelson Hipotezi, içsel aktarım mekanizması, verimlilik, ARDL, eşbütünlük

ABSTRACT

The purpose of this study is to test the internal mechanism of Balassa-Samuelson (B-S) (1964) hypothesis between Turkey and EU-27 area during 2001:Q1-2014:Q1 using the Autoregressive Distributed Lag (ARDL) method. The results support the international mechanism of B-S hypothesis. An increase in relative productivity differences in tradable and non-tradable sectors between Turkey and EU-27 leads to an increase in the relative price differences after 2001.

Keywords: Balassa-Samuelson Hypothesis, internal mechanism, productivity, ARDL, cointegration

¹ Araş.Gör., Çukurova Üniversitesi, İ.İ.B.F. İktisat Bölümü, aburgac@cu.edu.tr

1. Giriş

Geleneksel döviz kuru modellerinin ilkinin Satın Alma Gücü Paritesi (PPP) teorisi oluşturmaktadır. Sadece mal piyasasını göz önüne alan PPP göreceli ve mutlak PPP'den oluşmaktadır. Ancak zaman içerisinde PPP'den sapmaların reel döviz kurunun denge değerinde değişmelere yol açtığı gözlenmektedir. PPP'den sapmaların yapısal ve kalıcı olmasını, uluslararası fiyat farklılaşmasının nedenini açıklayan en önemli modellerden biri, ticarete konu olan ve ticarete konu olmayan sektörler arasındaki göreceli verimlilik büyümesine dayandıran Balassa-Samuelson (B-S) hipotezidir. B-S hipotezine göre, gelişmekte olan ülkelerde gelişmiş ülkelere göre ticarete konu olan sektörlerdeki göreceli verimlilik artışları ticarete konu olmayan sektörlerle göre daha hızlıdır. Ticarete konu olan sektörlerde hızlı verimlilik artışları işgücünün sektörler arasında tam hareketli olduğu varsayımında her iki sektörde de reel ücretlerin artmasına neden olacaktır. Ancak ticarete konu olmayan sektörlerdeki verimlilik artışının bu sektörlerdeki ücret artışlarından daha düşük olması, işgücü maliyetinin artmasına, fiyatların yükselmesine neden olacaktır. Ticarete konu olan sektörlerde fiyatların dünya piyasalarında belirlendiği göz önüne alındığında ticarete konu olmayan göreceli fiyatların artması ekonomide genel fiyat düzeyinin artmasına sebep olacaktır. B-S hipotezinde göreceli verimlilik farklılıklarının hem göreceli fiyatlar hem de reel döviz kuru üzerindeki etkisi içsel ve dışsal aktarım mekanizması olarak iki yönlü ele alınmaktadır.

Türkiye Cumhuriyet Merkez Bankası (TCMB) verimlilik artışlarına ve sektörler arasındaki fiyat artışlarındaki farklılaşmayı Enflasyon Raporu II (2006)'da vurgulamaktadır. Özellikle "2001 krizi sonrasında süregelen yapısal reformlar ve ekonomide özel sektörün rolünün artması verimlilik artışlarını doğrudan desteklemektedir. Yapısal reformların doğrudan etkisinin yanında, son yıllarda artan güven ortamı ve makroekonomik istikrar ticarete konu olan ve olmayan mallar arasındaki göreceli fiyat farklılaşması yoluyla dolaylı olarak ulusal paranın güçlü konumunu yapısal olarak desteklemektedir" (Enflasyon Görünümü II, 2006 Raporu, s.34). TCMB bu raporda kısmi emek verimliliğine vurgu yaparken B-S hipotezini işaret etmektedir

Bu bağlamda, Türkiye ekonomisi için B-S hipotezinin içsel aktarım mekanizması yani göreceli verimlilik farklılığının göreceli fiyatlar üzerindeki etkisi test edilmiştir. Türkiye ekonomisi için yapılmış ampirik literatür oldukça sınırlıdır. Bu çalışma, bu bağlamda literatüre katkı sağlaması amaçlanmıştır. Bu çalışmanın amacı, EU-27 ülkelerinin baz olarak alındığı Türkiye Ekonomisi için göreceli sektörel verimlilik farklılıklarındaki değişimin göreceli fiyat farklılıkları üzerindeki etkisi TCMB Enflasyon raporunda vurguladığı gibi 2001 sonrası dönem için (2001:Q1-2014Q1) Peseran vd. (2001) tarafından önerilen *ARDL* sınır testi yaklaşımı ile test etmektir. Sonuçlar ise göreceli verimlilik farklılıklarının göreceli fiyat değişimleri üzerinde pozitif etkisinin olduğunu ortaya koymaktadır.

Çalışmanın ikinci bölümünde Balassa-Samuelson hipotezinin teorik yapısı ve üçüncü bölümde¹ ise B-S hipotezinin içsel aktarım mekanizması açıklanmıştır. Dördüncü bölümde B-S hipotezinin içsel aktarım mekanizması ile ilgili ampirik literatür özetlenmiştir. Beşinci bölümde ise veri seti ve ekonometrik yöntem açıklanmış, altıncı bölümde uygulanan yöntemlere ilişkin sonuçlar ortaya konmuştur. Çalışma bulgularının tartışıldığı sonuç bölümüyle sonlandırılmıştır.

2. Balassa-Samuelson Hipotezinin Teorik Yapısı

Satın alma gücü paritesi teorisine göre uzun dönem denge değerinden sapmalar geçicidir. “Uzun dönemde PPP’nin geçerli olması için faktör fiyatları eşitliği, her bir malın ülkelerde fiyat indeksinde eşit ağırlığa sahip olduğu varsayımlarının doğruluğunun tartışmalı olduğu öne sürülmüştür. Zamanla üretim teknolojileri ve tüketim tercihleri farklı ülkelerde farklı değişimlere uğrar. Dolayısıyla ticarete konu olan ve olmayan malların göreceli fiyatının ülkeler arasında farklılaşması fiyatlar ve reel döviz kurundaki değişimle ilgilidir” (Isard, 1995, s.61).

Ticarete konu olan ve olmayan malların fiyatındaki farklılaşmayı ve reel döviz kurundaki değişimi açıklayan yaklaşımların başında Balassa ve Samuelson (B-S) hipotezi gelmektedir. B-S hipotezi reel döviz kuru ve göreceli fiyat hareketlerini ticarete konu olan ve olmayan sektörlerdeki verimlilik farklılıklarına dayandırarak açıklayan arz yanlı bir hipotezdır. Bu hipotez bağlamında, ticarete konu olan sektörlerdeki göreceli verimlilik artışının ticarete konu olmayan sektörlerden daha hızlı olması², yurtdışı ekonomide rekabete zarar vermeyecek düzeyde ücret artışına ve ticarete konu sektörlerde sermaye getiri oranları ile kar marjlarında değişime neden olur. Ancak, ticarete konu malların fiyatları uluslararası piyasalarda belirlendiğinden, verimlilik şoku bu fiyatları etkilememektedir. İşgücünün homojen ve sektörler arasında tam hareketli olduğu varsayımı ile ticarete konu olmayan sektörlerdeki ücret artışına verimlilik artışı eşlik etmediğinden ve firmalar fiyatları marjinal maliyete eşitleyerek hareket ettikleri için bu sektörlerde ücret artışları fiyat artışına neden olmaktadır³. Bu durum ise genel fiyat seviyesinde yükselmeye sebep olarak ülkenin reel döviz kurunda bir değerlendirme yaratmaktadır.

B-S hipotezi ülkede ticarete konu olan ve olmayan sektörler arasındaki verimlilik farklılıklarının göreceli fiyat farklılığı üzerindeki etkisini göstermek açısından önemlidir. B-S hipotezinde bu mekanizmanın tam olarak çalışabilmesi için bazı varsayımlara ihtiyaç vardır. Bunlar;

¹İkinci, üçüncü ve dördüncü bölüm, 2012 yılında tamamlanan “İktisat Teorisinde Balassa-Samuelson Hipotezi ve Türkiye Ekonomisi İçin Sınanması” başlıklı yüksek lisans tezimize dayandırılarak oluşturulmuştur.

²Ticarete konu olan sektörlerin uluslararası rekabete açık olması nedeniyle, teknolojik gelişmeleri daha hızlı içselleştirir ve bu sektörlerde verimlilik artışının daha yüksek olması beklenir (Balassa, 1964).

³Böylece ülkeler ve sektörler arasında göreceli fiyatlar işgücü maliyetine bağlı olup ve talebin fiyat oluşumunda katkısı yoktur (Coudert, 2004,s.28).

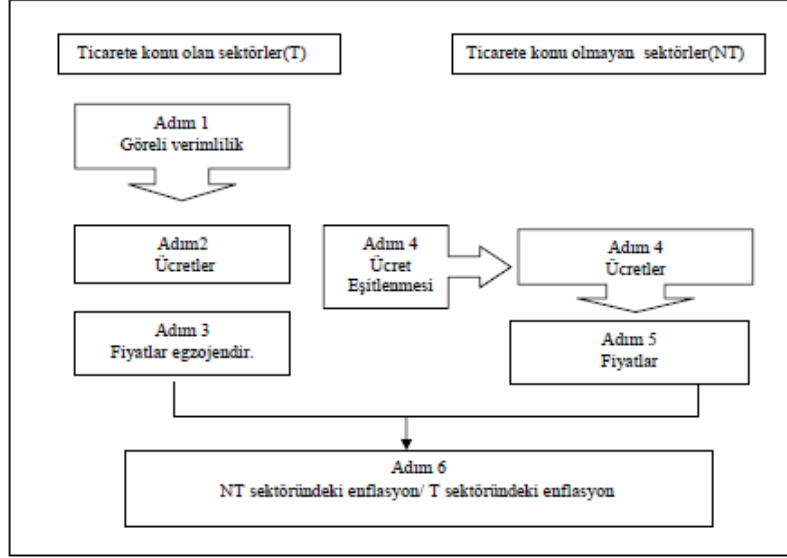
- Ülkeler ticarete konu olan ve ticarete konu olmayan sektörlerde mal üretmektedir.
- Ölçeğe göre sabit getiri varsayımında sermaye ve işgücünün girdi olarak kullanıldığı iki farklı üretim fonksiyonu temel alınmaktadır.
- Ticarete konu olmayan sektörler daha işgücü yoğunudur.
- Tam rekabet koşulları geçerlidir.
- Sermaye ise hem ülke içinde hem de ülkeler arasında tam hareketlidir.⁴
- Emek homojendir. Ticarete konu olan sektörlerde ücretler marjinal ürün tarafından belirlenir ve bu ücretler ticarete konu olmayan sektörlerde de geçerlidir.
- Sermaye stoku kısa dönemde sabittir.
- Ticarete konu olan mallar için PPP geçerlidir

Sermaye stoku, ticarete konu olan mal fiyatları ve faiz oranı dışsaldır. Bu varsayımlar altında, B-S hipotezi ticarete konu olan ve olmayan sektörler arasındaki yurt içi göreceli verimlilik farkının yurt dışından daha yüksek olması durumunda satın alma gücü paritesinden (PPP) yapısal ve kalıcı sapmalara neden olacağını ve reel döviz kurunun değer kazanmasına yol açacağını belirtmektedir. Ticarete konu olan sektörlerde fiyatların gelişmiş ve gelişmekte olan ülkelerde aynı olduğu varsayımı altında, fiyatlar genel seviyesinin gelişmekte olan ülkelere göre daha düşük olmasını sağlamaktadır. Zaman içerisinde ticaretin artması, ülkelere gelen doğrudan yabancı yatırımlarla yeni teknolojilere erişim gibi sebeplerden dolayı gelişmekte olan ülkelere ticarete konu olan sektörlerde verimlilik ve ücret artışları görülmektedir. Bu da görece verimliliğe bağlı olarak göreceli fiyatları arttırmaktadır.

3. Balassa-Samuelson Hipotezinin İçsel Aktarım Mekanizması

Ekonomik gelişim sürecinde, ticarete konu olan sektörlerde verimlilik artışı ticarete konu olmayan sektörlerle göre daha hızlı artmaya eğilimlidir. Ticarete konu olan sektörlerde fiyatlar uluslararası piyasalarda belirlendiği için bu sektörlerdeki verimlilik artışı rekabete zarar vermeyecek şekilde ücretlerin artışına imkan verecektir. Ticarete konu olmayan sektörlerdeki verimlilik aynı oranda artmazken, işgücünün sektörler arasında tam hareketli olduğu varsayımı ile ücretlerdeki bu artış bütün ekonomiye yayılacak ve diğer sektörlerdeki fiyatları yükseltecektir. Sektörler arasındaki verimlilik farklılıklarının toplam fiyat düzeyi üzerinde bir artışa yol açtığı bu mekanizma B-S hipotezinin içsel aktarım mekanizmasıdır. Şekil 1'de B-S hipotezinin içsel aktarım mekanizması açıklanmaktadır.

⁴ Bu varsayımda faiz oranı dünya faiz oranına eşittir.



Şekil 1. B-S Hipotezinin İçsel Aktarım Mekanizması

Kaynak: Çeliku ve Hoxiholl, 2007, s.12

B-S hipotezinin temel özellikleri Harrod (1933) ve Samuelson (1964)'de ele almasına ve Balassa (1964)'de ampirik olarak test edilmesine karşın matematiksel olarak açıkça Rogoff (1992)'de formüle edilmiştir (Tica ve Druzic,2006, s.5). Dışa açık küçük bir ekonomi için Rogoff (1992)'de formüle edilen ticarete konu olan ve olmayan malların üretildiği sektörler için üretim fonksiyonu aşağıdaki gibidir⁵.

$$Y_T = A_T (L_T)^\gamma (K_T)^{1-\gamma} \quad (1)$$

$$Y_{NT} = A_{NT} (L_{NT})^\delta (K_{NT})^{1-\delta} \quad (2)$$

Burada T ve N ticarete konu olan ve ticarete konu olmayan malları ifade ederken; Y çıktı düzeyini, A , L ve K sırasıyla teknoloji, işgücü ve sermayeyi göstermektedir. γ ve δ ise ticarete konu olan ve olmayan sektörlerde işgücünün payını belirtmektedir. Her iki sektör için geçerli olan kar fonksiyonu aşağıdaki gibi ifade edilmiştir.

$$\pi_T = P_T Y_T - R K_T - W L_T \quad (3)$$

$$\pi_{NT} = P_{NT} Y_{NT} - R K_{NT} - W L_{NT} \quad (4)$$

⁵ (Obstfeld ve Rogoff, 1996: 204-224), literatürde en açık çözümlenme Egert (2003)'de yapılmaktadır. Bakınız. Egert (2003, s.4-7)

π , R , W sırasıyla kar, faiz oranı ve ücreti gösterir. Üretim faktörlerinin tam hareketli olduğu, tam rekabet koşullarının sağlandığı, sermayenin ve işgücünün marjinal ürününün, reel faiz oranı ve reel ücretlere eşit olduğu, ve kar maksimizasyonu varsayımıyla aşağıdaki denklimler elde edilebilir.

$$\frac{\partial \pi_T}{\partial L_T} = P_T A_T \gamma \left(\frac{K_T}{L_T} \right)^{1-\gamma} = W \quad (6)$$

$$\frac{\partial \pi_{NT}}{\partial L_{NT}} = P_{NT} A_{NT} \delta \left(\frac{K_{NT}}{L_{NT}} \right)^{1-\delta} = W \quad (7)$$

$$\frac{\partial \pi_T}{\partial K_T} = P_T A_T (1-\gamma) \left(\frac{L_T}{K_T} \right)^\gamma = R \quad (8)$$

$$\frac{\partial \pi_{NT}}{\partial K_{NT}} = P_{NT} A_{NT} (1-\delta) \left(\frac{L_{NT}}{K_{NT}} \right)^\delta = R \quad (9)$$

Eşitliğin her iki tarafı da fiyata (P) bölünürse:

$$W / P_T = \gamma A_T (K_T / L_T)^{1-\gamma} \quad (10)$$

$$W / P_T = (P_{NT} / P_T) \delta A_{NT} (K_{NT} / L_{NT})^{1-\delta} \quad (11)$$

$$R / P_T = (1-\gamma) A_T (K_T / L_T)^{-\gamma} \quad (12)$$

$$R / P_T = (P_{NT} / P_T) (1-\delta) A_{NT} (K_{NT} / L_{NT})^{-\delta} \quad (13)$$

10-13 denkliklerin doğal logaritmaları ve toplam diferansiyelleri alınır ve fiyatlar normalize edildiğinde ve uluslararası faiz oranının değişmediği varsayımıyla ($dr=0$) denklimler aşağıdaki gibi tekrar yazılabilir.

$$da_T = \gamma d(k_T - l_T) \quad (14)$$

$$da_{NT} = \delta d(k_{NT} - l_{NT}) - d(p_{NT} - p_T) \quad (15)$$

$$dw = \gamma d(k_T - l_T) + (1-\gamma) d(k_T - l_T)^6 \quad (16)$$

$$dw = d(k_T - l_T) \quad (17)$$

Yukarıdaki denklimler yeniden düzenlendiğinde B-S etkisinin yurt içi uyarlaması olan denklik 18 elde edilir.

$$d(p_{NT} - p_T) = \frac{\delta}{\gamma} da_T - da_{NT} \quad (18)$$

(18) numaralı denklime göre, her iki sektörde işgücü yoğunluğunun aynı olması durumunda ($\gamma=\delta$), göreceli fiyatlar ticarete konu olan ve olmayan sektörlerdeki verimlilik farkı kadar yükselme kaydedecektir. Diğer yandan ticarete konu olmayan

⁶ Burada $w = \ln(w/p_T)$ 'dir.

sektörlerde işgücü yoğunluğunun daha fazla olması durumunda ise ($\delta > \gamma$) her iki sektörün verimliliği aynı olsa dahi göreceli fiyatlar artış göstermektedir (Funda vd., 2007; Egert, Halpern ve MacDonald, 2006; Bhagwathi, 1984; Kravis ve Lispey, 1983).

Sonuç olarak ticarete konu olmayan fiyatlar üzerinde verimlilik kazanımının etkisi gösterilmektedir.

$$(p_{NT} - p_T) = f(a_T - a_{NT}) \quad (19)$$

Aynı koşulların yurt dışı ülkeler için de geçerli olduğu varsayımında 19. denkleme bağlı olarak iki ülke arasındaki verimlilik farklılıkları ve göreceli fiyatlar arasındaki ilişki aşağıdaki gibi gösterilebilir.

$$(p_{NT} - p_T) - (p_{NT}^* - p_T^*) = c_t + (a_T - a_{NT}) - (a_T^* - a_{NT}^*) \quad (20)$$

4. İçsel Aktarım Mekanizmasının Test Edilmesine İlişkin Literatür Taraması

Göreceli sektörel verimlilik farklılığı ve göreceli fiyat düzeyi arasında ilişkiyi inceleyen içsel aktarım mekanizmasına ilişkin yapılan ampirik çalışmaların önemli bir çoğunluğu B-S etkisinin varlığı lehinde sonuçlara ulaşmıştır.

Hem arz yanlı ve hem de talep yanlı etkileri birlikte sınavan Bergstrand (1991) çalışmasında talep yanlı teoride yüksek gelir düzeyindeki ülkelerin hizmet fiyatlarının yüksek olduğunu öngörmüştür. Hizmet fiyatlarındaki hızlı büyümenin arkasındaki sebebi açıklamak için yazar hizmetleri lüks mal varsaymıştır. Talep yanlı teoriyi test etmek için Stone-Geary fayda fonksiyonundan elde edilen talep fonksiyonunu ve arz fonksiyonunu kullanmıştır. Analizde, hizmetlerle ilişkili mallarda verimlilik düzeyi ve sermaye işgücü getiri oranının, reel döviz kurları ve ticarete konu olmayan göreceli fiyatları önemli ölçüde etkilediği sonucuna ulaşılmıştır.

Rogoff (1992) B-S etkisini analiz ederken talep yanlı etkileri de göz önüne almıştır. Fiyat düzeyinin belirlenmesinde sadece göreceli verimliliğin etkilerini değil aynı zamanda kamu harcamaları, tercihler, petrol fiyatı gibi uzun dönemde göreceli fiyat düzeylerinde değişikliklere yol açan talep yanlı etkileri de modele dahil etmiştir. Rogoff modelinde talep yanlı etkilerin, örneğin kamu harcamalarının döviz kurunu açıklamada etkili olduğunu bulmuş ve ticari mallardaki verimlilik şokunun yalnız başına reel döviz kurunu tahmin etmede başarılı olamayacağı sonucuna ulaşmıştır.

Asea ve Mendoza (1994) B-S hipotezini, ülkeler arasında faktör donatımlarını ve teknolojiyi içeren dinamik denge modeline dayanarak tahmin etmiştir. Yazarlar, B-S hipotezinin iki test edilebilir önermesini analiz etmiştir. Bu önermelerden birincisi verimlilik farklılıklarının yurt içi ticarete konu olmayan göreceli mal fiyatını belirleyeceği, ikincisi ise PPP'den sapmaların ticarete konu olan mal fiyatlarındaki farklılıklara yol açabileceğini ifade etmektedir. Sonuçlara göre verimlilik farklılıkları

ticarete konu olmayan göreceli fiyatları belirlemektedir. Ancak, yazarlar PPP'den sapmaların ticarete konu olmayan göreceli fiyatlardaki farklılıkları ifade ettiğine ilişkin önermeyi destekleyen zayıf kanıtlara ulaşmıştır.

Verimlilik farklılıklarının ve talepte kaymaların temel nedeninin ticarete konu olmayan göreceli fiyatlardaki değişim olduğunu ifade eden DeGregorio vd. (1994), 14 OECD ülkesi için ticarete konu olmayan mal fiyatlarının ticarete konu olan sektörlerde üretim ile pozitif ilişkili olduğunu bulmuştur. Çalışmada 1970-1985 periyodu için sektörel veriler kullanılarak ticarete konu olmayan mal fiyatlarının hareketlerinde belirleyici olan talep faktörlerinin önemi vurgulanmıştır. Ticarete konu olan ve olmayan sektörlerde verimlilik ölçütü olarak TFP kullanılmıştır. Görünüşte ilişkisiz regresyon modeli (SUR) ile tahmin edilen bulgulara göre, Ekonomik İşbirliği ve Kalkınma Örgütü (OECD) ülkelerinde ticarete konu olmayan sektörlerdeki enflasyonun gelir büyümesi ve verimlilik farklılıkları kontrol edildikten sonra dahi ticarete konu olmayan göreceli fiyatlardaki değişimleri etkilemede önemli olduğu sonucuna ulaşılmıştır.

Alberola ve Tyrvainen (1998), standart ve genişletilmiş B-S hipotezini eşbütünleşme yöntemiyle 1975-1995 periyodunda 11 Avrupa ülkesi için test etmiştir. Yazarlar genişletilmiş modelde sektörler arasında ücretlerin eşit olmadığını varsayarak ticarete konu olan ve olmayan sektörler arasında ücret farklılıklarını modele dahil etmiştir. Enflasyon ve verimlilik arasındaki uzun dönemli ilişki standart modelde Almanya, İspanya ve Belçika için, genişletilmiş modelde ise Hollanda hariç diğer tüm ülkeler için doğrulanmıştır.

Kohler (2000) 1960-1997 yıllarını kapsayan dönemde gelişmekte olan ve endüstrileşmiş 28 ülke için ilk olarak uzun dönem göreceli fiyat hareketlerini açıklamak için B-S hipotezine göre sektörel verimlilik büyümesinin ne kadar önemli olduğunu araştırmış, ikinci olarak da, eğer nominal döviz kuru sabit ise verimlilik büyümesinin enflasyona yol açtığına ilişkin sorulara cevap aramıştır. Sonuçlar göreceli fiyat ve göreceli verimlilik arasında pozitif ilişkinin olduğunu göstermiştir. Ancak bu bağlantının gücü ülkeler arasında farklılaşmaktadır.

Dokuz geçiş ülkesinde 1991-1999 periyodu için panel veri kullanarak B-S etkisini test eden Halpern ve Wyplosz (2001) ticarete konu olan sektör olarak endüstri ve ticarete konu olmayan sektör olarak ise hizmet sektörünü seçmiştir. Verimlilik ölçütü olarak ortalama işgücü verimliliğini kullanmıştır. Bağımsız değişken olarak modelde ticarete konu olan ve olmayan sektörlerdeki verimlilikler, enflasyon oranındaki değişim ve kişi başı gelire göre düzeltilmiş PPP yer almıştır. Sonuçlara göre, verimliliklerin katsayısı teori ile tutarlı ve anlamlıdır. Ticarete konu olan sektörlerdeki verimliliğin katsayısı 0.24, hizmet sektöründeki verimliliğin katsayısı ise -0.18'dir. Kişi başı gelirin katsayısı küçük olmakla birlikte pozitif, enflasyonun etkisi ise içsel fiyat oranı üzerinde belirgin değildir. Halpern ve Wyplosz (2001) çalışmasında esnek döviz kuru rejiminde B-S etkisinin güçlü olduğunu göstermiştir.

Kakkar (2003), sermayenin ülke içinde ve uluslararası tam hareketli olduğu, ticarete konu olmayan mal fiyatlarının ticarete konu olan ve olmayan mallar üzerinde

tercihlerden bağımsız olduğu varsayımında B-S hipotezini test etmiştir. Yazar ticarete konu olmayan göreceli fiyatlardaki değişimin TFP tarafından açıklanıp açıklanamayacağını incelemiştir. 14 OECD ülkesinden alınan veriler B-S hipotezini desteklemektedir. Ticarete konu olmayan malların göreceli fiyatları ve işgücü payı ile düzeltilmiş TFP farklılıkları eşbütünleşiktir. Ticarete konu olmayan göreceli mal fiyatlarının ve reel döviz kurunun uzun dönemde birlikte hareket ettiğiyle ilişkili kanıtlarla bağlantılı olarak çalışmada, ticarete konu olan ve olmayan sektörlerde teknolojinin farklı düzeylerde gelişim göstermesi reel döviz kuru sapmalarını açıklamada önemli bir faktör olarak belirtilmektedir.

Lojschova (2003) Slovakya, Çek Cumhuriyeti, Macaristan, Polonya ve Avrupa bölgesi arasında son 10 yılda gözlenen göreceli fiyat farklılıklarını B-S hipotezi çerçevesinde açıklamaya çalışmıştır. Panel tahmin yöntemleri kullanılarak B-S etkisi lehinde güçlü kanıtlara ulaşılmıştır. Verimlilik büyüme farklılığında % 1'lik bir artışın göreceli fiyatları Slovakya'da % 1.7, Çek Cumhuriyeti'nde % 1.3, Macaristan'da % 0.8 ve Polonya'da % 2 arttırdığı gözlenmiştir. Buna ek olarak ticarete konu olan mallar için PPP'nin geçerli olduğu varsayımı esnetildiğinde Slovakya ve Çek Cumhuriyeti için verimlilik büyüme farklılıklarının göreceli fiyatlar üzerinde bir etkiye sahip olmadığı, ancak Macaristan ve Polonya açısından pozitif ilişkinin ise devam etmekte olduğu kanıtına ulaşılmıştır.

B-S hipotezi çerçevesinde, Estonya için nominal ve reel yakınsama sürecini analiz eden Egert (2003), 1993Q1-2002Q1 dönemi arasında verimlilik farklılığı ve ticarete konu olmayan göreceli fiyatlar arasındaki ilişkinin varlığını ortaya koymuştur. Ayrıca yazar tüketici Fiyat Endeksi'nde (TÜFE) müdahale edilmiş fiyatların rolünü de belirtmiştir. Ayarlanmış fiyatlar kapsam dışı bırakıldığında verimlilik ve göreceli fiyatlar arasındaki ilişki oldukça güçlüdür. B-S etkisi yıllık ortalama %2 - %3 arasındadır. Verimlilikteki değişim periyodun başlangıcında %1-%4 arasında iken 2000 ve 2001 yıllarında %0.5 - %1 düzeyinde TÜFE'ye katkı yapmaktadır. Estonya üzerinde B-S etkisi uzun dönemde %1 - %2 olarak tahmin edilmiştir. İngiltere, Almanya, İsveç ve Finlandiya'ya karşı reel döviz kurunun değerlendirilmesi ve enflasyon farklılıkları üzerinde B-S etkisinin katkısı 1990 yılları başında oldukça yüksek görünürken son yıllarda meydana gelen reel değerlendirilmeyi daha iyi açıklamaktadır. 1993-2002 yılları arasında Estonya'da B-S etkisinin büyüklüğünün enflasyon üzerinde sınırlı olmasının ana sebebi TÜFE'de piyasa ve toplam hizmetlerin payının oldukça düşük olmasıdır. TÜFE bazlı göreceli fiyat farklılıkları, dışa açık sektörlerde verimlilik avantajının ücret ayarlama sisteminden dolayı, oransal olarak hizmet fiyatlarına yansımalarının daha kısıtlı olduğunu göstermiştir.

Lommatsch ve Tober (2004), 12 ülke için 1991-2002 yılları arasında verimlilikteki farklılıkların enflasyon üzerine etkisini incelemiştir. İşgücü verimliliğini belirlerken sektörler arasındaki esnek çalışma farklılıklarını dikkate almak için birim işgücü maliyetini kullanmışlardır. Avrupa Bölgesi'nde verimliliğin enflasyon üzerindeki etkisi teoriyle tutarlı sonuçlar vermiş, ancak bulunan etki oldukça küçük olduğu için verimlilik artışlarının tam olarak göreceli fiyatlara yansımadağı sonucuna ulaşılmıştır.

Ticarete konu olan ve olmayan sektörler arasındaki enflasyon farklılıklarının bu sektörler arasında dengesiz verimlilik büyümesinden kaynaklandığını ifade eden B-S hipotezini 7 Avrupa ülkesi için sınanan Kastimi (2004), hipotezi test ederken sektörler arasındaki ücret farklılıklarının etkisini de dahil etmiştir. Sonuçlara göre, B-S etkisinin varlığına ilişkin kanıt sağlanamamıştır. Sektörler arasındaki verimlilik farklılıklarının Almanya, Fransa, İngiltere de enflasyon üzerinde pozitif etkiye sahip olduğu görülmüştür. İtalya, Belçika ve Danimarka’da ise B-S hipotezi sektörler arasında ücretlerin etkisi de dahil edildiğinde desteklenmektedir.

Lommatzch ve Tober’ın (2006)’da verimlilik göstergesi olarak birim işgücü maliyetini kullanmışlardır. Yazarlar, göreceli fiyatlar ve birim işgücü maliyeti arasındaki ilişkinin ücret mekanizması ve ticarete konu olan sektörlerde fiyat oluşumuna yönelik varsayımların daha az kısıtlayıcı bir mekanizmaya bağlı olduğunu savunmuşlardır. Çünkü ticarete konu olan sektörlerden ticarete konu olmayan sektörler ücret geçişleri tam olmayabilir. Eğer bir sektör diğerine göre daha esnek emek piyasasına sahip ise ortalama işgücü verimliliğini kullanmak göreceli fiyatlar ve göreceli verimlilik arasındaki ilişkiyi tahrif edebileceğinden, birim işgücü maliyeti bu etkiyi dengeleyeceği için daha uygun bir verimlilik göstergesi olarak kabul edilmiştir. Çalışma Avrupa bölgesinde 12 ülke için B-S etkisinin Avrupa Merkez Bankasının enflasyon hedeflemesinde önemli bir çıkmaza yol açmadığı sonucuna ulaşmıştır. Avrupa Bölgesinde verimliliğin enflasyon üzerindeki etkisi teoriyle tutarlı sonuçlar vermiş, ancak bulunan etki oldukça küçük (%0.6) olduğu için verimlilik artışlarının tam olarak göreceli fiyatlara yansımadağı sonucuna ulaşmıştır.

Masten (2007) çalışmasında, Avrupa Birliği’ne yeni katılan ülkeler için Yeni Keynesyen dinamik stokastik genel denge modelinde, optimal para politikası çerçevesinde B-S etkisini analiz etmiştir. Model önemli karakteristik özelliklere sahiptir. Birincisi, optimal enflasyon hedeflemesi araçları analiz edilmiştir. İkinci olarak, model yeni açık makroekonomide standart bir yaklaşım haline gelen ticarete konu olan sektörlerde piyasa gücünün analizine olanak sağlamamaktadır⁷. Son olarak ise bu çalışma sektörel şokları (B-S etkisi) dikkate almaktadır. Sonuçlara göre, B-S etkisinin yüksek enflasyona yol açtığı savı desteklenmemekte ve verimlilik büyümesindeki farklılıklar Maastict kriterlerini yerine getirilmesi için bir sorun teşkil etmemektedir.

Bayram (2007) ticarete konu olmayan göreceli fiyatlar ve dengeli verimlilik büyümesi arasındaki ilişkiyi 83 ülke için 1967-1998 yılları arası kısa ve uzun dönem olmak üzere iki bölümde incelemiştir. Çalışmada B-S etkisi analiz edilirken, uzun dönemli sermayenin uluslararası tam hareketli ve ücretlerin esnek olduğu varsayımı geçerli kabul edilirken, kısa dönemde ücretlerin rijit ve sermayenin tam hareketli olmadığı varsayılmıştır. Kravis-Lipsey (1983)’in çalışmasından esinlenerek kısa dönem için oluşturulan B-S modeli daha uygun ve anlamlı sonuçlar vermektedir. Ticarete konu olmayan fiyatlar üzerinde verimliliğin dengeli büyümesinin etkisi negatif olarak bulunmuştur. Modellerde talep faktörlerinin analize dahil edilmesi sonuçların

⁷ Böylece tek fiyat kanunu varsayımı geçerli değildir.

anlamlılığında büyük bir değişikliğe yol açmamıştır. Bu çalışmada sonuç olarak ticarete konu olmayan göreceli fiyatlardaki değişimlerin reel döviz kuru dalgalanmaları üzerinde itici bir güç olduğu sonucuna ulaşılmıştır.

B-S etkisini 11 merkez ve doğu Avrupa ülkesi için tahmin eden Mihaljek ve Klau (2008) veri dönemini 1990 yılının ortalarından 2008 yılının ilk çeyreği olarak belirlemiştir. B-S hipotezi desteklenmiş ve göreceli verimlilik farklılıkları Avrupa bölgesi ile karşılaştırıldığında enflasyon farklılıklarının %24'ünü, ticarete konu olan ve olmayan malların yurt içi göreceli fiyat farklılıklarının yaklaşık %84'ünü açıklamıştır. Çalışmada ayrıca 1990 yılının ikinci yarısı ile kıyaslandığında 2001 yılından sonra B-S etkisinin düşmekte olduğuna ilişkin kanıtlar sunulmuştur.

Dimutru ve Jianu (2009) ise farklı fiyat göstergelerini de dikkate alarak Romanya için B-S etkisini 1997-2006 dönemi için çeyrek yıllık verilerle test etmiştir. Bu çalışmanın sonucu aynı ülke, aynı dönem için B-S etkisini % 0.6, farklı fiyat göstergeleri kullanıldığında ise % 2.6 olarak tahmin etmiştir.

Juselius ve Ordenez (2009), İspanya için 1983:3-2007:3 dönemi için verimlilik gelişimi, reel ücret büyümesi, enflasyon ve işsizlik dinamiklerini ampirik olarak incelemiştir. Çalışmada İspanya'nın Avrupa ekonomik entegrasyonunun etkisini ve refah düzeyinde Avrupa'ya yakınsamasını göz önüne almıştır. B-S etkisi, mal piyasasında rekabeti ve sermaye liberelizasyonu bu dönemde ana itici güçlerdir.

5. Veri Seti ve Ekonometrik Yöntem

Çalışmada açıklanan teorik model çerçevesinde, Türkiye ve EU-27 bölgesi arasında B-S hipotezinin içsel aktarım mekanizması sınanmıştır. Tahmin edilen ekonometrik model aşağıdaki şekilde tanımlanmaktadır.

$$fiyat_t = \alpha + \beta verimlilik_t + \varepsilon_t \quad (21)$$

Modeldeki değişkenlerden *fiyat* Türkiye ve EU-27 arasında sektörel göreceli fiyat farklılığını ifade ederken, *verimlilik* ise Türkiye ve EU-27 arasında sektörel göreceli verimlilik farklılığını gösterir. Tüm veriler 2001:Q1-2014:Q1 dönemine ait veriler olup EU-27 için kullanılan veri setlerinden sektörel üretim, sektörel istihdam ve sektörel fiyat verileri Eurostat'tan alınmıştır. Türkiye Ekonomisi için sektörel üretim, sektörel istihdam ve sektörel fiyat verileri ise Eurostat ve Türkiye Cumhuriyet Merkez Bankası (TCMB) kaynaklıdır.

Verimlilik ölçütü olarak ortalama işgücü verimliliği kullanılmıştır. Çalışmada, imalat sanayi ticarete konu olan sektör olarak alınırken; inşaat, toptan ve perakende ticaret ve diğer sosyal, toplumsal ve kişisel hizmet faaliyetleri ticarete konu olmayan sektörler

olarak ele alınmaktadır. Ortalama işgücü verimliliği, sektörlerdeki üretim o sektörlerde çalışan kişi sayısına bölünüp sektörlerin ağırlıklı ortalaması alınarak hesaplanmıştır. Fiyat verisi olarak gayri safi yurtiçi hasıla deflatörü kullanılmıştır. Göreceli fiyat serileri sektörlerin ağırlıkları ortalaması alınarak hesaplanmıştır. Seriler üzerinde belirgin mevsimsellik görüldüğünden dönemselliğin sonuçları olumsuz yönde etkilememesi için mevsimsellikten arındırılmıştır. Değişkenlerin doğal logaritmaları alınmıştır.

Zaman serileri analizlerine uygun olarak ilk aşamada serilerin durağanlığını sınamak için *Ng-Perron* (2001) birim kök testi kullanılmaktadır. Değişkenler arasındaki uzun dönemli ilişki ise *ARDL* sınır testi yaklaşımı ile incelenmiştir.

Peseran, Shin ve Smith (2001) tarafından geliştirilen *ARDL* sınır testi yaklaşımı serilerin bütünlüşme derecelerini dikkate almadan değişkenler arasında eşbütünlüşme ilişkisinin varlığını araştırır. *ARDL* sınır testi yaklaşımına göre uzun dönemli ilişkileri analiz etmek için kullanılan model aşağıdaki gibidir:

$$\Delta Y_t = \beta_0 + \beta_1 Y_{t-1} + \beta_2 X_{t-1} + \sum_{i=1}^m \phi_{\Delta} Y_{t-i} + \sum_{i=0}^m \phi_i \Delta X_{t-i} + \varepsilon_t \quad (22)$$

Öncelikle, *ARDL* sınır testi yaklaşımının uygulanabilmesi için uygun gecikme uzunluğunun seçilmesi gerekmektedir. Gecikme uzunluğu Vektör Ardişık Bağlanım Modelinden (VAR) Akaike, Schwartz, Hannan-Quinn (*AIC*, *SC*, *HQ*) gibi bilgi kriterlerinden yararlanılarak belirlenir. Ancak seçilen gecikme uzunluğunda otokorelasyon problemi olmamalıdır. Eğer seçilen uygun gecikme sayısında otokorelasyon problemi ile karşı karşıya kalınıyorsa bir sonraki uygun gecikme sayısı alınır ve tekrar otokorelasyon problemi olup olmadığına bakılır. Eğer seçilen gecikme uzunluğuna göre otokorelasyon problemi yok ise bu gecikme katsayısı alınır, fakat otokorelasyon problemi devam ediyorsa tekrar aynı süreç tekrarlanır ve bu problem ortadan kalkana kadar devam edilir.

Modelde eşbütünlüşme ilişkisinin olup olmadığı araştırılırken belirlenen uygun gecikme sayısı bütün değişkenler için sabit olarak alınır. Eşbütünlüşme ilişkisinin varlığını test etmek için *F* testi kullanılır. Değişkenler arasında uzun dönemli ilişkiyi belirlemek için oluşturulan modelde her bir değişken için sabit gecikme sayısı alınarak *F* test istatistiği hesaplanır. Boş hipotez eşbütünlüşme ilişkisinin olmadığını, alternatif hipotez ise eşbütünlüşme ilişkisinin olduğunu belirtir. Bağımlı ve bağımsız değişkenlerin bir gecikmeli katsayılarının sifira eşit olup olmadığı kısıtı getirilerek hipotezler test edilir. Hesaplanan *F* test istatistiği standart dağılıma sahip olmadığından dolayı Peseran, Shin ve Smith (2001) hesapladığı kritik değerler ile karşılaştırılarak uzun dönemli ilişkinin olup olmadığına karar verilir. Eğer hesaplanan kritik değer, alt kritik değerden küçük ise seriler arasında eşbütünlüşme ilişkisinin olmadığına, alt ve üst kritik değer arasında ise kesin bir yorum yapılamayacağına, ancak hesaplanan *F* test istatistiği üst kritik değerden daha büyük ise seriler arasında uzun dönemli ilişkinin olduğu sonucuna ulaşılır.

Seriler arasında uzun dönemli ilişkinin olduğu tespit edilir ise uzun ve kısa dönem ilişkileri belirlemek için *ARDL* modeli tahmin edilir. *ARDL* modelinde uzun dönem

ilişkinin belirlenmesinde bütün değişkenler için sabit olarak tespit edilen uygun gecikme sayısı kullanılmaz. Uzun ve kısa dönem katsayılar hesaplanırken bilgi kriterlerine göre değişkenlerin farklı gecikmeler almasına izin verilerek değişkenler için uygun gecikmeler tespit edilir⁸. Gecikme uzunlukları belirlendikten sonra *ARDL* modeli tahmin edilir ve uzun dönem katsayılar hesaplanır. Uzun dönemli ilişki belirlendikten sonra uzun dönem katsayıları hesaplamada kullanılan *ARDL* modeli ise şu şekildedir:

$$Y_t = \beta_0 + \sum_{i=1}^m \varphi_i Y_{t-i} + \sum_{i=0}^n \phi_i X_{t-i} + \varepsilon_t \quad (23)$$

Değişkenler arasında kısa dönemli ilişki ise *ARDL* sınır testi yaklaşımına bağlı hata düzeltme modeli ile tahmin edilir. Bu model aşağıdaki gibi gösterilir:

$$\Delta Y_t = \beta_0 + \sum_{i=1}^m \varphi_i \Delta Y_{t-i} + \sum_{i=0}^n \beta_i \Delta X_{t-i} + \beta_3 ecm_{t-1} + \varepsilon_t \quad (24)$$

Modelde yer alan hata düzeltme terimi (*ecm*) uzun dönemli modelden elde edilen dengeyi temsil eder. Bağımlı ve bağımsız değişkenlere ilişkin her bir fark ve gecikmeleri ise kısa dönemli dinamikleri ifade etmektedir.

6. Analiz Sonuçları

Bu kısımda serilerin durağanlıkları test edilmiş, *ARDL* sınır testi yaklaşımı ile uzun dönemli ilişki araştırılmış, uzun ve kısa dönemli katsayılar tahmin edilmiştir.

6.1. Birim Kök Analiz Sonuçları

Analizlerde kullanılan serilerin durağan olup olmadıklarını saptamak için uygulanan *Ng-Perron (2001)* birim kök testlerinin sonuçları *Tablo 1*'de verilmektedir. Test sonucuna göre göreceli fiyatlar ve göreceli verimlilik farklılıkları serilerinin birim kök içerdiği sonucuna ulaşılmaktadır.

Tablo 1. Ng-Perron (2001) Birim Kök Testleri

		Sabit ve trend			
		<i>MZ_a</i>	<i>MZ_t</i>	<i>MSB</i>	<i>MP_t</i>
<i>fiyat</i>	3	-9.27	-2.12	0.22	9.94
<i>verimlilik</i>	1	-3.07	-1.21	0.39	29.10
Kritik	1%	-23.80	-3.42	0.14	4.03
Değerler ^a	5%	-17.30	-2.91	0.16	5.48
	10%	-14.20	-2.62	0.18	6.67

^a Kritik değerler Ng ve Perron (2001) Tablo 1'den alınmıştır

⁸ Uzun dönemli ilişkiyi belirlerken değişkenler sabit gecikme sayısı almaktadır.

6.2. ARDL Sınır Testi Sonuçları

ARDL sınır testinin uygulanması için ilk olarak gecikme uzunluğu VAR modeli çerçevesinde *AIC*, *SC* ve *HQ* kullanılarak *Tablo 2*'de verilmiştir. İncelenen veri seti çeyrek dönemlik olduğu için maksimum gecikme uzunluğu 8 olarak alınmıştır. Trend VAR modeline dışsal değişken olarak dahil edilmiştir. Uygun gecikme sayısı *AIC*'e göre 2, *SC* ve *HQ*'ne göre 1 olarak belirlenmiştir. Uzun dönemli ilişkinin varlığı araştırılırken gecikme sayısı *SC*'a göre 1 olarak seçilmiştir. *LM* testinde seçilen gecikme uzunluğunda otokorelasyon probleminde rastlanmamıştır.

Tablo 2: ARDL Testi İçin Gecikme Uzunluğunun Belirlenmesi

k	<i>AIC</i>	<i>SC</i>	<i>HQ</i>	<i>LM</i>
1	-8.15	-7.83	-8.03	0.54
2	-8.20	-7.72	-8.02	0.16
3	-8.10	-7.46	-7.86	0.99
4	-8.04	-7.24	-7.74	0.64
5	-7.91	-6.94	-7.55	0.96
6	-7.88	-6.75	-7.46	0.47
7	-7.74	-6.46	-7.26	0.54
8	-7.69	-6.24	-7.15	0.14

k: Gecikme sayısını, *LM* ise Breush-Godfrey *LM* otokorelasyon test istatistiğinin olasılık değerini gösterir.

Hesaplanan *F* istatistikleri *Tablo 3*'de belirtilmektedir. Hesaplanan *F* istatistiği üst kritik değerlerden daha büyük olduğu için değişkenler arasında uzun dönemli ilişkinin bulunmadığını ifade eden boş hipotez (%10 düzeyinde) reddedilmekte, bu değişkenler arasında uzun dönemli bir düzey ilişkisinin olduğunu işaret etmektedir.

Tablo 3: Uzun Dönemli İlişkinin Belirlenmesi İçin *F* İstatistiği

Hesaplanan <i>F</i> İstatistiği		6.891 [#]
	* %5	7.06-7.80
Kritik Değer	# %10	5.89-6.59

Bu sonuca göre kısa ve uzun dönemli katsayıları belirlemede *ARDL* modelleri değişkenlerin farklı gecikme uzunluklarına izin verilerek yeniden oluşturulmuştur.

Değişkenler arasındaki uzun dönemli katsayıların belirlenmesinde kullanılan *ARDL* modeli aşağıda belirtilmektedir.

$$fiyat_t = \beta_0 + \beta_1 trend + \sum_{i=1}^m \phi_i fiyat_{t-i} + \sum_{i=0}^n \varphi_i verimlilik_{t-i} + \varepsilon_t \quad (25)$$

Tablo 4: ARDL(1, 6) Modeli Tahmin Sonuçları {fiyat~verimlilik}

Değişken	Katsayı	Standart Hata	t - istatistiği	p - değeri
sabit terim	-0.014	0.010	-1.325	0.193
trend	0.002	0.001	2.683	0.011
fiyat (-1)	0.322	0.124	3.047	0.003
verimlilik	0.124	0.106	1.168	0.250
verimlilik (-1)	-0.309	0.121	-2.544	0.016
verimlilik (-2)	0.112	0.121	0.922	0.363
verimlilik (-3)	-0.029	0.116	-0.252	0.802
verimlilik (-4)	0.069	0.111	0.624	0.536
verimlilik (-5)	-0.009	0.104	-0.090	0.929
verimlilik (-6)	0.195	0.05	2.053	0.048

$R^2 = 0.68$ Düzeltilmiş $R^2 = 0.60$ LM: 2.20 (0.699) F(9, 35)= 8.33 (0.000)

Eşbütünleşme ilişkisindeki uzun dönem katsayılarının elde edilmesinde kullanılan, *ARDL* (1, 6) tahmin sonuçları *Tablo 4*'te verilmiştir. Tahmin sonuçlarına göre modelde otokorelasyon ve değişen varyans probleminin olmadığı tespit edilmiştir. Modelin tahmin sonuçları ve bu sonuçlara dayanılarak hesaplanan uzun dönem katsayıları *Tablo 5*'te verilmiştir.

Tablo 5: ARDL (1, 6) Modelinden Hesaplanan Uzun Dönem Katsayıları {fiyat~verimlilik}

Değişken	Katsayı	Standart Hata	t - istatistiği	p - değeri
sabit terim	-0.020	0.014	-1.423	0.164
trend	0.004	0.001	3.000	0.005
verimlilik	0.226	0.088	2.566	0.015

Tablo 5'te elde edilen sonuçlara göre, trend ve göreceli verimlilik farklılığının istatistiksel olarak anlamlı olduğu görülmektedir. TCMB'nin enflasyon raporunda

vurguladığı gibi 2001 sonrasında göreceli fiyat farklılaşmasında göreceli verimliliğin etkisi mevcuttur. Göreceli verimlilik farklılığındaki % 1'lik bir artış göreceli fiyat farkını % 22 arttırmaktadır.

Uzun dönem ilişkisinden elde edilen hata terimleri kullanılarak kısa dönemli ilişki *ARDL* yaklaşımına dayalı hata düzeltme modeli ile araştırılmaktadır ve aşağıdaki gibi tahmin edilmiştir.

$$\Delta fiyat_t = \beta_0 + \sum_{i=1}^m \phi_i \Delta fiyat_{t-i} + \sum_{i=0}^n \varphi_i \Delta verimlilik_{t-i} + \beta_3 ecm_{t-1} + \varepsilon_t \quad (26)$$

Tablo 6: ARDL (1, 6) Hata Düzeltme Modeli Sonuçları {fiyat~verimlilik}

Değişken	Katsayı	Standart Hata	t - istatistiği	p - değeri
sabit terim	-0.014	0.010	-1.325	0.193
trend	0.002	0.001	2.683	0.011
dverimlilik	0.124	0.106	1.168	0.250
dverimlilik (-1)	-0.338	0.106	-3.189	0.003
dverimlilik (-2)	-0.226	0.120	-1.870	0.070
dverimlilik (-3)	-0.255	0.118	-2.153	0.038
dverimlilik (-4)	-0.186	0.114	-1.625	0.113
dverimlilik (-5)	-0.195	0.095	-2.053	0.047
ecm	-0.677	0.156	-4.325	0.000

$R^2 = 0.40$ Düzeltilmiş $R^2 = 0.28$ $F(10, 58) = 3.86$ (0.000)

Kısa dönem ilişkiyi ele alan model uzun dönem modelde olduğu gibi seçilmiş ve *ARDL* (1, 6) formunda tahmin edilmiştir. Tahmin sonuçları *Tablo 6*'da verilmektedir. Sonuçlardan görüldüğü gibi, trend istatistiksel olarak anlamlı iken göreceli verimlilik farkının 1., 2., 3. ve 5. gecikmesinin istatistiksel olarak anlamlı ancak negatif işaretli olduğu görülmektedir. Hata düzeltme teriminin işareti beklendiği gibi negatif ve istatistiksel olarak anlamlıdır. Analiz döneminde dengeden sapmanın gelecek dönemde düzeltilmekte olduğunu, oluşacak bir dengesizliğin ilk dönemde yaklaşık olarak % 67'sinin yok olacağını, dengeye yaklaşacağını göstermektedir.

6. Sonuç

Bu çalışmada Türkiye ve EU-27 bölgesi arasında Balassa-Samuelson (B-S) (1964) hipotezinin içsel aktarım mekanizması 2001:Q1-2014:Q1 dönemini kapsayan veri seti ile *ARDL* sınır testi yaklaşımı kullanılarak sınanmıştır. Çalışmada analizde kullanılan serilerin durağanlıkları *Ng-Perron* (2001) birim kök testiyle sınanmış sonuçlar serilerin birim kök içerdiğini göstermiştir. Sonrasında, seriler arasında eşbütünlüşme ilişkisinin olup olmadığı *ARDL* sınır testi yaklaşımı ile araştırılmış, göreceli verimlilik farkı ve göreceli fiyat farkı arasında uzun dönemli ilişkinin olduğuna yönelik sonuca ulaşılmıştır. Uzun dönemli kanıtlara ulaşıldıktan sonra kısa ve uzun dönemli katsayıları belirlemede *ARDL* modeli oluşturulmuştur. Uzun dönemde göreceli verimlilik farklılığının istatistiksel olarak anlamlı olduğu görülmüştür. Kısa dönem ilişki ele alındığında hata düzeltme teriminin işareti beklendiği gibi negatif ve istatistiksel olarak anlamlıdır. Kullanılan veri seti, incelenen dönem ve uygulanan ekonometrik yöntemler göz önüne alındığında sonuçlar, TCMB Enflasyon Raporu II (2006)'da vurguladığı gibi 2001 sonrasında göreceli fiyat artışları göreceli işgücü verimliliğindeki artıştan kaynaklandığı vurgusunu destekleyen bulgular ortaya koymaktadır.

KAYNAKÇA

- Alberola, E. & Tyrväinen, T. (1998). Is There Scope for Inflation Differentials in EMU? An Empirical Evaluation of the Balassa-Samuelson Model in EMU Countries. *Bank of Spain Working Paper*, No. 9823.
- Asea, P. & Mendoza, E. (1994), The Balassa-Samuelson Model: A General Equilibrium Appraisal, *Review of International Economics*, 2 (3), 244-267.
- Balassa, B. (1964). Purchasing Power Parity Doctrin: A Reappraisal, *The Journal of Political Economy*, 72, 584-596.
- Bayram, T. (2007). Balassa Samuelson Model Revisited: Growth Productivity Effect & Capital Accumulation. *International Research Journal Financial Economics*, 9, 144-155.
- Bergstrand, J.H., (1991). Structural Determinants of Real Exchange Rates and National Price Levels: Some Empirical Evidence. *American Economic Review*, 81, 325–334.
- Bhagwati, J. N. (1984). Why are services cheaper in the poor Countries. *The Economic Journal*, 94, 279-286.
- Coudert, V. (2004). Measuring the Balassa-Samuelson Effect for the Countries of Central and Eastern?, *Banque DeFrance Bulettein*, 122.

- Çeliku E. & Hoxholli, R. (2007). An Estimation of Balassa Samuelson Effect in Albania, Bank of Albania.
- DeGregorio, J. , Giovannini, A. ve Wolf, H. (1994). International Evidence on Tradables and Nontradables Inflation, *European Economic Review*, 38, 1225-1224.
- Dimutru, I. & Jianu I. (2009). The Balassa Samuelson Effect in Romania: The Role of Regulated Prices, *European Journal of Operational Research*, 194, 873-887.
- Égert, B. (2003). Nominal and Real Convergence in Estonia The Balassa-Samuelson (dis)connection. *William Davidson Institute Working Papers*, 556.
- Égert, B. , Halpern, L. & MacDonald R. (2006). Equilibrium Exchange Rates in Transition Economies: Taking Stock of the Issues. *Journal of Economic Surveys*, 20(2), 257-324.
- Enflasyon Görünümü Raporu II, (2006). Türkiye Cumhuriyeti Merkez Bankası
- Funda, J, Lukinic, G. & Ljubaj, I. (2007). Assessment of the Balassa-Samuelson Effect in Croatia, *Financial Theory and Practice*, 31, 4, 321-351.
- Halpern, L, ve Wyplosz, C. (2001). Economic Transformation and Real Exchange Rates in the 2000s: The Balassa-Samuelson Connection. *Geneve: UN/ECE*.
- Isard, P. (1995). *Exchange Rate Economics*, England: Cambridge University Press.
- Harrod, R. F. (1933). *International Economics*, Nisbet & Cambridge University Press.
- Juselius, K. & Ordóñez, J. (2009). Balassa-Samuelson and Wage, Price and Unemployment Dynamics in the Spanish Transition to EMU Membership, *The Open Access, Open Assessment E Journal*, 3, 1-30.
- Kakkar, V. (2003). The Relative Price of Nontraded Goods and Sectoral Total Factor Productivity: An Empirical Investigation. *The Review of Economics and Statistics*, 85(2), 444-452.
- Kastimi, M. (2004). Inflation Divergence in the Euro Area: The Balassa Samuelson Effect. *Applied Economic Letters*, 11(5), 329-332.
- Kohler, M., 2000. The Balassa-Samuelson effect and monetary targets. In: Mahadeva, L., Sterne, G. (Eds.), *Monetary Frameworks in a Global Context*. Bank of England and Routledge, London, 354-390.
- Kravis, I., B. & Lipsey, R., E. (1982), Towards an Explanation of National Price Levels *NBER Working Paper*, 1034, 1-49.

- Lojschova, A. (2003). Estimating the Impact of the Balassa-Samuelson Effect in Transition Economies. *Vienna: Institute for Advanced Studies*.
- Lommatzch, K. & Tober, S. (2004), What is behind the Real Appreciation of the Accession Countries' Currencies? An Investigation of the PPI-based Real Exchange Rate, *Economic Systems*, 28, 383-403.
- Lommatzch, K. & Tober, S. (2006). Euro-Area Inflation: Does the Balassa-Samuelson Effect Matter?, *International Economics and Economic Policy*. 3(2), 105-136.
- Masten, I. (2007). Inflation targeting in presence of Balassa-Samuelson-type productivity shocks. *Available at SSRN 967650*.
- Mihaljek, D. & Klau, M. (2008), Catching-up and Inflation in Transition Economies: The Balassa-Samuelson Effect Revisited, *BIS Working Papers*, 270.1-23.
- Ng, S., & Perron, P. (2001). Lag length selection and the construction of unit root tests with good size and power. *Econometrica*, 1519-1554.
- Obstfeld, M. & Rogoff K. (1996). *Foundations of International Macroeconomics*, Cambridge, MA: The MIT Press.
- Pesaran, M. H. , Shin, Y. ve Smith, R. J. (2001). Bound Testing Approaches to the Analysis of Long-Run Relationships. *Journal of Applied Econometrics*, 16, 289-326.
- Rogoff, R. (1992). Traded Goods Consumption Smoothing and the Random Walk Behavior of the Real Exchange Rate. *NBER Working Papers Series*, 4119, 1-34.
- Samuelson, P. A. (1964). Theoretical Notes on Trade Problems, *Review of Economics and Statistics*, 46, 2, 145-54.
- Tica, J. & Druzic, I. (2006). The Harrod-Balassa-Samuelson Effect: A Survey of Empirical Evidence, *FEB Working Papers*, 0607, 1-37.

Avrupa Birliği İstihdam Politikaları¹

Employment Policies in European Union

H.Bilgehan YAVUZ²

ÖZET

Avrupa'da uzun yıllar boyunca yaşanan düşük işsizlik oranları, küresel piyasalardaki gelişmelerle birlikte 1990'lı yıllardan itibaren yüksek seviyelerde seyretmektedir. Yüksek işsizlik oranları ve bunun yarattığı sosyal huzursuzluklarla mücadele etmek üzere Avrupa Birliği İstihdam Stratejisi ortaya konulmuş ve bu kapsamda yeni istihdam politikaları (Aktif ve Pasif Politikalar) uygulanmaya başlamıştır. İşsizliğin azaltılması ve istihdamın artırılması için uygulanan politikalardaki temel gereksinim, işgücü piyasalarına esneklik kazandıracak politika karmasının etkileşim içerisinde, çalışmayı ve iş aramayı teşvik edecek şekilde uygulanmasıdır.

Anahtar Kelimeler: Avrupa Birliği, istihdam politikaları, Avrupa istihdam stratejisi, aktif işgücü piyasası politikaları, pasif işgücü piyasası politikaları

ABSTRACT

The low unemployment rates experienced in Europe for many years have sat on a high plateau with developments in global market. European unemployment strategy has been put forward to fight high unemployment rates and its provokes social unrest and this context new employment policies (Active and Passive policies) has began to be implemented. Basic requirements in implemented politics to increase the reducing unemployment and increas the employment is applied policy mix which will provide the labour market flexibility interact to encourage work and job search.

Keywords: European Union, employment policies, European employment strategy, active labour market policies, passive labour market policies

¹ Çukurova Üniversitesi Sosyal Bilimler Enstitüsü İktisat Anabilim Dalı Doktora tez çalışmasından üretilmiştir. Bütün hata ve eksiklikleri bana ait olmak üzere Doktora tez danışmanım Sn. Prof. Dr. M. Fatih CİN'e teşekkürü borç bilirim.

² Dr., bilgehanyavuz@hotmail.com

1. Giriş

19. Yüzyılın sonlarından itibaren pek çok ekonomide yaşanan bölüşüm sorunu bir takım toplumsal problemleri de beraberinde getirmiştir. Sanayi devrimi ile birlikte kentleşmenin artması ve üretim yöntemlerindeki gelişmeler, işsizlik sorununu geliştirmiş ve geliştirmekte olan pek çok ülkenin en önemli sosyal problemi haline getirmiştir. Bu sorunlarla baş edebilmek için, 1970-1980'ler boyunca pek çok Avrupa ülkesinde önemli yapısal değişiklikler sağlanmıştır. Bu yapısal değişiklikler, ekonomik aktivitede değişikliklere sebep olmuştur.

Avrupa'da, tarihsel olarak genelde düşük seviyelerde seyreden işsizlik seviyeleri, II. Dünya Savaşından sonra gerçekleşen yeniden yapılanma süreci, sermaye kıtlığı ve sürekli artan işgücü talebi koşullarında gerçekleşmiştir (Eichengreen & Iversen, 2013). Savaş sonrası dönemde düşük olarak seyreden işsizlik, 1970'lerde artmaya başlamış ve 1990'larda yüksek bir platforma oturmuştur. Bugün hala Avrupa'da işsizlik yüksek değerlerde ve ülkeler arasında heterojen bir yapıdadır (Blanchard, 2006).

Giriş bölümünün ardından çalışmanın ikinci bölümünde Avrupa Birliğinde istihdam ve işsizlik kavramlarının gelişimi kısaca açıklanarak, sonraki bölümde Avrupa Birliği işgücü piyasalarının özelliklerine değinilecektir. Çalışmanın dördüncü bölümünde Avrupa Birliği İstihdam Stratejisi tanımlanıp, beşinci bölümde Avrupa Birliğinde uygulanan istihdam politikaları anlatılacaktır.

2. Avrupa Birliğinde İstihdam ve İşsizlik

1970'li yıllara kadar işsizlik oranlarının düşük oranlarda gerçekleşmesinin en önemli sebebi olarak Avrupa'da uygulanan katı istihdamı koruma mevzuatıdır (Ljungqvist & Sargent, 2008). Ancak, 1970'lerden sonra yaşanan ekonomik şoklar ve siyasi gelişmelerin de etkisiyle işsizlik oranları artış trendine girmiştir (Martin, 2000). Avrupa'da 1960'larda ortalama % 1,7 olan işsizlik oranları, 1990'larda % 11'lere kadar yükselmiştir. Bununla beraber uygulanan sıkı para politikaları ile enflasyon kontrol altına alınmış ve faiz oranlarındaki düşmeyle birlikte yatırımlar artıp işsizlik azalma trendine girmiştir. Kısaca şoklardan sonra işsizlik artmış, genişleyici maliye politikaları ile bu artış kontrol altına alınmıştır (Avila & Usabiaga, 2009).

2000'li yıllara gelindiğinde, Avrupa'da işsizlik oranları, sabit enflasyon ile beraber seyretmiştir. Alışılmış olandan yüksek bir enflasyonun varlığı, Avrupa Merkez Bankasının enflasyonu hedefleyen politikalar uygulamasına ve işsizliği göz ardı etmesine sebep olmuştur. Blanchard (2006) çalışmasında; bu politikayı yanlış bularak yükselen işsizliğin doğal oranını düşürmek için öncelikle işgücü piyasası reformları yapılması gerektiğini vurgulamıştır (Blanchard, 2006).

Avrupa'da uygulanan olumsuz makro ekonomik politikalar ve işgücü piyasası katılıkları ile işgücü piyasası kurumları ve politikaları arasındaki etkileşimin, Avrupa'da yaşanan yüksek işsizliğin en önemli sebebi olduğu düşünülmektedir. Şokların bağımlılığını

arařtıran yazarlar, faktör verimliliđindeki büyümenin azalmasını, yüksek reel faiz oranlarının varlıđını, işgücü talebindeki olumsuz kaymaları, işsizlik sigortası gibi kurumsal katılıkları, güçlü istihdamı koruma yasalarının varlıđını ve yüksek emek vergilerini, şokların olumsuz etkilerinin ya da işsizliđin en önemli sebepleri olarak saymıřlardır (Fertig, 2003).

Blanchard ve Wolfers (2000) çalışmalarında Avrupa'da İşsizlik oranlarında yaşanan bu gelişmelerin üç farklı şekilde açıklayan çalışmaların olduđunu belirtmişlerdir. Bunlar (Blanchard & Wolfers, 2000);

- i. Olumsuz ekonomik şokların etkilerini açıklayan çalışmalar: Buna göre; Petrol şoku, faiz oranı şokları ve işgücü talebini etkileyecek diđer olumsuz şoklar işsizlik oranını arttıracaktır. Bu çalışmalar, yüksek işsizlik oranlarını açıklamakla beraber, ülkeler arasında yaşanan farklı işsizlik oranlarını açıklamakta yetersiz kalmaktadır.
- ii. İşgücü piyasası kurumlarının rolüne odaklanan çalışmalar: Bu çalışmalarda, işsizliđi doğrudan etkileyen kurumlara odaklanılmıştır. İşsizliđi olumsuz etkileyen kurumlar, çođunlukla işgücü piyasalarında katılıklara sebep olan kurumlar olarak gösterilmektedir. Ancak bu kurumların çođunun, işsizliđin düşük olduđu zamanlarda da mevcut olması bir çeliřki olarak görülmektedir. Böylece işgücü piyasası kurumlarının genel olarak işsizliđin evrimi konusunda yeterli bir açıklama sağlamayacađı, ancak ülkeler arasındaki işsizlik oranları farklılıklarını açıklamakta faydalı olacađını söyler.
- iii. Şoklar ile kurumlar arasındaki etkileşime odaklanan çalışmalar: Bu çalışmaların ortak noktası: Bazı kurumların, şokların işsizlik üzerindeki etkilerini deđiřtirebileceđini ileri sürmeleridir. Örneđin ücret pazarlıklarının koordine edilmesi, verimlilik büyümesini yavaşlatarak reel ücretlerin daha hızlı ayarlanmasını sağlar. Yine bazı kurumlar şoklara gösterilen tepkiyi azaltarak şoklar sebebiyle işten çıkarmaları engelleyebilir.

Bunların dışında Nickell ve Bell (1996), Avrupa'da işsizlik oranlarındaki bu artışları, teknolojik gelişmeyle beraber vasıfsız işçilerden vasıflı işçilere doğru bir talep kayması ile açıklamaktadır (Nickel & Bell, 1996). Yine Daveri, Tabellini, Bentolilo & Huizingo, (2000) çalışmalarında; Avrupa'daki refah devleti çalışmaları kapsamında yaşanan gelişmelerin, Avrupa'daki istihdamı etkilediđini ileri sürmektedirler. Avrupa'da, işgücü üzerinden alınan vergilerdeki çarpıklıklar sebebiyle emeklilik harcamalarının sürekli arttıđını, bunun da istihdamı olumsuz etkilediđini belirtmişlerdir (Daveri, Tabellini, Bentolilo & Huizingo, 2000).

3. Avrupa Birliđi İşgücü Piyasaları

Avrupa işgücü piyasalarının özelliklerine baktığımızda: İstihdamın korunması ve işsizlere belirli bir yaşam standardını sağlayacak gelirin verilmesi açılarından bazı kurumsal katılıklara sahip olduđu görülmektedir. Bu Kurumsal katılıklar Avrupa'da yaşanan yüksek işsizlik oranlarının da en önemli sebebi olarak gösterilmektedir.

Özellikle benzer özelliklere sahip olan ABD işgücü piyasaları ile yapılan karşılaştırmalarda, kurumsal yapıdaki bu katılık sebebiyle Avrupa'da işsizliđin daha yüksek olduđu söylenmektedir. Bunun yanı sıra, bir diđer kurumsal katılık sebebi olan yüksek miktardaki işsizlik yardımları, Avrupa'da işsizliđin uzun dönemler boyunca görülmesine sebep olduđu belirtilmektedir. İşgücü piyasaları bu açıdan incelendiğinde hangi kurumsal yapıların mutlak katılıklara yol açtıđının tespit edilmesi gerekmektedir (Nickell, 1997).

Siebert (1997) çalışmasında Avrupa işgücü piyasalarını etkileyen dört farklı unsurun varlıđından söz etmiştir. Bunlar:

1. Piyasa süreçlerinin Avrupa'ya özgü nitelikleri,
2. Etkili düzenleyici kurallar ve kurumlar,
3. Hukuk sistemi ve ücret oluşum süreçleri,
4. İşsizlik ödemesi sistemidir.

Siebert (1997)'ye göre bu kurumsal olgular, Avrupa'da ikili bir işgücü piyasası yapısının oluşmasına sebep olmuştur. İşgücünün büyük bir bölümü AB işgücü piyasalarında işlevsel değildir. Küresel ekonomilerde yaşanan yoğun rekabet ve teknik ilerlemeler işgücü tasarrufu gerektirerek ücret esnekliđine yol açmaktadır. Ancak, ülkelerin kurumsal yapısı bu esnekliđi önleyecek özellikler taşıyabilir. Kişi bir kez işsiz kalınca gerek aylıklık içgüdüğü, gerekse yaşayacağı yetenek kayıpları sebebiyle yeniden iş bulması zorlaşır. Bu unsurları dikkate alan firmalar da uzun süre işsiz kalan bireyleri yeniden istihdam etmek istemezler. İşsizlik, kişilere niteliklerini ve sosyal yetkinliklerini kaybettirir (Siebert, 1997).

Uzun dönemli ve kalıcı bir işsizlik, sosyal dışlanmanın da en önemli nedenlerinden biridir. Kapitalizmin ortaya çıktığı yer olan Batı Avrupa'da yaşanan uzun dönemli işsizlik ve yoksulluğun sebep olduđu sosyal dışlanma, sivil toplum yaşamı ile uyumlu değildir. Bu tür toplumlarda, sosyal bütünleşmenin sağlanması için tam istihdamın da sağlanması gerektiği düşünülmektedir. Çünkü işsizlik, hizmet alışverişini ve üretken bilgiyi dışlar. Pek çok çalışmada Avrupa'da yaşanan işsizliđin yapısal olduđu belirtilmiştir. Yapısal olan bu işsizlik problemini çözmek ve sosyal bütünleşmeyi sağlamak için; aktif işgücü piyasası politikalarının gerektirdiđi kurumsal düzenlemelerin yapılması, geçici işgücü piyasaları gibi fonksiyonel alt piyasaların oluşturulması gerektiği ileri sürülmüştür. Koordine olmamış bir işgücü piyasası veya ikincil işgücü piyasalarının aksine, geçici işgücü piyasaları, sosyal sistemdeki hareketliliđi teşvik ederek insanların sosyal dışlanmasını azaltacak ve yaşam boyu sosyal katılımı optimize edecektir (Gunter, 1998).

4. Avrupa Birliđi İstihdam Stratejisi

1989 yılında yayınlanan, İşçilerin Temel Sosyal Hakları Avrupa Komisyonu Şartı belgesindeki işçi deklasyonunda; Avrupa’da çalışan işçilerin, iş sađlıđı, iş güvenliđi, istihdamı koruma, çalışma saatlerinin düzenlenmesi, cinsiyet eşitliđi ve işçilerin katılımı gibi istihdama ilişkin pek çok konu düzenlenmiştir. Eylem planında sosyal şart olarak belirtilen hususların büyük çođunluđu da günümüze kadar yasalaşmıştır (Addison & Siebert, 1999).

Avrupa Birliđini kuran anlaşmaların hemen hepsinde çalışma çağında olan nüfusa istihdam sađlanması ve bu nüfusa sosyal koruma sađlanması için üye devletlere yükümlülükler getirilmiştir. Üye devletlerin her politikada olduđu gibi istihdam politikalarında da işbirliđi içerisinde çalışmaları beklenmektedir. Avrupa’da yaşanan işsizlik ve yapısal sorunlar karşısında üye devletler, 1990’ların başında gerçekleştirilen toplantı ve anlaşmalarla çözüm arayışına girişmiş ve 1994 yılında kabul edilen Essen Stratejisi ile İstihdam ve Emek Piyasası komitesi oluşturularak istihdam konusunda siyasi taahhütler ilan edilmiştir. 1999’da yürürlüđe giren Amsterdam Antlaşması ile de koordineli bir Avrupa Birliđi İstihdam Stratejisi için yasal çerçeve oluşturulmuştur (Taymaz & Özer, 2004).

Avrupa İstihdam Stratejisinin temel elementlerini oluşturan Amsterdam Anlaşması ile işsizlik, Avrupa’nın ortak bir sorunu olarak kabul edilmiş ve üyelerin politikalarını kontrol etmek ve yön vermek için etkili kurumlar oluşturulmasının yanı sıra; insan kaynađının geliştirilmesi için fonlar oluşturulmasına, işyerinde kalite ve verimliliđin geliştirilmesine, tam istihdamın sađlanmasına ve işgücü piyasasının kapsamının geliştirilmesine karar verilmiştir (Franzese & Hays, 2006).

Avrupa Birliđi, üye ülkelerin veya aday ülkelerin istihdamla ilgili ulaşılmaması gereken hedeflerini belirttiđi Avrupa İstihdam Stratejisinde; işsizlik stratejisi gibi pasif tedbirlerin yanında, nitelsiz işgücünün niteliklerinin artırılması, nitelikli işgücünün ise günün koşullarına uygun olarak güncellenmesi amacını güden aktif planların ön plana çıkarılması amaçlanmaktadır.

Avrupa İstihdam Stratejisini oluşturan dört önemli politika hedefi vardır (Kaya, 2014). Bu hedefleri Tablo 1 ile gösterecek olursak;

Tablo 1: Avrupa İstihdam Stratejisi Politika Hedefleri

No	Politika Hedefi	Politika Kapsamı
1	İstihdam Edilebilirlik	Eđitim ve danıřmanlık hizmetleri yoluyla iř arayanların yeteneklerinin arttırılması alıřmalarını kapsar.
2	Giriřimcilik	Kendi iřini kuracak kiřilerin desteklenmesi ve KOBİ'lerin önündeki engellerin kaldırılması konularında alıřma yapılmasını önerir.
3	Uygulanabilirlik	Sürekli deđiřip geliřen iř piyasası şartlarına, alıřanların ve řirketlerin kendilerini uydurması için gerekli önlemlerin alınmasını ister.
4	Eřit Fırsatlar	Özrürlüler, kadınlar gibi dezavantajlı grupların iřgücü piyasasına entegrasyonunun sađlanması için tedbirler öngörür.

Kaynak: Yazarın kendi sonuçlarıdır.

2002 yılında yapılan Barselona Zirvesinin ardından, 2003-2006 yıllarını kapsayacak şekilde Avrupa İstihdam Stratejisi yeniden yapılandırılmıştır. Yapılan alıřmalar sonucunda üç tamamlayıcı unsur tespit edilmiştir. (1) Tam istihdamın sađlanması yönelik aktif politikaların arttırılması, (2) alıřma yaşamında kalite ve verimliliđin arttırılması ve (3) sosyal birleřme ve bütünleřmenin sađlanmasıdır. Bu politika hedeflerine ulařabilmek için 2003 yılında güncellenen Avrupa İstihdam Stratejisinde ařađıdaki konular hedef olarak belirlenmiştir (Kesici & Selamođlu, 2005):

- i. İřsizler ve iřgücünün dıřında bulunanlar için, aktif ve koruyucu önlemlerin geliřtirilmesi amacıyla rehberlik, eđitim ve yeni mesleki fırsatların hükümetler tarafından geliřtirilmesi gerekmektedir.
- ii. İř yaratma ve giriřimciliđin önündeki engellerin kaldırılarak yeni iř kuran giriřimcilere finansal destek sađlanmalı, iřverenlik kültürü geliřtirilmeli, arařtırma ve yenilik alanlarında mali ve entellektüel fırsatlar sađlanmalıdır.
- iii. Sözleřmelere esneklik ve güvenilirlik kazandırılarak alıřma piyasalarında hareketlilik sađlanmalı ve adaptasyon yükseltilmelidir. Bu kapsamda kısmi alıřmalar, kendi adına alıřma gibi konularda teřvikler sađlanmalıdır.
- iv. Beřeri sermayenin geliřimi ve yaşam boyu öđrenmenin teřvik edilmesi için yeni fırsatlar sađlanmalı ve eđitim-öđretim alanında kaliteyi arttıracak reformlar yapılmalıdır.
- v. İř gücü arzını arttırmak ve aktif yařlanmayı teřvik etmek gerekmektedir. Bu amaçla yaşı ne olursa olsun eđitime giriř ve yaşam boyu öđrenme özendirilmelidir.
- vi. Cinsiyetler arası her türlü alıřma şartı eřitizliđi ortadan kaldırılmalıdır.
- vii. Dezavantajlı grupların iřgücü piyasasına entegrasyonu sađlanmalı ve her türlü ayrımcılıkla mücadele edilmelidir.

- viii. İş piyasasına girme, kalma ve ilerleme açısından insanların önünde bulunan her türlü caydırıcı etken ortadan kaldırılmalı, işin cazibesi, teşvikler vasıtasıyla artırılmalıdır.
- ix. Düzensiz ve kayıt dışı istihdam kayıt altına alınmalıdır.
- x. Ülke içindeki bölgesel istihdam farklılıkları azaltılmalıdır.

Avrupa İstihdam Stratejisi ile Avrupa ölçeğinde yenilikçi ve niteliksel bir istihdam stratejisi önerilmiştir. Bu kapsamda çalışma süreleri yeniden düzenlenmiş ve istihdam çeşitliliğinin artırılması için işgücü piyasalarının büyütülüp, istihdam yoğunluğunun artırılması gerektiği belirtilmiştir. Bu amaçla; ev işleri, eğitim, kültür hayatı ya da kazançlı mesleki faaliyetlere daha fazla zaman ayırmak için çalışma saatlerine esneklik kazandırılması planlanmıştır. Bunun dışında eğitim ve istihdam arasındaki geçişler için kurumsal düzenlemeler yapılarak işgücü piyasalarına geçişi ya da hareketliliği teşvik etmek gerekmektedir (Gunter, 1998).

Avrupa Konseyi, ulusal ekonomilerde işçilerin değişen şartlara uyum sağlaması, daha fazla insanın işgücü piyasası içinde yer alması ve insan sermayesine yatırım yapılması için 2004 yılında, yönergeler yayınlamıştır. Böylece, Avrupa İstihdam Stratejisinin amaçlarına ulaşmak için Avrupa Birliđi, ulusal istihdam politikalarının koordinasyonunda daha etkin rol oynamaya başlamıştır (Franzese & Hays, 2006).

5. Avrupa Birliđi İstihdam Politikaları

Avrupa Birliđinde, uzun dönemler boyunca yaşanan yüksek işsizlik seviyeleri sebebiyle toplumun sosyo-ekonomik yapısında, hükümetlerin politika tercihlerinde ve sendika ve buna benzer diğer çıkar gruplarının beklentilerinde, önemli değişiklikler yaşanmıştır. Uygulanacak ekonomik politikalarını belirleyen hükümetlerin siyasi duruşları (sosyalist-komünist-sosyal demokrat-solcu-muhafazakar-liberal vb. olup olmadığı), hem yüksek işsizliği hem de istihdamı etkileyen önemli farklılıklara sahiptir (Fialova & Schneider, 2008).

Hükümetler tarafından uygulanacak politikalar, ekonomik değişim ve dönüşümü sağlayacak politikaların ve kurumsal yapıların oluşturulması, olumsuz şokların etkilerinin hafifletilmesi için oldukça önemlidir (Eichengreen & Iversen, 2013). Avrupa'daki hükümetler ekonomik dönüşümü sağlamak ve istihdamı arttırmak için kamu harcamalarını özellikle pasif politikalardan aktif politikalara doğru kaydırma eğilimindedirler (Martin, 2000). Yüksek işsizliğe sebep olan işgücü piyasası katılıklarını ortadan kaldırmak için işgücü piyasası kurumlarına esneklik kazandırılması gerektiği belirtilmiştir. Avrupa işgücü piyasalarına esneklik kazandıracak politika önerileri şunlardır (Avila & Usabiaga, 2009):

- i. İşgücü maliyetlerini azaltacak tedbirlerin alınması,

- ii. İşsizlik ödeneđinin, çalışmamayı teşvik etmeyecek şekilde seviyesinin azaltılması,
- iii. İşgücü hareketliliđi kazandırılması için asgari ücret düzeyinin düşürülmesi,
- iv. Ücret pazarlıklarında sendikaların koordinasyon derecesinin artırılması,
- v. Piyasalara girişin serbestleştirilmesi.

İşgücü piyasalarına esneklik kazandıracak politikalar uygulanırken işsizliđin sosyal maliyetleri göz ardı edilmeden işçilerin insan onuruna yakışır bir hayat standardına sahip olmaları konuları göz ardı edilmemelidir. Fialova ve Schneider (2008) çalışmalarında işgücü piyasası politikalarının hem esnek hem güvenilir olması gerektiđini belirterek her iki unsuru da tanımlamak üzere; güvenceli esneklik tanımını yapmıştır (Fialova & Schneider, 2008). Güvenceli esneklik: İşgücü piyasalarının rekabetçi ve etkin bir yapıya kavuşmasının yanı sıra, işsizliđin sosyal boyutlarını da dikkate alan bir kavram olarak görülebilir.

İşgücü piyasalarında esneklik sağlamak her zaman mümkün olmamaktadır. Esnekliđi sağlamak için öncelikle hükümet çalışanlarının yani politikaları uygulama makamında olanların, politikaları içselleştirmesi gerekmektedir. Bu durum bir ajan problemine işaret etmektedir. Teoride oluşturulan esnek ve güvenceli bir politikanın, uygulayıcıları tarafından ataletle karşılanması, içselleştirilmemesi ve belirtildiđi şekilde uygulanmaması piyasalara ek katılıklar kazandırarak politikanın etkinliđinin kaybolmasına sebep olacaktır (Gilles, 2004).

Yukarıda da belirttiđimiz gibi ekonomik ve toplumsal yaşamın yönünün işgücü piyasaları kapsamında değerlendirildiđi bir ortamda, işsizlik oranlarının azaltılarak ekonomik büyümenin sağlanması için; ücret pazarlıklarının merkezi olarak yapılması ve üretimin sadece tüketiciler için yapıldıđı kapitalist iş ilişkilerinin geliştirilmesi konularında yapılacak düzenlemeler ve uygulanacak politikaların, işsizlik oranlarının azaltılmasında önemli etkisinin olacađı belirtilmektedir (Eichengreen & Iversen, 2013). Kompleks bir yapıya sahip olan ve bireysel etkileşime, insan davranışlarına bađımlı olan işgücü piyasalarında yapılacak düzenlemelerin ve uygulanacak politikaların zorlukları olacaktır. Çünkü yüksek işsizliđin tedavi edilmesi pek çok faktörün bir arada gözetilmesi gereken bir süreçtir. Bu sürecin optimal şekilde sürdürülmesi için çeşitli politika önerilerinde bulunmaktadır. Bu politika önerilerini aktif ve pasif işgücü piyasası politikaları olarak ikiye ayırabiliriz.

Aktif politikalar, işçilerin bireysel yeteneklerini geliştirecek ve işverenleri de işe almak için istekli olmasını sağlayacak politikaları içerirken pasif politikalar, işsizlik yardımı gibi karşılıksız bir ödeme içerir (Nickell, 1997).

6. Aktif İřgücü Piyasası Politikaları (ALMP)

Aktif İřgücü Piyasası Politikaları (Active Labour Market Policies, ALMP), Avrupa İstihdam Stratejisinin önemli bir kısmını oluřturur. ALMP programları; iř bulmayı kolaylařtıracak, verimliliđi ve dolayısıyla iřçilerin potansiyel kazançlarını arttıracak programlardır. Bunlar; Kamu istihdam harcamalarını, iřgücü piyasası eğitimlerini ve istihdamı teřvik edecek diđer politika bileřimlerini içerir. Avrupa istihdam stratejisi de bu kapsamda; her ulusal devletin, birbiriyle stratejik etkileřim içerisinde, gönüllü olarak bu politikaları uygulamasını teřvik eder (Franzese & Hays, 2006).

Avrupa'da uzun dönemler boyunca yařanan yüksek ve kalıcı iřsizlikle mücadele etmek için oluřturulan Aktif iřgücü piyasası politikalarından beklenen faydayı elde edebilmek için bu politikaların hangi kořullarda çalıřtığını bilmek önemlidir. Bu kapsamda Aktif İřgücü Piyasası politikalarının maksimizasyon kořullarını sayacak olursak:

- i. Özellikle iřsiz kalan bireylerin yeniden iř bulmasını teřvik edecek, aylıklık güdüsünden kurtaracak derinlemesine teřvikler sađlanması.
- ii. İř arayan ve iřverenlerin ihtiyaçlarına yönelik küçük ölçekli kamu eğitim programları uygulanması.
- iii. Okul ve okul öncesi eğitim çađındaki bireylere ulařarak, eğitimini yarım bırakma ihtimali olan dezavantajlı gençlerin okula devamının sađlanması ve beceri kazandıracak eğitimler verilmesi.
- iv. İřsizleri yeniden istihdama katacak řekilde, kısa süreli iřsizlik sübvansiyonlarının verilmesi.
- v. İřsizlere girişimcilik becerisi kazandıracak teřvikler sađlanması sayılabilir.

Aktif İřgücü Piyasası politikaları, kamu harcamalarından önemli paylar alır. Aktif politikaların üç temel iřlevi vardır. Bunlar: İře yerleřtirme, iřsizlik sigortası ödemeleri ve aktif programların katılımcıları (iřçi ve iřverenler) arasında etkileřim sađlamasıdır. Analitik ve politik amaçlar için yapılan bu harcamaların daha çok; iřsizlere ulařmak, iřgücünün becerilerini geliřtirmek, gelir transferi sađlamak ve istihdamı iyileřtirecek çalıřmalar yapmak amaçlarıyla kullanılması gerekmektedir. Martin (2000) çalıřmasında OECD bölgesi için yapılan ALMP harcamalarının beř farklı alanda toplandıđını belirtmiřtir. Bunlar:

- i. Kamu istihdam hizmetleri ve yönetimi: İře yerleřtirme, iřsizlik yardımı ödemeleri, iř arayanlara verilen rehberlik hizmetleri gibi faaliyetler için yapılan harcamalardır.
- ii. İřgücü piyasası eğitimleri: İřsizler için yapılan mesleki ve iyileřtirici eğitim harcamaları ile çalıřan yetişkinlere yönelik yapılan eğitimler.
- iii. Gençler İçin Yapılan Harcamalar: Genç iřsizlere yönelik eğitim ve istihdam programları ile okuldan ayrılanlara yönelik çıraklık eğitimleri.
- iv. Sübvansiyonlu istihdam harcamaları: İřsizleri teřvik etmek için iřverenlere ödenen sübvansiyonlar, kendi iřini kurmak isteyen iřsizlere yönelik yardımlar, kamu ve kar amacı gütmeyen sektörlere doğrudan iř yaratma için yapılan harcamalar.

- v. Engelli istihdamına yönelik harcamalar: Engellilerin mesleki rehabilitasyonu, engellilerin istihdamı ve engelli iş programları için yapılan harcamalar.

Aktif İşgücü Piyasası Politikalarının nihai amacı işsizliđi azaltmaktır. Uygulanan bu politikaların etkinliđi, makroekonomik büyüklüklere bakılarak ölçülebilir. Bununla ilgili yapılan pek çok çalışmadan elde edilen ve aktif politikaların etkilerini ölçen en net sonuçlar; işsiz sayısındaki deđişmeyi temel alanlar ile yaratılan iş miktarı deđişikliklerini inceleyen çalışmalardır (Martin, 2000).

Aktif İşgücü Piyasası Politikası önlemleri konusundaki en büyük harcama payını, kamu eğitim harcamaları almaktadır. Ancak Martin (2000) bu eğitim harcamalarından yetişkinler için yapılanların olumlu sonuçlar verdiđini, gençler için yapılanların pek olumlu sonuçlar vermediđini ileri sürmüştür (Martin, 2000). Lehman ve Muravyev (2012) çalışmasında, Aktif İşgücü Piyasası Politikası harcamalarının istihdamı etkilemediđini fakat genç işsizlik oranı üzerinde önemli etkisinin olduđunu belirtmiştir. ALMP harcamalarındaki bir puanlık artışın, genç işsizlik oranını bir puandan daha fazla azaltacađını ve ALMP harcamalarındaki artışın, genel ve uzun dönemli işsizlik oranlarını azaltacađını belirtmiştir.

Yapılan uygulamalı çalışmalarda, ALMP'nin diđer kurumsal deđişkenlerle etkileşimi incelendiđinde genellikle negatif ve anlamlı bir katsayı bulunmuştur. Bunun anlamı: ALMP harcamaları arttıkça, işsizliđin azalacađıdır. Ancak ALMP'nin, bir işgücü piyasası kurumu olarak sayılan vergilerle etkileşiminde, pozitif ve anlamlı bir katsayı bulunmaktadır. Bu katsayının varlıđı, vergilerin uzun dönem işsizliđi etkilediđi sonucuna götürür. ALMP'nin sendikalaşma ve istihdamı koruma mevzuatı ile etkileşimine baktığımızda, pozitif ve anlamlı bir katsayı bulunur. Genel olarak sonuçlara bakıldığında; bir ekonomide işsizlik ile etkili mücadele etmek için aktif işgücü piyasası politikaları (düşük vergiler, düşük sendikalaşma, düşük istihdamı koruma) uygulanması gerektiđi sonucuna ulaşılır (Lehman & Muravyev, 2012).

ALMP harcamalarının önemli dışsallıkları vardır. Örneđin; özellikle sınırların açık olduđu, yani işgücü mobilitesinin tam olduđu Avrupa Ülkelerinin birinde hükümetin mesleki eğitim alanında yapacađı harcamalar sonucunda yetiştirilen bireyler, kendi ülkelerinde iş bulamadıkları takdirde en yakın komşu ülkelere gideceklerdir. Bu durumda komşu ülke, hiçbir harcama yapmadan vasıflı işgücüne sahip olacaktır. Bu dışsallıkların bir sonucu olarak; bir ülkede ki ALMP harcamalarındaki artış, komşu ülkelerdeki ALMP harcamalarını azaltır. Bu tür bir dışsallığın varlıđı, bize genelde ALMP harcamalarının az olmasının nedenini açıklar.

ALMP harcamalarında azalan getiri söz konusudur. Şöyle ki: Eđer işgücü piyasalarındaki eğitim programları, işçi verimliliđini arttırarak istihdamı arttırıyorsa, bazı işçilerin marjinal verimliliđi belli bir eşiđin altında kalınca işsiz kalmaya devam edeceklerdir. Böylece bir miktar harcama birinci grup için işsizliđi azaltırken harcama miktarının belli bir eşiđin üstüne çıkması ikinci gruptaki işsizleri olumsuz etkileyecektir. Yine belli bir bölgede yaşanan bu olayların dışsallıkları diđer bölge ya da ülkeleri de etkileyecektir (Franzese & Hays, 2006).

Seçilmiş bazı Avrupa Birliđi ülkelerinde 2003-2013 dönemi için ALMP harcamalarının oranına baktığımızda sürekli bir artış trendinde olduđu ve özellikle 2008 yılında yaşanan ekonomik krizden etkilenmediđi görülür. Bunun sebebi olarak kriz dönemlerinde yaşanan sosyal huzursuzlukları azaltmak üzere hükümetlerin ALMP harcamalarını arttırdığı söylenebilir. Ancak buna rağmen Yunanistan, Polonya ve İngiltere’de 2012-2013 yıllarında, Yunanistan’da 2011-2012-2013 yıllarında Aktif İşgücü Piyasası Politikalarının uygulanmadığını söyleyebiliriz.

Tablo 2: Seçilmiş Avrupa Ülkeleri İçin Aktif İşgücü Piyasası Politikalarından Faydalanan İşçilerin Toplam İşgücüne Oranı (%)

	2003	2004	2005	2006	2007	2008	2009	2010	2011	2012	2013
Avusturya	1,72	1,72	1,89	2,18	2,29	2,44	2,64	2,74	2,38	2,46	2,47
Belçika	1,70	1,95	1,56	1,79	1,89	2,29	2,63	2,56	2,47	2,53	2,59
Çek Cumhuriyeti	0,14	0,15	0,12	0,14	0,14	0,09	0,10	0,10	0,09	0,08	0,07
Danimarka	1,87	1,77	1,68	1,51	1,85	2,08	2,20	2,71	2,34	1,94	2,21
Estonya	0,12	0,10	0,15	0,17	0,16	0,15	0,38	0,21	0,39	0,65	0,66
Finlandiya	1,81	1,90	1,85	1,73	1,72	1,58	1,73	2,11	2,34	2,39	2,70
Fransa	1,94	1,96	2,00	1,98	2,04	2,10	2,06	2,05	1,91	1,92	1,86
Almanya	2,30	2,04	1,74	2,14	2,20	1,99	2,37	2,44	2,45	2,38	2,58
Yunanistan	0,78	0,66	0,55	0,45	0,30	0,29	0,03	0,03	---	---	---
Macaristan	0,62	0,50	0,34	0,33	0,32	0,39	0,32	0,44	0,26	0,35	0,31
İrlanda	1,36	1,50	1,40	1,30	1,40	1,51	2,50	2,61	2,08	2,63	2,81
İtalya	4,83	4,51	3,86	3,70	4,21	3,39	3,81	2,58	2,38	1,93	1,49
Hollanda	1,93	1,66	1,63	1,54	1,33	1,57	1,95	2,11	1,96	1,78	1,79
Norveç	1,74	1,76	1,64	1,41	1,26	1,14	0,97	1,00	0,91	0,80	0,74
Polonya	0,72	0,70	0,69	0,64	0,60	0,63	0,11	0,10	0,04	---	---
Portekiz	0,79	0,71	0,92	0,86	0,81	0,89	1,46	1,48	1,37	1,34	1,64
Slovakya	0,23	0,18	0,17	0,09	0,02	0,04	0,04	0,05	0,00	0,01	0,01
Slovenya	1,10	0,78	0,36	1,17	0,44	0,33	3,22	0,92	0,58	0,32	0,28
İspanya	1,15	0,99	1,41	1,74	1,59	1,31	1,60	1,87	1,33	1,55	1,56
İsveç	0,59	0,56	0,54	0,58	0,29	0,20	0,20	0,31	0,37	0,47	0,52
İsviçre	0,84	0,94	0,91	0,77	0,64	0,55	0,66	0,75	0,62	0,62	0,67
İngiltere	0,19	0,17	0,15	0,13	0,07	0,08	0,07	0,03	0,01	---	---
Türkiye	0,10	0,09	0,09	0,08	0,15	0,10	0,06	0,13	0,17	0,16	0,15

Kaynak: OECDSTAT, Erişim Tarihi: 24.10.2014

7. Pasif İřgücü Piyasası Politikaları

Aktif İřgücü Piyasası politikalarının aksine Pasif İřgücü Piyasası Politikalarının alıřanların yeteneklerinin arttırılması veya iřsizlere yeni iř imkanları ve yeni becerilerin kazandırılması gibi amaları yoktur. Pasif İřgücü Piyasası Politikalarının amacı: İřsiz kalan bireylerin bazı temel ihtiyalarının karřılanarak yařamlarının devam ettirilmesinin sađlanmasıdır. Genel olarak kamunun transfer harcamalarını ieren Pasif İřgücü Piyasası harcamalarını iki kategoride inceleyebiliriz. Bunlar: İřsizlik yardımları ile emeklilik demeleridir. Pasif İřgücü Piyasası Politikaları, iřsizliđi tedavi etmek veya istihdam sađlamak aılarından ok fazla etkin deđildir. Bu nedenle alıřmada ayrıntılı olarak incelenmemiř ancak kısaca tanımlanmıřtır.

Pasif İřgücü Piyasası politikaları; iř arama motivasyonunu azaltarak, iřsizliđin ekonomik maliyetlerini dūřürmek suretiyle iřsizliđin artmasına neden olmaktadır. Pasif politikaların, iřsizliđin sosyal kayıplarını gz ardı ederek ulařabildiđi bir tek olumlu sonu vardır. Bu sonuca gre, iřgücü arzını azaltacađı iin, aktif iřgücü piyasası politikalarına yapılan harcamalardan daha yksek fayda sađlanarak iřgücü piyasalarının performansını arttırması beklenmektedir (Fialova & Schneider, 2008).

8. Sonu

Yapılan literatr taramasında endstrilemiř lkelerin tamamında olduđu gibi Avrupa'da da iřsizlik oranlarının artıřı ekonomilerin en acil sorunu olarak karřımıza çıkmaktadır.

İřsizlik sorununun özümünde en nemli adımın iřgücü piyasalarına esneklik kazandırmak olarak grldđi ifade edilebilir. Esneklik iin kurumsal katılıklar giderilerek aktif ve pasif iřgücü piyasası politikalarının eřitliki ve verimli bir şekilde uygulanması gerekmektedir. Bunu sađlamak ise aralarındaki etkileřime bađlıdır. İřsizlik sigortası sistemi cmert olan ve kt ynetilen piyasalarda verimliliđi arttırmak ve yapısal iřsizliđi azaltmak aısından aktif politikaları alıřtırmak zordur. Eđer aktif nlemler byk apta ve emekliliđe ynelik olursa bunlar pasif hale gelecektir. Bu sebeple etkileřimi kurmak nemlidir.

Aktif ve pasif iřgücü piyasası politikalarının etkinliđini arttırmak iin, politikalardan faydalanacak kiři veya kesimlerin dođru tespit edilmesi, piyasa sinyallerinin dođru yorumlanarak iř aramayı ve alıřmayı teřvik edecek politika uygulamalarına ađırlık verilmesi nemlidir.

KAYNAKA

Addison, J.T. & Siebert, S. (1999). Recent development in social policy in the New European Union, *Industrial and Labour Relation Review*, 48(1), 5-27.

- Avila, D.R. & Usabiaga, C. (2009). The unemployment paradigms revisited: A comparative analysis of U.S. State and European unemployment. *Contemporary Economic Policy*, 27(3), 321-334.
- Blanchard, O. (2006). European Unemployment: The Evaluation of facts and ideas. *Economic Policy*, 5-59
- Blanchard, O. & Wolfers, J. (2000). The role of shocks and institution in the rise of European unemployment. The aggregate evidence. *The Economic Journal, Conference Papers*, 110(462), C1-C33.
- Daveri, F., Tabellini, I G., Bentolilo, S. & Huizingo, L. (2000). Unemployment, Growth and taxation in industrial countries. *Economic Policy*, 15(30), 47-104.
- Eichengreen, B. & Iversen, T. (2013). Institutions and economic performance: Evidence from tha labour market. *Oxford Review Of Economic Policy*, 15(4)
- Fertig, M. (2003). The impact of economic integation on employment. An assesment in the context of EU enlargement. *IZA Discussion Paper*, 919.
- Fialova, K. & Schneider, O. (2008). Labour market institution and their effect on labour market performance in the new EU members countries. *CESIFO Working Paper*, 2421
- Franzese, R.J. & Hays, J.C. (2006). Strategic interaction among EU goverments in Active labour market policy making. *European Union Politics*, 7(2), 167-189.
- Gilles, S.P. (2004). Why are European countries divering in their unemployment experience? *The Journal Of Economic Perspective*, 18(4), 49-68.
- Gunter, S. (1998). Transitional labour market: A new European employment strategy. *Leibniz Information Centre For Economics*, Fs I 98206.
- Kaya, F. AB uyum sürecinde Avrupa İstihdam Stratejisi ve Türkiye. *Butçe dünyası*, Erişim:16.06.2014
- Kesici, M.R. Ve Selamođlu A. (2005). Genel Hatlarıyla Avrupa İstihdam Stratejisi ve geçirdiđi dönüőüm. *İő , Güç Endüstri İliőkileri ve İnsan Kaynakları Dergisi*, 7(2), ISSN:1303-2860
- Lehman, H. & Muravyev A. (2012). Labour market institution and labour market Performance. *Economics of Transition*, 20(2), 235-269.
- Ljungqvist, L. & Sargent, T.J. (2008). Two question about European Unemployment. *Econometrica*, 76(1), 1-29.

- Martin, J.P. (2000). What Works among active labour market policies: Evidence from OECD countries experience. *OECD Economic Studies*
- Nickel, S. & Bell, B. (1996). Changes in the distribution of wage and unemployment in OECD countries. *The American Review*, 86(2).
- Nickell, S. (1997). Unemployment and labour market rigidities: Europe versus North America. *The Journal Of Economic Perspective*, 11(3), 55-74.
- Siebert, H. (1997). Labour market rigidities: AT the root of unemployment in Europe. *Journal Of Economic Perspective*, 11(3), 37-54.
- Taymaz, E. ve Özer Ş. (2004). Labour Market policies and EU accession: Problems and prospect for Turkey. *ERC Working Paper in Economic*, 04/05.

Ticaret Performansı Ölçümlerine Çok Boyutlu Bir Yaklaşım: Seçilmiş Ülke ve Sektörlere İlişkin Karşılaştırmalı Analizler

A Multidimensional Approach to the Measurements of Trade Performance: Comparative Analyses on Selected Countries and Sectors

Mehmet DEMİRAL¹

Harun BAL²

ÖZET

Bu çalışma, geleneksel ve yeni yaklaşımda hesaplanan hacim ve değişim göstergelerini kullanarak, altı yükselen sanayi ekonomisi (Brezilya, Hindistan, Çin, Güney Afrika, Meksika, Türkiye) ve Rusya'nın ticaret performansları karşılaştırmalı olarak incelemektedir. Bu kapsamda, gelişmekte olan ülkelerin küresel ticarete en fazla paya sahip olduğu altı sektörde toplulaştırılan sanayiler için ihracat, ithalat, ticaret dengesi, açıklanmış karşılaştırmalı üstünlükler ile ürün ve piyasa farklılaştırması göstergeleri 2014 yılı için sunulmaktadır. Sonrasında, sırasıyla rekabetçilik, coğrafi ve ürün uzmanlaşma yapıları ile uyum göstergeleri, 2010-2014 dönemi için yüzde değişimleri dikkate alarak karşılaştırılmaktadır. Son olarak, seçilen ülkelerin toplulaştırılmış mal ticareti korelasyon endekslerini kullanarak ticari rekabetçilik ve ortaklık potansiyelleri tartışılmaktadır. Veriler, ülkelerin performanslarının farklı sektörlerde ve aynı sektörde farklı göstergeler bakımından değiştiğini göstermektedir. Türkiye düşük teknolojlili ve emek yoğun tekstil sektöründe en iyi performans göstergelerine sahip olmakla birlikte, orta teknolojlili ve sermaye yoğun ulaşım araçları sektöründe de gelişme göstermektedir. Türkiye, tekstil sektöründe en çok Çin ve Hindistan; ulaşım araçlarında ise Meksika ve Güney Afrika ile rekabet etmek durumundadır. Rusya ile Türkiye arasındaki düşük ticari korelasyon, farklı sektörlerde uzmanlaşmış bu iki ülkeyi potansiyel ticaret ortağı yapmaktadır.

Anahtar Kelimeler: Ticaret performansı, yükselen sanayi ekonomileri (YSE), sektörel analiz, Türkiye.

ABSTRACT

This study comparatively analyzes trade performances of six emerging industrial economies (Brazil, India, China, South Africa, Mexico, and Turkey) and Russia using volume and change indicators measured with the conventional and new approaches.

Within this context, the indicators of export, import, trade balance and revealed comparative advantages together with the product and market diversification for aggregated six sectors that developing countries mostly have highest shares in the world trade are presented for the year 2014. Afterwards, for the competitiveness, geographic and product specialization, and adaptation indicators are compared respectively, for 2010 - 2014 period considering percentage changes. Finally, the study discusses trade competitiveness and partnership potentials using the countries' trade correlation indexes. The data sets show that performances of selected countries vary over sectors and different indicators in the same sector. Although having better performance indicators in textiles, as low-tech and labor-intensive sectors, Turkey has been progressing in transport equipment sector that is relatively medium-tech and capital intensive. Turkey is seen subject to compete mostly with China and India in the textiles, and Mexico and South Africa in the transport equipment sector. The low correlations of the bilateral trade between Russia and Turkey reveal that these countries are potential trade partners since they have specialized in unrelated sectors.

Keywords: Trade performance, emerging industrial economies (EIE), sectoral analysis, Turkey.

¹ Yar.Doç.Dr., Niğde Üniversitesi, İ.İ.B.F., İktisat Bölümü, mdemiral@nigde.edu.tr

² Prof.Dr., Çukurova Üniversitesi, İ.İ.B.F., İktisat Bölümü, harunbal@cu.edu.tr

1. Giriş

Özellikle 1980 sonrası dönemde hız kazanan teknolojik gelişmelere bağlı olarak uluslararası taşıma, ulaştırma ve iletişim maliyetlerinin düşmesi ile ticaret önündeki tarife ve tarife dışı engellerin azalması süreci birlikte gelişmiştir. Bu gelişmelere paralel olarak, dışa açılarak ihracata dayalı sanayileşme politikalarına yönelen birçok gelişmekte olan ülke (GOÜ)'nin küresel ticarete katkıları artmaktadır. Bu GOÜ'lerden bazıları, 1990'lı yıllarla birlikte dış ticaret ve ihracat performansları bakımından hızlı sanayileşme süreçleriyle dikkat çekmektedir. Bu ülkeleri UNIDO (2013: 17) 'yükselen sanayi ekonomileri' (YSE'ler) olarak adlandırmaktadır.

Çalışmada UNIDO (2013: 17)'nin güncel sınıflandırmasına göre altı YSE (Brezilya, Hindistan, Çin, Güney Afrika, Meksika ve Türkiye) ile aynı sınıflandırmada 'sanayileşmiş ülkeler' grubunda yer almakla birlikte, petrol ve doğal gaz gibi enerji kaynakları temelinde gelişen ihracat yapısıyla dikkat çeken Rusya incelenmektedir. Küresel ticarete önemli bir paya sahip olan bu yedi ülke (BRICSMT)'nin farklı karakteristiklere sahip olması, yapılan karşılaştırmaların daha net ortaya konulmasını sağlamaktadır. Bu ülkelerin (özellikle BRIC), farklı konular üzerine yapılan daha önceki çalışmalarda da sıklıkla incelendiği görülmektedir (örn. IBRC, 2013; Cooper, 2006). Ancak daha önceki çalışmalarda yoğun olarak tek tek ülkeler için geleneksel yöntemlerin kullanıldığı ve karşılıklı rekabet yapılarının ihmal edildiği görülmektedir. Ayrıca yaygın olarak toplulaştırılmış ticaret verileri üzerinden yapılan bu çalışmalarda, toplulaştırma yanlılığı ortaya çıkabilmekte ve sektörel dinamikler kaybolabilmektedir. Literatürdeki bu boşluktan yola çıkarak hazırlanan bu çalışmada hem geleneksel hem de yeni performans ve rekabetçilik göstergeleri bakımından sektörel ve verilerin elde edilebilirliğine bağlı olarak, güncel bir karşılaştırma yapılmaktadır.

Bu kapsamda çalışmada ilk olarak göstergelerin hesaplama yöntemi tanıtıldıktan sonra YSE'ler için önemli olan i) tekstil, ii) kimyasallar, iii) elektriksiz makineler, iv) bilişim/elektronik tüketim malları v) ulaşım araçları ve vi) madencilik/mineraller sektörlerine ilişkin 2014 yılı için ihracat ve ithalattaki payı ile ticaret dengesi ve Açıklanmış Karşılaştırmalı Üstünlükler (AKÜ) endeksi gibi geleneksel ticaret ve ihracat performans göstergeleri sunulmaktadır. Ardından yine 2014 yılı için ITC (2015)'nin ihracatta performans ve rekabetçilikte yeni bakış açısına bağlı olarak hesapladığı piyasa ve ürün farklılaştırması endeksleri sunulmaktadır. Bu yeni anlayışta 2010 yılından 2014 yılına yüzde değişim göstergeleri ile hesaplanan rekabetçilik etkisi, ilk coğrafi ve ürün uzmanlaşması ile uyum etkisi endeksleri sunulmaktadır. Son olarak ülkelerin karşılıklı rekabet yapıları ticari uzmanlaşma ve korelasyon endeksleri yardımıyla ortaya konulmaktadır. Çalışma ulaşılan özet bulguların ve Türkiye ekonomisine ilişkin önerilerin sunulduğu sonuç bölümüyle tamamlanmaktadır.

2. Teorik Çerçeve: Ticaret Performans Göstergeleri

Geleneksel ticaret teorileri ülkeleri belirli sektörlerde uzmanlaşmaya yöneltmesine rağmen, ampirik bulgular ülkelerin gelir düzeyleri arttıkça sektörel yoğunlaşmanın

azaldığını ve mal farklılaştırmasının arttığını ortaya koymaktadır. Buna göre, ürün farklılaşması ve kalite gelişimi ekonomik büyümenin belirleyicileri arasında gösterilmektedir. Ürün farklılaştırması ile ekonomik gelişme arasındaki yüksek korelasyon, gelişmiş ülkelerin geniş aralıkta bir mal dizisi üretmesine karşın, GOÜ'lerin az sayıda ve belirli mallarda yoğunlaşması biçiminde kendini göstermektedir (Rodrik, 2007: 9-15).

Bunun yanında ülkelerin ne ihraç ettiği, yani ihracatın sektörel dağılımı da önemli olmaktadır. Hausmann ve Klinger (2006)'in bulgularına göre birbirleriyle ilişkisiz az sayıda malda uzmanlaşmış ülkelerde, bu sektörlerden diğer sektörlere bir katkı olmayacak ya da çok az olacaktır. Ayrıca bu sektörlerin gereklilikleri farklı olacağından birine yönelik politikalar diğerini olumlu etkilemediği gibi olumsuz da etkileyebilecektir. Sonuç olarak mevcut yazındaki çalışmalarda ülkelerin gelir seviyeleri arttıkça sektörel yoğunlaşmaların azaldığı ve üretimin farklılaştığı görülmektedir (Rodrik, 2007: 9).

1990'lı yıllarla birlikte GOÜ'lerin küresel ticaret ve ihracat payındaki artış hız kazanmış ve küresel ticaretin seyrinde rekabet ve işbirliği bakımından yapısal değişimler yaşanmıştır (IMF, 2011). Bu kapsamda dikkat çeken bir gelişme Çin'in ihracatındaki yüksek artışlardır. Çin'in bu yayılmacı etkisinin diğer yükselen sanayi ekonomilerine (YSE) etkilerini inceleyen çalışmalarda (örn. Lall ve Albaladejo, 2004; Venables ve Yueh, 2006; Eichengreen vd. 2007; Wood ve Mayer, 2010) Çin'in etkilerinin net olmadığı; sektörlere, ülkelere ve zamana göre farklılaştığı; diğer ülkelerin üretim, istihdam ve ihracat içeriğinin belirleyici olduğuna dikkat çekilmektedir. Sonuç olarak Çin faktörünün diğer ülkelere olan etkilerinin rekabet ve tamamlayıcılık kapsamında iki farklı yönde geliştiği görülmektedir.

Bazı çalışmalarda ülkelerin firmalar gibi küresel bir rekabet yapısında yer almadığı; uluslararası rekabetin nasıl ölçüleceği, açıklanacağı ve yorumlanacağı konusunda bir fikir birliği olmadığı ve iktisadi mantığının zayıf olduğu ortaya konulmaktadır (örn. Daniels, 1991; Krugman, 1994; Davies ve Ellis, 2000; Smit, 2010). Bu düşünceden hareketle çalışmada, ülkelerin doğrudan rekabet yapıları yerine onların karşılaştırmalı avantajları ve riskleri, hem geleneksel hem de yeni bakış açılarındaki yapılan analizlerle belirlenmeye çalışılmıştır.

2.1. Geleneksel Yaklaşım: Açıklanmış Karşılaştırmalı Üstünlükler

Ticaret ve özellikle ihracat performans göstergeleri olarak, ihracat miktarı ve içeriği, kişi başına ihracat, ticaret dengesi, ticaret hadleri, ülkelerin dünya piyasalarındaki payı ve katma değer içeriği gibi çok sayıda değişken, hem hacim hem de büyüme oranları üzerinden ele alınmaktadır. Bununla birlikte, ülkelerin avantaj durumlarının karşılaştırılmasında en yaygın kullanılan yöntem geleneksel açıklanmış karşılaştırmalı üstünlükler (AKÜ) endeksleridir. Geleneksel ticaret teorilerine göre ticaret öncesi nispi fiyat farklılıkları ülkelerin ticaret avantajını belirlemektedir. Balassa (1965, 1986), ise ülkelerin karşılaştırmalı avantajlarının, onların gözlenebilen mevcut ticaret verilerinden yararlanarak hesaplanan AKÜ endeksi ile belirlenebileceğini ortaya koymuştur. Bu

endekisle Balassa, ülkeler arasında karşılaştırmalı avantajların nedenine inmeden görünen bir avantaj farkı olup olmadığını belirlemeye çalışmıştır. Balassa'nın ilk AKÜ endeksi, bir ülkenin bir mal ya da sektördeki ihracatının toplam ihracatı içindeki payının diğer ülkelerinki ile karşılaştırılmasına dayanmaktadır:

$$AKÜ = \frac{X_{ij} / X_{it}}{X_{nj} / X_{nt}} = \frac{X_{ij} / X_{nj}}{X_{it} / X_{nt}} \quad (1)$$

Burada; X ihracatı, i ülkeyi, j malı (veya sektörü), t mal ya da sektör grubunu ve n ülke grubunu göstermektedir. AKÜ endeksi 1 den büyük ise o ülkenin incelenen sanayide açıklanmış karşılaştırmalı üstünlüğe ve 1 den küçük ise açıklanmış karşılaştırmalı dezavantaja sahip olduğu anlaşılmaktadır. AKÜ endeksinin 1 e eşit olması ise ülkelerin eşit karşılaştırmalı üstünlüğe sahip olarak rekabetin de fazla olduğuna işaret etmektedir (Seymen ve Şimşek, 2006: 40).

Balassa'nın AKÜ endeksi temelde, aynı sektörde ihracat yapan bir ülke grubuyla ilgili olarak söz konusu ülkelerin standartlaştırılmış ihracat paylarını ölçmektedir. Literatürde Balassa'nın AKÜ endeksi üzerinde lehte ve aleyhte tartışmalar devam etmesine rağmen, bu endeks (ve türevleri), ülkelerin karşılaştırmalı üstünlüklerini belirlemede halen en yaygın kullanılan ölçüm durumundadır. Literatürdeki çok sayıdaki ampirik çalışmada, ele alınan ülkelerin güçlü sektörlerinin belirlenmesinde Balassa'nın AKÜ endeksi kullanıldığı görülmektedir (Bhattacharyya, 2011: 23).

2.2. Yeni Yaklaşımlar: Ticari Performans Karşılaştırmalarında Yeni Göstergeler

Dış ticarete performans göstergelerinde piyasa seçimi ve hakimiyeti, değişen küresel ticaret dinamiklerine uyum sağlayabilme, küresel krizlere karşı kırılganlıklardan korunabilme, ticaret hadlerini lehine çevirebilme, piyasa ve ürün farklılaştırma yeteneği, ihracat içerikleri ve kalite merdiveni gibi çok sayıda gösterge belirleyici olmaktadır (Rodrik, 2007; ITC, 2014; WTO, 2014). Bu yeni bakış açılarına dikkat çeken Uluslararası Ticaret Merkezi (ITC), en geniş ve ayrıntılı uluslararası ticaret verilerine sahip UN-COMTRADE (2015) verilerini kullanarak, sektörel ticaret akımları üzerinde ülke ve ürün rekabetçiliğini ortaya koyan endeksler yayınlamaktadır (ITC, 2014). Verilerin kapsamı ve hesaplanması şu şekildedir.

i) Ürün farklılaştırması (ÜF): Piyasa farklılaştırılmasını veren endeks, 'ürün' ya da 'sektör' bazında hesaplanan *Herfindahl* endeksinin tersi olmakta ve şu şekilde hesaplanmaktadır (ITC, 2014):

$$ÜF(X_{ds}^t) = \frac{1}{HIP_{ds}^t}; \quad HIP_{ds}^t = \text{Herfindahl endeksi} = \sum_{p=1}^{np_s} \left(\frac{X_{dp,s}^t}{X_{ds}^t} \right)^2 \quad (2)$$

Burada $X_{dp,s}^t$, t yılında d ülkesinin p malı ihracatını; X_{ds}^t , d ülkesinin s sektöründeki tüm mallara ilişkin ihracatını ve X_{dp}^t / X_{ds}^t , d ülkesinin s sektörüne ilişkin toplam

ihracatı içinde p ürününün payını göstermektedir. Elde edilen değer, 0 ile $+\infty$ arasında değişmektedir. Değer büyüdükçe ihracatta sektör ya da ürün farklılaştırması ve dolayısıyla ülkenin rekabet seviyesi artmaktadır.

Mal Farklılaştırması endeksi nispeten az seviyedeki faaliyetlere karşı hassas olmadığından sektörel çalışmalara uygundur. Örneğin ihracat bileşenleri makine ve tekstil gibi temel sektörlerde farklılaşma seviyesini ortaya koyarken aynı sektördeki mal düzeyindeki analizlerde etkinlik ortaya koyamamaktadır. Yani bu gösterge petrol fiyatlarındaki artışın otomotiv ve tekstil ihracatında farklılaşma seviyesinin getireceği faydaları ortaya koyabilirken, otomotiv sektöründe benzinli/elektrikli ya da küçük/büyük olarak farklılaştırmanın faydalarını nispeten ortaya koyamamaktadır.

ii) Piyasa farklılaştırması (PF): İhracat yaptığı piyasaları farklılaştıran ülkeler, belirli piyasalara yoğunlaşmış ülkelere kıyasla, bu piyasalardan kaynaklı olumsuz şokların etkisinden daha az zarar görmektedir (WTO, 2014). Örneğin Türkiye'nin, ihracatında Avrupa Birliği piyasasında yoğunlaşması nedeniyle, AB ülkelerinde yaşanan herhangi bir talep şokunun Türkiye'nin ihracatını olumsuz etkilemesi beklenmektedir. Bu nedenle Türkiye'nin özellikle MENA ülkeleri ya da Rusya gibi yeni piyasalara girmesi AB piyasasına bağıllığını ve riski azaltacaktır¹. Piyasa farklılaştırması endeksi, piyasa yoğunlaşmasını veren *Herfindahl* endeksinin tersi olarak şu biçimde hesaplanmaktadır (ITC, 2014):

$$PF(X_{ds}^t) = \frac{1}{HIM_{ds}^t}; \quad HIM_{ds}^t = \text{Herfindahl endeksi} = \sum_{p=1}^{m_s} \left(\frac{X_{dm,s}^t}{X_{ds}^t} \right)^2 \quad (3)$$

Burada $X_{dm,s}^t$, s sektöründeki mallara ilişkin olarak t yılında d ülkesinin m piyasasına ihracatını; X_{ds}^t , d ülkesinin s sektöründeki tüm mallara ilişkin ihracatını ve $X_{dm,s}^t / X_{ds}^t$, d ülkesinin s sektöründeki tüm mallarına ilişkin toplam ihracatı içinde m piyasasının payını göstermektedir. Elde edilen değer, 0 ile $+\infty$ arasında değer almaktadır. Değer büyüdükçe faaliyette bulunan piyasa sayısı artmakta ve piyasalara özgü olası şoklara karşı kırılabilirlik azalarak ülkenin rekabet gücü artmaktadır.

iii) Rekabetçilik etkisi (RE, %): Bu endeks bir ülkenin dünya ihracat piyasası payındaki nispi değişim oranını, dolayısıyla seçilen sektörde dünya payındaki dönemsel

¹ Örneğin, 2015 yılı sonlarına doğru Türkiye ile Rusya arasında uçak düşürme krizinin ardından yaşanan siyasi sorunlar, iki ülkenin belirli sektörlerde ve karşılıklı piyasalarında aşırı yoğunlaşmış ticareti nedeniyle ciddi ekonomik sorunları da beraberinde getirmiştir. Şöyle ki, Türkiye'nin basit imalat sanayileri ile gıda ihracatında ve doğal gaz gibi enerji yoğun ithalatında Rusya piyasasına aşırı yoğunlaşmış olması nedeniyle gelişen karşılıklı ticari bağımlılık, iki ülke arasındaki siyasi sorunu ciddi ekonomik sorunlara dönüştürmüştür. Bu sorunun ardından, Türkiye, üretime temel girdi sağlayan enerji ithalatını; Rusya ise özellikle gıda ithalatını başka piyasalara kaydırmaya çalışarak her iki ülke de ticarete karşılıklı aşırı bağımlılığını azaltacak önlemlere başvurmuşlardır.

olarak yüzde rekabetçilik değişimini göstermektedir. Rekabetçilik etkisi şu şekilde hesaplanmaktadır (ITC, 2014):

$$RE = \sum_j \left(\frac{X_{djs}^t}{X_{js}^t} - \frac{X_{djs}^{t_0}}{X_{js}^{t_0}} \right) \left(\frac{X_{js}^{t_0}}{X_{ws}^{t_0}} \right) \quad (4)$$

Burada, t_0 ilk yıl (2008) iken, t sonraki yani cari (2012) yıldır. d incelenen ülke, j partner ülke, s ise seçilmiş sektördür. X ler ise yine ihracatları göstermektedir. $(X_{djs}^t / X_{js}^t) - (X_{djs}^{t_0} / X_{js}^{t_0})$ ifadesi ülkelerin, partner ülkelerin piyasalarına ilişkin ihracat payındaki değişimi gösterirken; $X_{js}^{t_0} / X_{ws}^{t_0}$, dünya ithalatında partner ülkelerin ilk paylarını göstermektedir. Yüzde olarak $-\infty$ ile $+\infty$ arasında değerler alan bu değişkenin pozitif olması, incelenen sektörde ülkenin artan rekabet gücüne bağlı olarak piyasa kazancına işaret etmektedir.

iv) İlk coğrafi uzmanlaşma (İCU, %): İlk coğrafi uzmanlaşma endeksi, dünya piyasasında nispi değişme miktarını göstermektedir. Bu endeks yurtiçi ihracatçıların dinamik piyasalardaki ilk uzmanlaşmalarına ilişkin olarak kazançlarını göstermektedir. Endeks şu şekilde hesaplanmaktadır (ITC, 2014):

$$İCU = \sum_j \frac{X_{djs}^{t_0}}{X_{js}^{t_0}} \left(\frac{X_{js}^t}{X_{ws}^t} - \frac{X_{js}^{t_0}}{X_{ws}^{t_0}} \right) \quad (5)$$

Burada, t_0 ve t sırasıyla ilk ve sonraki yılı göstermektedir. d , incelenen ülkeyi, j partner ülkeyi, s ise seçilen sektörü ve X 'ler ihracatı göstermektedir (X_s : s sektörüne ilişkin dünya ihracatı). $X_{djs}^{t_0} / X_{js}^{t_0}$, incelenen ülkenin partner ülke piyasasındaki (ithalatında) ilk payını, $(X_{js}^t / X_{ws}^t) - (X_{js}^{t_0} / X_{ws}^{t_0})$ ise, partner ülkenin dünya ithalatı içindeki ithalat payındaki değişimi göstermektedir. Yüzde olarak $-\infty$ ile $+\infty$ arasında değerler almaktadır. Eğer incelenen ülke dönem başlangıcında dinamik piyasalarda iyi bir pozisyon almışsa toplam etki (dünya ithalatında partner ülkenin paylarındaki değişimlerin ağırlıklı ortalaması) yani endeks pozitif olacaktır.

v) İlk ürün uzmanlaşması (İÜU, %): İlk ürün uzmanlaşma endeksi, dünya piyasası payındaki nispi değişme miktarını göstermektedir. Bu endeks dinamik talep tarafından belirlenen malların yurtiçi arzında ilk sektörel uzmanlaşmaya ilişkin olarak kayıp ve kazançları ortaya koymaktadır. Endeks şu şekilde hesaplanmaktadır (ITC, 2014):

$$İÜU = \sum_j \left(\frac{X_{djs}^{t_0}}{X_{js}^{t_0}} - \frac{X_{dj}^{t_0}}{X_j^{t_0}} \right) \left(\frac{X_{js}^t}{X_w^t} - \frac{X_{js}^{t_0}}{X_w^{t_0}} \right) \quad (6)$$

Burada, t_0 ve t sırasıyla ilk ve sonraki yılı göstermektedir. d , incelenen ülkeyi, j partner ülkeyi, s ise seçilen sektörü ve X ler ihracatı göstermektedir (X_s : s sektörüne ilişkin dünya ihracatı). $(X_{djs}^{t_0} / X_{js}^{t_0}) - (X_{dj}^{t_0} / X_j^{t_0})$ ifadesi incelenen ülkenin, ticari partnerlerinin ithalat piyasasındaki s sektörüne ilişkin ilk payı ile tüm sektörlerdeki toplam payı arasındaki farkı gösterirken $(X_{js}^t / X_w^t) - (X_{js}^{t_0} / X_w^{t_0})$, tüm dünya ithalat piyasasında j ülkesinin ihracat payındaki değişimi göstermektedir. Yüzde olarak $-\infty$ ile $+\infty$ arasında değerler almaktadır. Eğer incelenen ülkenin herhangi bir piyasadaki ihracat payı artarken (azalırken), ticari partner piyasasına ilişkin olarak incelenen sektör ihracatında da bir artış (azalış) görülürse ilk ürün uzmanlaşma endeksi pozitif olacaktır. Farklı yönlerde bir hareket ise negatif değere neden olacaktır. Eğer incelenen ülke dönem başlangıcında dinamik ürünlerde iyi bir pozisyon almışsa toplam etki yani endeks pozitif olacaktır.

vi) Uyum etkisi (UE, %): Uyum etkisi endeksi, dünya piyasası payındaki nispi değişme miktarını göstermektedir. Bu endeks bir ülkenin dünya ya da partner ülke piyasasındaki talep değişimleri karşısında ihracat arzını adapte edebilme yeteneğini göstermektedir. Şu formül ile hesaplanmaktadır (ITC, 2014):

$$UE = \sum_j \left(\frac{X_{djs}^t}{X_{js}^t} - \frac{X_{djs}^{t_0}}{X_{js}^{t_0}} \right) \left(\frac{X_{js}^t}{X_w^t} - \frac{X_{js}^{t_0}}{X_w^{t_0}} \right) \quad (7)$$

Burada, yine t_0 ve t sırasıyla ilk (2008) ve sonraki yani cari (2012) yılı göstermektedir. d incelenen ülkeyi, j partner ülkeyi, s seçilen sektörü, w ihracat yapan tüm ülkeler setini ve X ihracatı göstermektedir.

Yüzde olarak $-\infty$ ile $+\infty$ arasında değerler almaktadır. İncelenen ülkenin ihracat piyasası büyürken (küçülürken) yani partner ülkede ithalat talebi artarken (azalırken), ülkenin piyasa payı da artıyorsa (azalıyorsa) endeks pozitif olacaktır. Aksi durumda, yani bir sektöre ilişkin olarak ülkenin ihracat pazarı küçülürken (büyürken), ülkenin piyasa payı artıyorsa (azalıyorsa) endeks negatif olacaktır.

3. İhracat Performansı Karşılaştırmalı Analiz Bulguları

Yukarıda anlatılanlar doğrultusunda endeksler aşağıda izleyen tablolarda sunulmuştur. İncelenen sektörlerle ilişkin olarak Uluslararası Standart Ticaret Sınıflaması (*Standard International Trade Classification-SITC*), 3. Revizyon 3 haneli düzeyde (bkz. UN, 2015) hesaplamalar ve toplulaştırmalar yapılmıştır.

Aşağıda Tablo 1'in ilk kısmında 2014 yılına ilişkin öncelikle, tekstil sanayisinin Türkiye'nin toplam ihracatındaki payının (%7) diğer ülkelerden yüksek olduğu görülmektedir. Ayrıca bu sektördeki ithalatın, toplam ithalat içindeki payının da yüksek olması (%2) en genel anlamıyla endüstri-içi ticaret (EİT) yapısına işaret etmektedir.

Nispi ticaret dengesi değerlerine bakıldığında, tekstil sektöründe Hindistan, Çin ve Türkiye dışında diğer ülkelerin net ithalatçı olduğu görülmektedir. Çin'in (%72) ve Hindistan'ın (%64) bu sektörde net ticari fazlaları Türkiye'nin değerinin (%26) oldukça üzerindedir. Tekstil sektöründe, Çin'in dünya toplam ihracatındaki yüksek payı (%37), bu sektörü diğer GOÜ'ler için daha rekabetçi yapmaktadır. UN-COMTRADE (2015) SITC 3. Revizyon 1 haneli sınıflandırmalı verilerine göre, 2014 yılı için, tekstil ve türevleri sektörü Türkiye'nin en yüksek net ticari fazlaya sahip olduğu sektör gruplarıdır ve bu sektörde Çin'in AB piyasasındaki payı da artmaktadır. Bu durum, Türkiye için, rekabet baskısını daha da önemli hale getirmektedir.

Tablo 1: Tekstil Sektörüne İlişkin Ticaret Performans Göstergeleri

	Brzl.	Rusya	Hind.	Çin	G.Afr.	Meks.	Türkiye	
Ülke ihracatında payı, %	0	0	5	4	0	0	7	
2014 Endeks Değeri	Ülke ithalatında pay, %	1	1	0	0	1	2	
	Nispi ticaret dengesi, %	-66	-79	64	72	-53	-43	27
	Dünya ihracatında payı, %	0,29	0,15	5,99	36,59	0,13	0,84	4,10
		(33)	(46)	(2)	(1)	(48)	(20)	(6)
	Açık karş. üstn. (AKÜ) end.	0,48	0,07	1,87	2,53	0,45	0,59	2,89
	Ürün farklılaştırması	40	53	48	82	69	17	29
		(17)	(13)	(16)	(5)	(8)	(50)	(33)
Piyasa farklılaştırması	8	8	17	28	14	2	28	
	(49)	(50)	(11)	(2)	(14)	(119)	(1)	
2010-2014 Değişim, %	Rekabetçilik etkisi	-4,96	8,68	2,42	1,19	-1,39	1,45	2,67
		(98)	(22)	(41)	(50)	(72)	(47)	(40)
	İlk coğrafi uzmanlaşma	-2,21	-0,70	0,51	0,50	-0,58	0,09	-0,32
		(119)	(77)	(35)	(36)	(72)	(52)	(66)
	İlk ürün uzmanlaşması	-0,43	0,91	-1,83	0,86	2,40	0,90	0,95
	(76)	(40)	(96)	(42)	(23)	(41)	(38)	
Uyum etkisi	0,62	3,07	1,85	0,87	-4,66	-1,12	-0,77	
	(47)	(30)	(36)	(42)	(117)	(93)	(83)	

Not: Parantez içindeki rakam, sektörde ihracat yapan 130 ülke sıralamasındaki yerini göstermektedir. Tekstil için SITC (3. Revizyon, 3 haneli) sektör kodları: 651-659. Sektör kod açıklamaları için bkz. UN, 2015.

Kaynak: ITC (2015), Trade Competitiveness Map. <http://www.intracen.org/> verilerinden derlenmiş; UN-COMTRADE (2015), <http://comtrade.un.org/db/> verilerinden hesaplanmıştır.

Tabloda, 1'den büyük açıklanmış karşılaştırmalı üstünlük (AKÜ) endeks değerleri dikkate alındığında, tekstil sektöründe en fazla karşılaştırmalı üstünlüğe sahip olan ülkelerin sırasıyla Türkiye (2,89), Çin (2,53) ve Hindistan (1,87) olduğu görülmektedir. Ürün farklılaştırması değerlerine göre, tekstil sektöründe Çin (82)'in ve nispeten Güney Afrika (69)'nın mallarını farklılaştırılarak sektörel şoklara karşı daha dirençli oldukları görülmektedir. Buna karşın özellikle Meksika (17) ve Türkiye (29)'nin, tekstil sektöründe belirli ürün gruplarında uzmanlaşma ve yoğunlaşmanın fazla olması nedeniyle, kırılgan bir yapıya sahip oldukları görülmektedir. Piyasa farklılaştırması bakımından ise son yıllardaki ikili ticarete, Avrupa Piyasalarının yanında özellikle Türk

Cumhuriyetlerine ve Orta Doğu ülkelerine tekstil ihracatını (ve diğer ihracat kalemlerini) geliştirerek küresel piyasa yayılımını artıran (İTKİP, 2014; UN-COMTRADE, 2015) Türkiye ilk sırada yer almaktadır. Türkiye'yi beklendiği üzere Çin takip etmektedir. Çin'in bu sektörde (ve başka birçok sektörde) küresel yayılcı eğilimi dikkat çekmektedir. Bu sonuca göre, incelenen ülkeler kapsamında tekstil sektöründe Çin mallarıyla küresel olarak en çok rekabet etmek durumunda olan ülke Türkiye'dir.

Tablo 1'in ikinci kısmında ise ülkelerin 2010 yılından 2014 yılına ilişkin yüzde değişim endeksleri görülmektedir. Buna göre rekabetçilik etkisi bakımından Brezilya (%-4,96) ve Güney Afrika (%-1,39)'nın rekabet gücündeki azalışlar ile Rusya (%8,68), Türkiye (%2,67) ve Hindistan (%2,42)'in rekabet gücündeki artışların birlikte geliştiği görülmektedir. Çin, Hindistan ve Türkiye'nin uluslararası tekstil ihracatındaki ağırlıklarına (sırasıyla, %36,59; %5,99 ve %4,10) karşın, rekabetçilik etkisi bakımından 130 ülke içinde sırasıyla 50., 41. ve 40. sıralarda olmaları dolaylı olarak yine tekstil sektöründeki küresel rekabetin şiddetini ortaya koymaktadır. Emek yoğun olan bu sektör halen GOÜ'lerin temel ihracat sektörlerini oluşturmaktadır.

İlk coğrafi uzmanlaşma endeksine göre Hindistan (%0,51), Çin (%0,50) ve kısmen de olsa Meksika (%0,09) dışındaki diğer ülkelerin dinamik piyasalarda iyi bir yer edinmediği görülmektedir. Buna göre Türkiye'nin, piyasa farklılaştırması bakımından nispeten geniş yayılımına karşın, başlangıçta (2010) coğrafi olarak piyasa seçimini etkin bir biçimde yapmadığı anlaşılmaktadır. UN-COMTRADE (2015) verilerine göre bu gelişmede, birçok sektörde olduğu gibi tekstilde de AB piyasalarına yönelmenin etkisi görülmektedir. Bu gelişme, Avrupa Birliği ile oluşturulan Gümrük Birliği'nin Türkiye ekonomisine olumlu ve olumsuz etkileri kapsamında yapılan çalışmaları da artırmaktadır (tartışmalar için bkz. Soyak, 2005; Yıldırım ve Dura, 2007; Togan, 2012). İlk ürün uzmanlaşma endekslerine bakıldığında, Hindistan (%-1,83) ve Brezilya (%-0,43) dışında diğer ülkelerin dönem başlangıcında (2010) dinamik ürünlerde nispeten iyi bir pozisyon aldıkları görülmektedir. Bu gelişme, farklı bir yaklaşımda yine tekstil sektöründe Çin ile Türkiye başta olmak üzere birçok ülke için rekabetinin şiddetli olduğuna (olacağına) işaret etmektedir.

Tablo 1'de son olarak uyum etkisi incelendiğinde Rusya (3,07)'nin yüksek değeri dikkat çekmektedir. Onu sırasıyla Hindistan (1,85) ve Çin (0,87) izlemektedir. Buna göre bu üç ülke, ürün farklılaştırması sayesinde, faaliyet gösterdikleri ihracat piyasalarına ilişkin olarak sektörde bir talep değişmesine, incelenen diğer ülkelere kıyasla, daha hızlı bir şekilde uyum sağlayabilmişlerdir.

Farklı sektörler için toplu sonuçlar aşağıda izleyen tablolarda sunulmaktadır. Özellikle Türkiye örneğinde ülkelere ilişkin ayırıcı özellikler, karşılaştırmalı olarak belirtilmekle birlikte, yukarıda tekstil sektörüne ilişkin yapılan ayrıntılı açıklamalara gidilmemektedir. Ayrıca genel bulgular sonuç kısmında özetlenmektedir.

Tablo 2: Kimyasallar Sektörüne İlişkin Ticaret Performans Göstergeleri

	Brzl.	Rusya	Hind.	Çin	G.Afr.	Meks.	Türkiye	
2014 endeks Değeri	Ülke ihracatında payı, %	6	5	12	6	8	4	7
	Ülke ithalatında payı, %	21	14	11	10	11	12	14
	Nispi tic. dengesi, %	-52	-21	-12	-12	-21	-47	-50
	Dünya ihracatında payı, %	0,70 (28)	1,24 (20)	1,87 (18)	7,48 (3)	0,36 (34)	0,85 (26)	0,55 (32)
	AKÜ Endeksi	0,84	1,77	0,88	0,83	1,09	0,65	0,61
	Ürün farklılaştırması	57 (10)	29 (23)	20 (35)	106 (1)	62 (6)	61 (8)	61 (7)
	Piyasa farklılaştırması	13 (34)	23 (4)	22 (6)	24 (2)	24 (3)	4 (115)	32 (1)
2010-2014 değişim, %	Rekabetçilik etkisi	-2,80 (109)	0,50 (77)	6,76 (30)	5,67 (35)	-0,59 (92)	1,57 (64)	5,0 (37)
	İlk coğrafi uzmanlaşma	0,30 (100)	0,95 (75)	1,26 (58)	0,21 (107)	1,27 (57)	0,17 (109)	1,15 (63)
	İlk ürün uzmanlaşması	0,30 (77)	-1,22 (119)	-0,75 (11)	0,30 (78)	-0,78 (113)	1,37 (46)	1,56 (41)
	Uyum etkisi	-0,37 (79)	2,87 (35)	-1,18 (109)	-0,55 (87)	-0,81 (97)	-0,74 (93)	-3,43 (138)

Not: Parantez içindeki rakam, sektörde ihracat yapan 159 ülke sıralamasındaki yerini göstermektedir. Kimyasallar için SITC (3. Rev. 3 haneli) sektör kodları: 232, 266-267, 511-516, 522-525, 531-533, 541-542, 553-554, 562, 571-575, 579, 581-583, 591-593, 597-598, 621, 625, 629. Sektör kod açıklamaları için bkz. UN, 2015.

Kaynak: ITC (2015), Trade Competitiveness Map. <http://www.intracen.org/> verilerinden derlenmiş; UN-COMTRADE (2015), <http://comtrade.un.org/db/> verilerinden hesaplanmıştır.

Kimyasallar sektörü, incelenen sektörler içinde Türkiye'nin net ticaret açığı (%50) ile faaliyet gösterdiği sanayi gurupları arasındadır. Bilgi ve inovasyon faaliyetlerinin yoğun görüldüğü ve genellikle sanayileşmiş ülkelerde yoğunlaşan kimyasallar sektöründe Hindistan, Çin, Rusya ve G. Afrika'nın net açıklarının az olması bu sektörlerde de YSE'lerin ağırlığının arttığını ortaya koymaktadır. Dünya ihracatındaki payları, ürün ve piyasa farklılaştırması ile birlikte değerlendirildiğinde emek-yoğun faktör donanımı yapısına rağmen özellikle Çin'in bu gelişimi, geleneksel ticaret teorilerinin önermelerine uymamaktadır. Bu sektörde Rusya ve G. Afrika açıklanmış karşılaştırmalı üstünlüğe sahip iken, ürün farklılaştırması bakımından Çin'in 159 ülke içinde ilk sırada yer aldığı görülmektedir.

Türkiye'nin net ticaret açığı verdiği sektörlerden bir diğeri Tablo 3'te görülen 'elektriksiz makineler' imalat sanayileridir. Türkiye'nin ticari rekabet göstergelerinin yine bu sektörde de Çin'e kıyasla kötü bir durumda olduğu görülmektedir. Bu sektörde yedi ülke içinde, küresel piyasalardaki yüksek payı (%12,13) ile birlikte dış ticaret fazlası veren (%23) ve açıklanmış karşılaştırmalı üstünlüğe (1,36) sahip tek ülke Çin'dir. Türkiye'nin bu sektörde, coğrafi uzmanlaşma endeksi bakımından küresel

piyasalarda iyi bir konum alamadığı ve uyum etkisi bakımından ihracat piyasasındaki talep değişmelerine yeterince adapte olamadığı görülmektedir.

Tablo 3: Elektriksiz Makineler Sektörüne İlişkin Ticaret Performans Göstergeleri

	Brzl.	Rusya	Hind.	Çin	G.Afr.	Meks.	Türkiye		
2014 endeksi	Ülke ihracatında payı, %	6	1	4	8	7	9	7	
	Ülke ithalatında payı, %	13	16	5	6	12	13	10	
	Nispi tic. dengesi, %	-35	-72	-26	23	-30	-17	-40	
	Dünya ihracatında payı, %	0,89 (25)	0,47 (30)	0,93 (24)	12,13 (2)	0,40 (33)	2,41 (10)	0,70 (27)	
	AKÜ Endeksi	0,47	0,83	0,44	1,36	0,57	0,62	0,92	
	Ürün farklılaştırması	30 (40)	14 (87)	61 (12)	80 (4)	11 (96)	37 (31)	45 (24)	
	Piyasa farklılaştırması	9 (57)	12 (37)	23 (5)	22 (7)	17 (15)	1 (146)	10 (10)	
	2010-2014 değişim, %	Rekabetçilik etkisi	-1,72 (92)	3,40 (51)	5,22 (40)	5,04 (41)	-3,13 (98)	0,35 (72)	5,50 (38)
		İlk coğrafi uzmanlaşma	0,91 (50)	-0,99 (127)	0,78 (54)	0,25 (78)	1,36 (41)	3,02 (13)	0,13 (85)
		İlk ürün uzmanlaşması	-0,74 (108)	-0,51 (102)	0,01 (89)	0,02 (86)	1,40 (56)	-0,28 (99)	2,05 (39)
Uyum etkisi		0,55 (39)	1,03 (32)	1,11 (31)	-0,15 (60)	-2,04 (88)	0,27 (47)	-3,77 (104)	

Not: Parantez içindeki rakam, sektörde ihracat yapan 150 ülke sıralamasındaki yerini göstermektedir. Elektriksiz makineler için SITC (3. Rev. 3 haneli) sektör kodları: 711-714, 716-718, 721-728, 731-735, 737, 741-749. Sektör kod açıklamaları için bkz. UN, 2015.

Kaynak: ITC (2015), Trade Competitiveness Map. <http://www.intracen.org/> verilerinden derlenmiş; UN-COMTRADE (2015), <http://comtrade.un.org/db/> verilerinden hesaplanmıştır.

Seçilen ülkeler içinde Çin ile Meksika'nın rekabetçi yapılarının dikkat çektiği bir sektör Tablo 4'te görülen 'bilişim teknolojileri ve elektronik tüketim malları' imalat sanayileridir. Bu iki ülke dışında diğer ülkeler net ticari açıyla faaliyet göstermektedir. Bu durum AKÜ endekslerine de yansımıştır. Ürün ve piyasa farklılaştırması bakımından G. Afrika'nın nispeten iyi performans göstermesine rağmen dünya ihracatındaki payının düşük olması (%0,12), rekabetin yoğun olarak Meksika ile Çin arasında yaşanmakta olduğunu göstermektedir. Ancak Meksika, birçok sektörde olduğu gibi, bu sektörde de tek piyasaya (ABD piyasası) yoğunlaştığından, bu piyasadaki talep şoklarına karşı hassas bir yapıya sahip olmaktadır.

Tablo 4: Bilişim/Elektronik Tüketim Malları Sektörüne İlişkin Ticaret Performans Göstergeleri

	Brzl.	Rusya	Hind.	Çin	G.Afr.	Meks.	Türk.	
2014 endeksi	Ülke ihracatında payı, %	0	0	0	21	1	15	1
	Ülke ithalatında pay, %	6	7	5	3	7	11	4
	Nispi tic. dengesi, %	-90	-71	-81	76	-67	14	-65
	Dünya ihracatında payı, %	0,06 (46)	0,29 (29)	0,22 (31)	42,29 (1)	0,12 (39)	5,25 (3)	0,20 (34)
	AKÜ Endeksi	0,30	0,34	0,87	1,89	0,37	1,92	0,30
	Ürün farklılaştırması	12 (16)	10 (30)	9 (39)	8 (52)	12 (20)	9 (45)	2 (119)
	Piyasa farklılaştırması	10 (32)	3 (94)	14 (12)	8 (50)	16 (7)	1 (120)	11 (27)
2010-2014 değişim, %	Rekabetçilik etkisi	-12,67 (112)	39,68 (20)	-5,82 (101)	1,31 (69)	5,17 (56)	-0,86 (80)	9,65 (45)
	İlk coğrafi uzmanlaşma	-3,22 (120)	1,20 (29)	-0,10 (55)	0,75 (31)	3,00 (17)	-0,45 (75)	-1,34 (109)
	İlk ürün uzmanlaşması	0,77 (58)	-5,80 (124)	2,31 (35)	0,33 (66)	1,36 (48)	0,05 (70)	-4,37 (115)
	Uyum etkisi	1,90 (29)	4,96 (18)	-1,62 (59)	0,59 (37)	0,30 (41)	-0,04 (44)	-3,34 (85)

Not: Parantez içindeki rakam, sektörde ihracat yapan 128 ülke sıralamasındaki yerini göstermektedir. Bilişim Teknolojileri-Elektronik Tüketim Malları için SITC (3. Rev. 3 haneli) sektör kodları: 751-752, 759, 761-764, 771-776, 778. Sektör kod açıklamaları için bkz. UN, 2015.

Kaynak: ITC (2015), Trade Competitiveness Map. <http://www.intracen.org/> verilerinden derlenmiş; UN-COMTRADE (2015), <http://comtrade.un.org/db/> verilerinden hesaplanmıştır.

Fiziki ve beşeri sermaye yoğun üretim yapısına sahip olması ve küresel düzeyde diğer sektörlerde inovasyon ve teknolojik taşıma etkisinin yüksek olması nedeniyle GOÜ'ler için kritik önemde olan öncü sektörlerin başında aşağıda Tablo 5'te görülen 'ulaşım araçları' sanayileri gelmektedir. Bu sektör, GOÜ'lerin emek yoğun üretim ve ihracat yapısından sermaye ve teknoloji yoğun bir yapıya geçişte aracılık üstlenen öncü bir sektördür. Türkiye'nin ihracatı içinde önemli bir yeri olan (%12) ve sanayileşme sürecinde kritik öneme sahip ulaşım ve taşıma araçları sektöründe ticari fazlasının olmaması, yoğun montaj faaliyetlerine bağlı olarak düşük yurtiçi katma değere işaret etmektedir.

Tablo 5'te görülen AKÜ endekslerine göre Meksika, Türkiye ve Güney Afrika açıklanmış karşılaştırmalı üstünlüğe sahip iken, bu sektörde dünya ihracatında yaklaşık %6,5 paya sahip olan Çin'in açıklanmış karşılaştırmalı dezavantaja sahip olması dikkat çekmektedir. Bu durum, GOÜ'ler için bir yandan küresel bir fırsat iken, diğer yandan bu ülkeler için yapısal dönüşümü de zorunlu hale getirmektedir. Ayrıca bu sektörde de Çin'in artan performansı yapısal dönüşümün hızlı olmasını da gerektirmektedir. Yüksek performans göstergelerine sahip Meksika'nın piyasa farklılaştırması bakımından son

sıralarda yer alması ABD gibi tek bir piyasada yoğunlaşmasından ileri gelmekte ve ABD piyasalarında meydana gelecek talep şoklarına karşı kırılganlığını artırmaktadır.

Tablo 5: Ulaşım Araçları Sanayileri Sektörlerine İlişkin Ticaret Performans Göstergeleri

	Brzl.	Rusya	Hind.	Çin	G.Afr.	Meks.	Türkiye	
2014 endeksi	Ülke ihracatında payı, %	7	0	7	4	10	22	12
	Ülke ithalatında payı, %	10	11	2	6	9	9	8
	Nispi tic. dengesi, %	-19	-76	34	-7	2	41	0
	Dünya ihracatında payı, %	0,92 (23)	0,26 (33)	1,45 (16)	6,00 (6)	0,55 (27)	5,27 (7)	1,13 (19)
	AKÜ Endeksi	0,86	0,17	0,81	0,53	1,28	2,14	1,73
	Ürün farklılaştırması	12 (22)	11 (30)	14 (16)	21 (3)	7 (72)	10 (37)	12 (26)
	Piyasa farklılaştırması	6 (53)	5 (79)	21 (1)	21 (2)	16 (10)	1 (141)	17 (8)
2010-2014 değişim, %	Rekabetçilik etkisi	-4,58 (112)	5,16 (50)	1,89 (63)	1,51 (67)	-2,20 (98)	1,11 (70)	4,14 (53)
	İlk coğrafi uzmanlaşma	-2,44 (135)	-1,58 (125)	1,35 (44)	-1,57 (124)	1,02 (53)	2,61 (23)	-1,25 (117)
	İlk ürün uzmanlaşması	-0,27 (92)	-3,91 (132)	-1,27 (109)	-1,82 (117)	1,69 (62)	3,56 (41)	0,44 (80)
	Uyum etkisi	2,53 (31)	3,41 (28)	5,65 (22)	0,86 (44)	-1,85 (81)	0,45 (51)	-2,39 (85)

Not: Parantez içindeki rakam, sektörde ihracat yapan 151 ülke sıralamasındaki yerini göstermektedir. Ulaşım araçları için SITC (3. Rev. 3 haneli) sektör kodları: 781-786, 791-793. Sektörler için bkz. UN, 2015.

Kaynak: ITC (2015), Trade Competitiveness Map. <http://www.intracen.org/> verilerinden derlenmiş; UN-COMTRADE (2015), <http://comtrade.un.org/db/> verilerinden hesaplanmıştır.

Ülkelerin ihracat performansı göstergelerinden biri de onların tarım ve madencilik gibi ilksel sektörlerle dayalı ihracatlarının toplam ihracatları içindeki payıdır. İhracatın sürdürülebilirliği, kalite gelişimi, bozulan ticaret hadleri ve ülke kurumsal yapılarını bozması gibi çok farklı bakımlardan olumsuz etkileri üzerine tartışmalar bir tarafa, çalışmadaki göstergeler bakımından aşırı sektörel uzmanlaşma önemli bir risk oluşturmaktadır. Bu durumun gözlenen bir göstergesi dünya imalat sanayi lideri olan Çin'in uluslararası ihracatta en az paya sahip olduğu sektörlerin başında 'madencilik' yani 'mineraller' sektörü gelmektedir. Aşağıda Tablo 6'da görüldüğü üzere, bu sektörde imalat sanayileri nispeten az gelişmiş Brezilya, Rusya, Hindistan ve Güney Afrika'nın yüksek paylarına rağmen Çin, Meksika ve Türkiye'de bu oranlar oldukça düşüktür. Özellikle Türkiye için mevcut oranlar ise üretim faaliyetlerinden çok rafine faaliyetlerine dayanmaktadır (EIA, 2015).

Tablo 6: Maden Sanayileri (Mineraller) Sektörüne İlişkin Ticaret Performans Göstergeleri

	Brzl.	Rusya	Hind.	Çin	G.Afr.	Meks.	Türkiye	
2014 endeksi	Ülke ihracatında payı, %	23	60	28	1	27	15	6
	Ülke ithalatında pay, %	20	2	47	26	24	8	11
	Nispi tic. dengesi, %	5	94	-40	-84	0	15	-50
	Dünya ihracatında payı, %	1,58 (24)	8,94 (1)	2,71 (11)	1,26 (28)	0,75 (32)	1,45 (25)	0,29 (53)
	AKÜ Endeksi	1,26	2,08	0,68	0,40	1,16	0,85	0,50
	Ürün farklılaştırması	4 (52)	3 (79)	3 (68)	4 (53)	9 (2)	2 (119)	6 (21)
	Piyasa farklılaştırması	8 (38)	14 (8)	17 (4)	12 (13)	11 (17)	2 (130)	15 (6)
2010-2014 değişim, %	Rekabetçilik etkisi	-4,45 (17)	-4,96 (124)	-3,13 (104)	0,13 (76)	2,05 (65)	-4,71 (120)	-0,28 (78)
	İlk coğrafi uzmanlaşma	5,81 (56)	-0,43 (142)	3,53 (81)	4,35 (73)	5,64 (61)	0,60 (128)	1,70 (108)
	İlk ürün uzmanlaşması	-3,37 (113)	-1,15 (87)	-1,18 (88)	-2,55 (108)	-9,76 (143)	1,51 (51)	-1,69 (94)
	Uyum etkisi	-2,58 (102)	4,09 (24)	1,03 (46)	-1,52 (86)	-0,26 (65)	-0,50 (67)	1,26 (45)

Not: Parantez içindeki rakam, sektörde ihracat yapan 168 ülke sıralamasındaki yerini göstermektedir. Maden Sanayileri için SITC (3. Rev. 3 haneli) sektör kodları: 272-274, 277-278, 281-298, 321-322, 325, 333-335, 342-345, 351, 667. Sektör kod açıklamaları için bkz. UN, 2015.

Kaynak: ITC (2015), Trade Competitiveness Map. <http://www.intracen.org/> verilerinden derlenmiş; UN-COMTRADE (2015), <http://comtrade.un.org/db/> verilerinden hesaplanmıştır.

Tablo 6'da Rusya'nın maden sanayilerinin toplam ihracat içindeki payı (%60) dikkat çekmektedir. Rusya için %94'e ulaşan net ticaret fazlası ve küresel ihracattaki %9'a yaklaşan payı bu sektörün önemini ortaya koyarken, bu büyüklükler Rusya'yı önemli tedarikçi yapmaktadır. Bu durum Rusya'nın AKÜ endeksine de yansımıştır. Bu sektörde Çin, Türkiye ve Hindistan'ın ciddi nispi ticaret açıkları dikkat çekmektedir. Ürün farklılaştırmasında G. Afrika ve piyasa farklılaştırmasında sırasıyla Hindistan, Türkiye ve Rusya nispeten başarı göstermişlerdir. Sonraki üç ülke uyum etkisinde de nispeten iyi durumdadır.

4. Ülkelerin Karşılıklı Rekabeti: Ticari Uzmanlaşma ve Korelasyon Endeksleri

Artan sanayi üretimleri ve ihracatlarıyla dikkat çeken YSE'lerin özellikle 1990'lardan itibaren küresel ihracatta artan payları bu ülkelerin uzmanlaşma ve rekabet yapılarına dikkat çekmektedir. Bu kapsamda ülkelerin sektörel ihracat gelişmelerine ilişkin önemli bir konu ticaret dengesini ne kadar etkiledikleridir. Bunun için sektörel ticaret dengelerinin, yani diğer adıyla ticari uzmanlaşma seviyelerinin daha yakından incelenmesi gerekmektedir. Gerçekleşen ticaret verileri yoluyla malların üretiminde ya

da tüketiminde uzmanlaşma seviyesini ölçen ticari uzmanlaşma endeksi (TUE) şu şekilde hesaplanmaktadır (UNCTAD, 2015).

$$TUE_{ji} = \frac{X_j - M_j}{X_j^i + M_j^i} \quad (8)$$

Burada, TUE_{ji} belirli bir zaman diliminde (genellikle yıl olarak) j ülkesinin i malı için ticari uzmanlaşma endeksidir. i , mal ya da mal grubunu (sanayi); j , ülkeleri (ya da ülke grubunu); X_j^i , j ülkesinin i malı ihracatını ve M_j^i ise yine j ülkesinin i malı ithalatını göstermektedir. Net ticaret akımını (*ihracat-ithalat*) toplam mal ticareti (*ihracat+ithalat*) ile karşılaştıran bu endeksler sektörlere ilişkin normalleştirilmiş ticaret dengesi olarak bilinmektedir. -1 ile 1 arasında değişen bu endekslerin pozitif değer alması, ekonominin bu mal grubunda net ihracatçı olduğunu ve böylece bu mal grubunda uzmanlaştığını ortaya koymaktadır. Negatif değer ülkenin bu mal grubunda net ithalatçı olduğunu ve böylece tüketimde uzmanlaştığını göstermektedir. Bu endeks yeniden ihracat faaliyetlerinin neden olduğu yanlılıkları ortadan kaldırdığından ticaretçi ülkeler ile üretici ülkeleri birbirlerinden ayırabilmektedir.

TUE'ler ticari korelasyon endeksleri (TKE)'nin hesaplanmasında kullanılmaktadır. TKE'nin hesaplanması ülkelerin ihracatında rekabet durumlarını daha net olarak görebilmek için TUE'lerinin benzerliğinin ölçülmesine dayanmaktadır. Ülkelerin mal ticareti korelasyon endeksleri ile ülkelerin rekabet seviyelerinin belirlenebileceğini gösteren UNCTAD (2015), TKE'leri şu formül ile hesaplamaktadır:

$$TKE_{jk} = \frac{\sum_{i=1}^n (TUE_{ji} - \overline{TUE_{ji}})(TUE_{ki} - \overline{TUE_{ki}})}{\sqrt{\sum_{i=1}^n (TUE_{ji} - \overline{TUE_{ji}})^2 (TUE_{ki} - \overline{TUE_{ki}})^2}} \quad (9)$$

Burada, TKE_{jk} , belirli bir zaman biriminde j ve k ülkeleri arasındaki ticari korelasyon endeksini; TUE_{ji} , j ülkesi ve i mal(lar)ı ticari uzmanlaşma endeksini; TUE_{ki} ise k ülkesi ve i malı için ticari uzmanlaşma endeksini göstermektedir. TKE'leri birbirlerine yakın olan ülkelerin, hem ihracat hem de ithalat bakımından rekabet halinde oldukları anlaşılmaktadır. -1 ile 1 arasında değerler alabilen TKE'lerin pozitif olması bu ülkelerin aynı sanayilerde net ihracatçı olduğu ve böylece küresel piyasalarda rekabet ettikleri anlamına gelmektedir. TKE'lerin negatif değer alması ise, tüketim/üretim bakımından bu ülkelerin aynı sanayilerde uzmanlaşmadığı ve böylece doğal olarak ticari partner oldukları biçiminde yorumlanmaktadır (UNCTAD, 2015). Aşağıda Tablo 7'de ülkelerin karşılıklı olarak TKE'leri, 1995 ve 2012 yılı için aynı tabloda sunulmuştur.

Tablo 7: Toplulaştırılmış Mal Ticareti Korelasyon Endeksleri

		2012						
		Brezilya	Rusya	Hindistan	Çin	G.AFR.	Meksika	Türkiye
1995	Brezilya	---	0,115	0,239	-0,164	0,268	0,059	0,047
	Rusya	0,121	---	-0,261	-0,312	0,306	-0,219	-0,220
	Hindistan	0,197	-0,248	---	0,306	-0,094	-0,029	0,293
	Çin	0,065	-0,163	0,399	---	-0,270	0,169	0,384
	G.Afrika	0,339	0,236	0,078	0,074	---	0,122	0,083
	Meksika	0,058	-0,028	0,114	0,242	0,178	---	0,323
	Türkiye	0,154	-0,268	0,450	0,469	0,226	0,327	---

Kaynak: UNCTAD (2015), <http://unctadstat.unctad.org/> dan derlenmiştir.

Tabloda, TKE'lerin birbirlerine yakın olmasına bağlı olarak, 1995 yılında Türkiye'nin ticaret (hem ihracat hem de ithalat) bakımından diğer ülkelerle belirgin bir şekilde rekabet halinde olduklarını söylemek güçtür. Ancak 2012 yılında Türkiye ile Meksika, Çin ve Hindistan arasında, değişen oranlarda, rekabetçi yapının arttığı görülmektedir. TKE'lerin pozitif ya da negatif olmasına göre 1995 yılında Türkiye'nin ihracatta, Rusya dışında diğer ülkeler ile rekabet halinde olduğu görülmektedir. En şiddetli rekabet ise Çin ile yaşanmaktadır. Aynı durum 2012 yılı için de geçerlidir. Bununla birlikte 1995 yılına kıyasla 2012 yılında Türkiye için özellikle Güney Afrika ve Brezilya başta olmak üzere diğer ülkeler ile rekabetçi baskılar azalmıştır. TKE, Türkiye ile Rusya'nın doğal ticari partnerler olduğuna da işaret etmektedir.

5. Sonuç

Bu çalışmada, dış ticarete rekabetçilik ve performans kapsamında, geleneksel ve yeni yaklaşımlarla, uluslararası ticarete önemli bir yere sahip olan yükselen sanayi ekonomilerinin ticaret gelişmeleri analiz edilmiştir. Hem 2014 yılı için hesaplanan büyüklükler ve karşılaştırmalı üstünlükler endeksleri hem de 2010-2014 dönemi değişim üzerinden hesaplanan endeksler ile elde edilen çok sayıda gösterge ile karşılaştırmalar yapılarak özetle şu sonuçlar elde edilmiştir:

i) Seçilen ülkelerin ticaret ve ihracat performansları farklı sektörler ve aynı sektörde farklı göstergeler bakımından değişmektedir. Bu heterojen yapı Rusya dışında diğer ülkelerin faktör donanımlarından bağımsızlaşan dinamik bir yapısal dönüşüm sürecine işaret etmektedir.

ii) Özellikle ulaşım/taşıma araçları sektörüne doğru yapısal bir gelişme görülmekle birlikte, Türkiye'de halen tekstil sektörünün ağırlığı dikkat çekmektedir. Buna göre Türkiye ulaşım/taşıma araçları sektöründe incelenen ülkelere Meksika ve G. Afrika ve tekstil sektöründe ise özellikle Çin ve Hindistan ile olmak üzere, yapısal dönüşümünde iki farklı rekabetçilikle karşı karşıya kalmaktadır. Buna göre Türkiye, bir yandan otomotive sektöründe rekabetçiliğini sağlamaya ve artırmaya çalışırken, diğer yandan tekstil ve türevleri sektöründe rekabetçi özelliğini korumak durumundadır.

iii) Türkiye'nin tekstil sektöründe de yüksek olan ithalatı dikkate alındığında, tekstil ithalatını yurtiçi mallara kaydırıcı politikalar yararlı görülmektedir. Bu durumda örneğin döviz kuru politikası bir seçenek olmakla birlikte, ithalattaki payı dikkate alındığında kısa dönemli etkisi olumsuz olabilecektir.

iv) Türkiye genel olarak Avrupa Birliği piyasasında yoğunlaşmasının ortaya çıkardığı risklerle karşılaşmaktadır. Bu nedenle Türkiye'nin özellikle Orta Doğu ve Kuzey Afrika ülkeleri ile Türk Cumhuriyetleri ve Rusya gibi piyasalara girmesi veya mevcut ticari faaliyetlerini artırması AB piyasasına yoğunlaşmasının ortaya çıkardığı riskleri azaltacaktır. Türkiye için genel olarak tüm sektörlerde, ihracat yapan firmaların, faaliyet gösterdikleri piyasalar hakkında, beklentileri de kapsayacak biçimde, daha fazla bilgi sahibi olmaları gerekmektedir.

v) İhracatında doğal kaynakların ağırlığı dikkat çeken Rusya ile Türkiye arasında ticari korelasyonun düşük olması, farklı sektörlerde uzmanlaşmış bu iki ülkeyi potansiyel ticaret ortağı yapmaktadır. Hem 1995 hem de 2012 yılı için geçerli olan bu durum, iki ülke arasındaki ticaret potansiyelinin, mevcut seviyesinin çok üzerinde olduğunu göstermektedir. Rusya ile yapılacak ticaret anlaşmaları gibi ticari işbirliğini artırmaya yönelik uygulamalar iki ülke arasındaki ticaret hacmini artıracaktır.

vi) Türkiye'nin Çin başta olmak üzere diğer ülkeler ile değişen oranlarda benzer sektörlerde uzmanlaştığı ve dolayısıyla rekabet halinde oldukları görülmektedir. Ayrıca tekstil ve hazır giyim sektörlerinde de Türkiye artık yine Çin başta olmak üzere çok sayıda ülke ile rekabet etmek durumundadır. Bu nedenle özellikle Meksika'nın yaptığı gibi ihracatında yapısal değişime gitmek zorunda olan Türkiye için, diğer sektörlerde olan etkileri ve Avrupa Birliği ile olan ticaret yapılarına uygun olarak ulaşım araçları (özellikle otomotiv) sektörlerinde yeni sanayileşme hamlesi gerçekleştirmek durumundadır. Bu hamle, montaj aşamalarının ötesinde üretim faaliyetlerine de başlamak ile mümkün olabilecektir. Bunun için ilgili sektörlerde dolaylı ya da doğrudan teşviklerin uygulanması gerekliliği bir kez daha kendini göstermektedir.

Bundan sonraki çalışmalarda ülke ve sektör sayısının artırılması ve alt sektörlerde ayrıştırmaya gidilmesi ile üretim ve ticaret hacminin yanında katma-değerlerin de dikkate alınması sonuçların daha net ortaya konulmasını sağlayacaktır.

Kaynaklar

Balassa, B. (1965), Trade Liberalisation and 'Revealed' Comparative Advantage. *The Manchester School of Economics and Social Studies*, 33, 99-123.

Balassa, B. (1986), Comparative Advantage in Manufactured Goods: A Reappraisal. *The Review of Economics and Statistics*, 68(2), 315-319.

- Bhattacharyya, R. (2011), Revealed Comparative Advantage and Competitiveness: A Case Study for India in Horticultural Products. *International Conference On Applied Economics – ICOAE 2011*. <http://kastoria.teikoz.gr/icoae2/wordpress/wp-content/uploads/2011/10/003.pdf>
- Cooper, J. (2006), Of BRICs and Brains: Comparing Russia with China, India, and Other Populous Emerging Economies. *Eurasian Geography and Economics*, 47(3), 255-284.
- Daniels, J. D. (1991), The Elusive Concept of National Competitiveness. *Business Horizons*, 34(6), 3-6.
- Davies, H. & P. Ellis (2000), Porter's Competitive Advantage of Nations: Time for the Final Judgement?. *Journal of Management Studies*, 37(8), 1189-1213.
- EIA-US Energy Information Administration (2015), <http://www.eia.gov>
- Eichengreen, R. B. & H. Tong (2007), China and the Exports of Other Asian Countries. *Review of World Economics*, 143(2), 201-226.
- Hausmann, R. & B. Klinger (2006), Structural Transformation and Patterns of Comparative Advantage in the Product Space. *Harvard University, John F. Kennedy School of Government Working Paper Series, RWP06*, <http://www.hks.harvard.edu/content/download/69156/1249434/version/1/file/128.pdf>
- IMF (2011), Changing Patterns of Global Trade. <http://www.imf.org/external/np/pp/eng/2011/061511.pdf>
- IBRC (2013), U.S. and Indiana Trade Patterns with the BRICS Countries and Other (Often Overlooked) Emerging Markets. <http://www.ibrc.indiana.edu/studies/BRICS2013.pdf>
- ITC (2014), <http://legacy.intracen.org/appli/TradeCom/Documents/TradeCompMap-Trade%20Performance%20Index-Technical%20Notes-EN.pdf>
- ITC (2015), Trade Competitiveness Map. <http://legacy.intracen.org>.
- İTKİP (2014), Tekstil Sektörü İhracat Performans Değerlendirmesi: 2014 Ocak-Mart, İstanbul, İTKİP Genel Sekreterliği, <http://www.itkib.org.tr/>.
- Krugman, P. R. (1994), Competitiveness: A Dangerous Obsession. *Foreign Affairs*, 73(2), 28-44.
- Lall, S. & M. Albaladejo (2004), China's Competitive Performance: A Threat to East Asian Manufactured Exports? *World Development*, 32(9), 1441-1466.

- Rodrik, D. (2007), Industrial Development: Some Stylized Facts and Policy Directions. UN-DESA, Industrial Development for the 21st Century: Sustainable Development Perspectives. New York: UN, 7-28.
- Seymen, D. & N. Şimşek (2006), Türkiye ile Çin'in OECD Pazarında Rekabet Gücü Karşılaştırması. *İktisat İşletme ve Finans*, 21(244), 38-50.
- Smit, A. J. (2010), The Competitive Advantage of Nations: Is Porter's Diamond Framework a New Theory that Explains the International Competitiveness of Countries? *Southern African Business Review*, 14(1), 105-130.
- Soyak, A. (2005), Avrupa Birliği Sürecinde Türkiye Sanayi Politikası Üzerine Eleştirel Bir Yaklaşım. *TMMOB Ölçü Dergisi, Bilim ve Teknoloji Özel Sayısı*, 61-69.
- Togan, S. (2012), The EU-Turkey Customs Union: A Model for Future Euro-Med Integration. *MEDPRO Technical Reports*, 9. <http://www.medproforesight.eu/system/files/MEDPRO%20TR%20No%209%20WP5%20Togan.pdf>
- UN (2015), <http://unstats.un.org/unsd/cr/registry/regcst.asp?Cl=14>
- UN-COMTRADE (2015), <http://comtrade.un.org/db/>
- UNCTAD (2015), UNCTADStat. <http://unctadstat.unctad.org/>
- UNIDO (2013), Country Grouping in UNIDO Statistics. https://www.unido.org/fileadmin/user_media/Services/PSD/Country_Grouping_in_UNIDO_Statistics_2013.pdf
- Venables, T. & L. Yueh (2006), The China Effect. <http://cep.lse.ac.uk/pubs/download/CP208.pdf>
- Wood, A. & J. Mayer (2010), Has China De-Industrialised other Developing Countries? QEH Working Paper Series, 175. <http://www3.qeh.ox.ac.uk/pdf/qehwp/qehwps175.pdf>
- WTO (2014), Connecting to Global Markets. Challenges and Opportunities: Case Studies Presented by WTO Chair-Holders, (Ed. M. Jansen, M. Sadni, J. M. Smeets), Geneva: WTO Publications. https://www.wto.org/english/res_e/publications_e/connecting_markets_e.htm
- Yıldırım, E. & C. Dura (2007), Gümrük Birliği'nin Türkiye Ekonomisi Üzerindeki Etkileri Konusundaki Literatüre Bir Bakış. *Erciyes Üniv. İ.İ.B.F. Dergisi*, 28, 141-177.

Cari İşlemler Açığının Sürdürülebilirliğinin Çoklu Yapısal Kırılmalı Eşbütünleşme Yöntemi ile Sınanması

Testing the Sustainability of Current Account Deficits for Turkish Economy: Cointegration Analysis with Multiple Structural Breaks

Almıla Burgaç ÇİL¹

ÖZET

Bu çalışmanın amacı, Türkiye ekonomisi için cari işlemler açığının sürdürülebilirliğini 1984:Q1-2015:Q2 dönemini kapsayan veri seti ile çoklu yapısal kırılmaları dikkate alan Maki (2012) eşbütünleşme testi kullanılarak sınamaktır. Analizde kullanılan veri seti ve ekonometrik yöntemler, Türkiye ekonomisinde cari işlemler açığının sürdürülebilirliğinin zayıf formunun geçerli olduğuna yönelik sonuçlar ortaya koymaktadır.

Anahtar Kelimeler: Cari işlemler açığı sürdürülebilirlik, çoklu yapısal kırılma, eşbütünleşme

ABSTRACT

The main aim of this study is to test whether current account deficits are sustainable during 1984:Q1-2015:Q2 using the cointegration test with multiple structural break proposed by Maki (2012). Given the data set and econometric methods results indicate that the current account deficits are weak form sustainability in Turkish economy.

Keywords: Current account sustainability, multiple structural break, cointegration

¹ Araş.Gör., Çukurova Üniversitesi, İ.İ.B.F. İktisat Bölümü, aburgac@cu.edu.tr

1. Giriş

1990'lı yıllarda gelişmekte olan ülkelerde yaşanan krizler cari işlemler açığının sürdürülebilirliği ve açıkların finansmanını iktisatçılar ve politika yapıcılar için önemli bir makroekonomik gösterge olarak değerlendirilmesine yol açmıştır. Türkiye ekonomisi bağlamında 1990, 2000 ve 2010'lu yıllarda cari işlemler açığında oldukça büyük artışlar gerçekleşmiş olup cari işlemler açığının sürdürülebilirliği tartışmaları önem kazanmıştır. Cari işlemler açığının sürdürülebilirliği dışa açıklık, uluslararası rekabet düzeyi, yurtiçi tasarruf düzeyi, dış yükümlülüklerin yapısı, finansal sistemin gücü ve politik istikrarın düzeyi gibi birçok faktör tarafından etkilenmektedir (Milessi-Feretti ve Razin, 1996). Tasarruf ve yatırım düzeyi cari işlemler açığının sürdürülebilirliği açısından oldukça önemlidir. Yatırımlar eğer ticarete konu olan sektörlerde artış gösteriyorsa açığın sürdürülmesine olumlu katkı sağlayacağı açıktır (Roubini ve Wachtel, 1998, s. 8). Diğer taraftan, cari işlemler açığının finansman niteliği açığın sürdürülebilirliği üzerinde önemli bir etkiye sahiptir. Cari işlemler açığının uzun vadeli sermaye akımları ve dolaysız yabancı yatırımlarla finanse ediliyorsa sürdürülebilirliğini artırırken, kısa vadeli sermaye akımları ile finanse ediliyorsa cari işlemler açığının sürdürülebilirliği güçleşmektedir (Milessi-Feretti ve Razin, 1996).

Bu bağlamda, Türkiye ekonomisi için cari işlemler açığının sürdürülebilirliği Husted (1992) tarafından geliştirilen zamanlararası bütçe kısıtını temel alan model kullanılarak test edilmiştir. Genellikle Türkiye için yapılmış çalışmalarda cari işlemler açığının sürdürülebilirliği geleneksel eşbütünleşme yöntemleriyle sınımlanmaktadır. Ancak son dönemde literatürde yapısal kırılmaların varlığında standart eşbütünleşme testlerinin gücünün düşük olduğu belirtilmekte ve uygulamalı çalışmalarda yapısal dönüşümlerinde etkisini dikkate alan yöntemler kullanılmaktadır. Bu çalışmanın katkısı ise daha uzun bir dönem aralığı için cari işlemler açığının sürdürülebilirliğini çoklu kırılmaları dikkate alarak sınımlanmış olmasıdır. Çalışmanın amacı cari işlemler açığının sürdürülebilirliğini 1984:Q1-2015:Q2 dönemi için geleneksel eşbütünleşme ve çoklu yapısal kırılmaları dikkate alan Maki (2012) eşbütünleşme testi ile sınımlanmaktadır. Sonuçlar ise cari işlemler açığının güçlü sürdürülebilir olduğuna yönelik yeterli kanıtlar ortaya koymamaktadır.

Çalışmanın ikinci bölümünde cari işlemler açığının sürdürülebilirliğini test etmek için temel alınan Husted (1992) modeli açıklanmış, üçüncü bölümde Türkiye ekonomisi için cari işlemler açığının sürdürülebilirliği ile ilgili ampirik literatür özetlenmiştir. Dördüncü bölümde ise veri seti ve ekonometrik yöntem açıklanmış, beşinci bölümde uygulanan yöntemlere ilişkin sonuçlar ortaya konmuştur. Çalışma bulguların tartışıldığı sonuç bölümüyle sonlandırılmıştır.

2. Teorik Model

Cari işlemler açığının sürdürülebilirliğinin zamanlararası bütçe kısıtını temel alan (Hakkio ve Rush, 1991) yaklaşımın geliştirilmesi ile oluşturulmuş Husted (1992) teorik modeli kullanılmıştır. Modelde, temsili bireyin veri faiz oranıyla bütçe kısıtı altında yaşam boyu faydasını maksimize edildiği varsayılmıştır. Cari dönemde temsili bireyin bütçe kısıtı aşağıdaki gibi gösterilebilir

$$C_0 = Y_0 + B_0 - I_0 - (1+i_0)B_{t-1} \quad (1)$$

C_0 cari dönemdeki tüketimi, Y_0 çıktıyı, I_0 yatırımı, i_0 faiz oranını, B_0 dış borçlanmayı ve $(1+i_0)B_{t-1}$ ise ülkenin dış borcuna karşılık gelen temsili bireyin borcunu gösterir. Her zaman periyodunda 1. denklemin eşit olması gerektiği için her dönemdeki bütçe kısıtı ekonominin zamanlararası bütçe kısıtı formu için toplanıp aşağıdaki denklige ulaşılabilir.

$$B_0 = \sum \mu + TA_t + \lim_{n \rightarrow \infty} \mu_n B_n \quad (2)$$

Burada $TA_t = X_t - M_t (= Y_t - C_t - I_t)$ t döneminde ticaret dengesini gösterirken X ihracatı M ise ithalatı gösterir ve $\lambda_0 = 1/(1+r_0)$ ve μ_t ise iskonto faktörünü ifade eder. İkinci denklemin son terimi sıfıra eşit olduğunda uluslararası piyasada ülkenin borcu (alacağı) gelecek ticaret fazlasının (açığının) bugünkü değerine eşittir. Ampirik olarak test edebilmek için 1. denklemden dünya faiz oranının durağan olduğu varsayımında yeniden aşağıdaki gibi yazılabilir:

$$Z_t + (1+r)B_t - 1 = X_t + B_t \quad (3)$$

Burada $Z_t = M_t + (r_t - r)B_{t-1}$ olarak ifade edilebilir.

$$M_t + r_t B_t - 1 = X_t + \sum_{j=0}^{\infty} \lambda^{j-1} [\Delta X_{t+j} - \Delta Z_{t+j}] + \lim_{j \rightarrow \infty} \lambda^{t+j} B_{t+j} \quad (4)$$

4. denklem X ve Z 'nin durağan olmadığı varsayımı ile yeniden düzenlendiğinde aşağıdaki gibi yazılabilir

$$X_t = \alpha + MM_t - \lim_{j \rightarrow \infty} \lambda^{t+j} B_{t+j} + \varepsilon_t \quad (5)$$

Burada $MM_t = M_t + r_t B_{t-1}$ olarak gösterilir ve 5. denklemden limitli terim sıfıra eşit varsayıldığında standart regresyon denklemi elde edilir.

$$X_t = \alpha + \beta MM_t + e_t \quad (6)$$

X mal ve hizmet ihracatını gösterirken, MM ise mal ve hizmet ithalatı ile net faiz ödemelerini ve transfer ödemelerini kapsar. Ekonominin zamanlararası bütçe kısıtının sağlanmasındaki yeter koşul (zayıf form) ithalat ve ihracat arasında uzun dönemli ilişkinin varlığıdır. Cari işlemler açığının sürdürülebilir olmasındaki gerek ve yeter koşul (güçlü form) ise $\beta = 1$ eşitliğinin sağlanması ile oluşur.

3. Literatür Özeti

Cari işlemler açığının sürdürülebilirliğine ilişkin Türkiye'de yapılmış birçok çalışma bulunmaktadır ve sonuçlar genel olarak cari işlemler açığının sürdürülebilirliğinin zayıf olduğu yönündedir. Dülger ve Özdemir (2004) 1984:Q1-2000:Q4 döneminde altı gelişmekte olan (Meksika, Filipin, Güney Kore, Güney Afrika, İsrail ve Türkiye) ülkeler için cari işlemler açığının sürdürülebilirliğini Johansen, Gregory-Hansen eşbütünleşme yöntemleri ve kesirli bütünleşme ve eşbütünleşme tekniklerini kullanarak cari işlemler açığının sürdürülebilir olup olmadığını test etmişlerdir. Türkiye için cari işlemler açığının sürdürülemez olduğu sonucuna ulaşmışlardır. Diğer taraftan, Yamak ve Korkmaz (2007) çok kısa bir zaman dönemi için (2000:01-2005:09) Peseran ve diğ. (2001) sınır testi yaklaşımını kullanarak Türkiye'de cari işlemler açığının sürdürülebilirliğinin zayıf formda olduğu belirtilmektedir.

Peker (2009) cari işlemler açığının sürdürülebilirliğini 1992:01-2007:12 dönemi aylık veriler kullanılarak Johansen eşbütünleşme testiyle sınımıştır. Türkiye'de cari işlemler açığının düşük düzeyde sürdürülebilir olduğu sonucuna ulaşırken Berke (2009) 1989:Q1-2006:Q2 döneminde geleneksel ve parçalı eşbütünleşme yöntemini kullanarak cari işlemler açıklarının sürdürülebilir olduğuna ulaşmıştır.

Ümit (2011) 1992:Q1-2010:Q2 dönemine ait üçer aylık veriler kullanılarak 1994-2001 krizlerinin neden olduğu yapısal değişimi dikkate alarak cari işlemler açığının sürdürülebilirliğini Johansen eşbütünleşme yöntemiyle incelemişlerdir. İhracat ve ithalat arasında uzun dönemli ilişkinin varlığına ulaşmalarına karşın cari işlemler açığının sürdürülebilirliğinin Türkiye için zayıf formda olduğunu göstermişlerdir. Aynı dönem (1992:Q1-2011:Q3) ve farklı yöntemlerle (Engle-Granger (1987), Peseran ve diğ. (2001) Açıkgoz ve Akçağlayan (2014) Türkiye'de cari işlemler açığının sürdürülebilirliğini sınımıştır. Çalışmanın sonucuna göre ihracat ve ithalat arasında

uzun dönemli bir ilişki olduğuna ilişkin kanıtlara ulaşılrken sürdürülebilirliğini zayıf formda olduğu bulunmuştur.

Polat (2011) 2000:01-2010:06 döneminde ARDL eşbütünleşme yöntemi ile cari işlemler açığının sürdürülebilirliğini Türkiye için sınıamışlardır. Uzun dönemli ilişkinin varlığına ulaşmalarına rağmen cari işlemler açığının sürdürülebilirliğin güçlü formunu destekleyici kanıtı ulaşamamışlardır.

Hakkio ve Rush (1991) ve Husted (1992) modelini takip eden Binatlı ve Sohrabji (2012)'de, Türkiye için cari işlemler açığının sürdürülebilir olup olmadığını 1997:Q1-2009:Q4 dönemi için Johansen ve Gregory-Hansen (1996) eşbütünleşme testiyle incelemişlerdir. Yapısal kırılma olmadan ve yapısal kırılmayla beraber ithalat ve ihracat arasındaki uzun dönemli ilişkinin olduğuna ilişkin kanıtlara ulaşılmıştır. Bu sonuca rağmen, ihracat ve ithalat arasındaki uzun dönemli ilişki cari işlemler açığının sürdürülemeyeceğini ve Türkiye'nin krizlere maruz kalacağını belirtmiştir. Murat ve diğ. (2014) Türkiye Ekonomisi için cari işlemler açığının sürdürülebilirliğini yapısal kırılma altında eşbütünleşme ilişkisini inceleyen Gregory-Hansen (1996) eşbütünleşme yöntemini kullanmışlardır. Sonuçlara göre sürdürülebilirliğin zayıf formda olduğu bulunmuştur.

Göçer ve diğ. (2012) 1976-2011 döneminde OECD ülkeleri için yatay kesit bağımlılığı ve yapısal kırılmaları göz önüne alan veri teknikleriyle cari işlemler açığının sürdürülebilirliğini incelemişlerdir. Türkiye için elde edilen sonuca göre cari işlemler açığının zayıf sürdürülebilir olduğu ortaya konmuştur.

1992:01-2010:12 dönemi için cari işlemler açığının sürdürülebilirliği Ekinci ve Kahyaoğlu (2015) tarafından doğrusal olmayan zaman serileri yaklaşımı kullanılarak incelenmişti ve cari işlemler açığının zayıf sürdürülebilirliğinin zayıf formda olduğu bulunmuştur.

4. Veri Seti ve Ekonometrik Yöntem

Çalışmada açıklanan teorik model çerçevesinde, Türkiye ekonomisi için cari işlemler açığının sürdürülebilirliği incelenmektedir. Tahmin edilen ekonometrik model aşağıdaki şekilde tanımlanmaktadır.

$$X_t = \alpha + \beta MM_t + \varepsilon_t \quad (7)$$

Modeldeki değişkenlerden X (ihracat) mal ve hizmet ihracatının MM (ithalat) ise mal ve hizmet ithalatı ile net faiz ve transfer ödemelerinin gayri safi yurtiçi hasılasıya (GSYİH) oranını ifade etmektedir. 1984:Q1-2015:Q2 dönemine ait ithalat ve ihracat verileri IFS'den alınmıştır. GSYİH serisi ise 1984:Q1-2007:Q1 arası Devlet Planlama Teşkilatı diğer dönemler ise Türkiye İstatistik Kurumundan elde edilmiştir.

Seriler mevsimsellikten arındırılmıştır. Zaman serileri analizlerine uygun olarak ilk aşamada serilerin durağanlığını sınamak için Ng-Perron (2001) birim kök testi kullanılmaktadır. Değişkenler arasındaki uzun dönemli ilişki ise Shin (1994) eşbütünleşme yöntemi ve çoklu yapısal kırılmaları dikkate alan ve içsel olarak belirleyen Maki (2012) eşbütünleşme yöntemi kullanılarak incelenmiştir.

Gregory-Hansen (G-H) (1996a, b) yapısal kırılmanın varlığında standart (geleneksel) eşbütünleşme testlerinin değişkenler arasında uzun dönemli ilişkinin araştırılmasında yetersiz kalacağını belirtip, yapısal kırılma altında uzun dönemli ilişkiyi belirlemek için dört model geliştirmiştir. G-H tek yapısal kırılmayı göz önüne alırken Hatemi-J (2008) iki kırılma için eşbütünleşme testini geliştirmiştir. Ancak Maki (2012) ikiden fazla kırılma olduğunda G-H ve Hatemi-J testlerinin gücünün düşük olacağını belirtmiştir. Kırılma noktalarının içsel olarak belirlendiği maksimum beş kırılma altında uzun dönemli ilişkiyi inceleyen dört model test etmiştir. Maki (2012) tarafından test edilen dört model aşağıdaki gibidir:

Düzeyde Kırılma (C)

$$y_t = \mu + \sum_{i=1}^k \mu_i D_{it} + \beta' x_t + \varepsilon_t, \quad (8)$$

Kırılmadan önce sabit terim μ , kırılmaların sabit terimde yaptığı değişim ise μ_i ile gösterilmektedir. β' ise bağımsız değişkenlerin katsayılarını ifade etmektedir.

Trendli düzeyde kırılma (C/T)

$$y_t = \mu + \sum_{i=1}^k \mu_i D_{it} + \gamma t + \beta' x_t + \varepsilon_t, \quad (9)$$

Bu model sabit ve eğimde kırılma modelinden farklı olarak trendin varlığında sabit terimde kırılmaya izin verilmiştir. γ trendin katsayısını göstermektedir.

Rejim Değişikliği (C/S)

$$y_t = \mu + \sum_{i=1}^k \mu_i D_{it} + \beta' x_t + \sum_{i=1}^k \beta'_i x_t D_{it} + \varepsilon_t, \quad (10)$$

Rejim değişikliğinin olduğu modelde μ ve μ_i düzeyde kırılma modeli ile aynıdır. β' rejim değişikliğinden önceki eğim katsayılarını ve β'_i ise kırılma dönemlerinden sonraki eğim katsayılarındaki değişimi göstermektedir. Kırılma dönemlerinin belirlenmesiyle parametrelerde ne yönde bir değişim olduğu bu model ile ortaya konulmaktadır.

Trendde Kırılma ve Rejim Değişikliği (C/T/S)

$$y_t = \mu + \sum_{i=1}^k \mu_i D_{it} + \gamma t + \sum_{i=1}^k \gamma'_i t D_{it} + \beta' x_t + \sum_{i=1}^k \beta'_i x_t D_{it} + \varepsilon_t, \quad (11)$$

Sabit terim, kırılmalar öncesindeki eğim katsayıları ve trend katsayısı sırasıyla μ , β' , γ ile ifade edilmektedir. μ_i , γ' ve β'_i ise kırılmadan sonraki ilgili değişimleri göstermektedir.

Maki (2012) eşbütünleşme testinde boş hipotez uzun dönemli ilişkinin olmadığını belirtirken alternatif hipotez ise yapısal kırılma altında uzun dönemli ilişkinin var olduğunu belirtir. Örneklemin başından ve sonundan belirli bir yüzde (örnek olarak %15) atılarak her bir dönem için tahmin edilen muhtemel kırılma tarihlerinin t istatistikleri hesaplanıp değerlerin minimum olduğu nokta birinci kırılma noktası olarak belirlenir. İkinci kırılma dönemi belirlenirken ilk kırılma dönemi modele dahil edilerek bütün olası dönemler için hesaplanan t istatistiklerinden en küçük olanı alınır ve ikinci kırılma dönemi belirlenir. Kaç kırılmaya kadar izin verildiyse bu süreç tekrarlanır. Kritik değerler 1000 adım ve 10000 tekrar kullanılarak Monte Carlo simülasyonu ile hesaplanmıştır. Değerler maksimum beş kırılma sayısına kadar ve dört regressör değişken için Maki (2012)'de Tablo 1'de verilmiştir.

5. Analiz Sonuçları

Öncelikle Türkiye ekonomisi için ilgili dönemde sürdürülebilirliğinin sınanmasında X ve MM serilerinin durağanlık testi yapılarak seriler arasındaki uzun dönemli ilişki farklı modeller ile sınanmıştır. Sürdürülebilirliğin zayıf ya da güçlü formda olup olmadığına karar verebilmek açısından eşbütünleşmede tahmin edilen modellerin β katsayıları Wald testi kullanılarak sınanmıştır.

5.1 Birim Kök Analiz Sonuçları

Farklı eşbütünleşme yöntemleri test edilmeden önce analizlerde kullanılan serilerin durağan olup olmadıklarını saptamak için uygulanan *Ng-Perron (2001)* birim kök testlerinin sonuçları *Tablo 1*'de verilmektedir. Test sonucuna göre ihracat ve ithalat serisinin birim kök içerdiği sonucuna ulaşılmaktadır.

Tablo 1. Ng-Perron (2001) Birim Kök Testleri

	k	Sabit			
		MZ_{α}	MZ_t	MSB	MP_t
X	0	-3.20	-1.02	0.32	7.40
MM	0	0.11	0.06	0.57	23.55
Kritik Değerler ^a	1%	-13.80	-2.58	0.17	1.78
	5%	-8.10	-1.98	0.23	3.17
	10%	-5.70	-1.62	0.27	4.45
Sabit ve trend					
X	0	-19.30	-3.10	0.16	4.74
MM	0	-9.22	-2.14	0.23	9.88
Kritik Değerler ^a	1%	-23.80	-3.42	0.14	4.03
	5%	-17.30	-2.91	0.16	5.48
	10%	-14.20	-2.62	0.18	6.67

^aKritik değerler Ng ve Perron (2001) Tablo 1'den alınmıştır

5.2. Shin (1994) ve Maki (2012) Eşbütünleşme Testlerinin Sonuçları

5.2.1. Shin (1994) Eşbütünleşme Testinin Sonuçları

Shin (1994) eşbütünleşme yöntemiyle (7) nolu eşitlik tahmin edilmiş ve sonuçlar *Tablo 2*'de verilmiştir. Eşbütünleşme sonucuna göre değişkenler arasında uzun dönemli ilişkinin olduğunu ifade eden boş hipotez %5 önem düzeyine göre reddedilmiştir. Dolayısıyla bu sonuçlar, yapısal kırılmalar dikkate alınmadığında ilgili dönem için cari işlemler açığının sürdürülemez olduğunu göstermektedir.

Tablo 2. Shin (1994) Eşbütünleşme Testi Sonuçları

		Test İstatistiği	Test İstatistiği
		0.621	0.195
Kritik Değer	** %1	0.533	0.184
	* %5	0.314	0.121
	# %10	0.231	0.097

5.2.2. Maki (2012) Eşbütünleşme Testinin Sonuçları

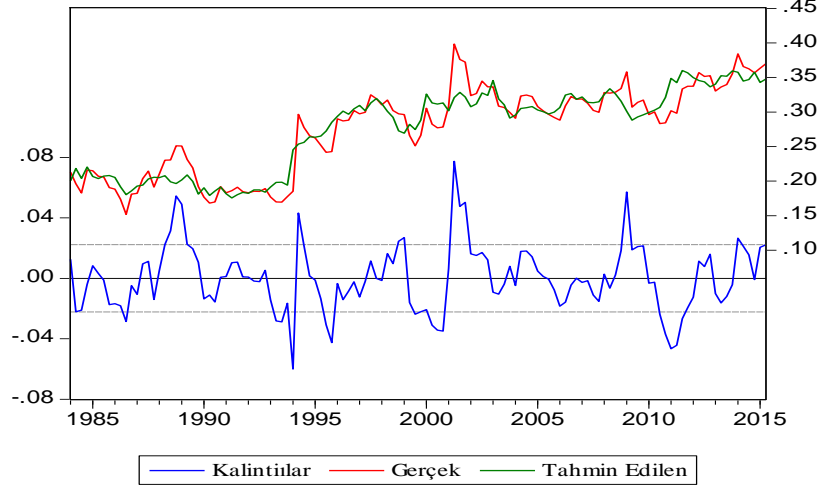
Yapısal kırılmanın olmadığı standart eşbütünleşme testinde uzun dönemli ilişkinin varlığına ilişkin kanıtlara ulaşılamamıştır. İlgili dönemde Türkiye ekonomisinde gözlenen birden fazla yapısal değişikliklerin varlığı sonuçların iktisadi anlamlılığını azaltmaktadır. Bu bağlamda, yapısal kırılmayı dikkate alarak uzun dönemli ilişkinin varlığını sınavan Maki (2012) testinin sonuçları *Tablo 3*'te sunulmaktadır. Maki testinin sonuçlarına göre Türkiye ekonomisi için cari işlemler açığının sürdürülebilirliğinin test edildiği düzeyde kırılma, trendli düzeyde kırılma, rejim değişikliği ve rejim değişikliği ve trendde kırılma modellerinde %5 anlamlılık düzeyinde eşbütünleşme ilişkisinin olmadığı yokluk hipotezi reddedilmiştir. Buna göre, Maki eşbütünleşme testinde belirlenen kırılma tarihleri düzeyde kırılma modeli için 1989:Q1,1994:Q1, 2003:Q4, trendli düzeyde kırılma modelinde 1988:Q4, 1994:Q1, 2002:Q4, 2009:Q1, rejim değişikliği modelinde 1994:Q1,1998:Q4, 2003:Q4 ve son olarak trendde kırılma ve rejim değişikliği modelinde ise 1994:Q1, 2001:Q1 olarak belirlenmiştir. İçsel olarak belirlenen kırılma dönemleri Türkiye ekonomisinde gözlenen gelişmelere bakıldığında anlamlıdır. 1980 sonrasında finansal liberalizasyon, 1994 ve 2001 yıllarında yaşanan finansal krizler, 2002 yılında Güçlü Ekonomiye Geçiş Programının uygulanması, 2003 yılından bu yana cari işlemler açığında artışların meydana gelmesi, 2008 dünya krizinin Türkiye'ye yansımaları açısından bakıldığında, bu dönemlerin model tarafından içsel olarak belirlenmesi Türkiye ekonomisi açısından oldukça anlamlıdır.

Tablo 3: Maki (2012) Eşbütünleşme Testi Sonuçları

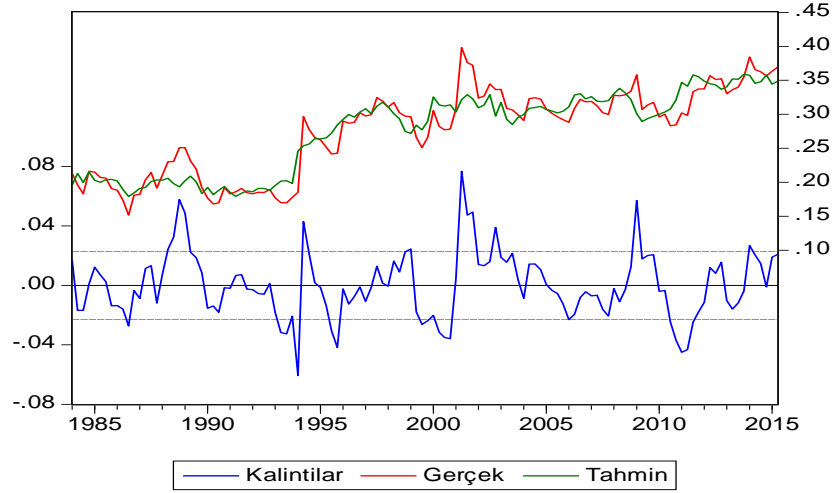
	Test İstatistiği	Kırılma Dönemleri			
		1989:Q1	1994:Q1	2003:Q4	-
Düzeyde Kırılma	-5.43*	1	1	4	-
** %1	-5.56				
* %5	-5.08				
# %10	-4.78				
Trendli Düzeyde Kırılma	-5.62*	1988:Q4	1994:Q1	2002:Q4	2009:Q1
** %1	-5.83	4	1	4	1
* %5	-5.37				
# %10	-5.10				
Rejim Değişikliği	-5.73*	1994:Q1	1998:Q4	2003:Q4	-
** %1	-6.25	1	4	4	-
* %5	-5.70				
# %10	-5.40				
Rejim Değişikliği ve Trendde Kırılma	-6.45*	1994:Q1	2001:Q1	-	-
-6.25	-6.62	1	1		
-5.70	-6.10				
-5.40	-5.84				

Maki (2012) eşbütünleşme sınamasında dar modelden (C) en geniş modele kadar (C/T/S) uzun dönemli ilişkinin incelenmesinde içsel olarak belirlenen kırılma tarihleri göz önüne alınarak değişkenlerin katsayıları tahmin edilmiştir. Tahmin sonuçları *Tablo 4*'te yer almaktadır. Düzeyde kırılma modelinde üç kırılmanın varlığında tahmin edilen ithalatın katsayısı 0.60'tır. Trendli düzeyde kırılma modelinde ise trend istatistiksel olarak anlamsızken ithalatın katsayısı 0.57 ve anlamlıdır. Rejim değişikliği modelinde tahmin sonucuna göre ithalatın katsayısı rejim değişikliklerine göre sırasıyla birinci rejimde 0.68, ikinci rejimde 0.54 ve üçüncü rejimde 0.40 olarak tahmin edilmiştir. Tahmin edilen modellere ilişkin grafikler ise aşağıda *Şekil 1, 2, 3* ve *4*'de gösterilmektedir. İthalat ve ihracat arasında uzun dönemli ilişkinin varlığı cari işlemler açığının sürdürülebilirliği için gerek koşul ancak yeter koşul değildir. Cari işlemler açığının güçlü formda sürdürülmesi için eşbütünleşmenin varlığında aynı zamanda β katsayısının 1'e eşit olması gerekmektedir. Her bir model ve her bir dönem için ithalatın katsayısının 1'e eşit olup olmadığı Wald testiyle sınanmıştır. Düzeyde kırılma ve trend varken düzeyde kırılma modelinde β katsayısının bire eşit olmadığı ancak, rejim değişikliği ve trendde kırılma ve rejim değişikliği modellerinde ilk rejim (1984:Q1-1994:Q1) için β katsayısının bire eşitliği kabul edilirken diğer dönemlerde bire eşit olmadığı sonucuna ulaşılmıştır. Cari işlemler açığının sürdürülebilirliği için her bir modelde (rejim değişikliği ve trendde kırılma ve rejim değişikliği modellerinin ilk dönemleri hariç) gerek ve yeter şartın sağlanmadığı, yani zayıf sürdürülebilir olduğu ifade edilebilir.

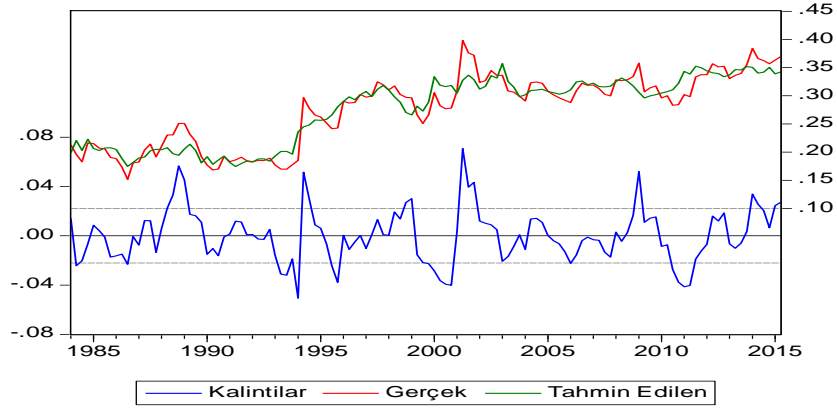
Tablo 4. Maki (2012) Eşbütünleşme Tahmin Sonuçları													
$(X) = f(MM)$													
	c_1	c_2	c_3	c_4	c_5	δ_1	δ_2	δ_3	δ_4	β_{11}	β_{12}	β_{13}	β_{14}
Düzeyde Kırılma													
Kırılma Tarihleri: (1989:Q1, 1994:Q1, 2003:Q4)													
	0.07 (5.16)	0.06 (5.16)	0.11 (5.88)	0.08 (3.34)	-	-	-	-	-	0.60 (9.90)	-	-	-
	Wald Testi									(0.00)			
Trendli Düzeyde Kırılma													
Kırılma Tarihleri: (1988:Q4, 1994:Q1, 2002:Q4, 2009:Q1)													
	0.07 (4.27)	0.07 (5.02)	0.11 (5.38)	0.08 (3.13)	0.08 (2.43)	0.00 (0.51)	-	-	-	0.56 (6.48)	-	-	-
	Wald Testi									(0.00)			
Rejim Değişikliği													
Kırılma Tarihleri: (1994:Q1, 1998:Q4, 2003:Q4)													
	0.04 (1.02)	0.08 (2.20)	0.07 (1.65)	0.13 (3.81)	-	-	-	-	-	0.72 (3.41)	0.67 (4.91)	0.72 (4.90)	0.47 (5.37)
	Wald Testi									(0.20)	(0.02)	(0.00)	(0.00)
Trendde Kırılma ve Rejim Değişikliği													
Kırılma Tarihleri: (1994:Q1, 2001:Q1)													
	0.05 (1.01)	0.13 (3.74)	0.21 (6.64)	-	-	-0.00 (-0.37)	-0.00 (-0.38)	-0.00 (-1.25)	-	0.68 (2.66)	0.54 (3.49)	0.40 (2.93)	-
	Wald Testi									(0.21)	(0.00)	(0.00)	
β_{ij} , $i=1,2,\dots$ değişken; $j: 1,2,\dots$ rejim. Kırılma tarihleri ve t değerleri parantez içinde yer almaktadır. Wald testinde test edilen hipotez: $H_0: \beta=1$. Sonuçlara ait olasılık değerleri parantez içinde verilmektedir.													



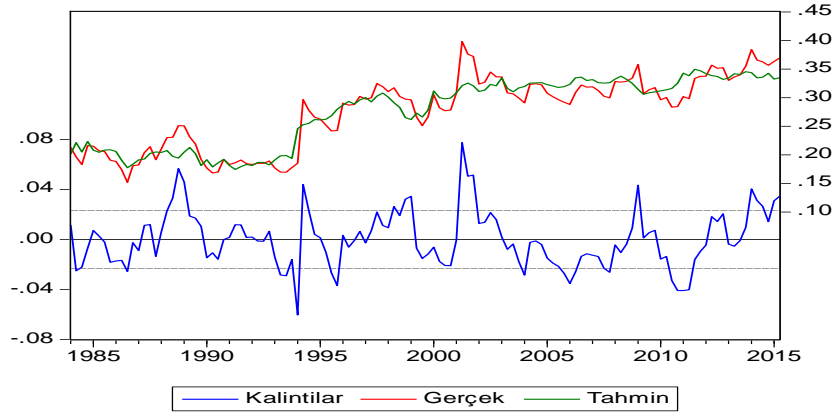
Şekil 1. Düzeyde Kırılma Tahmin Grafiği



Şekil 2. Trendli Düzeyde Kırılma Tahmin Grafiği



Şekil 3. Rejim Değişikliği Tahmin Grafiği



Şekil 4. Trendde Kırılma ve Rejim Değişikliği Tahmin Grafiği

6. Sonuç

Bu çalışmada, zaman serisi metotları kullanılarak, Türkiye ekonomisi için cari işlemler açığının sürdürülebilirliği 1984:Q1-2015:Q2 dönemini kapsayan veri seti ile incelenmiştir. Çalışmada öncelikle analize konu serilerin durağanlıkları birim kök testiyle sınanmıştır. Sonuçlar serilerin birim kök içerdiğini göstermiştir. Bu bulgular ışığında seriler arasında eşbütünleşme ilişkisinin olup olmadığı ilk olarak geleneksel Shin (1994) eşbütünleşme yöntemine göre sınanmış, ancak ilişkinin varlığına yönelik

sonuca ulaşamamıştır. Daha sonra ise Türkiye ekonomisinde birden fazla yapısal kırılmaların olduğu göz önüne alınarak uzun dönemli ilişkinin araştırılmasında çoklu yapısal kırılmaları dikkate alan Maki (2012) test sonuçları ise değişkenler arasında uzun dönem denge ilişkisinin varlığını göstermiştir. İçsel olarak belirlenen yapısal kırılma tarihleri modellerde 1989, 1994, 2001, 2002 ve 2003 dönemini vermektedir. Finansal liberalizasyonun ortaya çıktığı 1990'ların ilk çeyreğinde spekülasyon sermaye girişleri artmış, faiz oranı yükselmiş ve kur aşırı değerlenmiştir. 1994 yılında da finansal kriz ortaya çıkmıştır. 2002 yılında Güçlü Ekonomiye Geçiş programına geçilmiş ve 2003 yılından bu yana ise cari işlemler açığında artışlar gerçekleşmiştir. Modeller belirlenen kırılma dönemleri göz önüne alınarak tahmin edilmiştir. Tahmin edilen C/S ve C/T/S modellerinde birinci rejim için (1984:Q1-1994:Q1) cari işlemler açığının güçlü formda sürdürülebilir olduğu, diğer rejimlerde ise zayıf sürdürülebilir olduğuna yönelik güçlü kanıtlara ulaşılmıştır. Tahmin edilen diğer iki modelde (C ve C/T) cari işlemler açığının sürdürülebilirliğinin güçlü formunu doğrulayacak olan ithalatın katsayısının bire eşitliği sağlanamamıştır. Dolayısıyla, tüm modeller 1990'ların ortasından sonra Türkiye ekonomisi için cari açığın zayıf formda olduğunu göstermektedir.

2010'lu yıllara gelindiğinde, Türkiye ekonomisinde temel istikrarsızlık göstergesi olarak cari işlemler açığının sürdürülebilirliğinin öneminin daha fazla artmış olması, politika yapıcıları açısından cari işlemler açığının finansmanın ve kalitesinden öte açığın sürdürülebilirliği bağlamında toplam döviz gelirlerinin arttırmaya yönelik politikalara öncelik vermeleri gerekmektedir. Bu çalışmanın da gösterdiği gibi cari işlemler açığının sürdürülebilirliğinin zayıf formda olması, yurtiçi ve yurtdışı iktisadi karar alıcılarının bunu potansiyel güçlü bir kriz tetikleyici makroekonomik gösterge olarak algılaması Türkiye ekonomisinin istikrarı açısından önemlidir.

KAYNAKÇA

- Açıkgöz, Ş., & Akçağlayan, A. (2014). Türkiye'de Cari İşlemler Açığının Sürdürülebilirliği. *Ege Academic Review*, 14(1).
- Berke, B. (2009). Türkiye'de Cari açığın sürdürülebilirliği: Parçalı eşbütünleşme analizi. *Akdeniz University Faculty of Economics & Administrative Sciences Faculty Journal/Akdeniz Üniversitesi İktisadi ve İdari Bilimler Fakültesi Dergisi*, 9(18).
- Binatlı, O. A., & Sohrabji, N. (2012). Intertemporal solvency of Turkey's current account. *Panoeconomicus*, 59(1), 89-104.
- Dülger, F. & Özdemir, Z., A. (2004) Testing for the sustainability of current account deficit in six developing countries. *Yapı Kredi Economic Review*, 1, 51-69.
- Ekinci, R., & Kahyaoğlu, H. (2015). The Sustainability of Current Account Deficit in Turkey: A Non-Linear Time Series Approach. *Izmir Review of Social Sciences*, 2(2), 28-40.

- Engle, R. F., & Granger, C. W. (1987). Co-integration and error correction: representation, estimation, and testing. *Econometrica: journal of the Econometric Society*, 251-276..
- Göçer, İ., Mercan, M., & Hotonoğlu, H. (2012). Seçilmiş OECD Ülkelerinde Cari İşlemler Açığının Sürdürülebilirliği: Yatay Kesit Bağımlılığı Altında Çoklu Yapısal Kırılmalı Panel Veri Analizi. *Maliye dergisi*, (163), 449-470.
- Gregory, A. W., & Hansen, B. E. (1996a). Residual-based tests for cointegration in models with regime shifts. *Journal of econometrics*, 70(1), 99-126.
- Gregory, A. W., & Hansen, B. E. (1996b). Practitioners corner: tests for cointegration in models with regime and trend shifts. *Oxford bulletin of Economics and Statistics*, 58 (3), 555-560.
- Hakkio, C. S., & Rush, M. (1991). Is the budget deficit 'too large?'. *Economic inquiry*, 29(3), 429.
- Hatemi-j, A. (2008). Tests for cointegration with two unknown regime shifts with an application to financial market integration. *Empirical Economics*, 35(3), 497-505.
- Husted, S. (1992). The emerging US current account deficit in the 1980s: A cointegration analysis. *The Review of Economics and Statistics*, 159-166.
- Maki, D. (2012). Tests for cointegration allowing for an unknown number of breaks. *Economic Modelling*, 29 (5), 2011-2015.
- Milesi-Ferretti, G. M., & Razin, A. (1996). *Current account sustainability: selected East Asian and Latin American experiences* (No. w5791). National Bureau of Economic Research.
- Murat, S., Hobikoğlu, E. H., & Dalyancı, L. (2014). Structure and Sustainability of Current Account Deficit in Turkish Economy. *Procedia-Social and Behavioral Sciences*, 150, 977-984.
- Ng, S., & Perron, P. (2001). Lag length selection and the construction of unit root tests with good size and power. *Econometrica*, 1519-1554.
- Peker, O. (2009). Türkiye'deki Cari Açık Sürdürülebilir mi? Ekonometrik Bir Analiz. *Kocaeli Üniversitesi Sosyal Bilimler Enstitüsü Dergisi* 17 (1), 164-174.
- Pesaran, M. H., Shin, Y., & Smith, R. J. (2001). Bounds testing approaches to the analysis of level relationships. *Journal of applied econometrics*, 16(3), 289-326.
- Polat, Ö. (2011). Sustainability of the current account deficit in Turkey. *African Journal of Business Management*, 5(2), 577-581.
- Roubini, N., & Wachtel, P. (1998). Current Account Instability in Transition Economies, NBER Working Paper No. 6468 (March).

- Shin, Y. (1994). A Residual-Based Test of the Null of Cointegration Against the Alternative of No Cointegration. *Econometric Theory*, 10, 91-115.
- Ümit, A. Ö. (2011). Türkiye’de Cari İşlemler Açığının Sürdürülebilirliğinin Zaman Serileri Analizi İle Değerlendirilmesi: 1992-2010 Dönemi. *Anadolu Üniversitesi Sosyal Bilimler Dergisi*, 11 (3), 135-148.
- Yamak, R., & Korkmaz, A. (2007). Türk Cari İşlemler Açığı Sürdürülebilir mi? Ekonometrik Bir Yaklaşım. *Bankacılar Dergisi*, 60, 17-32.

Ülke Riski Bileşenlerinin Bankacılık ve Reel Sektör Üzerine Etkileri: Türkiye Örneği, 1993-2015

The Effects of Country Risk Components on the Banking Sector and Reel Sector

Recep KÖK¹

Ramazan EKİNCİ²

A.Elif Ay YALÇINKAYA³

ÖZET

Bu çalışmanın amacı ekonomik, finansal ve politik risklerden oluşan ülke riski bileşenlerinden hangisinin bankacılık ve reel sektör performansları üzerinde daha etkin sonuçlar doğurduğunu test etmektir. Başka bir ifadeyle ülke riski ile sektör performansı arasındaki ilişkiyi ortaya koyarak ülkedeki kaynak kullanımını olumsuz etkileyen ülke risklerini analiz etmektir. Ayrıca Türkiye ekonomisi açısından, koalisyonlar ve tek parti dönemlerine ilişkin risk yönetimindeki performansı aydınlatmak suretiyle istikrar olgusunun yönünü analiz etmektir. Burada bankacılık sektörü özelinde aktif karlılık oranı; reel sektörün performansını temsilen de sanayi üretim endeksi, vekil değişkenler olarak tanımlanmıştır. 1993 Aralık – 2015 Eylül dönemine ait çeyreklik verilerden oluşan veri seti kullanılmış ve ARDL yönteminden yararlanılmıştır. Her iki sektöre yönelik yapılan ARDL modeli tahmin sonuçlarından, ekonomik ve politik risklerin bankacılık sektörü üzerinde; finansal risklerin ise reel sektör üzerinde negatif ve anlamlı etkisinin olduğu görülmektedir.

Anahtar Kelimeler: Ekonomik risk, politik risk, finansal risk, bankacılık sektörü, reel sektör

ABSTRACT

In this study, it is aimed to determine which one of the country risk components consisting of economic, financial and political risks affects efficiently banking and reel sectors' performance. In other words, it is aimed to analyze the country risk components affecting negatively resource use, by determining the relation between country risk and sectoral performance. As regards, it is analyzed the performance on risk management in Turkish economy in terms of the coalition governments and one-party-governments. We describe return on assets for banking and industrial production index for real sector as proxy variables. And we use the database quarterly for the period between December 1993 and September 2015 and ARDL method. According to ARDL results for both of the sectors, it is concluded that economic and politic risks have a negative and significant effect on banking sector and financial risk has a negative and significant effect on real sector.

Keywords: Economic risk, political risk, financial risk, banking sector, reel sector

¹ Prof.Dr., Dokuz Eylül Üniversitesi, İktisadi ve İdari Bilimler Fakültesi, İktisat Bölümü, recep.kok@deu.edu.tr

² Araş.Gör., Dokuz Eylül Üniversitesi, İ.İ.B.F., İktisat Bölümü, ramazan.ekinci@deu.edu.tr

³ Araş.Gör.Dr., Dokuz Eylül Üniversitesi, İ.İ.B.F., İktisat Bölümü, elif.ay@deu.edu.tr

GİRİŞ

Bir ekonomide, karar alma birimleri ve bunların amaç fonksiyonlarına ilişkin güdülerine yönelik olarak devlet eksenli amaç-araç bileşimlerini belirleme faaliyeti ekonomi politikasını ifade etmektedir. Ekonomi politikası bir teorileşme temeline dayanmaktadır. Bu bağlamda, bir toplumdaki refahın artırılması ve sosyal barışın sağlanması nihai amacı, ilke ve kurumların biçimlendirdiği bir sisteme dayanan ekonomik düzen içinde gerçekleşmek durumundadır. Ekonomik karar alma birimlerinin özgün davranışları ile ekonomik faaliyetlerin işleyişine yönelik oyun kurucu aktörler/kurumlar tarafından kurgulanan düzen arasındaki ilişki, ekonomik sistem analizleri açısından oldukça önemlidir.

Ekonomik sistemin açıklık, serbestlik ve etkinlik ilkeleri temelinde, ekonomik yapıya ilişkin olarak sektörler arası ilişkiler öne çıkmaktadır. Bir başka deyişle, küresel piyasa ekonomisinin akışları bağlamında bir ekonomide kaynakların etkin kullanılabilmesi amacıyla sektörel performansların nasıl bir seyir izlediği önemli olmaktadır. Bu doğrultuda bir ülke ekonomisinin ne gibi riskler altında küresel ekonomiyle iç içe faaliyet gösterdiği konusu üzerinde durulması gerekmektedir.

Bu önemden hareketle, bu çalışmada ekonomik, finansal ve politik risklerden oluşan ülke riski bileşenleri temel alınarak, ülke riski göstergelerinden hangisinin sektör performansı üzerinde daha etkili olduğu burada incelenmektedir. Ülke riskinin bileşenlerine yönelik bulguların nedensellikler yönüyle ayrıştırılmasından beklenen; belli bir dönemin görünümünden hareketle geliştirilebilecek politikalar aracılığıyla, ulusal refahın daha da artması ve sosyal barışın giderek güçlendirilmesidir. Dolayısıyla ekonomi politikası sonuçlarının tartışılması amacıyla; ‘Türkiye ekonomisine ilişkin ülke riski bileşenleri, zamanlar arası (1993 Aralık – 2003 Mart ve 2003 Haziran – 2015 Eylül) olmak üzere reel ve bankacılık sektörlerinin performansını farklılaşan boyutta etkilemektedir’ şeklindeki bir hipotez bu çalışmada test edilmektedir. Bu doğrultuda birinci bölümde kavramsal çerçeve ve yazın özeti ele alınmakta, ikinci bölümde ise çalışmanın değişken tanımlamalarına, veri tabanına ve kullanılan yöntemlere yer verilmektedir. Son bölümde ise modelin analitik bulguları karşılaştırmalı şekilde incelenmekte ve ekonomi politikası önermeleri geliştirilmektedir.

1. İstikrarsızlık, Risk Bileşenleri ve Yazın Taraması

Bir ekonomide karar alma birimlerinin üretim, mübadele ve tüketim kararları ekonomik sistemin ilke ve kurumlarının ne olduğu temeline dayanmaktadır. Bir ekonomi politikası kuramcısı olarak Theodor Pütz’e göre, ekonomik düzenin oluşturulması için gerekli kurallar, normlar anlamındaki ilkeler; bireylerin, firmaların ve devletin davranışlarının dayanağını oluşturmaktadır. Bu ilkelerle bir ekonomik sistem ve ardından da ekonomik düzen kurulmaktadır (Pütz, 1994: 43-51). Ekonomik düzende, ilke ve kurumlar ile davranışlar arasında uyumsuzluklar, hatta çelişkiler oluştuğunda ekonomik dengeler

sürdürülemez kabul edilmektedir. Dolayısıyla, ekonomideki istikrarsızlık kaçınılmaz hale gelmektedir.

Ekonomik istikrarsızlığın ortaya çıkması o ekonominin riskli olarak değerlendirilmesinin en önemli nedenidir. Özellikle küresel ekonomik akışların günümüzdeki gibi yaygınlığı ve büyük hacimli olması, ekonomilerin riskli görülmesine potansiyel oluşturabilmektedir. Risklere ilişkin istikrarsızlık kimi zaman bunalım olarak da ele alınmaktadır. Ekonomik bunalım olgusu, konjonktürün doğasına uygun olarak ekonomik değişkenlerde sağlanacak sürdürülebilirliğin ortadan kalkması şeklinde gözlemlenmektedir. Bunalım olgusunun kavramlaştırılması bazı özelliklere dayanmaktadır. Bunlar, üretimde hızlı daralma, fiyatlarda düşüş, çok sayıda iflas, işsizlikte artış, ücretlerde gerileme, toplumsal gerginlikler ve genellikle bir patlayıcı işlevine sahip olmak üzere borsanın ya da banka sisteminin çökmesi gibi özelliklerdir (Rosier, 1994: 20). Dolayısıyla bunalım hem reel hem de finansal değişkenlerle ilgili olarak aşağı yönlü bir süreci ifade etmektedir. İstikrarsızlık da reel ve finansal göstergelerdeki bozulmaları işaret etmektedir.

Ekonomik istikrarsızlık, temelde bir yandan fiyatlar genel düzeyi, üretim miktarı, istihdam düzeyi, devlet bütçesi gibi değişkenlerdeki dalgalanmaları, diğer bir yandan da, finansal piyasalara ilişkin olarak kurlar, borçlanma, bankacılık işlemleri, menkul kıymet borsaları gibi alanlardaki dalgalanmaları içermektedir. Bu dalgalanmalar (konjonktür) yerli ve yabancı ekonomik karar birimlerinin planlarını bozucu etki göstermektedir. Karar alma birimleri belirsizlik ve risk altında karar almakta ve faaliyette bulunmaktadır.

İstikrarsızlığın belirsizlik ve risk anlamına gelmesi bu kavramların da analiz edilmesini gerektirmektedir. Risk bir tehlikenin ortaya çıkma olasılığı ile ilgilidir. Bu yönüyle 'tehdike' ve 'olasılık' olmak üzere iki boyutu vardır. Belirsizlik ise riski kapsamaktadır ve onun da iki boyutu vardır. Bunlar 'bilgisizlik' ve 'sürpriz-şok' boyutlarıdır (Alada, 2000: 78-82).

Risk ve belirsizlik kavramları ekonomik istikrarsızlık bağlamında değerlendirildiğinde; risk, ekonomideki sürdürülemezliklerin ortaya çıkma olasılığına ilişkin iken, belirsizlik, ekonomik dalgalanmalarla ilgili bir bilgisizliği ve bu bilgisizliğe sahipken ansızın ortaya çıkan dalgalanma belirtilerini ve kaynaklarını ifade etmektedir. Örneğin, kurların aniden yükselme ve ekonomik dengeleri bozma olasılığı risk olgusunu betimlerken, kurların yükselmesini öngörememe ve bu yükselmenin gerçekleşmesiyle şok yaşama, belirsizliği anlatmaktadır.

Riskin felsefi tanımlamasından hareketle hem reel hem de finansal sektör bağlamında önemli olan ülke riski kavramından söz etmekte yarar vardır. Ülke riski, özellikle yabancı sermaye yatırımları ve pazar potansiyeli bakımından önemli olan bir ölçüttür. Bir ülkenin ya da ekonominin riskli olması; yabancı sermaye çekmesini, pazar olarak

görülme suretiyle mal satılmasını, uluslararası işbirliğine gidilmesini, işgücü akışını ve diğer sivil akışları olumsuz yönde etkilemektedir.

Ülke riski belli bileşenlerden oluşmaktadır. PRS Group adlı araştırma kuruluşu tarafından hazırlanan Uluslararası Ülke Riski Kılavuzu'na göre (International Country Risk Guide), risk bileşenleri temel olarak politik, ekonomik ve finansal risk olmak üzere üçe ayrılmaktadır. Risk bileşenleri ile ilgili ayrıntılı bilgi değişken tanımlamalarında verilmektedir. Bu noktada yazın taraması yol gösterici niteliktedir. Ülke riski ve bileşenlerinin kullanıldığı uygulamalı çalışmalar Tablo 1'de özetlenmiştir:

Tablo 1: Yazın Özeti

Yazarlar	Veri Tabanı	Amaç	Yöntem	Sonuç
Erb, Harvey ve Tadas (1996)	117 ülkeye ilişkin hisse senedi piyasası beklenen getirisi	Ülke riskinin hisse senedi getirisi üzerindeki etkisini tespit etmek	Yatay kesit analizi ve zaman serisi analizi	Ülke riski ile hisse senedi getirileri arasındaki negatif ilişki bulunmaktadır.
Yapraklı ve Güngör (2007)	BIST 100 endeksi (1986:01-2006:12)	BIST 100 endeksi ile ülke riski arasındaki ilişkiyi tespit etmek	Granger nedensellik ve Johansen Juselius eşbütünlük testleri	Politik ve ekonomik riskten BIST100 endeksine doğru nedensellik vardır. Ekonomik, finansal ve politik riskler; BIST100 endeksini olumsuz yönde etkilemektedir.
Khan ve Akbar (2013)	94 ülkeye ilişkin doğrudan yabancı yatırımlar (1986-2009)	Doğrudan yabancı yatırımlar ile politik risk arasındaki ilişkiyi tespit etmek	Havuzlanmış en küçük kareler, bir yönlü ve iki yönlü sabit ve rassal etkiler modeli	Politik risk ile doğrudan yabancı yatırımlar arasında negatif bir ilişki bulunmaktadır. Bu ilişki yüksek gelirli ülkelerde, düşük gelirli ülkelere göre daha fazladır.
Çam (2014)	IMKB'ye kayıtlı firmalar (2000-2009)	Politik riskin IMKB'ye kayıtlı firmaların üzerindeki etkisini tespit etmek	Panel veri analizi	Politik risk ile firma değeri arasında istatistiksel olarak anlamlı bir ilişki bulunmaktadır.
Kaya, Güngör ve Özçömek (2014)	BIST 100 endeksi (1998:01-2012:12)	BIST 100 endeksi ile politik risk arasındaki ilişkiyi tespit etmek	Regresyon analizi	BIST 100 endeksi ile politik risk arasında uzun dönemli ve negatif bir ilişki vardır.
Kara ve Karabyık (2015)	BIST 100 endeksi (1999:01-2013:12)	BIST 100 endeksi ile ülke riski arasındaki ilişkiyi tespit etmek	Johansen Eşbütünlük testi ve Vektör Hata Düzeltme Modeline Dayalı Nedensellik Testi	Ekonomik, finansal ve politik riskler; BIST100 endeksini olumsuz yönde etkilemektedir.

2. Veri Seti ve Yöntem

Çalışmada öncelikle ele alınan değişkenlerin tanımı ve elde edildiği veri tabanları tanımlanmış, daha sonra çalışmada kullanılan yöntem hakkında bilgi verilmiştir.

2.1. Veri Seti

Çalışma, Türkiye özelinde 1993 Aralık – 2015 Eylül dönemine ait çeyreklik verileri kapsamaktadır. Finansal sektörü temsilen Türk bankacılık sistemi ele alınmıştır. Türk bankacılık sisteminin performansına ilişkin yazında genel kabul görmüş aktif karlılık oranı (net dönem karı / toplam aktifler) kullanılmıştır. “Aktif karlılık oranı” verisi, “Türkiye Bankalar Birliği, Veri Sorgulama Sistemi, Mali Tablolar” veri tabanından elde edilmiştir. Reel sektörün performansına ilişkin ise “Sanayi üretim endeksi” verisi

kullanılmış, “TCMB Elektronik Veri Dağıtım Sistemi”nden 1997 ve 2010 yılları baz olan iki seri olarak indirilmiş ve tek bir endekse dönüştürülmüştür.

Ülke risk derecelendirmesinin bileşenleri olan politik, ekonomik ve finansal risk verileri, yazındaki çalışmalarla güvenilirliği kabul edilmiş “Politik Risk Grubu (The PRS Group)” tarafından hazırlanan “Uluslararası Ülke Risk Rehberi (ICRG-International Country Risk Guide)”nden temin edilmiştir. Tablo 2’de görüldüğü üzere, ekonomik ve finansal risk göstergeleri 5 alt bileşenden oluşurken, politik risk göstergesi 12 alt bileşenden oluşmaktadır. Ayrıca ekonomik ve finansal riskin maksimum değerleri 50 iken, politik riskin maksimum değeri 100’dür. Ülke riski hesaplanması şu şekilde yapılabilmektedir:

$$\text{Ülke riski} = \frac{\text{Ekonomik risk} + \text{Finansal risk} + \text{Politik risk}}{2} \quad (1)$$

ICRG tarafından hesaplanan risk göstergelerinin değer aralığında, değer büyüdükçe risk potansiyelinin azalması durumu, çalışmamızın hipotezine uyumlu olacak şekilde, değer büyüdükçe risk potansiyeli artacak şekilde düzenlenmiştir.

Tablo 2: Politik, Ekonomik ve Finansal Risk Alt Bileşenleri

	Politik Risk	Ekonomik Risk	Finansal Risk			
Bileşenleri	<ul style="list-style-type: none"> • Hükümet istikrarı • Sosyo-ekonomik koşullar • Yatırım profili • İç çatışmalar • Dış çatışmalar • Yolsuzluk • Politikada ordunun etkisi • Dinsel gerilimler • Hukuk ve düzen • Etnik gerilimler • Demokratik hesap verebilirlik • Bürokrasinin niteliği 	<ul style="list-style-type: none"> • Kişi başına GSYİH • Reel GSYİH bütüme oranı • Yıllık enflasyon oranı • Bütçe dengesi/GSYİH • Cari hesap/GSYİH 	<ul style="list-style-type: none"> • Dış borçlar/GSYİH • Dış borç servisi/Mal ve hizmet ihracatı • Cari hesap/Mal ve hizmet ihracatı • İthalatın yapıldığı aylar bazında net uluslararası likidite • Döviz kuru istikrarı 			
Değer Aralığı	0 $\xrightarrow{\text{risk azalıyor}}$ 100	0 $\xrightarrow{\text{risk azalıyor}}$ 50	0 $\xrightarrow{\text{risk azalıyor}}$ 50			
Ölçüt	Çok yüksek:	%0,0-%49,9	Çok yüksek:	%0,0-%24,9	Çok yüksek:	%0,0-%24,9
	Yüksek:	%50,0-%59,9	Yüksek:	%25,0-%29,9	Yüksek:	%25,0-%29,9
	Orta:	%60,0-%69,9	Orta:	%30,0-%34,9	Orta:	%30,0-%34,9
	Düşük:	%70,0-%79,9	Düşük:	%35,0-%39,9	Düşük:	%35,0-%39,9
	Çok düşük:	%80,0 ve fazlası	Çok düşük:	%40,0 ve fazlası	Çok düşük:	%40,0 ve fazlası

Kaynak: The PRS Group, ICRG Methodology, <http://www.prsgroup.com/wp-content/uploads/2012/11/icrgmethodology.pdf> internet adresinden tarafımızdan derlenmiştir. (28.08.2015)

2.2. Yöntem

Sınır testi yaklaşımında durağanlık dereceleri farklı olan değişkenler arasındaki eşbütünleşme ilişkisi kısıtsız hata düzeltme modeline bağlı olarak aşağıdaki gibi test edilebilir:

$$\Delta ROA = a_0 + \sum_{i=1}^p a_{1i} \Delta ROA_{t-i} + \sum_{i=0}^p a_{2i} \Delta \ln ER_{t-i} + \sum_{i=0}^p a_{3i} \Delta \ln FR_{t-i} + \sum_{i=0}^p a_{4i} \Delta \ln PR_{t-i} + a_5 ROA_{t-1} + a_6 \ln ER_{t-1} + a_7 \ln FR_{t-1} + a_8 \ln PR_{t-1} + u_t \quad (2)$$

$$\Delta SUE = b_0 + \sum_{i=1}^p b_{1i} \Delta ROA_{t-i} + \sum_{i=0}^p b_{2i} \Delta \ln ER_{t-i} + \sum_{i=0}^p b_{3i} \Delta \ln FR_{t-i} + \sum_{i=0}^p b_{4i} \Delta \ln PR_{t-i} + b_5 ROA_{t-1} + b_6 \ln ER_{t-1} + b_7 \ln FR_{t-1} + b_8 \ln PR_{t-1} + u_t \quad (3)$$

Birinci eşitlikte, bağımlı değişken ROA ve bağımsız değişkenler risk göstergesidir. Buna göre finansal sektöre yönelik risk göstergeleri ve aktif karlılık oranı arasındaki eşbütünleşme ilişkisi test edilmektedir. İkinci eşitliğin bağımlı değişkeni ise sanayi üretim endeksi ve bağımlı değişkenleri benzer şekilde risk göstergeleridir. Burada ise risk göstergeleri ile reel sektör göstergesi arasındaki eşbütünleşme ilişkisinin varlığı araştırılmaktadır.

Eşbütünleşme ilişkisi; $H_0 = a_5 = a_6 = a_7 = a_8 = 0$ ve $H_0 = b_5 = b_6 = b_7 = b_8 = 0$ hipotezleri altında incelenmektedir. Burada hesaplanan test istatistiği Pesaran vd. (2001: 300)'nin çalışmasında elde edilen tablo değeriyle karşılaştırılmaktadır. Test istatistiği üst kritik değerden büyük olursa bu durumda farklı dereceden bütünlük değişkenler arasında bir eşbütünleşme ilişkisinin varlığı bilinmektedir. Eğer test istatistiği alt kritik değerden küçükse, bu durumda da değişkenler arasında bir eşbütünleşme ilişkisinin olmadığı sonucuna varılabilmektedir. Alt ve üst kritik değerlerin arası ise kararsızlık bölgesini göstermektedir.

ARDL yönteminin ilk aşamasını gecikme uzunluklarının belirlenmesi oluşturmaktadır. Buna göre, ilk olarak (2) ve (3) numaralı denklemlerde yer alan p gecikme uzunlukları belirlenmektedir. Gecikme uzunluklarının belirlenmesinde Akaike ve Schwarz bilgi kriterleri kullanılmaktadır. Akaike ve Schwarz bilgi kriterlerinin minimum olduğu gecikme uzunluğu, uygun gecikme uzunluğu olarak seçilmektedir.

ARDL yönteminde, ilk aşamada değişkenler arasında uzun dönemli bir eşbütünleşmenin varlığı tespit edildikten sonra ikinci aşamada uzun ve kısa dönem tahmin sonuçlarına geçilmektedir. Değişkenler arasında uzun dönem ilişkinin tahmininde ARDL modelinden faydalanılmaktadır:

$$ROA = a_0 + \sum_{i=1}^p a_{1i}ROA_{t-i} + \sum_{i=1}^p a_{2i}lnER_{t-i} + \sum_{i=1}^p a_{3i}lnFR_{t-i} + \sum_{i=1}^p a_{4i}lnPR_{t-i} + u_t \quad (4)$$

$$SUE = a_0 + \sum_{i=1}^p b_{1i}SUE_{t-i} + \sum_{i=0}^p b_{2i}ER_{t-i} + \sum_{i=0}^p b_{3i}FR_{t-i} + \sum_{i=0}^p b_{4i}PR_{t-i} + u_t \quad (5)$$

(4) ve (5) numaralı denklemler sırasıyla finansal ve reel sektöre yönelik ARDL denklemlerini göstermektedir. Buradan yola çıkarak değişkenlere ait uzun dönem katsayılar elde edilmektedir. Yine burada gecikme uzunluklarının belirlenmesinde Akaike ve Schwarz bilgi kriterlerinden yararlanılmaktadır.

Değişkenler arasındaki kısa dönem ilişki ise yine ARDL yaklaşımına bağlı olarak bir hata düzeltme modeli yardımıyla elde edilmektedir.

$$\Delta ROA = a_0 + \sum_{i=1}^p a_{1i}\Delta ROA_{t-i} + \sum_{i=1}^p a_{2i}\Delta lnER_{t-i} + \sum_{i=1}^p a_{3i}\Delta lnFR_{t-i} + \sum_{i=1}^p a_{4i}\Delta lnPR_{t-i} + a_5 EC_{t-1} + u_t \quad (6)$$

$$SUE = a_0 + \sum_{i=1}^p b_{1i}\Delta SUE_{t-i} + \sum_{i=0}^p b_{2i}\Delta ER_{t-i} + \sum_{i=0}^p b_{3i}\Delta FR_{t-i} + \sum_{i=0}^p b_{4i}\Delta PR_{t-i} + b_5 EC_{t-1} + u_t \quad (7)$$

(6) ve (7) numaralı denklemler sırasıyla finansal ve reel sektöre yönelik kısa dönem ilişkiyi gösteren denklemlerdir. Burada EC_{t-1} değişkenler arasındaki kısa dönemdeki dengesizliğin kaç dönem sonra kalkacağını ve değişkenlerin uzun dönemde dengeye geleceğini gösteren hata düzeltme terimidir. a_5 katsayısının negatif ve istatistiki olarak anlamlı olması kısa dönem sapmaların, uzun dönemde ortadan kalktığını gösteren bir hata düzeltme mekanizmasının varlığını göstermektedir.

Durağan ve birim kök içeren değişkenleri aynı anda modelleyebilmesinin yanı sıra ARDL yönteminin diğer bir avantajı ise, kısa ve uzun dönemi eşanlı olarak tahmin etmesidir. Ayrıca gecikme uzunluklarını birbirinden bağımsız farklı belirleyebilme imkanı vermektedir. Diğer yandan küçük örneklerde bile etkin sonuçlar verebilmektedir.

3. Analitik Bulgular

Çalışmada kullanılan ve Tablo 3’te yer verilen değişkenlere ait tanımlayıcı istatistiklerin yanı sıra burada birim kök testleri ve tahmin sonuçlarına yer verilmektedir. Bu bilgiler çalışmanın veri tabanı hakkında analitik bulguları destekleyen göstergeler içermektedir.

Tablo 3: Tanımlayıcı İstatistikler

DEĞİŞKENLER	ROA	SUE	ER	FR	PR
Ortalama	0,025	124,019	39,093	35,818	41,727
Maksimum	0,073	179,171	65,000	53,000	53,000
Minimum	-0,088	69,345	28,000	26,000	29,500
Standart Sapma	0,027	30,726	8,884	7,215	5,386
Çarpıklık	-1,364	0,196	0,781	0,918	-0,258
Aşırı Basıklık	6,282	1,831	3,383	3,164	2,661
Jarque-Bera	66,779	5,576	9,485	12,468	1,403
Gözlem	88	88	88	88	88

3.1. Birim Kök Testleri

Zaman serileri genellikle trend içermektedir. Trend içeren makroiktisadi zaman serilerinin durağan olmama ihtimali oldukça güçlüdür. Durağan olmayan zaman serileri ile yapılan regresyon analizleri genellikle sahte regresyon içerir (Granger ve Newbold, 1974). Bu nedenle öncelikle zaman serilerinin durağanlık durumu test edilmiştir. Tablo 4’te ADF (Genişletilmiş Dickey Fuller) ve PP (Phillips-Perron) birim kök testi sonuçları yer almaktadır.

Tablo 4: ADF ve PP Birim Kök Test Sonuçları

Değişkenler	ADF Test İstatistiği		PP Test İstatistiği	
	Trendsiz	Trendli	Trendsiz	Trendli
ROA	I(0)	I(0)	I(0)	I(0)
Düzye	-4,836 (0) ***	-5,298 (0) ***	-4,673 (1) ***	-5,244 (2) ***
Birinci Farkı	-8,951 (2) ***	-8,919 (2) ***	-42,555 (1)***	-46,297(3)***
SUE	I(1)	I(1)	I(1)	I(1)
Düzye	-0,137 (0)	-3,102 (1)	-0,137(0)	-2,953(2)
Birinci Farkı	-7,239 (0) ***	-7,186 (0) ***	-7,238 (2) ***	7,187 (0) ***
ER	I(1)	I(0)	I(1)	I(0)
Düzye	-0,775 (5)	-4,368 (0) ***	-2,390 (6)	-4,300 (2) ***
Birinci Farkı	-6,547 (4) ***	6,567 (4) ***	-17,369 (9)***	-18,363 (8) ***
FR	I(0)	I(0)	I(0)	I(0)
Düzye	-3,166 (0) **	-3,357 (0) *	-3,167 (1) **	-3,357 (0) *
Birinci Farkı	-6,453 (3) ***	-6,484 (3) ***	-10,225 (4) ***	-10,341 (5) ***
PR	I(1)	I(1)	I(1)	I(1)
Düzye	-1,808 (7)	-1,748 (7)	-1,839 (4)	-1,826 (4)
Birinci Farkı	-2,973 (6) **	-3,982 (6) **	-11,134 (3) ***	-11,069 (3) ***

*Not: ***, ** ve *; birim kökün varlığına ilişkin boş hipotezin sırasıyla %1, %5 ve %10 hata düzeylerinde reddedildiğini göstermektedir. Her iki test için de MacKinnon (1991)'un kritik değerleri kullanılmıştır. Parantez içindeki rakamlar Akaike bilgi kriterine (AIC) göre uygun gecikme uzunluğunu göstermektedir.*

Elde edilen sonuçlar ROA (Aktif karlılık oranı) ve FR (finansal risk) değişkeninin hem sabitte hem de sabit ve trendde durağan olduğunu göstermektedir. SUE (sanayi üretim endeksi) ve PR (politik risk) değişkenleri ise her iki durumda birim kök içermektedir. ER (ekonomik risk) değişkeni ise sabitte birim kök içerirken, sabit ve trendli modelde durağan olduğu görülmektedir.

Standart birim kök testlerinin önemli bir eksikliği yapısal kırılmaları dikkate almamalarıdır. Ancak iktisadi zaman serileri, özellikle yaşanan bunalım dönemlerinin etkisiyle, genellikle kırılmaların etkisi altındadır. Yapısal kırılmaların varlığı durumunda bu kırılmaları dikkate almayan standart birim kök testlerinin gücü azalmaktadır. Bundan dolayı çalışmada kırılmayı dikkate alan Zivot-Andrews birim kök testi kullanılmıştır. (Zivot ve Andrews, 1992)

Zivot-Andrews birim kök testinin önemli bir özelliği kırılma yıllarını içsel olarak belirlemesidir. Birim kökün varlığını ifade eden boş hipotez, 'Kırılmanın varlığı durumunda değişken durağandır.' şeklindeki alternatif hipoteze karşı test edilmektedir. Test istatistiğinin alternatif önem düzeylerindeki kritik değerden küçük olması durumunda boş hipotez reddedilmekte, alternatif hipotez kabul edilmektedir. Tablo 5'teki sonuçlar incelendiğinde aktif karlılık oranı, sanayi üretim endeksi ve politik risk

değişkenleri birim kök içerirken, ekonomik risk ve finansal risk değişkenlerinin kırılmaların varlığı altında trend durağan olduğu görülmektedir.

Tablo 5: Tek Kırılmalı Zivot-Andrews Birim Kök Testi

DEĞİŞKENLER	Zivot-Andrews Testi			
	Model A		Model C	
ROA	-4,167 (3)	2002Q4	-4,614 (3)	2002Q4
SUE	-3,917 (1)	1998Q4	-4,074 (1)	1998Q4
ER	-5,810 (0)	2004Q3	-6,065 (0)	2002Q1
FR	-5,348 (0)	1997Q3	-5,459 (0)	1997Q3
PR	-3,316 (3)	2001Q2	-4,198 (3)	2003Q2
Kritik Değerler				
	%1	%5	%10	
Model A	-5,34	-4,83	-4,58	
Model C	-5,57	-5,08	-4,82	

Not: Model A: Ortalama kırılma

Model C: Rejimde (ortalama+eğim) kırılmayı ifade etmektedir. Parantez içindeki değerler gecikme uzunluklarını göstermektedir.

Eşbütünleşme testleri yazında yaygın olarak kullanılmaya başlanmasından önce, sahte regresyon sonucundan kaçınmak için değişkenlerin genellikle farkları alınarak regresyon analizi yapılmaktaydı. Ancak bu durum uzun döneme ait iktisadi bilgi kaybına yol açmaktadır. Engle ve Granger (1987)'in geliştirdiği eşbütünleşme testi bu sorunu gidermektedir. Buna göre birim kök içeren zaman serileri arasında eşbütünleşik ilişki var ise bu zaman serileriyle yapılan regresyon sonuçları gerçek regresyon sonuçlarıdır. Engle ve Granger (1987) tarafından geliştirilen iki aşamalı Engle-Granger eşbütünleşme testi ve Johansen (1988) ve Johansen ve Juselius (1990) tarafından geliştirilen Johansen eşbütünleşme testleri değişkenlerin entegrasyon derecelerinin aynı olması varsayımına dayanmaktadır.

Çalışmada kullanılan değişkenlerin entegrasyon derecelerinin farklı olması nedeniyle sınır testi yaklaşımı kullanılmıştır (Pesaran vd., 2001). Gecikmesi dağıtılmış oto regresif (ARDL) diye bilinen bu yaklaşımın en önemli özelliği farklı entegrasyon derecelerine sahip değişkenler arasından eşbütünleşme ilişkisinin testine imkan sağlamasıdır.

3.2. Tahmin Sonuçları

Çalışmada öncelikle değişkenler arasındaki eşbütünleşme ilişkisi (2) ve (3) numaralı denklemlerdeki sınır testi yaklaşımına bağlı olarak belirlenmiştir. Maksimum 8 gecikme (çeyreklik verilerle çalışıldığı için) seçilerek uygun gecikme uzunluğu Akaike bilgi kriterine (AIC) belirlenmiştir. Buna göre sırasıyla reel ve finansal sektörü ifade eden (2)

ve (3) numaralı denklemlerin gecikme uzunlukları 1 olarak belirlenmiştir. Ayrıca yapılan Breusch-Godfrey otokorelasyon testi sonucunda seçilen gecikme uzunluklarında otokorelasyon sorununun olmadığı görülmüştür.

Tablo 6: Sınır Test İstatistiği Sonuçları

Sektörler	k	F istatistiği	Kritik Değer	
			Alt Sınır I(0)	Üst Sınır I(1)
Finans Sektörü	3	17,845	3,23	4,35
Reel Sektör	3	5,833	4,01	5,07

*Not: *k, bağımsız değişken sayısıdır. Kritik değerler Pesaran vd. (2001:300)'deki Tablo CI(iii) 'ten alınmıştır. Kritik değerler %5 önem düzeyindeki kritik değerlerdir.*

Tablo 6'da her iki sektöre yönelik eşbütünleşme test sonuçları yer almaktadır. Hesaplanan F istatistikleri %5 önem düzeyinde üst kritik değerden büyük olduğu için, değişkenler arasında uzun dönemli bir eşbütünleşme ilişkisinin olduğu görülmektedir.

Çalışmanın ikinci aşamasını, (4) ve (5) numaralı ARDL denklemlerine dayanarak finansal ve reel sektöre yönelik uzun ve kısa dönem denklemlerin tahmini oluşturmaktadır. Yine burada da maksimum gecikme uzunluğu 8 olarak seçilmiş ve AIC değerini minimum yapan gecikme uzunluğu, uygun gecikme uzunluğu olarak belirlenmiştir.

Tablo 6'da görüldüğü üzere, finansal sektöre yönelik ARDL tahmin sonuçları ve buradan elde edilen uzun dönem katsayı tahminleri yer almaktadır. Çalışmada finansal sektörün performansını temsilen aktif karlılık oranı, bağımlı değişken olarak belirlenmiştir. Bağımsız değişkenler ise ekonomik, politik ve finansal olmak üzere üç temel risk göstergesidir. Risk göstergelerine ilave olarak yapısal kırılma dönemleri kukla değişken olarak modele dahil edilmiştir. Kukla değişken, denklem sistemindeki kırılmaları dikkate alan Quandt-Andrews (Quandt, 1960: 327) yapısal kırılma testi yardımıyla belirlenmiştir.

Bankacılık sektörü ARDL modeli tahmin sonuçları incelendiğinde, bir önceki dönem sektör performansının (ROA(-1): aktif karlılık oranı) takip eden dönem performansını olumlu ve anlamlı düzeyde etkilediği görülmektedir. Yine sektörün, politik risklerden (PR) ilgili dönemde; ekonomik risk (LER(-3)) üzerinden ise üç dönemlik gecikmeye bağlı olarak olumsuz/negatif yönde etkilendiği söylenebilir.

Uzun dönem katsayı sonuçları incelendiğinde, bankacılık sektörü, ekonomik (ER) ve politik (PR) risklerden anlamlı biçimde olumsuz yönde etkilenmektedir. Finansal risk (FR) göstergesi ise işareti beklentilerle uyumlu olmakla birlikte istatistiki olarak anlamsız bulunmuştur.

Tablo 7: Finansal Sektör ARDL (1,3,1,0) Modeli Sonuçları ve Uzun Dönem Katsayıları

Bağımlı Değişken: ROA			
Bağımsız Değişkenler	Katsayılar		t istatistiği
ROA (-1)	0,322	***	4,119
LER	-0,029	*	-1,771
LER (-1)	0,017		0,887
LER (-2)	0,010		0,550
LER (-3)	-0,037	**	-2,176
LFR	-0,026	*	-1,621
LFR (-1)	0,026		1,649
LPR	-0,030		-2,238
DUM	-0,099	***	-7,914
C	0,272	***	3,904
Hesaplanan Uzun Dönem Katsayılar			
Sabit	0,402	***	4,468
LER	-0,056	***	-3,757
LFR	-0,008		0,046
LPR	-0,045	**	-2,306
DUM	-0,146	***	-6,040
R² = 0,691	Düzeltilmiş R² = 0,655	F-ist= 18,721 (0,000)	
B-G = 0,999 (0,445)	B-P-G = 1,75 (0,092)	J-B = 4,536 (0,103)	
R-R = 1,323 (0,189)			

*Not: B-G, Breusch-Godfrey otokorelasyon testini; B-P-G, Breusch-Pagan-Godfrey değişen varyans testini; Jarque-Bera, normallik testini ve R-R, Ramsey-Reset model kurma hatası testini ifade etmektedir. Parantez içindeki değerler % 5 önem düzeyinde olasılık değerleridir. *, **, *** sırasıyla %10, %5 ve %1 önem düzeylerini göstermektedir.*

Bankacılık sektörünü etkileyen ülke riski bileşenlerinden finansal risk değişkeninin katsayılarının anlamsız olması, karar alma birimlerinin sektör içindeki kaynak kullanımını etkileyen faktörleri kendi iç denetim mekanizmaları üzerinden kestirmiş olmaları ihtimaline bağlanabilir. Nitekim sektör içindeki her karar alma birimi, risk yönetimine referans olacak değişkenleri analiz etmek; yurt içi ve yurt dışı parasal şokların potansiyel etkilerini önceden alınan sinyaller üzerinden yönetmek zorundadır.

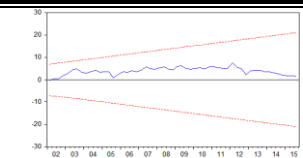
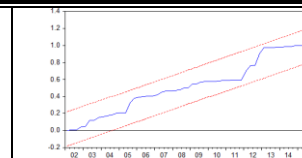
Diğer yandan karar alma birimlerinin bu başarı/başarısızlık hikayesini izleyen ve kurumsal ölçekte dış denetimden sorumlu olan Bankacılık Düzenleme ve Denetleme Kurumu, ülke riski bileşenlerinden finansal risklere yönelik izlenen yol haritasını izlemek ve finansal piyasalar çerçevesinde yönlendirici göstergeleri paylaşmak konumundadır. Ayrıca ülke ekonomisinin para politikasına katkı sağlayan Merkez Bankası da iç ve dış denetimlerin zamanlar arası uyum sürecini dikkate alarak, yönetim stratejileri geliştirmektedir. Dolayısıyla bu durum, sektördeki finansal risklerin

yaratabileceği olumsuz etkilerin kısmen de olsa önceden öngörülebilir olmuş olmasına ve anlamlı gecikmelere yol açılmamış olmasına bağlı olduğu söylenebilir.

Ayrıca modele eklenen kukla değişkeninin (DUM) işareti negatif olup, oldukça anlamlıdır. Bu durum sektörün özellikle Türkiye krizi (2001) diyebileceğimiz, finans sektörü krizi (bunalımı) olarak bilinen bunalım döneminden önemli ölçüde olumsuz etkilendiğini gösterir.

Özetle sektöre yönelik ARDL tahmin sonuçlarının bir bütün olarak güvenilirliğini açıklayan, Tablo 7’de yer alan model tahmin sonuçlarından ve istatistiki tanı bulgularından anlaşıldığı üzere model bir bütün olarak anlamlıdır. Başka bir ifadeyle, otokorelasyon ve değişen varyans sorunu yoktur, modelin hata terimi normal dağılmaktadır, tanımlama hatası içermemektedir.

Tablo 8: Finansal Sektör Kısa Dönem Hata Düzeltme Modeli Sonuçları

Bağımlı Değişken: ΔROA			
Bağımsız Değişkenler	Katsayılar		t istatistiği
ΔLER	-0,029	*	-1,771
$\Delta LER (-1)$	-0,010		-0,550
$\Delta LER (-2)$	0,037	**	2,176
ΔLFR	-0,026		-1,621
ΔLPR	-0,030	**	-2,238
ΔDUM	-0,099	***	-7,914
$ECM (-1)$	-0,677	***	-8,842
$R^2 = 0,686$	Düzeltilmiş $R^2 = 0,653$	F-ist= 20,547	
B-G = 0,751 (0,506)	B-P-G = 0,573 (0,796)	J-B=3,097 (0,212)	
R-R = 0,585 (0,506)			

*Not: B-G, Breusch-Godfrey otokorelasyon testini; B-P-G, Breusch-Pagan-Godfrey değişen varyans testini; Jarque-Bera, normallik testini ve R-R, Ramsey-Reset model kurma hatası testini ifade etmektedir. Cusum ve Cusum-Squares testleri katsayıların yapısal istikrarlılığı testini göstermektedir. Parantez içindeki değerler olasılık değerlerini göstermektedir. Parantez içindeki değerler % 5 önem düzeyinde olasılık değerleridir. *, **, *** sırasıyla %10, %5 ve %1 önem düzeylerini göstermektedir.*

Tablo 8’de yer alan finansal sektörü etkileyen ülke riski değişkenlerine ilişkin kısa dönem hata düzeltme modelinin tahmin sonuçları değerlendirildiğinde; yine ekonomik ve politik riskin aktif karlılık oranı üzerindeki etkisi beklentilerle uyumlu olarak negatif

işaretlidir. Diğer taraftan hata terimi mekanizması çalışmakta olup anlamlıdır. Bu durum değişkenler arasında kısa dönemli sapmaların uzun dönemde ortadan kalktığını göstermesinin yanı sıra; sisteme gelen şoklar açısından kısa dönemli sapmaların yaklaşık $(1/0,68=1,47$ çeyreklik dönem) 4,5 ay sonra ortadan kalktığını gösterirken, sektörün değişkenler bağlamıyla uzun dönemde denge düzeyini yakaladığını açıklamaktadır.

Ayrıca katsayıların istikrarlılığını ifade eden Cusum ve Cusum Squares test sonuçlarına göre tahmin edilen katsayıların istikrarlı olduğunu söylemek mümkündür. Model diğer istikrarlılık koşullarını (otokorelasyon yoktur, değişen varyans yoktur, hatalar normal dağılır, model kurma hatası yoktur) da sağlamaktadır.

Tablo 9: Reel Sektör ARDL (2, 2, 4, 3) Modeli Sonuçları ve Uzun Dönem Katsayıları

Bağımlı Değişken: SUE			
Bağımsız Değişkenler	Katsayılar		t istatistiği
SUE(-1)	1,037	***	10,040
SUE(-2)	-0,222	**	-2,134
ER	-0,110		-1,437
ER(-1)	-0,058		-0,671
ER(-2)	0,269	***	3,390
FR	0,010		0,123
FR(-1)	-0,232	**	-2,375
FR(-2)	0,256	**	2,623
FR(-3)	-0,117		-1,180
FR(-4)	-0,135	*	-1,679
PR	-0,137		-0,889
PR(-1)	-0,288		-1,539
PR(-2)	0,865	***	4,508
PR(-3)	-0,450	***	-2,788
DUM	-10,382	***	-4,488
C	18,397	***	2,959
TREND	0,224	***	3,873
Hesaplanan Uzun Dönem Katsayılar			
Sabit	12,201	***	6,238
ER	-0,384		-0,881
FR	-0,759	**	-2,334
PR	0,355		1,165
DUM	-4,608	***	-3,054
TREND	0,935	***	8,240
R²=0,982	Düzeltilmiş R²= 0,978	F-ist= 555,634 (0,000)	
B-G (4) = 1,821 (0,135)	B-P-G= 1,376 (0,180)	J-B = 0,640 (0,726)	
R-R= 0,546 (0,586)			

*Not: B-G, Breusch-Godfrey otokorelasyon testini; B-P-G, Breusch-Pagan-Godfrey değişen varyans testini; Jarque-Bera, normallik testini ve R-R, Ramsey-Reset model kurma hatası testini ifade etmektedir. Parantez içindeki değerler % 5 önem düzeyinde olasılık değerleridir. *, **, *** sırasıyla %10, %5 ve %1 önem düzeylerini göstermektedir.*

Tablo 9'da reel sektöre yönelik ARDL modeli ve uzun dönem katsayı tahmin sonuçları yer almaktadır. Burada bağımlı değişken olarak reel sektörün performansını temsilen sanayi üretim endeksi kullanılmıştır. Değişken, Census-12 mevsimsel düzeltme yöntemi

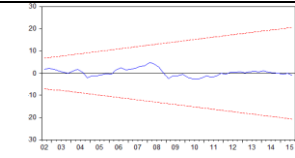
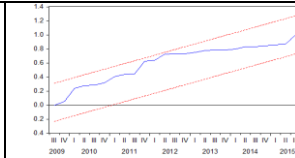
yardımıyla mevsimsel etkilerden arındırılarak analize dahil edilmiştir. Bağımsız değişkenler ise yine aynı şekilde üç temel risk göstergesidir. Burada ise risk göstergelerinin reel sektör üzerindeki etkileri analiz edilmiştir. Yine yapılan Quandt-Andrews (Quandt, 1960:327) yapısal kırılma testi sonucunda 2008Q4 dönemi kırılma dönemi olarak belirlenmiş ve kukla değişken olarak modele dahil edilmiştir.

Reel sektörü etkileyen ülke riski değişkenlerine ilişkin Tablo 9'de yer alan ARDL model tahmin sonuçları finansal sektörden farklı bir durum sergilemektedir. Reel sektörde tersine bir yaklaşımla finansal riskin sanayi üretim endeksi üzerindeki etkisi negatif ve anlamlıdır. Burada gecikmeli birinci dönem performans katsayısı (SUE(-1)) olumlu iken; gecikmeli ikinci dönem performans katsayısı (SUE(2)) negatif olup her iki katsayı istatistiki olarak anlamlıdır. Sektörde gecikmeli birinci dönem katsayısının pozitif olmasının nedeni, reel sektörün ülke riski değişkenlerinden finansal risk göstergesine daha gecikmeli bir tepki vermesiyle açıklanabilir. Nitekim ekonomik ve politik risk göstergelerinin gecikmeli birinci dönem katsayılarının işaretleri beklentilerle uyumlu olsa da etkisi anlamlı bulunmamıştır.

Diğer önemli bir sonuç ise, özellikle finansal risk göstergesinin etkilerinin anlık olmaktan ziyade reel sektörde 2 veya 3 çeyrek gecikmelerle ortaya çıkabilen sonuçlar yaratmasıdır. Yine bunalım dönemlerinin reel sektör üzerinde daraltıcı etkisi oldukça nettir. Bankacılık sektörü ve reel sektör karşılaştırılırsa, ülke riski bileşenlerinden finansal riskin reel sektöre etkisi oldukça büyüktür. Sektöre yönelik trend değişkeninin anlamlı olması, ortalamadaki kaymanın yanı sıra 2001 Türkiye krizinin ardından, 2002 yılından itibaren rejim değişimine yol açan sonuçların doğduğu şeklindeki yorumları destekler niteliktedir. Reel sektörde kısa dönem bulgularından ziyade, parasal ve ticaret kanallarının eş zamanlı uyumluluk sergilememesi nedeniyle uzun dönem tahmincilerin daha güvenilir sonuçlar vermesi beklenir. Nitekim, Tablo 9'da reel sektöre yönelik ARDL modelinden elde edilen uzun dönem katsayı sonuçları incelendiğinde; ekonomik ve politik riskin uzun dönemde sanayi üretim endeksi üzerinde anlamlı bir etki yaratmadığı görülmektedir. Buna karşın finansal risk göstergesinin sanayi üretim endeksi üzerinde negatif ve anlamlı bir etkisinin olduğu görülmektedir. Ancak ülke riskini etkileyen değişkenlerdeki dalgalanmalar, kısa ve kırılma dönemlerinde sektör performansını olumsuz etkilemekle birlikte, trend değişkeninin pozitif ve anlamlı olması, politik ve ekonomik risk göstergelerinin etkisizliğine işaret sayılabileceği gibi, bu durumu sanayi üretim endeksindeki bir artış da doğrulamaktadır. Reel sektör modelinin tüm tanı istatistiklerine göre tahminciler bütünüyle güvenilir düzeydedir.

Tablo 10'da yer alan reel sektör hata düzeltme modelinin tahmin sonuçları değerlendirildiğinde; kısa dönemde değişkenler arasındaki sapmalar yaklaşık (1/0,19=5,2 çeyreklik dönem) 15 ay sonra ortadan kalkmaktadır. Bu etki yaklaşık 4,5 ay olan finansal sektör ile karşılaştırıldığında oldukça büyüktür. Yani reel sektörde dört kata yakın, bir yıl aralıklı bir gecikme ile telafi edilebilmektedir. Bu durum ekonomideki belirsizlik ve risklerin reel sektör üzerinde daha kalıcı, daha etkin ve refah yaratmada daha olumsuz bir etkinin hissedildiğini göstermektedir.

Tablo 10: Reel Sektör Kısa Dönem Hata Düzeltme Modeli Sonuçları

Bağımlı Değişken: ΔSUE			
Bağımsız Değişkenler	Katsayılar		t istatistiği
$\Delta SUE (-1)$	0,222	**	2,134
ΔER	-0,110		-1,437
$\Delta ER (-1)$	-0,269	***	-3,390
ΔFR	0,010		0,123
$\Delta FR (-1)$	-0,256	**	-2,623
$\Delta FR (-2)$	0,117		1,180
$\Delta FR (-3)$	-0,135	*	1,679
ΔPR	-0,137		-0,898
$\Delta PR (-1)$	-0,865	***	-4,508
$\Delta PR (-2)$	-0,450	***	2,788
ΔDUM	-10,382	***	-4,488
TREND	0,224	***	3,873
ECM(-1)	-0,184	***	-3,421
$R^2=0,569$	Düzeltilmiş $R^2=0,489$		F-ist=7,132 (0,000)
B-G(4) =0,141(0,966)	B-P-G =0,671 (0,086)		J-B=0,657 (0,719)
R-R= 0,221(0,825)	 <p style="text-align: center;">Cusum Testi</p>		 <p style="text-align: center;">Cusum-Squares Testi</p>

*Not: B-G, Breusch-Godfrey otokorelasyon testini; B-P-G, Breusch-Pagan-Godfrey değişen varyans testini; Jarque-Bera, normallik testini ve R-R, Ramsey-Reset model kurma hatası testini ifade etmektedir. Cusum ve Cusum-Squares testleri katsayıların yapısal istikrarlılığı testini göstermektedir. Parantez içindeki değerler olasılık değerlerini göstermektedir. Parantez içindeki değerler % 5 önem düzeyinde olasılık değerleridir. *, **, *** sırasıyla %10, %5 ve %1 önem düzeylerini göstermektedir.*

Tahmin sonuçlarına yönelik istikrar testleri incelendiğinde ise modelin temel istikrar koşullarını sağladığı görülmektedir. Katsayıların istikrarlılığını gösteren Cusum ve Cusum-Squares test sonuçlarına göre ele alınan dönemde katsayıların istikrarlılığı sağlanmıştır. Cusum-Square testi sonuçları değerlendirildiğinde 2009Q2 döneminde katsayıların istikrarlılığını bozan outlier (sapan-uç değerler) tespit edilmiş ve bu değerlere yönelik outlier kuklası modele dahil edilmiştir. Böylece katsayıların istikrarlılığı sağlanmıştır.

4. Sonuç

Ekonomik, finansal ve politik risklerden oluşan ülke riski bileşenlerinden hangisinin bankacılık ve reel sektör performansları üzerinde daha etkili olduğunun araştırıldığı bu çalışmada, Türkiye özelinde 1993 Aralık – 2015 Eylül dönemine ait finansal sektörün performansını temsilen aktif karlılık oranı, reel sektörün performansını temsilen ise sanayi üretim endeksine ilişkin çeyreklik verilerden yararlanılarak temel hipotez test edilmiştir.

Bankacılık sektörü için ülke riski bileşenlerinden finansal risk değişkeninin katsayılarının anlamsız olması, karar alma birimlerinin sektör içindeki kaynak kullanımını etkileyen faktörleri kendi iç denetim mekanizmaları üzerinden kestirmiş olmaları ihtimaline bağlanabilmektedir. Nitekim sektör içindeki her karar alma birimi, risk yönetimine referans olacak değişkenleri analiz etmek; yurt içi ve yurt dışı parasal şokların potansiyel etkilerini önceden alınan sinyaller üzerinden yönetmek zorundadır. Diğer yandan karar alma birimlerinin bu başarı/başarısızlık hikayesini izleyen ve kurumsal ölçekte dış denetimden sorumlu olan Bankacılık Düzenleme ve Denetleme Kurumu, ülke riski bileşenlerinden finansal risklere yönelik izlenen yol haritasını gözlemek ve finansal piyasalar çerçevesinde yönlendirici göstergeleri paylaşmak konumundadır. Ayrıca ülke ekonomisinin para politikasına katkı sağlayan Merkez Bankası da iç ve dış denetimlerin zamanlar arası uyum sürecini dikkate alarak, yönetim stratejileri geliştirmektedir. Dolayısıyla bu durum, sektördeki finansal risklerin yaratabileceği olumsuz etkilerin kısmen de olsa önceden öngörülebilir olmuş olmasına ve anlamlı gecikmelere yol açılmamış olmasıyla ilişkilendirilebilir.

Öte yandan vekil değişkenlere (ROA ve SUE) ait performans serilerinin durağanlık test göstergelerinden aktif karlılık oranı (durağan) ve sanayi üretim endeksinin (durağan değil) entegrasyon derecesinin farklılığının yanı sıra; her iki sektörün performansını etkileyen değişkenlerin gecikme aralıkları da bankacılık sektöründe (1, 3, 1, 0); reel sektörde (2, 2, 4, 3) olup birbirinden farklıdır. Her iki sektör bağlamıyla ülke riski bileşenleri üzerinden gelen kısa dönemli sapmaların uzun dönemde ortadan kalktığına göstergesi sayılan hata düzeltme mekanizmalarındaki farklılıklar değerlendirildiğinde; sisteme gelen şoklar açısından bankacılık sektöründe kısa dönemli sapmaların yaklaşık 4,5 ay sonra ortadan kalktığı görülmektedir. Reel sektörde ise kısa dönemde değişkenler arasındaki sapmalar yaklaşık 15 ay sonra, yani dört kata yakın bir dönem aralıklı bir gecikme ile telafi edilebilmektedir. Bu durumlar ekonomideki belirsizlik ve risklerin reel sektör üzerinde daha kalıcı, daha etkin ve refah yaratmada daha olumsuz bir sonuç hissettirdiğini göstermektedir.

Yukarıdaki analitik bulgular bir bütün olarak değerlendirildiğinde; “Türkiye ekonomisi açısından ülke riski bileşenleri, zamanlar arası (1993 Aralık – 2003 Mart ve 2003 Haziran – 2015 Eylül) reel ve bankacılık sektörlerinin performansını farklılaşan zaman boyutuyla ve farklı derecelerde etkilemektedir” şeklindeki bu çalışmanın temel hipotezi doğrulanmıştır. Bu durumun nedeni, finans sistemindeki düzenlemelerin, kaynak tahsisi

açısından reel sektördeki düzenlemelere göre daha etkin olmasıdır. Nitekim bankacılık kesiminin reel sektör üzerinde kredi kanalıyla etkili olması düşünüldüğünde, bu kanal hem reel sektörün üretim gücüne, hem de bankaların aktif karlılığına yansımaktadır. Ancak bu yansıma sürecinde sektörler arası uyumsuzluğun ortaya çıkması politika başarısızlığı olarak değerlendirilebilir.

Zira bankacılık sektörü uluslar arası parasal piyasaların etkisi karşısında daha kısa zamanda uyum sürecine adapte olur iken; reel sektör hem parasal hem de ticaret kanallarının eş zamanlı uyum politikalarına bağlı olduğu için etkileşim sürecindeki gecikme uzunlukları bankacılık sektöründen farklılık göstermektedir. Ayrıca farklı entegrasyon derecelerine sahip değişkenler arasındaki eşbütünleşme ilişkisi dikkate alındığında kırılmalar arasındaki farklılıklar da ülke risk bileşenlerinin bankacılık sektörü üzerindeki etkisi ile reel sektör üzerindeki etkisini birbirinden farklılaştırmıştır.

KAYNAKÇA

- ALADA, Dinç (2000). İktisat Felsefesi ve Belirsizlik, Bağlam Yayınları, İstanbul.
- BREUSCH, Trevor S. (1978). “Testing for Autocorrelation in Dynamic Linear Models”, *Australian Economic Papers*, Cilt:17, ss. 334-355.
- GODFREY, Leslie George (1978). “Testing for Higher Order Serial Correlation in Regression Equations when the Regressors Include Lagged Dependent Variables”, *Econometrica*, Cilt: 46, ss. 1303-1310.
- AKAIKE, Hirotugu (1974). “A New Look At the Statistical Model Identification, IEEE Transaction on Automatic Control”, AC-19, ss. 716-723.
- SCHWARTZ, Gideon (1978). “Estimating the Dimensions of a Model”, *Annals of Statistics*, Cilt: 6, Sayı: 2, ss. 461-464.
- ÇAM, Alper Veli (2014). “Politik Riskin Firma Değeri İle İlişkisi: İMKB’ye Kayıtlı Firmalar Üzerinde Bir Uygulama”, *Doğuş Üniversitesi Dergisi*, Cilt: 15, Sayı: 1, ss. 109-122.
- DICKEY, David A. ve Wayne A. FULLER (1979). “Distrubition of the Estimators for Autogressive Time Series with a Unit Root”, *Journal of the American Statistical Association*, Cilt:74, Sayı: 366, ss. 427-431.
- ENGLE, Robert F. ve Clive W. J. GRANGER (1987). “Co-integration and Error Correction: Representation, Estimation and Testing”, *Econometrica*, Cilt: 55, Sayı: 2, ss. 251-276.

- ERB, Claude, Campbell R. HARVEY ve Tadas E. VISKANTA (1996). “Political Risk, Economic Risk, and Financial Risk”, *Financial Analysts Journal*, Cilt: 52, Sayı: 6, ss. 29-46.
- GRANGER, Clive W.J. ve Paul NEWBOLD (1974). “Spurious Regressions in Econometrics”, *Journal of Econometrics*, 2, ss. 111-120
- JOHANSEN, Soren (1988). “Statistical Analysis of Cointegration Vectors”, *Journal of Economic Dynamics and Control*, Vol. 12, No. 2–3, pp. 231–254.
- JOHANSEN, Soren ve Katarina JUSELIUS (1990), “Maximum Likelihood Estimation And Inference On Cointegration - With Applications To The Demand For Money”, *Oxford Bulletin of Economics and Statistics*, Cilt: 52, Sayı: 2, ss.169-210.
- KARA, Esen ve Lale KARABIYIK (2015). “The Effect of Country Risk on Stock Prices: An Application in Borsa İstanbul”, *Süleyman Demirel Üniversitesi İktisadi ve İdari Bilimler Fakültesi Dergisi*, Cilt: 20, Sayı: 1, ss. 225-239.
- KAYA, Abdulkadir, Bener GÜNGÖR ve M. Suphi ÖZÇOMAK (2014). “Politik Risk Yatırımcının Dikkate Alması Gereken Bir Risk Midir? Borsa İstanbul Örneği”, *Gazi Üniversitesi İktisadi ve İdari Bilimler Fakültesi Dergisi*, Cilt: 16, Sayı: 1, ss. 74-87.
- KHAN, Mashrur M. ve Mashfique I. AKBAR (2013). “The Impact of Political Risk on Foreign Direct Investment”, *International Journal of Economics and Finance*, Cilt: 5, Sayı: 8, ss. 147-156.
- MACKINNON, James G. (1991). Critical Values for Cointegration Tests, Chapter 13: In Long-Run Economic Relationships: Readings in Cointegration, ed. R. F. Engle ve C. W. J. Granger, Oxford University Press.
- PESARAN, M. Hashem, Yongcheol SHIN ve Richard J. SMITH (2001). “Bounds Testing Approaches to the Analysis of Level Relationship”, *Journal of Applied Econometrics*, Cilt:16, Sayı:3, ss. 289-326.
- PHILLIPS, Peter C. B. ve Pierre PERRON (1988). “Testing for a unit root in time series regression”, *Biometrika*, Cilt: 75, Sayı: 2, ss. 335–346.
- PÜTZ, Theodor (1994). Kuramsal Ekonomi Politikasının Temelleri, Çeviren: Naci KEPKEP, Der Yayınevi, 4. Baskı, İstanbul - Türkiye.

- QUANDT, Richard E. (1960). “Tests of the hypothesis that a linear regression system obeys two separate regimes”, *Journal of the American Statistical Association*, Cilt: 55, Sayı:290, ss. 324-330.
- RAMADY, Mohamed A. (2014). *Political, Economic and Financial Country Risk: Analysis of the Gulf Cooperation Council*, Springer International Publishing, ISBN: 978-3-319-02176-8.
- ROSIER, Dani (2007). *One Economics, Many Recipes: Globalization, Institutions and Economic Growth*, Princeton University Press, New Jersey – ABD.
- The PRS Group, *International Country Risk Guide*, Erişim adresi: <http://epub.prsgroup.com/products/international-country-risk-guide-icrg>, (28.08.2015).
- Türkiye Bankalar Birliği, *Veri Sorgulama Sistemi, Mali Tablolar*, <http://www.tbb.org.tr/banka-ve-sektor-bilgileri/veri-sorgulama-sistemi/mali-tablolar/71>, (28.08.2015).
- Türkiye Cumhuriyeti Merkez Bankası, *Elektronik Veri Dağıtım Sistemi*, Erişim adresi: <http://evds.tcmb.gov.tr/yeni/arsiv-tr.html>, (28.08.2015).
- YAPRAKLI, Sevda ve Bener GÜNGÖR (2007). “Ülke Riskinin Hisse Senedi Fiyatlarına Etkisi: İMKB 100 İndeksi Üzerine Bir Araştırma”, *Ankara SBF Dergisi*, Cilt: 62, Sayı: 2, ss. 199-218.
- ZIVOT, Eric ve Donald W. K. ANDREWS (1992). “Further Evidence on the Great Crash, the Oil-Price Shock and the Unit Root Hypothesis”, *Journal of Business and Economic Statistics*, Cilt: 10, Sayı: 3, ss. 251-270.

Doğrudan Yabancı Sermaye Yatırım İkliminin Oluşturulmasını Belirleyen Faktörler

Factors to Specify the Creation of Foreign Direct Investment Climate

Hakkı ÇİFTÇİ¹

ÖZET

Bu araştırmada dolaysız yabancı sermaye yatırımları ile finansal yabancı sermaye yatırımlarının ekonomilerin kaynak dağılımı ve üretim etkinliği üzerindeki etkileri analiz edilmiştir ve doğrudan yabancı sermaye yatırımları etkileyen faktörler ülke ekonomisi üzerindeki ekonomik, finansal, sosyal, politik, teknolojik etkilerin Yabancı sermaye yatırımlarının etkinliği ve reel sektörün performansı tespit edilmesi amaçlanmıştır. Bir diğer deyişle bu çalışma yabancı sermaye yatırımları ülkelerin kaynak kullanımını olumlu ve olumsuz etkileyen bileşenleri analiz etmeyi amaçlamaktadır. Çalışma, bu etkileşim çağında doğrudan yabancı yatırımlar (DYY)'yi incelemeyi amaçlamaktadır. Bu doğrultuda çalışmada DYYnin tanımı ve çeşitleri tanıtılmış, DYY ve teorileri, DYY'yi etkileyen faktörler incelenmiş, dünya gerçekleştirmeleri verilmiş, son olarak da DYY'nin büyüme ve yatırım iklimleri üzerindeki etkileri incelenmiştir. Bu kapsamda Yabancı sermaye yatırımları ve teorileri, belirleyicileri analiz edilmiştir. Dünyadaki yabancı sermaye belirleyicileri ve göstergeleri incelenmiş son olarak da yabancı sermaye yatırımlarının ekonomik büyüme ve uygun yatırım iklimleri üzerindeki etkileri incelenmiştir. Yabancı sermaye yatırımlarının ekonomik rekabet üzerindeki performansı analiz edilmiş ve reel sektöre çarpan etkisi olduğu tanımlanmış ve yabancı sermaye yatırımları için reel sektör üzerindeki ekonomik ve politik katkıları ve önemli etkileri gözden geçirilmiştir.

Anahtar Kelimeler: Doğrudan yabancı sermaye, yatırım koşulları, rekabet, itici ve çekici faktörler

ABSTRACT

Theories on foreign direct investment (FDI) often claim that foreign investment help bring a more efficient allocation of capital across countries. it is aimed **the factors that effect Foreign Direct Investments(FDI)** to determine which one of the countries economy components consisting of economic, financial, social, technological and political affects efficiently FDI and reel sectors' performance. In other words, it is aimed to analyze of FDI of the countries components affecting negatively and positively resource use, by determining the relation between country economies and sectoral performance. The study aims to analyze foreign direct investment (FDI) in the aforementioned epoch of interaction. In this context the definition of FDI and theories, the determinants of FDI are analyzed, indicators of FDI determinants for the world are examined, FDI are examined and lastly by examining the effects of FDI on economic growth and climates of suitable investment.As regards, FDI is analyzed the performance on competition in economy. We describe on foreign trade for real sector as multiplier. it is concluded that economic and politic contributions; significant effect on real sector.

Keywords: Foreign direct investment, competition, conditions of investments, push and pull factors

¹ Yar.Doç.Dr., Çukurova Üniversitesi İktisadi ve İdari Bilimler Fakültesi İktisat Bölümü, hciftci@cu.edu.tr

1.GİRİŞ

Bir ekonomide, doğrudan yabancı sermaye yatırımı, dışa açılmayı yararlı hale getirebilmek için ve dış pazar oluşturabilmek amacıyla; yatırılabilir kaynakların kişi ve kuruluşlar tarafından bir başka ülkeye taşınması yada bir ülkede bir firmayı satın almak veya yeni kurulan bir firma için kuruluş sermayesini sağlamak veya mevcut bir firmanın sermayesini artırmak yoluyla o ülkede bulunan firmalar tarafından diğer bir ülkede bulunan firmalara yapılan ve kendisiyle birlikte teknoloji, işletmecilik bilgisi ve yatırımcının kontrol yetkisini de beraberinde getiren yatırımdır(Karluk, 2001). Dolaysız yabancı yatırımlar diğer uluslar arası sermaye hareketlerinden farklı olarak marka, teknoloji, işletmecilik bilgisi, patent, tescil, fikri ve mülki katkılar, know-how gibi “maddi olmayan varlıkların” (intangible assets) transferini, absorbesini, yayılmasını, masedilmesini ve yatırımcıya yatırımını kontrol etme yetkisini de içerir. Bu nedenle yatırım fonlarının kaynağı ile fonların kullanımı arasında doğrudan bir ilişki vardır (Hymer, 1960; Kindleberger, 1971). Dolaysız yabancı yatırımlar (DYY); yatırımlarının sermaye birikimini hızlandırması ile , “kaynak dağılımı etkinliği”, üretimi artırması ile “üretim etkinliği”, artan üretime bağlı olarak üretim faktörlerinin aldıkları paydaki değişim ise “dağılım etkisi” olarak ifade edilmektedir(Kula, 2003). Yatırımı kontrol etme yetkisinin yabancı da olması nedeniyle, DYY’nın “bağımsızlık etkisi “de söz konusu olmaktadır. DYY’na bağlı olarak ulusal firmaların verimliliklerinde ortaya çıkan artış olarak “Sektörel Taşma etkisi” de ortaya çıkmaktadır. Bu etki sonuç olarak üretimi arttıracığından üretim etkinliğinin bir parçası olarak düşünülebilmektedir. gelişmekte olan ülkeler için öncelikle yatırımları için ek dış kaynak olmaktadır. Bu dışkaynak temini hem ekonomiye katkı sağlayacak hem de yeni teşebbüsleri tanıyacaktır. Öncelikle yabancı sermaye “bilgi taşması etkisi” (knowledge spillovereffect) yaratacak, bu yolla kaynak dağılımı etkinliğini arttıracak ve gelişmekte olan ülkelerin doğrudan yabancı sermaye açısından uygun iklimler ve ekonomiye olumlu katkılar sağlayacaktır(Kruger, 1987). Doğrudan yabancı sermaye akımları ise hisse senedi, tahvil ve bankacılık sektörü kanalıyla ülkeye gelir. Fonlar mali piyasalarda kullanıcıların eline geçtikten sonra, genellikle fon kaynağı ile fonun kullanılması arasında doğrudan bir bağlantı kalmaz. Menkul değerler biçiminde gerçekleşen “sıcak para” girişi olarak adlandırılır. Uluslar arası Para Fonu (IMF) istatistiklerinde özel yabancı yatırımlar; dolaysız yabancı yatırımlar (foreign direct investment), portföy yatırımları (portfolio investment) ve diğer yatırımlar(other investment) olmak üzere üç ana kategori içinde sunulmaktadır(World Bank, 1997): dışa açılma sonucunda gelen yabancı sermaye sonucu yurt içi yatırımlar arttıracaktır(Kazgan,G,1988). Ayrıca yabancı sermaye yatırımları yatırımcıların uygun yatırım iklimlerinde dışa açılmasını sağlayıcı, bu sayede ekonomik bünyeyi sağlamlaştırıcı desteklerle yurt içi yatırım ve tüketim harcamalarındaki dalgalanmalar sonucu ortaya çıkabilecek riski dış pazardan telafi edici özelliği ile dışa açılma açısından risk ve belirsizliği ortadan kaldıracak, düşük gelire bağlı olarak ortaya çıkan düşük tasarruf ve düşük yatırım döngüsü, az gelişmiş ülkeleri dış tasarruflara yönlendirerek ekonominin kaynak dağılımı ve üretim etkinliği üzerindeki etkileri ile büyümesine katkı sağlayacaktır(Lucas,R.E. Jr,1988). Yabancı doğrudan yatırımlar sermaye birikiminin ve teknoloji seviyesinin yeterli

düzye de olmadığı az gelişmiş ve gelişmekte olan ülke ekonomilerinin ekonomik büyümeleri açısından önemlidir. Adeta bir can simidi olarak vazife görecektir. Yatırımcılar her şeyden önce iyi işleyen pazar ekonomisine sahip olan ve bürokratik gerekliliklerin minimum olduğu ülkeleri tercih ederek olumlu katkıları elde edeceklerdir. Yabancı sermaye yatırımları Ülkeleri, politik ve ekonomik istikrardan vergilere, teşviklere, yatırım yerlerine, lojistik maliyetlere, personel maliyetlerine, kalifiye işgücünün varlığına, ulaşım, iletişim ve enerji maliyetleri ve altyapı koşullarına kadar çok çeşitli alanlarda karşılaştırmaktadırlar(KOYUNCU,Fatma Turan 2010). Bir ülke belirtilen faktörlerin hepsinde iyi olmayabilir, birinde çok iyi diğerlerinde ortalamasının altında olabilir. Burada yatırımcıların son kararını şekillendiren şey tüm faktörlerin birleşimidir. Günümüzde hız kazanan küreselleşme olgusu ile birlikte doğrudan yabancı yatırımlar, az gelişmiş ve gelişmekte olan ülke ekonomileri için teknoloji ve bilgi transferi etkileri, istihdam artışları, uluslararası piyasalara erişim imkanları nedeniyle çok önemli bir unsur haline gelmiştir. Küreselleşmenin getirdiği avantajlardan daha fazla yararlanabilmek için, yabancı doğrudan yatırımları teşvik eden, daha fazla yabancı doğrudan yatırım çekme özellikleri olan bir yatırım ikliminin geliştirilmesi gerekir. Yabancı yatırımcılar yatırım yapacakları ülkeyi seçerken yatırım iklimi ölçütlerini değerlendirerek kararlarını vermektelerdir. Bu nedenle iyi bir yatırım ikliminin iktisadi büyümeyi hızlandırma potansiyellerinden birisi ve belki de en önemlisi DYY üzerindeki pozitif etkisidir(Bulut, Mustafa, 2009). Bu çerçevede gelişmiş ve gelişmekte olan ülkeler gibi DYY'den azami faydayı sağlayacak ve uygun yatırım iklimleri oluşturacak politikalar geliştirmeli ve hedefler belirlemelidir.

2. Doğrudan Yabancı Sermaye Yatırımlarının Teorik Değerlendirmesi, Türleri ve Yazın Özeti

Doğrudan yabancı sermaye yatırımlarına ilişkin ekonomi politikası bir teorileşme temeline dayanmaktadır. Bu bağlamda, bir toplumdaki refahın artırılması ve Pazar payının genişlemesi, dışarıdan kaynak teminiyle tasarruf yetersizliğinin giderilmesi nihai amacıyla doğrudan yabancı sermaye yatırımları, ilke ve kurumların biçimlendirdiği bir sisteme dayanan ekonomik düzen içinde gerçekleşmek durumundadır. Ekonomik karar alma birimlerinin doğrudan yabancı sermaye yatırımları ile ilgili özgün davranışları ile ekonomik faaliyetlerin işleyişine yönelik uygun yatırım iklimlerinin oyun kurucu aktörler/kurumlar tarafından kurgulanan düzen arasındaki ilişki, ekonomik sistemi anlamada ve kurumsal alt yapının varlığı teorik açıdan oldukça önemlidir(North, 1990).

Buna göre, Sermaye hareketleri ile ilgili olarak, DYY ve portföy yatırımı ayrımı yapılmaksızın uluslararası sermaye hareketlerini analiz eden Marksist ve NeoKlasik yaklaşımlarda sermaye hareketleri gelişmemişlik ve faiz farklılıklarına dayandırılarak açıklanmıştır. Bunun yanı sıra Üretim Düzeyi Hipotezi; mikro seviyede bir firmanın bir ülkede yaptığı yabancı yatırımlarla yine aynı firmanın çıktısı (satışları) arasında pozitif bir ilişki olduğunu ileri sürerken, Pazar Büyüklüğü hipotezi; makro seviyede milli

gelirle ifade edilen bir ülkenin Pazar büyüklüğü ile yabancı yatırımlarının pozitif bir ilişki içinde olduğunu ileri sürmektedir. Klasik varsayımlara dayanan bu hipotezlerde, İlk ve Tekeli'nin de işaret ettiği gibi, firmaya özgü nedenlerden çok, yatırım yapılan ülkelere özgü nedenler üzerinde yoğunlaşmıştır. Yukarıdaki yaklaşımlardan farklı olarak, DYY'lerle ilgili ilk modern yaklaşım, 1960'lı yıllarda ülkeye özgü faktörlerden çok, firmaya özgü faktörler üzerinde yoğunlaşan Hymer ve Kindleberger tarafından gerçekleştirilmiştir. DYY'lerle ilgili teorik yaklaşımlarında Hymer ve Kindleberger, DYY'lerin yalnızca uluslararası faiz farklılıklarıyla açıklanamayacağını ileri sürerek, uluslararası alanda yapılan doğrudan yatırımların nedeninin, piyasalardaki oligopolistik endüstriyel yapı olduğunu belirtmişlerdir. Yazarlar, yabancı firmaların bir ülkede bir üretim yeri kurmada ve işletmede yerli firmalarla karşılaştırdığında ekonomik anlamda bazı avantaj ve dezavantajlara sahip olduğunu ve yabancı firmaların, mevcut ya da potansiyel yerli rakiplerin erişemeyecekleri bazı avantajları elde etmek için doğrudan yatırım yaptıklarını ifade etmişlerdir. Bu bağlamda Hymer ve Kindleberger, yabancı firmaların belirtilen avantajlara sahip olmak için DYY yaptıklarına işaret etmişlerdir. Ancak bu teorik yaklaşım, yukarıda belirtilen avantajlara sahip olan yabancı firmaların neden doğrudan yatırım yaptıklarını tam açıklayamadığı yönünde eleştirilmiş ve çeşitli iktisatçılarda birçok yeni teorinin geliştirilmesine neden olmuştur. Daha sonraları Vernon, ürün yaşam dönemi teorisini kullanarak DYY teorisi geliştirmiştir. Vernon yaklaşımında; ürün yaşam dönemlerinin sonundaki üretici firmanın, üretimini lisans anlaşmalarıyla üçüncü ülkelere kaydırmak yerine, üretimin yapılacağı ülkeye doğrudan kendisinin yatırım yapmasının daha kârlı olabileceği ortaya konulmaktadır. Genel olarak ihracata yönelik yabancı yatırımlar bu hipoteze göre değerlendirildiğinde, yabancı yatırımcıların özellikle teknolojinin standart hale geldiği aşamada üretimin maliyetini düşürmek için yatırımlarını emeğin ucuz olduğu GOÜ'lere kaydıkları görülmektedir. Knickerbocker tarafından ortaya atılan ve özellikle GÜ'lerdeki DYY'lerin oligopolistik bir tepkinin sonucunda ortaya çıktığını iddia eden bir teoriye göre; herhangi bir ülkede pazar payını artırmak için rakip bir firmaya yapılan yatırım, ardından pazar paylarını korumak isteyen oligopol durumdaki diğer firmaları da bu ülkede yatırım yapmaya itecektir. Buckley ve Cason'un ileri sürdüğü ve Dunning ve Rugman'ın da katkıda bulunduğu içselleştirme teorisine göre, yabancı yatırımı gerçekleştiren firmaların bulunduğu piyasaların birçok düzensizlik ve risk içermesi, firmaların kendi üretim faaliyetleri ile ilgili olan başka piyasalara DYY yapmalarına yol açmaktadır. Bu teoriye göre içselleştirme, yabancı yatırımı gerçekleştiren firmaların buldukları piyasalardaki mevcut ticaret ve yatırımların verimliliğini azaltan, üretim süreçlerini olumsuz etkileyen piyasa aksaklıklarından kurtulmak ve bundan kazanç elde etmek için başka piyasalara yönelme çabalarıdır. İçselleştirmenin firmalara sağladığı faydalar; gecikme, pazarlık ve müşteri belirsizliklerinden kaçınabilme, ticaret engellerinin varlığı, sermaye hareketlerine konan sınırlamalar ya da ülkeler arasındaki vergi oranı farklılıkları gibi hükümet kontrollerinin etkilerini en aza indirecek şekilde firma içi fiyat oluşturulabilme ve piyasalar arasında fiyat farklılaştırması uygulayabilme olanağı şeklinde sıralanabilir. Dunning tarafından 1973'de geliştirilen ve genel bir DYY kuramı oluşturma amacına yönelik yaklaşıma göre DYY; sahipliğin, alansal avantajların ve içselleştirmenin bir fonksiyonudur. Dunning, bu değişkenleri bir firmanın belirli bir

DYY kararı vermesi için tatmin olmak zorunda olduğu koşullar haline getirmiştir. Caves tarafından geliştirilen ve daha çok yabancı yatırımcıların yatırım stratejilerini açıklamaya yönelik olan yaklaşıma göre, yabancı yatırımcı ya pazar yapısından dolayı daha çok mal farklılaştırması uygulayarak değişik ülkelerde aynı malı üretmek için, ya da bir malın alt üretim süreçlerini içermek için DYY yapmaktadır. Bunun dışında Evans, 1990'lı yılların ortalarından itibaren yabancı yatırımlardan pay alabilmek için özellikle GOÜ'ler arasında rekabet ortamı doğduğunu ileri sürmüştür(YAPRAKLI Sevda(2006), ÖZCAN Burcu, ARI Ayşe(2010).

Özetlenecek olursa, teorik bağlamda DYY'leri etkileyen faktörler konusunda tam bir görüş birliği sağlanamamakla birlikte, açıklamaların birbirini tamamlayıcı nitelikte olduğunu söylemek mümkündür. Bu bağlamda, DYY'leri etkileyen çeşitli faktörlerin etkinliğini analiz etmek, DYY çekme konusunda izlenecek politikaların başarısı açısından önem arz etmektedir. Ekonomik büyüme ve kalkınma açısından DYY'nin öneminin farkına varan ülkeler artık aşağıda açıklanan koşulları sağlamaya çalışmakta, çeşitli politik ve kurumsal düzenlemeler yolu ile yabancı yatırımlar için ülkeleri-ni cazip hale getirmektedirler. Dunning,DYY'nin bir ülkeye girmesi için üç koşulun eş anlamlı olarak sağlanması gerektiğini ileri sürmekte ve bunu OLI paradigması olarak adlandırmaktadır. Bunlar; Firmanın sahiplik avantajına sahip olması (Ownership), Yabancı pazarın mekânsal bir avantaj sunması (Location) içselleştirme avantajının (Internalization) söz konusu olmasıdır.

Sahiplik avantajı, firmaya özgü varlıklardan (ürün,teknoloji, patent, marka vb.) ibarettir. İçselleştirme avantajı, ürünü ya da süreci uluslar arası lisanslama ya da franchising yolu ile pazarlamak yerine, söz konusu ülkede birebir üretim yapmak ile sağlanmaktadır. Mekânsal avantaj, firmanın üretim yapacağı ülkedeki faktör fiyatlarını, hükümetin ticari düzenlemelerini, döviz kurlarını, kurumsal ve politik istikrarını içermektedir. Ekonomik sistemin açıklık, serbestlik ve etkinlik ilkeleri temelinde, ekonomik yapıya ilişkin olarak sektörler arası ilişkiler öne çıkmaktadır. Bir başka deyişle, küresel piyasa ekonomisinin akışları bağlamında bir ekonomide kaynakların etkin kullanılabilmesi amacıyla sektörel performansların nasıl bir seyir izlediği önemli olmaktadır. Bu doğrultuda bir ülke ekonomisinin ne gibi riskler altında küresel ekonomiyle iç içe faaliyet gösterdiği konusu üzerinde durulması gerekmektedir(ÖZCAN Burcu, ARI Ayşe(2010),Bevan ve Saul Estrin, 2004; Dunning, 1993).

Doğrudan Yabancı Sermaye(DYY) üzerinde birçok faktörün etkili olmasının nedeni, DYY'nin farklı türlerinin mevcut olması ve bu türlerin farklı etkenlerden etkilenmesidir. DYY, genellikle dikey ya da yatay biçimde sınıflandırılmaktadır. Dikey (vertical) DYY,firmanın üretim zincirinin coğrafik yerleştirilmesini içermektedir. Düşük ücretli ülkelerdeki yabancı iştirakler, emek yoğun ara ürünler üretmekte ve bu ürünler daha sonra yüksek ücretli ülkelere,genellikle de ana şirketin kendi ülkesine gönderilmektedir. Sermaye yoğun aşamalar ise, nispeten sermaye zengin ülkelerde gerçekleştirilmektedir. Dikey DYY“Etkinlik arayan DYY”, maliyetin en aza indirgenmesini amaçlayan dikey DYY “ Hammadde arayan DYY” olarak da

adlandırılır. Bu yatırım türü, ev sahibi ülkenin pazar büyüklüğünden değil de ülkeler arasında, faktörlerin ve hammaddelerin miktar ve fiyat farklılıklarının söz konusu olmasından ve farklı üretim teknolojilerinin varlığından etkilenmektedir “Pazar arayan DYY” olarak da adlandırılan Yatay(horizontal) DYY, yerel pazara hizmet vermeyi amaçlamaktadır. Bu yatırım türünün amacı, pazara yönelik üretim sırasında ortaya çıkan maliyetleri asgari düzeye indirmek ve/ya da değişen yerel şartlara ve tercihlere cevap vererek rekabetçiliği arttırmaktır(ÖZCAN Burcu, ARI Ayşe(2010).

Tablo:1. DYY'nin Farklı Türlerinin Ev Sahibi Ülkelerin Rekabet Yapıları Üzerindeki Olası Katkıları;

Doğal kaynak arayışında olan DYY	*Tamamlayıcı varlıklar sağlar (teknoloji, yönetim gibi) *Yabancı piyasalara erişim sağlar. *Üretim kalitesi standartlarını yükseltir.
Pazar arayışında olan DYY	*Tamamlayıcı varlıklar sağlar (teknoloji, yönetim gibi) *Geri kalmış üretim bağlantılarını, özelleşmiş emek piyasalarını destekler. *Yerli rakiplerin ulusal tüketicilerinin beklentilerini yükseltir. *Yerel girişimciliği ve ulusal rekabeti tetikler
Etkinlik arayışında olan DYY	*Sınır ötesi ağlaşma ve emeğin uluslar arası dağılımını geliştirir. Ev sahibi ülkenin nispi avantajlarını artırır. *Yabancı pazarlara ve arz kaynaklarına erişim sağlar. *Geri kalmış üretim bağlantılarını, özelleşmiş emek piyasalarını düzenler. *Üretim kalitesi standartlarını yükseltir. *Yapısal düzenlemeleri etkinleştirir.
Stratejik varlık arayışında olan DYY	*Yeni finans sermayesi ve tamamlayıcı varlıklar sağlar. *Yabancı pazarlara erişim sağlar. *Yerel girişimciliği ve ulusal rekabeti tetikler. *Sınır ötesi ağlaşma ve emeğin uluslar arası dağılımını geliştirir.

DUNNING, J.H. (1981), “Explaining the International Direct Investment Position of Countries: Towards a Dynamic or Developmental Approach”, *Weltwirtschaftliches Archiv*, 117, pp. 30–64.

ÖZCAN Burcu, ARI Ayşe(2010), Doğrudan Yabancı Yatırımların Belirleyicileri Üzerine Bir Analiz: OECD Örneği, *Ekonometri ve İstatistik Sayı: 12* 2010 65–88

COSKUN Recai, (2001) "Determinants of direct foreign investment in Turkey", *European Business Review*, Vol. 13 Iss: 4, pp.221 – 227 <http://www.emeraldinsight.com/doi/abs/10.1108/EUM000000005536> ISSN: 0955-534X Online from: 1989

Bu politikalar çerçevesinde verimliliğe dayalı ücret sistemine geçilmesinin, nitelikli işgücü istihdamının artırılmasının, ülkede faaliyet gösteren yabancı firmaların ulusal girdi kullanımını artırıcı teşvikler verilmesinin, dış ticarete açıklığın önündeki görünmez engellerin kaldırılmasının ve dış ticaret açıklarını azaltmaya yönelik kalıcı önlemler alınmasının, ihracatı geliştirici nitelikteki yatırımların ülkeye çekilmesi açısından gereklilik arz ettiği ifade edilebilir.

Tablo 2: Yazın Özeti

Yazarlar	Sonuç
Bandera-White(1968) ile Scaperlanda, Mauer'e(1969), Schmitz ve Bieri (1972),Root ve Ahmed (1979), Culem (1988), Mcculloch (1993), Shamsuddin (1994), Billigton (1999), Pistoresi (2000), Chakrabarti (2001) ve Akinkugbe (2005)	Piyasa Hacmi ile DYY Arasındaki İlişki;Piyasa hacmi ve potansiyel talep yapısı, ev sahibi ülkenin GSYİH'sı ile ölçülmektedir. Piyasa hacminin DYY üzerindeki etkisini belirlemek amacıyla
Saunders (1982),Flam (1984), Shamsuddin (1994) ve Pistoresi (2000)	İşgücü Maliyeti ile DYY Arasındaki İlişki: DYY'lerin belirleyicileri arasında en tartışmalı olanı işgücü maliyeti ve işgücü maliyetinin en önemli göstergelerinden biri olan ücretlerdir.Yaptıkları çalışmalarda, düşük işgücü maliyetlerinin DYY'leri cezbediği sonucuna ulaşmışlardır.
Swedenborg (1979), Wheeler ve Mody(1992), Kotler ve Maesincee (2000)	düşük işgücü maliyetlerinin DYY'leri cezbetmede etkili olamayacağı ev sahibi ülkedeki düşük ücret düzeyi, düşük verimlilik ve niteliksiz işgücü istihdamından kaynaklanıyorsa ve DYY yapan firmalarda ücretler üretim maliyetlerinin küçük bir payını oluşturuyorsa, düşük işgücü maliyetleri, yabancı yatırımcılar için maliyet avantajını ortadan kaldırarak DYY yapmayı cazip olmaktan uzaklaştırır
Rolfe ve White (1992), Sader (1993) ve Tsai (1994)	yapılan çalışmalarda ise işgücü maliyetleri ile DYY arasında önemli bir ilişki olmadığı sonucuna ulaşılmıştır.
Clegg and Gren, 1999: Chakrabarti, 2003	DYY literatüründe rekabet gücünün göstergesi olarak kabul edilen döviz kuru, DYY'leri gelir ve maliyet etkisi olmak üzere iki şekilde etkilemektedir. Döviz kurlarının yükselmesi durumunda, üretimi ihracata yönelik yatırımcının üretiminde ulusal girdi kullanımını artırması, yatırımcının ihracatının ve karının artmasına imkan sağlayacaktır. Buna gelir etkisi denilmektedir ve bu durumda döviz kurunun yükselmesi DYY'leri pozitif yönde etkilemektedir. Diğer taraftan döviz kurunun yükselmesi durumunda, ihracata yönelik yatırımcının üretiminde ithal girdi kullanması ve ithal girdi bağımlılığının yüksek olması, yatırımcının ihracatının ve karının düşmesine neden olabilecektir. Buna ise maliyet etkisi denilmektedir ve bu durumda döviz kurunun yükselmesi DYY'leri negatif yönde etkilemektedir. Döviz kurlarının DYY üzerindeki net etkisi, gelir ve maliyet etkisinin büyüklüğüne göre değişmektedir. Gelir etkisi maliyet etkisinden büyükse, döviz kurunun yükselmesi DYY' leri pozitif, maliyet etkisi gelir etkisinden büyükse negatif yönde etkilemektedir. Bu konuda yapılan uygulamalı çalışmalarda tam bir fikir birliğine varılamamıştır.
Edwards (1990)	kur değişmelerinin DYY'yi pozitif etkilediği sonucuna ulaşmış
Contractor (1990), Froot ve Stein (1991), Blonigen ve Feenstra (1996)	kur değişmelerinin DYY'yi negatif yönde etkilediği sonucuna varmışlardır.

Calderon ve Jorge (1985), Sader (1991), Tuman ve Emmert (1999)	yaptıkları çalışmalarda kur değişmelerinin DYY'yi iki değişken arasında önemli bir ilişki bulamamışlardır.
(Kazgan,1988).Kravis ve Lipsey (1982) Culem(1988),Edwards(1990),Pistoresi(2000)	Dışa Açıklık ile DYY Arasındaki İlişki: Bir ülkenin dışa açıklık derecesi genellikle,dış ticaret hacmi (ihracat+ithalat)/ GSMH oranı ile ölçülmektedir. dışa açıklık derecesinin DYY üzerinde güçlü bir pozitif etkiye sahip olduğu yönünde sonuçlar elde etmişlerdir. Buna göre dışa açıklık derecesi arttıkça ülkeler daha fazla DYY çekebilmektedirler.
Schmitz ve Bieri (1972) ve Wheeler ve Mody (1992)	Dışa Açıklık ile DYY Arasındaki İlişki söz konusu değişkenler arasında önemli bir ilişki olmadığı sonucuna varmışlardır.
(Chakrabarti,2001). Schneider ve Frey (1985) ve Hein (1992)	Dış Ticaret Açığı ile DYY Arasındaki İlişki: DYY'nin önemli belirleyicilerinden biri olan dış ticaret açığı ile ilgili olarak kabul edilen hipoteze göre, ticaret fazlası ihracat potansiyeli olan dinamik ve sağlam bir ekonominin göstergesidir ve bu nedenle DYY'yi etkilemektedir. ticaret fazlası ile DYY arasında güçlü bir pozitif ilişki tespit etmişlerdir. Bununla birlikte dış ticaret açığı veren ülkelerin açıklarını kapatabilmek için DYY çekme konusuna önem verdikleri,bu şekilde makro-ekonomik istikrar sağlayarak söz konusu dengesizliği ortadan kaldırmaya yönelik politikalar uyguladıkları görülmektedir
Tsai (1994) ve Shamsuddin (1994)	ticaret açığının DYY'ler üzerinde pozitif etkisi olduğunu ve bu ülkelerin yabancı yatırımcılara daha fazla esneklik sağladıklarını belirtmişlerdir.

Aktaran; YAPRAKLI Sevda(2006), Türkiye'de Doğrudan Yabancı Yatırımların Ekonomik Belirleyicileri Üzerine Ekonometrik Bir Analiz; D.E.Ü.İ.İ.B.F. Dergisi Cilt:21 Sayı:2, Yıl:2006, ss:23-48
 BANDERA-WHITE(1968) Empirical Determinants of Manufacturing Direct Foreign Investment in Developing Countries Franklin R. Root and Ahmed A. Ahmed Economic Development and Cultural Change Vol. 27, No. 4 (Jul., 1979), pp. 751-767 Published by: University of Chicago Press Stable URL: <http://www.jstor.org/stable/1153569> Page Count: 17
 SCAPERLANDA, A.E. ve L.S. MAUER (1969), "The Determinants of U.S.Foreign Direct Investment in the E.E.C.", American Economic Review, 59, 558-568.
 SCHMITZ, A. ve J. BIERI (1972), "EEC Tariffs and U.S. Direct Investment", European Economic Review, 3, 259-270.
 ROOT, F. ve A. AHMED, (1979), "Empirical Determinants of Manufacturing Direct Foreign Investment in Developing Countries", Economic Development and Cultural Change 27, 751-767.
 MCCULLOCH, R. (1993), "New Perspectives on Foreign Direct Investment",K. A. Froot (der.), Foreign Direct Investment içinde, University of Chicago Press, Chicago, 37-53.
 SHAMSUDDIN, A.F. (1994), "Economic Determinants of Foreign Direct Investment in Less Developed Countries", The Pakistan Development Review, 33, 41-51.
 BILLINGTON, N. (1999), "The Location of Foreign Direct Investment: An Empirical Analysis", Applied Economics, 31, 65-76.
 PISTORESI, B. (2000), "Foreign Direct Investment and Factor Localization:Latin America and South East Asia", Rivista di Politica Economica,90, 27-44.
 CHAKRABARTI, A. (2003), "A Theory of the Spatial Distribution of Foreign Direct Investment", International Review of Economics and Finance, 12 (2), 149-169.
 AKINKUGBE, O. (2005), "A Two Part Econometric Analysis of Foreign Direct Investment Flows to Africa", Journal of World Trade, 39 (5), 907-923.

3. Uygun Yatırım İklimlerinin Oluşması İçin Gerekli Faktörler

Herkes gibi sermayedarlar da sermayelerini daima kazançlı buldukları yerlerde yatırmaya önem vermektedir. Müteşebbisin kar veya en yüksek kar dışında bir amacının olabileceğini düşünmek ekonominin ilkeleriyle bağdaşmaz. Ancak bunun yanında yabancı müteşebbislerin üzerinde durduğu diğer bir husus, yabancı memlekette elde edilen karın kendi ülkesine transfer edilebilmesidir. Kendi memleketine karını transfer edemeyen müteşebbis için yabancı memlekette yaptığı yatırım önemini kaybeder. Esas amaç karlılık ve kar transferi olmakla birlikte yabancı sermayenin yatırımlarını yaparken dikkat ettiği başka hususlar da vardır. Bunları, ekonomik, siyasi, psikolojik, ahlaki ve moral değerler olarak sıralamak mümkündür. Esasen bu faktörler ana amaç olan karı ve kar transferini sağlayan ve yabancı sermayenin varlığının ve geleceğinin güvencesini belirleyen etkenler olarak değerlendirilmektedir. Bunları sırasıyla şöyle açıklamak mümkündür(Akdiş, M.)

Kurumsal iktisatçılardan North(1990)'un özellikle Afrika ülkelerini konu alan ampirik çalışmasında, bu ülkelerde iktisadi büyüme sorunlarının yalnızca geleneksel faktörlerden (işgücü, beşeri sermaye, sermaye birikimi) kaynaklanmadığını ortaya koymaktadır. Yeni büyüme teorileri ışığında yapılan sayısız ampirik ve teorik çalışmaların ortaya koyduğu sonuçlardan biri de başarılı bir büyüme ve gelişme stratejisi için ekonomilerin “fonksiyonel ve etkin kurumlar” ile desteklenmesi gerektiği gerçeğidir. Kategori ve Faktörler Listesi; Yerel pazarın genel makroekonomik durumu, Politik çevre ve kamu yönetimi, İşgücü,Enerji, Vergiler/Teşvikler, Ulaşım ve iletişim altyapısı, Araştırma ve geliştirme (Ar&Ge), Politik çevre ve kamu yönetimi,Politik istikrar,yasal çerçeve, Bürokratik prosedürler,Rüşvet ve yolsuzluk, Yabancı sermayenin desteklenmesiyle ilgili yasalar, İşgücü, İşgücü maliyeti, İşgücü verimliliği, Kalifiye işgücü, İşgücü yüzdesi, Enerji, Maliyet, Enerji tüketimi, Vergiler/Teşvikler, Ortalama kurumlar vergisi oranı, Toplanan kurumlar vergisi, Mal ve hizmet vergileri (toplam cari gelirin yüzdesi), ticaret vergileri (toplam cari gelirin yüzdesi), Diğer vergiler (toplam cari gelirin yüzdesi), Vergi teşvikleri, Ulaşım ve iletişim altyapısı, Karayolları (şebeke yoğunluğu), Demiryolları (şebeke yoğunluğu), Deniz ulaşımı, Hava yolu ulaşımı, Uluslararası sabit telefon maliyetleri, İnternet maliyeti, Yerel telefon maliyeti, Araştırma ve geliştirme (Ar&Ge), Ar&Ge harcamaları (GSMH %), Yatırım iklimi kavramı, bir müteşebbis için bir ülkede ya da bölgede yatırım yapmayı rasyonel ya da karlı kılan bütün unsurları içermektedir ve sadece yatırımlarla ilgili olmayıp, yatırımları da bir sonuç olarak içine alan daha geniş bir kavramdır. Makro yaklaşımda iktisadi büyümeyi, mikro yaklaşımda daha fazla mal ve hizmet üretmeyi doğuran ortam olarak ifade edilebilir. Yatırım iklimi kavramının hem yabancı yatırımcıları hem de yurtiçinde yerleşik yatırımcıları ilgilendiren boyutu vardır. Yatırım ikliminin iyileştirilmesi en başta ülke içinde ekonomik büyüme için mevcut olan kaynakların harekete geçirilmesi sonucunu doğurarak büyümeyi hızlandırmakta, ülke içinde sermaye birikimi teknoloji gibi yeterli düzeyde olmayan kaynakların DYY aracılığı ile ülke dışından gelmesi sağlanabilmektedir. Uluslararası mal ve sermaye hareketlerinin günümüzde ulaştığı boyut DYY'ları özellikle az gelişmiş ve gelişmekte olan ülkeler açısından giderek daha

da önemli hale getirmiştir. O bakımdan yabancı yatırımcılar açısından ülkenin yatırım ikliminin görünümü ekonomik büyüme açısından önem arz etmektedir. Yatırım yapmak başta yer seçimi olmak üzere bir tercihler bütünüdür ve hedef en karlı seçimi yapmaktır. Yerleşik yatırımcılar açısından da eğer iyi bir yatırım iklimi yoksa başka bir ülkeyi seçmek olasıdır. O bakımdan ülkedeki yatırımları yabancı yatırımcılar açısından karlı kılan şartlar yerleşik girişimciler açısından da geçerlidir. Sonuç olarak DYY'lere yönelik ülke değerlendirmeleri esasen o ülkenin genel olarak yatırım ikliminin görünümünü ortaya koymaktadır. Yatırım İklimine Dünya Bankası Yaklaşımı; Dünya Bankası yakın zamanda büyüme ve verimliliğin belirleyicilerinin daha açık anlaşılabilmesi için iki çalışma başlatmıştır. Bunlardan birincisi, 2001 yılında başlatılmış olan "Yatırım İklimi Araştırmaları"dır. Araştırma kapsamında firmaların, gözetim, düzenleme, vergileme, finans, altyapı ve işgücü konularında karşılaştıkları zorluklarla ya da sınırlandırmalarla ilgili değerlendirmeleri alınmaktadır. Araştırmada aynı zamanda firma performansıyla alakalı olabilecek objektif veriler de toplanarak, bu verilerin verimlilik, yatırım kararları ve istihdam kararlarına etkileri anlaşılmaya çalışılmaktadır. Dünya Bankasının ikinci araştırması; 130 ülkeyi kapsayan ve varsayımsal bir firma ve işlemler için faaliyette bulunma (iş yapma) maliyetlerini uzmanların (avukat, müşavir) görüşleri çerçevesinde hesaplanan iş yapma (doing business) projesidir. Bu maliyetin içerdiği bilgi, işe başlama için sicile kaydolma, sözleşmelerin icra gücü, işgücü düzenlemelerini kapsayan değişik düzenleme alanlarında uygulama maliyetlerini ve zamanı göstermektedir. Dünya Bankası Yatırım İklimi Raporunda yatırım iklimi kavramının merkezinde firmalar açısından karlılığın belirleyicisi olan maliyetler, riskler ve rekabet engelleri yer almaktadır. Bu üç faktöre etki eden tüm faktörler bir ülkenin yatırım iklimini tanımlamaktadır. İyi bir yatırım ikliminin özel sektör yatırımlarının miktar ve verimliliğinin artmasına, bunun da iktisadi büyümeye ve nihayetinde işsizlik ve yoksulluğun azaltılmasına hizmet etmesi beklenir. Yatırımların miktarı ve verimliliği iktisadi büyüme ve yoksulluğun azalmasına katkıda bulunmaktadır. Günümüzde yatırımların büyük bölümü özel sektör yatırımlarından oluşmaktadır. Yatırım iklimi, firmaların verimli yatırım yapmaları, istihdam yaratmaları ve genişlemeleri yönündeki güdülerini ve fırsatlarını şekillendiren yerleşim yerine özgü faktörler setidir. Firmaların yatırım kararlarındaki temel motivasyon kar arayışıdır. Karlılık ise maliyetler, riskler ve fırsatlarla alakalı rekabet engelleri tarafından belirlenir. Dünya Bankası yatırım iklimi ile ilgili olarak yatırım iklimi anketleri ve İş yapma veri tabanından yararlanarak bu doğrultuda aşağıda yer alan değişkenleri oluşturmaktadır. Politika belirsizliği, yolsuzluk, yargı, suçlar, vergi oranı, finans, elektrik, işgücü vasfı (Bal, H.(2000), Algan,1988, YASED,1988).

Dünya Bankası Yatırım İklimi Raporunda özel yatırımların miktar ve verimliliğini etkileyen yatırım iklimi yukarıda yer almaktadır. Buna göre özel yatırımların miktar ve verimliliğini belirleyen maliyetler, riskler ve rekabet engelleri ve bu faktörleri etkileyen bir tarafta hükümet davranışları ve politikaları, diğer tarafta coğrafya, piyasa büyüklüğü ve tüketici tercihleri gibi diğer faktörler yatırım iklimi kavramının unsurlarını oluşturmaktadır. Yatırım ikliminin piyasa büyüklüğü ve coğrafya gibi bazı unsurlarını

hükümetlerin değiştirme şansları yoktur ancak diğer unsurlar üzerinde önemli etkiler yaratarak yatırım iklimini iyileştirmeye önemli katkılar sağlayabilmektedirler.

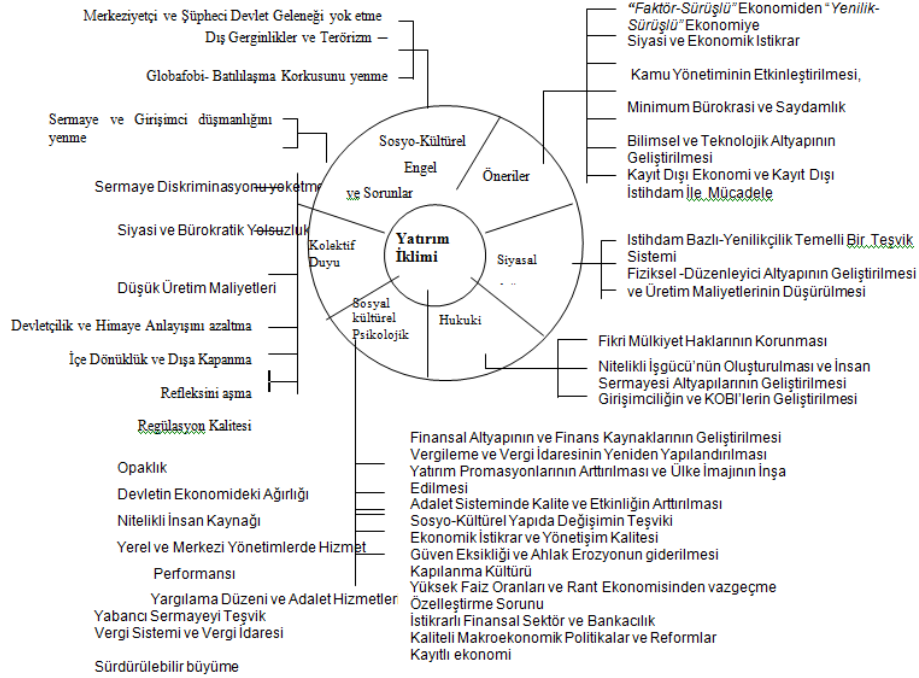
Tablo. 3. Küreselleşen Dünyada Ülkelerin Yatırım Cazibesini Belirleyen Unsurlar

Karşılaştırmalı ve Rekabetçi Avantajlar	<p><i>Faktör Koşulları:</i> Bir ulusun yatırım çekiciliği, giderek daha iyi doğal kaynaklar, yer, nitelikli-niteliksiz işgücü ve temel altyapı ile ilgilidir</p> <p><i>Talep Koşulları:</i> Bir ülkenin yatırım çekiciliği, ev sahibi ülkenin endüstrinin üretim hizmetleri için giderek daha sofistike olmasıdır.</p> <p><i>İlişkili ve Destekleyen Endüstriler:</i> Bir ulusun yatırım çekiciliği, uluslararası rekabetçilikle ilişkili olması ve bunu desteklemede giderek daha çok yer almasıdır.</p> <p><i>Şirket Stratejisi, Yapı ve Rekabet:</i> Bir ülkenin yatırım çekiciliği, içerdeki rekabetin giderek daha da şiddetlenmesidir.</p>
İçeride Ekonomik ve Politik Denge	<p>Dengesiz ve sendeleyeyen ekonomiler, ticari şirketleri söz konusu ülkelerde yatırım yapma konusunda şüpheli davranmaya itmektedir. 1960'tan bu yana 511 ayrı faaliyet alanındaki 1.500'ün üzerindeki şirket 76 ülke tarafından kamulaştırılmıştır. Kamulaştırmanın küçük ölçeklileri dahi, grevler, nakit paranın değerinin düşmesi, nakit paranın bloke edilmesi ve benzeri uygulamalar nedeniyle şirketin yatırım değerini kaybetmesine neden olmaktadır. Ekonomik ve politik denge, Doğu Asya'nın doğrudan yabancı yatırımlar için çekici olmasının anahtarı kabul edilebilir. Analistler, ülkenin taşıdığı riskler arasında iki tipi birbirinden ayırmaktadırlar. Bunlardan ilki, hükümetin ya da insanların doğrudan aldığı tavır nedeniyle ortaya çıkan; yatırımın mahvolması, kamulaştırma ve yatırım kaynaklarıyla transferin sınırlandırılmasıyla sonuçlanan <i>kıymetli malların korunması / yatırımın geri alınması riski</i>' dir. İkincisi ise, ekonominin aşağı doğru dönmesi, nakit paranın kıymetinin düşmesi, grevler vb. sonucu ortaya çıkan <i>kullanılmaya hazır kazanç / nakit akışı riski</i>'dir. Bazı analistler, politik riskin, eski risk ve ekonomik riskin ikinci ve son risk olduğunu, fakat her ikisinin de sık sık birbirine karıştığını düşünmektedirler.</p>
Mülkiyet Haklarının Korunması	<p>Yasal ve kurumsal çerçeve içinde yönetilen doğrudan yabancı yatırım, açık, önceden tahmin edilebilir ve dengeli olmalıdır. Karlı para havalesi ve ithal girdilerin tedarik edilmesi için yabancı mübadeleye serbest giriş gerçekleştirilmeye çalışılmalıdır. Muhtemel yabancı yatırımcılar, yerli sahiplik ya da sınırsız milliyetçilik baskısından sık sık ürkmektedirler.</p>

Doğrudan Yabancı Sermaye Yatırım İkliminin Oluşturulmasını Belirleyen Faktörler

Yabancı Ticaret Sahaları	Çok uluslu şirketlere işlerini idare etmeleri, ithalat, üretim ve YTS içinde tüm işe sahip olmaları için izin verilir. Çokuluslular, ithal ettiği malları ev sahibi ülkede satamadığı sürece yerel pazarda etkili olamaz. Ev sahibi ülke, iş yaratmak, işgücünün niteliklerini geliştirmek, teknoloji transferi ve vatandaşlarının gelirlerinin yükselmesi gibi kazançları elde eder.
---------------------------------	---

Kovancılar, Birol(2005), “Türkiye’de Yatırım İkliminin Geliştirilmesi ve İstihdam” konulu Maliye Hesap Uzmanları Vakfı Ekonomik ve Mali Araştırma Yarışması, MHUV Yayını, Ankara



Şekil 1. Yatırım İklimini Belirleyen Faktörler

Kaynak: Çiftçi Hakkı, Kovancılar Birol vd.(2005), Maliye Hesap Uzmanları Vakfı Bilimsel Araştırma Yarışması derece alan eserlerinin Özetinden tarafımca derlenmiştir.

Bu uygun yatırım iklimlerinin oluşmasının yanısıra bir de; doğrudan yabancı yatırımların(DYY) Girişlerini ve kararlarını Etkileyen Önemli Etkenler olarak; ülkenin sağladığı teşvikler, vergi politikası ve vergi oranları, dış ticaret politikaları, yatırım ortamının/iş ortamının iyileştirilmesine yönelik girişimlerin uygulanabilirliği, girişimcilik, ticaret ve yatırımların önündeki engellerin kaldırılması, devlet kontrolünün ağırlığının azaltılması, piyasalarda rekabetçi bir yapı ve işleyişin

sağlanması, yargı sisteminin etkinleştirilmesi, mevzuat uygulamalarının yeknesak ve öngörülebilir olması, mal, işgücü ve finans piyasalarında idari engellerin azaltılması, politik ve ekonomik istikrar, iç pazarın büyüklüğü, maliyet, kâr ve finansman koşulları, kurumsal yapının özellikleri, ev sahibi ülkenin kısa ve uzun dönemli politik ve ekonomik rolü, ucuz ve kalifiye işgücü, hammadde kaynakları, gelişmiş pazarlara yakınlığı ve ulaştırma-haberleşme imkanları (DEĞER, M. K., S. EMSEN ve C. GERNİ(2006); ÖZCAN Burcu, ARI Ayşe(2010)

Tablo.4. DYY girişlerini belirleyen faktörler

Maliyetle ilgili faktörler	Ev sahibi ülke ile sermayenin geldiği ülke arasında önemli maliyet farklılıklarının olması, yatırım mekânının seçimini önemli bir şekilde etkilemektedir.
Yatırım çevresini zenginleştirici faktörler	DYY liberalleşme paketi, vergiler-sübvansiyonlar, para biriminin konvertibilitesi ve fiyat kontrollerinden ibarettir.
Makro ekonomik faktörler ve ülkenin kalkınma stratejisi	Burada yabancı firmanın lisanslama, ihracat ya da farklı bir yolla ev sahibi ülkeye hizmet etmek yerine, doğrudan yatırım yapmasını sağlayan faktörler kast edilmektedir. Mevcut ve potansiyel pazar hacmi faktörü burada dikkat çekmektedir
Arz yönlü ve talep yönlü belirleyiciler	Arz yönlü faktörler niteliksel oldukları kadar niceliksel özelliklere de sahip olabilmekte, işgücü maliyetleri ve kurum vergileri niceliksel özelliğe sahipken, işgücünün kalitesi ve yasal düzenleyici çerçevelerin varlığı ve yoğunluğu ise niteliksel özelliğe sahiptir. Talep yönlü faktörler ise, pazarın hacmi, yatırım yapılacak mekânın coğrafi ve kültürel özellikleri gelmektedir. Nispi kâr oranları, yerel piyasa hacmi ve büyüklüğü, ticaret dengesi, döviz kuru politikaları, politik düzen, DYY'nin geçmiş dönem seviyeleri, yatırım iklimi, yabancı yatırımcılara sunulan düzen-lemeler ve teşviklerde talep yönlü faktörlerdir.
Geleneksel ve geleneksel olmayan	Geleneksel faktörler ;Ev sahibi ülkenin nüfusu, Kişi başı gelir,GSYİH büyüme oranı,Yönetimsel darboğazlar,Pazara giriş kısıtlamaları ve risk faktörleri, Geleneksel olmayan faktörler ;Globalleşme ile ön plana çıkan faktörlerden oluşmaktadır.Tamamlayıcı üretim faktörleri (örn, ev sahibi gelişmekte olan ülkedeki üretim için İhtiyaç duyulan yerel girdiler), Ortalama eğitim süresi (nitelikli emeğin yetişmesi için gerekli süre), Vergiler-istihdam koşulları-emek piyasasındaki düzenle-meler ile ilgili maliyet faktörleridir.

İtici ve çekici faktörler	Ev sahibi ülkeden kaynaklananlar çekici faktörler (pull effects) ve sermayenin geldiği ülkeden kaynaklanan itici faktörler (push effects) şeklinde deki sınıflandırmada ise; Genellikle dış dünyadaki ekonomik gelişmeler sonucu sermayenin dışarıya yönelmesine etki eden unsurları kapsar. Çekici faktörler; DYY'ın yöneldiği ekonominin iç dinamiklerinden kaynaklanır: Bölgesel ticaret anlaşmaları Gelişmiş ülke piyasalarındaki kârlılığın azalması. Sermaye hareketleri üzerindeki kontrollerin kaldırılması ve finansal serbestleşme, Ulaşım ve haberleşme teknolojilerindeki gelişmeler, Gelişmekte olan ülkelerin keşfedilmemiş birer Pazar oluşları, Hammadde ve işgücü maliyetinin ucuz olması vergi oranları, döviz kuru politikaları, Mali teşvikler, Özelleştirme uygulamaları, Makro ekonomik istikrar, Bürokrasinin kalitesi ve politik istikrar
---------------------------	--

KAR, Muhsin ve Tatlısöz, Fatma (2008), "Türkiye'de Doğrudan Yabancı Sermaye Hareketlerini Belirleyen Faktörlerin Ekonometrik Analizi", KMU İİBF Dergisi, Yıl.10, sayı 14.
TUSELMANN, H.J. (1999), "German direct foreign investment in Eastern and Central Europe: relocation of German industry?", European Business Review, Vol. 99 No. 6.

Bütün bunlarla beraber, uygun yabancı sermaye yatırım ikliminin uluslar arası yatırımcılara fikir veren bir takım endekslerde hem etkin olmak da hem de mevcut durumun daha iyi görülebilmesi açısından çeşitli kurumlarının geliştirdiği uluslararası alanda kabul gören endekslerden hareket edilmesi gerekmektedir. Bu endeksler; Dünya rekabetçilik Endeksi, Ekonomik Özgürlük Endeksi, Global Rekabet (Küreselleşme) Endeksi, İş Yapma Ortamı (Doing Business), Yabancı Sermaye Yatırım Potansiyel Endeksi, Yolsuzluk Algılama Endeksi, Opaklık Endeksi dir. Bu endekslerin ölçülmesinde baz alınan kriterlerde doğrudan yabancı sermaye yatırım iklimlerinin anlamlandırılması, açıklanması ve yorumlanması açısından büyük önem arz etmekte ve buna göre mesajlar karşı tarafa ulaşmaktadır.

Özellikle de; UNCTAD Yabancı Sermaye Yatırımları Potansiyel Endeksi ve Alt Bileşenleri bu endeksler içerisinde öne çıkmaktadır. UNCTAD doğrudan yabancı sermaye yatırım girişleri ile ilgili ülke potansiyelini ölçmek için "Doğrudan Yabancı Sermaye Yatırımı Potansiyel Endeksini (FDI-POT-I) geliştirmiştir. Bu endekste, 12 adet ekonomik ve yapısal değişken yer almakta, her bir değişkene 0 ile 1 arasında değer verilerek, ortalama endeks değeri hesaplanmaktadır. FDI Potansiyel endeksinde yer alan değişkenler şunlardır; Ortalama GSYH Büyüme Hızı, Kisi Basına GSYH (Dolar), Toplam ihracatın GSYH içindeki Payı, Telekomünikasyon Altyapısı (1000 kişiye düşen telefon hattı ve cep telefonu), Kisi Basına Ticari Enerji Tüketimi, AR-GE Harcamalarının GSYH'ya Oranı, Yüksek Öğretimdeki Öğrenci Sayısının Toplam Nüfus içindeki Payı, Ülke Riski, Doğal Kaynak ihracatının Dünya Toplamı içindeki Payı, Elektronik ve Tasıt Araçları Aksam ve Parça ihracatının Dünya Toplamı içindeki Payı,

Hizmet hracatının Dünya Toplamı içindeki Payı, Doğrudan Yabancı Sermaye Yatırım Stokunun Dünya Toplamı içindeki Payı dikkate alınmaktadır.

SONUÇ VE DEĞERLENDİRME

Doğrudan Yabancı Yatırımları(DYY) çekme konusunda son yıllarda gelişmekte olan ülkeler arasında yoğun bir rekabet oluşmuştur. Bu yarışta daha rekabetçi olmak amacıyla ülkeler politik ve ekonomik politikalarını yeniden yapılandırmaya ve yatırım teşvik kurumları yoluyla teşvik rejimleri uygulamaya başlamıştır. Alternatif ülkelere göre daha iyi bir yatırım iklimine sahip bir ülke, yabancı yatırımcılar açısından tercih edilen bir yatırım yeri olacağı gibi, yerli yatırımların da diğer ülkelere kayması söz konusu olmayacaktır. Küreselleşmenin getirdiği avantajlardan daha fazla yararlanabilmek için, yabancı doğrudan yatırımları teşvik eden, daha fazla yabancı doğrudan yatırım çekme özellikleri olan bir yatırım ikliminin geliştirilmesi gerekir. Yabancı yatırımcılar yatırım yapacakları ülke-yi seçerken yatırım iklimi ölçütlerini değerlendirerek kararlarını vermektedirler. Bu nedenle iyi bir yatırım ikliminin iktisadi büyümeyi hızlandırma potansiyellerinden birisi ve belki de en önemlisi DYY'lar üzerindeki pozitif etkisidir. Literatürde yatırım ikliminin belirleyicileri ile DYY'ların belirleyicileri hemen hemen aynı ölçütleri kapsamaktadır. Yatırım iklimi değerlendirmeleri de daha ziyade ülkeye yatırım yapma potansiyeli olan yabancı yatırımcılara yönelik olarak hazırlanmaktadır. Ancak, yatırım iklimi yalnızca yabancı yatırım çekme amacına yönelik değil, aynı zamanda en küçük girişimciden en geniş firmalara kadar tüm yatırımcıları, mal ve hizmet üretme döngüsünü harekete geçirmeye güdüleyecek bir iklimi ifade etmek amacıyla kullanılmalıdır.

Yatırım İklimini Açıklayan Çalışmalardaki; ölçütlere ve doğrudan yabancı sermaye yatırımları için oluşturulması gereken uygun iklimlere yönelik incelemede; ekonomik, sosyal ve teknolojik alt yapıların bütün detaylarıyla beraber etkili olduğu görülmektedir. Özetle yapılan çalışmaların neticesinde rastladığımız temel göstergeler olarak; yatırım iklimi, altyapıdan kurumsal yapıya, güvenlikten adalet sistemine, işgücüne, veri kaynaklarına kadar pek çok alanı ilgilendiren ve çerçevesi kesin ve net bir şekilde belirlenemeyen bir kavram olduğundan, bir ülke hakkındaki değerlendir-meler farklı ölçütler dikkate alınarak yapılmaktadır. Sonuçta yatırımların karlılığıyla dolaylı veya dolaysız alakalı olabilecek hususlar dikkate alındığından farklı çalışmalarda kullanılan ölçütler benzerlikler taşımaktadır; ticaret politikası, vergilendirme, ekonomideki kamu yatırımları, para politikası, sermaye akımları ve yabancı yatırımlar, bankacılık, ücret ve fiyat kontrolleri, mülkiyet hakları, düzenlemeler ve kanunlar, karaborsa'yı saymaktadır. Bununla birlikte; çeşitli araştırma kuruluşları tarafından gelişmekte olan ülkelerin yatırım iklimi değerlendirme raporlarında genellikle yer verilen konular aşağıda belirtilmektedir. Konu başlıklarının her biri yatırım iklimi değerlendirme ölçütü olarak dikkate alınabilmektedir. kârlılık, piyasa değişkenleri, yerel pazar büyüklüğü, ticari etkiler, politik istikrar: yolsuzluk, bölgesel ekonomik bütünleşme, döviz kuru etkileri, vergiler, kurumlar, özelleştirme, fiziksel, finansal ve teknolojik altyapı, ekonomik

istikrar, pazar gibi faktörler doğrudan yabancı sermaye yatırımlarının iklim çeşidini belirlemektedir. Bu faktörlerin önem sıralaması DYY'nin geliş amacına göre farklılık gösterir. Kaynak arayışı söz konusu ise, ev sahibi ülkenin faktörleri, sermayenin geldiği ülkenin faktörlerine kıyasla daha önemli hale gelmekte, Stratejik bir yatırım söz konusu ise, sermayenin geldiği ülkenin sahiplik avantajlarının yetersiz olması en önemli faktör haline gelmekte, Pazarı ele geçirmek amaç ise, nispi maliyet avantajları ve pazar büyüklüğü önemli hale gelmektedir. DYY girişlerini etkileyen belli başlı faktörlerden karlılık, piyasa değişkenleri, ticari etkiler, politik istikrar, bölgesel ekonomik bütünleşme, döviz kuru etkisi, vergi, kurumlar, yolsuzluk, özelleştirme ayrı ayrı incelendiğinde; uluslararası entegrasyon, sahiplik,giriş ve çıkışlar, firma faaliyetlerinde düzenleyici ve idari engeller,fiziksel ve teknolojik altyapı varlığı ve kalitesi,finansman kaynaklarına erişim, yetenek ölçütü, firmaların üst düzey yöneticilerinin çalışanlarının yeteneklerini yatırımlarının önünde engel teşkil edip etmediğine ilişkin değerlendirmelerini yansıtmaktadır.

1990'lı yılların ikinci yarısından itibaren Doğrudan Yabancı yatırımların(DYY) ivme kazanmasının nedenleri ülke ve firmalar açısından farklılık göstermektedir. Ülke açısından; liberal piyasa mekanizması, ekonomik küreselleşme,refah sağlayıcı varlıkların artan hareketliliği, kalkınmada kalkış (take-off) aşamasına gelen ülke sayısının artması, gelişmiş ve bazı yeni sanayileşmekte olan ülkelerin ekonomik yapılarının yakınlaşması, DYY'nin fayda ve maliyetlerinin hükümetler tarafından daha iyi değerlendirilmesi olarak sınıflandırılabilir.Firma açısından ise,global piyasalara erişim ihtiyacının artması,mevcut en ucuz kaynaklardan girdi temin etmek için oluşan rekabetçi baskılar,bölgesel bütünleşmenin daha fazla etkinlik arayışında olan yatırımları hızlandırması,ulaşım maliyetlerinin düşmesi ve sınır ötesi iletişim kolaylığının artması,lider firmalar arasında oligopolistik rekabetin yükselmesi, DYY için yeni mekânsal olanakların ortaya çıkması,globalleşme ve lokalleşmenin avantajlarını daha iyi anlaşılmiş olması önem arz etmektedir. İktisat literatüründe DYY'nin belirleyicilerini açıklamak üzere yapılan çalışmaların büyük çoğunluğu ekonomik faktörlerin etkinliği üzerinde yoğunlaşmıştır. Birçok ekonomik değişken ele alınmış olmakla birlikte piyasa hacmi (GSYİH), büyüme oranı, işgücü maliyetleri, döviz kuru, dışa açıklık, dış ticaret dengesi literatürde yaygın olarak kullanılan değişkenler olmuşlardır.

Diğer yandan, doğrudan yabancı yatırımların cezbedilmesine yönelik anahtar konumdaki ulusal politikalar; Ülkeler büyüme ve kalkınmalarını ilerletmek için DYY kollarlar. DYY'ların giderek büyüyen fayda artışı bir çok faktöre de yansır. Örneğin, ödünler karşılığı olarak alınan yardımlar düşürülebilir, bu yolla sağlanan uzun vadeli ve düzenli sermaye girişleri finansal kriz riskini azaltabilir. İstihdam faydasının yanı sıra, günümüzde giderek önemi artan yenilikçi teknolojiler DYY'ların sunduğu imkanlardan bir diğeridir. Uyguladıkları başarılı politikalar yardımıyla birçok ülke-G.Kore, Polonya gibi- önemli yatırım miktarına ulaşmışlardır. Yabancı yatırımları cezbedici ve onlardan sağlanan faydayı artırıcı yol, "açık- kapı" politikası olarak nitelendirilen pasif bir liberalizasyon uygulamasına, yüksek düzeyde rekabetçi bir

piyasaya, çok daha güçlü lokasyon avantajlarına ve promosyon çabalarına odaklanılmasına ihtiyaç vardır. Teknolojik açıdan ileri düzeyde olan ya da ihracat yönelimli faaliyetlere yönelen yabancı yatırımların ülkeye çekilebilmesi daha fazla önem kazanmaktadır. Başarılı ülke deneyimlerinde yabancı yatırımlar için itici güç oluşturan ve yabancı yatırımlarla arasında bir etkileşim ilişkisinin mevcut olduğu ulusal politikaların bileşenlerini şu şekilde sıralanabilir: Ülke içi kümeleşmelerin teşvik edilmesi, endüstri ve bilim parklarının oluşturulması, kaliteli insan kaynağı ve girişim ruhu yaratılması, yüksek beceri düzeyine sahip yabancı uzmanların ülkeye gelişinin olabildiğince özendirilmesi, oldukça gelişmiş bilgi ağları oluşturulması ve bilgi ve iletişim altyapılarının olabildiğince geliştirilmesi, üniversiteler ile iş dünyası arasında çok sıkı ilişkilerin kurulması, eğitim sisteminin kalitesinin artırılması, mümkün olduğunca cazip yatırım teşvikleri sunulması, Ulusal Promosyon Ajansları kurarak proaktif (ileriye yönelik, önleyici tedbirler alınan) bir şekilde hedefli yatırım promosyonuna yönelmesidir. Bunların mevcudiyeti ve desteklenmesi gerçekten yabancı yatırım politikalarının başarısı açısından kritik gözükmektedir.

KAYNAKÇA

- AKDİŞ, M. Dünyada Ve Türkiye’de Yabancı Sermaye Yatırımları ve Beklentiler, <http://makdis.pau.edu.tr/Ysermaye.htm>,2015
- AKINKUGBE, O. (2005), “A Two Part Econometric Analysis of Foreign Direct Investment Flows to Africa”, *Journal of World Trade*, 39 (5), 907-923.
- ALGAN, Neşe(1988); “Dünyada ve Türkiye’de Yabancı Sermaye Yatırımları ve Beklentiler”, YASED Yayın No: 33, İstanbul 1988.
- BAL H.(2000), “Yabancı Sermaye Yatırımlarına Yönelik Uluslararası Kuruluşların Faaliyetleri ve Türkiye Ekonomisinde Yabancı Sermaye Yatırımları”, Çukurova Üniversitesi Sosyal Bilimler Enstitüsü Dergisi Adana
- BANDERA-WHITE(1968) Empirical Determinants of Manufacturing Direct Foreign Investment in Developing Countries Franklin R. Root and Ahmed A. Ahmed *Economic Development and Cultural Change* Vol. 27, No. 4 (Jul., 1979), pp. 751-767 Published by: University of Chicago Press Stable URL: <http://www.jstor.org/stable/1153569> Page Count: 17
- BEVAN, Alan A. ve Saul Estrin (2000), “The Determinants of Foreign Direct Investment in Transition Economies”, William Davidson Institute Working Paper, No.342, October 2000.
- BILLINGTON, N. (1999), “The Location of Foreign Direct Investment: An Empirical Analysis”, *Applied Economics*, 31, 65-76.

- BULUT, Mustafa(2009); Yatırım İkliminin Geliştirilmesinde Vergi Politikalarının Rolü: Türkiye Örneği T.C. Maliye Bakanlığı Strateji Geliştirme Başkanlığı Strateji Geliştirme Başkanlığı Yayın No:2009/388 Ankara
- CHAKRABARTI, A. (2003), “A Theory of the Spatial Distribution of Foreign Direct Investment”, *International Review of Economics and Finance*, 12 (2), 149-169.
- COSKUN Recai, (2001) "Determinants of direct foreign investment in Turkey", *European Business Review*, Vol. 13 Iss: 4, pp.221 – 227 <http://www.emeraldinsight.com/doi/abs/10.1108/EUM0000000005536> ISSN: 0955-534X Online from: 1989
- DEĞER, M. K., S. EMSEN ve C. GERNİ, “Doğrudan Yabancı Yatırımların Belirleyicileri: Geçiş Ekonomileri Üzerinde Nedensellik Testleri ve Panel Veri Analizleri (1990 - 2002)”, *Uluslararası Ekonomi Konferansı*, 11 – 13 Eylül, TEK, Ankara, 2006, s. 2.
- DEMİREL Onur(2006), Doğrudan Yabancı Yatırımlar, Ekonomik Büyümeye Etkileri ve Türkiye Uygulaması T.C. Süleyman Demirel Üniversitesi Sosyal Bilimler Enstitüsü İktisat Anabilim Dalı Yüksek Lisans Tezi, Isparta, 2006
- DUNNING, J.H. (1981), “Explaining the International Direct Investment Position of Countries: Towards a Dynamic or Developmental Approach”, *Weltwirtschaftliches Archiv*, 117, pp. 30–64.
- Dunning, J.H. (1994), “Re-evaluating the benefits offoreign direct investment”, *Transnational Corporations*, Vol. 3, No. 1, pp. 23–51.
- HYMER, S. H. (1960), *The International Operations of National Firms: A Study of Foreign Direct Investment*, M.I.T. Doctoral Dissertation, Cambridge, Massachusetts.
- KARLUK, R. (2001), Türkiye’de Yabancı Sermaye Yatırımlarının Ekonomik Büyümeye Katkısı: Ekonomik İstikrar, Büyüme ve Yabancı Sermaye, TCMB Yayınları, 97-115
- KAR, Muhsin ve Tatlısöz, Fatma (2008), “Türkiye’de Doğrudan Yabancı Sermaye Hareketlerini Belirleyen Faktörlerin Ekonometrik Analizi”, *KMU İİBF Dergisi*, Yıl.10, sayı 14.
- KAZGAN, G (1988), *Ekonomide Dışa Açık Büyüme*, 2. Basım, Altın Kitaplar, İstanbul.

- KİNDLEBERGER, C. P. (1971), *American Business Abroad: Six Lectures on Direct Investment*, Third Edition, Yale University Press.
- KOYUNCU Fatma TURAN(2010), Türkiye’de Seçilmiş Makroekonomik değişkenlerin Doğrudan Yabancı Sermaye Yatırımları Üzerindeki Etkisinin Yapısal Var Analizi: 1990-2009 Dönemi Anadolu Üniversitesi Ekonomi Bilimleri Dergisi Cilt 2, Sayı 1, 2010 Issn: 1309-8020 (Online)55
- KRUGER, A. O. (1987), “Debt, Capital Flows, and LDC Growth”, *The American Economic Review*, Vol. 77, pp: 160-163.
- KULA Ferit(2003), Uluslararası Sermaye Hareketlerinin Etkinliği: Türkiye Üzerine Gözlemler, C.Ü. İktisadi ve İdari Bilimler Dergisi, Cilt 4, Sayı 2, 2003 141, Erciyes Üniversitesi, İİBF, İktisat Bölümü
- LUCAS, R. E. Jr (1988), “On the Mechanics of Economic Development”, *Journal of Monetary Economics*, Vol. 22, pp:3
- HEINZ WEIHRICH(1982), The TOWS matrix—A tool for situational analysis Volume 15, Issue 2, April 1982, Pages 54-66
- MCCULLOCH, R. (1993), “New Perspectives on Foreign Direct Investment”, K. A. Froot (der.), *Foreign Direct Investment içinde*, University of Chicago Press, Chicago, 37-53.
- MORISSET, J., PIRNIA, N., ALLEN, N. J. and WELLS, L.T. “Using Tax Incentives to Compete for Foreign Investment”, *Foreign Investment Advisory Service*, Occasional Paper 15, 1997.
- MORISSET, J., PIRNIA, N., ALLEN, N. J. and WELLS, L. T. “How Tax Policy and Incentives Affect Foreign Direct Investment”, *Foreign Investment Advisory Service*, Occasional Paper 15, 1999.
- MORISSET, Jacques. “Using Tax Incentives to Attract Foreign Direct Investment”, *The World Bank Group Private Sector and Infrastructure Network*, Note Number 253, 1990.
- North, D.C. 1990. *Institutions, institutional change, and economic performance*. Cambridge:Cambridge University Press.
- ÖZCAN Burcu, ARI Ayşe(2010), Doğrudan Yabancı Yatırımların Belirleyicileri Üzerine Bir Analiz: OECD Örneği, *Ekonometri ve İstatistik Dergisi* Sayı:12 2010 65–88 <http://eidergisi.istanbul.edu.tr/sayi12/ueis12m4.pdf>;Erişim tarihi,08/11/2015

- PISTORESI, B. (2000), "Foreign Direct Investment and Factor Localization:Latin America and South East Asia", *Rivista di Politica Economica*,90, 27-44.
- ROOT, F. ve A. AHMED, (1979), "Empirical Determinants of Manufacturing Direct Foreign Investment in Developing Countries", *Economic Development and Cultural Change* 27, 751-767.
- SCAPERLANDA, A.E. ve L.S. MAUER (1969), "The Determinants of U.S.Foreign Direct Investment in the E.E.C.", *American Economic Review*, 59, 558-568.
- SCHMITZ, A. ve J. BIERI (1972), "EEC Tariffs and U.S. Direct Investment", *European Economic Review*, 3, 259-270.
- SHAMSUDDIN, A.F. (1994), "Economic Determinants of Foreign Direct Investment in Less Developed Countries", *The Pakistan Development Review*, 33, 41-51.
- TUSELMANN, H.J. (1999), "German direct foreign investment in Eastern and Central Europe:relocation of German industry?", *European Business Review*, Vol. 99 No. 6.
- WORLD BANK (1997), *Private Capital Flows to Developing Countries – The Road to Financial Integration*, World Bank Policy Research Report. Washington, D.C, The World Bank.
- YAPRAKLI Sevda(2006), Türkiye’de Doğrudan Yabancı Yatırımların Ekonomik Belirleyicileri Üzerine Ekonometrik Bir Analiz; *D.E.Ü.İ.İ.B.F. Dergisi* Cilt:21 Sayı:2, Yıl:2006, ss:23-48